

信诚四季红混合型证券投资基金 2017 年半年度报告

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：信诚基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2017 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	2
§ 2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	8
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	8
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	8
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	9
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	9
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	10
§ 5 托管人报告	10
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	10
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	10
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	10
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)	10
6.1 资产负债表	10
6.2 利润表	11

6.3 所有者权益（基金净值）变动表	13
6.4 报表附注	14
§ 7 投资组合报告	29
7.1 期末基金资产组合情况	29
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	29
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	30
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	31
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	33
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	33
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	33
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	33
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	33
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	34
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	34
7.12 投资组合报告附注	34
§ 8 基金份额持有人信息	35
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	35
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	35
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	35
§ 9 开放式基金份额变动	36
§ 10 重大事件揭示	36
10.1 基金份额持有人大会决议	36
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	36
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	36
10.4 基金投资策略的改变	36
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	36
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	36
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	36
10.8 其他重大事件	37
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	39
§ 12 备查文件目录	40
12.1 备查文件名称	40
12.2 备查文件存放地点	40
12.3 备查文件查阅方式	40

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	信诚四季红混合型证券投资基金	
基金简称	信诚四季红混合	
基金主代码	550001	
交易代码	550001	551001
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2006 年 4 月 29 日	
基金管理人	信诚基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,448,863,330.03 份	
基金合同存续期	不定期	

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效配置资产的基础上, 精选投资标的, 追求在稳定分红的基础上, 实现基金资产的长期稳定增长。
投资策略	本基金在充分借鉴英国保诚集团的资产配置理念和方法的基础上, 建立了适合国内市场的资产配置体系。本基金的资产配置主要分为战略性资产配置(SAA)和战术性资产配置(TAA)。战略性资产配置(SAA)即决定投资组合中股票、债券和现金各自的长期均衡比重, 按照本基金的风险偏好以及对资本市场各大类资产在长期均衡状态下的期望回报率假定而作出。战术性资产配置(TAA)是本基金资产配置的核心, 是指依据特定市场情况对在一定时段持有某类资产的预期回报作出预测, 并围绕基金资产的战略性资产配置基准, 进行相应的短中期资产配置的过程。
业绩比较基准	$62.5\% \times \text{新华富时全 A 指数收益率} + 32.5\% \times \text{中证国债指数收益率} + 5\% \times \text{金融同业存款利率}$
风险收益特征	作为一只混合型基金, 本基金的资产配置中线(股票 62.5%, 债券 32.5%)确立了本基金在平衡型基金中的中等风险定位, 因此本基金在证券投资基金中属于中等风险。同时, 通过严谨的研究和稳健的操作, 本基金力争在严格控制风险的前提下谋求基金资产的中长期稳定增值。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		信诚基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周浩	林葛
	联系电话	021-68649788	010-66060069
	电子邮箱	hao.zhou@xcfunds.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-666-0066	95599
传真		021-50120888	010-68121816

注册地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 9 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 9 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	200120	100031
法定代表人	张翔燕	周慕冰

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报、中国证券报、证券日报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.xcfunds.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	信诚基金管理有限公司	中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 9 层

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东长安街 1 号东方广场东二办公楼八层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-36,252,270.02
本期利润	91,726,466.17
加权平均基金份额本期利润	0.0622
本期加权平均净值利润率	5.96%
本期基金份额净值增长率	5.63%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	128,462,851.74
期末可供分配基金份额利润	0.0887
期末基金资产净值	1,577,326,181.77
期末基金份额净值	1.0887
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	296.05%

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低

于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

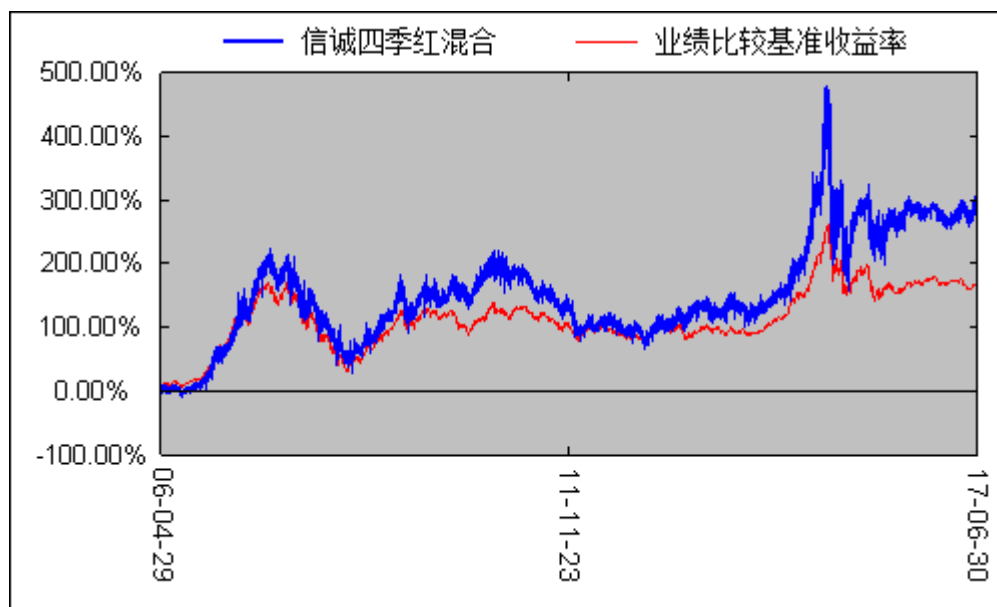
3、期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	6.25%	0.84%	2.94%	0.40%	3.31%	0.44%
过去三个月	4.87%	0.90%	-0.89%	0.46%	5.76%	0.44%
过去六个月	5.63%	0.75%	0.17%	0.42%	5.46%	0.33%
过去一年	4.32%	0.74%	2.77%	0.46%	1.55%	0.28%
过去三年	71.27%	1.94%	39.59%	1.13%	31.68%	0.81%
自基金合同生效起至今	296.05%	1.60%	169.14%	1.17%	126.91%	0.43%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1、本基金建仓期自 2006 年 4 月 29 日至 2006 年 10 月 28 日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

