

信诚全球商品主题证券投资基金(LOF)

[2015] 第二季度报告

基金管理人:信诚基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期: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。
基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同的规定,于2015年7月17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4月1日起至6月30日止。
§2基金产品概况

基金简称	信诚全球商品主题(QuDII-FOF-LOF)
场内简称	信诚商品
基金代码	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	211,273,065.38份
投资目标	通过在不同国家和地区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	本基金根据商品类资产及商品衍生品投资情况,并通过全球范围内的精选基金构建组合,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	本基金主要投资于全球商品类基金,商品价格具有较高的波动率,因此,本基金属于较高风险级别和较高预期收益级别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	美林银行(Bank of China (Hong Kong) Limited)
境内资产托管人	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4月1日至2015年6月30日)
1.本期已实现收益	9,601,184.31
2.本期利润	14,230,811.85
3.加权平均基金份额本期利润	0.0420
4.期末基金份额净值	119,088,606.48
5.期末基金份额净值	0.564

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,本期利润为期末已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.上述基金业指标不包括持有人认购或交易基金份额的费用,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报告期末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	净值增长率差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率差④	①-③	②-④
过去三个月	6.21%	1.19%	8.73%	1.41%	-2.52%	-0.22%

3.2.2自基金合同生效以来基金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



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合同规定。

§4管理人报告

姓名	职务	任本基金的基金经理期间	证券从业年限	离任日期
刘鹤明	本基金基金经理(QuDII-FOF-LOF)基金经理 信诚基金管理有限公司海外投资部总监	2013年1月15日	-	21
李抒东	本基金基金经理	2011年12月20日	-	10

注:1.上述任职日期,离任日期根据基金管理人对基金经理的书面辞职报告填写。

2.证券从业的含义从广义上讲指证券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情况说明

在本基金报告期内,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)招募说明书》的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则,履行了法定的职责。

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《信诚基金管理公司公平交易管理制度》,公司采取了一系列的行动实施公平交易和利益输送的异常交易,报告期内,未出现参与各交易场所的公开竞价、未发现损害基金份额持有人利益的行为。

4.3.2公平交易专项说明

4.3.3公平交易制度的执行情况
根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易管理制度》,公司采取了一系列的行动实施公平交易和利益输送的异常交易,报告期内,未发现损害基金份额持有人利益的行为。

4.3.4公平交易专项说明

4.3.5公平交易制度的执行情况
根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易管理制度》,公司采取了一系列的行动实施公平交易和利益输送的异常交易,报告期内,未发现损害基金份额持有人利益的行为。

4.3.6公平交易制度的执行情况

4.3.7公平交易制度的执行情况
根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易管理制度》,公司采取了一系列的行动实施公平交易和利益输送的异常交易,报告期内,未发现损害基金份额持有人利益的行为。

4.3.8公平交易制度的执行情况

4.3.9公平交易制度的执行情况
根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易管理制度》,公司采取了一系列的行动实施公平交易和利益输送的异常交易,报告期内,未发现损害基金份额持有人利益的行为。

4.3.10公平交易制度的执行情况

4.3.11公平交易制度的执行情况
根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易管理制度》,公司采取了一系列的行动实施公平交易和利益输送的异常交易,报告期内,未发现损害基金份额持有人利益的行为。

4.3.12公平交易制度的执行情况

4.3.13公平交易制度的执行情况
根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易管理制度》,公司采取了一系列的行动实施公平交易和利益输送的异常交易,报告期内,未发现损害基金份额持有人利益的行为。

4.3.14公平交易制度的执行情况

4.3.15公平交易制度的执行情况
根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易管理制度》,公司采取了一系列的行动实施公平交易和利益输送的异常交易,报告期内,未发现损害基金份额持有人利益的行为。

4.3.16公平交易制度的执行情况

4.3.17公平交易制度的执行情况
根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易管理制度》,公司采取了一系列的行动实施公平交易和利益输送的异常交易,报告期内,未发现损害基金份额持有人利益的行为。

4.3.18公平交易制度的执行情况

4.3.19公平交易制度的执行情况
根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易管理制度》,公司采取了一系列的行动实施公平交易和利益输送的异常交易,报告期内,未发现损害基金份额持有人利益的行为。

4.3.20公平交易制度的执行情况

4.3.21公平交易制度的执行情况
根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易管理制度》,公司采取了一系列的行动实施公平交易和利益输送的异常交易,报告期内,未发现损害基金份额持有人利益的行为。

4.3.22公平交易制度的执行情况

4.3.23公平交易制度的执行情况
根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易管理制度》,公司采取了一系列的行动实施公平交易和利益输送的异常交易,报告期内,未发现损害基金份额持有人利益的行为。

4.3.24公平交易制度的执行情况

4.3.25公平交易制度的执行情况
根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易管理制度》,公司采取了一系列的行动实施公平交易和利益输送的异常交易,报告期内,未发现损害基金份额持有人利益的行为。

4.3.26公平交易制度的执行情况

4.3.27公平交易制度的执行情况
根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易管理制度》,公司采取了一系列的行动实施公平交易和利益输送的异常交易,报告期内,未发现损害基金份额持有人利益的行为。

4.3.28公平交易制度的执行情况

4.3.29公平交易制度的执行情况
根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易管理制度》,公司采取了一系列的行动实施公平交易和利益输送的异常交易,报告期内,未发现损害基金份额持有人利益的行为。

4.3.30公平交易制度的执行情况

4.3.31公平交易制度的执行情况
根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易管理制度》,公司采取了一系列的行动实施公平交易和利益输送的异常交易,报告期内,未发现损害基金份额持有人利益的行为。

