信诚四季红混合型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

2018年06月30日

基金管理人:中信保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:2018年08月28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2018年8月27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2018年1月1日起至6月30日止。

§2基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	信诚四季红混合	
场内简称	-	
基金主代码	550001	
交易代码	-	-
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2006年04月29日	
基金管理人	中信保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	1,178,493,165.95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%×新华富时全A指数收益率+32.5%×中证国债指数收益率+5%×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		中信保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	贺倩
	联系电话	021-68649788	010-66060069
	电子邮箱	haozhou@citicprufunds.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-666-0066	95599
传真		021-50120888	010-68121816

注:本基金管理人法定名称于2017年12月18日起变更为“中信保诚基金管理有限公司”。

本基金管理人已于2017年12月20日在中国证监会指定媒介以及公司网站上刊登了公司法定名称变更的公告。

2.4信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.citicprufunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

注:自2018年1月1日起,本基金选定的信息披露报纸为:上海证券报、中国证券报、证券日报

§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(2018年01月01日-2018年06月30日)
本期已实现收益	-48,455,273.70
本期利润	-172,218,760.32
加权平均基金份额本期利润	-0.1352
本期基金份额净值增长率	-13.58%
3.1.2期末数据和指标	报告期末(2018年06月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0974
期末基金资产净值	1,063,762,797.61
期末基金份额净值	0.9026

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。

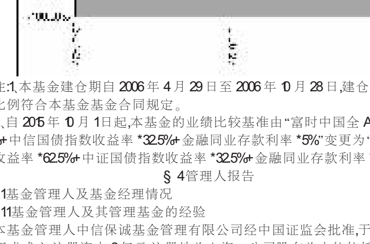
3、期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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	-3.72%	1.63%	-5.59%	0.91%	1.87%	0.72%
过去三个月	-11.26%	1.38%	-7.19%	0.73%	-4.07%	0.65%
过去六个月	-13.58%	1.43%	-8.95%	0.74%	-4.63%	0.69%
过去一年	-11.09%	1.18%	-6.66%	0.60%	-4.43%	0.58%
过去三年	-12.54%	1.73%	-21.00%	1.00%	8.46%	0.73%
自基金合同生效起至今	252.11%	1.57%	151.20%	1.14%	100.91%	0.43%

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



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

本基金管理人中信保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%。因业务发展需要,经国家工商行政管理总局核准,本基金管理人法定名称于2017年12月18日起由“信诚基金管理有限公司”变更为“中信保诚基金管理有限公司”。本基金管理人已于2017年12月20日在中国证监会指定媒介以及公司网站上刊登了公司法定名称变更的公告。

截至2018年6月30日,本基金管理人管理的运作中基金为64只,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、信诚至远灵活配置混合型证券投资基金、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、信诚中证基建工程指数型证券投资基金(LOF)、信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、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、信诚惠泽债券型证券投资基金(LOF)、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、信诚至裕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(LOF)、信诚新泽回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚新丰回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚量化阿尔法股票型证券投资基金、信诚智惠金货币市场基金、中信保诚嘉鑫定期开放债券型发起式证券投资基金、中信保诚稳鸿债券型证券投资基金、中信保诚至兴灵活配置混合型证券投资基金。

