

信诚金砖四国积极配置证券投资基金（LOF）

2022 年中期报告

2022 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

报告送出日期：2022 年 08 月 27 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 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。本中期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 2022 年 08 月 26 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 2022 年 01 月 01 日起至 2022 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

|      |                                     |    |
|------|-------------------------------------|----|
| § 1  | 重要提示及目录                             | 2  |
| 1.1  | 重要提示                                | 2  |
| 1.2  | 目录                                  | 3  |
| § 2  | 基金简介                                | 5  |
| 2.1  | 基金基本情况                              | 5  |
| 2.2  | 基金产品说明                              | 5  |
| 2.3  | 基金管理人和基金托管人                         | 5  |
| 2.4  | 境外投资顾问和境外资产托管人                      | 6  |
| 2.5  | 信息披露方式                              | 6  |
| 2.6  | 其他相关资料                              | 6  |
| § 3  | 主要财务指标和基金净值表现                       | 6  |
| 3.1  | 主要会计数据和财务指标                         | 6  |
| 3.2  | 基金净值表现                              | 7  |
| § 4  | 管理人报告                               | 8  |
| 4.1  | 基金管理人及基金经理情况                        | 8  |
| 4.2  | 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 10 |
| 4.3  | 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 10 |
| 4.4  | 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明             | 11 |
| 4.5  | 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 11 |
| 4.6  | 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 12 |
| 4.7  | 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 12 |
| 4.8  | 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明       | 12 |
| § 5  | 托管人报告                               | 12 |
| 5.1  | 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 13 |
| 5.2  | 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 13 |
| 5.3  | 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见      | 13 |
| § 6  | 半年度财务会计报告（未经审计）                     | 13 |
| 6.1  | 资产负债表                               | 13 |
| 6.2  | 利润表                                 | 14 |
| 6.3  | 净资产（基金净值）变动表                        | 15 |
| 6.4  | 报表附注                                | 16 |
| § 7  | 投资组合报告                              | 38 |
| 7.1  | 期末基金资产组合情况                          | 38 |
| 7.2  | 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布              | 38 |
| 7.3  | 期末按行业分类的权益投资组合                      | 38 |
| 7.4  | 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       | 38 |
| 7.5  | 报告期内权益投资组合的重大变动                     | 39 |
| 7.6  | 期末按债券信用等级分类的债券投资组合                  | 39 |
| 7.7  | 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      | 39 |
| 7.8  | 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   | 39 |
| 7.9  | 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   | 39 |
| 7.10 | 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      | 39 |

|      |                                     |    |
|------|-------------------------------------|----|
| 7.11 | 投资组合报告附注 .....                      | 40 |
| § 8  | 基金份额持有人信息 .....                     | 41 |
| 8.1  | 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....             | 41 |
| 8.2  | 期末上市基金前十名持有人 .....                  | 41 |
| 8.3  | 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....          | 41 |
| 8.4  | 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情况 .....  | 41 |
| 8.5  | 发起式基金发起资金持有份额情况 .....               | 41 |
| § 9  | 开放式基金份额变动 .....                     | 42 |
| § 10 | 重大事件揭示 .....                        | 42 |
| 10.1 | 基金份额持有人大会决议 .....                   | 42 |
| 10.2 | 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 .....   | 42 |
| 10.3 | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....        | 42 |
| 10.4 | 基金投资策略的改变 .....                     | 42 |
| 10.5 | 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....              | 42 |
| 10.6 | 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....      | 42 |
| 10.7 | 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....             | 43 |
| 10.8 | 其他重大事件 .....                        | 45 |
| § 11 | 影响投资者决策的其他重要信息 .....                | 46 |
| 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 ..... | 46 |
| 11.2 | 影响投资者决策的其他重要信息 .....                | 46 |
| § 12 | 备查文件目录 .....                        | 46 |
| 12.1 | 备查文件目录 .....                        | 47 |
| 12.2 | 存放地点 .....                          | 47 |
| 12.3 | 查阅方式 .....                          | 47 |

## § 2 基金简介

### 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） |
| 基金简称         | 信诚四国配置（QDII-FOF-LOF）  |
| 场内简称         | 信诚四国 LOF              |
| 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   | 14,115,087.20 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 01 月 20 日      |

注：自 2021 年 8 月 23 日起，本基金场内简称扩位为“信诚四国 LOF”。

### 2.2 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。<br>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。   |

### 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      |      | 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                                    | 许俊                   |
|         | 联系电话 | 021-68649788                          | 95566                |
|         | 电子邮箱 | hao.zhou@citicprufunds.com.cn         | fcid@bankofchina.com |
| 客户服务电话  |      | 400-666-0066                          | 95566                |
| 传真      |      | 021-50120895                          | 010-66594942         |
| 注册地址    |      | 中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 9 层 | 北京市西城区复兴门内大街 1 号     |
| 办公地址    |      | 中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 9 层 | 北京市西城区复兴门内大街 1 号     |
| 邮政编码    |      | 200120                                | 100818               |
| 法定代表人   |      | 涂一锴                                   | 刘连舸                  |

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。

## 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   | 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 |    | -      | -                                 |

## 2.5 信息披露方式

|                     |                          |
|---------------------|--------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 证券时报                     |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.citicprufunds.com.cn |
| 基金中期报告备置地点          | 基金管理人及基金托管人住所            |

## 2.6 其他相关资料

| 项目     | 名称             | 办公地址             |
|--------|----------------|------------------|
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司 | 北京市西城区太平桥大街 17 号 |

# § 3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 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（2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日） |
|---------------|---|

|                      |                          |
|----------------------|--------------------------|
| 本期已实现收益              | -497,164.84              |
| 本期利润                 | -765,368.89              |
| 加权平均基金份额本期利润         | -0.0465                  |
| 本期加权平均净值利润率          | -6.90%                   |
| 本期基金份额净值增长率          | -6.78%                   |
| <b>3.1.2 期末数据和指标</b> | <b>报告期末（2022年06月30日）</b> |
| 期末可供分配利润             | -4,601,454.33            |
| 期末可供分配基金份额利润         | -0.3260                  |
| 期末基金资产净值             | 9,513,632.87             |
| 期末基金份额净值             | 0.674                    |
| <b>3.1.3 累计期末指标</b>  | <b>报告期末（2022年06月30日）</b> |
| 基金份额累计净值增长率          | -32.60%                  |

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)扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 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      | 0.75%    | 1.45%       | -0.80%     | 1.37%         | 1.55%   | 0.08%  |
| 过去三个月      | 1.20%    | 1.35%       | -0.46%     | 1.28%         | 1.66%   | 0.07%  |
| 过去六个月      | -6.78%   | 1.45%       | -12.31%    | 1.70%         | 5.53%   | -0.25% |
| 过去一年       | -20.52%  | 1.20%       | -27.25%    | 1.40%         | 6.73%   | -0.20% |
| 过去三年       | -10.73%  | 1.41%       | -9.77%     | 1.30%         | -0.96%  | 0.11%  |
| 自基金合同生效起至今 | -32.60%  | 1.12%       | 21.34%     | 1.08%         | -53.94% | 0.04%  |