2、自 2015 年 10 月 1 日起,本基金的业绩比较基准由“富时中国全 A 指数收益率*62.5%+中信国债指数收益率*32.5%+金融同业存款利率*5%”变更为“富时中国全 A 指数收益率*62.5%+中证国债指数收益率*32.5%+金融同业存款利率*5%”。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人信诚基金管理有限公司经中国证监会批准,于 2005 年 9 月 30 日正式成立,注册资本 2 亿元,注册地为上海。公司股东为中信信托有限责任公司、英国保诚集团股份有限公司和中新苏州工业园区创业投资有限公司,各股东出资比例分别为 49%、49%、2%。截至 2017 年 6 月 30 日,本基金管理人共管理 70 只基金,分别为信诚四季红混合型证券投资基金、信诚精萃成长混合型证券投资基金、信诚盛世蓝筹混合型证券投资基金、信诚三得益债券型证券投资基金、信诚经典优债债券型证券投资基金、信诚优胜精选混合型证券投资基金、信诚中小盘混合型证券投资基金、信诚深度价值混合型证券投资基金(LOF)、信诚增强收益债券型证券投资基金(LOF)、信诚金砖四国积极配置证券投资基金(LOF)、信诚中证 500 指数分级证券投资基金、信诚货币市场证券投资基金、信诚新机遇混合型证券投资基金(LOF)、信诚全球商品主题证券投资基金(LOF)、信诚沪深 300 指数分级证券投资基金、信诚双盈债券型证券投资基金(LOF)、信诚周期轮动混合型证券投资基金(LOF)、信诚理财 7 日盈债券型证券投资基金、信诚添金分级债券型证券投资基金、信诚优质纯债债券型证券投资基金、信诚新双盈分级债券型证券投资基金、信诚新兴产业混合型证券投资基金、信诚中证 800 医药指数分级证券投资基金、信诚中证 800 有色指数分级证券投资基金、信诚季季定期支付债券型证券投资基金、信诚年年有余定期开放债券型证券投资基金、信诚中证 800 金融指数分级证券投资基金、信诚月月定期支付债券型证券投资基金、信诚幸福消费混合型证券投资基金、信诚薪金宝货币市场基金、信诚中证 TMT 产业主题指数分级证券投资基金、信诚新选回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚新锐回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、信诚中证信息安全指数分级证券投资基金、信诚中证智能家居指数分级证券投资基金、信诚中证建筑工程指数型证券投资基金(LOF)、信诚惠报债券型证券投资基金、信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金、信诚稳利债券型证券投资基金、信诚惠盈债券型证券投资基金、信诚稳健债券型证券投资基金、信诚至利灵活配置混合型证券投资基金、信诚至益灵活配置混合型证券投资基金、信诚惠泽债券型证券投资基金、信诚稳瑞债券型证券投资基金、信诚稳益债券型证券投资基金、信诚至优灵活配置混合型证券投资基金、信诚至裕灵活配置混合型证券投资基金、信诚至鑫灵活配置混合型证券投资基金、信诚至瑞灵活配置混合型证券投资基金、信诚至选灵活配置混合型证券投资基金、信诚景瑞债券型证券投资基金、信诚新悦回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚主题轮动灵活配置混合型证券投资基金、信诚稳丰债券型证券投资基金、信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金、信诚稳悦债券型证券投资基金、信诚稳泰债券型证券投资基金、信诚永鑫一年定期开放混合型证券投资基金、信诚永利一年定期开放混合型证券投资基金、信诚永丰一年定期开放混合型证券投资基金、信诚稳鑫债券型证券投资基金、信诚至诚灵活配置混合型证券投资基金、信诚理财 28 日盈债券型证券投资基金、信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金、信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金、信诚新泽回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚至信灵活配置混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
闫志刚	本基金基金经理,信诚幸福消费混合基金的基金经理	2010 年 6 月 2 日	-	16	清华大学 MBA。曾先后世纪证券、平安证券、平安资产管理有限公司从事投资研究工作。2008 年加盟信诚基金管理有限公

					司,曾担任保诚韩国中国龙 A 股基金(QFII)投资经理(该基金由信诚基金担任投资顾问),信诚中小盘基金基金经理。现任信诚四季红混合基金、信诚幸福消费混合基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

注:1.上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《信诚四季红混合型证券投资基金基金合同》、《信诚四季红混合型证券投资基金招募说明书》的约定,本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金财产。本基金管理人通过不断完善法人治理结构和内部控制制度,加强内部管理,规范基金运作。本报告期内,基金运作合法合规,没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,以及公司拟定的《信诚基金公平交易管理制度》,公司采取了一系列的行动实际落实公平交易管理的各项要求。各部门在公平交易执行中各司其职,投资研究前端不断完善研究方法和投资决策流程,确保各投资组合享有公平的投资决策机会,建立公平交易的制度环境;交易环节加强交易执行的内部控制,利用恒生交易系统公平交易相关程序,及其它的流程控制,确保不同基金在一、二级市场同一证券交易时的公平;公司同时不断完善和改进公平交易分析系统,在事后加以了严格的行为监控,分析评估以及报告与信息披露。当期公司整体公平交易制度执行情况良好,未发现违背公平交易的相关情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金与其它投资组合之间有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。报告期内,未出现参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的交易(完全复制的指数基金除外)。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年,国内经济表现出了较强的韧性,地产投资和进出口超出预期;另外,又叠加了供给侧的改革,上下游企业的盈利得到迅速的恢复,资产负债表也得到修复,这不仅改善了企业和金融机构的损益表和资产负债表、扭转了市场的悲观预期,也为后续的制造业升级和进一步扩张打下了较好的基础。在这期间,市场涌现了很多结构性的机会,如大盘蓝筹股、优质龙头股、消费升级、消费电子、新能源等均出现了很不错的投资机会。