截至2018年6月30日,本基金管理人管理的处于清算期中的基金为10只,分别为信诚季季定期支付债券型证券投资基金、信诚惠报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、信诚至鑫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、信诚永鑫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、信诚永利一年定期开放混合型证券投资基金、信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、信诚至盛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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
闫志刚	本基金基金经理,信诚幸福消费混合基金、中信保诚至兴灵活配置混合基金的基金经理	2010年06月02日	-	17	工商管理硕士。曾任职于世纪证券有限责任公司,担任投行部高级经理;于平安证券有限责任公司,担任投行事业部项目经理;于平安资产管理有限责任公司,担任股票投资部投资经理。2008年7月加入中信保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(该基金由中信保诚基金担任投资顾问),信诚中小盘混合基金的基金经理。现任信诚四季红混合基金、信诚幸福消费混合基金、中信保诚至兴灵活配置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,未发现有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,市场跌宕起伏,背后的驱动逻辑从年初的全球同步复苏转变为国内加强金融监管去杠杆和中美贸易摩擦加剧引发经济回落,市场从年初的金融地产等周期性行业上涨切换到医药食品饮料等防御性板块上涨。由于金融去杠杆,市场整体呈现出资金流出的存量博弈特征,周期性行业估值连续下跌,导致以上证指数为代表的主板连续调整。由于医药和食品饮料确定的业绩增长,资金抱团现象明显,医药和食品饮料等稳定增长行业获得了明显的超额收益。在中美贸易摩擦加剧、中小微企业融资渠道不畅的情况下,市场预期经济基本面会逐渐下行,市场持续下跌,这种下跌又加大了一些企业抵押资产的压力,这进一步恶化了二级市场的供需关系,市场跌幅较大。

在这期间,组合在一季度主要配置了银行地产煤炭等周期性行业和电子、半导体等科技产业的龙头企业,但在随后的市场逻辑变化时,组合减持了银行和地产等行业的配置,但并没有减持煤炭行业,没有减持的原因是我们通过研究发现,煤炭行业在过去的几年中并没有新增产能的资本支出增加,叠加了过去两年的供给侧改革,煤炭行业的供需已经发生根本的变化,后来我们又发现用电数据屡超预期、用电结构的变化导致电力需求具备持续性,从而对煤炭的需求产生持续的拉动作用。虽然发改委通过长协价和进口等综合手段来调控煤炭价格、市场因对经济的悲观预期也不看好上游的大宗商品,但是由于认为煤炭的供需基本面已发生变化,未来可能存在缺口,所以没有减持该板块,也错过了医药和食品饮料的配置机会,对组合产生了较大的负面影响。

4.4.2报告期内的基金业绩表现

本报告期内,本基金份额净值增长率为-13.58%,同期业绩比较基准收益率为-8.95%,基金落后业绩比较基准4.63%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在内外矛盾交加的复杂环境下,国内政策已逐渐在发生变化,随着理财新规等一系列政策的出台,悲观预期可望得到修正、国内经济有望启稳,市场有望反弹,周期和成长均会迎来反弹机会。周期性行业由于其估值原先受到抑制而会有所修复,但未来经济转型的消费和科技行业应是组合未来投资的重点。本管理人以后将进一步做好组合管理工作,为本基金持有人提供更好的投资回报。

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严格控制。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。基金管理人采用专用的估值业务系统进行基金核算及账务处理,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备估值业务所需的专业胜任能力,具有基金从业人员资格。

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

2028

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中信保诚基金管理有限公司2018年1月1日至2018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,中信保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,中信保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:2018年06月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末(2018年06月30日)	上年度末(2017年12月31日)
资产:			
银行存款		98,501,286.28	149,110,417.63
结算备付金		2,802,965.66	4,675,156.37
存出保证金		594,523.82	804,392.67
交易性金融资产		968,584,686.04	1,204,416,564.13
其中:股票投资		957,613,742.49	1,201,556,415.83
基金投资		-	-
债券投资		10,970,943.55	2,860,148.30
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	99,910,269.87
应收证券清算款		-	9,034,803.38
应收利息		37,629.84	153,828.12
应收股利		-	-
应收申购款		474,228.76	145,895.33
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,070,995,320.40	1,468,251,327.50

