

信诚周期轮动股票型证券投资基金(LOF)

2015 第二季度 报告

2015年6月30日

基金管理人:信诚基金管理有限公司
基金资产人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:2015年7月20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。

基金管理人中信银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2015年7月17日发布了本报告中财务报告、净值表现和投资组合报告等内容,保证复利内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

基金的过往业绩并不预示其未来表现,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。

本报告财务资料未经审计。
本报告日期2015年6月30日止。

2 基金产品概况

基金名称	信诚周期轮动股票
场内简称	信诚周期
基金代码	166516
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年5月21日
报告期末基金份额总额	402,632,782.25份
投资目标	在深入分析宏观经济形势的基础上,本基金根据行业与宏观经济发展的联动特点,动态调整行业及个股配置比例,在严格控制风险并保证流动性的前提下,谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采取行业轮动下的个股精选方法,即首先自上而下宏观经济发展情况,在严格控制风险的前提下,对宏观经济与行业景气度进行判断,确定行业配置策略;其次,在行业景气度提升的前提下,对行业景气度进行判断,确定行业配置策略;最后,在行业景气度提升的前提下,对行业景气度进行判断,确定行业配置策略。
业绩比较基准	80%×沪深300指数收益率+20%×中信周期指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金,预期长期收益高于混合型基金,业绩波动高于市场平均水平,属于中高风险、较高收益的品种。
基金管理人	信诚基金管理有限公司
基金资产人	中信银行股份有限公司

3.1 主要财务指标

3.1 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(2015年4月1日至2015年6月30日)
1.本期已实现收益	102,071,176.58
2.本期利润	1,516,086.26
3.加权平均基金份额本期利润	0.0029
4.期末基金资产净值	1,197,644,731.90
5.期末基金份额净值	2.975

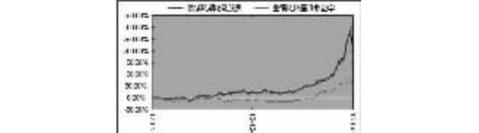
注:1.上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数据。

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。

3.2.1 本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
过去三个月	30.31%	2.87%	8.27%	2.69%	21.44%	0.78%

3.2.2 自基金合同生效以来基金资产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



4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
党光成	本基金基金经理 党光成,男,1973年11月11日出生,毕业于中央财经大学,2000年毕业于中央财经大学,获经济学硕士学位。2001年加入信诚基金管理有限公司,历任投资部副经理、基金经理助理、基金经理、信诚中证500指数证券投资基金基金经理。	2012年5月21日	-	11	CFA11年证书,基金从业年限,曾任政府机构(上市公司)财务总监,具有多年基金从业经验,2011年加入信诚基金管理有限公司,担任投资部副经理、基金经理助理、基金经理、信诚中证500指数证券投资基金基金经理。

注:1.上述任职日期、离任日期指本基金管理人对外披露的任职日期。

2.上述从业年限指中国证监会《证券投资基金销售管理办法》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

本基金管理人本着诚实信用、勤勉尽责的原则,严格按照法律法规的有关规定,在《信诚周期轮动股票型证券投资基金(LOF)基金合同》、《信诚周期轮动股票型证券投资基金(LOF)招募说明书》的约定下,勤勉尽责地管理和运用基金资产,本基金管理人不存在违法违规及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 公平交易专项说明的情况

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》以及公司制定的《信诚基金管理有限公司公平交易管理制度》,公司采取了一系列的措施来落实公平交易管理的各项要求,各部门公平交易执行中各司其职,投资研究部前端公平交易研究支持投资决策,确保投资组合享有公平的投资机会,建立公平交易的控制环境,交易执行部门严格执行公平交易系统公平交易程序,交易管理部严格执行公平交易系统的控制,确保公平交易制度的有效执行,同时不断完善和改进公平交易分析系统的程序,保证了公平交易制度的有效执行,当期公司整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易专项说明

本基金管理人发现本基金与其投资组合基金之间有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易,报告期内未出现参与交易所公开竞价同日反向交易成交的单元交易且超过该证券当日成交量5%的异常交易情况。