### 3.2.2 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



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 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 2022 年 6 月 30 日，本基金管理人管理的运作中基金为 79 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）、中信保诚中证 500 指数型证券投资基金（LOF）、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）、中信保诚沪深 300 指数型证券投资基金（LOF）、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）、中信保诚景华债券型证券投资基金、中信保诚至远动力混合型证券投资基金、信诚优质纯债债券型证券投资基金、信诚新兴产业混合型证券投资基金、中信保诚中证 800 医药指数型证券投资基金（LOF）、中信保诚中证 800 有色指数型证券投资基金（LOF）、中信保诚中证 800 金融指数型证券投资基金（LOF）、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、中信保诚中证 TMT 产业主题指数型证券投资基金（LOF）、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）、中信保诚中证信息安全指数型证券投资基金（LOF）、中信保诚中证智能家居指数型证券投资基金（LOF）、信诚中证建筑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、中信保诚嘉鸿债券型证券投资基金、中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金、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 3 个月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、中信保诚嘉裕五年定期开放债券型证券投资基金、中信保诚红利精选混合型证券投资基金、中信保诚嘉丰一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中信保诚中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、中信保诚中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、中信保诚景裕中短债债券型证券投资基金、中信保诚安鑫回报债券型证券投资基金、中信保诚成长动力混合型证券投资基金、中信保诚嘉润 66 个月定期开放债券型证券投资基金、中信保诚丰裕一年持有期混合型证券投资基金、中信保诚养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、中信保诚龙腾精选混合型证券投资基金、中信保诚盛裕一年持有期混合型证券投资基金、中信保诚养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、中信保诚弘远混合型证券投资基金、中信保诚前瞻优势混合型证券投资基金。

#### 4.1.2 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 |        |  |
| 顾凡丁 | 基金经理 | 2019年04月18日     | -    | 7      | 顾凡丁先生，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。现任信诚金砖四国积极配置证券投资基金（LOF）、信诚全球商品主题证券投资基金（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. 证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券基金从业人员范围的相关规定。

#### 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。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 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《信诚基金管理有限公司公平交易及异常交易管理制度》，公司采取了一系列的行动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，研究分析方面，公司通过统一的研究平台发布研究成果，并构建投资备选库、交易对手库、风格维度库等，确保所有投资经理在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；在交易端，公司管理的不同投资组合执行集中交易制度，不同投资组合同时同向交易同一证券时需通过交易系统内的公平交易程序，确保各投资组合享有公

平的交易执行机会：对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；同时，公司每个季度对旗下所有投资组合向交易、反向交易以及债券一级市场申购、非公开发行股票申购等交易进行统计分析，并要求相关投资组合经理对异常交易情况进行合理性解释。

本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

公司对旗下所有产品的交易价格、产品投资杠杆、集中度、反向交易等进行控制，事后根据《信诚基金管理有限公司公平交易及异常交易管理制度》定期对相关情况进行汇总和统计分析，相关情况由投资经理出具情况说明后签字确认。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。未发生主动投资杠杆超标情况。对于债券交易价格监控结果，每日、每周对现券、回购交易价格偏离及回购投资情况按照要求进行统计，并对需要上报的情况按时进行上报。

本报告期内，未发现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。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 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、印度和中国等新兴国家的权益资产。

报告期内，供需失衡和地缘冲突造成全球通胀高企，欧美国家经济受到冲击，同时美联储采取激进加息抑制通胀，造成国际美元回流，新兴市场走弱。另一方面，国内经济虽再次受到新冠疫情冲击，但政府采取多项积极措施应对国内风险及外需走弱，在疫情得到控制后市场得到修复，报告期内中国板块下跌 10.9%，香港板块下跌 6.6%；国际资金撤出印度，权益市场下跌 16.4%；巴西出口受到大宗商品价格波动影响，权益市场宽幅波动，最终收跌 7.0%。汇率方面：美元指数上涨 9.4%，人民币贬值 5.1%、港币贬值 0.6%、印度卢比贬值 5.9%、巴西雷亚尔升值 6.1%。

上半年基金严格控制风险，应对海外市场不确定性。

#### 4.4.2 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-6.78%，同期业绩比较基准收益率为-12.31%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为持续高通胀环境对欧美国家经济的冲击正在持续体现，美联储和欧央行采取激进加息策略，通过抑制需求应对高通胀，进一步降低了市场对中短期经济增长的预期。下半年全球或将延

续本轮弱经济下的货币收缩过程。另一方面，国内经济周期与欧美国家形成错位，在积极的政策引导下率先走出衰退阴影，利好中国和香港板块权益市场。

我们预期当前新兴市场较充分反映了全球经济下行和流动性收缩的不利因素，整体进入稳定整理窗口，若欧美通胀得到有效控制，货币紧缩预期改善，新兴市场或在中国和香港板块的带领下进入新一轮上行通道。我们将保持对全球经济及风险因素的关注和跟踪分析，力争在风险可控的前提下优化投资组合，为投资者获取更优回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。

本基金管理人设置了估值决策委员会，负责组织制定适当的估值政策和程序，并定期进行评估，在发生了影响估值政策和程序的有效性、适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值决策委员会包括下列成员：分管基金运营业务的领导、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。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所对管理人所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。基金经理不参与估值的具体流程，但若认为存在对相关投资品种估值有失公允的情况，可向估值决策委员会报告并提出相关意见和建议。

在每个估值日，本基金管理人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，托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。上述参与估值流程人员均具有估值业务所需的专业胜任能力及相关工作经历。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按合同约定提供相关投资品种的估值相关数据服务。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行过利润分配。该处理符合相关法律法规及《基金合同》约定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金自 2015 年 7 月 1 日起至 2022 年 6 月 30 日基金资产净值低于五千万元，已经连续六十个工作日以上，本基金管理人已按规定向中国证监会进行了报告并提交了解决方案。

## § 5 托管人报告

### 5.1 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”)在对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。

### 5.2 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。

### 5.3 托管人对本中期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”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”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。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 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: 2022 年 06 月 30 日

单位: 人民币元

| 资产         | 附注号     | 本期末<br>2022 年 06 月 30 日 | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|-------------------------|--------------------------|
| <b>资产:</b> |         |                         |                          |
| 银行存款       | 6.4.7.1 | 1,526,864.00            | 3,111,007.23             |
| 结算备付金      |         | -                       | -                        |
| 存出保证金      |         | -                       | -                        |
| 交易性金融资产    | 6.4.7.2 | 8,229,027.93            | 8,588,704.31             |
| 其中: 股票投资   |         | -                       | -                        |
| 基金投资       |         | 8,229,027.93            | 8,588,704.31             |
| 债券投资       |         | -                       | -                        |
| 资产支持证券投资   |         | -                       | -                        |
| 贵金属投资      |         | -                       | -                        |
| 其他投资       |         | -                       | -                        |
| 衍生金融资产     | 6.4.7.3 | -                       | -                        |

