信诚理财7日盈债券型证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015年9月30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
报告送出日期:2015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2015年10月23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2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	信诚理财7日盈债券	
基金主代码	550012	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年11月27日	
报告期末基金份额总额	49,539,221.98份	
投资目标	本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,追求基金资产稳定增值,力争成为投资者短期理财的理想工具。	
投资策略	本基金将综合考虑各类投资品种的收益性、流动性和风险特征,在保证基金资产的安全性和流动性的基础上力争为投资人创造稳定的收益。同时,通过对国内外宏观经济走势、货币政策和财政政策的研究,结合对市场利率变动的预期,进行积极的投资组合管理。	
业绩比较基准	活期存款利率(税后)	
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的低风险品种,其预期风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。	
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	
下属分级基金的基金简称	信诚理财7日盈债券A	信诚理财7日盈债券B
下属分级基金的交易代码	550012	550013
报告期末下属分级基金的份额总额	49,539,221.98份	-份

§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	信诚理财7日盈债券A报告期(2015年7月1日至2015年9月30日)	信诚理财7日盈债券B报告期(2015年7月1日至2015年9月30日)
1.本期已实现收益	429,356.69	64,173.66
2.本期利润	429,356.69	64,173.66
3.期末基金资产净值	49,539,221.98	-

注: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,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

信诚理财7日盈债券A

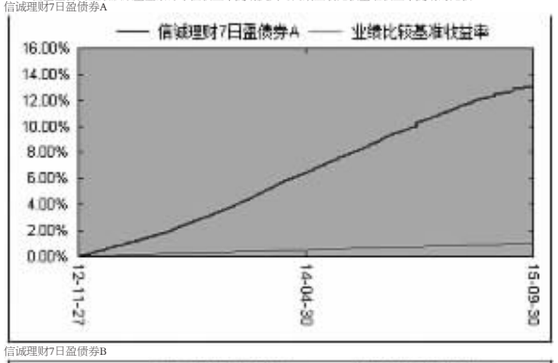
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.6470%	0.0210%	0.0882%	0.0000%	0.5588%	0.0210%

信诚理财7日盈债券B

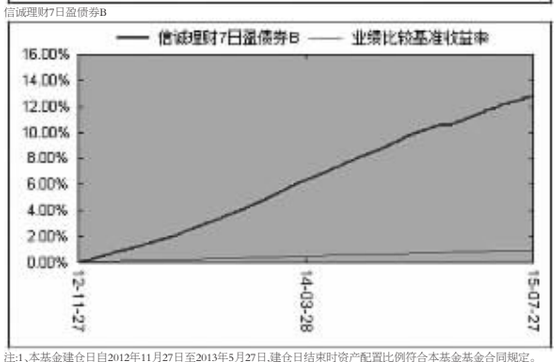
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月(2015年7月1日至2015年7月27日)	0.2522%	0.0180%	0.0259%	0.0000%	0.2263%	0.0180%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

信诚理财7日盈债券A



信诚理财7日盈债券B



注:1、本基金建仓日自2012年11月27日至2013年5月27日,建仓日结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。
2、自2015年7月28日至2015年9月30日,本基金B级份额为0。

§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		
王国强	本基金基金经理,信诚添金分级债券基金、信诚优质纯债债券基金及信诚年年有余定期开放债券基金基金经理	2012年11月27日	-	16	管理学硕士,16年证券、基金从业经验,曾先后任职于浙江国际信托投资公司、健桥证券投资有限公司和银河基金管理有限公司。2006年加盟信诚基金管理有限公司,现任信诚理财7日盈债券基金、信诚添金分级债券基金、信诚优质纯债债券基金及信诚年年有余定期开放债券基金的基金经理。
张倩	本基金基金经理,信诚货币市场基金、信诚新金宝货币市场基金和信诚3个月理财债券基金基金经理	2014年2月11日	2015年9月11日	11	2003年7月至2007年4月期间于申银万国证券股份有限公司固定收益部担任交易员;2008年11月至2013年4月于信诚基金管理有限公司担任交易员。

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 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《信诚理财7日盈债券型证券投资基金合同》、《信诚基金环境商品主题证券投资基金(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 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》,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

本报告期内,未发现本基金与其它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。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(完全复制的指数基金除外)。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度经济增长较弱,投资、出口延续放缓态势,消费增长平稳,消费物价指数维持较低水平。央行继续实施稳健的货币政策,实施降息25个基点、降低存款准备金率0.5个百分点,并运用新型数量调节工具,保持流动性适度增长,流动性宽裕。三季度,债市资金面宽松,货币市场利率维持低位,1月期Shibor利率维持在3%左右,1月AA短期融资券收益率在3.8%左右。

