

# 信诚永益一年定期开放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：中信银行股份有限公司

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。

基金托管人中信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 25 日(基金合同生效日)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 .....	5
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现 .....	6
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
3.3 其他指标 .....	8
§ 4 管理人报告 .....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	10
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 .....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	11
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 .....	12
§ 5 托管人报告 .....	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	12
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 .....	12
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 .....	12
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计) .....	12
6.1 资产负债表 .....	12

6.2	利润表 .....	13
6.3	所有者权益（基金净值）变动表 .....	14
6.4	报表附注 .....	15
§ 7	投资组合报告 .....	32
7.1	期末基金资产组合情况 .....	32
7.2	期末按行业分类的股票投资组合 .....	32
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.....	33
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动 .....	33
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.....	34
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.....	34
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.....	34
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.....	34
7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	35
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	35
7.12	投资组合报告附注 .....	35
§ 8	基金份额持有人信息 .....	36
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	36
8.2	期末上市基金前十名持有人 .....	36
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	36
8.4	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.....	37
8.5	发起式基金发起资金持有份额情况 .....	37
§ 9	开放式基金份额变动 .....	37
§ 10	重大事件揭示 .....	38
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	38
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.....	38
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	38
10.4	基金投资策略的改变 .....	38
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	38
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.....	38
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	38
10.8	其他重大事件 .....	39
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息 .....	40
§ 12	备查文件目录 .....	41
12.1	备查文件名称 .....	41
12.2	备查文件存放地点 .....	41
12.3	备查文件查阅方式 .....	41

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金	
基金简称	信诚永益	
场内简称	-	
基金主代码	004171	
基金运作方式	契约型、定期开放式。本基金以定期开放方式运作，即本基金以封闭期和开放期相结合的方式运作。	
基金合同生效日	2017 年 1 月 25 日	
基金管理人	信诚基金管理有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	3,000,043,620.81 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	信诚永益 A	信诚永益 C
下属分级基金的场内简称	-	-
下属分级基金的交易代码	004171	004172
报告期末下属分级基金的份额总额	2,999,999,199.92 份	44,420.89 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下,通过合理的资产配置,综合运用多种投资策略,力争获得超越业绩比较基准的回报。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金主要通过对宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势的分析,在评价未来一段时间股票、债券市场相对收益率的基础上,动态优化调整权益类、固定收益类等大类资产的配置。在严格控制风险的前提下,力争获得超越业绩比较基准的绝对回报。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>在灵活的类别资产配置的基础上,本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的上市公司,严选其中安全边际较高的个股构建投资组合:自上而下地分析行业的增长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会;自下而上地评判企业的产品、核心竞争力、管理层、治理结构等;并结合企业基本面和估值水平进行综合的研判,严选安全边际较高的个股。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金将根据当前宏观经济形势、金融市场环境,运用基于债券研究的各种投资分析技术,进行个券精选。对于普通债券,本基金将在严格控制目标久期及保证基金资产流动性的前提下,采用目标久期控制、期限结构配置、信用利差策略、相对价值配置、回购放大策略等策略进行主动投资。</p> <p>4、证券公司短期公司债券投资策略</p> <p>本基金通过对证券公司短期公司债券发行人基本面的深入调研分析,结合发行人资产负债状况、盈利能力、现金流、经营稳定性以及</p>

	<p>债券流动性、信用利差、信用评级、违约风险等的综合评估结果,选取具有价格优势和套利机会的优质信用债券进行投资。</p> <p>5、资产支持证券投资策略</p> <p>资产支持证券的定价受市场利率、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率等多种因素影响。本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上,对资产支持证券的交易结构风险、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行分析,采取包括收益率曲线策略、信用利差曲线策略、预期利率波动率策略等积极主动的投资策略,投资于资产支持证券。</p> <p>6、股指期货投资策略</p> <p>基金管理人可运用股指期货,以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货的投资,以管理投资组合的系统性风险,改善组合的风险收益特性。此外,本基金还将运用股指期货来对冲诸如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理。</p> <p>7、权证投资策略</p> <p>本基金将按照相关法律法规通过利用权证进行套利、避险交易,控制基金组合风险,获取超额收益。本基金进行权证投资时,将在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上,结合股价波动率等参数,运用数量化定价模型,确定其合理内在价值,构建交易组合。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,本基金可以相应调整和更新相关投资策略,并在招募说明书更新或相关公告中公告。</p>
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率×30%+中证综合债指数收益率×70%。
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期风险、预期收益高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。
下属分级基金的风险收益特征	-

