

## 信诚四季红混合型证券投资基金

## 2012 第一季度 报告

2012年3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  
报告送出日期:2012年4月24日

## \$1 重要提示

基金管理人的董事会及董事声明本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性、完整性和完整性承担个别及连带责任。

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2012年4月17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，保证复核结果不存在虚假记载、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2012年1月1日起至3月31日止。

## \$2 基金产品概况

基金简称 信诚四季红混合

基金代码 550001

交易代码 前端交易代码:550001 后端交易代码:551001

基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2006年4月12日

报告期末基金份额总额 4,076,349,867.76份

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成熟集中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)。SAA是根据各资产类别的历史表现和预期表现，通过资产配置模型，将各自的长期配置比例，按照基金的风险偏好以及对资产市场的大势判断，在长期均态分布下的期限内进行定期调整。战术性资产配置 TAA是基于资产配置的核心，是依据评估市场情况对在一定时期内各类资产的预期回报作出预测，并根据基金资产的动态资产配置策略，进行相应的短期资产配置的过程。

业绩比较基准 62.5%沪深300指数+32.5%中信国指收益券+5%金融同业存款利率

风险收益特征 一只混合型基金，本基金的资产配置中股票、股票 42.5%，债券 32.5%，确立了本基金在资产配置中的风格定位。因此本基金在证券投资组合中集中于中低风险、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追求基金份额的中期稳健增值。

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

## \$3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期 2012年1月1日至2012年3月31日

1.本期已实现收益 -513,346,282.59

2.本期利润 -35,328,562.52

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0082

4.期末基金份额净值 2,916,848,813.04

5.期末基金资产净值 0.7156

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将低于所列数字。  
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

3.2.1 本基金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 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

2012年第1季度 -1.43% 1.16% 3.21% 1.02% -4.64% 0.14%

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

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

2012年第1季度 -1.43% 1.16% 3.21% 1.02% -4.64% 0.14%

3.3.1 本基金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 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

2012年第1季度 -1.43% 1.16% 3.21% 1.02% -4.64% 0.14%

3.3.2 本基金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 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

2012年第1季度 -1.43% 1.16% 3.21% 1.02% -4.64% 0.14%

3.3.3 本基金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 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

2012年第1季度 -1.43% 1.16% 3.21% 1.02% -4.64% 0.14%

3.3.4 本基金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 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

2012年第1季度 -1.43% 1.16% 3.21% 1.02% -4.64% 0.14%

3.3.5 本基金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 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

2012年第1季度 -1.43% 1.16% 3.21% 1.02% -4.64% 0.14%

3.3.6 本基金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 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

2012年第1季度 -1.43% 1.16% 3.21% 1.02% -4.64% 0.14%

3.3.7 本基金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 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

2012年第1季度 -1.43% 1.16% 3.21% 1.02% -4.64% 0.14%

3.3.8 本基金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 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

2012年第1季度 -1.43% 1.16% 3.21% 1.02% -4.64% 0.14%

3.3.9 本基金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 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

2012年第1季度 -1.43% 1.16% 3.21% 1.02% -4.64% 0.14%

3.3.10 本基金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 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

2012年第1季度 -1.43% 1.16% 3.21% 1.02% -4.64% 0.14%

3.3.11 本基金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 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

2012年第1季度 -1.43% 1.16% 3.21% 1.02% -4.64% 0.14%

3.3.12 本基金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 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

2012年第1季度 -1.43% 1.16% 3.21% 1.02% -4.64% 0.14%

3.3.13 本基金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 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

2012年第1季度 -1.43% 1.16% 3.21% 1.02% -4.64% 0.14%

3.3.14 本基金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 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

2012年第1季度 -1.43% 1.16% 3.21% 1.02% -4.64% 0.14%

3.3.15 本基金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 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

2012年第1季度 -1.43% 1.16% 3.21% 1.02% -4.64% 0.14%

3.3.16 本基金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 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

2012年第1季度 -1.43% 1.16% 3.21% 1.02% -4.64% 0.14%

3.3.17 本基金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 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

2012年第1季度 -1.43% 1.16% 3.21% 1.02% -4.64% 0.14%

3.3.18 本基金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 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

2012年第1季度 -1.43% 1.16% 3.21% 1.02% -4.64% 0.14%

3.3.19 本基金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 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

2012年第1季度 -1.43% 1.16% 3.21% 1.02% -4.64% 0.14%

3.3.20 本基金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 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

2012年第1季度 -1.43% 1.16% 3.21% 1.02% -4.64% 0.14%

3.3.21 本基金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 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

2012年第1季度 -1.43% 1.16% 3.21% 1.02% -4.64% 0.14%

3.3.22 本基金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 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

2012年第1季度 -1.43% 1.16% 3.21% 1.02% -4.64% 0.14%

3.3.23 本基金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 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

2012年第1季度 -1.43% 1.16% 3.21% 1.02% -4.64% 0.14%

3.3.24 本基金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 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

2012年第1季度 -1.43% 1.16% 3.21% 1.02% -4.64% 0.14%

3.3.25 本基金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 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

2012年第1季度 -1.43% 1.16% 3.21% 1.02% -4.64% 0.14%

3.3.26 本基金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 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

2012年第1季度 -1.43% 1.16% 3.21% 1.02% -4.64% 0.14%

3.3.27 本基金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 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

2012年第1季度 -1.43% 1.16% 3.21% 1.02% -4.64% 0.14%

3.3.28 本基金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