|               |            |                            |                             |
|---------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 买入返售金融资产      | 6.4.7.4    | -                          | -                           |
| 应收清算款         |            | -                          | -                           |
| 应收股利          |            | -                          | 3,980.21                    |
| 应收申购款         |            | 6,943.09                   | 7,606.54                    |
| 递延所得税资产       |            | -                          | -                           |
| 其他资产          | 6.4.7.5    | -                          | 128.34                      |
| 资产总计          |            | 9,762,835.02               | 11,711,426.63               |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2022年06月30日</b> | <b>上年度末<br/>2021年12月31日</b> |
| <b>负债：</b>    |            |                            |                             |
| 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     |            | -                          | -                           |
| 应付清算款         |            | -                          | -                           |
| 应付赎回款         |            | 136,111.58                 | 238,982.95                  |
| 应付管理人报酬       |            | 14,853.58                  | 16,685.24                   |
| 应付托管费         |            | 2,546.32                   | 2,860.34                    |
| 应付销售服务费       |            | -                          | -                           |
| 应付投资顾问费       |            | -                          | -                           |
| 应交税费          |            | -                          | -                           |
| 应付利润          |            | -                          | -                           |
| 递延所得税负债       |            | -                          | -                           |
| 其他负债          | 6.4.7.6    | 95,690.67                  | 90,900.64                   |
| 负债合计          |            | 249,202.15                 | 349,429.17                  |
| <b>净资产：</b>   |            |                            |                             |
| 实收基金          | 6.4.7.7    | 14,115,087.20              | 15,707,846.06               |
| 未分配利润         | 6.4.7.8    | -4,601,454.33              | -4,345,848.60               |
| 净资产合计         |            | 9,513,632.87               | 11,361,997.46               |
| 负债和净资产总计      |            | 9,762,835.02               | 11,711,426.63               |

注：截止本报告期末，基金份额净值 0.674 元，基金份额总额 14,115,087.20 份。

## 6.2 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：2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 项目             | 附注号     | 本期<br>2022年01月01<br>日至2022年06月<br>30日 | 上年度可比期间<br>2021年01月01日<br>至2021年06月30<br>日 |
|----------------|---------|---------------------------------------|--|
| <b>一、营业总收入</b> |         | -646,370.14                           | 448,080.15                                 |
| 1. 利息收入        |         | 1,658.35                              | 4,812.62                                   |
| 其中：存款利息收入      | 6.4.7.9 | 1,658.35                              | 4,812.62                                   |

|                            |          |             |            |
|----------------------------|----------|-------------|------------|
| 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                 |          | -           | -          |
| 证券出借利息收入                   |          | -           | -          |
| 其他利息收入                     |          | -           | -          |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）          |          | -481,945.92 | 537,235.79 |
| 其中：股票投资收益                  | 6.4.7.10 | -           | -          |
| 基金投资收益                     | 6.4.7.11 | -549,415.59 | 485,618.60 |
| 债券投资收益                     | 6.4.7.12 | -           | -          |
| 资产支持证券投资收益                 | 6.4.7.13 | -           | -          |
| 贵金属投资收益                    |          | -           | -          |
| 衍生工具收益                     | 6.4.7.14 | -           | -          |
| 股利收益                       | 6.4.7.15 | 67,469.67   | 51,617.19  |
| 其他投资收益                     |          | -           | -          |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）     | 6.4.7.16 | -268,204.05 | -61,125.76 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         |          | 92,870.06   | -56,663.29 |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         | 6.4.7.17 | 9,251.42    | 23,820.79  |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |          | 118,998.75  | 251,802.62 |
| 1. 管理人报酬                   |          | 96,514.47   | 163,726.76 |
| 2. 托管费                     |          | 16,545.37   | 28,067.50  |
| 3. 销售服务费                   |          | -           | -          |
| 4. 投资顾问费                   |          | -           | -          |
| 5. 利息支出                    |          | -           | -          |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |          | -           | -          |
| 6. 信用减值损失                  | 6.4.7.18 | -           | -          |
| 7. 税金及附加                   |          | 30.85       | -          |
| 8. 其他费用                    | 6.4.7.19 | 5,908.06    | 60,008.36  |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | -765,368.89 | 196,277.53 |
| 减：所得税费用                    |          | -           | -          |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |          | -765,368.89 | 196,277.53 |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |          | -           | -          |
| <b>六、综合收益总额</b>            |          | -765,368.89 | 196,277.53 |

### 6.3 净资产（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：2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日 |            |               |               |
|-----------------|--|------------|---------------|---------------|
|                 | 实收基金                                     | 其他综合<br>收益 | 未分配<br>利润     | 净资产合计         |
| 一、上期期末净资产（基金净值） | 15,707,846.06                            | -          | -4,345,848.60 | 11,361,997.46 |

|  |   |        |               |                |
|--|---|--------|---------------|----------------|
| 二、本期期初净资产（基金净值）                          | 15,707,846.06                                 | -      | -4,345,848.60 | 11,361,997.46  |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -1,592,758.86                                 | -      | -255,605.73   | -1,848,364.59  |
| （一）、综合收益总额                               | -   | -      | -765,368.89   | -765,368.89    |
| （二）、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）      | -1,592,758.86                                 | -      | 509,763.16    | -1,082,995.70  |
| 其中：1. 基金申购款                              | 6,188,054.51                                  | -      | -2,057,006.87 | 4,131,047.64   |
| 2. 基金赎回款                                 | -7,780,813.37                                 | -      | 2,566,770.03  | -5,214,043.34  |
| （三）、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） | -   | -      | -             | -              |
| 四、本期期末净资产（基金净值）                          | 14,115,087.20                                 | -      | -4,601,454.33 | 9,513,632.87   |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日 |        |               |                |
|  | 实收基金  | 其他综合收益 | 未分配利润         | 净资产合计          |
| 一、上期期末净资产（基金净值）                          | 17,941,530.46                                 | -      | -3,337,869.89 | 14,603,660.57  |
| 二、本期期初净资产（基金净值）                          | 17,941,530.46                                 | -      | -3,337,869.89 | 14,603,660.57  |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | 347,037.88                                    | -      | 551,471.38    | 898,509.26     |
| （一）、综合收益总额                               | -   | -      | 196,277.53    | 196,277.53     |
| （二）、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）      | 347,037.88                                    | -      | 355,193.85    | 702,231.73     |
| 其中：1. 基金申购款                              | 23,130,561.69                                 | -      | -3,277,692.53 | 19,852,869.16  |
| 2. 基金赎回款                                 | -22,783,523.81                                | -      | 3,632,886.38  | -19,150,637.43 |
| （三）、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） | -   | -      | -             | -              |
| 四、本期期末净资产（基金净值）                          | 18,288,568.34                                 | -      | -2,786,398.51 | 15,502,169.83  |

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：

张翔燕

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 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或工具：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、资产支持证券等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本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金合同中，“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，如台湾股票等。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监管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）。

#### 6.4.2 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〈年度报告和中期报告〉》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。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 06 月 30 日的财务状况以及 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日止期间的经营成果和基金净资产变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 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

除下文 6.4.5.1 会计政策变更的说明中涉及的变更外，本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金自 2022 年度起执行了财政部发布的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量（修订）》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移（修订）》、《企业会计准则第 24 号——套期会计（修订）》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报（修订）》（统称“新金融工具准则”）和 2022 年中国证监会发布的修订的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》。

##### (a) 新金融工具准则

根据财政部发布的新金融工具准则相关衔接规定,以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,本基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。

新金融工具准则修订了财政部于 2006 年颁布的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》和《企业会计准则第 24 号——套期保值》以及财政部于 2014 年修订的《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(统称“原金融工具准则”)。