### 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	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周浩	方韡
	联系电话	021-68649788	4006800000
	电子邮箱	hao.zhou@xcfunds.com	fangwei@citicbank.com
客户服务电话		400-666-0066	95558
传真		021-50120888	010-85230024
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	北京市东城区朝阳门北大街 9 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	北京市东城区朝阳门北大街 9 号

邮政编码	200120	100010
法定代表人	张翔燕	李庆萍

## 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、证券时报
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	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼

## § 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25日(基金合同生效日)至2017年6月30日)	
	信诚永益 A	信诚永益 C
本期已实现收益	41,640,385.17	539.58
本期利润	35,255,020.82	444.90
加权平均基金份额本期利润	0.0118	0.0100
本期加权平均净值利润率	1.17%	1.00%
本期基金份额净值增长率	1.18%	1.00%
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	35,255,020.82	444.90
期末可供分配基金份额利润	0.0118	0.0100
期末基金资产净值	3,035,254,220.74	44,865.79
期末基金份额净值	1.0118	1.0100
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	1.18%	1.00%

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

信诚永益 A

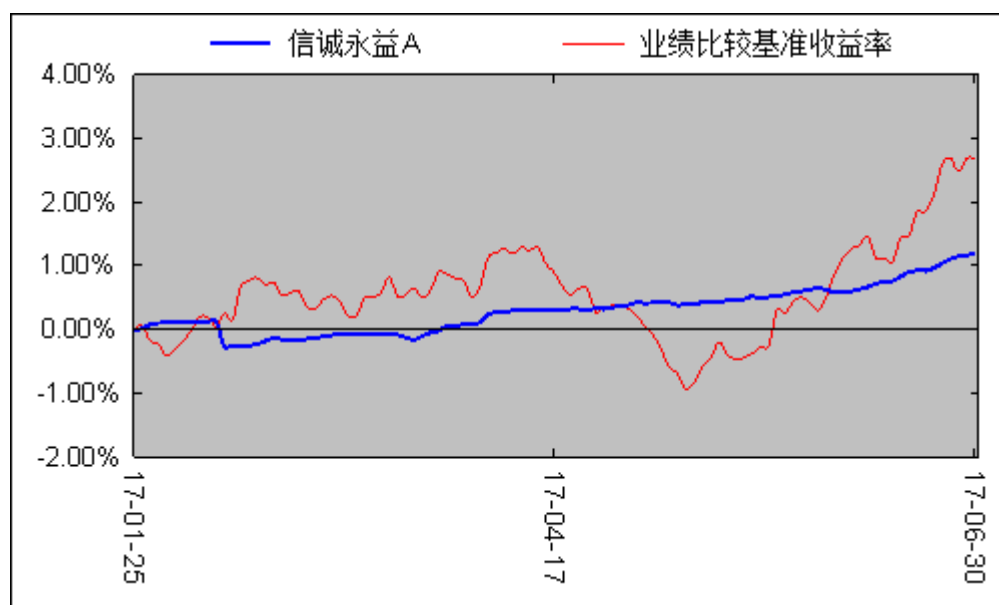
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.60%	0.03%	2.23%	0.20%	-1.63%	-0.17%
过去三个月	1.07%	0.03%	2.00%	0.20%	-0.93%	-0.17%
自基金合同生效起至今	1.18%	0.05%	2.69%	0.19%	-1.51%	-0.14%

