

信诚周期轮动混合型证券投资基金(LOF) 2015 年年度报告摘要

2015 年 12 月 31 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

送出日期：2016 年 3 月 25 日

§ 1 重要提示

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。本年度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 2016 年 3 月 24 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容应阅读年度报告正文。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	信诚周期轮动混合
场内简称	信诚周期
基金主代码	165516
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 5 月 7 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
报告期末基金份额总额	332,716,561.02 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所(若有)	深圳证券交易所
上市日期(若有)	2012 年 11 月 5 日

2.2 基金产品说明

投资目标	在深入分析经济发展规律的基础上,本基金根据行业与宏观经济的联动特点,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,力求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金采取行业指导下的个股精选方法。即:首先结合宏观经济发展情况,在严格控制风险的前提下,对周期类行业与稳定类行业进行配置;在此基础上确定周期类行业与稳定类行业内各行业配置情况;最后分别对周期类行业、稳定类行业内个股进行评估,从而精选基本面良好的个股以构建股票投资组合。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*80%+中证综合债指数收益率*20%
风险收益特征	本基金属于混合型基金,预期风险与收益高于债券型基金与

	货币市场基金, 低于股票型基金, 属于较高风险、较高收益的品种。
--	----------------------------------

注:本基金管理人 2015 年 9 月 28 日发布公告,自 2015 年 10 月 1 日本基金业绩比较基准由“沪深 300 指数收益率*80%+中信标普全债指数收益率*20%”变更为“沪深 300 指数收益率*80%+中证综合债指数收益率*20%”。

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	信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
	联系电话	021-68649788
	电子邮箱	hao.zhou@citicpru.com.cn
客户服务电话	400-666-0066	95566
传真	021-50120888	010-66594942

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.xcfunds.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2015 年	2014 年	2013 年
本期已实现收益	-100,169,299.07	20,181,720.05	18,096,815.54
本期利润	-95,552,450.73	29,025,877.02	15,331,372.92
加权平均基金份额本期利润	-0.3696	0.8484	0.3127
本期基金份额净值增长率	54.47%	41.24%	19.71%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
期末可供分配基金份额利润	0.9508	0.7329	0.2272
期末基金资产净值	890,548,500.99	235,289,426.92	26,809,035.37
期末基金份额净值	2.677	1.733	1.227

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、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。

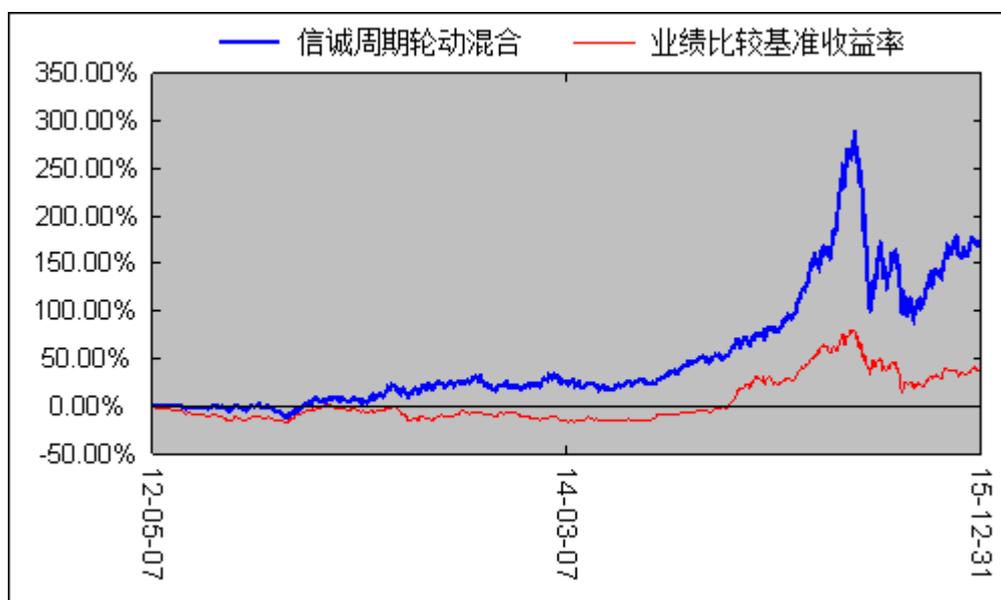
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	28.39%	2.02%	13.68%	1.34%	14.71%	0.68%
过去六个月	-10.02%	3.19%	-12.14%	2.14%	2.12%	1.05%
过去一年	54.47%	2.79%	6.99%	1.99%	47.48%	0.80%
过去三年	161.17%	1.93%	44.04%	1.44%	117.13%	0.49%
自基金合同生效起至今	167.70%	1.79%	36.77%	1.36%	130.93%	0.43%

注:自 2015 年 10 月 1 日起,本基金的业绩比较基准由“沪深 300 指数收益率*80%+中信标普全债指数收益率*20%”变更为“沪深 300 指数收益率*80%+中证综合债指数收益率*20%”。

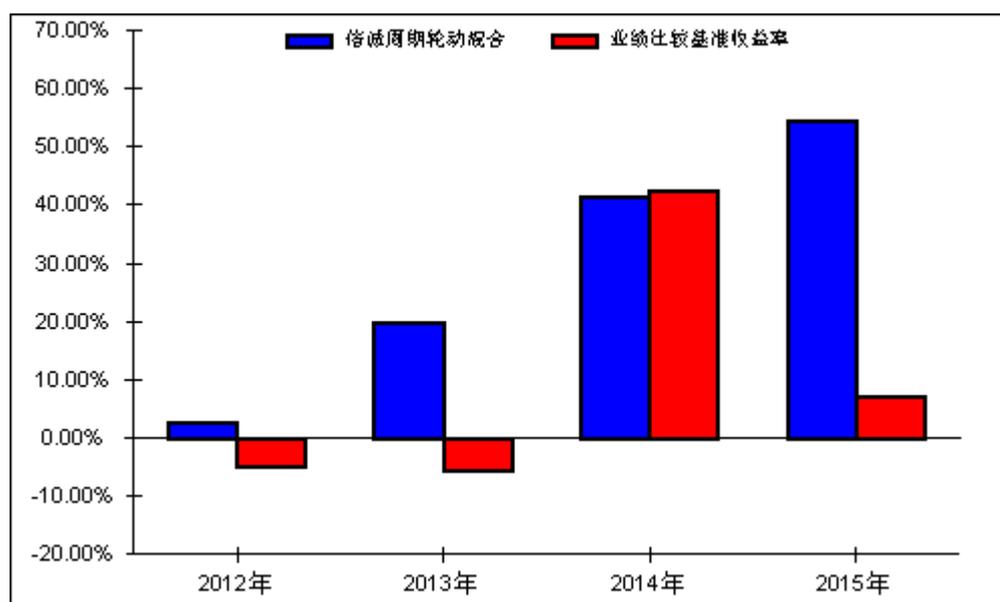
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1、本基金建仓日自 2012 年 5 月 7 日至 2012 年 11 月 7 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 10 月 1 日起,本基金的业绩比较基准由“沪深 300 指数收益率*80%+中信标普全债指数收益率*20%”变更为“沪深 300 指数收益率*80%+中证综合债指数收益率*20%”。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 其他指标