4.4.2 报告期内基金业绩表现

本报告期内,本基金份额净值增长率为 5.63%,同期业绩比较基准收益率为 0.17%,基金超越业绩比较基准 5.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在年初,由于对宏观经济持谨慎观点,组合配置偏防御,同时本人也对上半年的大盘蓝筹风格预料不足,组合配置的成长股估值所有收敛,另外,组合中的部分股票由于基本面不好而下跌,这导致了组合的业绩平平。根据目前披露的经济数据,市场对经济的悲观预期有所改变,市场逐渐相信企业盈利的持续性,

这会抬升整体市场的估值水平。鉴于经济和企业盈利超出本人的原先预期,本组合管理人对组合做了调整,减持了部分医药和建筑,增加了消费电子、新能源和有色的配置。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1. 基金估值程序

为了向基金投资人提供更好的证券投资管理服务,本基金管理人对估值和定价过程进行了最严格的控制。本基金管理人通过估值决策委员会来更有效的完善估值服务。估值决策委员会包括下列成员:分管基金运营业务的领导(委员会主席)、风险管理部负责人、股票投资负责人、债券投资负责人、交易部负责人、运营部负责人、基金会计主管(委员会秘书)。本基金管理人在充分衡量市场风险、信用风险、流动性风险、货币风险、衍生工具和结构性产品等影响估值和定价因素的基础上,综合运营部、稽核部、投资部、风控部和其它相关部门的意见,确定本基金管理人采用的估值政策。

估值政策和程序的确立和修订须经本基金管理人总经理批准后方可实行。基金在采用新投资策略或投资新品种时,应评价现有估值政策和程序的适用性,并在不适用的情况下,及时召开估值决策委员会。

在每个估值日,本基金管理人的运营部使用估值政策确定的估值方法,确定证券投资基金的份额净值。

基金管理人对基金资产进行估值后,将基金份额净值结果发送基金托管人,基金托管人按照托管协议中“基金资产净值计算和会计核算”确定的规则复核,复核无误后,由基金管理人对外公布。

2. 基金管理人估值业务的职责分工

本基金管理人的估值业务采用双人双岗,所有业务操作需经复核方可生效。

3. 基金管理人估值人员的专业胜任能力和相关工作经历

本基金管理人的估值人员均具有专业会计学习经历,具有会计上岗证和基金从业人员资格

4. 基金经理参与或决定估值的程度

本基金管理人的后台与投资业务隔离,基金经理不直接参与或决定估值

基金经理持续保持对基金估值所采用估值价格的关注,在认为基金估值所采用的估值价格不足够公允时,将通过首席投资官提请召开估值决策委员会会议,通过会议讨论决定是否调整基金管理人所采用的估值政策。

5. 参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

6. 已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

本基金未与任何第三方签订定价服务协议。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金采用季度结算的收益分配机制:

1. 分红结算日:每季最后一个工作日作为每季分红结算日;
 2. 分红前提:分红结算日基金份额净值超过 1.00 元,且基金产生已实现收益;
 3. 分红比例:本基金进行收益分配,至少分配基金份额净值超过 1.00 元部分的 25%;但分红金额不得超过已实现收益,且分配后基金份额净值不低于 1.00 元;
 4. 分红登记日与除权日:基金管理人于每季分红结算日(T 日)决定是否分红,若确定分红,经基金托管人核实后,则 T+1 日为权益登记日并进行除权, T+7 日内实现派息;
- 若基金已实现收益不足基金份额净值超过 1.00 元部分的 25%,在满足法律法规的前提下,基金将全部分配已实现收益(每份基金份额的最小分配单位为 0.1 分)。

本基金约定每季度结算收益,但并不保证每季度实现分红。在符合有关基金分红条件的前提下,基金收益分配每年不超过 4 次,基金合同生效后的下一个季度开始分红结算;基金年度收益分配比例不低于基金年度已实现收益的 50%;法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

本基金本报告期内的收益分配情况如下:

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2017-01-03	2017-01-03	0.150	12,931,175.70	9,589,822.05	22,520,997.75	-
2	2017-04-05	2017-04-05	0.130	11,162,333.69	7,757,079.35	18,919,413.04	-
合计			0.280	24,093,509.39	17,346,901.40	41,440,410.79	-

本基金的收益分配情况符合本基金的利润分配机制。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内,本基金未出现连续 20 个工作日基金资产净值低于五千万元(基金份额持有人数量不满两百人)的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中,本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定,对本基金基金管理人-信诚基金管理有限公司 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为,信诚基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为,信诚基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：信诚四季红混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	176,478,091.11	360,400,637.79
结算备付金		1,054,484.09	3,812,683.03
存出保证金		799,662.98	907,811.42
交易性金融资产	6.4.7.2	1,289,109,926.51	805,108,026.06

其中：股票投资		1,289,109,926.51	805,108,026.06
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	116,000,394.00	449,940,914.91
应收证券清算款		1,363,911.06	-
应收利息	6.4.7.5	99,919.97	210,762.78
应收股利		-	-
应收申购款		48,308.80	10,049,328.99
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,584,954,698.52	1,630,430,164.98
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,353,565.75	35,451,307.65
应付赎回款		766,201.01	80,448.45
应付管理人报酬		1,994,542.45	1,777,452.25
应付托管费		332,423.75	296,242.05
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,563,573.69	1,766,499.44
应交税费		207,196.00	207,196.00
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	1,411,014.10	1,370,145.83
负债合计		7,628,516.75	40,949,291.67
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1,448,863,330.03	1,501,503,144.08
未分配利润	6.4.7.10	128,462,851.74	87,977,729.23
所有者权益合计		1,577,326,181.77	1,589,480,873.31
负债和所有者权益总计		1,584,954,698.52	1,630,430,164.98

