信诚至远灵活配置混合型证券投资基金(原信诚添金分级债券型证券投资基金转型)

2017年第三季度报告

2017年9月30日
基金管理人:信诚基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2017年10月26日

§1重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年10月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

自2017年8月31日起,"信诚添金分级债券型证券投资基金"变更为"信诚至远灵活配置混合型证券投资基金"。基金类别由债券型基金转型为混合型,运作方式由原"运作周年滚动"运作方式改为常规契约型开放式,取消分级运作机制。自2017年8月31日起,(信诚至远灵活配置混合型证券投资基金基金合同)、(信诚至远灵活配置混合型证券投资基金托管协议)、(信诚至远灵活配置混合型证券投资基金招募说明书)生效,原(信诚添金分级债券型证券投资基金基金合同)、(信诚添金分级债券型证券投资基金托管协议)、(信诚添金分级债券型证券投资基金招募说明书)将自同一日起失效。原信诚添金分级债券型证券投资基金本报告期自2017年7月1日至2017年8月31日止,信诚至远灵活配置混合型证券投资基金本报告期自2017年9月1日至2017年9月30日止。

§2基金产品概况

2.1信诚至远灵活配置混合型证券投资基金

基金简称	信诚至远
场内简称	-
基金主代码	550015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年8月31日
报告期末基金份额总额	43,084,673.15份
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绝对回报。
投资策略	1.资产配置策略 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,在评估未来一段时间股票、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。 2.股票投资策略 在灵活的资产配置的基础上,本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法把握优质的上市公司,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研判,严选安全边际较高的个股。 3.债券投资策略 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、利对价策略、收益率曲线配置、回购放大策略等策略进行主动投资。 4.证券公司短期公司债券投资策略 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、投资收益记账以及债券流动性、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安全利息收益的优质短期公司债券投资组合。	信诚至远A	信诚至远C
---	---	---
1.资产配置策略	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,在评估未来一段时间股票、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。	
2.股票投资策略	在灵活的资产配置的基础上,本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法把握优质的上市公司,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研判,严选安全边际较高的个股。	
3.债券投资策略	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、利对价策略、收益率曲线配置、回购放大策略等策略进行主动投资。	
4.证券公司短期公司债券投资策略	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、投资收益记账以及债券流动性、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安全利息收益的优质短期公司债券投资组合。	
5.中小企业私募债券投资策略	在严格控制风险的前提下,综合考虑中小企业私募债券的安全性、收益性和流动性等特征,选择具有相对优势的类属和个券进行投资。同时,通过期限和品种的分散投资降低基金投资中小企业私募债券的信用风险、利率风险和流动性风险。	
6.资产支持证券投资策略	资产支持证券的定价受示场利率、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变化分析的基础上,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。	
7.股指期货投资策略	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通知预期大额申购赎回、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。	
8.国债期货投资策略	本基金将按照相关法律法规的规定,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,投资国债期货。本基金将充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征,结合对宏观经济形势和政策趋势的判断,对债券市场进行定性和定量分析,对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、流动水平等指标进行跟踪监控,在最大限度保证基金资产安全的基础上,力求实现委托财产的长期稳定增值。	
9.权证投资策略	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,运用恰当定价模型,确定权证理论价值,构建交易组合。	
10.融资投资策略	本基金在参与融资业务中将根据风险管理的原则,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与融资业务,本基金将基于对市场行情和组合风险收益的分析,确定投资时机,标的证券以及投资比例。如法律法规或监管部门对融资业务做出调整或另有规定的,本基金将以法律法规规定。	
业绩比较基准	50%×沪深300指数收益率+50%×中证综合债指数收益率。	
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。	
基金管理人	信诚基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的场内简称	-	信诚添金分级债券
下属分级基金的交易代码	550015	550016
报告期末下属分级基金的份额总额	42,960,962.83份	103,710.32份
下属分级基金的风险收益特征	-	-