信诚永益 C

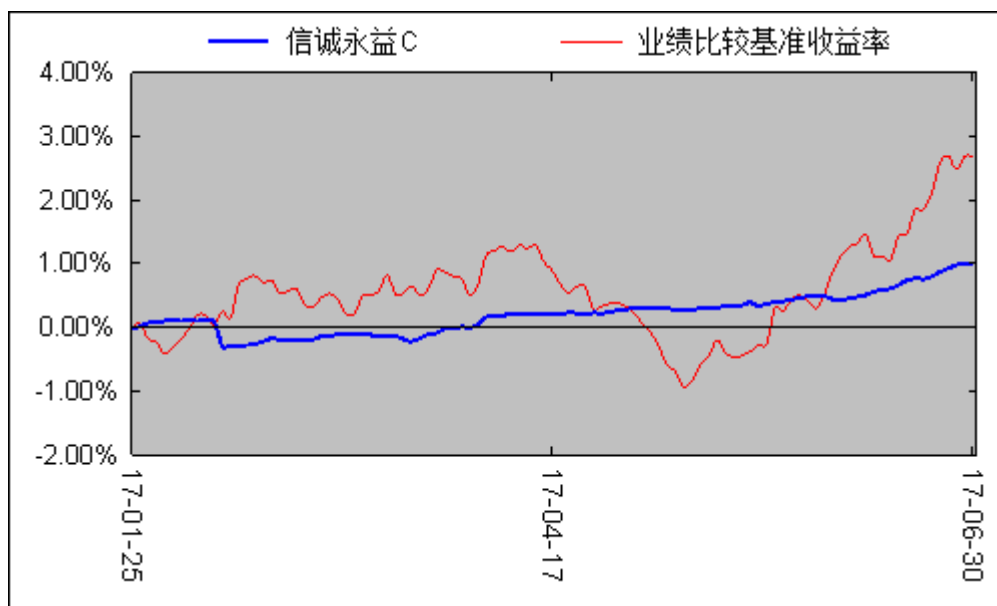
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.56%	0.03%	2.23%	0.20%	-1.67%	-0.17%
过去三个月	0.96%	0.03%	2.00%	0.20%	-1.04%	-0.17%
自基金合同生效起至今	1.00%	0.05%	2.69%	0.19%	-1.69%	-0.14%

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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

信诚永益 A



信诚永益 C



注：1、基金合同生效起至本报告期末不满一年(本基金合同生效日为2017年1月25日)。

2、本基金建仓期自2017年1月25日至2017年7月25日,截至本报告期末,本基金尚处于建仓期。

### 3.3 其他指标

## §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性证券投资基金、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		
提云涛	本基金基金经理，信诚至利灵活配置混合基金、信诚至益灵活配置混合基金、信诚至优灵活配置混合基金、信诚至鑫灵活配置混合基金、信诚至瑞灵活配置混合基金、信诚至选灵活配置混合基金、信诚新选回报灵活配置混合基金、信诚新旺回报灵活配置混合基金 (LOF)、信	2017 年 1 月 25 日	-	17	复旦大学经济学博士。曾任职于大鹏证券股份有限公司上海分公司，担任研究部分析师；于上海申银万国证券研究所，历任宏观策略部副总监、金融工程部总监；于平安资产管理有限责任公司，担任量化投研部总经理；于中信证券股份有限公司，担任研究部金融工程总监。2015 年 6 月加入信诚基金管理有限公司。现任信诚基金管理有限公司数量投资总监、信诚沪深 300 指数分级基金、信诚至利灵活配置混合基金、信诚至益灵活配置混合基金、信诚至优灵活配置混合基金、信诚至鑫灵活配置混合基

	诚永益一年定期开放混合基金、信诚永鑫一年定期开放混合基金、信诚永利一年定期开放混合基金的基金经理, 信诚基金管理有限公司数量投资总监			金、信诚至瑞灵活配置混合基金、信诚至选灵活配置混合基金、信诚新选回报灵活配置混合基金、信诚新旺回报灵活配置混合基金 (LOF)、信诚永益一年定期开放混合基金、信诚永鑫一年定期开放混合基金、信诚永利一年定期开放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遵规守信情况的说明

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《信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》、《信诚永益一年定期开放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

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、二级市场对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

2017 年上半年, 宏观经济平稳向好, 金融市场总体稳定。宏观经济, 经济运行整体平稳。PPI 涨幅呈逐季回落趋势, CPI 涨幅继续保持较低水平; 固定资产投资虽略有回落, 但投资结构继续改善, 制造业投资和民间投资稳步增长; 制造业 PMI 虽然各月有所波动, 上半年保持在 50 荣枯线上方, 说明企业对市场持续看好; 金融市场, 一方面, 是去杠杆、防风险、强监管; 另一方面, 是经济基本面向好, 企业盈利改善。

债券市场。受到加强监管、货币政策趋紧、经济基本面向好等多重因素的影响, 债券收益率整体震荡上行。在“春节后上调公开市场回购利率和 SLF 利率—2 月份紧缩措施略有放松—季度 MPA 考核临近—4、5 月份进一步加强监管—6 月中旬公开市场维持适当流动性”等因素影响下, 上半年债券收益率呈整体震荡上行。

本基金采取短久期加杠杆的操作策略, 主要投资于银行间短期品种, 维持适度的杠杆, 获取稳定的票息和息差收益, 有效规避了期间净值波动。鉴于短端品种仍有较高的投资价值, 而中长端收益率走势仍存在不确定性, 未来基金的债券组合仍倾向投资于安全性及高流动性的短端品种, 维持低久期、适度杠杆的配置思路, 谨慎参与长端品种, 并通过分散化投资和加大信用风险筛查力度, 规避可能的信用风险冲击。同时,

