信诚四季红混合型证券投资基金

2011 年度报告摘要

2011年12月31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：2012年3月27日

§1 重要提示

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2011年3月23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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自2011年1月1日起至12月31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	
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	4,412,234,643.13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%×富时中国全A指数收益率+32.5%×中信国债指数收益率+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		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	唐世春	李芳菲
	联系电话	021-68649788	010-63201510
	电子邮箱	shichun.tang@citicpru.com.cn	Lifangfei@abchina.com
客户服务电话		400-666-0066/021-51085168	95599
传真		021-501208888	010-63201816

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.citicprufunds.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所和营业场所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2011年	2010年	2009年
本期已实现收益	-747,644,291.57	1,246,553,644.04	1,418,058,652.45
本期利润	-1,620,599,581.06	720,978,647.08	2,346,134,029.52
加权平均基金份额本期利润	-0.3578	0.1382	0.3736
本期基金份额净值增长率	-33.16%	14.45%	61.03%
3.1.2 期末数据和指标	2011年末	2010年末	2009年末
期末可供分配基金份额利润	-0.2740	0.0726	-0.1828
期末基金资产净值	3,203,100,600.35	5,499,414,064.98	6,110,468,824.04
期末基金份额净值	0.7260	1.1373	0.9937

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。

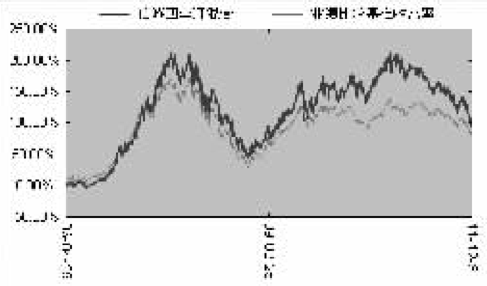
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	-12.22%	1.26%	-6.79%	0.92%	-5.43%	0.34%
过去六个月	-22.08%	1.15%	-15.64%	0.89%	-6.44%	0.26%
过去一年	-33.16%	1.06%	-17.35%	0.84%	-15.81%	0.22%
过去三年	23.18%	1.41%	28.25%	1.05%	-5.07%	0.36%
过去五年	48.35%	1.61%	31.34%	1.35%	17.01%	0.26%
自基金合同生效起至今	99.25%	1.55%	84.09%	1.31%	15.16%	0.24%

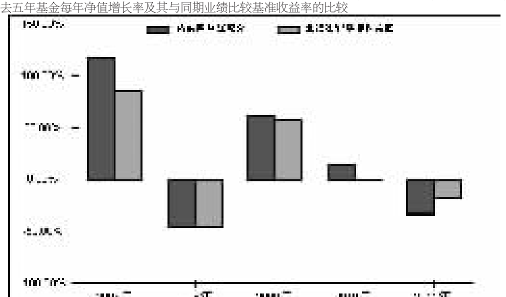
注：本基金的业绩比较基准为62.5%×富时中国全A指数收益率+32.5%×中信国债指数收益率+5%×金融同业存款利率

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

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	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	年度利润分配合计	备注
2011	0.510	158,024,525.07	88,229,384.88	246,253,909.95	本基金本期分红两次。
2010	-	-	-	-	本基金本期未分红。
2009	-	-	-	-	本基金本期未分红。
合计	0.510	158,024,525.07	88,229,384.88	246,253,909.95	本基金最近三年共利润分配两次

§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2011年底，本基金管理人共管理14只基金，分别为信诚四季红混合型证券投资基金、信诚精萃成长股票型证券投资基金、信诚盛世蓝筹股票型证券投资基金、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、信诚优胜精选股票型证券投资基金、信诚中小盘股票型证券投资基金、信诚深度价值股票型证券投资基金（LOF）、信诚增强收益债券型证券投资基金、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、信诚新机遇股票型证券投资基金（LOF）和信诚全球商品主题证券投资基金（LOF）。

