

信诚金砖四国积极配置证券投资基金(LOF)

[2015] 年 度 报 告 摘 要

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
报告期末：2015年6月30日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示
基金管理人的董事会、董事保证本基金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、完整性、及时性承担个别及连带的法律责任。本基金半年度报告已三分之二以上独立董事签字确认。
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2015年8月25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、净值公告、投资组合报告等信息，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预示其未来表现。投资人应当认真阅读基金合同、招募说明书及其更新、基金产品资料概要、定期报告和临时公告等信息披露文件，了解基金的具体情况，做出独立的投资决策，自行承担投资风险。

本报告期为2015年1月1日起至6月30日止。

§ 2 基金简介

基金名称	信诚金砖四国积极配置证券投资基金(LOF)
场内简称	信诚四国
基金代码	166100
基金上市方式	上证型开放式
基金的生效日	2010年12月17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
报告期末基金份额总额	64,390,562.07份
基金合同的存续期	不定期
基金类别	股票型证券投资基金
上市日期	2011年1月20日

2.1 基金基本情况

基金名称：信诚金砖四国积极配置证券投资基金(LOF)；场内简称：信诚四国；基金代码：166100；上市地点：上海证券交易所；基金上市方式：上证型开放式；基金的生效日：2010年12月17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；报告期末基金份额总额：64,390,562.07份。

报告期起止日期：2015年1月1日起至6月30日止。

2.2 基金简介

投资目标：通过对“金砖四国”各区域的经济和政治以及对“金砖四国”的相关ETF和股票的精挑细选，有效分散风险，追求基金份额的长期稳定增长。

投资策略：本基金将通过配置在“金砖四国”的股票类资产，从而获得市场收益。“金砖四国”是指巴西、俄罗斯、印度、中国这四个新兴市场国家，它们在政治、经济、社会、文化和市场地位方面具有较大的相似性。因此，本基金将配置的集中于这些国家的股票资产，同时，本基金将利用行业配置策略，在考虑宏观政策的同时，分散组合风险，从而达到降低风险、提高收益的目的。

投资范围：本基金主要投资于“金砖四国”的股票类资产，从而获得市场收益。“金砖四国”是指巴西、俄罗斯、印度、中国这四个新兴市场国家，它们在政治、经济、社会、文化和市场地位方面具有较大的相似性。因此，本基金将配置的集中于这些国家的股票资产，同时，本基金将利用行业配置策略，在考虑宏观政策的同时，分散组合风险，从而达到降低风险、提高收益的目的。

业绩比较基准：标准普尔巴西/中国/印度/俄罗斯指数。

风险收益特征：本基金主要投资于“金砖四国”的股票类资产，从而获得市场收益。“金砖四国”是指巴西、俄罗斯、印度、中国这四个新兴市场国家，它们在政治、经济、社会、文化和市场地位方面具有较大的相似性。因此，本基金将配置的集中于这些国家的股票资产，同时，本基金将利用行业配置策略，在考虑宏观政策的同时，分散组合风险，从而达到降低风险、提高收益的目的。

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 中国银行股份有限公司
姓名 徐世春 王永冰
联系电话 021-68040798 010-66948986
电子邮箱 shichengfund@ctepu.com.cn lcbankfundchina.com
客户服务电话 400-099-0006
传真 010-66949492
010-50120988

2.4 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 English Investors (Singapore) Limited Bank of China (Hong Kong) Limited
中文 麦理浩资本(新加坡)有限公司 中国银行(香港)有限公司
注册地址 新加坡 香港花园道1号中国大厦
办公地址 新加坡海花林荫路10号32楼01室, 海南 海南国际中心2座
邮政编码 019093 -

2.5 信息费率方式

报告期起止日期：2015年1月1日至2015年6月30日。

费用类型 金额(人民币)
申购费 0.65%
赎回费 0.32%
转换费 0.32%
定期定额投资扣款金额 279.38元

2.6 主要财务指标和基金净值表现

金额单位：人民币元

3.1 期间费用和指标 报告期起止日期：2015年1月1日至2015年6月30日
本期实现收益 -6,256,069.98
本期利润 -2,839,279.38
已扣税均匀份额本期利润 -0.0344
本期份额净值增长率 7.90%

3.2 期末未分配利润 报告期起止日期：2015年6月30日

金额单位：人民币元

3.3 主要数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.4 本期每十份可供基金份额净值 报告期起止日期：2015年1月1日至2015年6月30日