新金融工具准则将金融资产划分为三个基本分类:(1)以摊余成本计量的金融资产;(2)以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产;及(3)以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。在新金融工具准则下,金融资产的分类是基于本基金管理金融资产的商业模式及该资产合同现金流量特征而确定。新金融工具准则取消了原金融工具准则中规定的持有至到期投资、贷款和应收款项及可供出售金融资产三个分类类别。根据新金融工具准则,嵌入衍生工具不再从金融资产的主合同中分拆出来,而是将混合金融工具整体适用关于金融资产分类的相关规定。

新金融工具准则以“预期信用损失”模型替代了原金融工具准则中的“已发生损失”模型。“预期信用损失”模型要求持续评估金融资产的信用风险,因此在新金融工具准则下,本基金信用损失的确认时点早于原金融工具准则。

本基金按照新金融工具准则的衔接规定,对新金融工具准则施行日(即 2022 年 1 月 1 日)未终止确认的金融工具的分类和计量(含减值)进行追溯调整。本基金未调整比较财务报表数据,将金融工具的原账面价值和在新金融工具准则施行日的新账面价值之间的差额计入 2022 年年初留存收益。

执行新金融工具准则对本基金资产负债表的影响汇总如下:

(i) 金融工具的分类影响

以摊余成本计量的金融资产

于 2021 年 12 月 31 日,本基金按照原金融工具准则以摊余成本计量的金融资产为银行存款、应收利息、应收股利和应收申购款,对应的账面价值分别为人民币 3,111,007.23 元、128.34 元、3,980.21

元和 7,606.54 元。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则以摊余成本计量的金融资产为银行存款、应收股利和应收申购款，对应的账面价值分别为人民币 3,111,135.57 元、3,980.21 元和 7,606.54 元。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为交易性金融资产，对应的账面价值为人民币 8,588,704.31 元。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为交易性金融资产，对应的账面价值为人民币 8,588,704.31 元。

以摊余成本计量的金融负债

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费和其他负债，对应的账面价值分别为人民币 238,982.95 元、16,685.24 元、2,860.34 元和 90,900.64 元。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费和其他负债，对应的账面价值分别为人民币 238,982.95 元、16,685.24 元、2,860.34 元和 90,900.64 元。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产和卖出回购金融资产款等对应的应计利息余额均列示在应收利息或应付利息科目中。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则，将上述应计利息分别转入银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产和卖出回购金融资产款等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(ii) 采用“预期信用损失”模型的影响

“预期信用损失”模型适用于本基金持有的以摊余成本计量的金融资产。采用“预期信用损失”模

型未对本基金 2022 年年初留存收益产生重大影响。

(b) 修订的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》

本基金根据修订的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》编制财务报表时，调整了部分财务报表科目的列报和披露，未对财务报表列报和披露产生重大影响。

#### 6.4.5.2 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。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 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我们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。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2022 年 06 月 30 日 |
|----------------|-------------------------|
| 活期存款           | 1,526,864.00            |
| 等于：本金          | 1,526,789.42            |
| 加：应计利息         | 74.58                   |
| 定期存款           | —                       |
| 等于：本金          | —                       |
| 加：应计利息         | —                       |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | —                       |
| 存款期限 1-3 个月    | —                       |
| 存款期限 3 个月以上    | —                       |
| 其他存款           | —                       |
| 等于：本金          | —                       |
| 加：应计利息         | —                       |
| 合计             | 1,526,864.00            |

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2022 年 06 月 30 日 |      |      |        |
|----|-------------------------|------|------|--------|
|    | 成本                      | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
|    |                         |      |      |        |

|               |              |   |              |               |
|---------------|--------------|---|--------------|---------------|
| 股票            | -            | - | -            | -             |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -            | - | -            | -             |
| 债券            | 交易所市场        | - | -            | -             |
|               | 银行间市场        | - | -            | -             |
|               | 合计           | - | -            | -             |
| 资产支持证券        | -            | - | -            | -             |
| 基金            | 9,585,152.38 | - | 8,229,027.93 | -1,356,124.45 |
| 其他            | -            | - | -            | -             |
| 合计            | 9,585,152.38 | - | 8,229,027.93 | -1,356,124.45 |

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2022年06月30日 |
|-------------|--------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                  |
| 应付赎回费       | 512.61             |
| 应付证券出借违约金   | -                  |
| 应付交易费用      | -                  |
| 其中：交易所市场    | -                  |
| 银行间市场       | -                  |
| 应付利息        | -                  |
| 应付审计费       | 5,178.06           |
| 应付信息披露费     | 90,000.00          |
| 合计          | 95,690.67          |

### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日 |               |
|---------------|--|---------------|
|               | 基金份额（份）                                  | 账面金额          |
| 上年度末          | 15,707,846.06                            | 15,707,846.06 |
| 本期申购          | 6,188,054.51                             | 6,188,054.51  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -7,780,813.37                            | -7,780,813.37 |
| 本期末           | 14,115,087.20                            | 14,115,087.20 |

注：1、申购含红利再投（如有）、转换入份额（如有），赎回含转换出份额（如有）。

2、本基金本报告期末及上年度末场内外基金份额如下：

|        |      | 本报告期末        |              | 上年度末         |              |
|--------|------|--------------|--------------|--------------|--------------|
| 基金代码   | 基金名称 | 场内           | 场外           | 场内           | 场外           |
| 165510 | 信诚四国 | 5,047,181.00 | 9,067,906.20 | 8,307,557.00 | 7,400,289.06 |

## 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分         | 未实现部分       | 未分配利润合计       |
|----------------|---------------|-------------|---------------|
| 上年度末           | -4,235,048.68 | -110,799.92 | -4,345,848.60 |
| 本期利润           | -497,164.84   | -268,204.05 | -765,368.89   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 439,553.36    | 70,209.80   | 509,763.16    |
| 其中：基金申购款       | -1,834,174.33 | -222,832.54 | -2,057,006.87 |
| 基金赎回款          | 2,273,727.69  | 293,042.34  | 2,566,770.03  |
| 本期已分配利润        | -             | -           | -             |
| 本期末            | -4,292,660.16 | -308,794.17 | -4,601,454.33 |

## 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日 |
|-----------|--|
|           | 活期存款利息收入                                 |
| 定期存款利息收入  | -  |
| 其他存款利息收入  | -  |
| 结算备付金利息收入 | -  |
| 其他        | -  |
| 合计        | 1,658.35                                 |

注：其他包括直销申购款利息收入、结算保证金利息收入。

## 6.4.7.10 股票投资收益

## 6.4.7.10.1 股票投资收益—买卖股票差价收入

本基金本报告期内无股票投资收益。

#### 6.4.7.11 基金投资收益

单位：人民币元

| 项目                    | 本期<br>2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日 |
|-----------------------|--|
| 卖出/赎回基金成交总额           | 1,756,892.74                             |
| 减：卖出/赎回基金成本总额         | 2,300,271.76                             |
| 减：买卖基金差价收入应缴纳增值<br>税额 | 257.11                                   |
| 减：交易费用                | 5,779.46                                 |
| 基金投资收益                | -549,415.59                              |