4.3.3 异常交易专项说明的情况

本基金管理人未发现本基金存在异常交易行为。

4.3.4 公平交易专项说明的情况

本基金管理人未发现本基金存在异常交易行为。

4.3.5 公平交易专项说明的情况

本基金管理人未发现本基金存在异常交易行为。

4.3.6 公平交易专项说明的情况

本基金管理人未发现本基金存在异常交易行为。

4.3.7 公平交易专项说明的情况

本基金管理人未发现本基金存在异常交易行为。

4.3.8 公平交易专项说明的情况

本基金管理人未发现本基金存在异常交易行为。

4.3.9 公平交易专项说明的情况

本基金管理人未发现本基金存在异常交易行为。

4.3.10 公平交易专项说明的情况

本基金管理人未发现本基金存在异常交易行为。

4.3.11 公平交易专项说明的情况

本基金管理人未发现本基金存在异常交易行为。

4.3.12 公平交易专项说明的情况

本基金管理人未发现本基金存在异常交易行为。

4.3.13 公平交易专项说明的情况

本基金管理人未发现本基金存在异常交易行为。

4.3.14 公平交易专项说明的情况

本基金管理人未发现本基金存在异常交易行为。

4.3.15 公平交易专项说明的情况

本基金管理人未发现本基金存在异常交易行为。

4.3.16 公平交易专项说明的情况

本基金管理人未发现本基金存在异常交易行为。

4.3.17 公平交易专项说明的情况

本基金管理人未发现本基金存在异常交易行为。

4.3.18 公平交易专项说明的情况

本基金管理人未发现本基金存在异常交易行为。

4.3.19 公平交易专项说明的情况

本基金管理人未发现本基金存在异常交易行为。

4.3.20 公平交易专项说明的情况

本基金管理人未发现本基金存在异常交易行为。

4.3.21 公平交易专项说明的情况

本基金管理人未发现本基金存在异常交易行为。

4.3.22 公平交易专项说明的情况

本基金管理人未发现本基金存在异常交易行为。

4.3.23 公平交易专项说明的情况

本基金管理人未发现本基金存在异常交易行为。

4.3.24 公平交易专项说明的情况

本基金管理人未发现本基金存在异常交易行为。

4.3.25 公平交易专项说明的情况

本基金管理人未发现本基金存在异常交易行为。

4.3.26 公平交易专项说明的情况

本基金管理人未发现本基金存在异常交易行为。

4.3.27 公平交易专项说明的情况

本基金管理人未发现本基金存在异常交易行为。

4.3.28 公平交易专项说明的情况

本基金管理人未发现本基金存在异常交易行为。

基金管理人:天弘基金管理有限公司
基金资产人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:2015年7月20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。

基金管理人中信银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2015年7月17日发布了本报告中财务报告、净值表现和投资组合报告等内容,保证复利内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

基金的过往业绩并不预示其未来表现,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。

本报告财务资料未经审计。
本报告日期2015年6月30日止。

2 基金产品概况

基金名称	天弘季加利理财
基金代码	000070
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年6月18日
报告期末基金份额总额	1,121,115,072.47份
投资目标	本基金为固定收益类基金,追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采取自上而下资产配置策略,在严格控制风险的前提下,谋求基金资产的长期增值。
业绩比较基准	3个月银行定期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为固定收益类基金,预期长期收益高于货币型基金,属于中低风险、较低收益的品种。
基金管理人	天弘基金管理有限公司
基金资产人	中信银行股份有限公司

3.1 主要财务指标

3.1 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(2015年4月1日至2015年6月30日)
1.本期已实现收益	1,027,711.27
2.本期利润	1,027,711.27
3.加权平均基金份额本期利润	0.0009
4.期末基金资产净值	1,121,115,072.47
5.期末基金份额净值	1.0000

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据。

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。

3.2.1 本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	净值收益率①	净值收益率标准差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
过去三个月	0.0000%	0.0000%	0.0000%	0.0000%	0.0000%	0.0000%

3.2.2 自基金合同生效以来基金资产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



4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
王峰	本基金基金经理 王峰,男,1978年11月11日出生,毕业于中央财经大学,2000年毕业于中央财经大学,获经济学硕士学位。2001年加入天弘基金管理有限公司,历任投资部副经理、基金经理助理、基金经理、天弘中证500指数证券投资基金基金经理。	2014年6月18日	-	6	天弘季加利理财基金基金经理。

注:1.上述任职日期、离任日期指本基金管理人对外披露的任职日期。

2.上述从业年限指中国证监会《证券投资基金销售管理办法》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

本基金管理人本着诚实信用、勤勉尽责的原则,严格按照法律法规的有关规定,在《天弘季加利理财基金(LOF)基金合同》、《天弘季加利理财基金(LOF)招募说明书》的约定下,勤勉尽责地管理和运用基金资产,本基金管理人不存在违法违规及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 公平交易专项说明的情况

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》以及公司制定的《天弘季加利理财基金(LOF)公平交易管理制度》,公司采取了一系列的措施来落实公平交易管理的各项要求,各部门公平交易执行中各司其职,投资研究部前端公平交易研究支持投资决策,确保投资组合享有公平的投资机会,建立公平交易的控制环境,交易执行部门严格执行公平交易系统公平交易程序,交易管理部严格执行公平交易系统的控制,确保公平交易制度的有效执行,同时不断完善和改进公平交易分析系统的程序,保证了公平交易制度的有效执行,当期公司整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易专项说明

