**信诚金砖四国积极配置证券投资基金(LOF)2019年半年度报告摘要**

**2019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：中国银行股份有限公司**

**送出日期：2019年08月26日**

# 重要提示及目录

## 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年8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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至2019年6月30日止。

# 基金简介

## 基金基本情况

|  |  |
| --- | --- |
| 基金简称 | 信诚四国配置(QDII-FOF-LOF) |
| 场内简称 | 信诚四国 |
| 基金主代码 | 165510 |
| 基金运作方式 | 上市型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2010年12月17日 |
| 基金管理人 | 中信保诚基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 12,614,320.85份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所 |
| 上市日期 | 2011年1月20日 |

## 基金产品说明

|  |  |
| --- | --- |
| 投资目标 | 通过对“金砖四国”各地区间的积极配置,以及对“金砖四国”相关ETF和股票的精选,在有效分散风险的基础上,追求基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 资产配置策略包括大类资产配置和地区配置两个层面。  在大类资产配置层面,原则上,本基金将积极投资于ETF和股票等权益类资产。当权益类市场整体系统性风险突出,无法通过地区配置降低组合风险的市场情况下,本基金将降低权益类资产的配置比例,但权益类资产的比例不低于基金资产的60%。  同时,本基金将运用积极的地区配置策略,在追求超额收益的同时,分散组合风险。地区配置通过定量和定性分析相结合的方式,依据对全球和投资目标市场的经济和金融参数的分析,综合决定主要目标市场国家地区的投资吸引力和投资风险,进而决定各个国家地区市场的投资比例。 |
| 业绩比较基准 | 标准普尔金砖四国(含香港)市场指数(总回报) |
| 风险收益特征 | 本基金主要投资于与“金砖四国”相关的权益类资产。从所投资市场看,“金砖四国”均属于新兴市场,其投资风险往往高于成熟市场;同时,“金砖四国”经济联动性和市场相关性存在日益加大的可能性,因此本基金国家配置的集中性风险也可能较其他分散化程度较高的新兴市场投资基金更高。从投资工具看,权益类投资的风险高于固定收益类投资的风险。因此,本基金是属于高预期风险和高预期收益的证券投资基金品种,其预期风险和预期收益水平高于一般的投资于全球或成熟市场的偏股型基金。 |

## 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 | 中国银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 周浩 | 王永民 |
| 联系电话 | 021-68649788 | 010-66594896 |
| 电子邮箱 | hao.zhou@citicprufunds.com.cn | fcid@bankofchina.com |
| 客户服务电话 | | 400-666-0066 | 95566 |
| 传真 | | 021-50120888 | 010-66594942 |

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。

## 境外投资顾问和境外资产托管人

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 项目 | | 境外投资顾问 | 境外资产托管人 |
| 名称 | 英文 | - | Bank of China (Hong Kong) Limited |
| 中文 | - | 中国银行(香港)有限公司 |
| 注册地址 | | - | 香港中环花园道1号中银大厦 |
| 办公地址 | | - | 香港中环花园道1号中银大厦 |
| 邮政编码 | | - | - |

## 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 |

# 主要财务指标和基金净值表现

## 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(2019年01月01日至2019年06月30日) |
| 本期已实现收益 | -163,383.76 |
| 本期利润 | 752,707.53 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0581 |
| 本期基金份额净值增长率 | 8.17% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2019年06月30日) |
| 期末可供分配利润 | -3,745,652.82 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.2969 |
| 期末基金资产净值 | 9,528,906.99 |
| 期末基金份额净值 | 0.755 |