2.2原信诚添金分级债券型证券投资基金

基金简称	信诚添金分级债券
场内简称	-
基金主代码	550017
基金运作方式	契约型,本基金以"运作周年滚动"的方式运作。季季添金日基金合同生效日起每3个月开放申购和赎回一次,岁岁添金日还一定作周年时间运作,仅在每个运作周年到期日开放申购和赎回一次,每次开放仅开放一个工作日。
基金合同生效日	2012年12月12日
报告期末基金份额总额	47,489,563.69
投资目标	在严格控制风险的基础上,通过主动管理,力争追求超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金按照自下而上的个股精选方法,即:首先结合宏观经济发展情况,在严格控制风险的前提下,对固期类行业与稳定类行业进行配置;在此基础上确定固期类行业与稳定类行业内各行业配置情况;最后分别对固期类行业、稳定类行业内个股进行评估,从而精选基本面良好的个股以构建获票投资组合。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*80%+中证综合债指数收益率*20%
风险收益特征	本基金属于混合型基金,预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金,属于较高风险、较高收益的品种。
基金管理人	信诚基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

§3主要财务指标和基金净值表现

3.1主要财务指标

信诚至远灵活配置混合型证券投资基金

单位:人民币元

主要财务指标	信诚至远A报告期(2017年9月1日至2017年9月30日)	信诚至远C报告期(2017年9月1日至2017年9月30日)
1.本期已实现收益	-282,439.16	58.83
2.本期利润	726,083.75	1,228.74
3.加权平均基金份额本期利润	0.0164	0.0514
4.期末基金资产净值	43,678,854.41	106,934.65
5.期末基金份额净值	1.0167	1.0311

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。

3.1主要财务指标

原信诚添金分级债券型证券投资基金

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2017年7月1日至2017年8月31日)
1.本期已实现收益	1,442,178.16
2.本期利润	553,538.73
3.加权平均基金份额本期利润	0.0079
4.期末基金资产净值	45,841,287.99
5.期末基金份额净值	0.965

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。

3.2基金净值表现

信诚至远灵活配置混合型证券投资基金

3.2.1本报告期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

信诚至远A

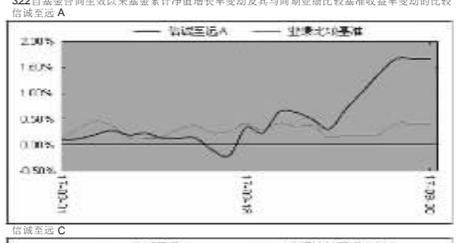
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自转型之日起至今(2017年9月1日-2017年9月30日)	1.67%	0.21%	0.41%	0.13%	1.26%	0.08%

信诚至远C

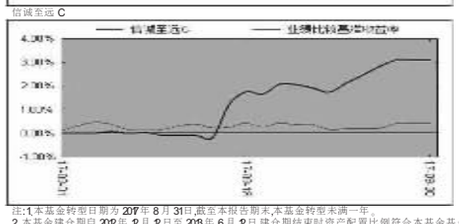
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自转型之日起至今(2017年9月1日-2017年9月30日)	3.11%	0.35%	0.41%	0.13%	2.70%	0.22%

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

信诚至远A



信诚至远C



注:1.本基金转型日期为2017年8月31日,截至本报告期末,本基金转型未满一年。

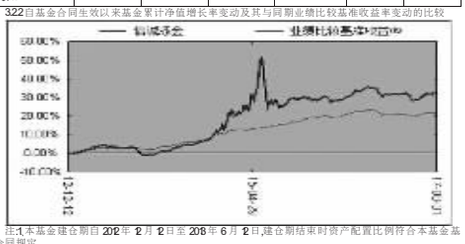
2.本基金建仓期自2012年2月12日至2012年6月12日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

3.自2017年9月1日起,本基金的业绩比较基准由"中证综合债指数收益率"变更为"50%×沪深300指数收益率+50%×中证综合债指数收益率"。

3.2.3自基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	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
2017年7月1日-2017年8月31日	1.90%	0.21%	0.20%	0.03%	1.70%	0.18%

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2012年2月12日至2012年6月12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"沪深300指数收益率*80%+中信标普金债指数收益率*20%"变更为"沪深300指数收益率*80%+中证综合债指数收益率*20%"。