积极参与转债网下申购的套利机会,增强组合投资收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金 A、C 份额净值增长率分别为 1.18%和 1.00%,同期业绩比较基准收益率为 2.69%,基金 A、C 份额落后业绩比较基准分别为 1.51%和 1.69%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年下半年,预计经济运行整体平稳。一方面,外部经济的复苏,有助于拉动出口增长;另一方面,国内的投资将继续保持适当的规模,消费也将稳步增长,而通胀压力较小,经济结构也正逐步调整。金融市场发面,虽然“防风险、强监管”的政策仍将延续,但经过 2 季度监管措施,金融风险也有所控制,政策力度可能稍有缓和。在“稳定”的主基调下,货币政策仍在中性区域。预计债券收益率基本平稳,可能会略有下行但幅度不大,但是要注意信用风险。

本基金后续继续短久期加杠杆的操作策略,以绝对收益为目标获取稳定收益。同时,继续参与转债网下申购的套利机会,增强组合投资收益。

#### 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

本基金收益分配应遵循下列原则:

- 1、《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配;
- 2、本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

3、同一类别内的每一基金份额享有同等分配权；

4、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。本基金于本报告期末未进行过利润分配，该处理符合本基金利润分配原则。

#### 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

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金 2017 上半年度基金的投资运作，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，不存在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信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金的投资运作、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信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金 2017 年半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，未发现有关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：信诚永益一年定期开放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
<b>资产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	2,613,897.26
结算备付金		-
存出保证金		13,399.48
交易性金融资产	6.4.7.2	3,935,426,000.00
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		3,935,426,000.00
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	166,770,543.46
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	76,781,809.08
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		4,181,605,649.28
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017年6月30日</b>
<b>负 债:</b>		
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		1,143,947,759.56
应付证券清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		1,491,012.56
应付托管费		248,502.09
应付销售服务费		14.70
应付交易费用	6.4.7.7	77,082.32
应交税费		-
应付利息		358,024.24
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	184,167.28
负债合计		1,146,306,562.75
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	6.4.7.9	3,000,043,620.81
未分配利润	6.4.7.10	35,255,465.72
所有者权益合计		3,035,299,086.53
负债和所有者权益总计		4,181,605,649.28

注:1、截止本报告期末,基金份额总额 3,000,043,620.81 份。下属分级基金:信诚永益 A 的份额净值 1.0118 元,基金份额总额 2,999,999,199.92 份;信诚永益 C 的基金份额净值 1.0100 元,基金份额总额为 44,420.89 份。

2、本基金合同自 2017 年 1 月 25 日起生效,无上年度可比期间。

## 6.2 利润表

会计主体:信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金

本报告期:2017 年 1 月 25 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期
-----	-----	----

		2017 年 1 月 25 日(基金合同生效日) 至 2017 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		52,252,414.95
1. 利息收入		58,051,743.23
其中：存款利息收入	6.4.7.11	4,591,737.97
债券利息收入		51,918,190.89
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		1,541,814.37
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		586,130.75
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	586,130.75
资产支持证券投资	6.4.7.13.1	-
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	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-6,385,459.03
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		-
<b>减：二、费用</b>		16,996,949.23
1. 管理人报酬		7,714,641.16
2. 托管费		1,285,773.51
3. 销售服务费		76.44
4. 交易费用		6.4.7.19 18,098.41
5. 利息支出		7,783,980.25
其中：卖出回购金融资产支出		7,783,980.25
6. 其他费用		6.4.7.20 194,379.46
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		35,255,465.72
<b>减：所得税费用</b>		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		35,255,465.72

注：本基金合同自 2017 年 1 月 25 日起生效，无上年度可比期间。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 25 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 25 日(基金合同生效日)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)	3,000,043,620.81	-	3,000,043,620.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本	-	35,255,465.72	35,255,465.72

期利润)			
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)	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	3,000,043,620.81	35,255,465.72	3,035,299,086.53

注：本基金合同自 2017 年 1 月 25 日起生效，无上年度可比期间。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 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

信诚永益一年定期开放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”)《关于准予信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2016]3001 号文)和《关于信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金备案确认的函》(机构部函[2017]287 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《信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于 2017 年 1 月 25 日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为信诚基金管理有限公司,基金托管人为中信银行股份有限公司。