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、信诚中小盘股票的基金经理	2010年5月25日	-	10	清华大学MBA，历任世纪证券有限责任公司投行部高级经理、平安证券有限责任公司投行事业部项目经理、平安资产管理有限责任公司股票投资部投资经理。于2008年7月加盟信诚基金投资管理部，2009年7月14日起至12月31日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），2010年2月10日起至今担任信诚中小盘股票型证券投资基金的基金经理。

注：1、任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日；若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业年限的计算标准遵从行业协会《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

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基金合同和招募说明书的约定，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

针对中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司采取了一系列行动来落实指导意见中的各项要求。明确了各部门在公平交易执行中的具体责任，在日常交易中，严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的有关规定对本基金的日常交易行为进行监控。对于交易所公开竞价交易，在恒生交易系统中执行公平交易程序，确保不同基金在买卖同一证券时，按照时间优先，比例分配的原则在各基金间公平分配交易量。对于场外交易，通过业务流程的人为控制执行公平交易程序。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金管理人旗下无与本基金投资风格相似的其他投资组合。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内无异常交易行为。

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

对于四季红基金来说，2011年是一个在国内外政治经济环境剧烈变化、甚至动荡的情况下如何去判断和投资的一年，是本基金投资管理人屡犯错误的一年，也是一个关于如何投资成长股的理念逐渐成熟的一年。对于2011年宏观紧缩的持续性的认识不够充分和对成长股的估值和成长的过于乐观是2011年本基金落后很多的主要原因，再加上操作上的一些错误，导致本基金的持有人产生了较大的损失，希望在以后的管理中能够不断完善，争取为持有人获得较好的回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

信诚四季红在2011年的份额净值增长率为-33.16%，业绩比较基准收益率-17.35%，基金表现落后基准15.81个百分点。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2012年，会有这样几个方面的因素困扰着投资者：一是中国经济结构转型的长期性和艰巨性以及中国经济增长放缓和新股发行制度改革下的上市公司的业绩变化和估值中枢的界定，二是人民币升值趋缓甚至阶段性贬值下对我国货币政策和流动性的影响，三是外围经济政治环境变化对国内货币政策和财政政策的影响。对于我们来说，在存在诸多不确定的2012年，我认为还应该在坚守价值的基础上投资那些未来精准中国成长的行业。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2011年度内，公司依据相关法律法规的规定及公司内部监察稽核制度，在督察长的指导和监察稽核部的努力下，开展了一系列监察稽核工作，取得了较好的成效。现将全年的监察稽核工作总结如下：

1、针对上海证监局现场检查的反馈意见进行整改

公司于2011年2月15日收到上海证监局下发的《关于信诚基金管理有限公司现场检查的反馈意见函》。公司对《反馈意见函》中提出的问题及工作要求高度重视，迅速按照相关要求制定整改计划并开展整改工作。为保证整改工作的持续性，公司已将检查发现问题作为关注点列入《监察稽核项目表》，在每季度的常规检查中均会重点关注落实情况或执行情况。截至2011年二季度末各项检查发现问题都已整改完毕。

2、对公司管理制度体系不断修订和完善

监察稽核部负责对公司制定的规章制度进行审核和修订。2011年度，公司修订和发布的主要制度包括《总经理办公会议事规则》、《投资咨询业务管理制度》、《银行间债券市场交易对手管理办法》、《固有资金投资基金操作手册》、《营销活动管理制度》、《员工报销制度》、《反洗钱内部控制制度》、《基金备选库管理制度》、《直销业务流程手册》、《估值决策委员会议事规则》、《债券投资管理制度》、《债券分销工作流程》、《新股IPO询价申购业务流程》、《境外基金投资备选库管理制度》、《离任审计和离任审查管理制度》、《估值决策委员会议事规则》、《新股IPO询价申购工作流程》等，并对公司的所有基本管理制度进行了一轮梳理。这些制度的修订和完善对确保公司各项业务顺利、规范地进行起到了很好的促进作用。