3.3其他指标

§4管理人报告

4.1基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王国强	本基金基金经理,信诚周期回报混合基金基金经理,信诚优质纯债债券基金、信诚优质纯债债券基金、信诚新兴产业股票基金、信诚惠利债券型基金、信诚增利债券型基金、信诚增利2年定期开放债券基金、信诚惠利债券型基金、信诚周期回报混合基金基金经理	2012年12月12日	-	18	管理学硕士。曾先后任职于浙江国际信托投资公司、健桥证券投资有限公司和信诚资金管理有限公司。2006年加盟信诚基金管理有限公司,现任固定收益总监。信诚周期回报混合基金基金经理自2012年12月12日起担任,信诚惠利债券基金、信诚优质纯债债券基金、信诚增利2年定期开放债券基金、信诚惠利债券型基金、信诚增利28日债券型基金的基金经理。

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《信诚至远灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》、《信诚至远灵活配置混合型证券投资基金托管协议》、《信诚至远灵活配置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公平交易专项说明

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《信诚至远灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》、《信诚至远灵活配置混合型证券投资基金托管协议》、《信诚至远灵活配置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。

4.3.2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报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度上证指数上涨4.9%,上证50指数上涨4.8%,创业板指数也上涨2.7%,各大指数都呈现小幅上涨状态。

三季度表现较好的板块有食品饮料,有色,通信,电子等板块。表现较差的板块主要有纺织服装,电力,传媒和建筑等。

年初以来表现较好的板块有食品饮料,家电,煤炭,有色,电子等。而表现较差的有纺织服装,传媒和农林牧渔。

展望后市,我们认为股市仍将呈现慢牛状态,在经历了两年多的调整之后有一定的机会。虽然从整个交易(完全复制的指数基金除外)。

4.4报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度经济增长平稳,投资增速回落,消费平稳、出口增长较快,企业盈利增长维持较高水平。消费物价维持低位,CPI表数仍然维持在较低水平,其中的服务类项目将拖动未来物价温和上涨。央行货币政策继续维持稳健中性货币政策,货币供给维持紧平衡,三季度货币市场利率维持较高水平,主要市场基准利率3M Shibor维持利率4.4%左右、R007和FR007年期利率维持在3.5%左右。金融监管政策稳步推进落实,随着了公募基金流动性新规,限制了货币基金与投管账户的资金融通便利,推动货币资金利率进一步上升。三季度债券利率维持高位,10年国债、金融债分别维持在3.6%和4.3%左右。3年AA+信用债维持在4.8%左右,信用利差处于历史较低水平。三季度债市收益回报率较低,中证综合债指数上涨0.6%。

三季度,本基金持仓以中短久期信用债为主,组合杠杆维持较低水平。特别注重信用风险管理,通过严格的内部信用评级体系,甄别信用风险,规避负债率高、经营性现金流持续为负和经营亏损的公司发行的债券。

9月份本基金从封闭式债券型基金转型成为配置型基金,本基金未来定位为偏债型混合基金,股票仓位控制30%以内,未来将坚持绝对收益策略,注重止盈和止损,控制回撤风险,力图为持有人获取较高的稳定回报。本基金采取精选股票、重点配置的策略,以合理的估值水平购买优质的股票,重点配置行业地位较高,发展空间较大,盈利增长确定,经营管理优良的优质公司。

4.5报告期内基金的业绩表现

本报告期内,原信诚添金分级本债券型证券投资基金(2017年7月1至2017年8月31日)份额净值增长率为190%,同期业绩比较基准收益率为0.22%,基金超越业绩比较基准170%。信诚至远灵活配置混合型证券投资基金(2017年9月1至2017年9月30日)A类份额净值增长率分别为167%和3.11%,同期业绩比较基准收益率为0.41%,基金A类份额分别超越业绩比较基准126%和2.70%。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金自2017年8月31日起至2017年9月29日止基金资产净值低于五千万元。

5投资组合报告

信诚至远灵活配置混合型证券投资基金

报告期2017年9月1日至2017年9月30日

5.1报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	12,428,710.00	24.71
	其中:股票	12,428,710.00	24.71
2	固定收益投资	24,254,423.10	48.22
	其中:债券	24,254,423.10	48.22
	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	5,000,000.00	9.94
	其中:买断式逆回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	8,046,259.03	16.00
7	其他资产	571,308.14	1.14
8	合计	50,300,700.27	100.00