3.4 过去三年基金的利润分配情况

本基金合同生效日为 2012 年 5 月 7 日,本基金自基金合同生效以来未进行过利润分配。

§ 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

本基金管理人信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%。截至 2015 年 12 月 31 日,本基金管理人共管理 38 只基金,分别为信诚四季红混合型证券投资基金、信诚精萃成长混合型证券投资基金、信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、信诚经典优债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)、信诚中证 500 指数分级证券投资基金、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)、信诚沪深 300 指数分级证券投资基金、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)、信诚理财 7 日盈债券型证券投资基金、信诚添金分级债券型证券投资基金、信诚优质纯债债券型证券投资基金、信诚新双盈分级债券型证券投资基金、信诚新兴产业混合型证券投资基金、信诚中证 800 医药指数分级证券投资基金、信诚中证 800 有色指数分级证券投资基金、信诚季季定期支付债券性证券投资基金、信诚年年有余定期开放债券型证券投资基金、信诚中证 800 金融指数分级证券投资基金、信诚月月定期支付债券型证券投资基金、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、信诚中证 TMT 产业主题

指数分级证券投资基金、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)、信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚中证信息安全指数分级证券投资基金、信诚中证智能家居指数分级证券投资基金和信诚中证建筑工程指数分级证券投资基金。

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		
张光成	本基金基金经理，股票投资副总监、信诚幸福消费混合基金基金经理	2012年5月7日	-	11	CFA, 11年证券、基金从业经验。曾任欧洲货币(上海)有限公司研究总监、兴业全球基金管理有限公司基金经理。2011年7月加入信诚基金管理有限公司,担任投资经理。现任股票投资副总监及信诚周期轮动混合(LOF)基金、信诚幸福消费混合基金基金经理。

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 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《信诚周期轮动混合型证券投资基金(LOF)基金合同》、《信诚周期轮动混合型证券投资基金(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 公平交易制度和控制方法

为使公司管理的不同投资组合得到公平对待,保护投资者合法权益,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》,公司已制订了《信诚基金管理有限公司公平交易及异常交易管理制度》(“公平交易制度”)作为开展公平交易管理的规则指引,制度适用公司管理所有投资组合(包括公募基金、特定客户资产管理组合),对应的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动。

在实际的公平交易管理贯彻落实中,公司在公平交易制度的指引下采用事前、事中、事后的全流程控制方法。事前管理主要包括:已搭建了合理的资产管理业务之间及资产管理业务内的组织架构,健全投资授权制度,设立防火墙,确保各块投资业务、各基金组合投资决策机制的合理合规与相对独立;同时让各业务组合共享必要的研究、投资信息等,确保机会公平。在日常操作上明确一级市场、非集中竞价市场投资的要求与审批流程;借助系统建立投资备选库、交易对手库、基金风格维度库,规范二级市场、集中竞价市场的操作,建立公平交易的制度流程文化环境。事中监控主要包括:公司管理的不同投资组合执行集中交易制度,确保一般情况下不同投资组合同向买卖同一证券时需通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理,按照时间优先、比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易量;同时原则上禁

止同日反向交易,如因流动性等问题需要反向交易须经过严格审批和留档。一级市场、非集中竞价市场等的投资则需要经过合理询价、逐笔审批与公平分配。事后管理主要包括:定期对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异进行分析,对连续四个季度期间内、不同时间窗下(日内、3日内、5日内)公司管理的不同投资组合向交易的交易价差,对反向交易等进行价差分析。同时,合规、审计会对公平交易的执行情况做定期检查。相关人员对事后评估报告、合规审计报告进行审阅,签字确认,如有异常情况将及时报送相关部门并做信息披露。

4.3.2 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,未发现违背公平交易的相关情况。

4.3.3 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 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

2015 年市场经历了戏剧性的一幕,在六月之前,市场经历了一轮轰轰烈烈的大牛市,上证指数最高上涨到 5178 点,相比 2014 年底上涨 60%。创业板指数更为夸张,最高上涨到 4037 点,相比 2014 年底上涨 174%。之后由于各种因素,股市进入了恐怖的下跌过程,先后发生了股灾 1.0 和股灾 2.0。全年上证指数仅上涨 9.4%,创业板指仍然上涨 84%。

本基金净值本年度上涨 54%,差强人意。一度净值上涨超过 100%,然而在股灾 1.0 和 2.0 中表现不佳,回撤较大。虽然在年底的反弹行情中获得一定收益,但综合来看,全年收益相对一般。

4.4.2 报告期内基金业绩的表现

本报告期内,本基金份额净值增长率为 54.47%,同期业绩比较基准收益率为 6.99%,基金超越业绩比较基准 47.48%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年对于股市来讲非常困难,第一个月已经出现了股灾 3.0。主要原因有三个。第一,大家看好的新兴产业由于经过三年连续上涨后大部分个股估值显得非常贵。第二,随着注册制的日益临近,股票供给会大大增加。第三,整个宏观经济较差,企业盈利状况一般。同时国际经济形势比较差,人民币又有较强的贬值预期。

因此本管理人判断上半年整个股市将表现不佳,而下半年随着股指逐渐调整到位,慢慢吸引价值投资者入场,全年可能先抑后扬。但纵观全年的话,要获取较好的收益仍然比较困难。

本基金仍将聚焦于新兴产业,看好的板块和方向有影视娱乐消费,虚拟现实,人工智能网络视频等。以及部分供给侧已经相对比较稳定的周期品行业,如维生素等。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2015 年度内,依据相关法律法规的规定及公司内部监察稽核制度,公司督察长和监察稽核部门充分发挥其职能作用,开展了一系列监察稽核工作,取得了较好的成效。现将全年的监察稽核工作总结如下:

1、对公司规章制度体系不断补充和完善

公司监察稽核部组织各业务部门对公司相关规章制度进行梳理补充和完善,主要包括投资、研究、风控、行政、人力资源、财务、反洗钱等业务范畴。推进了公司规章制度建设,完善了公司规章制度体系。

2、开展各类合规监察工作。

监察稽核部严格遵照法律法规和公司制度,对基金运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况进行监督检查,防范内幕交易,确保基金运作的独立性、公平性及合规性。2015年3月底至4月初,中国证监会对我公司进行了现场监督检查,监察稽核部对本次现场检查积极配合。通过本次现场检查,能更客观地发现公司各项内控中的薄弱环节,有助于督促公司不断加强制度和风控措施,提高经营效率。