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。

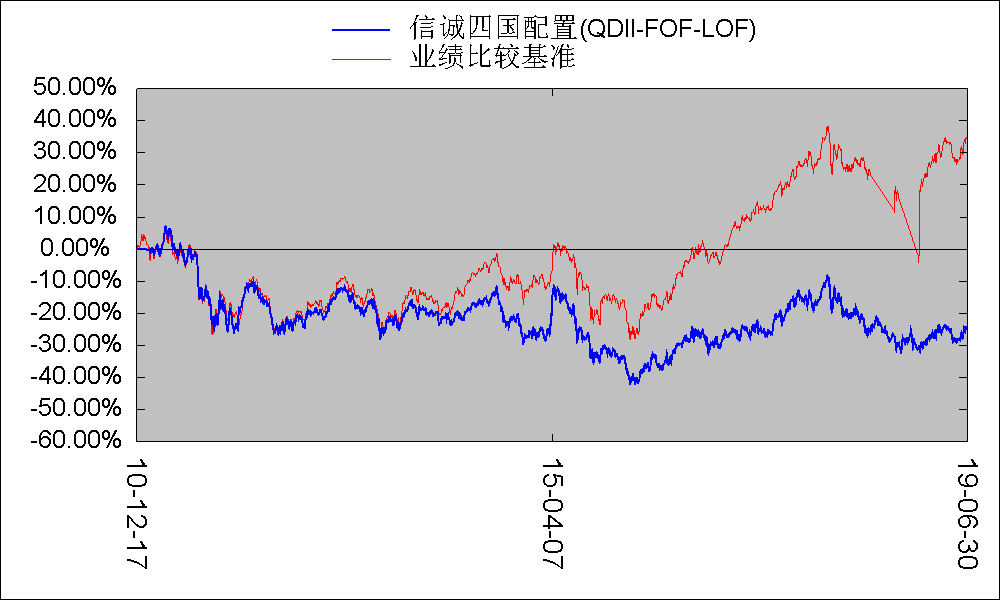
## 基金净值表现

* + 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 | 5.15% | 0.99% | 5.34% | 0.76% | -0.19% | 0.23% |
| 过去三个月 | 0.94% | 0.84% | 2.69% | 0.63% | -1.75% | 0.21% |
| 过去六个月 | 8.17% | 0.91% | 13.74% | 0.70% | -5.57% | 0.21% |
| 过去一年 | 0.53% | 0.97% | 7.87% | 0.84% | -7.34% | 0.13% |
| 过去三年 | 11.85% | 0.99% | 53.03% | 0.78% | -41.18% | 0.21% |
| 自基金合同生效起至今 | -24.50% | 1.00% | 34.48% | 0.99% | -58.98% | 0.01% |

注:本基金的业绩比较标准为标准普尔金砖四国(含香港)市场指数(总回报) 。

* + 1. **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2010年12月17日至2011年6月16日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

# 管理人报告

## 基金管理人及基金经理情况

* + 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2019年6月30日,本基金管理人管理的运作中基金为67只, 分别为信诚四季红混合型证券投资基金、中信保诚精萃成长混合型证券投资基金、中信保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）、中信保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、中信保诚惠泽18个月定期开放债券型证券投资基金、信诚稳瑞债券型证券投资基金、中信保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、中信保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、中信保诚稳达债券型证券投资基金、中信保诚新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚景泰债券型证券投资基金、中信保诚景丰债券型证券投资基金、中信保诚创新成长灵活配置混合型证券投资基金。

* + 1. **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 |
| 刘儒明 | 本基金基金经理 | 2010年12月17日 | 2019年01月25日 | 24 | 工学硕士。曾任职于永昌证券投资信托股份有限公司,担任基金经理;于富邦证券投资信托股份有限公司,担任基金经理;于金复华证券投资信托股份有限公司,担任基金经理;于台湾工银证券投资信托股份有限公司,担任基金经理;于富国基金管理有限公司,担任境外投资部经理;2009年6月加入中信保诚基金管理有限公司,担任海外投资副总监,信诚金砖四国积极配置证券投资基金(LOF)及信诚全球商品主题证券投资基金(LOF)的基金经理,于2019年1月离任上述职务。 |
| 李舒禾 | 本基金基金经理 | 2011年12月20日 | 2019年04月26日 | 14 | 商学硕士。曾任职于台湾证券投资信托股份有限公司,历任宝来全球ETF稳健组合证券投资信托基金经理、宝来黄金期货信托基金经理。2011年3月加入中信保诚基金管理有限公司,担任信诚全球商品主题证券投资基金(LOF)、信诚金砖四国积极配置证券投资基金(LOF)基金经理,于2019年4月离任上述职务。 |
| 顾凡丁 | 本基金基金经理,兼任信诚金砖四国积极配置证券投资基金(LOF)的基金经理。 | 2019年04月18日 | - | 4 | 金融工程硕士、计量金融学硕士。曾任职于中国人寿资产管理有限公司,担任量化分析师。2015年7月加入中信保诚基金管理有限公司,历任金融工程师、投资经理。现任信诚全球商品主题证券投资基金(LOF)、信诚金砖四国积极配置证券投资基金(LOF)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。