注：截止本报告期末，基金份额净值 1.0887 元，基金份额总额 1,448,863,330.03 份。

6.2 利润表

会计主体：信诚四季红混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		110,968,013.29	-23,371,796.18
1. 利息收入		1,867,935.07	1,155,345.79
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,394,841.58	1,054,017.18
债券利息收入		-	0.02
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		473,093.49	101,328.59
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-19,085,058.59	-30,427,259.39
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-26,932,800.33	-33,393,093.86
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	13.46
资产支持证券投资	6.4.7.13.1	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	7,847,741.74	2,965,821.01
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	127,978,736.19	5,696,797.75
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	206,400.62	203,319.67
减：二、费用		19,241,547.12	15,926,832.28
1. 管理人报酬		11,441,406.52	8,473,202.51
2. 托管费		1,906,901.05	1,412,200.42
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	5,599,509.08	5,750,322.41
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	293,730.47	291,106.94
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		91,726,466.17	-39,298,628.46
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		91,726,466.17	-39,298,628.46

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：信诚四季红混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,501,503,144.08	87,977,729.23	1,589,480,873.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	91,726,466.17	91,726,466.17
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-52,639,814.05	-9,800,932.87	-62,440,746.92
其中：1. 基金申购款	138,720,212.13	2,870,078.47	141,590,290.60
2. 基金赎回款	-191,360,026.18	-12,671,011.34	-204,031,037.52
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-41,440,410.79	-41,440,410.79
五、期末所有者权益（基金净值）	1,448,863,330.03	128,462,851.74	1,577,326,181.77
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	942,474,290.46	242,783,992.37	1,185,258,282.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-39,298,628.46	-39,298,628.46
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	346,192,054.18	22,559,507.54	368,751,561.72
其中：1. 基金申购款	520,906,743.09	34,450,618.06	555,357,361.15
2. 基金赎回款	-174,714,688.91	-11,891,110.52	-186,605,799.43
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-61,220,529.04	-61,220,529.04
五、期末所有者权益（基金净值）	1,288,666,344.64	164,824,342.41	1,453,490,687.05

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 至 财务报表由下列负责人签署：

吕涛	陈逸辛	刘卓
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

信诚四季红混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于同意信诚四季红混合型证券投资基金募集的批复》(证监基金字[2006]42号文)和《关于信诚四季红混合型证券投资基金备案确认的函》(基金部函[2006]96号文)批准,由信诚基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《信诚四季红混合型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于 2006 年 4 月 29 日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集规模为 3,006,323,520.62 份基金份额。本基金的基金管理人为信诚基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《信诚四季红混合型证券投资基金基金合同》和《信诚四季红混合型证券投资基金招募说明书(更新)》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法公开发行上市的股票、债券及其他中国证监会批准的投资工具。在正常市场情况下,本基金投资组合的比例范围为:股票资产 30%-95%;债券资产 0%-65%(不包括到期日在一年以内的政府债券);现金或者到期日在一年内的政府债券不低于 5%。本基金的业绩比较基准为:新华富时全 A 指数收益率*62.5%+中证国债指数收益率*32.5%+金融同业存款利率*5%。

根据《证券投资基金信息披露管理办法》,本基金定期报告在公开披露的第二个工作日,报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金按照财政部颁布的企业会计准则、中国证券业协会于 2012 年颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《信诚四季红混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的基金行业实务操作的规定编制会计报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则要求,真实、完整地反映了本基金的财务状况、经营成果和基金净值变动情况。

此外,本财务报表同时符合如会计报表附注 6.4.2 所列示的其他有关规定的要求。

6.4.4 重要会计政策和会计估计(本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明)

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计除 6.4.5 所列变更外,与最近一期年度报告相一致。

6.4.4.1 会计年度

6.4.4.2 记账本位币

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

6.4.4.7 实收基金

6.4.4.8 损益平准金

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

6.4.4.10 费用的确认和计量

6.4.4.11 基金的收益分配政策

6.4.4.12 分部报告

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计政策变更事项。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计估计变更事项。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期未发生会计差错。

6.4.6 税项

根据财税字[1998]55号文《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《财政部 国家税务总局 证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2015]125号文《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、《关于资管产品增值税有关问题的通知》(财税[2017]56号)及其他相关税务法规和实务操作,本基金适用的主要税项列示如下:

(a) 以发行基金方式募集资金,不属于营业税征收范围,不征收营业税。

(b) 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(c) 自2016年5月1日起,在全国范围内全面推开营业税改征增值税(以下称营改增)试点,建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人,纳入试点范围,由缴纳营业税改为缴纳增值税。

证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券收入免征增值税。

对香港市场投资者(包括单位和个人)通过基金互认买卖内地基金份额免征增值税。

2018年1月1日(含)以后,资管产品管理人(以下称管理人)运营资管产品(含公开募集证券投资基金)过程中发生的增值税应税行为(以下称资管产品运营业务),以管理人为增值税纳税人,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。管理人接受投资者委托以及管理人发生的除资管产品运营业务以

外的其他增值税应税行为(以下称其他业务),继续按照现行规定缴纳增值税。管理人应分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额,未分别核算的,资管产品运营业务不得适用于简易计税方法。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。因此,截至 2017 年 6 月 30 日,本基金没有计提有关增值税费用。

(d) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价,暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(e) 对基金取得的股票的股息、红利收入,债券的利息收入,由上市公司、发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起,对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额:持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50% 计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,股权登记日为自 2013 年 1 月 1 日起至 2015 年 9 月 7 日期间的,暂减按 25% 计入应纳税所得额,股权登记日在 2015 年 9 月 8 日及以后的,暂免征收个人所得税。

(f) 关于香港市场投资者通过基金互认买卖内地基金份额的所得税问题:

对香港市场投资者(包括企业和个人)通过基金互认买卖内地基金份额取得的转让差价所得,暂免征收所得税。

对香港市场投资者(包括企业和个人)通过基金互认从内地基金分配取得的收益,由内地上市公司向该内地基金分配股息红利时,对香港市场投资者按照 10% 的税率代扣所得税;或发行债券的企业向该内地基金分配利息时,对香港市场投资者按照 7% 的税率代扣所得税,并由内地上市公司或发行债券的企业向其主管税务机关办理扣缴申报。该内地基金向投资者分配收益时,不再扣缴所得税。