5.2报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	10,415,750.00	23.79
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	1,958,800.00	4.47
J	金融业	54,160.00	0.12
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	12,428,710.00	28.36

5.2.2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。

5.3报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600703	三安光电	90,000	2,082,600.00	4.76
2	002594	比亚迪	25,000	1,707,500.00	3.90
3	600066	宇通客车	60,000	1,476,000.00	3.37
4	002008	大族激光	30,000	1,308,000.00	2.99
5	300296	利亚德	50,000	1,007,500.00	2.30
6	002624	完美世界	30,000	982,800.00	2.24
7	300182	捷成股份	100,000	976,000.00	2.23
8	002001	新和成	30,000	767,100.00	1.75
9	600487	亨通光电	20,000	688,000.00	1.57
10	002271	东方雨虹	15,000	578,550.00	1.32

5.4报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	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	17,954,023.10	41.00
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	6,300,400.00	14.39
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	24,254,423.10	55.39

5.5报告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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	124079	PR保园资	67,520	4,126,147.20	9.42
2	132009	17中油EB	40,000	4,072,000.00	9.30
3	122629	PR平安债	79,190	3,258,668.50	7.44
4	122533	PR平城投	70,000	2,877,000.00	6.57
5	124142	PR金三峡	50,000	2,522,500.00	5.76

5.6报告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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7报告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

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8报告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

本基金本报告期末未持有权证。

5.9报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1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。

5.9.2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。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1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。

5.10.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

5.10.3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。

5.11投资组合报告附注

5.11.1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。

5.11.2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。

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	21,357.48
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	549,252.27
5	应收申购款	686.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	571,308.14

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113011	光大转债	2,228,400.00	5.09

5.11.5报告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的情况。

5.11.6报告期末前十大股票中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§6开放式基金份额变动

信诚至远灵活配置混合型证券投资基金

单位:份

项目	信诚至远A	信诚至远C
报告期期初基金份额总额	45,841,287.99	0.00
报告期期间基金总申购份额	3,560.01	105,710.02
减:报告期期间基金总赎回份额	2,883,885.17	1,999.70
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	0.00	0.00
报告期期末基金份额总额	42,960,962.83	103,710.32

注:根据(信诚添金分级债券型证券投资基金基金合同)、(信诚添金分级债券型证券投资基金招募说明书)、(信诚添金分级债券型证券投资基金名称变更及实施转型的提示性公告)及中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定,本基金于2017年08月31日(份额转换基准日)实施转型,2017年08月31日日终,基金管理人将投资者未赎回的季季添金和岁岁添金基金份额统一变更登记为信诚至远灵活配置混合型证券投资基金A类的基金份额,详情见信诚基金官网2017年9月2日发布的(信诚添金分级债券型证券投资基金基金份额转换结果暨信诚至远灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效公告)。

原信诚添金分级债券型证券投资基金

单位:份

项目	信诚季季添金	信诚岁岁添金
报告期期初基金份额总额	27,737,369.55	49,150,463.69
报告期期间基金总申购份额	-	-
减:报告期期间基金总赎回份额	2,679,092.30	26,719,177.25
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	25,058,277.25	22,431,286.44

注:根据(信诚添金分级债券型证券投资基金基金合同)、(信诚添金分级债券型证券投资基金招募说明书)、(信诚添金分级债券型证券投资基金名称变更及实施转型的提示性公告)及中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定,本基金于2017年08月31日(份额转换基准日)实施转型,2017年08月31日日终,基金管理人将投资者未赎回的季季添金和岁岁添金基金份额统一变更登记为信诚至远灵活配置混合型证券投资基金A类的基金份额,详情见信诚基金官网2017年9月2日发布的(信诚添金分级债券型证券投资基金基金份额转换结果暨信诚至远灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效公告)。

§7报告管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

项目	信诚至远A	信诚至远C
报告期期初管理人持有的本基金份额	-	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	-	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	-	-