本基金于 2016 年 12 月 26 日至 2017 年 1 月 23 日募集,首次向社会公开发售募集且扣除认购费用后的有效认购资金人民币 3,000,043,610.87 元(其中 A 级 2,999,999,199.88 元,C 级 44,410.99),募集期间认购利息转份额 9.94 元(其中 A 级 0.04 元,C 级 9.90 元),共计人民币 3,000,043,620.81 元。上述认购资金折合 3,000,043,620.81 份基金份额。上述募集资金已由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了普华永道中天验字(2017)第 029 号验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》和《信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(含国债、金融债、地方政府债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券、证券公司短期公司债券及其他中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、银行存款、同业存单、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×30%+中证综合债指数收益率×70%。

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

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《信诚永益一年定期开放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年度财务报表。

#### 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)

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2017 年 1 月 25 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

###### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

##### 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

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中

包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2) 该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;或者(3) 该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。



当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易,但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具,如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场,采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。

金融工具公允价值计量的方法:

(1) 公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层次:直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层次:以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(2) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

(3) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;且 2) 交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投

资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和 C 类份额的销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金收益分配应遵循下列原则：

- 1、《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；
- 2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；
- 3、同一类别内的每一基金份额享有同等分配权；
- 4、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；
5. 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 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

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38 号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》提供的根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外），按照中央国债登记结算有限责任公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

#### 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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《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《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《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《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[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前,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。管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起,金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 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。

(3) 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。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 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。

(5) 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	2,613,897.26
定期存款	-	
其中:存款期限 1-3 个月	-	
其他存款	-	
合计	2,613,897.26	

##### 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	-	-	-	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市	315,888,271.50	315,655,000.00	-233,271.50

	场			
	银行间市场	3,625,923,187.53	3,619,771,000.00	-6,152,187.53
	合计	3,941,811,459.03	3,935,426,000.00	-6,385,459.03
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		3,941,811,459.03	3,935,426,000.00	-6,385,459.03

#### 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	166,770,543.46	-
合计	166,770,543.46	-

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有任何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	3,845.00
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	940.50
应收债券利息	76,762,613.48
应收买入返售证券利息	14,404.10
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	6.00
合计	76,781,809.08

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	-
银行间市场应付交易费用	77,082.32
合计	77,082.32

#### 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	-
应付赎回费	-
预提审计费	46,041.82
预提信息披露费	138,125.46
合计	184,167.28

#### 6.4.7.9 实收基金

信诚永益 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月25日(基金合同生效日)至2017年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	2,999,999,199.92	2,999,999,199.92
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
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	2,999,999,199.92	2,999,999,199.92

信诚永益 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月25日(基金合同生效日)至2017年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	44,420.89	44,420.89
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
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	44,420.89	44,420.89
-----	-----------	-----------

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

信诚永益 A

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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	41,640,385.17	-6,385,364.35	35,255,020.82
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	41,640,385.17	-6,385,364.35	35,255,020.82

信诚永益 C

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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	539.58	-94.68	444.90
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	539.58	-94.68	444.90

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月25日(基金合同生效日)至2017年6月30日
活期存款利息收入	284,550.18
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	4,238,888.89
结算备付金利息收入	68,245.86
其他	53.04
合计	4,591,737.97

注：1. 其他存款利息收入指有存款期限、但根据协议可提前支取且没有利息损失的协议存款利息收入。

2. 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**

本基金本报告期内无股票投资收益。

**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**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月25日(基金合同生效日)至2017年6月30日
债券投资收益——买卖债券(、债转股及债券到期兑付)差价收入	586,130.75
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	586,130.75

**6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月25日(基金合同生效日)至2017年6月30日
卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额	582,851,928.12
减：卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	578,576,768.08
减：应收利息总额	3,689,029.29
买卖债券差价收入	586,130.75

**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25日(基金合同生效日)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

本基金本报告期无股利收入。

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25日(基金合同生效日)至2017年6月30日
1. 交易性金融资产	-6,385,459.03
——股票投资	-
——债券投资	-6,385,459.03
——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	-6,385,459.03

6.4.7.18 其他收入

注：本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月25日(基金合同生效日)至2017年6月30日
交易所市场交易费用	873.41
银行间市场交易费用	17,225.00
合计	18,098.41

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月25日(基金合同生效日)至2017年6月30日
审计费用	46,041.82
信息披露费	138,125.46



银行费用	6,712.18
债券帐户维护费	3,000.00
其他	500.00
合计	194,379.46

#### 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《信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》、《信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金基金招募说明书》、《信诚永益一年定期开放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 14 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 14 日,除息日 2017 年 7 月 14 日,红利发放日 2017 年 7 月 17 日,每 10 份永益 A 级基金份额分 0.12 元,每 10 份永益 C 级基金份额分 0.1 元。