负债和所有者权益	附注号	本期末(2018年06月30日)	上年度末(2017年12月31日)
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		2,861,261.44	-
应付赎回款		92,604.96	656,806.92
应付管理人报酬		1,351,210.38	1,836,329.72
应付托管费		225,201.73	306,054.92
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		1,186,787.23	2,433,554.72
应交税费		207,368.03	207,196.00
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		1,308,089.02	1,670,724.06
负债合计		7,232,522.79	7,110,666.34
所有者权益:			
实收基金		1,178,493,165.95	1,366,084,744.76
未分配利润		-114,730,368.34	95,055,916.40
所有者权益合计		1,063,762,797.61	1,461,140,661.16
负债和所有者权益总计		1,070,995,320.40	1,468,251,327.50

注:截止本报告期末,基金份额净值0.9026元,基金份额总额1,178,493,165.95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:2018年01月01日-2018年06月30日

单位:人民币元

项目	附注号	本期(2018年01月01日至2018年06月30日)	上年度可比期间(2017年01月01日至2017年06月30日)
一、收入		-155,808,679.38	110,968,013.29
1.利息收入		476,626.55	1,867,935.07
其中:存款利息收入		450,880.07	1,394,841.58
债券利息收入		9,028.59	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		16,717.89	473,093.49
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		-32,704,318.80	-19,085,058.59
其中:股票投资收益		-40,771,624.51	-26,932,800.33
基金投资收益		-	-
债券投资收益		227,812.25	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		7,839,493.46	7,847,741.74
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		-123,763,486.62	127,978,736.19
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		182,499.49	206,400.62
减:二、费用		16,410,080.94	19,241,547.12
1.管理人报酬		9,633,239.15	11,441,406.52
2.托管费		1,605,539.84	1,906,901.05
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		4,887,527.56	5,599,509.08
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		32.50	-
7.其他费用		283,741.89	293,730.47
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-172,218,760.32	91,726,466.17
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-172,218,760.32	91,726,466.17

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:2018年01月01日-2018年06月30日

单位:人民币元

项目	本期(2018年01月01日至2018年06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)	1,366,084,744.76	95,055,916.40	1,461,140,661.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-172,218,760.32	-172,218,760.32
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)	-187,591,578.81	-4,073,020.11	-191,664,598.92
其中:1.基金申购款	103,092,989.31	4,791,248.78	107,884,238.09
2.基金赎回款	-290,684,568.12	-8,864,268.89	-299,548,837.01
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)	-	-33,494,504.31	-33,494,504.31
五、期末所有者权益(基金净值)	1,178,493,165.95	-114,730,368.34	1,063,762,797.61

项目	上年度可比期间(2017年01月01日至2017年06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

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,由中信保诚基金管理有限公司(原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中信保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:62.5%×富时中国全A指数收益率+32.5%×中证国债指数收益率+5%×金融同业存款利率。

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

本基金以持续经营为基础。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的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《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>》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

6.4.3遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018年1月1日至2018年6月30日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2018年6月30日的财务状况以及2018年1月1日至2018年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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。

6.4.5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

本基金在本报告期未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2会计估计变更的说明

本基金在本报告期未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3差错更正的说明

本基金在本报告期未发生重大会计差错更正。

6.4.6税项

(1)主要税项说明

根据财税[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[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》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)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。

(b)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。

2018年1月1日(含)以后,资管产品管理人(以下称管理人)运营基金过程中发生的增值税应税行为,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。对基金在2018年1月1日以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。

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。

(c)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。

(d)对基金取得的股票的股息、红利收入,由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。自2018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2018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。

(e)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。

(f)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,暂不征收企业所得税。

(g)对基金在2018年1月1日(含)以后运营过程中缴纳的增值税,按照证券投资基金管理人所在地适用的城市维护建设税税率,计算缴纳城市维护建设税。

(h)对基金在2018年1月1日(含)以后运营过程中缴纳的增值税,分别按照证券投资基金管理人所在地适用的费率计算缴纳教育费附加、地方教育费附加。

6.4.7关联方关系

6.4.7.1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

6.4.7.2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
中信保诚基金管理有限公司(“中信保诚基金”)	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司(“农业银行”)	基金托管人、基金销售机构