三季度,本基金重点配置高收益短期融资券和短期利率债。本基金特别注重信用风险管理,通过严格的内部信用评级体系,甄别信用风险,规避负债率高、经营性现金流持续为负和经营亏损的公司发行的短期融资券,以及信用风险较为突出的行业的短期融资券,如房地产、钢铁、电解铝、煤化工等行业的短期融资券。加强流动性管理,针对本基金的基金份额有固定运作期的特点,根据申购日分布情况,进行资金匹配。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金A、B份额净值收益率分别为0.6470%和0.2522%,业绩比较基准收益率分别为0.0882%和0.0259%,基金超越业绩比较基准分别为0.5588%和0.2263%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金未出现连续20个工作日基金资产净值低于五千万元(基金份额持有人数量不满两百人)的情形。

§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	固定收益投资	20,058,996.70	40.07
	其中:债券	20,058,996.70	40.07
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	18,500,267.75	36.95
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	10,721,854.74	21.42
4	其他资产	784,478.24	1.57
5	合计	50,065,597.43	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	0.46	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-

报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	64
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	97
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	26

注:本基金合同约定,本基金管理人将动态确定并控制投资组合平均剩余期限在127天以内,以规避较长期限债券的利率风险。

报告期内投资组合平均剩余期限超过127天情况说明

本基金本报告期内未出现投资组合平均剩余期限超过127天的情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	69.08	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	10.16	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	20.25	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		99.49	-

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,029,348.17	20.25
	其中:政策性金融债	10,029,348.17	20.25
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	10,029,648.53	20.25
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	20,058,996.70	40.49
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	150211	15国开11	100,000	10,029,348.17	20.25
2	041563002	15富兴CP001	50,000	5,032,528.22	10.16
3	041452049	14华泰CP001	50,000	4,997,120.31	10.09

注:本基金本报告期末仅持有上述债券。

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	15次
报告期内偏离度的最高值	0.3889%
报告期内偏离度的最低值	0.0578%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1847%

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 投资组合报告附注

5.8.1 基金计价方法说明

本基金估值采用"摊余成本法",即估值对象以买入成本列示,按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价,在剩余存续期内平均摊销,每日计提损益。

5.8.2 本报告期内,本基金不存在持有的剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值20%的情况。

5.8.3 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现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、处罚的情形。

5.8.4 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	552,183.97
4	应收申购款	232,294.27
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	784,478.24

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	信诚理财7日盈债券A	信诚理财7日盈债券B
报告期期初基金份额总额	43,372,485.75	25,440,434.16
报告期期间基金总申购份额	278,738,968.08	3,546,463.67
报告期期间基金总赎回份额	272,572,231.85	28,986,897.83
报告期期末基金份额总额	49,539,221.98	-

注:总申购份额含红利再投、份额强增和转换入份额;总赎回份额含份额强减、转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

无

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、信诚理财7日盈债券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、信诚理财7日盈债券型证券投资基金基金合同
4、信诚理财7日盈债券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

9.2 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。

9.3 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.xcfunds.com。

信诚基金管理有限公司
2015年10月24日

信诚全球商品主题证券投资基金(LOF)

2015 第三季度 报告

2015年9月30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
报告送出日期:2015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2015年10月23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2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	信诚全球商品主题(QDII-FOF-LOF)	
场内简称	信诚商品	
基金主代码	165513	
基金运作方式	上市契约型开放式	
基金合同生效日	2011年12月20日	
报告期末基金份额总额	130,159,299.56份	
投资目标	通过在全球范围内积极配置商品类相关资产,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	本基金将根据宏观及商品分析进行资产配置,并通过全球范围内精选基金构建组合,以达到预期的风险收益水平。	
业绩比较基准	标准普尔高盛商品总收益指数	
风险收益特征	本基金主要投资全球商品类基金,商品价格具有较高的波动性,因此,本基金属于较高预期风险和较高预期收益的证券投资基金品种。	
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

3.1 主要财务指标
单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年7月1日至2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-3,830,588.90
2.本期利润	-11,660,832.98
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0732
4.期末基金资产净值	64,856,489.02
5.期末基金份额净值	0.498

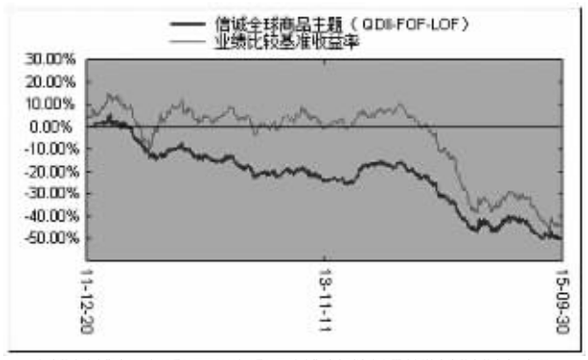
注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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
2015年第3季度	-11.70%	0.98%	-19.30%	1.73%	7.60%	-0.75%