金额单位：人民币元

3.5 本期每十份可供基金份额净值增长率 报告期起止日期：2015年1月1日至2015年6月30日

金额单位：人民币元

3.6 本期每十份可供基金份额净值变动率 报告期起止日期：2015年1月1日至2015年6月30日

金额单位：人民币元

3.7 本期每十份可供基金份额净值增长率变动率 报告期起止日期：2015年1月1日至2015年6月30日

金额单位：人民币元

3.8 本期每十份可供基金份额净值变动率标准差 报告期起止日期：2015年1月1日至2015年6月30日

金额单位：人民币元

3.9 本期每十份可供基金份额净值变动率标准差系数 报告期起止日期：2015年1月1日至2015年6月30日

金额单位：人民币元

3.10 本期每十份可供基金份额净值变动率标准差系数的绝对值 报告期起止日期：2015年1月1日至2015年6月30日

金额单位：人民币元

3.11 本期每十份可供基金份额净值变动率标准差系数的绝对值系数 报告期起止日期：2015年1月1日至2015年6月30日

金额单位：人民币元

3.12 本期每十份可供基金份额净值变动率标准差系数的绝对值系数的绝对值 报告期起止日期：2015年1月1日至2015年6月30日

金额单位：人民币元

3.13 本期每十份可供基金份额净值变动率标准差系数的绝对值系数的绝对值系数 报告期起止日期：2015年1月1日至2015年6月30日

金额单位：人民币元

3.14 本期每十份可供基金份额净值变动率标准差系数的绝对值系数的绝对值系数的绝对值 报告期起止日期：2015年1月1日至2015年6月30日

金额单位：人民币元

3.15 本期每十份可供基金份额净值变动率标准差系数的绝对值系数的绝对值系数的绝对值系数 报告期起止日期：2015年1月1日至2015年6月30日

金额单位：人民币元

3.16 本期每十份可供基金份额净值变动率标准差系数的绝对值系数的绝对值系数的绝对值系数 报告期起止日期：2015年1月1日至2015年6月30日

金额单位：人民币元

3.17 本期每十份可供基金份额净值变动率标准差系数的绝对值系数的绝对值系数的绝对值系数 报告期起止日期：2015年1月1日至2015年6月30日

金额单位：人民币元

3.18 本期每十份可供基金份额净值变动率标准差系数的绝对值系数的绝对值系数的绝对值系数 报告期起止日期：2015年1月1日至2015年6月30日

金额单位：人民币元

3.19 本期每十份可供基金份额净值变动率标准差系数的绝对值系数的绝对值系数的绝对值系数 报告期起止日期：2015年1月1日至2015年6月30日

金额单位：人民币元

3.20 本期每十份可供基金份额净值变动率标准差系数的绝对值系数的绝对值系数的绝对值系数 报告期起止日期：2015年1月1日至2015年6月30日

金额单位：人民币元

3.21 本期每十份可供基金份额净值及其与同期业绩比较基准收益率的比较

金额单位：人民币元

3.22 本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率

注：1.本基金业绩指标不包括持有买入或卖出交易基金的各项费用,以计入费用后实际收益水平要低若干数字。
2.本期每十份可供基金份额净值变动率=当期可供基金份额净值减去前一交易日可供基金份额净值后的差额除以前一交易日可供基金份额净值。
3.本期可供分配利润=采用期末资产负债表中未分配利润与本期利润之和计算。

3.23 基金净值表现

报告期起止日期：2015年1月1日至2015年6月30日

金额单位：人民币元

3.24 基金合同期间的基金资产净值

报告期起止日期：2015年1月1日至2015年6月30日

金额单位：人民币元

3.25 基金合同期间的基金资产净值增长率

报告期起止日期：2015年1月1日至2015年6月30日

金额单位：人民币元

3.26 基金合同期间的基金资产净值增长率标准差

报告期起止日期：2015年1月1日至2015年6月30日

金额单位：人民币元

3.27 基金合同期间的基金资产净值增长率标准差系数

报告期起止日期：2015年1月1日至2015年6月30日

金额单位：人民币元

3.28 基金合同期间的基金资产净值增长率标准差系数的绝对值

报告期起止日期：2015年1月1日至2015年6月30日

金额单位：人民币元

3.29 基金合同期间的基金资产净值增长率标准差系数的绝对值系数

报告期起止日期：2015年1月1日至2015年6月30日

金额单位：人民币元

3.30 基金合同期间的基金资产净值增长率标准差系数的绝对值系数的绝对值

报告期起止日期：2015年1月1日至2015年6月30日

金额单位：人民币元

3.31 基金合同期间的基金资产净值增长率标准差系数的绝对值系数的绝对值系数

报告期起止日期：2015年1月1日至2015年6月30日

金额单位：人民币元

3.32 基金合同期间的基金资产净值增长率标准差系数的绝对值系数的绝对值系数的绝对值

报告期起止日期：2015年1月1日至2015年6月30日

金额单位：人民币元

3.33 基金合同期间的基金资产净值增长率标准差系数的绝对值系数的绝对值系数的绝对值系数

报告期起止日期：2015年1月1日至2015年6月30日

金额单位：人民币元

3.34 基金合同期间的基金资产净值增长率标准差系数的绝对值系数的绝对值系数的绝对值系数

报告期起止日期：2015年1月1日至2015年6月30日

金额单位：人民币元

3.35 基金合同期间的基金资产净值增长率标准差系数的绝对值系数的绝对值系数的绝对值系数

报告期起止日期：2015年1月1日至2015年6月30日

金额单位：人民币元

3.36 基金合同期间的基金资产净值增长率标准差系数的绝对值系数的绝对值系数的绝对值系数

报告期起止日期：2015年1月1日至2015年6月30日

金额单位：人民币元

3.37 基金合同期间的基金资产净值增长率标准差系数的绝对值系数的绝对值系数的绝对值系数

报告期起止日期：2015年1月1日至2015年6月30日

金额单位：人民币元

3.38 基金合同期间的基金资产净值增长率标准差系数的绝对值系数的绝对值系数的绝对值系数

报告期起止日期：2015年1月1日至2015年6月30日

金额单位：人民币元

3.39 基金合同期间的基金资产净值增长率标准差系数的绝对值系数的绝对值系数的绝对