## 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

## 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《信诚金砖四国积极配置证券投资基金(LOF)基金合同》、《信诚金砖四国积极配置证券投资基金(LOF)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。

## 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

* + 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。

* + 1. **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)。

## 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

* + 1. **报告期内基金投资策略和运作分析**

本基金重点投资于巴西、俄罗斯、印度和中国等新兴国家的权益资产。

2019年上半年度，新兴市场权益资产震荡上行，中美关系的走向作为未来全球经济变化的关键因素，主导了上半年的新兴国家权益市场：前四个月，全球权益市场在中美关系缓的助推下扭转了去年的悲观预期，权益市场经历一轮估值修复的过程；随后，五月初中美矛盾又重新升级，引起全球股市大幅震荡；六月中美关系再次释放乐观信号，权益市场也再次随之反弹，印度、巴西、俄罗斯等国家的股票市场指数先后创出近三年来的新高。整个上半年度，中国和香港板块分别上涨11.3%、12.2%；印度板块受政府换届选情扰动震荡上涨，上半年累计上涨4.6%；巴西和俄罗斯股市表现相对强劲，分别上涨14.4%、17.5%。汇率方面：美元指数上涨0.1%，人民币升值0.2%、港币升值0.3%、印度卢比升值0.6%、巴西雷亚尔升值0.6%、俄罗斯卢布大幅升值10.3%。

基金在上半年整体保持了高仓位紧跟市场反弹，在第二季度进行了较大幅度的资产配置调整，并随后增加了巴西、俄罗斯板块的配置权重并降低了印度板块的配置权重；在五月下旬市场调整后期，又增加了中国板块的配置权重。

* + 1. **报告期内基金的业绩表现**

本报告期内,本基金份额净值增长率为8.17%, 同期业绩比较基准收益率为13.74%,基金落后业绩比较基准5.57%。

## 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为当前全球经济正处在重要转折点。2016年以来美联储退出QE并进入持续了3年的加息周期，全球经济在货币宽松时期形成的同步性开始减弱，各国经济周期又开始逐渐分化。当前，美联储逐渐明确的鸽派表态让市场预期新一轮货币宽松，而实际上印度、巴西、俄罗斯等国家均已经下调政策利率，使得各国经济周期分化进一步拉开。

我们判断新兴市场和发达市场的走势或持续出现分化，美元和美股或进入弱势调整周期，新兴市场则可能提前触底进入新一轮上行周期。金砖四国中，俄罗斯和巴西的经济仍保持在周期高位，印度经济则可能正处在由盛转衰短周期的拐点，而中国经济则经过外部事件的刺激后提前释放了风险，或正处在周期底部即将迎来复苏。我们将保持对各国经济数据、汇率波动和股市表现的观察和跟踪分析，对各板块资产做出相应调整，同时在经济周期触底的过程中保持对权益市场风险的控制。

## 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、权益投资负责人、固定收益投资负责人、研究部负责人、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,可申请召开估值决策委员会临时会议,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。

## 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、本基金的每份基金份额享有同等分配权;

2、基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式。登记在注册登记系统的基金份额,其持有人可自行选择收益分配方式。基金份额持有人事先未做出选择的,默认的分红方式为现金红利;选择红利再投资的,现金红利则按除权后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资(具体日期以本基金分红公告为准); 登记在证券登记结算系统中的基金份额只支持现金红利方式,投资人不能选择其他的分红方式,具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定;

3、在符合基金收益分配条件的情况下,本基金收益每年最多分配十二次;