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2011年12月20日至2012年6月20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		
刘德明	本基金基金经理、信诚四国配置(QDII-FOF-LOF)基金基金经理、信诚基金管理有限公司海外投资副总监	2013年1月15日	-	21	21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,并曾担任投资型基金和基金中的基金(FOF)的基金经理。现任信诚基金管理有限公司海外投资副总监,信诚金砖四国积极配置证券投资基金(LOF)及信诚全球商品主题证券投资基金(LOF)的基金经理。
李舒禾	本基金基金经理	2011年12月20日	-	11	台湾国立成功大学硕士,11年基金从业经验;2004年7月至2011年初曾任职于台湾宝来证券投资信托股份有限公司,拥有丰富的全球资产配置和ETF投资经验。2006/9 - 2010/9期间担任宝来全球ETF稳健组合证券投资信托基金经理,该基金的投资内容以ETF为主,资产范围包括股票、债券、商品、REITS、货币、杠杆等。2010/11 - 2011/3期间担任宝来黄金期货信托基金经理,该基金主要投资于黄金期货。现任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 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《信诚全球商品主题证券投资基金(LOF)基金合同》、《信诚全球商品主题证券投资基金(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 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》,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

本报告期内,未发现本基金与其它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。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(完全复制的指数基金除外)。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

美国S&P500因今年5/20创历史新高2134以后大幅滑落,跌幅最大来到12.5%,波动度Vix指数也达金融海啸后的新高。全球龙头市场美国股票表现大幅震荡,也使得香港国企指数下跌32.5%,原油下跌35%,市场弥漫保守的氛围。但10/2非农就业数据不如预期,市场又开始预期Fed将延后升息,商品股领涨推升S&P500指数连续5个交易日走高,创今年来最长升势,纳斯达克指数今年来表现也由负转正。原油也取得30%的涨幅。

展望全球风险性资产未来表现,风向球仍在美股,美股自2011年来,经历了三年的多头,预计未来三个月向下调整将持续。然而,美国服务业仍处稳步扩张水平,近期消费支出增加有助美国经济维持温和复苏趋势,较慢的升息步调有望支撑企业并购趋势延续至明年,预期未来一年美股仍有表现机会,短线震荡为投资人创造进场机会。

原油供需的基本面仍然疲弱,国际能源署估计到原油市场到2016年底才有可能从供给过剩到供需平衡,但近期中东的不平静造成原油风险溢价上升,增加油价预测的难度。展望未来,今年石油产业投资跌20%,创历史最大跌幅,制约了除页岩油外的供给,加上全球原油需求每年都增加50-150万桶,所以预期明年第2季度将迎来油价最低点。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金净值增长率为-11.70%,同期业绩比较基准收益率为-19.30%,基金超越业绩比较基准7.60%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金未出现连续20个工作日基金资产净值低于五千万元(基金份额持有人数量不满两百人)的情形。

§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	-	-
	其中:普通股	-	-
	优先股	-	-
	存托凭证	-	-
2	基金投资	42,386,509.23	64.75
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	21,291,967.45	32.53
8	其他资产	1,783,311.73	2.72
9	合计	65,461,788.41	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

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证投资。

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证投资。

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

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证投资。

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	FGS -BACKW BASKE-R COMM-IUSD	ETF基金	契约型开放式	FundLogic SAS/France	11,342,271.76	17.49
2	ISHARES BARCLAYS 1-3	ETF基金	契约型开放式	iSHARES BARCLAYS 1 -3 YEAR TR	9,623,514.59	14.84
3	UNITED STATES BRENT OIL FUND	ETF基金	契约型开放式	UNITED STATES COMMODITIES FUND LLC	8,288,214.11	12.78
4	UNITED STATES OIL FUND LP	ETF基金	契约型开放式	UNITED STATES COMMODITIES FUND LLC	5,266,851.06	8.12
5	UNITED STATES GAS FUND LP	ETF基金	契约型开放式	UNITED STATES COMMODITIES FUND LLC	2,617,356.89	4.04
6	POWERSHARES DB US DOL IND BU	ETF基金	契约型开放式	POWERSSHARES DB US DOL IND BU	1,309,282.77	2.02
7	ISHARES BARCLAYS 7-10 YEAR	ETF基金	契约型开放式	BLACKROCK FUND ADVISORS	1,303,767.52	2.01
8	VELOCITYSHARES 3X	ETF基金	契约型开放式	APT SATELLITE HOLDINGS LIMITED	974,847.60	1.50
9	US NATURAL GAS FUND	ETF基金	契约型开放式	US NATURAL GAS FUND LP	945,340.07	1.46
10	ETFS DAILY LYRG LEAN HOGS	ETF基金	契约型开放式	APT SATELLITE HOLDINGS LIMITED	715,062.86	1.10