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8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。

6.4.8.1通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.8.1.2权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.8.1.3债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.8.1.4债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.8.1.5应支付关联方的佣金

本基金在本年度与上年度均没有应支付关联方的佣金。

6.4.8.2关联方报酬

6.4.8.2.1基金管理费

单位:人民币元

项目	本期(2018年01月01日至2018年06月30日)	上年度可比期间(2017年01月01日至2017年06月30日)
当期发生的基金应支付的管理费	9,633,239.15	11,441,406.52
其中:支付销售机构的客户维护费	1,465,910.74	1,543,607.99

注:支付基金管理人中信保诚基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值1.50%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×1.50%/当年天数

6.4.8.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期(2018年01月01日至2018年06月30日)	上年度可比期间(2017年01月01日至2017年06月30日)
当期发生的基金应支付的托管费	1,605,539.84	1,906,901.05

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

6.4.8.2.3销售服务费

本基金本报告期末及上年度可比区间未发生销售服务费。

6.4.8.3与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本报告期内与上年度均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的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,本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2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(2018年06月30日) 持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	上年度末(2017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
中信保诚人寿保险有限公司	-	-	3,204,373.79	0.23%

注: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未持有本基金。

6.4.8.5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(2018年01月01日至2018年06月30日) 期末余额	当期利息收入	上年度可比期间(2017年01月01日至2017年06月30日) 期末余额	当期利息收入
农业银行	98,501,286.28	418,584.58	176,478,091.11	1,348,567.08

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2018年6月30日的相关余额为人民币2,802,965.66元(2017年6月30日余额为人民币1,054,484.09元)。

6.4.8.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期内与上年度均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

6.4.8.7其他关联交易事项的说明

6.4.9期末(2018年06月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1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

6.4.9.1.1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
603105	芯能科技	2018年06月29日	2018年07月09日	网下新股申购未上市	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	-
603706	东方环宇	2018年06月29日	2018年07月09日	网下新股申购未上市	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	
603693	江苏新能	2018年06月25日	2018年07月03日	网下新股申购未上市	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	

6.4.9.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002450	康得新	2018年06月04日	发行股份购买资产	17.08	-	-	10,000	208,737.22	170,800.00	-

注:本基金截至2018年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。截止报送基准日“康得新”未复牌。

6.4.9.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.9.3.2交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.10有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)以公允价值计量的资产和负债

下表列示了本基金在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次。公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下:

第一层次输入值:在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价;

第二层次输入值:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值;

第三层次输入值:相关资产或负债的不可观察输入值。

于2018年6月30日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层次的余额为人民币957,354,912.34元,第二层次的余额为人民币258,830.15元,无属于第三层次的余额(2017年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层次的余额为人民币1,123,300,683.06元,第二层次的余额为人民币81,115,881.07元,无属于第三层次的余额)。

(a)第二层次的公允价值计量

对于本基金投资的证券交易所上市的证券,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时,本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑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,确定相关证券公允价值的层次。

(b)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2018年6月30日,本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2017年12月31日:无)。

(2)其他金融工具的公允价值(年末非以公允价值计量的项目)

其他金融工具主要包括买入返售金融资产、应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值之间无重大差异。

(3)除以上事项外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	957,613,742.49	89.41
	其中:股票	957,613,742.49	89.41
	基金投资	-	-
2	固定收益投资	10,970,943.55	1.02
	其中:债券	10,970,943.55	1.02
	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	-	-
	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	101,304,251.94	9.46
7	其他各项资产	1,106,382.42	0.10
8	合计	1,070,995,320.40	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

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	64,857,099.90	6.10
B	采矿业	216,838,113.80	20.38
C	制造业	517,257,952.26	48.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,559.85	0.01
E	建筑业	718,000.00	0.07
F	批发和零售业	33,041,209.90	3.11
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	5,364,000.00	0.50
J	金融业	21,326,540.40	2.00
K	房地产业	44,484,800.00	4.18
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	53,573,240.24	5.04
N	水利、环境和公共设施管理业	81,226.14	0.01
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	957,613,742.49	90.02