4、若基金合同生效不满3个月则可不进行收益分配;

5、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;

6、每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的25%(收益分配基准日可供分配利润指收益分配基准日资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数);

7、基金红利发放日距离收益分配基准日(即可供分配利润计算截止日)的时间不得超过15个工作日;

8、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

本基金于本报告期间未进行过利润分配,该处理符合基金利润分配原则。

# 托管人报告

## 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在信诚金砖四国积极配置证券投资基金(LOF)(以下称“本基金”)的托管过程中,严格遵守《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有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

## 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

本报告期内,本托管人根据《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,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

## 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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

# 半年度财务会计报告（未经审计）

## 资产负债表

会计主体：信诚金砖四国积极配置证券投资基金(LOF)

报告截止日：2019年06月30日

单位：人民币元

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **资产** | **附注号** | **本期末**  （2019年06月30日） | **上年度末**  （2018年12月31日） |
| **资 产：** |  |  |  |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 821,890.64 | 808,257.35 |
| 结算备付金 |  | - | - |
| 存出保证金 |  | - | - |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 8,732,608.31 | 8,569,958.81 |
| 其中：股票投资 |  | - | 2,700,449.27 |
| 基金投资 |  | 8,732,608.31 | 5,869,509.54 |
| 债券投资 |  | - | - |
| 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 | - | - |
| 应收证券清算款 |  | 269,646.70 | - |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 43.04 | 48.35 |
| 应收股利 |  | 12,691.95 | 2,520.85 |
| 应收申购款 |  | 9.98 | - |
| 递延所得税资产 |  | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 |  | 9,836,890.62 | 9,380,785.36 |
| **负债和所有者权益** | **附注号** | **本期末**  （2019年06月30日） | **上年度末**  （2018年12月31日） |
| **负 债：** |  |  |  |
| 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 |  | - | - |
| 应付证券清算款 |  | - | - |
| 应付赎回款 |  | 119,778.12 | - |
| 应付管理人报酬 |  | 13,461.80 | 13,864.70 |
| 应付托管费 |  | 2,307.74 | 2,376.81 |
| 应付销售服务费 |  | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | - | - |
| 应交税费 |  | - | - |
| 应付利息 |  | - | - |
| 应付利润 |  | - | - |
| 递延所得税负债 |  | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 172,435.97 | 165,000.00 |
| 负债合计 |  | 307,983.63 | 181,241.51 |
| 所有者权益： |  |  |  |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 12,614,320.85 | 13,178,667.36 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | -3,085,413.86 | -3,979,123.51 |
| 所有者权益合计 |  | 9,528,906.99 | 9,199,543.85 |
| 负债和所有者权益总计 |  | 9,836,890.62 | 9,380,785.36 |

注:截止本报告期末,基金份额净值0.755元,基金份额总额12,614,320.85份。

## 利润表

会计主体：信诚金砖四国积极配置证券投资基金(LOF)

本报告期：2019年01月01日至2019年06月30日

单位：人民币元

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **项 目** | **附注号** | **本期**  （2019年01月01日至2019年06月30日） | **上年度可比期间**  （2018年01月01日 -2018年06月30日） |
| **一、收入** |  | 923,951.81 | -1,144,531.75 |
| 1.利息收入 |  | 681.62 | 1,121.54 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 681.62 | 1,121.54 |
| 债券利息收入 |  | - | - |
| 资产支持证券利息收入 |  | - | - |
| 买入返售金融资产收入 |  | - | - |
| 其他利息收入 |  | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） |  | -12,239.90 | 251,261.48 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | -342,676.38 | 259,828.12 |
| 基金投资收益 | 6.4.7.13 | 252,882.99 | -80,596.85 |
| 债券投资收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.14.1 | - | - |
| 贵金属投资收益 |  | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.15 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.16 | 77,553.49 | 72,030.21 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | 916,091.29 | -1,425,890.14 |
| 4.汇兑收益(损失以“-”号填列) |  | 19,082.00 | 27,681.02 |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.18 | 336.80 | 1,294.35 |
| **减：二、费用** |  | 171,244.28 | 232,293.73 |
| 1．管理人报酬 |  | 82,176.68 | 107,396.06 |
| 2．托管费 |  | 14,087.46 | 18,410.71 |
| 3．销售服务费 |  | - | - |
| 4．交易费用 | 6.4.7.19 | 30,463.62 | 46,863.50 |
| 5．利息支出 |  | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 |  | - | - |
| 6．其他费用 | 6.4.7.20 | 44,516.52 | 59,623.46 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |  | 752,707.53 | -1,376,825.48 |
| 减：所得税费用 |  | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） |  | 752,707.53 | -1,376,825.48 |