##### 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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 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
中信银行股份有限公司(“中信银行”)	基金托管人

#### 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

1、本基金在本报告期内未通过关联方交易单元进行过交易。

2、本基金合同自 2017 年 1 月 25 日起生效,无上年度可比期间。

##### 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 25 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日

当期发生的基金应支付的管理费	7,714,641.16
其中：支付销售机构的客户维护费	56.44

注：1、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 0.60%的年费率每日计提，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×0.60%/当年天数

2、本基金合同自 2017 年 1 月 25 日起生效，无上年度可比期间。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 25 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,285,773.51

注：1. 支付基金托管人中信银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率每日计提，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×0.10%/当年天数

2. 本基金合同自 2017 年 1 月 25 日起生效，无上年度可比期间。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2017 年 1 月 25 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	信诚永益 A	信诚永益 C	合计
中信银行	-	-	-
信诚基金管理有限公司	-	0.65	0.65
合计	-	0.65	0.65

注：1. 本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的年销售服务费率为 0.4%。C 类基金份额销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.4%年费率每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。计算公式为：C 类基金日销售服务费=C 类基金份额前一日资产净值×0.4%/当年天数

2. 本基金合同自 2017 年 1 月 25 日起生效，无上年度可比期间。

#### 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

注：1、本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

2、本基金合同自 2017 年 1 月 25 日起生效，无上年度可比期间。

#### 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固有资金投资本基金的情况

1. 基金管理人运用固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在

##### 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

1. 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，本基金的其它关联方在本报告期末未持有本基金。

2. 本基金合同自 2017 年 1 月 25 日起生效，无上年度可比期间。

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25日(基金合同生效日)至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中信银行	2,613,897.26	284,550.18

注：本基金通过“中信银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于本报告期末的相关余额为人民币 0 元。（本基金合同自 2017 年 1 月 25 日起生效，无上年度可比期间。）

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

1. 本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。
2. 本基金合同自 2017 年 1 月 25 日起生效，无上年度可比期间。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行过利润分配。

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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

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

截至本报告期末，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 906,947,759.56 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
111681200	16 江苏江南农村商业 银行 CD157	2017-07-05	95.98	1,050,000	100,779,000.00
111681429	16 合肥科技农 村商行 CD040	2017-07-04	95.82	1,000,000	95,820,000.00
111699832	16 浙江泰隆商 行 CD047	2017-07-05	96.34	1,260,000	121,388,400.00
111681652	16 浙江民泰商 行 CD102	2017-07-03	95.82	2,000,000	191,640,000.00
111681803	16 中原银行 CD186	2017-07-03	95.91	1,150,000	110,296,500.00
111681844	16 苏州银行	2017-07-03	95.86	2,000,000	191,720,000.00

	CD140				
111681717	16 九江银行 CD109	2017-07-03	95.86	220,000	21,089,200.00
111682001	16 广州农村 商业 银 行 CD167	2017-07-06	95.83	1,050,000	100,621,500.00
合计				9,730,000	933,354,600.00

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 237,000,000.00 元,其中 R-007 余额 24,000,000.00 元于 2017 年 7 月 3 日、2017 年 7 月 6 日先后到期,GC003 余额 103,000,000.00 元于 2017 年 7 月 3 日到期,GC004 余额 90,000,000.00 元于 2017 年 7 月 3 日到期,GC007 余额 20,000,000.00 元于 2017 年 7 月 5 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

#### 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系的建设,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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行,因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程,通过对投资品种和证券发行人进行信用等级评估来控制信用风险,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发行的证券,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通过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。此外,对于基金投资的股指期货等场内金融衍生品,管理人会对衍生品的流动性、交割日等予以关注。

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

单位:人民币元

本期末 2017年6 月30日	1个月以内	1-3个月	6个月以内	3个月-1 年	6个月-1 年	1年以内	1-5年	5年以上	合计
资产									
资产总计	-	-	-	-	-	-	-	-	-
负债									
负债总计	-	-	-	-	-	-	-	-	-
流动性净 额	-	-	-	-	-	-	-	-	-

#### 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。

本基金投资的交易所市场及银行间市场交易的固定收益证券,存在一定的利率风险。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,并通过对所持投资品种修正久期等参数的监控进行利率风险管理。

##### 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	6个月以内	3个月 -1年	6个月-1年	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产										