内地基金管理人应当向相关证券登记结算机构提供内地基金的香港市场投资者的相关信息。

(g) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

(h) 对投资者(包括个人和机构投资者)从基金分配中取得的收入,暂不征收个人所得税和企业所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
活期存款	176,478,091.11
定期存款	-
其中:存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计	176,478,091.11

6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,232,097,629.09	1,289,109,926.51	57,012,297.42
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券			
交易所市	-	-	-

	场			
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,232,097,629.09	1,289,109,926.51	57,012,297.42

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间市场买入返售金融资产	116,000,394.00	-
交易所市场买入返售金融资产	-	-
合计	116,000,394.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	55,868.81
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	427.05
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	36,493.16
应收申购款利息	6,807.04
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	323.91
合计	99,919.97

注：其他指应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他应收款、待摊费用等其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	1,557,911.14
银行间市场应付交易费用	5,662.55
合计	1,563,573.69

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	750,000.00
应付赎回费	1,524.35
预提审计费	109,095.94
预提信息披露费	548,765.71
应付后端申购费	1,628.10
合计	1,411,014.10

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,501,503,144.08	1,501,503,144.08
本期申购	138,720,212.13	138,720,212.13
本期赎回（以“-”号填列）	-191,360,026.18	-191,360,026.18
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,448,863,330.03	1,448,863,330.03

注：此处申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	454,998,243.32	-367,020,514.09	87,977,729.23
本期利润	-36,252,270.02	127,978,736.19	91,726,466.17
本期基金份额 交易产生的变 动数	-16,240,873.76	6,439,940.89	-9,800,932.87
其中：基金申 购款	33,128,429.26	-30,258,350.79	2,870,078.47
基金赎	-49,369,303.02	36,698,291.68	-12,671,011.34

回款			
本期已分配利润	-41,440,410.79	-	-41,440,410.79
本期末	361,064,688.75	-232,601,837.01	128,462,851.74

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	1,348,567.08
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	31,562.72
其他	14,711.78
合计	1,394,841.58

注：其他指申购款利息收入，结算保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	1,730,060,270.25
减：卖出股票成本总额	1,756,993,070.58
买卖股票差价收入	-26,932,800.33

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
申购基金份额对价总额	-
减：现金支付申购款总额	-
减：申购债券成本总额	-
减：申购债券应收利息总额	-
申购差价收入	-

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	7,847,741.74
基金投资产生的股利收益	-
合计	7,847,741.74

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1. 交易性金融资产	127,978,736.19
——股票投资	127,978,736.19
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	127,978,736.19

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	206,298.25

转换费收入	102.37
合计	206,400.62

注：本基金赎回费和转换费的 25% 归入基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	5,599,509.08
银行间市场交易费用	-
合计	5,599,509.08

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	109,095.94
信息披露费	148,765.71
银行费用	17,368.82
债券帐户维护费	18,000.00
上清所 CFCA 数字证书服务费	300.00
其他	200.00
合计	293,730.47

6.4.7.21 分部报告

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至本报告期末，本基金未发生需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

根据《信诚四季红混合型证券投资基金基金合同》、《信诚四季红混合型证券投资基金基金招募说明书》、《信诚四季红混合型证券投资基金分红公告》规定，基金管理人信诚基金管理有限公司于 2017 年 7 月 3 日（权益登记日）对本基金进行了分红除权。分红结果如下：

权益登记日 2017 年 7 月 3 日，除息日 2017 年 7 月 3 日，红利发放日 2017 年 7 月 4 日，每 10 份基金份额分 0.23 元。

除以上情况外，无其他需要说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
信诚基金管理有限公司	基金管理人
中国农业银行股份有限公司（“农业银行”）	基金托管人
信诚人寿保险有限公司	基金管理人主要股东控制的机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均根据正常的商业交易条件进行,并以一般交易价格为定价基础。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行过交易。

6.4.10.1.2 权证交易

6.4.10.1.3 债券交易

6.4.10.1.4 债券回购交易

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月 30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	11,441,406.52	8,473,202.51
其中:支付销售机构的客户维护费	1,543,607.99	1,608,138.75

注:支付基金管理人信诚基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。计算公式为:日基金管理费=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月 30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,906,901.05	1,412,200.42

注:支付基金托管人农业银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。计算公式为:日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

基金管理人运用自有资金投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。本基金的基金管理人本报告期内及上年度可比期间均未投资过本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位:份

关联方名称	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日

	持有的 基金份额	持有的基金 份额 占基金总份 额的比例	持有的 基金份额	持有的基 金份额 占基金总 份额的比 例
信诚人寿保险有 限公司	3,061,049.71	0.21%	9,457,107.73	0.63%

注:本基金除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。除上表外,本基金的其它关联方在本报告期末及上年度末均未持有本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	176,478,091.11	1,348,567.08	143,721,991.12	995,745.13

注:本基金通过“中国农业银行基金托管结算资金转用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金,于2017年6月30日的相关余额为人民币1,054,484.09元(2016年6月30日余额为3,077,832.49元)。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间,本基金均未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

6.4.11 利润分配情况

单位:人民币元

序号	权益 登记日	除息日	每10份 基金份额 分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
1	2017-01-03	2017-01-03	0.150	12,931,175.70	9,589,822.05	22,520,997.75	-
2	2017-04-05	2017-04-05	0.130	11,162,333.69	7,757,079.35	18,919,413.04	-
合计			0.280	24,093,509.39	17,346,901.40	41,440,410.79	-

6.4.12 期末(2017年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别:股票										
证券代 码	证 券 名 称	成功认购日	可流通日	流通受 限类型	认购价 格	期末估 值单价	数量 (单 位:股)	期末成本 总额	期末估值 总额	备注
603617	君禾股 份	2017-06-23	2017-07-03	网下新 股申购 未上市	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-
300671	富满电	2017-06-27	2017-07-05	网下新	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-

