信诚精萃成长股票型证券投资基金

【2012】第三季度报告

基金管理人：信诚基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
报告送出日期：2012年10月24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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2012年10月19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2012年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	信诚精萃成长股票
基金主代码	550002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年11月27日
报告期末基金份额总额	5,506,265,332.54份
投资目标	本基金通过考察公司的产业竞争环境、业务模式、盈利模式和增长模式、公司治理结构以及公司股票的估值水平，挖掘具备长期稳定成长潜力的上市公司，以实现基金资产的长期增值和风险调整后的超额收益。
投资策略	本基金定位为股票型基金，其战略性资产配置以股票为主，并不因市场的中短期变化而改变。在不同的市场条件下，本基金允许在一定的范围内作战术性资产配置调整，以规避市场风险。在实际投资过程中，本基金将根据满足本基金选股标准的股票的数量、估值水平、股票资产相对于无风险资产的风险溢价水平以及该溢价水平对均衡或长期水平的偏离程度配置大类资产，调整本基金股票的投资比重。
业绩比较基准	80%×中信标普300指数收益率+15%×中信国债指数收益率+5%×金融同业存款利率
风险收益特征	作为一只股票型基金，本基金的资产配置确立了本基金较高回报、较高风险的产品特征。
基金管理人	信诚基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§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7月1日至2012年9月30日)
1.本期已实现收益	-17,242,119.76
2.本期利润	-26,692,752.92
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0096
4.期末基金资产净值	2,992,424,330.84
5.期末基金份额净值	0.5435

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。

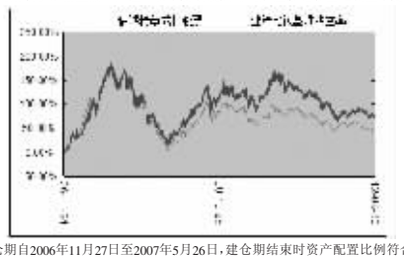
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

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

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
2012年第3季度	-3.14%	0.90%	-5.18%	0.93%	2.04%	-0.03%

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：本基金建仓期自2006年11月27日至2007年5月26日，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

§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		
谭鹏万	本基金基金经理，信诚深度价值股票(LOF)基金基金经理	2012年8月28日	-	3	曾任华宝信托有限责任公司高级分析师。2008年7月加入信诚基金管理有限公司，担任高级分析师。
刘浩	本基金基金经理，信诚基金股票投资副总监兼信诚新机遇股票(LOF)基金基金经理	2008年6月25日	2012年9月29日	9	MBA，9年证券、基金从业经验。曾任申银万国证券研究所行业研究员，从事房地产行业与房地产上市公司研究。2005年加盟信诚基金管理有限公司，历任行业研究员、保诚韩国中国龙A股基金(QFII)投资经理（该信诚基金由信诚基金投资担任顾问），公司股票投资副总监兼信诚精萃成长股票及信诚新机遇股票(LOF)基金基金经理。

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《信诚精萃成长股票型证券投资基金基金合同》、《信诚精萃成长股票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《信诚基金公平交易管理制度v1.2》，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

报告期内本基金未有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。

4.4报告期内基金的投资策略和运作分析

本基金严格坚持基金合同的要求，坚持寻找具有较高成长性的行业和公司作为配置的重点。3季度增持了金融、食品饮料、安防，降低了地产股的持仓。

从中长期看，中国经济原有增长模式无法延续，经济增速将下一个台阶。目前经济还处在去杠杆化和去产能化的过程中，与上一轮高速经济增长相匹配的金融体制将加速改革。海外，美国复苏的大方向不变，欧洲边缘国家长期竞争力缺失问题短期无法解决，这些国家经济的深度调整不可避免，新兴国家的状况也不容乐观。

四万亿投资造成的后遗症将持续发酵，一些产能过剩的行业依然看不到迅速复苏的希望，在各项要素都面临瓶颈的情况下，经济转型是必然的选择，上层建筑也需要进行相应的改革。尽管未来之路依然比较迷茫，但我相信提升内需、提高医疗和养老的保障水平、减少公害病，提高清洁能源的开发和利用应是未来的重点投资方向。