3、开展日常的投资合规监控工作

在投资合规监控方面，公司严格遵照法律法规和公司制度对公司和基金运作的合规情况进行监控。在基金日常投资运作过程中，监察稽核部和风险管理部对基金投资进行了事前、事中和事后的全方位监控，发现问题及时与相关部门沟通。开展的主要工作包括：

（1）基金投资的各项阀值设置和修改都必须通过监察稽核部的事先审核。

（2）风险管理部对基金的投资进行日常监控，每日填写监控日志，对违反法律法规或内部制度规定的行为予以记录并督促整改。定期监测在各个交易席位上的交易量，防止过于集中。

（3）监察稽核部定期检查基金经理在出差时的书面授权、新股申购流程等，定期抽查投资决策是否有研究报告的支持以及股票库的建立和维护是否符合公司有关制度。

（4）对新上岗的投资交易人员在上岗前进行一对一的合规培训，强化投资交易人员对合规要求的理解，提高投资交易人员的合规意识。

4、对各类法律文件和基金营销材料进行合规审核

材料审核包括各类法定信息披露文件、新产品申报材料、基金宣传推介材料、各类新闻通稿、媒体采访稿、各类合同协议等，确保各项材料的合法合规性。对于基金募集和持续营销的宣传推介材料，均经公司督察长检查，出具合规意见书，经副总经理复核并出具复核意见，按要求向监管部门报备。

5、积极开展各类合规培训

监察稽核部及时将新颁布的法律法规传递给各相关业务部门，并对具体的执行和合规要求进行提示。在日常工作中通过多种形式加强对员工职业操守的教育和监督，并开展法规培训。本年度，监察稽核部根据监管部门的要求，结合自身实际情况，主要采取课堂讲授的方式为员工提供多种形式的培训。各类合规培训主要包括：

（1）全部新进公司员工在到岗内一定时间内进行合规培训；

（2）对投资管理人员（基金经理、咨询业务投资经理、交易总监等）进行上岗前的专项合规培训；

（3）对公司全体员工进行年度的合规培训。

6、对员工个人证券投资行为进行合规监控

监察稽核部按照《员工个人证券投资及股权投资管理办法》严格要求公司员工对每季度个人证券投资情况进行申报，并定期对相关申报情况进行统计、管理和检查。

7、开展各类内部审计工作

（1）常规审计工作

监察稽核部严格按照证监会对基金公司季度监察稽核工作的要求进行了4次季度常规审计，完成监察稽核季度报告并及时报送监管部门；内容涵盖了公司治理、投资管理、营销与销售、后台营运管理、人力资源和反洗钱等方面，涉及170余个业务风险点。每次常规审计均对上季度发现问题的整改情况进行追踪，确保问题整改的及时性。

（2）专项审计工作

监察稽核部在2011年度共计开展专项审计9项，包括4次新基金募集审计工作、1次针对基金经理离任进行的离任审查、4次针对性质较为重要或核心业务领域的专项审计工作。

其中，4次新基金募集审计工作具体包括信诚中证500指数分级证券投资基金募集审计、信诚货币市场证券投资基金募集审计、信诚新机遇股票型证券投资基金（LOF）募集审计以及信诚全球商品主题证券投资基金（LOF）募集审计；1次基金经理离任审查为信诚盛世蓝筹股票型证券投资基金和信诚深度价值股票型证券投资基金基金经理张锋离任审查；4次针对性质较为重要或核心业务领域的专项审计工作具体包括采购业务开展情况专项审计、境外证券市场基金业务开展情况专项审计、营销费用专项审计、反洗钱年度专项审计