	子			股申购未上市						
603331	百达精工	2017-06-27	2017-07-05	网下新股申购未上市	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
300672	国科微	2017-06-30	2017-07-12	网下新股申购未上市	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
300670	大烨智能	2017-06-26	2017-07-03	网下新股申购未上市	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
603305	旭升股份	2017-06-30	2017-07-10	网下新股申购未上市	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
603933	睿能科技	2017-06-28	2017-07-06	网下新股申购未上市	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
002882	金龙羽	2017-06-15	2017-07-17	网下新股申购未上市	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
002879	长缆科技	2017-06-05	2017-07-07	网下新股申购未上市	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本报告期末,本基金未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末,本基金未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金金融工具的风险主要包括:信用风险、流动性风险、市场风险。

本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险,并设定适当的风险限额及内部控制流程,通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人奉行全面风险管理体的建设,在董事会下设立风控与审计委员会,负责制定风险管

理的宏观政策, 设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策等; 在管理层层面设立风险管理委员会, 实施董事会风控与审计委员会制定的各项风险管理和内部控制政策; 在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责, 协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部和风险管理部对公司首席执行官负责, 其中监察稽核部还须向督察长报告工作。

本基金管理人建立了以风险管理委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任, 或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息, 导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券, 且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%, 且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算, 因此违约风险发生的可能性很小; 本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度与可能遭受的损失。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现, 另一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求, 并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求, 对流动性指标进行持续的监测和分析。

针对投资品种变现的流动性风险, 本基金的基金管理人对流通受限证券的投资交易进行限制和控制, 对缺乏流动性的证券投资比率事先确定最高上限, 控制基金的流动性结构; 加强对投资组合变现周期和冲击成本的定量分析, 定期揭示基金的流动性风险; 通过分散投资降低基金财产的非系统性风险, 保持基金组合良好的流动性。本基金所持证券均可在证券交易所或银行间同业市场交易, 均能及时变现。此外, 本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求, 其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

针对兑付赎回资金的流动性风险, 本基金的基金管理人根据申购赎回变动情况, 制定现金头寸预测表, 及时采取措施满足流动性需要; 分析基金持有人结构, 加强与主要持有机构的沟通, 及时揭示可能的赎回需求; 按照有关法律法规规定应对固定赎回, 并进行适当报告和披露; 在基金合同中设计了巨额赎回条款, 约定在非常情况下赎回申请的处理方式, 控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险, 有效保障基金持有人利益。

本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或合同约定到期日均为一个月以内且不计息, 可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息, 因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

6.4.13.4 市场风险

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分

金融资产和金融负债不计息,因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年6月30 日	1个月以内	1-3 个月	3个月 -1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	176,478,091.11	-	-	-	-	-	176,478,091.11
结算备付金	1,054,484.09	-	-	-	-	-	1,054,484.09
存出保证金	799,662.98	-	-	-	-	-	799,662.98
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,289,109,926.51	1,289,109,926.51
买入返售金融资产	116,000,394.00	-	-	-	-	-	116,000,394.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,363,911.06	1,363,911.06
应收利息	-	-	-	-	-	99,919.97	99,919.97
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	48,308.80	48,308.80
待摊费用	-	-	-	-	-	-	-
其他应收款	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	294,332,632.18	-	-	-	-	1,290,622,066.34	1,584,954,698.52
负债							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,353,565.75	1,353,565.75
应付赎回款	-	-	-	-	-	766,201.01	766,201.01
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,994,542.45	1,994,542.45
应付托管费	-	-	-	-	-	332,423.75	332,423.75
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,563,573.69	1,563,573.69
应交税费	-	-	-	-	-	207,196.00	207,196.00
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	1,411,014.10	1,411,014.10
负债总计	-	-	-	-	-	7,628,516.75	7,628,516.75
利率敏感度缺口	294,332,632.18	-	-	-	-	-1,282,993,549.59	1,577,326,181.77
上年度末 2016年12月31 日	1个月以内	1-3 个月	3个月 -1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	360,400,637.79	-	-	-	-	-	360,400,637.79
结算备付金	3,812,683.03	-	-	-	-	-	3,812,683.03

存出保证金	907,811.42	-	-	-	-	907,811.42
交易性金融资产	-	-	-	-	805,108,026.06	805,108,026.06
买入返售金融资产	449,940,914.91	-	-	-	-	449,940,914.91
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	210,762.78	210,762.78
应收股利	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	10,049,328.99	10,049,328.99
待摊费用	-	-	-	-	-	-
其他应收款	-	-	-	-	-	-
资产总计	815,062,047.15	-	-	-	815,368,117.83	1,630,430,164.98
负债	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	35,451,307.65	35,451,307.65
应付赎回款	-	-	-	-	80,448.45	80,448.45
应付管理人报酬	-	-	-	-	1,777,452.25	1,777,452.25
应付托管费	-	-	-	-	296,242.05	296,242.05
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	1,766,499.44	1,766,499.44
应交税费	-	-	-	-	207,196.00	207,196.00
应付利息	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	1,370,145.83	1,370,145.83
负债总计	-	-	-	-	40,949,291.67	40,949,291.67
利率敏感度缺口	815,062,047.15	-	-	-	774,418,826.16	1,589,480,873.31

注：上表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

	假设
	-

由于本基金于本期末及上年度末，未持有债券等受利率波动明显的金融资产，因此可认为市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金承受的其他市场价格风险，主要是基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金的其他市场价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。于本报告期末，本基金面临的其他市场价格风险列示如下

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	1,289,109,926.51	81.73	805,108,026.06	50.65
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,289,109,926.51	81.73	805,108,026.06	50.65

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准中的股票指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末(2017年6月30日)	上年度末(2016年12月31日)
	业绩比较基准中的股票指数上升5%	68,881,836.97	71,991,357.82
业绩比较基准中的股票指数下降5%	-68,881,836.97	-71,991,357.82	

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

假设	1. -		
	2. -		
假设	-		
	-		
分析	风险价值 (单位：人民币元)	本期末(2017年6月30日)	上年度末(2016年12月31日)
	-	-	-