3、强化合规培训教育,提高全员合规意识。

本报告期内,监察稽核部及时将新颁布的监管法规传递给公司相关业务部门,并对具体的执行和合规要求进行提示。在日常工作中通过多种形式加强对员工职业操守的教育和监督,并开展法规培训。本年度,监察稽核部根据监管部门的要求,结合自身实际情况,主要采取课堂讲授的方式为员工提供多种形式的培训。

4、开展各类内外部审计工作,包括4次常规审计、13项专项审计、协助外部审计师开展审计、配合监管机构完成现场检查及多项自查工作等。

5、完成各只基金及公司的各项信息披露工作,保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

监察稽核部严格按照《证券投资基金信息披露管理办法》、《信息披露内容与格式准则》、《信息披露编报规则》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》等法规要求进行信息披露和公告,并按法律法规规定报监管机构备案。

6、牵头开展反洗钱的各项工作,进一步完善修订了反洗钱制度,按照相关规定将相关可疑记录及时上报反洗钱监测中心,根据中国人民银行通知要求组织开展反洗钱培训和宣传工作。

本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,继续加强内部控制和风险管理,进一步提高监察稽核工作的科学性和有效性,充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1. 基金估值程序

为了向基金投资人提供更好的证券投资管理服务,本基金管理人对估值和定价过程进行了最严格的控制。本基金管理人通过估值决策委员会来更有效的完善估值服务。估值决策委员会包括下列成员: 分管基金运营业务的领导(委员会主席)、风险管理部负责人、股票投资负责人、债券投资负责人、交易部负责人、运营部负责人、基金会计主管(委员会秘书)。本基金管理人在充分衡量市场风险、信用风险、流动性风险、货币风险、衍生工具和结构性产品等影响估值和定价因素的基础上,综合运营部、稽核部、投资部、风控部和其它相关部门的意见,确定本基金管理人采用的估值政策。

估值政策和程序的确立和修订须经本基金管理人总经理批准后方可实行。基金在采用新投资策略或投资新品种时,应评价现有估值政策和程序的适用性,并在不适用的情况下,及时召开估值决策委员会。

在每个估值日,本基金管理人的运营部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。

基金管理人对基金资产进行估值后,将基金份额净值结果发送基金托管人,基金托管人按照托管协议中“基金资产净值计算和会计核算”确定的规则复核,复核无误后,由基金管理人对外公布。

2. 基金管理人估值业务的职责分工

本基金管理人的估值业务采用双人双岗,所有业务操作需经复核方可生效。

3. 基金管理人估值人员的专业胜任能力和相关工作经历

本基金管理人的估值人员均具有专业会计学习经历,具有会计上岗证和基金从业人员资格。

4. 基金经理参与或决定估值的程度。

本基金管理人的后台与投资业务隔离,基金经理不直接参与或决定估值

基金经理持续保持对基金估值所采用估值价格的关注,在认为基金估值所采用的估值价格不足够公允时,将通过首席投资官提请召开估值决策委员会会议,通过会议讨论决定是否调整基金管理人所采用的估值政策。

5. 参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

6. 已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

本基金未与任何第三方签订定价服务协议。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配应遵循下列原则：

1、登记在注册登记系统的基金份额,其收益分配方式分为两种:现金分红与红利再投资,投资人可选择现金红利或将现金红利按除权后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资(具体日期以本基金分红公告为准);若投资人不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;登记在证券登记结算系统的基金份额的分红方式为现金分红,投资人不能选择其他的分红方式,具体收益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定;

2、每一基金份额享有同等分配权;

3、基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值,基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日;

4、在符合有关基金分红条件的前提下,基金收益分配每年至多 12 次;每次基金收益分配比例不得低于收益分配基准日期末可供分配利润的 25%。基金的收益分配比例以期末可供分配利润为基准计算,期末可供分配利润以期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数为准。基金合同生效不满三个月,收益可不分配;

5、基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不超过 15 个工作日;

6、投资者的现金红利和分红再投资形成的基金份额均保留到小数点后第 2 位,小数点后第 3 位开始舍去,舍去部分归基金资产;

7、法律法规或监管机构另有规定的,从其规定。

本基金于本期间未进行过利润分配,该处理符合基金利润分配原则。

4.9 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 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”)在信诚周期轮动混合型证券投资基金(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 托管人对本年度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”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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 1600074 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	信诚周期轮动混合型证券投资基金(LOF)全体基金份额持有人:
引言段	我们审计了后附的第 1 页至第 27 页的信诚周期轮动混合型证券投资基金(LOF) (以下简称“信诚周期轮动基金”)财务报表,包括 2015 年 12 月 31 日的资产负债表、2015 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是信诚周期轮动基金管理人信诚基金管理有限公司管理层的责任,这种责任包括:(1)按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表,并使其实现公允反映;(2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价信诚基金管理有限公司管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,</p>

	为发表审计意见提供了基础。	
审计意见段	我们认为, 信诚周期轮动基金财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则和在财务报表附注 2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制, 公允反映了信诚周期轮动基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果及基金净值变动情况。	
注册会计师的姓名	黄小熠	查希箐
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	
会计师事务所的地址	北京市东长安街 1 号东方广场东二办公楼八层	
审计报告日期	2016 年 3 月 24 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体: 信诚周期轮动混合型证券投资基金(LOF)

报告截止日: 2015 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产:			
银行存款		198,739,534.41	44,199,236.45
结算备付金		2,048,909.36	821,006.81
存出保证金		495,571.58	98,039.13
交易性金融资产		697,187,786.34	191,861,604.46
其中: 股票投资		697,146,237.54	187,538,564.46
基金投资		-	-
债券投资		41,548.80	4,323,040.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		6,990,546.16	-
应收利息		43,094.26	12,034.40
应收股利		-	-
应收申购款		3,621,205.86	8,898,632.74
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		909,126,647.97	245,890,553.99
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日

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		-	-
应付证券清算款		14,139,460.78	6,858,784.28
应付赎回款		1,140,013.88	2,774,313.19
应付管理人报酬		1,045,274.11	193,403.23
应付托管费		174,212.34	32,233.87
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		1,634,889.49	452,745.27
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		444,296.38	289,647.23
负债合计		18,578,146.98	10,601,127.07
所有者权益:			
实收基金		332,716,561.02	135,779,425.45
未分配利润		557,831,939.97	99,510,001.47
所有者权益合计		890,548,500.99	235,289,426.92
负债和所有者权益总计		909,126,647.97	245,890,553.99

注：截止本报告期末，基金份额净值 2.677 元，基金份额总额 332,716,561.02 份。

7.2 利润表

会计主体：信诚周期轮动混合型证券投资基金(LOF)