在上述9项专项审计工作中，共发现23项审计问题并提出了相应的整改建议；截至本报告日，其中16项审计问题已整改完毕，其他7项按照审计报告的要求正在整改过程中。

8、信息披露与文件报备

监察稽核部严格按照《证券投资基金信息披露管理办法》、《信息披露内容与格式准则》、《信息披露编报规则》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》，的要求进行信息披露和公告，包括基金发行时的法律文件、基金季度报告、半年度报告、年度报告、分红公告以及在深圳证券交易所进行LOF基金生效、开放申赎、上市交易及定期报告等内容的公告，并报监管机关备案。2011年，我们认真按照证监会部署进行XBRL文档的测试和报送，同时做好其他文件的书面报备和网上报备。

9、牵头开展反洗钱的各项工作

（1）按时进行反洗钱工作，并按照相关规定将可疑记录及时上报反洗钱监测中心。在本年度触发可疑交易报警的165笔交易中，109笔是因为长期持有后的赎回，我们判断为正常交易不予上报；1笔遗产继承导致的非交易过户，资料齐全，排除洗钱嫌疑不予上报；6笔是直销机构客户，经向直销人员了解，排除洗钱嫌疑不予上报；全年累计上报可疑交易49笔，其中机构可疑交易报告3笔，个人可疑交易报告46笔；

（2）主动提醒身份信息缺失或已过有效期的客户，进行身份信息的填补、更新；

（3）通过各种形式进行了反洗钱宣传活动，开展多种形式的反洗钱培训。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

基金估值程序

1、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：首席运营官（会议主席）、副首席运营官、风险控制总监/专员、数量研究员、交易总监、运营总监、基金会计主管。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。

2、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。

3、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。

4、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。

基金管理人估值业务的职责分工

1、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。

2、基金份额净值公告需经处理估值的操作人员、复核估值的复核人员和基金运营总监三人确认后，方可对外发布。

基金管理人估值人员的专业胜任能力和相关工作经历

1、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。

2、本基金管理人的估值人员平均拥有6年金融从业经验和3年基金管理公司的基金从业和基金估值经验。

基金经理参与或决定估值的程度

1、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。

2、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。

参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

1、参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

1、本基金未与任何第三方签订定价服务协议。

4.8 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）。

本基金的收益分配情况如下：

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	利润分配合计
1	2011-01-04	2011-01-04	0.500	155,257,372.08	86,479,232.60	241,736,604.68
2	2011-04-01	2011-04-01	0.010	2,767,152.99	1,750,152.28	4,517,305.27
合计			0.510	158,024,525.07	88,229,384.88	246,253,909.95

本基金的收益分配情况符合本基金的利润分配机制。

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。

§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

在托管信诚四季红混合型证券投资基金的过程中，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《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托管协议》的约定，对信诚四季红混合型证券投资基金管理人-信诚基金管理有限公司2011年1月1日至2011年12月31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信诚四季红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四季红混合型证券投资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 审计报告

毕马威华振会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告，投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 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：2011年12月31日

单位：人民币元

资产	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
资产：		
银行存款	384,595,695.93	638,080,159.16
结算备付金	5,391,805.10	13,017,782.89
存出保证金	4,262,473.25	2,837,856.87
交易性金融资产	2,416,140,276.17	4,726,177,166.95
其中：股票投资	2,416,140,276.17	4,726,177,166.95
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	377,500,806.25	200,000,620.00
应收证券清算款	25,044,858.69	-
应收利息	259,703.04	437,262.96
应收股利	-	-
应收申购款	37,711.20	1,047,573.72
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	3,213,233,329.63	5,581,598,422.55
负债和所有者权益	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010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	-	64,792,994.66
应付赎回款	103,505.48	1,091,456.46
应付管理人报酬	4,360,080.37	6,407,106.34
应付托管费	726,680.06	1,067,851.08
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,775,022.99	6,746,498.84
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	1,960,244.38	1,871,254.19
负债合计	10,132,729.28	82,184,357.57
所有者权益：		
实收基金	4,412,234,643.13	4,835,476,483.70
未分配利润	-1,209,134,042.78	663,937,581.28
所有者权益合计	3,203,100,600.35	5,499,414,064.98
负债和所有者权益总计	3,213,233,329.63	5,581,598,422.55