预计4季度市场还将继续维持震荡走势，在权重股估值较低的情况下，大盘继续大跌的空间不大，但盈利显著回升，估值扩张的时点未到，因此大盘也难持续上涨。个股之间的盈利能力将出现显著差异，那些代表未来增长方向，并具有持续竞争能力的公司将获得较好的投资收益。

本基金将深入挖掘行业和个股的投资价值，在不确定中精选成长确定的行业和个股，同时适度参与强周期性板块的阶段性行情，争取为基金持有人获得长期稳定的回报。

4.5报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末，本基金份额净值为0.5435元，本报告期份额净值增长率为-3.14%，同期业绩比较基准收益率为-5.18%，领先业绩基准2.04%。

§5 投资组合报告

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	2,416,752,853.46	72.00
	其中：股票	2,416,752,853.46	72.00
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	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	887,292,501.89	26.43
6	其他资产	52,677,810.87	1.57
7	合计	3,356,723,166.22	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	采掘业	131,879,861.60	4.41
C	制造业	782,471,682.87	26.15
C0	食品、饮料	304,915,457.50	10.19
C1	纺织、服装、皮毛	28,893,500.00	0.97
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	109,092,881.76	3.65
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	82,000,281.00	2.74
C8	医药、生物制品	257,569,562.61	8.61
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	47,993,379.09	1.60
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	34,350,000.00	1.15
I	金融、保险业	955,023,835.30	31.91
J	房地产业	461,599,396.88	15.43
K	社会服务业	3,434,697.72	0.11
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	2,416,752,853.46	80.76

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	000024	招商地产	10,037,713	208,784,430.40	6.98
2	601318	中国平安	4,939,728	207,172,192.32	6.92
3	601601	中国太保	7,919,760	160,216,744.80	5.35
4	601398	工商银行	40,210,218	150,788,317.50	5.04
5	600276	恒瑞医药	4,275,600	129,593,436.00	4.33
6	600036	招商银行	12,604,733	128,064,087.28	4.28
7	600048	保利地产	11,799,831	126,966,181.56	4.24
8	600519	贵州茅台	459,969	113,060,380.20	3.78
9	002304	洋河股份	775,871	96,983,875.00	3.24
10	002415	海康威视	3,121,183	86,519,192.76	2.89

5.4 报告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。

5.5 报告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。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	3,335,789.31
2	应收证券清算款	47,750,449.49
3	应收股利	1,264,654.15
4	应收利息	295,025.20
5	应收申购款	31,892.72
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	52,677,810.87

5.8.4 报告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。

5.8.5 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情况。

5.8.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	1,600,096,791.00
报告期期间基金总申购份额	4,686,130,348.60
减：报告期期间基金总赎回份额	779,961,807.06
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	5,506,265,332.54

§7 备查文件目录

7.1备查文件目录

1、信诚精萃成长股票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、信诚精萃成长股票型证券投资基金基金合同
4、信诚精萃成长股票型证券投资基金招募说明书
5、本报告期内按照规定披露的各项公告

7.2存放地点

信诚基金管理有限公司办公地——上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层。

7.3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.citicprufunds.com.cn。

信诚基金管理有限公司
2012年10月24日

信诚金砖四国积极配置证券投资基金（LOF）

【2012】第三季度报告

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：2012年10月24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2012年10月22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2012年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	信诚金砖四国积极配置(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
报告期末基金份额总额	79,980,054.33份
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	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
境外投资顾问	英文名称：Eastspring Investments（Singapore）Limited 中文名称：瀚亚投资(新加坡)有限公司
境外资产托管人	英文名称：Bank of China（Hong Kong）Limited 中文名称：中国银行(香港)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7月1日至2012年9月30日)
1.本期已实现收益	-1,243,855.84
2.本期利润	2,953,410.13
3.加权平均基金份额本期利润	0.0366
4.期末基金资产净值	64,158,946.60
5.期末基金份额净值	0.802