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
一、收入		-74,619,732.15	31,184,182.33
1. 利息收入		1,126,000.88	120,981.55
其中：存款利息收入		1,125,761.12	76,046.04
债券利息收入		239.76	38,817.45
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	6,118.06
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-84,426,509.33	21,819,292.09
其中：股票投资收益		-87,579,973.61	21,200,895.79
基金投资收益		-	-

债券投资收益		905,747.39	499,366.66
资产支持证券投资 收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		2,247,716.89	119,029.64
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）		4,616,848.34	8,844,156.97
4. 汇兑收益（损失以“- ”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“- ”号填列）		4,063,927.96	399,751.72
减：二、费用		20,932,718.58	2,158,305.31
1. 管理人报酬		9,655,066.06	744,337.37
2. 托管费		1,609,177.70	124,056.22
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		9,216,353.76	1,014,290.54
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 其他费用		452,121.06	275,621.18
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		-95,552,450.73	29,025,877.02
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以 “-”号填列）		-95,552,450.73	29,025,877.02

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：信诚周期轮动混合型证券投资基金(LOF)

本报告期：2015年1月1日至2015年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基 金净值）	135,779,425.45	99,510,001.47	235,289,426.92
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数（本期利 润）	-	-95,552,450.73	-95,552,450.73
三、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）	196,937,135.57	553,874,389.23	750,811,524.80

施《公开募集证券投资基金运作管理办法》有关问题的规定》等相关法律法规及《信诚周期轮动股票型证券投资基金(LOF)基金合同》的约定,经与基金托管人协商一致,自2015年8月3日起,本基金名称变更为“信诚周期轮动混合型证券投资基金(LOF)”,基金类别变更为“混合型”,同时相应修改基金合同和托管协议相关表述。

本基金于:2012年3月14日至2012年4月27日募集,扣除认购费后的有效认购资金308,287,512.34元,利息转份额198,030.99元,募集规模为308,485,543.33份。上述募集资金已由毕马威华振会计师事务所验证,并出具了KPMG-B(2012)CR No. 0032号验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《信诚周期轮动混合型证券投资基金(LOF)基金合同》和《信诚周期轮动混合型证券投资基金(LOF)招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、银行定期存款、中期票据、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:股票等权益类资产占基金资产为60%-95%;债券、中期票据、资产支持证券、银行定期存款等固定收益类证券品种占基金资产的比例不超过40%;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%;权证不超过基金资产净值的3%。当法律法规的相关规定变更时,基金管理人在履行适当程序后可对上述资产配置比例进行适当调整。

本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率*80%+中证综合债指数收益率*20%。

根据《证券投资基金信息披露管理办法》,本基金定期报告在公开披露的第二个工作日,报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

7.4.2 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<年度报告和半年度报告>》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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金的财务状况、经营成果和基金净值变动情况。

此外本财务报表同时符合如财务报表附注7.4.2所列示的其他有关规定的要求。

7.4.4 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

7.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无差错事项。

7.4.6 税项

根据财税字[1998]55号文《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》、财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、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》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:

(1) 以发行基金方式募集资金,不属于营业税征收范围,不征收营业税。

- (2) 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。
- (3) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价,暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。
- (4) 对基金取得的股票的股息、红利收入,债券的利息收入,由上市公司、发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起,对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额:持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50%计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,股权登记日为自 2013 年 1 月 1 日起至 2015 年 9 月 7 日期间的,暂减按 25%计入应纳税所得额,股权登记日在 2015 年 9 月 8 日及以后的,暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。
- (5) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。
- (6) 对投资者(包括个人和机构投资者)从基金分配中取得的收入,暂不征收个人所得税和企业所得税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
信诚基金管理有限公司	基金管理人
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人
中信信托有限责任公司	基金管理人的中方股东
英国保诚集团股份有限公司	基金管理人的外方股东
中新苏州工业园区创业投资有限公司	基金管理人的中方股东
信诚人寿保险有限公司	基金管理人主要股东控制的机构
中信信诚资产管理有限公司	基金管理人出资成立的子公司

7.4.8 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。

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本基金在本年度及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	9,655,066.06	744,337.37
其中:支付销售机构的客户维护费	4,537,938.68	270,573.35

注:支付基金管理人信诚基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率每日计提,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×1.5%/当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
----	---	--

当期发生的基金应支付的托管费	1,609,177.70	124,056.22
----------------	--------------	------------

注：支付基金托管人中国银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率每日计提，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×0.25%/当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本年度及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。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
基金合同生效日(2012年5月7日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	1,801,501.50	-
报告期间因拆分变动的份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	1,801,501.50	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.54%	-

注：基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。本基金的基金管理人在上年度可比期间未投资过本基金。

7.4.8.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2015年12月31日		上年度末 2014年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
信诚人寿保险有限公司	7,627,383.68	2.29%	-	-

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行，本基金的其它关联方在上年度末未持有本基金。

7.4.8.5 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 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31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	198,739,534.41	1,072,318.37	44,199,236.45	70,156.36

注：本基金通过“中国银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司

公司的结算备付金,于本报告期末的相关余额为人民币 2,048,909.36 元。(上年度末余额:人民币 821,006.81 元)。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本年度与上年度可比期间,在承销期内均未购入过由关联方承销的证券。

7.4.8.7 其它关联交易事项的说明

7.4.9 期末(2015年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值单 价	复牌日期	复牌 开盘单 价	数量(股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
300043	互动娱乐	2015-12-17	拟披露 重大事项	15.80	-	-	1,000,000	16,985,313.59	15,800,000.00	-
300104	乐视网	2015-12-07	拟定增 收购乐 视营业 股权	58.80	-	-	100,000	4,746,053.00	5,880,000.00	-
600690	青岛海尔	2015-10-19	筹划重 大事项	9.92	2016-02-01	8.93	500,000	5,949,571.00	4,960,000.00	-

注:截至本报告批准报出日,“互动娱乐”、“乐视网”仍未发布复牌公告。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

于本报告期末,本基金未持有正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无需要说明的此类事项。

§8 投资组合报告

8.1 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	697,146,237.54	76.68
	其中:股票	697,146,237.54	76.68
2	固定收益投资	41,548.80	-
	其中:债券	41,548.80	-

	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
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	银行存款和结算备付金合计	200,788,443.77	22.09
7	其他各项资产	11,150,417.86	1.23
8	合计	909,126,647.97	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	470,125,130.41	52.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,157,092.00	1.03
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	88,741,014.05	9.96
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	62,252,962.08	6.99
J	金融业	20,575,000.00	2.31
K	房地产业	8,196,000.00	0.92
L	租赁和商务服务业	15,407,039.00	1.73
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	22,692,000.00	2.55
S	综合	-	-
	合计	697,146,237.54	78.28