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无需要说明的此类事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,289,109,926.51	81.33
	其中：股票	1,289,109,926.51	81.33
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	116,000,394.00	7.32
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	177,532,575.20	11.20
7	其他各项资产	2,311,802.81	0.15
8	合计	1,584,954,698.52	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	130,693.82	0.01
B	采矿业	107,187.87	0.01
C	制造业	490,869,711.63	31.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	329,621,262.30	20.90
F	批发和零售业	154,386,400.00	9.79
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	54,673.00	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	156,951,699.84	9.95
N	水利、环境和公共设施管理业	126,660,398.05	8.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	30,327,900.00	1.92
S	综合	-	-
	合计	1,289,109,926.51	81.73

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
-	-	-
合计	-	-

本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300284	苏交科	7,975,188	156,951,699.84	9.95
2	002450	康得新	3,970,000	89,404,400.00	5.67
3	600196	复星医药	2,725,166	84,452,894.34	5.35
4	300070	碧水源	4,487,957	83,700,398.05	5.31
5	601607	上海医药	2,730,000	78,842,400.00	5.00
6	600068	葛洲坝	7,000,000	78,680,000.00	4.99
7	000963	华东医药	1,520,000	75,544,000.00	4.79
8	002117	东港股份	2,510,787	64,979,167.56	4.12
9	000915	山大华特	1,509,796	55,666,178.52	3.53
10	002217	合力泰	5,539,950	54,734,706.00	3.47
11	300237	美晨科技	3,074,946	53,073,567.96	3.36
12	600079	人福医药	2,679,936	52,580,344.32	3.33
13	002051	中工国际	2,401,828	49,789,894.44	3.16
14	601186	中国铁建	3,879,938	46,675,654.14	2.96
15	002310	东方园林	2,639,763	44,136,837.36	2.80
16	300355	蒙草生态	4,000,000	42,960,000.00	2.72
17	300197	铁汉生态	3,079,825	40,900,076.00	2.59
18	300011	鼎汉技术	2,030,000	32,480,000.00	2.06
19	600373	中文传媒	1,290,000	30,327,900.00	1.92
20	300210	森远股份	2,504,903	24,297,559.10	1.54
21	000928	中钢国际	1,729,940	16,365,232.40	1.04
22	000756	新华制药	1,049,935	15,938,013.30	1.01
23	600271	航天信息	749,960	15,479,174.40	0.98
24	000651	格力电器	10,000	411,700.00	0.03
25	002234	民和股份	7,717	95,999.48	0.01
26	600988	赤峰黄金	6,875	87,656.25	0.01

27	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	-
28	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	-
29	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	-
30	002355	兴民智通	3,881	39,702.63	-
31	300017	网宿科技	2,995	36,149.65	-
32	603335	迪生力	2,230	24,864.50	-
33	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	-
34	002881	美格智能	989	22,608.54	-
35	603679	华体科技	809	21,438.50	-
36	002746	仙坛股份	727	21,177.51	-
37	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	-
38	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	-
39	603933	睿能科技	857	17,311.40	-
40	002444	巨星科技	1,000	15,580.00	-
41	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	-
42	300669	沪宁股份	841	14,650.22	-
43	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	-
44	603286	日盈电子	890	13,528.00	-
45	002299	圣农发展	909	13,516.83	-
46	000603	盛达矿业	939	12,751.62	-
47	002548	金新农	986	11,910.88	-
48	300672	国科微	1,257	10,659.36	-
49	002123	梦网荣信	953	10,587.83	-
50	603331	百达精工	999	9,620.37	-
51	300671	富满电子	942	7,639.62	-
52	603617	君禾股份	832	7,429.76	-
53	600348	阳泉煤业	1,000	6,780.00	-
54	603799	华友钴业	100	6,078.00	-
55	600426	华鲁恒升	130	1,526.20	-
56	300113	顺网科技	11	295.90	-

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002450	康得新	110,858,850.34	6.97
2	300284	苏交科	106,668,863.80	6.71
3	300070	碧水源	102,250,220.03	6.43
4	000915	山大华特	90,440,263.98	5.69
5	000963	华东医药	86,392,073.25	5.44
6	600068	葛洲坝	84,522,772.19	5.32

7	601607	上海医药	76,936,001.30	4.84
8	600196	复星医药	73,741,633.01	4.64
9	000651	格力电器	72,418,817.27	4.56
10	600373	中文传媒	66,267,658.38	4.17
11	600104	上汽集团	63,264,351.08	3.98
12	002051	中工国际	60,951,198.61	3.83
13	600079	人福医药	57,538,619.72	3.62
14	002310	东方园林	56,117,157.07	3.53
15	300237	美晨科技	54,155,033.76	3.41
16	601186	中国铁建	53,083,309.00	3.34
17	002217	合力泰	46,872,717.93	2.95
18	002236	大华股份	45,715,438.49	2.88
19	300355	蒙草生态	45,533,679.10	2.86
20	002746	仙坛股份	45,367,646.48	2.85
21	600808	马钢股份	42,968,578.67	2.70
22	300197	铁汉生态	39,114,252.32	2.46
23	600491	龙元建设	35,138,117.98	2.21
24	002415	海康威视	32,201,556.00	2.03

注：买入金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000651	格力电器	87,734,536.45	5.52
2	600104	上汽集团	62,929,871.44	3.96
3	002299	圣农发展	59,290,637.90	3.73
4	002236	大华股份	58,775,390.73	3.70
5	600426	华鲁恒升	57,723,261.10	3.63
6	002123	梦网荣信	56,702,983.10	3.57
7	002294	信立泰	51,071,387.79	3.21
8	300017	网宿科技	48,361,061.97	3.04
9	002234	民和股份	47,472,532.83	2.99
10	002746	仙坛股份	47,166,569.41	2.97
11	000059	华锦股份	45,916,205.73	2.89
12	600808	马钢股份	45,600,534.70	2.87
13	002548	金新农	44,255,566.49	2.78
14	600373	中文传媒	43,290,763.67	2.72
15	300011	鼎汉技术	40,539,764.30	2.55
16	002450	康得新	39,149,452.07	2.46
17	600491	龙元建设	37,964,933.83	2.39
18	000963	华东医药	37,214,753.78	2.34
19	000915	山大华特	37,009,657.30	2.33