银行存款	2,613,897.26	-	-	-	-	-	-	-	2,613,897.26
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	13,399.48	-	-	-	-	-	-	-	13,399.48
交易性金融资产	-	196,015,000.00	-	3,344,498,000.00	-	-	394,913,000.00	-	3,935,426,000.00
买入返售金融资产	166,770,543.46	-	-	-	-	-	-	-	166,770,543.46
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	76,781,809.08	76,781,809.08
应收股利	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	-	-
待摊费用	-	-	-	-	-	-	-	-	-
其他应收款	-	-	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	169,397,840.20	196,015,000.00	-	3,344,498,000.00	-	-	394,913,000.00	76,781,809.08	4,181,605,649.28
负债	-	-	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	1,143,947,759.56	-	-	-	-	-	-	-	1,143,947,759.56
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	1,491,012.56	1,491,012.56
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	248,502.09	248,502.09
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-	14.70	14.70
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	77,082.32	77,082.32
应交税费	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-	358,024.24	358,024.24
应付利润	-	-	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	184,167.28	184,167.28
负债总计	1,143,947,759.56	-	-	-	-	-	-	2,358,803.19	1,146,306,562.75
利率敏感度缺口	-974,549,919.36	196,015,000.00	-	3,344,498,000.00	-	-	394,913,000.00	74,423,005.89	3,035,299,086.53

注：1. 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。

2. 本基金合同自 2017 年 1 月 25 日起生效，无上年度可比期间。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率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）
	市场利率下降 25 个基点	6,322,764.98
	市场利率上升 25 个基点	-6,266,060.95

注：本基金合同自 2017 年 1 月 25 日起生效，无上年度可比期间。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

1. 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。本基金本报告期末未持有受其他市场价格影响的交易性金融资产，因此无重大市场价格风险。

2. 本基金合同自 2017 年 1 月 25 日起生效，无上年度可比期间。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

	假设
	-

#### 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）
	-	-

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《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》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。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，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务

报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

## § 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	3,935,426,000.00	94.11
	其中：债券	3,935,426,000.00	94.11
	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	166,770,543.46	3.99
	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	2,613,897.26	0.06
7	其他各项资产	76,795,208.56	1.84
8	合计	4,181,605,649.28	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和 供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	-	-
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	-	-



N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	-	-

本基金本报告期末未持有股票投资。

### 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（%）
-	-	-	-	-	-

本基金本报告期末未持有股票投资。

### 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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
-	-	-	-	-

1. 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。

2. 本基金本报告期内未进行股票买入。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
-	-	-	-	-

1. 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。

2. 本基金本报告期内未进行股票卖出。

#### 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	-
卖出股票收入（成交）总额	-

1. 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。

2. 本基金本报告期内未进行股票买入和卖出。

### 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	315,655,000.00	10.40
5	企业短期融资券	50,110,000.00	1.65
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	同业存单	3,369,861,000.00	111.02
9	其他	199,800,000.00	6.58
10	合计	3,935,426,000.00	129.66

#### 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（%）
1	111681267	16 包商银行 CD078	3,000,000	287,940,000.00	9.49
2	1705192	17 湖南债 02	2,000,000	199,800,000.00	6.58
3	111698358	16 晋城银行 CD026	2,000,000	193,100,000.00	6.36
4	111699832	16 浙江泰隆商行 CD047	2,000,000	192,680,000.00	6.35
5	111681200	16 江苏江南农村商业银行 CD157	2,000,000	191,960,000.00	6.32

#### 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**

基金管理人可运用股指期货,以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货的投资,以管理投资组合的系统性风险,改善组合的风险收益特性。此外,本基金还将运用股指期货来对冲诸如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理。

本基金本报告期内未进行股指期货投资。

**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)				-	-

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

**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中,没有超出基金合同规定备选库之外的股票。

**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	13,399.48
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	76,781,809.08
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	76,795,208.56
---	----	---------------

#### 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

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

份额级别	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
信诚永益 A	3	999,999,733.31	2,999,999,000.00	100.00%	199.92	-
信诚永益 C	386	115.08	-	-	44,420.89	100.00%
合计	389	7,712,194.40	2,999,999,000.00	100.00%	44,620.81	-

注：本表列示“占基金总份额比例”中，对下属分级基金，为占各自级别份额的比例；对合计数，为占期末基金份额总额的比例。

#### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
-	-	-	-

#### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	信诚永益 A	-	-
	信诚永益 C	100.05	0.23%
	合计	100.05	-