注：报告截止日2011年12月31日，基金份额净值0.7260元，基金份额总额4,412,234,643.13份。

7.2 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：2011年1月1日至2011年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
一、收入	-1,509,402,481.09	853,103,881.77
1.利息收入	11,967,670.40	7,578,850.67
其中：存款利息收入	5,903,294.00	7,334,686.35
债券利息收入	523,371.28	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	5,541,005.12	244,164.32
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-648,750,056.35	1,369,181,679.97
其中：股票投资收益	-675,470,144.71	1,347,069,410.06
基金投资收益	-	-
债券投资收益	272,816.80	-
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	26,447,271.56	22,112,269.91
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-872,955,289.49	-525,574,996.96
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	335,194.35	1,918,348.09
减：二、费用	111,197,099.97	132,125,234.69
1.管理人报酬	63,790,908.49	79,581,989.70
2.托管费	10,631,818.15	13,263,664.97
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	36,294,453.15	38,814,771.46
5.利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	479,920.18	464,808.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-1,620,599,581.06	720,978,647.08
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-1,620,599,581.06	720,978,647.08

7.3 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：2011年1月1日至2011年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31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）	4,835,476,483.70	663,937,581.28	5,499,414,064.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,620,599,581.06	-1,620,599,581.06
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）	-423,241,840.57	-6,218,133.05	-429,459,973.62
其中：1.基金申购款	260,795,060.21	-2,761,432.42	258,033,627.79
2.基金赎回款	-684,036,900.78	-3,456,700.63	-687,493,601.41
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）	-	-246,253,909.95	-246,253,909.95
五、期末所有者权益（基金净值）	4,412,234,643.13	-1,209,134,042.78	3,203,100,600.35
项目	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31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）	6,148,955,644.82	-38,486,820.78	6,110,468,824.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	720,978,647.08	720,978,647.08
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）	-1,313,479,161.12	-18,554,245.02	-1,332,033,406.14
其中：1.基金申购款	1,989,680,205.82	201,026,917.02	2,190,707,122.84
2.基金赎回款	-3,303,159,366.94	-219,581,162.04	-3,522,740,528.98
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）	4,835,476,483.70	663,937,581.28	5,499,414,064.98

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

王俊锋　　桂思毅　　詹朋
基金管理公司负责人　　主管会计工作负责人　　会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 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：62.5%×富时中国全A指数收益率+32.5%×中信国债指数收益率+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。

7.4.2 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（2006）、中国证券业协会2007年颁布的《证券投资基金会计核算指引》、《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如财务报表附注7.4.4所列示的基金行业实务操作的规定编制年度财务报表。

7.4.3 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”）于2006年2月15日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）的要求，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财务报表附注7.4.2所列示的其他有关规定的要求。

7.4.4 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。

7.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期未发生重大会计差错。

7.4.6 税项

根据财税字[1998]55号文、[2001]61号文《关于证券投资基金税收问题的通知》、财税字[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》、财税字[2005]11号文《关于调整证券（股票）交易印花税税率的通知》、财税[2005]102号文《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、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》、财税[2005]107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2007]84号文《财政部国家税务总局关于调整证券（股票）交易印花税税率的通知》、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》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：

（1）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。

（2）基金买卖股票、债券的投资收益暂免征收营业税和企业所得税。

（3）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。

（4）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2005年6月13日起，对个人投资者从上市公司取得的股票的股息、红利收入暂减按50%计算个人所得税。