#### 6.4.7.12 债券投资收益

##### 6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期内无债券投资收益。

##### 6.4.7.12.2 债券投资收益—买卖债券差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益-买卖债券差价收入。

#### 6.4.7.13 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

##### 6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益-买卖资产支持证券差价收入。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

##### 6.4.7.14.1 衍生工具收益—买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.14.2 衍生工具收益—其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具收益-其他投资收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|----|----|

|               | 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日 |
|---------------|------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | -                                  |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | -                                  |
| 基金投资产生的股利收益   | 67,469.67                          |
| 合计            | 67,469.67                          |

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期                                 |
|------------------------|------------------------------------|
|                        | 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日 |
| 1. 交易性金融资产             | -268,204.05                        |
| --股票投资                 | -                                  |
| --债券投资                 | -                                  |
| --资产支持证券投资             | -                                  |
| --基金投资                 | -268,204.05                        |
| --贵金属投资                | -                                  |
| --其他                   | -                                  |
| 2. 衍生工具                | -                                  |
| --权证投资                 | -                                  |
| 3. 其他                  | -                                  |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | -                                  |
| 合计                     | -268,204.05                        |

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期                                 |
|---------|------------------------------------|
|         | 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日 |
| 基金赎回费收入 | 9,251.42                           |
| 合计      | 9,251.42                           |

注：本基金的场内外赎回费率不高于 1.5%，随基金份额持有期限的增加而递减，赎回费不低于其总额的 25% 归入基金财产。

#### 6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期                                 |
|---------|------------------------------------|
|         | 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日 |
| 审计费用    | 5,178.06                           |
| 信息披露费   | -                                  |
| 证券出借违约金 | -                                  |

|      |          |
|------|----------|
| 银行费用 | 730.00   |
| 合计   | 5,908.06 |

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 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的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 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。

#### 6.4.10 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。

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 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股票交易。

###### 6.4.10.1.2 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权证交易。

###### 6.4.10.1.3 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应支付关联方的佣金。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2022年01月01日至2022<br>年06月30日 | 上年度可比期间<br>2021年01月01日至2021<br>年06月30日 |
|-----------------|-----------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 96,514.47                         | 163,726.76                             |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 32,215.39                         | 40,278.98                              |

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

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2022年01月01日至2022年<br>06月30日 | 上年度可比期间<br>2021年01月01日至2021<br>年06月30日 |
|----------------|-----------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 16,545.37                         | 28,067.50                              |

注：支付基金托管人中国银行股份有限公司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

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自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基金合同公布的费率执行, 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。

#### 6.4.10.5.2 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基金合同公布的费率执行, 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。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2022年01月01日至2022年06月30日 |          | 上年度可比期间<br>2021年01月01日至2021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  | 646,328.27                    | 1,658.35 | 1,058,992.51                       | 4,812.62 |
| 中银香港  | 880,535.73                    | -        | 2,026,792.81                       | -        |

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国银行股份有限公司保管, 按银行同业利率或约定利率计息。

#### 6.4.10.7 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。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 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。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

#### 6.4.12 期末 2022 年 06 月 30 日本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 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/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统进行持续监控。

公司风险管理组织体系包括董事会（及其下设的审计与风控委员会）、管理层（及其下设的经营层面风险管理委员会）及公司各业务部门层面。董事会对有效的风险管理承担最终责任，负责确定公司风险管理总体目标，制定公司风险管理战略和风险应对策略等等。董事会下设审计与风控委员会，根据董事会的授权履行相应的风险管理和监督职责。公司管理层对有效的风险管理承担直接责任，根据董事会的风险管理战略，制定与公司发展战略、整体风险承受能力相匹配的风险管理制度，确保风险管理制度全面、有效执行；批准重大事件、重大决策的风险评估意见和重大风险的解决方案等等。管理层下设经营层面风险管理委员会，负责指导、协调和监督各职能部门和各业务单元开展风险管理工作；识别公司各项业务所涉及各类重大风险，对重大事件、重大决策和重要业务流程的风险进行评估，制定重大风险的解决方案等等。各业务部门负责执行风险管理的基本制度流程，定期对本部门的风险进行评估，对其风险管理的有效性负责，并及时、准确、全面、客观地将本部门的风险信息和监测情况向管理层报告。同时，公司设立独立于业务体系汇报路径的风险管理部与监察稽核部，协调并与各业务部门共同配合完成公司整体风险管理工作。风险管理部和监察稽核部日常向督察长汇报工作。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管银行，本基金在选择定期存款存放的银行前通过审慎评估其信用风险并通过

额度控制的方法以控制银行存款的信用风险。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算,因此违约风险发生的可能性很小;本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。另外,本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程,审慎进行债券投资,通过信用评级和分散化投资以分散信用风险。

#### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

本基金于本报告期末及上年度末均未持有短期债券投资。

#### **6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金于本报告期末及上年度末均未持有短期资产支持证券投资。

#### **6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

本基金于本报告期末及上年度末均未持有短期同业存单投资。

#### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

本基金于本报告期末及上年度末均未持有长期债券投资。

#### **6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金于本报告期末及上年度末均未持有长期资产支持证券投资。

#### **6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

本基金于本报告期末及上年度末均未持有长期同业存单投资。

### **6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现,另一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额。

针对兑付赎回资金的流动性风险,本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求,保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款,约定在非常情况下赎回申请的处理方式,控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险,有效保障基金持有人利益。针对资产变现流动性风险,本基金管理人严格控制流通受限资产的投资限额,并及时追踪持仓证券的流动性情况,综合持有人赎回变动情况对流动

性风险进行管理。

本基金本报告期末所持有的全部金融负债无固定到期日或合同约定到期日均为一个月以内且不计息,可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金持有同一机构(政府、国际金融组织除外)发行的证券市值(不包括 ETF)不得超过基金净值的 10%。本基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产(不包括 ETF)不得超过基金资产净值的 10%,其中,持有任一国家或地区市场的证券资产(不包括 ETF)不得超过基金资产净值的 3%。本基金管理人管理的全部基金不得持有同一机构 10%以上具有投票权的证券发行总量。本基金管理人管理的全部基金持有任何一只境外基金,不得超过该境外基金总份额的 20%。每只境外基金投资比例不超过本基金基金资产净值的 20%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算,确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。本报告期末,本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

本报告期末,本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险,包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险,其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控,并通过调整投资组合的久