注:1. 注:本表列示“占基金总份额比例”中,对下属分级基金,为占各自级别份额的比例;对合计数,为占期末基金份额总额的比例。

2. 期末基金管理人的从业人员未持有本基金 A 级份额。

#### 8.4 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	份额级别	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	信诚永益 A	-
	信诚永益 C	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	信诚永益 A	-
	信诚永益 C	-
	合计	-

1、期末本基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金的基金份额。

2、期末本基金的基金经理未持有本基金的基金份额。

#### 8.5 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	-	-	-	-	-
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

## §9 开放式基金份额变动

单位:份

项目	信诚永益 A	信诚永益 C
基金合同生效日(2017年1月25日)基金份额总额	2,999,999,199.92	44,420.89
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-	-
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	2,999,999,199.92	44,420.89

## § 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

1、报告期内基金管理人无重大人事变动。

2、报告期内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普华永道中天会计师事务所。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	
长城证券	1	-	-	-	-	本期新增
天风证券	2	-	-	-	-	本期新增
招商证券	1	-	-	-	-	本期新增
中泰证券	1	-	-	-	-	本期新增
中信建投	1	-	-	-	-	本期新增
中信证券	2	-	-	-	-	本期新增

注：本基金根据券商的研究实力和服务水平选择专用席位。由研究部牵头对席位候选券商的研究实力和服务质量进行评估，并综合考虑候选券商的综合实力，由研究总监和投资总监审核批准。

#### 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	
长城证券	398,384,574.54	93.02%	7,483,000,000.00	88.10%	-	-	
天风证	-	-	-	-	-	-	

券							
招商证 券	29,911,367.67	6.98%	-	-	-	-	
中泰证 券	-	-	38,000,000.00	0.45%	-	-	
中信建 投	-	-	973,000,000.00	11.46%	-	-	
中信证 券	-	-	-	-	-	-	

### 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》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2017-01-03
2	信诚基金管理有限公司关于信诚稳丰债券型证券投资基金提前结束募集的公告	同上	2017-01-20
3	信诚基金管理有限公司关于信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金提前结束募集的公告	同上	2017-01-24
4	信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金基金合同生效公告	同上	2017-01-26
5	信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金基金净值 20170126	同上	2017-01-27
6	信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金基金净值 20170203	同上	2017-02-04
7	信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金基金净值 20170210	同上	2017-02-11
8	信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金基金净值 20170217	同上	2017-02-18
9	信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金基金净值 20170224	同上	2017-02-25
10	信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金基金净值 20170303	同上	2017-03-04
11	信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金基金净值 20170310	同上	2017-03-11
12	信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金基金净值 20170317	同上	2017-03-18
13	信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金基金净值 20170324	同上	2017-03-25
14	信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金基金净值 20170331	同上	2017-04-01

15	信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金基金净值 20170407	同上	2017-04-09
16	信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金基金净值 20170414	同上	2017-04-15
17	信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金 2017 年第一季度报告	同上	2017-04-21
18	信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金基金净值 20170421	同上	2017-04-22
19	信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金基金净值 20170428	同上	2017-04-29
20	信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金 2017 年 5 月 5 日净值	同上	2017-05-06
21	信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金基金净值 20170512	同上	2017-05-13
22	信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金 2017 年 5 月 19 日净值	同上	2017-05-20
23	信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金 2017 年 5 月 26 日净值	同上	2017-05-27
24	信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金基金净值 20170602	同上	2017-06-03
25	信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金基金净值 20170609	同上	2017-06-10
26	信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金 2017 年 6 月 16 日净值	同上	2017-06-17
27	信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金基金净值 20170623	同上	2017-06-24

## § 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	1	20170124 至 20170630		2,999,999,000.00		2,999,999,000.00	100.00%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							



本基金如果出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%,则面临大额赎回的情况,可能导致:

- (1)基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对,可能会产生基金仓位调整困难,导致流动性风险;如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回,基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回,如果连续 2 个开放日以上(含本数)发生巨额赎回,基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请,对剩余投资者的赎回办理造成影响;
- (2)基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要,则可能使基金资产净值受到不利影响,影响基金的投资运作和收益水平;
- (3)因基金净值精度计算问题,或因赎回费收入归基金资产,导致基金净值出现较大波动;
- (4)基金资产规模过小,可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略;
- (5)大额赎回导致基金资产规模过小,不能满足存续的条件,基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

## 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

- 1、信诚永益一年定期开放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、信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金基金合同
- 4、信诚永益一年定期开放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](http://www.xcfunds.com)。

信诚基金管理有限公司  
2017 年 8 月 29 日