（5）自2005年1月24日起，基金买卖A股、B股股权所书立的股权转让书据按照0.1%的税率征收证券（股票）交易印花税。自2007年5月30日起，该税率上调至0.3%。自2008年4月24日起，根据上海证券交易所与深圳证券交易所的相关规定，调整证券（股票）交易印花税税率，由0.3%降至0.1%。自2008年9月19日起，根据上海证券交易所与深圳证券交易所的相关规定，证券交易印花税改为单边征收，即仅对卖出A股、B股股权按0.1%的税率征收。

6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。

7.4.7 关联方关系

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
中信信托有限责任公司	基金管理人的中方股东
英国保诚集团股份有限公司	基金管理人的外方股东
中新苏州工业园区创业投资有限公司	基金管理人的中方股东
信诚人寿保险有限公司	基金管理人主要股东控制的机构

7.4.8 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。

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金在本年度及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过交易。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	63,790,908.49	79,581,989.70
其中：支付销售机构的客户维护费	9,841,950.65	13,266,160.38

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。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	10,631,818.15	13,263,664.97

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。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金在本年度与上年度可比期间均未与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
基金合同生效日（2006年4月29日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	4,759,694.34	4,759,694.34
期间申购/买入总份额	220,282.01	-
期间因拆分变动的份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	4,979,976.35	4,759,694.34
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.11%	0.10%

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。

7.4.8.4.2 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 2011年12月31日		上年度末 2010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	65,370,101.68	1.48%	62,478,550.39	1.29%

注：1、除上表所示外，本基金除基金管理人之外的其它关联方在本年末与上年末均未持有本基金。

2、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。

7.4.8.5 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 2011年1月1日至2011年12月31日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	384,595,695.93	5,749,221.21	638,080,159.16	7,158,443.47

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2011年12月31日的相关余额为人民币5,391,805.10元。（2010年：13,017,782.89元）。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本年度与上年度可比期间，在承销期内均未购入过由关联方承销的证券。

7.4.9 期末（2011年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

于2011年12月31日，本基金未持有因认购新发/增发而于期末流通受限证券。

7.4.9.2 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
002051	中工国际	2011-12-08	重大资产重组事项	27.97	2012-03-19	30.00	1,582,245	42,923,518.28	44,255,392.65	-

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

于2011年12月31日，本基金未持有因正回购交易而作为抵押的债券。

§8 投资组合报告

8.1 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	2,416,140,276.17	75.19
	其中：股票	2,416,140,276.17	75.19
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	377,500,806.25	11.75
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	377,500,806.25	11.75
5	银行存款和结算备付金合计	389,987,501.03	12.14
6	其他各项资产	29,604,746.18	0.92
7	合计	3,213,233,329.63	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

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	40,759,229.28	1.27
B	采掘业	-	-
C	制造业	1,488,440,716.83	46.47
C0	食品、饮料	374,537,691.10	11.69
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	34,568,490.24	1.08
C5	电子	41,158,269.03	1.28
C6	金属、非金属	118,535,980.66	3.70
C7	机械、设备、仪表	437,961,960.53	13.67
C8	医药、生物制品	481,678,325.27	15.04
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	150,546,220.28	4.70
F	交通运输、仓储业	14,920,000.00	0.47
G	信息技术业	279,583,199.41	8.73
H	批发和零售贸易	54,669,319.02	1.71
I	金融、保险业	22,220,500.16	0.69
J	房地产业	121,610,330.41	3.80
K	社会服务业	212,332,489.06	6.63
L	传播与文化产业	31,058,271.72	0.97
M	综合类	-	-
	合计	2,416,140,276.17	75.43

8.3 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	600519	贵州茅台	793,102	153,306,616.60	4.79
2	600276	恒瑞医药	4,945,148	145,585,157.12	4.55
3	600518	康美药业	9,008,982	101,080,778.04	3.16
4	600498	烽火通信	3,300,579	89,445,690.90	2.79
5	600585	海螺水泥	5,326,671	83,362,401.15	2.60
6	002564	张化机	7,182,044	82,234,403.80	2.57
7	000423	东阿阿胶	1,854,040	79,631,018.00	2.49
8	600256	广汇股份	3,841,966	79,067,660.28	2.47
9	002115	三维通信	5,744,436	70,082,119.20	2.19
10	601117	中国化学	12,270,014	69,939,079.80	2.18