期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息,因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2022年06月30<br>日 | 1个月内       | 1-3个月 | 3个月-1年 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息          | 合计           |
|------------------------|------------|-------|--------|------|------|--------------|--------------|
| 资产                     |            |       |        |      |      |              |              |
| 银行存款                   | 646,328.27 | -     | -      | -    | -    | 880,535.73   | 1,526,864.00 |
| 结算备付金                  | -          | -     | -      | -    | -    | -            | -            |
| 存出保证金                  | -          | -     | -      | -    | -    | -            | -            |
| 交易性金融资产                | -          | -     | -      | -    | -    | 8,229,027.93 | 8,229,027.93 |
| 衍生金融资产                 | -          | -     | -      | -    | -    | -            | -            |
| 买入返售金融资产               | -          | -     | -      | -    | -    | -            | -            |
| 应收清算款                  | -          | -     | -      | -    | -    | -            | -            |
| 应收股利                   | -          | -     | -      | -    | -    | -            | -            |
| 应收申购款                  | -          | -     | -      | -    | -    | 6,943.09     | 6,943.09     |
| 递延所得税资产                | -          | -     | -      | -    | -    | -            | -            |
| 其他资产                   | -          | -     | -      | -    | -    | -            | -            |
| 资产总计                   | 646,328.27 | -     | -      | -    | -    | 9,116,506.75 | 9,762,835.02 |
| 负债                     |            |       |        |      |      |              |              |
| 短期借款                   | -          | -     | -      | -    | -    | -            | -            |
| 交易性金融负债                | -          | -     | -      | -    | -    | -            | -            |
| 衍生金融负债                 | -          | -     | -      | -    | -    | -            | -            |
| 卖出回购金融资产款              | -          | -     | -      | -    | -    | -            | -            |
| 应付清算款                  | -          | -     | -      | -    | -    | -            | -            |
| 应付赎回款                  | -          | -     | -      | -    | -    | 136,111.58   | 136,111.58   |
| 应付管理人报酬                | -          | -     | -      | -    | -    | 14,853.58    | 14,853.58    |
| 应付托管费                  | -          | -     | -      | -    | -    | 2,546.32     | 2,546.32     |
| 应付销售服务费                | -          | -     | -      | -    | -    | -            | -            |
| 应付投资顾问费                | -          | -     | -      | -    | -    | -            | -            |
| 应交税费                   | -          | -     | -      | -    | -    | -            | -            |
| 应付利润                   | -          | -     | -      | -    | -    | -            | -            |
| 递延所得税负债                | -          | -     | -      | -    | -    | -            | -            |
| 其他负债                   | -          | -     | -      | -    | -    | 95,690.67    | 95,690.67    |
| 负债总计                   | -          | -     | -      | -    | -    | 249,202.15   | 249,202.15   |
| 利率敏感度缺口                | 646,328.27 | -     | -      | -    | -    | 8,867,304.60 | 9,513,632.87 |
| 上年度末<br>2021年12月31     | 1个月以内      | 1-3个月 | 3个月-1年 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息          | 合计           |

|           |              |   |   |   |   |                |               |
|-----------|--------------|---|---|---|---|----------------|---------------|
| 日         |              |   |   |   |   |                |               |
| 资产        |              |   |   |   |   |                |               |
| 银行存款      | 1,273,975.20 | - | - | - | - | 1,837,032.03   | 3,111,007.23  |
| 结算备付金     | -            | - | - | - | - | -              | -             |
| 存出保证金     | -            | - | - | - | - | -              | -             |
| 交易性金融资产   | -            | - | - | - | - | 8,588,704.31   | 8,588,704.31  |
| 衍生金融资产    | -            | - | - | - | - | -              | -             |
| 买入返售金融资产  | -            | - | - | - | - | -              | -             |
| 应收清算款     | -            | - | - | - | - | -              | -             |
| 应收股利      | -            | - | - | - | - | 3,980.21       | 3,980.21      |
| 应收申购款     | -            | - | - | - | - | 7,606.54       | 7,606.54      |
| 递延所得税资产   | -            | - | - | - | - | -              | -             |
| 其他资产      | -            | - | - | - | - | 128.34         | 128.34        |
| 资产总计      | 1,273,975.20 | - | - | - | - | 10,437,451.43  | 11,711,426.63 |
| 负债        |              |   |   |   |   |                |               |
| 短期借款      | -            | - | - | - | - | -              | -             |
| 交易性金融负债   | -            | - | - | - | - | -              | -             |
| 衍生金融负债    | -            | - | - | - | - | -              | -             |
| 卖出回购金融资产款 | -            | - | - | - | - | -              | -             |
| 应付清算款     | -            | - | - | - | - | -              | -             |
| 应付赎回款     | -            | - | - | - | - | 238,982.95     | 238,982.95    |
| 应付管理人报酬   | -            | - | - | - | - | 16,685.24      | 16,685.24     |
| 应付托管费     | -            | - | - | - | - | 2,860.34       | 2,860.34      |
| 应付销售服务费   | -            | - | - | - | - | -              | -             |
| 应付投资顾问费   | -            | - | - | - | - | -              | -             |
| 应交税费      | -            | - | - | - | - | -              | -             |
| 应付利润      | -            | - | - | - | - | -              | -             |
| 其他负债      | -            | - | - | - | - | 90,900.64      | 90,900.64     |
| 负债总计      | -            | - | - | - | - | 349,429.17     | 349,429.17    |
| 利率敏感度缺口   | 1,273,975.20 | - | - | - | - | -10,088,022.26 | 11,361,997.46 |

注：上表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末及上年度末，本基金持有对利率敏感的金融资产与负债的比例较低。因此市场利率的变动对本基金资产的净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

汇率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的汇率风险。本基金管理人每日对本基

金的外汇头寸进行监控。

本报告期末，本基金各外币资产负债项目汇率风险敞口如下。出于列报考虑，风险敞口金额以人民币列示，以资产负债表日即期汇率折算。

#### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2022年06月30日  |              |               |               |
|---------------|---------------------|--------------|---------------|---------------|
|               | 美元<br>折合人民币         | 港币<br>折合人民币  | 其他币种<br>折合人民币 | 合计            |
| 以外币计价的资产      |                     |              |               |               |
| 银行存款          | 643,242.12          | 237,311.02   | 5.04          | 880,558.18    |
| 交易性金融资产       | 7,116,213.65        | 1,112,814.28 | -             | 8,229,027.93  |
| 资产合计          | 7,759,455.77        | 1,350,125.30 | 5.04          | 9,109,586.11  |
| 以外币计价的负债      |                     |              |               |               |
| 应付清算款         | -                   | -            | -             | -             |
| 负债合计          | -                   | -            | -             | -             |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | 7,759,455.77        | 1,350,125.30 | 5.04          | 9,109,586.11  |
| 项目            | 上年度末<br>2021年12月31日 |              |               |               |
|               | 美元<br>折合人民币         | 港币<br>折合人民币  | 其他币种<br>折合人民币 | 合计            |
| 以外币计价的资产      |                     |              |               |               |
| 银行存款          | 1,610,167.10        | 226,879.99   | 5.34          | 1,837,052.43  |
| 结算备付金         | -                   | -            | -             | -             |
| 存出保证金         | -                   | -            | -             | -             |
| 交易性金融资产       | 7,402,046.21        | 1,186,658.10 | -             | 8,588,704.31  |
| 衍生金融资产        | -                   | -            | -             | -             |
| 买入返售金融资产      | -                   | -            | -             | -             |
| 应收证券清算款       | -                   | -            | -             | -             |
| 应收利息          | -                   | -            | -             | -             |
| 应收股利          | 3,980.21            | -            | -             | 3,980.21      |
| 其他资产          | -                   | -            | -             | -             |
| 资产合计          | 9,016,193.52        | 1,413,538.09 | 5.34          | 10,429,736.95 |
| 以外币计价的负债      |                     |              |               |               |
| 应付证券清算款       | -                   | -            | -             | -             |
| 应付交易费用        | -                   | -            | -             | -             |
| 负债合计          | -                   | -            | -             | -             |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | 9,016,193.52        | 1,413,538.09 | 5.34          | 10,429,736.95 |