## 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：信诚金砖四国积极配置证券投资基金(LOF)

本报告期：2019年01月01日至2019年06月30日

单位：人民币元

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **项目** | **本期**  （2019年01月01日至2019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） | 13,178,667.36 | -3,979,123.51 | 9,199,543.85 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 752,707.53 | 752,707.53 |
| 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） | -564,346.51 | 141,002.12 | -423,344.39 |
| 其中：1.基金申购款 | 171,311.15 | -47,477.10 | 123,834.05 |
| 2.基金赎回款 | -735,657.66 | 188,479.22 | -547,178.44 |
| 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） | 12,614,320.85 | -3,085,413.86 | 9,528,906.99 |
| **项目** | **上年度可比期间**  （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） | 16,624,082.17 | -2,505,830.19 | 14,118,251.98 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -1,376,825.48 | -1,376,825.48 |
| 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） | -2,067,852.93 | 264,827.03 | -1,803,025.90 |
| 其中：1.基金申购款 | 596,327.05 | -107,068.34 | 489,258.71 |
| 2.基金赎回款 | -2,664,179.98 | 371,895.37 | -2,292,284.61 |
| 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） | 14,556,229.24 | -3,617,828.64 | 10,938,400.60 |

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:

唐世春 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

## 报表附注

* + 1. **基金基本情况**

信诚金砖四国积极配置证券投资基金(LOF) (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”)《关于核准信诚金砖四国积极配置证券投资基金(LOF) 募集的批复》(证监许可[2010] 1217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》等相关法规和《信诚金砖四国积极配置证券投资基金(LOF) 基金合同》发售，基金合同于2010年12月17日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集资金总额人民币399,198,154.16元。上述募集资金已由会计师事务所验证，并出具了验资报告。本基金的基金管理人为中信保诚基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”) 。本基金的境外资产托管人为中国银行(香港) 有限公司(以下简称“中银香港”) 。

根据中信保诚基金管理有限公司于 2017 年 12 月 20 日发布的《中信保诚基金管理有限公司关于公司名称变更的函》,经中华人民共和国国家工商行政管理总局核准,公司名称由“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”,并由上海市工商行政管理局于 2017 年 12 月 18 日核发新的营业执照。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”) 深证上字[2011] 第22号文审核同意，本基金14,891,642份基金份额于2011年1月20日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《信诚金砖四国积极配置证券投资基金(LOF) 基金合同》和《信诚金砖四国积极配置证券投资基金(LOF) 招募说明书》的有关规定，本基金可投资于下列金融产品及工具：交易型开放式指数基金(以下简称“ETF”)；普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；金融衍生产品、结构性投资产品以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金定义的“金砖四国”是指巴西、俄罗斯、印度、中国(含香港) 。本基金主要投资于“金砖四国”相关的金融资产，包括以“金砖四国”至少一国/地区为主要投资范围的ETF以及两类上市公司的股票：(1) 在“金砖四国”登记注册的企业，(2) 主营业务收入主要来自于“金砖四国”的企业。本基金投资上述“金砖四国”相关的金融资产的比例不低于基金权益类资产的80%，其余不高于20%的权益类资产可投资于非符合本基金定义的“金砖四国”相关金融资产。本基金投资于ETF的比例不低于基金资产的60%，且本基金所投资的ETF应在与中国证监会签署双边管辖合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册。本基金投资于权益类资产的比例不低于基金资产的60% 。本基金持有现金或到期日在一年内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为标准普尔金砖四国(含香港) 市场指数(总回报) 。