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	1,782,827.05
3	应收股利	-
4	应收利息	484.68
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,783,311.73

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。

5.10.6 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	211,273,065.38
报告期期间基金总申购份额	38,390,275.47
减:报告期期间基金总赎回份额	119,504,041.29
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	130,159,299.56

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

无

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、信诚全球商品主题证券投资基金(LOF)相关批准文件
2、信诚基金管理公司营业执照、公司章程
3、信诚全球商品主题证券投资基金(LOF)基金合同
4、信诚全球商品主题证券投资基金(LOF)招募说明书
5、本报告期内按照规定披露的各项公告

9.2 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。

9.3 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.xcfunds.com。

信诚基金管理有限公司
2015年10月24日

信诚年年有余定期开放债券型证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015年9月30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
报告送出日期:2015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2015年10月23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2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	信诚年年有余定期开放债券	
基金主代码	000360	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年11月27日	
报告期末基金份额总额	154,893,573.45份	
投资目标	在严格控制风险的基础上,通过主动管理,力争实现基金资产长期增值并为投资人实现稳定的定期回报。	
投资策略	1、资产配置策略 本基金投资组合中债券类、货币类等大类资产各自的长期均衡比重,依照本基金的特征和风险偏好而确定。本基金定位为债券型基金,其资产配置以债券为主,并不因市场的中短期变化而改变。在不同的市场条件下,本基金将综合考虑宏观环境、市场估值水平、风险水平以及市场情绪,在一定的范围内对资产配置调整,以降低系统性风险对基金收益的影响。 2、固定收益类资产的投资策略 (1)类属资产配置策略 在整体资产配置的基础上,本基金将通过考量不同类型固定收益品种的信用风险、市场风险、流动性风险、税收等因素,研究各投资品种的利差及其变化趋势,制定债券类属资产配置策略,以获取债券类属之间利差变化所带来的潜在收益。 (2)普通债券投资策略 对于普通债券,本基金将在严格控制目标久期及保证基金资产流动性的前提下,采用目标久期控制、期限结构配置、信用利差策略、流动性管理、相对价值配置、杠杆策略等策略进行主动投资。 (3)资产支持证券的投资策略 对于资产支持证券,本基金将综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成和质量等因素,研究资产支持证券的收益和风险匹配情况,采用数量化的定价模型跟踪债券的价格走势,在严格控制投资风险的基础上选择合适的投资对象以获得稳定收益。 3、其他金融工具的投资策略 如法律法规或监管机构以后允许基金投资于其他衍生金融工具,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金对衍生金融工具的投资主要以对冲投资风险或无风险套利为主要目的。基金将在有效进行风险管理的前提下,通过对标的品种的基本面研究,结合衍生工具定价模型预估衍生工具价值或风险对冲比例,谨慎投资。 在符合法律、法规相关限制的前提下,基金管理人按谨慎原则确定本基金衍生工具的总风险暴露。 4、开放期投资策略 开放期内,本基金为保持较高的组合流动性,方便投资人安排投资,在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下,将主要投资于高流动性的投资品种,防范流动性风险,满足开放期流动性的需求。	
业绩比较基准	同期中国人民银行公布的一年期定期存款基准利率(税后)+2%	
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。	
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	
下属分级基金的基金简称	信诚年年有余定期开放债券A	信诚年年有余定期开放债券B
下属分级基金的交易代码	000360	000361
报告期末下属分级基金的份额总额	135,142,433.50份	19,751,139.95份

§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	信诚年年有余定期开放债券A报告期(2015年7月1日至2015年9月30日)	信诚年年有余定期开放债券B报告期(2015年7月1日至2015年9月30日)
1.本期已实现收益	403,579.90	34,281.00
2.本期利润	-10,717,905.18	-1,580,490.55
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0793	-0.0800
4.期末基金资产净值	164,153,724.70	23,814,323.27
5.期末基金份额净值	1.215	1.206

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

信诚年年有余定期开放债券A

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	-6.11%	0.56%	0.98%	0.01%	-7.09%	0.55%

信诚年年有余定期开放