注：1.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。

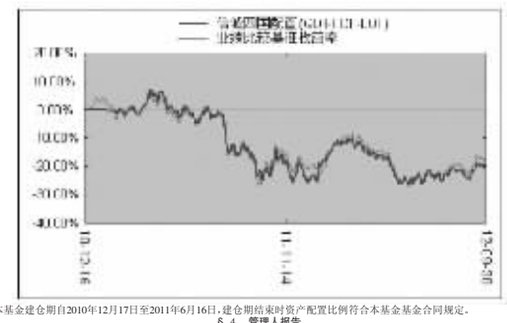
2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

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

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
2012年第3季度	4.70%	0.92%	6.71%	0.91%	-2.01%	0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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。

§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		
刘儒明	本基金基金经理，信诚基金管理有限公司海外投资副总监	2010年12月17日	-	18	18年证券、基金从业经验，其中包含8年海外基金经理的专业资历。曾先后任职于永昌证券投资信托股份有限公司、富邦证券投资信托股份有限公司、金复华证券投资信托股份有限公司、台湾工银证券投资信托股份有限公司和富国基金管理有限公司境外投资部，均从事证券投资研究工作，并曾担任股票型基金和基金中的基金(FOF)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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

姓名	在境外投资顾问所任职务	证券从业年限	说明
Kelvin Blacklock	全球资产配置团队(GAA)的首席投资官	22	Kelvin Blacklock先生曾就职于施罗德投资管理公司长达11年之久。他曾在伦敦担任固定收益团队的基金经理，主要关注G10的债券市场及汇率市场；之后他分别在香港和新加坡相继负责组建施罗德亚洲的新兴市场债券团队。
Nick Ferres	全球资产配置团队投资总监	15	Nick Ferres先生曾在澳大利亚任Goldman Sachs JBWere资产管理公司的平衡型基金的策略师及组合经理，管理资产规模为12亿澳元。据晨星数据，他所管理的基金Goldman Sachs JBWere分散化成长基金五年业绩排名在前四分之一位。

4.3 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 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v1.2》，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，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。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

报告期内本基金未有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。

4.5 报告期内基金的投资策略和运作分析

2012年第三季金砖四国股票市场呈现上涨态势。在欧洲央行推出直接货币交易计划（OMT）、德国宪法法院裁决批准欧洲稳定基金（ESM）和美国宣布购入机构按揭证券方案的第三波量化宽松政策（QE3）后，新兴市场股票市场因为各主要国家的货币放松政策激励而走势变强。欧洲央行推出OMT计划已经使得西班牙、意大利等国债收益率大幅下降。美联储将失业率及名义GDP增长作为政策参考依据，在失业率及名义GDP增长恢复到危机前水平之前，在通胀可控的范围内，QE3不会停止，对风险资产的支持时间可能较长。这些宽松货币政策均有助于推动海外资金流入新兴市场。

从2012年第三季经济基本面看，美国方面，经济数据表现不一，就业市场缓慢改善，制造业不振，但房地产市场似乎见底回升，服务业温和扩张，个人消费支出上扬，总体上来看，美国经济缓慢复苏。在欧元区方面，整体温和衰退，各国间差异颇大，包括德国在内的欧洲多国制造业持续不振，德国在欧元区中，表现较好，西班牙和意大利因财政紧缩束缚，经济前景不佳，但或许在随着欧债危机和财政紧缩压力缓解，欧洲经济有望温和复苏。在新兴市场方面，数据显示，中国和巴西的制造业已经缓慢收缩，巴西经济由于受到大环境影响仍可能导致内需减缓，若全球景气无明显复苏迹象，巴西今年经济成长率有为2%，但是巴西有财政盈余，税收稳定，有能力采取减税等优惠政策刺激经济及消费成长，而且巴西通胀在可控范围内，这也给巴西货币政策放松的空间。俄罗斯第三季的零售及就业等经济指标都比预期略好，失业率续降，可以看出俄罗斯内需缓慢升温，因此俄罗斯央行对于降息会比较保守谨慎。印度第三季的汽车销售成长和出口都表现不佳，但印度宣布推行减贫及私有化活动，并重启基础建设的计划，对于外资采取更为开放的态度，这些政策将有助于激励资金回流股票市场，为一个方面。