4.3.32公平交易制度的执行情况

4.3.33公平交易制度的执行情况
根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易管理制度》,公司采取了一系列的行动实施公平交易和利益输送的异常交易,报告期内,未发现损害基金份额持有人利益的行为。

4.3.34公平交易制度的执行情况

4.3.35公平交易制度的执行情况
根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易管理制度》,公司采取了一系列的行动实施公平交易和利益输送的异常交易,报告期内,未发现损害基金份额持有人利益的行为。

4.3.36公平交易制度的执行情况

4.3.37公平交易制度的执行情况
根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易管理制度》,公司采取了一系列的行动实施公平交易和利益输送的异常交易,报告期内,未发现损害基金份额持有人利益的行为。

4.3.38公平交易制度的执行情况

4.3.39公平交易制度的执行情况
根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易管理制度》,公司采取了一系列的行动实施公平交易和利益输送的异常交易,报告期内,未发现损害基金份额持有人利益的行为。

4.3.40公平交易制度的执行情况

4.3.41公平交易制度的执行情况
根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易管理制度》,公司采取了一系列的行动实施公平交易和利益输送的异常交易,报告期内,未发现损害基金份额持有人利益的行为。

4.3.42公平交易制度的执行情况

4.3.43公平交易制度的执行情况
根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易管理制度》,公司采取了一系列的行动实施公平交易和利益输送的异常交易,报告期内,未发现损害基金份额持有人利益的行为。

4.3.44公平交易制度的执行情况

4.3.45公平交易制度的执行情况
根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易管理制度》,公司采取了一系列的行动实施公平交易和利益输送的异常交易,报告期内,未发现损害基金份额持有人利益的行为。

4.3.46公平交易制度的执行情况

4.3.47公平交易制度的执行情况
根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易管理制度》,公司采取了一系列的行动实施公平交易和利益输送的异常交易,报告期内,未发现损害基金份额持有人利益的行为。

4.3.48公平交易制度的执行情况

4.3.49公平交易制度的执行情况
根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易管理制度》,公司采取了一系列的行动实施公平交易和利益输送的异常交易,报告期内,未发现损害基金份额持有人利益的行为。

4.3.50公平交易制度的执行情况

4.3.51公平交易制度的执行情况
根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易管理制度》,公司采取了一系列的行动实施公平交易和利益输送的异常交易,报告期内,未发现损害基金份额持有人利益的行为。

4.3.52公平交易制度的执行情况

4.3.53公平交易制度的执行情况
根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易管理制度》,公司采取了一系列的行动实施公平交易和利益输送的异常交易,报告期内,未发现损害基金份额持有人利益的行为。

4.3.54公平交易制度的执行情况

4.3.55公平交易制度的执行情况
根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易管理制度》,公司采取了一系列的行动实施公平交易和利益输送的异常交易,报告期内,未发现损害基金份额持有人利益的行为。

4.3.56公平交易制度的执行情况

4.3.57公平交易制度的执行情况
根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易管理制度》,公司采取了一系列的行动实施公平交易和利益输送的异常交易,报告期内,未发现损害基金份额持有人利益的行为。

4.3.58公平交易制度的执行情况

4.3.59公平交易制度的执行情况
根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易管理制度》,公司采取了一系列的行动实施公平交易和利益输送的异常交易,报告期内,未发现损害基金份额持有人利益的行为。

4.3.60公平交易制度的执行情况

4.3.61公平交易制度的执行情况
根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易管理制度》,公司采取了一系列的行动实施公平交易和利益输送的异常交易,报告期内,未发现损害基金份额持有人利益的行为。

4.3.62公平交易制度的执行情况

4.3.63公平交易制度的执行情况
根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易管理制度》,公司采取了一系列的行动实施公平交易和利益输送的异常交易,报告期内,未发现损害基金份额持有人利益的行为。

4.3.64公平交易制度的执行情况

4.3.65公平交易制度的执行情况
根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易管理制度》,公司采取了一系列的行动实施公平交易和利益输送的异常交易,报告期内,未发现损害基金份额持有人利益的行为。

4.3.66公平交易制度的执行情况

4.3.67公平交易制度的执行情况
根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易管理制度》,公司采取了一系列的行动实施公平交易和利益输送的异常交易,报告期内,未发现损害基金份额持有人利益的行为。

4.3.68公平交易制度的执行情况

4.3.69公平交易制度的执行情况
根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易管理制度》,公司采取了一系列的行动实施公平交易和利益输送的异常交易,报告期内,未发现损害基金份额持有人利益的行为。

4.3.70公平交易制度的执行情况

4.3.71公平交易制度的执行情况
根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易管理制度》,公司采取了一系列的行动实施公平交易和利益输送的异常交易,报告期内,未发现损害基金份额持有人利益的行为。

4.3.72公平交易制度的执行情况

4.3.73公平交易制度的执行情况
根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易管理制度》,公司采取了一系列的行动实施公平交易和利益输送的异常交易,报告期内,未发现损害基金份额持有人利益的行为。

4.3.74公平交易制度的执行情况

4.3.75公平交易制度的执行情况
根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易管理制度》,公司采取了一系列的行动实施公平交易和利益输送的异常交易,报告期内,未发现损害基金份额持有人利益的行为。

4.3.76公平交易制度的执行情况

4.3.77公平交易制度的执行情况
根据中国证监会颁布的《证券投资基金公司公平交易管理制度》,公司采取了一系列的行动实施公平交易和利益输送的异常交易,报告期内,未发现损害基金份额持有人利益的行为。

4.3.78公平交易制度的执行情况