本基金管理人未发现本基金存在异常交易行为。

4.3.3 异常交易专项说明的情况

本基金管理人未发现本基金存在异常交易行为。

4.3.4 公平交易专项说明的情况

本基金管理人未发现本基金存在异常交易行为。

4.3.5 公平交易专项说明的情况

本基金管理人未发现本基金存在异常交易行为。

4.3.6 公平交易专项说明的情况

本基金管理人未发现本基金存在异常交易行为。

4.3.7 公平交易专项说明的情况

本基金管理人未发现本基金存在异常交易行为。

4.3.8 公平交易专项说明的情况

本基金管理人未发现本基金存在异常交易行为。

4.3.9 公平交易专项说明的情况

本基金管理人未发现本基金存在异常交易行为。

4.3.10 公平交易专项说明的情况

本基金管理人未发现本基金存在异常交易行为。

4.3.11 公平交易专项说明的情况

本基金管理人未发现本基金存在异常交易行为。

4.3.12 公平交易专项说明的情况

本基金管理人未发现本基金存在异常交易行为。

4.3.13 公平交易专项说明的情况

本基金管理人未发现本基金存在异常交易行为。

4.3.14 公平交易专项说明的情况

本基金管理人未发现本基金存在异常交易行为。

4.3.15 公平交易专项说明的情况

本基金管理人未发现本基金存在异常交易行为。

4.3.16 公平交易专项说明的情况

本基金管理人未发现本基金存在异常交易行为。

4.3.17 公平交易专项说明的情况

本基金管理人未发现本基金存在异常交易行为。

4.3.18 公平交易专项说明的情况

本基金管理人未发现本基金存在异常交易行为。

4.3.19 公平交易专项说明的情况

本基金管理人未发现本基金存在异常交易行为。

4.3.20 公平交易专项说明的情况

本基金管理人未发现本基金存在异常交易行为。

4.3.21 公平交易专项说明的情况

本基金管理人未发现本基金存在异常交易行为。

4.3.22 公平交易专项说明的情况

本基金管理人未发现本基金存在异常交易行为。

4.3.23 公平交易专项说明的情况

本基金管理人未发现本基金存在异常交易行为。

4.3.24 公平交易专项说明的情况

本基金管理人未发现本基金存在异常交易行为。

4.3.25 公平交易专项说明的情况

本基金管理人未发现本基金存在异常交易行为。

4.3.26 公平交易专项说明的情况

本基金管理人未发现本基金存在异常交易行为。

4.3.27 公平交易专项说明的情况

本基金管理人未发现本基金存在异常交易行为。

4.3.28 公平交易专项说明的情况

本基金管理人未发现本基金存在异常交易行为。

天弘余额宝货币市场基金

2015 第二季度 报告

2015年6月30日

基金管理人:天弘基金管理有限公司
基金资产人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:2015年7月20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。

基金管理人中信银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2015年7月17日发布了本报告中财务报告、净值表现和投资组合报告等内容,保证复利内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

基金的过往业绩并不预示其未来表现,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。

本报告财务资料未经审计。
本报告日期2015年6月30日止。

2 基金产品概况

基金名称	天弘余额宝货币
基金代码	000198
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年5月29日
报告期末基金份额总额	613,380,565.513.07份
投资目标	本基金为货币市场基金,追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采取自上而下资产配置策略,在严格控制风险的前提下,谋求基金资产的长期增值。
业绩比较基准	同期三个月定期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为货币市场基金,属于证券投资基金中的低风险品种,其预期收益和风险均低于股票型基金、混合型基金及债券型基金。
基金管理人	天弘基金管理有限公司
基金资产人	中信银行股份有限公司

3.1 主要财务指标

3.1 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(2015年4月1日至2015年6月30日)
1.本期已实现收益	6,857,182,056.18
2.本期利润	6,857,182,056.18
3.期末基金资产净值	613,380,565.513.07

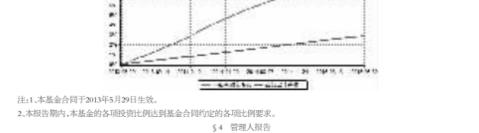
注:1.本基金为货币市场基金,其预期收益和风险均低于股票型基金、混合型基金及债券型基金。

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。

3.2.1 本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	净值收益率①	净值收益率标准差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
过去三个月	1.0152%	0.0008%	0.3418%	0.0006%	0.6734%	0.0008%

3.2.2 自基金合同生效以来基金资产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



4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
王峰	本基金基金经理 王峰,男,1978年11月11日出生,毕业于中央财经大学,2000年毕业于中央财经大学,获经济学硕士学位。2001年加入天弘基金管理有限公司,				