印度央行第三季继续执行较宽松的货币政策，油价走跌将会降低通膨压力，但印度南季目前降雨量不如预期，要密切观察农产品价格走势。中国方面，第三季的采购经理人指数、进出口与零售销售等经济指标疲弱，不过由于宽松政策带动，投资增速优于预期，房地产景气恢复稳定，稳成长仍是中国的政策目标，未来可望加大基础建设投资。整体来看，目前新兴市场整体通胀较为温和，货币政策仍有放松的空间，但要观察农产品价格飙升带来输入性通胀压力及欧美国家新一轮的宽松政策可能推高通胀率，未来随着发达国家经济增速缓慢回稳，新兴市场经济也有望随之反弹。

在第三季时，本基金的净值上涨，但落后基准，主要原因在于在第三季本基金主要持股的涨势暂时较为落后，但未来仍有表现空间。展望未来，全球经济目前虽走缓，但在各国的货币放松政策激励下，股票市场或许有持续上涨反弹机会，可谨慎参与，未来重点还是在选股上。在选股上，应该特别留意未来半年内业绩不错或超过预期的个股。操作策略上以稳健均衡为主，参与行情，把握个股机会。

4.6 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金单位净值为0.802元，报告期内累计净值增长率为4.70%，同期比较基准的累计收益率为6.71%，基金净值落后比较基准2.01%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	15,326,719.64	23.62
	其中：普通股	15,326,719.64	23.62
	优先股	-	-
	存托凭证	-	-
2	基金投资	43,313,429.58	66.75
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	4,697,950.09	7.24
8	其他资产	1,549,801.64	2.39
9	合计	64,887,900.95	100.00

5.2报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家(地区)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
中国香港	15,326,719.64	23.89
合计	15,326,719.64	23.89

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
工业	4,668,096.11	7.28
金融	3,391,564.97	5.29
必须消费品	1,355,626.61	2.11
材料	2,225,190.08	3.47
非必须消费品	2,703,712.92	4.21
能源	982,528.95	1.53
合计	15,326,719.64	23.89

注：本基金持有的股票及存托凭证采用全球行业分类标准 GICS)进行行业分类

5.4 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及存托凭证投资明细

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	CHINA EVER-BRIGHT	中国光大国际有限公司	257 HK	香港证券交易所	中国香港	1,295,000	4,342,215.29	6.77
2	CAFE DE CORAL HOLDIN	大家乐集团有限公司	341 HK	香港证券交易所	中国香港	152,000	2,703,712.92	4.21
3	SINOFERT HOLDING	中化化肥控股有限公司	297 HK	香港证券交易所	中国香港	1,144,000	1,422,090.84	2.22
4	SHIMAO PROPERTY	世茂房地产控股有限公司	813 HK	香港证券交易所	中国香港	127,500	1,390,989.15	2.17
5	TINGYI HLDG CO	康师傅控股有限公司	322 HK	香港证券交易所	中国香港	46,000	878,420.46	1.37
6	JIANGXI COPPER - H	江西铜业股份有限公司	358 HK	香港证券交易所	中国香港	50,000	803,099.24	1.25
7	CNOOC LTD	中国海洋石油有限公司	883 HK	香港证券交易所	中国香港	50,000	650,166.90	1.01
8	CHINA RES LAND LTD	华润置地有限公司	1109 HK	香港证券交易所	中国香港	46,000	642,544.82	1.00
9	CHINA PACIFIC-H	中国太平洋保险(集团)股份有限公司	2601 HK	香港证券交易所	中国香港	33,000	632,870.01	0.99
10	SUN HUNG KAI PROP	新鸿基地产发展有限公司	16 HK	香港证券交易所	中国香港	6,000	557,426.11	0.87