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。

* + 1. **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。

* + 1. **遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注6.4.2中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金2019年6月30日的财务状况、2019年1月1日至2019年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

* + 1. **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。

* + 1. **会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**
       1. **会计政策变更的说明**

本基金本报告期未发生会计政策变更。

* + - 1. **会计估计变更的说明**

本基金本报告期未发生会计估计变更。

* + - 1. **差错更正的说明**

本基金在本报告期内无须说明的会计差错更正。

* + 1. **税项**

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[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《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) 目前税收政策法规未对合格境内机构投资者（“QDII”）产品的税收处理给予特别的说明。在法规未有明确说明的情况下，参考现有的针对证券投资基金的税收法规进行处理。

(b) 目前基金取得的源自境外的差价收入和股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行。

(c) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(d) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(e) 2018年1月1日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下称资管产品运营业务），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。对资管产品在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。

(f) 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对自国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(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，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

* + 1. **关联方关系**
       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。

* + - 1. **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、基金销售机构 |
| 中国银行股份有限公司(“中国银行”) | 基金托管人、基金销售机构 |
| 中国银行(香港)有限公司(“中银香港”) | 基金境外托管人 |

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。

* + 1. **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。

* + - 1. **通过关联方交易单元进行的交易**
         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。

* + - * 1. **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。

* + - * 1. **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。

* + - * 1. **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。

* + - * 1. **基金交易**

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。

* + - * 1. **应支付关联方的佣金**

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。

* + - 1. **关联方报酬**
         1. **基金管理费**

单位：人民币元

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 项目 | 本期  （2019年01月01日至2019年06月30日） | 上年度可比期间  （2018年01月01日至2018年06月30日） |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 82,176.68 | 107,396.06 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 30,215.97 | 40,553.20 |

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1.75%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×1.75% / 当年天数

* + - * 1. **基金托管费**

单位：人民币元

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 项目 | 本期  （2019年01月01日至2019年06月30日） | 上年度可比期间  （2018年01月01日至2018年06月30日） |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 14,087.46 | 18,410.71 |

注:支付基金托管人中国银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.30%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×0.30% / 当年天数

* + - 1. **与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

* + - 1. **各关联方投资本基金的情况**
         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。

* + - * 1. **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**

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,本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

* + - 1. **由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

金额单位：人民币元

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 关联方名称 | 本期  （2019年01月01日至2019年06月30日） | | 上年度可比期间  （2018年01月01日至2018年06月30日） | |
| 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国银行 | 821,890.64 | 681.62 | 287,585.57 | 1,121.54 |
| 中银香港 | - |  | 1,794,843.93 | - |

* + - 1. **本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

* + - 1. **其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

* + 1. **期末（2019年06月30日）本基金持有的流通受限证券**
       1. **因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发流通受限证券。

* + - 1. **期末持有的暂时停牌股票**

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

* + - 1. **期末债券正回购交易中作为抵押的债券**
         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。

* + - * 1. **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。

* + 1. **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

如下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2019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8,732,608.31元,无属于第二层次和第三层次的余额(2018年12月31日:属于第一层次的余额为人民币8,569,958.81元,无属于第二层次和第三层次的余额)。

(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2019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(2018年12月31日:无)。

(2) 其他金融工具的公允价值 (非以公允价值计量的项目)

其他金融工具主要包括应收账款和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

（3）除以上事项外，截至本报告期末本基金无需说明的其他重要事项。

# 投资组合报告

## 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：普通股 | - | - |
|  | 存托凭证 | - | - |
| 2 | 基金投资 | 8,732,608.31 | 88.77 |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
|  | 其中：债券 | - | - |
|  | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
|  | 其中：远期 | - | - |
|  | 期货 | - | - |
|  | 期权 | - | - |
|  | 权证 | - | - |
| 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 | 货币市场工具 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 821,890.64 | 8.36 |



|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 8 | 其他各项资产 | 282,391.67 | 2.87 |
| 9 | 合计 | 9,836,890.62 | 100.00 |