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值	占基金资产净值比例
----	------	------	--------	------	-----------

					(%)
1	000952	广济药业	1,788,500	41,135,500.00	4.62
2	300093	金刚玻璃	839,941	26,626,129.70	2.99
3	002453	天马精化	2,350,000	26,437,500.00	2.97
4	002655	共达电声	1,000,000	24,660,000.00	2.77
5	002727	一心堂	362,139	20,942,498.37	2.35
6	002009	天奇股份	1,000,000	20,750,000.00	2.33
7	002426	胜利精密	759,950	19,773,899.00	2.22
8	603456	九洲药业	276,500	19,661,915.00	2.21
9	000679	大连友谊	1,000,100	19,281,928.00	2.17
10	300086	康芝药业	999,925	17,598,680.00	1.98

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600666	西南药业	98,784,469.93	41.98
2	300059	东方财富	94,549,734.39	40.18
3	600829	三精制药	63,436,084.92	26.96
4	300104	乐视网	60,145,994.00	25.56
5	002373	千方科技	59,878,408.68	25.45
6	600599	熊猫金控	57,802,775.00	24.57
7	300295	三六五网	57,623,399.66	24.49
8	300304	云意电气	55,384,839.36	23.54
9	002355	兴民钢圈	51,843,358.00	22.03
10	603899	晨光文具	51,139,166.50	21.73
11	001696	宗申动力	49,264,339.64	20.94
12	002084	海鸥卫浴	47,249,600.57	20.08
13	002715	登云股份	46,965,569.32	19.96
14	002646	青青稞酒	46,602,301.90	19.81
15	300226	上海钢联	45,963,999.76	19.54
16	600687	刚泰控股	44,391,476.15	18.87
17	000952	广济药业	39,370,196.66	16.73
18	600483	福能股份	38,742,490.75	16.47
19	000024	招商地产	35,818,252.15	15.22
20	600651	飞乐音响	35,788,038.44	15.21
21	300212	易华录	34,209,055.61	14.54
22	601233	桐昆股份	33,203,161.43	14.11
23	002539	新都化工	32,419,672.00	13.78
24	300198	纳川股份	32,185,091.08	13.68
25	300093	金刚玻璃	31,461,699.70	13.37

26	600637	百视通	31,190,698.75	13.26
27	002009	天奇股份	29,635,171.03	12.60
28	002453	天马精化	29,215,618.76	12.42
29	300433	蓝思科技	28,625,068.00	12.17
30	002363	隆基机械	28,240,044.00	12.00
31	300274	阳光电源	28,172,999.78	11.97
32	000858	五粮液	27,095,682.00	11.52
33	002655	共达电声	26,999,367.28	11.47
34	601166	兴业银行	26,985,092.00	11.47
35	300043	互动娱乐	26,454,625.92	11.24
36	300086	康芝药业	26,113,864.65	11.10
37	002329	皇氏集团	25,642,433.50	10.90
38	000513	丽珠集团	24,853,837.33	10.56
39	300199	翰宇药业	24,257,827.86	10.31
40	600963	岳阳林纸	24,235,348.87	10.30
41	600664	哈药股份	23,968,784.49	10.19
42	600260	凯乐科技	23,702,493.90	10.07
43	600479	千金药业	23,673,877.00	10.06
44	002290	禾盛新材	23,468,823.66	9.97
45	603883	老百姓	23,455,781.30	9.97
46	603939	益丰药房	23,306,771.52	9.91
47	300316	晶盛机电	22,859,062.35	9.72
48	300178	腾邦国际	22,651,467.00	9.63
49	600203	福日电子	21,974,192.85	9.34
50	603456	九洲药业	21,969,176.00	9.34
51	000025	特力A	21,360,321.29	9.08
52	300305	裕兴股份	21,175,409.12	9.00
53	002332	仙琚制药	20,909,347.04	8.89
54	600208	新湖中宝	20,704,498.00	8.80
55	300252	金信诺	20,676,832.10	8.79
56	300345	红宇新材	20,638,602.99	8.77
57	000679	大连友谊	20,449,717.42	8.69
58	002713	东易日盛	20,074,577.59	8.53
59	300022	吉峰农机	19,921,653.38	8.47
60	002727	一心堂	19,585,059.20	8.32
61	002426	胜利精密	19,205,210.00	8.16
62	002634	棒杰股份	18,797,642.00	7.99
63	601021	春秋航空	18,289,177.20	7.77
64	601377	兴业证券	17,667,000.00	7.51
65	000783	长江证券	17,521,330.54	7.45
66	002172	澳洋科技	17,380,581.19	7.39

67	002085	万丰奥威	17,266,514.84	7.34
68	600090	啤酒花	16,825,797.95	7.15
69	002367	康力电梯	16,785,712.47	7.13
70	002347	泰尔重工	16,752,447.39	7.12
71	000599	青岛双星	16,296,677.39	6.93
72	603368	柳州医药	16,204,847.00	6.89
73	300096	易联众	15,257,980.00	6.48
74	002736	国信证券	15,250,000.00	6.48
75	600958	东方证券	14,740,388.02	6.26
76	601688	华泰证券	14,676,518.42	6.24
77	000789	万年青	14,633,815.85	6.22
78	000776	广发证券	13,964,009.80	5.93
79	000669	金鸿能源	13,919,832.20	5.92
80	603898	好莱客	13,500,000.00	5.74
81	300032	金龙机电	13,475,209.00	5.73
82	002152	广电运通	13,471,617.50	5.73
83	002768	国恩股份	13,455,292.00	5.72
84	000333	美的集团	13,317,755.71	5.66
85	600649	城投控股	12,857,421.00	5.46
86	601599	鹿港科技	12,811,307.35	5.44
87	300133	华策影视	12,658,314.62	5.38
88	002699	美盛文化	12,327,429.05	5.24
89	300356	光一科技	12,137,752.00	5.16
90	300300	汉鼎股份	12,130,000.00	5.16
91	000919	金陵药业	12,038,010.14	5.12
92	600067	冠城大通	11,953,297.27	5.08
93	600999	招商证券	11,876,132.00	5.05
94	002123	荣信股份	11,484,266.77	4.88
95	000592	平潭发展	11,468,614.50	4.87
96	300299	富春通信	11,291,526.00	4.80
97	300058	蓝色光标	11,239,527.58	4.78
98	002488	金固股份	11,219,561.00	4.77
99	002188	新嘉联	11,116,980.00	4.72
100	000651	格力电器	11,061,164.00	4.70
101	600617	国新能源	10,955,679.00	4.66
102	300228	富瑞特装	10,869,911.98	4.62
103	600570	恒生电子	10,744,398.94	4.57
104	002364	中恒电气	10,420,000.00	4.43
105	002142	宁波银行	10,139,642.96	4.31
106	600330	天通股份	10,017,386.00	4.26
107	300291	华录百纳	9,891,563.00	4.20