7.2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

7.3.1期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	000651	格力电器	1,230,000	57,994,500.00	5.45
2	600196	复星医药	1,315,982	54,468,494.98	5.12
3	300124	汇川技术	1,639,950	53,823,159.00	5.06
4	300284	苏交科	6,755,768	53,573,240.24	5.04
5	600188	兖州煤业	4,100,000	53,464,000.00	5.03
6	600703	三安光电	2,749,100	52,837,702.00	4.97
7	002236	大华股份	2,330,000	52,541,500.00	4.94
8	601699	潞安环能	5,650,000	52,319,000.00	4.92
9	603986	兆易创新	392,000	42,539,840.00	4.00
10	601666	平煤股份	10,000,000	41,800,000.00	3.93

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	600519	贵州茅台	78,619,344.88	5.38
2	600340	华夏幸福	72,897,969.02	4.99
3	601155	新城控股	57,609,454.07	3.94
4	601398	工商银行	56,253,079.80	3.85
5	300124	汇川技术	55,036,541.85	3.77
6	300203	聚光科技	53,866,077.42	3.69
7	600887	伊利股份	53,771,859.75	3.68
8	300476	胜宏科技	52,173,689.94	3.57
9	603799	华友钴业	49,414,007.50	3.38
10	000725	京东方A	47,301,758.00	3.24
11	600740	山西焦化	43,702,576.00	2.99
12	600985	雷鸣科化	43,209,211.94	2.96
13	000671	阳光城	41,467,044.58	2.84
14	601678	滨化股份	41,004,645.33	2.81
15	601225	陕西煤业	40,218,477.05	2.75
16	002234	民和股份	39,378,249.95	2.70
17	600188	兖州煤业	37,937,696.50	2.60
18	002458	益生股份	37,627,998.54	2.58
19	601666	平煤股份	34,909,258.92	2.39
20	000069	华侨城A	32,008,856.24	2.19
21	601699	潞安环能	30,615,520.14	2.10
22	300037	新宙邦	29,917,906.90	2.05

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	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300070	碧水源	90,936,421.88	6.22
2	601398	工商银行	82,697,776.65	5.66
3	600519	贵州茅台	79,360,940.64	5.43
4	300476	胜宏科技	74,809,031.26	5.12
5	000858	五粮液	66,155,386.32	4.53
6	600340	华夏幸福	64,587,502.30	4.42
7	600426	华鲁恒升	56,131,588.37	3.84
8	600887	伊利股份	53,958,451.49	3.69
9	600809	山西汾酒	52,776,452.02	3.61
10	300203	聚光科技	51,687,986.43	3.54
11	002717	岭南股份	49,867,602.52	3.41
12	002236	大华股份	47,585,764.50	3.26
13	600183	生益科技	42,383,508.24	2.90
14	601678	滨化股份	39,877,052.06	2.73
15	601600	中国铝业	38,498,370.44	2.63
16	300237	美晨生态	38,470,581.80	2.63
17	000725	京东方A	37,594,367.00	2.57
18	002310	东方园林	37,108,412.52	2.54
19	000069	华侨城A	34,904,280.17	2.39
20	002573	清新环境	33,570,128.26	2.30
21	300037	新宙邦	32,875,699.42	2.25
22	300197	铁汉生态	30,737,821.66	2.10

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	1,564,145,090.09
卖出股票收入(成交)总额	1,644,481,642.17

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	10,970,943.55	1.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,970,943.55	1.03

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	128019	久立转2	67,283	6,179,943.55	0.58
2	128012	辉丰转债	60,000	4,791,000.00	0.45

7.7期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

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

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

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

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

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基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚说明