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

|    |                |
|----|----------------|
| 假设 | 除汇率以外的市场变量保持不变 |
|----|----------------|

| 分析                | 相关风险变量的变动         | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                          |
|-------------------|-------------------|-----------------------------|--------------------------|
|                   |                   | 本期末<br>2022 年 06 月 30 日     | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|                   | 所有外币相对人民币升值<br>5% | 455,479.31                  | 521,486.85               |
| 所有外币相对人民币贬值<br>5% | -455,479.31       | -521,486.85                 |                          |

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市的基金整体涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金持有同一机构（政府、国际金融组织除外）发行的证券市值（不包括 ETF）不得超过基金净值的 10%。本基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产（不包括 ETF）不得超过基金资产净值的 10%，其中，持有任一国家或地区市场的证券资产（不包括 ETF）不得超过基金资产净值的 3%。本基金管理人管理的全部基金不得持有同一机构 10% 以上具有投票权的证券发行总量。本基金管理人管理的全部基金持有任何一只境外基金，不得超过该境外基金总份额的 20%。每只境外基金投资比例不超过本基金基金资产净值的 20%。并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

本基金持有一定比例的证券交易所上市的基金，因此存在相应的其他价格风险。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2022 年 06 月 30 日 |                  | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |                  |
|---------------|-------------------------|------------------|--------------------------|------------------|
|               | 公允价值                    | 占基金资产净值<br>比例（%） | 公允价值                     | 占基金资产净<br>值比例（%） |
| 交易性金融资产—股票投资  | -                       | -                | -                        | -                |
| 交易性金融资产—基金投资  | 8,229,027.93            | 86.50            | 8,588,704.31             | 75.59            |
| 交易性金融资产—债券投资  | -                       | -                | -                        | -                |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | -                       | -                | -                        | -                |
| 衍生金融资产—权证投资   | -                       | -                | -                        | -                |
| 其他            | -                       | -                | -                        | -                |
| 合计            | 8,229,027.93            | 86.50            | 8,588,704.31             | 75.59            |

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

|    |                            |
|----|----------------------------|
| 假设 | 除业绩比较基准中的股票指数以外的其他市场变量保持不变 |
|----|----------------------------|

| 分析 | 相关风险变量的变动         | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                   |
|----|-------------------|-----------------------------|-------------------|
|    |                   | 本期末(2022年06月30日)            | 上年度末(2021年12月31日) |
|    | 业绩比较基准中的股票指数上升 5% | 332,977.15                  | 436,221.27        |
|    | 业绩比较基准中的股票指数下降 5% | -332,977.15                 | -436,221.27       |

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末<br>2022年06月30日 | 上年末<br>2021年12月31日 |
|---------------|--------------------|--------------------|
| 第一层次          | 8,229,027.93       | 8,588,704.31       |
| 第二层次          | -                  | -                  |
| 第三层次          | -                  | -                  |
| 合计            | 8,229,027.93       | 8,588,704.31       |

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，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，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

###### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(上年度末：无)。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于本报告期末，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

### § 7 投资组合报告

#### 7.1 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              | 8,229,027.93 | 84.29         |
| 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      | 1,526,864.00 | 15.64         |
| 8  | 其他各项资产            | 6,943.09     | 0.07          |
| 9  | 合计                | 9,762,835.02 | 100.00        |

#### 7.2 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权益投资。

#### 7.3 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权益投资。

#### 7.4 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权益投资。

## 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

### 7.5.1 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

本基金本报告期未进行权益投资交易。

### 7.5.2 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

本基金本报告期未进行权益投资交易。

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

本基金本报告期未进行权益投资交易。

## 7.6 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。

## 7.7 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。

## 7.8 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。

## 7.9 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。

## 7.10 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

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  | 契约型开放式 | SPDR S&P China ETF            | 1,668,163.70 | 17.53         |
| 2  | ISHARES MSCI CHINA ETF      | ETF  | 契约型开放式 | iShares MSCI China ETF        | 1,624,106.18 | 17.07         |
| 3  | ISHARES MSCI INDIA ETF      | ETF  | 契约型开放式 | iShares MSCI India ETF        | 1,621,566.12 | 17.04         |
| 4  | ISHARES MSCI HONG KONG ETF  | ETF  | 契约型开放式 | iShares MSCI Hong Kong ETF    | 1,144,266.85 | 12.03         |
| 5  | ISHARES CORE MSCI CHINA ETF | ETF  | 契约型开放式 | iShares Core MSCI China Index | 1,112,814.28 | 11.70         |
| 6  | ISHARES MSCI                | ETF  | 契约型开   | iShares MSCI                  | 460,849.89   | 4.84          |

|   |                                   |     |            |  |            |      |
|---|-----------------------------------|-----|------------|--|------------|------|
|   | BRAZIL ETF                        |     | 放式         | Brazil ETF                             |            |      |
| 7 | DRX DLY MSCI<br>INDIA BULL<br>3X  | ETF | 契约型开<br>放式 | Direxion Dai<br>ly MSCI Indi<br>a Bull | 383,008.52 | 4.03 |
| 8 | DIREXION DLY<br>BRAZIL BULL<br>2X | ETF | 契约型开<br>放式 | Direxion Dai<br>ly Brazil Bu<br>ll 3X  | 133,225.32 | 1.40 |
| 9 | DRX DLY CHIN<br>A ASHR BULL<br>2X | ETF | 契约型开<br>放式 | Direxion Dai<br>ly CSI 300 C<br>hina A | 81,027.07  | 0.85 |

## 7.11 投资组合报告附注

### 7.11.1 基金投资前十名证券的发行主体本期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、处罚说明

本基金投资的前十名证券的发行主体均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。

### 7.11.2 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

本基金本报告期末未持有股票投资,没有超过基金合同规定备选库之外的股票。

### 7.11.3 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  | 应收清算款 | -        |
| 3  | 应收股利  | -        |
| 4  | 应收利息  | -        |
| 5  | 应收申购款 | 6,943.09 |
| 6  | 其他应收款 | -        |
| 7  | 待摊费用  | -        |
| 8  | 其他    | -        |
| 9  | 合计    | 6,943.09 |

### 7.11.4 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。

### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票投资,不存在流通受限情况。

### 7.11.6 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 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 |
| 2,092    | 6,747.17  | 19,763.55 | 0.14%  | 14,095,323.65 | 99.86% |

### 8.2 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  | 邵常红   | 580,899.00 | 11.51%   |
| 2  | 丁文胜   | 393,061.00 | 7.79%    |
| 3  | 贺金宝   | 252,398.00 | 5.00%    |
| 4  | 高赛飞   | 196,500.00 | 3.89%    |
| 5  | 陈跃明   | 154,100.00 | 3.05%    |
| 6  | 刘泽放   | 128,249.00 | 2.54%    |
| 7  | 杨定功   | 101,812.00 | 2.02%    |
| 8  | 关亮华   | 100,000.00 | 1.98%    |
| 9  | 李家强   | 77,944.00  | 1.54%    |
| 10 | 周张辉   | 71,800.00  | 1.42%    |

### 8.3 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。

### 8.4 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<br>研究部门负责人持有本开放式基<br>金 | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基<br>金                    | 0                 |