108	002354	天神娱乐	9,871,800.00	4.20
109	002632	道明光学	9,843,218.00	4.18
110	002739	万达院线	9,818,776.74	4.17
111	300194	福安药业	9,779,780.39	4.16
112	601388	怡球资源	9,711,789.40	4.13
113	600738	兰州民百	9,691,209.00	4.12
114	300243	瑞丰高材	9,625,091.00	4.09
115	300130	新国都	9,546,197.40	4.06
116	002055	得润电子	9,325,487.00	3.96
117	002668	奥马电器	9,200,000.00	3.91
118	002496	辉丰股份	9,185,986.73	3.90
119	002390	信邦制药	9,146,420.00	3.89
120	600837	海通证券	9,137,316.80	3.88
121	002230	科大讯飞	8,994,954.00	3.82
122	002513	蓝丰生化	8,910,862.33	3.79
123	300278	华昌达	8,871,967.84	3.77
124	002587	奥拓电子	8,833,435.00	3.75
125	002405	四维图新	8,812,499.44	3.75
126	600373	中文传媒	8,802,489.80	3.74
127	300165	天瑞仪器	8,682,702.12	3.69
128	600029	南方航空	8,550,000.00	3.63
129	600969	郴电国际	8,357,758.10	3.55
130	002156	通富微电	8,350,558.00	3.55
131	601009	南京银行	8,294,820.00	3.53
132	600315	上海家化	8,281,027.00	3.52
133	600745	中茵股份	8,278,372.00	3.52
134	300136	信维通信	8,219,272.00	3.49
135	600136	道博股份	8,190,941.00	3.48
136	600048	保利地产	8,162,500.00	3.47
137	600058	五矿发展	8,161,131.62	3.47
138	300328	宜安科技	8,149,398.00	3.46
139	002454	松芝股份	8,148,148.39	3.46
140	000540	中天城投	8,123,321.00	3.45
141	600172	黄河旋风	8,097,056.00	3.44
142	601888	中国国旅	8,003,471.67	3.40
143	002487	大金重工	7,997,164.28	3.40
144	601198	东兴证券	7,995,766.50	3.40
145	300159	新研股份	7,953,091.00	3.38
146	300099	尤洛卡	7,934,344.00	3.37
147	600576	万好万家	7,915,391.40	3.36
148	601998	中信银行	7,889,914.63	3.35

149	300207	欣旺达	7,799,756.00	3.31
150	600162	香江控股	7,784,604.00	3.31
151	300471	厚普股份	7,723,353.50	3.28
152	600705	中航资本	7,693,545.65	3.27
153	300383	光环新网	7,687,520.00	3.27
154	002626	金达威	7,654,824.64	3.25
155	002081	金螳螂	7,645,990.98	3.25
156	000790	华神集团	7,576,176.44	3.22
157	300031	宝通科技	7,530,000.00	3.20
158	000977	浪潮信息	7,487,391.93	3.18
159	600358	国旅联合	7,291,184.70	3.10
160	600536	中国软件	7,288,652.00	3.10
161	002617	露笑科技	7,198,894.98	3.06
162	002475	立讯精密	7,178,763.21	3.05
163	600872	中炬高新	7,094,000.00	3.02
164	300003	乐普医疗	7,057,022.75	3.00
165	600310	桂东电力	6,999,944.00	2.98
166	000016	深康佳 A	6,900,000.00	2.93
167	002127	新民科技	6,882,274.00	2.93
168	600282	南钢股份	6,881,964.50	2.92
169	000625	长安汽车	6,458,028.15	2.74
170	601601	中国太保	6,218,431.04	2.64
171	600019	宝钢股份	6,198,347.88	2.63
172	300294	博雅生物	6,194,759.30	2.63
173	600690	青岛海尔	5,949,571.00	2.53
174	300122	智飞生物	5,844,592.00	2.48
175	600782	新钢股份	5,707,779.83	2.43
176	002191	劲嘉股份	5,441,538.57	2.31
177	601555	东吴证券	5,420,000.00	2.30
178	300128	锦富新材	5,375,000.00	2.28
179	000100	TCL 集团	5,370,000.00	2.28
180	600987	航民股份	5,362,166.14	2.28
181	000603	盛达矿业	5,283,584.26	2.25
182	002469	三维工程	5,168,207.34	2.20
183	002241	歌尔声学	5,086,535.60	2.16
184	000550	江铃汽车	5,001,686.60	2.13
185	300100	双林股份	4,807,368.00	2.04
186	600000	浦发银行	4,800,000.00	2.04
187	002568	百润股份	4,735,000.00	2.01

注：买入金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600666	奥瑞德	129,532,471.12	55.05
2	300059	东方财富	89,860,191.56	38.19
3	300304	云意电气	64,630,933.20	27.47
4	002373	千方科技	50,898,402.00	21.63
5	600599	熊猫金控	50,581,664.80	21.50
6	002355	兴民钢圈	44,753,373.65	19.02
7	600687	刚泰控股	43,166,570.85	18.35
8	600829	人民同泰	42,972,540.94	18.26
9	300104	乐视网	42,548,210.62	18.08
10	002084	海鸥卫浴	42,378,164.00	18.01
11	002329	皇氏集团	40,092,139.09	17.04
12	002539	新都化工	37,021,616.00	15.73
13	600208	新湖中宝	34,579,711.25	14.70
14	300226	上海钢联	33,797,989.60	14.36
15	600483	福能股份	33,166,109.84	14.10
16	600637	百视通	32,389,264.33	13.77
17	000024	招商地产	31,834,417.50	13.53
18	002646	青青稞酒	31,571,276.46	13.42
19	300433	蓝思科技	29,701,384.58	12.62
20	603899	晨光文具	29,533,156.46	12.55
21	300295	三六五网	27,940,500.50	11.87
22	300198	纳川股份	27,743,432.12	11.79
23	002363	隆基机械	27,713,081.44	11.78
24	300345	红宇新材	27,439,083.60	11.66
25	000858	五粮液	26,894,304.33	11.43
26	603939	益丰药房	26,398,845.26	11.22
27	600963	岳阳林纸	25,064,995.38	10.65
28	002715	登云股份	24,681,137.18	10.49
29	601166	兴业银行	24,459,731.00	10.40
30	300212	易华录	23,857,796.77	10.14
31	001696	宗申动力	23,447,160.78	9.97
32	300252	金信诺	22,866,068.20	9.72
33	300096	易联众	22,347,530.00	9.50
34	600651	飞乐音响	22,290,336.38	9.47
35	600664	哈药股份	21,464,402.80	9.12
36	601021	春秋航空	21,207,281.00	9.01
37	300316	晶盛机电	20,737,906.04	8.81
38	002085	万丰奥威	20,454,534.56	8.69
39	002634	棒杰股份	20,336,844.19	8.64