20	002355	兴民智通	35,995,519.48	2.26
21	002415	海康威视	33,851,301.00	2.13
22	601997	贵阳银行	32,331,489.20	2.03

注:卖出金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	2,113,016,234.84
卖出股票收入(成交)总额	1,730,060,270.25

注:买入股票成本和卖出股票收入按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	-	-

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
-	-	-	-	-	-

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

金额单位:人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
-	-	-	-	-	-

本基金本报告期内未进行资产支持证券投资。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

金额单位:人民币元

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
-	-	-	-	-	-

本基金本报告期内未进行贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

金额单位:人民币元

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
-	-	-	-	-	-

本基金本报告期内未进行权证投资。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计(元)				-	
股指期货投资本期收益(元)				-	
股指期货投资本期公允价值变动(元)				-	

本基金本报告期内未进行股指期货投资。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资范围不包括股指期货投资

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资范围不包括国债期货投资。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险指标说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计(元)				-	
国债期货投资本期收益(元)				-	
国债期货投资本期公允价值变动(元)				-	

本基金投资范围不包括国债期货投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金投资范围不包括国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金本期投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

7.12.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	799,662.98
2	应收证券清算款	1,363,911.06
3	应收股利	-
4	应收利息	99,919.97
5	应收申购款	48,308.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	2,311,802.81
---	----	--------------

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
-	-	-	-	-

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
-	-	-	-	-	-

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因,投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
42,243	34,298.31	575,441,373.87	39.72%	873,421,956.16	60.28%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	768,549.01	0.05%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2006年4月29日)基金份额总额	3,006,323,520.62
本报告期期初基金份额总额	1,501,503,144.08
本报告期基金总申购份额	138,720,212.13
减:本报告期基金总赎回份额	191,360,026.18
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	1,448,863,330.03

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金进行审计的会计师事务所是毕马威华振会计师事务所。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	2	1,106,371,388.08	28.82%	1,030,363.35	29.20%	-
海通证券	1	1,000,432,903.93	26.06%	911,693.66	25.83%	-
国信证券	1	553,866,233.45	14.43%	504,738.02	14.30%	-
光大证券	1	342,297,910.07	8.92%	318,781.17	9.03%	-
国泰君安	1	291,039,224.78	7.58%	265,223.95	7.52%	-
中金公司	1	225,035,030.56	5.86%	205,074.92	5.81%	-
方正证券	1	222,791,301.94	5.80%	203,029.99	5.75%	-
申银万国	1	96,678,379.42	2.52%	90,037.02	2.55%	-

东方证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
联合证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信证券	-	-	420,000,000.00	100.00%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
联合证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	信诚基金管理有限公司旗下证券投资基金 2016 年 12 月 31 日基金资产净值和基金份额净值公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2017-01-03
2	信诚四季红混合型证券投资基金分红公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2017-01-03
3	信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中正达广为销售机构并参加申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2017-01-05

4	信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海华信证券为销售机构并参加申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》及公司网站(www.xcfunds.com)	2017-01-07
5	信诚四季红混合型证券投资基金 2016 年第四季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》及公司网站(www.xcfunds.com)	2017-01-20
6	信诚基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》及公司网站(www.xcfunds.com)	2017-02-23
7	信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海基煜基金销售有限公司为销售机构并参加申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》及公司网站(www.xcfunds.com)	2017-03-07
8	信诚基金管理有限公司关于信诚四季红混合型证券投资基金分红结算的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》及公司网站(www.xcfunds.com)	2017-03-28
9	信诚四季红混合型证券投资基金 2016 年年度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》及公司网站(www.xcfunds.com)	2017-03-31
10	信诚四季红混合型证券投资基金 2016 年年度报告摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》及公司网站(www.xcfunds.com)	2017-03-31
11	信诚四季红混合型证券投资基金分红公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》及公司网站(www.xcfunds.com)	2017-04-05
12	信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金参与广发证券股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》及公司网站(www.xcfunds.com)	2017-04-07
13	关于旗下部分基金增加上海朝阳永续基金销售有限公司为销售机构并参加基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》及公司网站(www.xcfunds.com)	2017-04-17
14	信诚四季红混合型证券投资基金 2017 年第一季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》及公司网站(www.xcfunds.com)	2017-04-21
15	信诚基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》及公司网站(www.xcfunds.com)	2017-04-22
16	信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加贵州华阳众惠基金销售有限公司为销售机构并参加基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》及公司网站(www.xcfunds.com)	2017-04-27
17	信诚基金管理有限公司关于旗下部	《中国证券报》、《上海证券	2017-04-27

	分基金增加武汉市伯嘉基金销售有限公司为销售机构并参加基金申购费率优惠活动的公告	报》、《证券日报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	
18	信诚基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加北京蛋卷基金销售有限公司为代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2017-05-13
19	信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海大智慧财富管理有限公司为销售机构并参加基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2017-05-18
20	信诚四季红混合型证券投资基金招募说明书摘要(2017年第1次更新)	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2017-06-12
21	信诚四季红混合型证券投资基金招募说明书(2017年第1次更新)	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2017-06-12
22	信诚基金管理有限公司关于信诚四季红混合型证券投资基金分红结算的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2017-06-27
23	信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加通华财富为销售机构并参加基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2017-06-27
24	信诚基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2017-06-30

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
-							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件名称

- | |
|--|
| <ol style="list-style-type: none">1、信诚四季红混合型证券投资基金相关批准文件2、信诚基金管理公司营业执照、公司章程3、信诚四季红混合型证券投资基金基金合同4、信诚四季红混合型证券投资基金招募说明书5、本报告期内按照规定披露的各项公告 |
|--|

12.2 备查文件存放地点

信诚基金管理有限公司办公地--中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 9 层。

12.3 备查文件查阅方式

投资者可在营业时间至公司办公地点免费查阅，也可按工本费购买复印件。
亦可通过公司网站查阅，公司网址为 www.xcfunds.com。

信诚基金管理有限公司
2017 年 8 月 29 日