## 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

## 期末按行业分类的权益投资组合

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

## 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

## 报告期内权益投资组合的重大变动

* + 1. **累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细**

金额单位：人民币元

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 序号 | 公司名称（英文） | 证券代码 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例（%） |
| 1 | CHINA EVERBRIGHT INTL LTD | 257 HK | 106,645.92 | 1.16 |
| 2 | HAITONG SECURITIES CO LTDH | 6837 HK | 99,173.08 | 1.08 |
| 3 | HUATAI SECURITIES CO LTDH | 6886 HK | 96,437.05 | 1.05 |
| 4 | CHINA EVERBRIGHT GREENTECH L | 1257 HK | 40,497.13 | 0.44 |
| 5 | CHINA TRADITIONAL CHINESE ME | 570 HK | 24,626.79 | 0.27 |

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。

* + 1. **累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细**

金额单位：人民币元

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 序号 | 公司名称  （英文） | 证券代码 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例（%） |
| 1 | CHINA EVERBRIGHT GREENTECH L | 1257 HK | 357,978.93 | 3.89 |
| 2 | VITASOY INTL HOLDINGS LTD | 345 HK | 333,671.27 | 3.63 |
| 3 | DALI FOODS GROUP CO LTD | 3799 HK | 313,363.92 | 3.41 |
| 4 | ALIVING SERVICES CO LTDH | 3319 HK | 311,984.15 | 3.39 |
| 5 | ALIBABA GROUP HOLDINGSP ADR | BABA US | 310,790.67 | 3.38 |
| 6 | TENCENT HOLDINGS LTD | 700 HK | 282,244.69 | 3.07 |
| 7 | BESTWAY GLOBAL HOLDING INC | 3358 HK | 227,948.76 | 2.48 |
| 8 | SEMICONDUCTOR MANUFACTURING | 981 HK | 224,442.50 | 2.44 |
| 9 | GREENTOWN SERVICE GROUP CO L | 2869 HK | 216,479.36 | 2.35 |
| 10 | CHINA TRADITIONAL CHINESE ME | 570 HK | 200,826.62 | 2.18 |
| 11 | XIAOMI CORPCLASS B | 1810 HK | 162,813.35 | 1.77 |
| 12 | CHINA EVERBRIGHT INTL LTD | 257 HK | 102,772.62 | 1.12 |
| 13 | HAITONG SECURITIES CO LTDH | 6837 HK | 88,654.77 | 0.96 |
| 14 | HUATAI SECURITIES CO LTDH | 6886 HK | 81,480.96 | 0.89 |

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。

* + 1. **权益投资的买入成本总额及卖出收入总额**

金额单位：人民币元

|  |  |
| --- | --- |
| 买入成本（成交）总额 | 367,379.97 |
| 卖出收入（成交）总额 | 3,215,452.59 |

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。

## 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

## 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。

## 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

## 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

## 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十大基金投资明细

金额单位：人民币元

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 序号 | 基金名称 | 基金类型 | 运作方式 | 管理人 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
| 1 | SPDR S&P CHINA ETF | ETF基金 | 契约型开放式 | - | 1,475,964.68 | 15.49 |
| 2 | ISHARES MSCI HONG KONG ETF | ETF基金 | 契约型开放式 | - | 1,464,614.69 | 15.37 |
| 3 | ISHARES CORE MSCI CH IND ETF | ETF基金 | 契约型开放式 | - | 1,321,178.95 | 13.86 |
| 4 | ISHARES MSCI CHINA ETF | ETF基金 | 契约型开放式 | - | 1,098,588.06 | 11.53 |
| 5 | ISHARES MSCI INDIA ETF | ETF基金 | 契约型开放式 | - | 918,046.75 | 9.63 |
| 6 | ISHARES MSCI BRAZIL ETF | ETF基金 | 契约型开放式 | - | 790,778.32 | 8.30 |
| 7 | WISDOMTREE INDIA EARNINGS | ETF基金 | 契约型开放式 | - | 452,903.04 | 4.75 |
| 8 | iShares MSCI Russia ETF | ETF基金 | 契约型开放式 | - | 377,566.43 | 3.96 |
| 9 | DRX DLY CHINA ASHR BULL 2X | ETF基金 | 契约型开放式 | - | 249,957.42 | 2.62 |
| 10 | VANECK VECTORS RUSSIA ETF | ETF基金 | 契约型开放式 | - | 196,888.38 | 2.07 |