江苏辉丰农化股份有限公司(以下简称“公司”)于2017年起因存在非法处置危险废物、违规转移和贮存危险废物、长期偷排高浓度有毒有害废水以及治污设施不正常运行等多项环境违法行为,陆续收到地方环境保护部门出具的多份《行政处罚决定书》,并于2018年5月9日收到盐城市大丰区环境保护局下发的《实施停产整治的通知》,要求公司除环保车间外,其他生产车间实施停产整治;生产车间复产必须验收合格,未经同意不得擅自恢复生产。2018年4月,公司因涉嫌信息披露违法违规被中国证监会立案调查。2018年5月15日,公司董事、副总经理季自华因涉嫌污染环境罪被盐城市公安局直属分局执行逮捕。2018年6月,盐城市公安局直属分局以“单位涉嫌环境污染罪”对公司进行立案侦查。期间,中小板公司管理部及深圳证券交易所对公司上述情况予以监管关注,并进行了多次问询;深圳证券交易所因公司存在信息披露违规行为于2018年6月予以公开谴责。

对128012辉丰转债的投资决策程序说明:辉丰股份的确因为环保问题被相关部门处罚,目前其环保问题对企业经营带来的不利影响依然存在,其正股和转债均因此出现了较大幅度的下跌。根据辉丰股份在农药行业的行业地位、过往经营业绩和现金流情况,除非公司出现破产,否则公司的偿债能力应有保障。根据跟踪其环保问题的解决情况,我们认为辉丰转债存在较好的投资机会,另外,鉴于其处罚尚未完全落地、不确定性尚未完全消除,因此组合配置时考虑到该风险,配置比例较低,而且是在其转债出现了较大跌幅后买入的,该品种的配置对组合应不会产生重大影响。我们对该转债的投资经过了仔细研究和仓位控制,符合内部投资决策流程,符合法律法规和相关制度的规定。

除此之外,本基金本期投资的前十名股票及前五名债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声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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	594,523.82
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	37,629.84
5	应收申购款	474,228.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,106,382.42

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(%)
1	128019	久立转2	6,179,943.55	0.58
2	128012	辉丰转债	4,791,000.00	0.45

7.12.5报告期末股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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 持有份额	占总份额比例	个人投资者 持有份额	占总份额比例
37875	31,115.33	348,051,560.55	29.53%	830,441,605.40	70.47%

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	350,338.78	0.03%

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	-

期末本基金的基金经理未持有本基金的基金份额。

8.4发起式基金发起资金持有份额情况

无

§9开放式基金份额变动

单位:份

项目	信诚四季红混合
基金合同生效日(2006年04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	1,366,084,744.76
本报告期基金总申购份额	103,092,989.31
减:本报告期基金总赎回份额	290,684,568.12
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,178,493,165.95

§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 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
光大证券	1	1,291,979,651.11	40.30%	1,203,222.48	40.68%	-
海通证券	1	493,344,658.95	15.39%	449,585.31	15.20%	-
联合证券	1	401,370,587.95	12.52%	373,796.51	12.64%	-
国信证券	1	263,864,691.10	8.23%	240,459.21	8.13%	-
中信证券	2	256,522,756.82	8.00%	233,769.09	7.90%	-
国泰君安	1	218,053,195.08	6.80%	198,712.37	6.72%	-
中金公司	1	164,155,609.47	5.12%	149,595.15	5.06%	-
银河证券	1	116,967,750.40	3.65%	108,931.92	3.68%	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-

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 成交金额	占当期债券成交总额的比例	回购交易 成交金额	占当期回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	占当期权证成交总额的比例
光大证券	1,341,745.65	8.91%	-	-	-	-
海通证券	1,780,204.44	11.82%	-	-	-	-
联合证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	6,740,010.22	44.73%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中金公司	5,204,867.09	34.55%	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

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。

§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

11.2影响投资者决策的其他重要信息

无

中信保诚基金管理有限公司

2018年08月28日