40	000333	美的集团	19,790,702.37	8.41
41	000513	丽珠集团	19,673,345.00	8.36
42	300178	腾邦国际	19,483,045.66	8.28
43	600260	凯乐科技	19,229,855.00	8.17
44	601688	华泰证券	18,720,317.00	7.96
45	300305	裕兴股份	18,481,000.84	7.85
46	300199	翰宇药业	18,013,429.32	7.66
47	601233	桐昆股份	17,930,387.00	7.62
48	002736	国信证券	17,809,701.00	7.57
49	600479	千金药业	17,608,924.40	7.48
50	000919	金陵药业	17,473,531.57	7.43
51	002347	泰尔重工	17,437,070.33	7.41
52	601377	兴业证券	16,767,382.00	7.13
53	300032	金龙机电	16,203,538.47	6.89
54	600649	城投控股	15,945,254.80	6.78
55	600958	东方证券	15,918,105.65	6.77
56	603368	柳州医药	15,881,435.86	6.75
57	300228	富瑞特装	15,827,027.18	6.73
58	300243	瑞丰高材	15,377,721.00	6.54
59	000669	金鸿能源	14,988,029.00	6.37
60	600067	冠城大通	14,851,516.00	6.31
61	600203	福日电子	14,293,618.84	6.07
62	601601	中国太保	13,639,905.75	5.80
63	300274	阳光电源	13,594,628.78	5.78
64	002713	东易日盛	13,515,983.31	5.74
65	002488	金固股份	13,398,715.96	5.69
66	600048	保利地产	13,209,000.00	5.61
67	002290	禾盛新材	13,189,141.60	5.61
68	000783	长江证券	13,067,630.71	5.55
69	002405	四维图新	12,844,792.79	5.46
70	000599	青岛双星	12,788,530.20	5.44
71	601599	鹿港科技	12,619,312.16	5.36
72	300086	康芝药业	12,586,953.67	5.35
73	000592	平潭发展	12,394,738.05	5.27
74	000540	中天城投	12,061,569.68	5.13
75	300022	吉峰农机	11,807,475.04	5.02
76	300356	光一科技	11,794,667.80	5.01
77	601388	怡球资源	11,701,359.91	4.97
78	603883	老百姓	11,519,896.00	4.90
79	300328	宜安科技	11,468,188.03	4.87
80	600705	中航资本	11,436,584.20	4.86

81	600881	亚泰集团	11,108,999.00	4.72
82	002496	辉丰股份	10,934,976.85	4.65
83	601318	中国平安	10,875,700.00	4.62
84	002354	天神娱乐	10,812,820.58	4.60
85	600373	中文传媒	10,715,119.25	4.55
86	002172	澳洋科技	10,707,909.60	4.55
87	300291	华录百纳	10,623,623.00	4.52
88	002152	广电运通	10,599,254.38	4.50
89	002230	科大讯飞	10,562,375.33	4.49
90	002390	信邦制药	10,536,646.00	4.48
91	600058	五矿发展	10,474,946.00	4.45
92	600330	天通股份	10,471,478.00	4.45
93	300133	华策影视	10,432,683.40	4.43
94	002142	宁波银行	10,402,924.70	4.42
95	002364	中恒电气	10,343,582.49	4.40
96	603898	好莱客	10,273,758.24	4.37
97	300058	蓝色光标	10,134,632.64	4.31
98	600690	青岛海尔	10,129,671.23	4.31
99	300383	光环新网	10,004,206.00	4.25
100	002739	万达院线	9,966,106.60	4.24
101	600090	啤酒花	9,917,440.10	4.21
102	000025	特力A	9,858,916.08	4.19
103	600570	恒生电子	9,782,490.77	4.16
104	601198	东兴证券	9,592,825.00	4.08
105	002626	金达威	9,264,000.00	3.94
106	601009	南京银行	9,170,512.57	3.90
107	002454	松芝股份	9,068,248.72	3.85
108	603456	九洲药业	9,030,326.69	3.84
109	600029	南方航空	8,894,808.00	3.78
110	300136	信维通信	8,884,230.50	3.78
111	300471	厚普股份	8,883,000.00	3.78
112	300300	汉鼎股份	8,840,949.22	3.76
113	600837	海通证券	8,650,369.00	3.68
114	002367	康力电梯	8,559,714.42	3.64
115	300043	互动娱乐	8,512,173.40	3.62
116	002475	立讯精密	8,480,778.40	3.60
117	002617	露笑科技	8,444,000.00	3.59
118	000046	泛海控股	8,438,057.73	3.59
119	002570	贝因美	8,436,993.00	3.59
120	000651	格力电器	8,417,024.00	3.58
121	000977	浪潮信息	8,416,060.58	3.58

122	600162	香江控股	8,372,112.76	3.56
123	300278	华昌达	8,248,175.70	3.51
124	000789	万年青	8,219,693.17	3.49
125	601888	中国国旅	8,172,479.90	3.47
126	300003	乐普医疗	8,103,180.00	3.44
127	000625	长安汽车	8,026,774.00	3.41
128	600315	上海家化	8,000,000.00	3.40
129	000603	盛达矿业	7,921,089.20	3.37
130	600536	中国软件	7,750,826.98	3.29
131	601998	中信银行	7,624,595.80	3.24
132	002487	大金重工	7,568,149.00	3.22
133	600969	郴电国际	7,545,177.73	3.21
134	600000	浦发银行	7,405,897.00	3.15
135	600036	招商银行	7,358,737.53	3.13
136	600872	中炬高新	7,302,681.00	3.10
137	002127	新民科技	7,277,238.00	3.09
138	600782	新钢股份	7,265,962.00	3.09
139	300128	锦富新材	7,171,574.64	3.05
140	000793	华闻传媒	7,169,094.00	3.05
141	002241	歌尔声学	7,157,497.13	3.04
142	300122	智飞生物	7,079,496.20	3.01
143	600282	南钢股份	7,062,818.26	3.00
144	000016	深康佳 A	6,966,542.80	2.96
145	002081	金螳螂	6,692,137.90	2.84
146	001979	招商蛇口	6,646,466.76	2.82
147	600019	宝钢股份	6,341,423.58	2.70
148	000002	万 科 A	6,262,366.00	2.66
149	002469	三维工程	6,134,310.02	2.61
150	300294	博雅生物	6,024,967.76	2.56
151	002280	新世纪	5,998,102.00	2.55
152	600310	桂东电力	5,790,285.00	2.46
153	600297	美罗药业	5,715,276.00	2.43
154	002191	劲嘉股份	5,506,569.14	2.34
155	601169	北京银行	5,452,657.84	2.32
156	603885	吉祥航空	5,249,832.16	2.23
157	600643	爱建股份	5,190,596.56	2.21
158	601555	东吴证券	5,121,298.42	2.18
159	002445	中南重工	4,991,857.95	2.12

