

信诚金砖四国积极配置证券投资基金(LOF)

[2017] 第一季度报告

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
报告送达日期:2017年4月21日
§ 1 需要提示
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。
基金托管人对本基金履行了监督职责，但不对具体内容负责。基金托管人对本报告的内容不负责任，但保证基金一定盈利。

基金销售机构在向投资人提供服务时，应提示投资人注意投资风险，投资人应当以书面形式对所投资基金的说明书进行书面确认。

本报告出自基金管理人2017年3月31日。

本报告出自基金管理人2017年3月31日。

§ 2 基金产品概况

基金简称	信诚金砖四国积极配置证券投资基金(LOF)
场内简称	信诚金砖
基金主代码	166610
基金运作方式	上市开放式基金
基金合同生效日	2010年12月17日
报告期末基金份额总额	22,888,337份
投资目标	通过“金砖四国”各地区的积极配置，以及对“金砖四国”相关地区的深入研究，实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	资产配置策略：在类属资产类别之间配置；行业配置策略：优先配置于资源类行业，其次配置于金融类行业，同时配置于消费类行业；区域配置策略：优先配置于资源类国家，其次配置于金融类国家，同时配置于消费类国家；风格配置策略：优先配置于周期类股票，其次配置于稳定增长类股票，同时配置于价值类股票。
业绩比较基准	业绩比较基准：人民币计价的GDI/GDP-FCPI-LCP
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期收益及风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。
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	
单位:人民币元	
主要财务指标	报告期(2017年1月1日至2017年3月31日)
1.本期已实现收益	641,397,069
2.本期利润	706,756,73
3.加权平均基金份额本期利润	0.0326
4.期末基金资产净值	17,137,016.02
5.049	

序号	公司名称(英文)	公司简称	证券代码	所在证券市场	所列国家或地区	数量(股)	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例(%)
1	NINTENDO LTD.	任天堂	NTDOY US	美国	3,800	70,822.21	4.44	
2	NEOTEKER AUTOMOTIVE LTD.	耐特克	1356 HK	香港证券交易所	73,000	742,707.36	4.23	
3	ORANGE CHINA LTD.	欧朗	1628 HK	香港证券交易所	14,400	400,230.34	2.69	
4	RELIANCE TELCO MFG. LTD.	仁和	1818 HK	香港证券交易所	47,000	434,799.27	2.54	
5	SHENZHEN KINETIC MFG. LTD.	芯力学	001 HK	香港证券交易所	60,400	430,443.21	2.51	
6	GALAXY ENTERTAINMENT LTD.	新濠国际	29 HK	香港证券交易所	9,000	329,918.10	1.98	
7	BYD ELECTRIC CO LTD.	比亚迪	281 HK	香港证券交易所	35,000	336,584.62	1.96	
8	ALIBABA GROUP HOLDING LTD.	阿里巴巴	BA BA US	纽约	400	207,500.01	1.14	
9	TELECOM HOLDINGS LTD.	电信盈科	700 HK	香港证券交易所	1,500	206,699.42	1.13	
10	KINGPORT CORP HOLDING LTD.	金港控股	3888 HK	香港证券交易所	15,000	284,930.00	1.66	

注:本基金持有的股票及存托凭证采用直接交易类行业标准(GICS)进行分类。

§ 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资产支持证券投资明细

§ 5 主要财务指标

报告期(2017年1月1日至2017年3月31日)

1.本期已实现收益

641,397,069

2.本期利润

706,756,73

3.加权平均基金份额本期利润

0.0326

4.期末基金资产净值

17,137,016.02

5.049



注:本基金自2010年12月17日至2011年6月16日，建仓期满后资产配置比例符合本基金合同规定。

§ 6 管理人报告

姓名	职务	任本基金的基金经理(或基金经理助理) 任职日期	离任日期
刘明丽	本基金基金经理,信诚基金管理有限公司 执行董事兼总经理 FOF-FOIP-FOIP-FOIP FOF-FOIP-FOIP-FOIP FOF-FOIP-FOIP-FOIP	2010年12月17日	-

注:上述任期内,刘明丽担任基金经理期间未有认购的免定期报告。

刘明丽的办公地址及办公电话从信诚基金管理有限公司处获得。

42. 继续聘任刘明丽为本基金基金经理的主要原因和说明

姓名	在本公司担任的职务	证券从业年限	说明
-	-	-	-

43. 报告期内本基金未运用过资金投资的情况

在本基金期间,本基金管理人未使用资金投资于股票基金、固定收益类基金、货币市场基金、QDII基金、商品基金等其他类型基金,也未投资于基金公司发起设立的基金。

本基金期间未投资于基金公司发起设立的基金。

4.4 公司公平交易制度的执行情况

根据法律法规和公司内部制度的规定,公司对旗下基金的交易行为进行了规范,对可能存在的不公平交易行为进行了监控,对异常交易行为及时采取了有效措施。

4.5 基金关联交易的说明

根据法律法规和公司内部制度的规定,公司对旗下基金的关联交易行为进行了规范,对可能存在的不公平交易行为及时采取了有效措施。

4.6 基金投资组合的重大变动

报告期内本基金投资组合的重大变动情况如下:

4.7 会计报表的批准报送情况

本基金的会计报表由基金管理人批准后对外披露。

4.8 报告期内基金投资组合每日前20名股票情况

4.9 报告期内基金投资组合前十重仓股情况

4.10 报告期内基金投资组合前十名债券情况

4.11 报告期内基金投资组合前十名资产支持证券投资情况

4.12 报告期内基金投资组合前十名贵金属情况

4.13 报告期内基金投资组合前五名权证及信用衍生品情况

4.14 报告期内基金投资组合投资组合偏离度情况

4.15 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.16 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.17 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.18 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.19 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.20 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.21 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.22 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.23 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.24 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.25 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.26 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.27 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.28 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.29 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.30 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.31 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.32 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.33 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.34 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.35 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.36 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.37 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.38 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.39 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.40 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.41 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.42 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.43 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.44 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.45 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.46 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.47 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.48 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.49 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.50 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.51 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.52 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.53 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.54 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.55 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.56 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.57 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.58 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.59 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.60 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.61 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.62 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.63 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.64 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.65 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.66 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.67 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.68 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.69 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.70 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.71 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.72 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.73 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.74 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.75 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.76 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.77 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.78 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.79 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.80 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.81 报告期内基金投资组合偏离度情况

4.82 报告期内基金投资组合偏离度情况