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	600048	保利地产	386,147,015.43	7.02
2	600519	贵州茅台	311,752,878.27	5.67
3	000009	中国宝安	287,169,113.54	5.22
4	000858	五 粮 液	222,830,215.14	4.05
5	600362	江西铜业	218,125,782.10	3.97
6	600036	招商银行	216,269,633.70	3.93
7	000002	万 科A	214,090,840.78	3.89
8	600585	海螺水泥	204,929,238.87	3.73
9	600425	青松建化	204,898,239.01	3.73
10	601006	大秦铁路	203,399,645.19	3.70
11	600068	葛洲坝	201,744,308.76	3.67
12	601088	中国神华	197,561,127.08	3.59
13	600089	特变电工	181,094,591.15	3.29
14	600467	好当家	168,589,856.34	3.07
15	600050	中国联通	168,152,357.69	3.06
16	600383	金地集团	167,401,970.59	3.04
17	000877	天山股份	162,699,566.10	2.96
18	600123	兰花科创	162,578,946.46	2.96
19	002564	张化机	160,893,393.97	2.93
20	600309	烟台万华	154,914,192.09	2.82
21	601117	中国化学	152,328,413.03	2.77
22	600518	康美药业	147,168,857.31	2.68
23	600416	湘电股份	146,919,469.72	2.67
24	000423	东阿阿胶	146,072,508.10	2.66
25	601009	南京银行	145,563,053.44	2.65
26	000063	中兴通讯	144,122,565.74	2.62
27	600636	三爱富	141,989,632.35	2.58
28	601169	北京银行	139,941,145.59	2.54
29	600276	恒瑞医药	139,357,853.68	2.53
30	000650	仁和药业	138,941,505.78	2.53
31	600582	天地科技	129,289,644.77	2.35
32	600970	中材国际	127,939,685.13	2.33
33	600498	烽火通信	126,688,462.99	2.30
34	601678	滨化股份	122,924,554.74	2.24
35	000651	格力电器	116,827,051.03	2.12
36	000402	金 融 街	114,331,899.90	2.08

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。

8.4.2 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	000009	中国宝安	384,441,496.34	6.99
2	600048	保利地产	342,127,761.10	6.22
3	600585	海螺水泥	297,398,985.53	5.41
4	000423	东阿阿胶	269,900,688.91	4.91
5	000002	万 科A	266,788,944.10	4.85
6	600089	特变电工	253,040,184.99	4.60
7	002106	莱宝高科	246,263,319.13	4.48
8	600970	中材国际	240,606,463.97	4.38
9	600123	兰花科创	236,442,548.14	4.30
10	600000	浦发银行	222,019,794.70	4.04
11	600256	广汇股份	213,726,849.16	3.89
12	600362	江西铜业	208,882,002.42	3.80
13	601166	兴业银行	197,201,643.83	3.59
14	600036	招商银行	195,458,859.18	3.55
15	601006	大秦铁路	191,279,605.37	3.48
16	600425	青松建化	185,937,462.05	3.38
17	601088	中国神华	182,601,051.96	3.32
18	600261	阳光照明	180,595,040.51	3.28
19	600887	伊利股份	174,013,433.82	3.16
20	000792	盐湖股份	163,733,430.12	2.98
21	600636	三爱富	160,675,961.96	2.92
22	600050	中国联通	160,544,747.38	2.92
23	600750	江中药业	157,862,954.21	2.87
24	600519	贵州茅台	157,636,396.27	2.87
25	000538	云南白药	152,057,404.14	2.76
26	600383	金地集团	147,522,763.83	2.68
27	000063	中兴通讯	145,287,511.03	2.64
28	000848	承德露露	143,954,876.29	2.62
29	000858	五 粮 液	139,265,827.18	2.53
30	000877	天山股份	133,368,857.84	2.43
31	600628	新世界	126,905,374.73	2.31
32	600309	烟台万华	124,967,465.54	2.27
33	600068	葛洲坝	124,073,722.48	2.26
34	600416	湘电股份	122,972,647.21	2.24
35	000021	长城开发	122,438,209.84	2.23
36	601169	北京银行	122,125,244.00	2.22
37	000960	锡业股份	121,390,346.24	2.21
38	601009	南京银行	119,816,350.32	2.18
39	600467	好当家	113,649,295.98	2.07
40	600582	天地科技	113,031,401.56	2.06
41	600160	巨化股份	111,953,752.94	2.04