注：本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

5.4.1 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票及存托凭证投资明细

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	CHINA EVER-BRIGHT	中国光大国际有限公司	257 HK	香港证券交易所	中国香港	1,295,000	4,342,215.29	6.77
2	CAFE DE CORAL HOLDIN	大家乐集团有限公司	341 HK	香港证券交易所	中国香港	152,000	2,703,712.92	4.21
3	SINOFERT HOLDING	中化化肥控股有限公司	297 HK	香港证券交易所	中国香港	1,144,000	1,422,090.84	2.22
4	SHIMAO PROPERTY	世茂房地产控股有限公司	813 HK	香港证券交易所	中国香港	127,500	1,390,989.15	2.17
5	TINGYI HLDG CO	康师傅控股有限公司	322 HK	香港证券交易所	中国香港	46,000	878,420.46	1.37

5.5 报告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

5.6 报告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

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

5.8 报告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。

5.9 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基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(元)	占基金资产净值比例
1	MARKET VECTORS RUSSIA ETF	ETF基金	契约型开放式	VAN ECK ASSOCIATES CORP	8,222,384.85	12.82
2	ISHARES MSCI BRAZIL INDEX FUND	ETF基金	契约型开放式	BLACKROCK FUND ADVISORS	7,361,862.95	11.47
3	TRACKER FUND OF HONG KONG	ETF基金	契约型开放式	STATE STREET GLOBAL ADVISORS ASIA LT	7,006,877.30	10.92
4	ISHARES MSCI BRAZIL	ETF基金	契约型开放式	BLACKROCK ASSET MANAGEMENT IRELANDL	5,534,770.32	8.63
5	HANG SENG INVESTMENT INDEX FUNDS SERIES II-HSI ETF	ETF基金	契约型开放式	HANG SENG INVESTMENT MANAGEMENT LTD	5,233,524.60	8.16
6	ISHARES MSCI INDIA INDEX ETF	ETF基金	契约型开放式	BLACKROCK FUND ADVISORS	4,651,364.46	7.25
7	DB X TR-MSCI BRAZIL TRN INDEX ETF	ETF基金	契约型开放式	DB PLATINUM ADVISORS	3,470,728.30	5.41
8	HANG SENG INVESTMENT INDEX FUNDS SERIES-H-SHARE INDEX ETF	ETF基金	契约型开放式	HANG SENG INVESTMENT MANAGEMENT LTD	1,831,916.80	2.86

注：本基金本报告期末仅持有上述8只基金。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本基金本期投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

5.10.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	1,507,876.13
3	应收股利	41,131.16
4	应收利息	104.44
5	应收申购款	689.91
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,549,801.64

5.10.4 报告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。

5.10.5 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情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	81,794,465.40
报告期期间基金总申购份额	264,652.88
减：报告期期间基金总赎回份额	2,079,063.95
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	79,980,054.33

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、信诚金砖四国积极配置证券投资基金(LOF)相关批准文件
2、信诚基金管理有限公司营业执照、公司章程
3、信诚金砖四国积极配置证券投资基金(LOF)基金合同
4、信诚金砖四国积极配置证券投资基金(LOF)招募说明书
5、本报告期内按照规定披露的各项公告

7.2 存放地点

信诚基金管理有限公司办公地——上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层。

7.3 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.citicprufunds.com.cn。

信诚基金管理有限公司
2012年10月24日

信诚经典优债债券型证券投资基金

【2012】第三季度报告

基金管理人：信诚基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
报告送出日期：2012年10月24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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2012年10月19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2012年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	信诚经典优债债券
基金主代码	550006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年3月11日
报告期末基金份额总额	1,515,482,717.04份
投资目标	本基金在严格控制风险和维持资产较高流动性的基础上，通过主动管理，追求基金资产的长期稳定增值，力争获得超越业绩比较基准的投资收益率。
投资策略	本基金通过实施稳健