## 投资组合报告附注

* + 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**

本基金投资前十名证券的发行主体没有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。

* + 1. **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中,没有超出基金合同规定备选库之外的股票。

* + 1. **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 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | 269,646.70 |
| 3 | 应收股利 | 12,691.95 |
| 4 | 应收利息 | 43.04 |
| 5 | 应收申购款 | 9.98 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |



|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 282,391.67 |

* + 1. **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。

* + 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。

* + 1. **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。

# 基金份额持有人信息

## 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 |
| 808 | 15,611.78 | 19,863.55 | 0.16% | 12,594,457.30 | 99.84% |

## 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 |
| 1 | OOI HOE SEONG | 494,158.65 | 3.92% |
| 2 | 雷四成 | 296,453.19 | 2.35% |
| 3 | 许泽娜 | 256,926.10 | 2.04% |
| 4 | 李秀珍 | 247,228.07 | 1.96% |
| 5 | 孙琪琪 | 237,347.35 | 1.88% |
| 6 | 赵爱英 | 226,264.82 | 1.79% |
| 7 | 黄伟强 | 197,873.46 | 1.57% |
| 8 | 余献 | 197,761.46 | 1.57% |
| 9 | 黄林 | 197,642.46 | 1.57% |
| 10 | 赵芳 | 197,635.46 | 1.57% |

## 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

期末本基金管理人的从业人员未持有本基金的基金份额。

## 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 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0 |

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。

## 发起式基金发起资金持有份额情况

无

# 开放式基金份额变动

单位：份

|  |  |
| --- | --- |
| 基金合同生效日(2010年12月17日)基金份额总额 | 399,198,154.16 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 13,178,667.36 |
| 本报告期基金总申购份额 | 171,311.15 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 735,657.66 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 12,614,320.85 |

# 重大事件揭示

## 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。

## 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的重大人事变动:

吕涛先生于2019年3月6日离任公司总经理职务，同日起公司董事长张翔燕女士代为履行总经理职务；唐世春先生于2019年6月3日新任公司总经理职务，同日起，唐世春先生离任公司副总经理职务、张翔燕女士不再代为履行总经理职务。上述事项已按监管要求备案并公告。

2、报告期内基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动:

2019年5月，陈四清先生因工作调动，辞去中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

## 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。

## 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略无改变。

## 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。

## 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、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 基金租用证券公司交易单元的有关情况

* + 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 |
| Shenwan Hongyuan Securities (H.K.) Limited | - | 1,227,490.16 | 34.26% | 1,472.97 | 41.55% | - |
| China Securities (International) Brokerage Co. Ltd | - | 876,959.29 | 24.48% | 438.48 | 12.37% | - |
| China Merchants Securities (HK) Co. Ltd | - | 1,167,592.42 | 32.59% | 1,167.58 | 32.93% | - |
| Cathay Securities (Hong Kong) Limited | - | - | - | - | - | - |
| Bank of Nova Scotia (The) | - | 310,790.67 | 8.67% | 466.23 | 13.15% | - |

本基金根据券商的研究实力和服务水平选择选择券商以及分配交易量。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。

* + 1. **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 | | 基金交易 | |
| 成交金额 | 占当期成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期成交总额的比例 |
| Shenwan Hongyuan Securities (H.K.) Limited | - | - | - | - | - | - | - | - |
| China Securities (International) Brokerage Co. Ltd | - | - | - | - | - | - | - | - |
| China Merchants Securities (HK) Co. Ltd | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Cathay Securities (Hong Kong) Limited | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Bank of Nova Scotia (The) | - | - | - | - | - | - | - | - |

本基金根据券商的研究实力和服务水平选择选择券商以及分配交易量。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。

# 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

2019年08月26日