7.2基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金

§8报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

无

§9影响投资者决策的其他重要信息

9.1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	20170701至20170930	20,266,642.10	18,799,145.77	20,266,642.10	18,799,145.77	43.65%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品持有风险							

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)基金日常时间内无法实现足额申购的资产于以应对,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比例赎回,基金管理人可能根据《基金合同》的约定启动巨额赎回,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)基金管理人被动触发暂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)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启动合同终止清算,转型等风险。

9.2影响投资决策的其他重要信息

本基金于2017年8月3日发布了(信诚基金管理有限公司关于信诚添金分级债券型证券投资基金基金份额持有人大会重新表决结果暨决议生效的公告)和(信诚添金分级债券型证券投资基金集中赎回选择期及季季添金份额、岁岁添金份额开放赎回及转换转出业务的公告)。

本基金于2017年8月2日上午10:30以现场方式二次召开信诚添金分级债券型证券投资基金基金份额持有人大会,审议(关于信诚添金分级债券型证券投资基金基金份额转型有关事项的议案)。

根据(公开募集证券投资基金运作管理办法)的规定,基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。本次重新表决于2017年8月2日表决通过了(关于信诚添金分级债券型证券投资基金转型有关事项的议案),基金份额持有人大会的决议自该日起生效。基金管理人将于表决通过之日起5日内报中国证监会备案。基金管理人根据基金份额持有人大会的授权,将以2017年8月31日为本基金的份额结转基准日2017年8月31日正式实施基金转型。

自2017年8月31日起,本基金的基金名称由"信诚添金分级债券型证券投资基金"变更为"信诚至远灵活配置混合型证券投资基金",基金类别由债券型基金转型为混合型,运作方式由原"运作周年滚动"运作方式改为常规契约型开放式,取消分级运作机制。自2017年8月31日起(信诚至远灵活配置混合型证券投资基金基金合同)、(信诚至远灵活配置混合型证券投资基金托管协议)、(信诚至远灵活配置混合型证券投资基金招募说明书)生效,原(信诚添金分级债券型证券投资基金基金合同)、(信诚添金分级债券型证券投资基金托管协议)、(信诚添金分级债券型证券投资基金招募说明书)将自同一日起失效。

§10备查文件目录

10.1备查文件目录

1.(1)信诚添金分级债券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.(1)信诚添金分级债券型证券投资基金基金合同
4.(1)信诚添金分级债券型证券投资基金托管协议书
5.信诚至远灵活配置混合型证券投资基金基金合同
6.信诚至远灵活配置混合型证券投资基金招募说明书
7.本报告期内按照规定披露的各项公告

10.2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

10.3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10月26日

信诚周期轮动混合型证券投资基金(LOF)

2017年第三季度报告

2017年9月30日
基金管理人:信诚基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2017年10月26日

§1重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年10月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年7月1日起至9月30日止。

§2基金产品概况

基金简称	信诚周期轮动混合
场内简称	信诚周期
基金主代码	165516
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年5月7日
报告期末基金份额总额	366,879,690.64份
投资目标	在深入分析经济发展规律的基础上,本基金根据行业与宏观经济的联动特点,动态调整行业及个股配置比例,在严格控制风险并保证流动性的前提下,力求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金采取行业指导下的个股精选方法,即:首先结合宏观经济发展情况,在严格控制风险的前提下,对固期类行业与稳定类行业进行配置;在此基础上确定固期类行业与稳定类行业内各行业配置情况;最后分别对固期类行业、稳定类行业内个股进行评估,从而精选基本面良好的个股以构建获票投资组合。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*80%+中证综合债指数收益率*20%
风险收益特征	本基金属于混合型基金,预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金,属于较高风险、较高收益的品种。
基金管理人	信诚基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

§3主要财务指标和基金净值表现

3.1主要财务指标

主要财务指标	报告期(2017年9月1日至2017年9月30日)
1.本期已实现收益	3,377,384.88
2.本期利润	20,686,932.77
3.加权平均基金份额本期利润	0.1328
4.期末基金资产净值	761,844,094.31
5.期末基金份额净值	2.077

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