注：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。

### 8.5 发起式基金发起资金持有份额情况

无

## § 9 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                    | 15,707,846.06  |
| 本报告期基金总申购份额                     | 6,188,054.51   |
| 减：本报告期基金总赎回份额                   | 7,780,813.37   |
| 本报告期基金拆分变动份额                    | -              |
| 本报告期期末基金份额总额                    | 14,115,087.20  |

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 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

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略无改变。

### 10.5 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（特殊普通合伙）。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。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，中国证券监督管理委员会上海监管局向本基金管理人出具处罚决定（已披露），并对公司及相关责任人员采取相关行政监管措施。基金管理人对此高度重视，积极开展整改工作，对具体问题进行深入整改，全面完善公司私募资产管理业务及其信息披露管理的内控制度体系和管理机制。前述事项对基金份额持有人利益无不利影响。

本报告期内，本基金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。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

## 10.7.1 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 |    |
| Bank of Nova Scotia (The)                          | 1      | -    | -            | 5,361.74  | 93.20%     | -  |
| Cathay Securities (Hong Kong) Limited              | 1      | -    | -            | 391.19    | 6.80%      | -  |
| China Merchants Securities (HK) Co. Ltd            | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| China Securities (International) Brokerage Co. Ltd | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| Shenwan Hongyuan Securities (H.K.) Limited         | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 安信证券   | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 长江证券   | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 德邦证券   | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 东方财富证券   | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 东方证券   | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 广发证券   | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 国盛证券   | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 国泰君安   | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 国信证券   | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 海通证券   | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 开源证券   | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 天风证券   | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 兴业证券   | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |

|      |   |   |   |   |   |
|------|---|---|---|---|---|
| 浙商证券 | 1 | - | - | - | - |
| 中信建投 | 4 | - | - | - | - |
| 中信证券 | 2 | - | - | - | - |

注：本基金根据券商的研究实力和服务水平选择专用席位。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。

### 10.7.2 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           |              |
|--|------|--------------|------|--------------|------|--------------|--------------|--------------|
|  | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 | 成交金额         | 占当期基金成交总额的比例 |
| Bank of Nova Scotia (The)                          | -    | -            | -    | -            | -    | -            | 3,574,447.82 | 90.13%       |
| Cathay Securities (Hong Kong) Limited              | -    | -            | -    | -            | -    | -            | 391,244.36   | 9.87%        |
| China Merchants Securities (HK) Co. Ltd            | -    | -            | -    | -            | -    | -            | -            | -            |
| China Securities (International) Brokerage Co. Ltd | -    | -            | -    | -            | -    | -            | -            | -            |
| Shenwan Hongyuan Securities (H.K.) Limited         | -    | -            | -    | -            | -    | -            | -            | -            |
| 安信证券   | -    | -            | -    | -            | -    | -            | -            | -            |
| 长江证券   | -    | -            | -    | -            | -    | -            | -            | -            |
| 德邦证券   | -    | -            | -    | -            | -    | -            | -            | -            |
| 东方财富证券   | -    | -            | -    | -            | -    | -            | -            | -            |
| 东方证券   | -    | -            | -    | -            | -    | -            | -            | -            |
| 广发证券   | -    | -            | -    | -            | -    | -            | -            | -            |
| 国盛证券   | -    | -            | -    | -            | -    | -            | -            | -            |
| 国泰君安   | -    | -            | -    | -            | -    | -            | -            | -            |

|      |   |   |   |   |   |   |   |   |
|------|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 开源证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 天风证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 浙商证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |

注：本基金根据券商的研究实力和服务水平选择专用席位。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。

## 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项  | 法定披露方式                         | 法定披露日期      |
|----|---|--------------------------------|-------------|
| 1  | 信诚金砖四国积极配置证券投资基金（LOF）因境外主要市场节假日暂停申赎及定投业务的公告 | 《证券时报》及/或基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2022年01月14日 |
| 2  | 信诚金砖四国积极配置证券投资基金（LOF）2021 年第四季度报告           | 同上                             | 2022年01月21日 |
| 3  | 中信保诚基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年第四季度报告提示性公告        | 同上                             | 2022年01月21日 |
| 4  | 信诚金砖四国积极配置证券投资基金（LOF）因境外主要市场节假日暂停申赎及定投业务的公告 | 同上                             | 2022年02月18日 |
| 5  | 信诚金砖四国积极配置证券投资基金（LOF）2021 年年度报告             | 同上                             | 2022年03月31日 |
| 6  | 中信保诚基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年年度报告提示性公告          | 同上                             | 2022年03月31日 |
| 7  | 信诚金砖四国积极配置证券投资基金（LOF）因境外主要市场节假日暂停申赎及定投业务的公告 | 同上                             | 2022年04月14日 |
| 8  | 信诚金砖四国积极配置证券投资基金（LOF）2022 年第一季度报告           | 同上                             | 2022年04月21日 |
| 9  | 中信保诚基金管理有限公司旗下全部基金 2022 年第一季度报告提示性公告        | 同上                             | 2022年04月21日 |
| 10 | 信诚金砖四国积极配置证券投资基金（LOF）因境外主要市场节假日暂停申赎及定投业务的公告 | 同上                             | 2022年05月06日 |
| 11 | 信诚金砖四国积极配置证券投资基金（LOF）因境外主要市场节假日暂停申赎及定投业务的公告 | 同上                             | 2022年05月27日 |

|    |   |    |             |
|----|---|----|-------------|
| 12 | 信诚金砖四国积极配置证券投资基金(LOF)更新招募说明书(2022年5月)       | 同上 | 2022年05月31日 |
| 13 | 信诚金砖四国积极配置证券投资基金(LOF)基金产品资料概要更新             | 同上 | 2022年05月31日 |
| 14 | 信诚金砖四国积极配置证券投资基金(LOF)因境外主要市场节假日暂停申赎及定投业务的公告 | 同上 | 2022年06月17日 |
| 15 | 信诚金砖四国积极配置证券投资基金(LOF)因境外主要市场节假日暂停申赎及定投业务的公告 | 同上 | 2022年06月30日 |

## § 11 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

| 投资者类别   | 报告期内持有基金份额变化情况 |  |              |      |              | 报告期末持有基金情况 |      |
|---|----------------|--|--------------|------|--------------|------------|------|
|   | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间                          | 期初份额         | 申购份额 | 赎回份额         | 持有份额       | 份额占比 |
| 机构  |                |  |              |      |              |            |      |
| 个人  | 1              | 2022-01-01 至 2022-02-13, 2022-02-17 至 2022-02-28 | 3,240,317.00 | -    | 3,240,317.00 | -          | -    |
| 产品特有风险  |                |  |              |      |              |            |      |
| <p>本基金如果出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%，则面临大额赎回的情况，可能导致：</p> <p>(1) 基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20% 的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上(含本数)发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；</p> <p>(2) 基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；</p> <p>(3) 因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；</p> <p>(4) 基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；</p> <p>(5) 大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。</p> |                |  |              |      |              |            |      |

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

## § 12 备查文件目录

## 12.1 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、中信保诚基金管理有限公司营业执照
- 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

## 12.2 存放地点

基金管理人和/或基金托管人住所。

## 12.3 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](http://www.citicprufunds.com.cn)。

中信保诚基金管理有限公司

2022 年 08 月 27 日