注：卖出金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,454,485,130.79
卖出股票收入（成交）总额	2,870,619,228.95

注：买入股票成本和卖出股票收入按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	41,548.80	-
8	其他	-	-
9	合计	41,548.80	-

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110031	航信转债	320	41,548.80	-

注：本基金本报告期末仅持有上述债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未进行贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未进行股指期货投资。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资范围不包括股指期货投资。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资范围不包括国债期货投资。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金投资范围不包括国债期货投资。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 2015年6月26日，根据媒体报道的情况，武穴市环保局对广济药业进行现场检查，并于

2015年6月27日向广济药业下达了《武穴市环境保护局行政处罚事先(听证)告知书》(武环罚听告字[2015]第11号)。2015年6月30日,广济药业接到武穴市环保局下达的《行政处罚决定书》(武环罚听告字[2015]第21号):责令广济药业拆除排水泵排污设施,并处以人民币10万元的罚款。广济药业结合维生素B2生产线搬迁,对环保部门现场检查提出的问题启动整改,截至2015年6月30日,广济药业已全部完成整改事项。

对广济药业的投资决策程序的说明:根据广济药业于2015年7月1日发布的“澄清公告”,公司已经于6月30日完成相关整改,同时伴随VB2生产基地搬迁至“生物产业园”,我们预计后续发生环保问题的可能性比较小。另外,公司备货充足,不会因环保停产等问题导致业绩出现大幅下滑。综上,我们认为该处理不会影响广济药业的经营业绩,不会对公司股价造成明显的负面影响。此外,我们对该证券的投资严格执行内部投资决策流程,符合法律法规和公司制度的规定。

除此之外,其余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。

8.12.2 本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定备选库之外的股票。

8.12.3 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	495,571.58
2	应收证券清算款	6,990,546.16
3	应收股利	-
4	应收利息	43,094.26
5	应收申购款	3,621,205.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,150,417.86

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110031	航信转债	41,548.80	-

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
8,091	41,121.81	32,729,453.86	9.84%	299,987,107.16	90.16%

9.2 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	中国平安人寿保险股份有限公司-分红	9,366,714.11	2.82%
2	信诚人寿保险有限公司	7,627,383.68	2.29%
3	中国平安人寿保险股份有限公司-UL 投资	7,232,911.39	2.17%
4	英大泰和人寿保险股份有限公司-传统保险产品	5,748,945.96	1.73%
5	曾秀吟	5,085,215.16	1.53%
6	陈水珍	3,676,102.94	1.10%
7	黄锦	3,621,513.94	1.09%
8	汪维姗	2,932,769.01	0.88%
9	陈臻瑞	2,790,820.14	0.84%
10	吕大龙	2,782,737.62	0.84%

注：持有人为场内持有人。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	125,334.70	0.04%

9.4 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的情况

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 研究部门负责人持有本开放式 基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基 金	10~50

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2012年5月7日)基金份额总额	308,485,543.33
本报告期期初基金份额总额	135,779,425.45
本报告期基金总申购份额	1,490,703,272.65

减：本报告期基金总赎回份额	1,293,766,137.08
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	332,716,561.02

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 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

1、报告期内基金管理人的重大人事变动：

经信诚基金管理有限公司第二届董事会第 48 次会议审议通过，聘任吕涛先生担任信诚基金总经理职务。本基金管理人已于 2015 年 4 月 3 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站上刊登了《信诚基金管理有限公司关于总经理任职的公告》。自新任总经理任职之日起，本公司董事长张翔燕女士不再代为履行总经理职务。上述变更事项已按有关规定向中国证券监督管理委员会证券投资基金监管部和上海证监局报告。

经信诚基金管理有限公司董事会审议通过，解聘林军女士信诚基金副总经理职务，同时聘任唐世春先生担任公司副总经理，不再担任督察长职务。在新任督察长任职之前，代为履行督察长职务。本基金管理人已于 2015 年 6 月 30 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站上刊登了《信诚基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。上述变更事项已按规定向中国证券监督管理委员会证券投资基金监管部、中国证券投资基金业协会和上海证监局报备。

经信诚基金管理有限公司第二届董事会第五十三次会议审议通过，聘任周浩先生担任公司督察长职务。自新任督察长任职之日起，本公司副总经理唐世春先生不再代为履行督察长职务。本基金管理人已于 2015 年 9 月 26 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站上刊登了《信诚基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。上述变更事项已按规定向中国证券监督管理委员会证券投资基金监管部、上海证监局和中国证券投资基金业协会报备。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2015 年 4 月，李爱华先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金报告年度应支付给毕马威华振会计师事务所的报酬为人民币 50,000 元。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。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人于 2015 年 7 月 29 日收到上海证监局《关于对信诚基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》（以下简称“整改决定书”）。公司领导高度重视，针对整改决定书指出的问题，公司认真落实整改要求，加强制度和风控措施，进一步提升了公司内部控制和风险管理的能力，并已按要求向上海证监局提交了整改报告。除上述情况外，报告期内管理人、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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
安信证券	1	2,767,903,632.92	43.82%	2,475,189.65	43.39%	本期新增
国泰君安	1	1,314,379,171.22	20.81%	1,199,800.20	21.03%	本期新增
国信证券	1	604,439,183.87	9.57%	550,825.49	9.66%	本期新增
东方证券	1	573,044,394.16	9.07%	525,144.82	9.21%	-
浙商证券	1	515,732,477.33	8.17%	456,371.92	8.00%	-
招商证券	2	400,643,141.84	6.34%	373,118.00	6.54%	本期新增
大通证券	1	139,978,801.97	2.22%	123,867.30	2.17%	-
海通证券	2	-	-	-	-	本期新增
西南证券	2	-	-	-	-	本期新增
中信建投	2	-	-	-	-	本期新增
中信证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	2	-	-	-	-	本期新增

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。

11.7.2 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	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
安信证券	-	-
国泰君安	-	-
国信证券	-	-
东方证券	4,619,223.80	100.00%
浙商证券	-	-
招商证券	-	-
大通证券	-	-
海通证券	-	-
西南证券	-	-
中信建投	-	-
中信证券	-	-
齐鲁证券	-	-

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《关于实施〈公开募集证券投资基金运作管理办法〉有关问题的规定》等相关法律法规及信诚基金管理有限公司(以下简称“本基金管理人”)旗下部分基金基金合同的约定,经与基金托管人协商一致,自 2015 年 8 月 3 日起,本基金名称变更为“信诚周期轮动混合型证券投资基金(LOF)”,基金类别变更为“混合型”。上述事项已报中国证监会备案。

信诚基金管理有限公司
2016 年 3 月 25 日