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。

8.4.3 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	11,419,073,816.43
卖出股票收入（成交）总额	12,180,685,273.01

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现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、处罚的情形。

8.9.2 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。

8.9.3 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	4,262,473.25
2	应收证券清算款	25,044,858.69
3	应收股利	-
4	应收利息	259,703.04
5	应收申购款	37,711.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	29,604,746.18

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.9.5 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未存在流通受限情况。

8.9.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
152,601	28,913.54	1,460,441,290.76	33.10%	2,951,793,352.37	66.90%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	93,129.67	0.002%

§10 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	4,835,476,483.70
本报告期基金总申购份额	260,795,060.21
减：本报告期基金总赎回份额	684,036,900.78
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	4,412,234,643.13

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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、基金管理人的重大人事变动：

经信诚基金管理有限公司第二届董事会第十五次会议审议通过，聘任桂思毅先生担任公司副总经理。

本基金管理人已于2011年5月25日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站上刊登了《信诚基金管理有限公司关于副总经理任职的公告》。

上述变更事项已按规定向中国证监会和上海证监局报告。

2、本基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

2011年1月21日，中国证监会核准中国农业银行股份有限公司张健基金行业高级管理人员任职资格（证监许可[2011]116号），张健任中国农业银行股份有限公司托管业务部总经理。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金报告年度应支付给毕马威华振会计师事务所有限公司的报酬为人民币160,000.00元。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。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	3	4,257,619,492.92	18.05%	3,541,854.68	17.95%	-
联合证券	1	3,665,114,947.08	15.53%	3,115,331.74	15.79%	-
东方证券	2	3,589,017,343.93	15.21%	3,050,661.42	15.46%	-
国信证券	1	3,035,130,703.23	12.86%	2,466,062.86	12.50%	-
国泰君安	1	1,854,117,766.36	7.86%	1,506,484.44	7.63%	-
瑞银证券	1	1,829,198,814.43	7.75%	1,554,813.36	7.88%	-
光大证券	1	1,737,839,243.40	7.37%	1,477,155.64	7.49%	-
申银万国	2	872,652,844.29	3.70%	741,755.05	3.76%	-
中金证券	1	853,523,918.70	3.62%	693,491.70	3.51%	-
银河证券	2	781,581,856.11	3.31%	664,344.43	3.37%	-
中投证券	1	763,214,175.82	3.23%	620,117.53	3.14%	-
招商证券	1	354,068,024.29	1.50%	300,955.80	1.53%	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-

注：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。

2、本基金本期未新增交易单元。

11.7.2 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
中信证券	-	-
联合证券	-	-
东方证券	-	-
国信证券	-	-
国泰君安	-	-
瑞银证券	-	-
光大证券	996,783.20	100.00%
申银万国	-	-
中金证券	-	-
银河证券	-	-
中投证券	-	-
招商证券	-	-
高华证券	-	-
中信建投	-	-

注：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。

2、本基金本期未新增交易单元。

信诚基金管理有限公司
2012年3月27日