

信诚双盈债券型证券投资基金(LOF)  
(原信诚双盈分级债券型证券投资基金转型)2015年半年度报告摘要

2015年6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

送出日期：2015年8月26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。本半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2015年8月25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。

自2015年4月13日信诚双盈分级债券型证券投资基金之双盈B份额终止上市起,原信诚双盈分级债券型证券投资基金名称变更为信诚双盈债券型证券投资基金(LOF)。原信诚双盈分级债券型证券投资基金本报告期自2015年1月1日至2015年4月13日止,信诚双盈债券型证券投资基金(LOF)本报告期自2015年4月14日至2015年6月30日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

#### 2.1.1 信诚双盈分级债券型证券投资基金

基金名称	信诚双盈分级债券型证券投资基金	
基金简称	信诚双盈分级债券	
场内简称	信诚双盈	
基金主代码	165517	
基金运作方式	契约型,本基金合同生效后三年内,双盈A份额每满6个月开放申购和赎回一次,但在第六个开放日仅开放赎回,不开放申购;双盈B份额封闭运作,不开放申购和赎回,但可在深圳证券交易所上市交易;基金合同生效后3年期届满,本基金不再进行基金份额分级,并转换为上市开放式基金(LOF)。	
基金合同生效日	2012年4月13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	166,060,887.75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	2012年7月12日	
下属分级基金的基金简称	信诚双盈分级债券A	信诚双盈分级债券B
下属分级基金的场内简称	双盈A	双盈B
下属分级基金的交易代码	165518	150081

注:根据基金合同,本基金在份额转换基准日(2015年4月13日)日终,以份额转换后1.000元的基金份额净值为基准,双盈A和双盈B以各自的基金份额参考净值为基准已转换为信诚双盈债券型证券投资基金(LOF)的份额。双盈B份额自2015年4月13日起终止上市。

<b>2.1.2 信诚双盈债券型证券投资基金(LOF)</b>	
基金名称	信诚双盈债券型证券投资基金(LOF)
基金简称	信诚双盈债券(LOF)
场内简称	信诚双盈
基金主代码	165517
基金运作方式	契约型, 基金合同生效后3年期届满, 本基金不再进行基金份额分级, 并已转换为上市开放式基金(LOF)
基金合同生效日	2012年4月13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	129,984,408.22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	2015年4月23日

## 2.2 基金产品说明

<b>2.2.1 信诚双盈分级债券型证券投资基金</b>	
投资目标	本基金在严格控制风险的基础上, 通过主动管理, 追求超越业绩比较基准的投资收益, 力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金投资组合中债券、股票、现金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, 其战略性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, 在一定的范围内作战术性资产配置调整, 以降低系统性风险对基金收益的影响。
业绩比较基准	中信标普全债指数收益率
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。
下属分级基金的风险收益特征	基金合同生效之日起3年内, 本基金经过基金份额分级后, 双盈A份额为低风险、收益相对稳定的基金份额。 基金合同生效之日起3年内, 本基金经过基金份额分级后, 双盈B份额为中高风险、中高收益的基金份额。
<b>2.2.2 信诚双盈债券型证券投资基金(LOF)</b>	
投资目标	本基金在严格控制风险的基础上, 通过主动管理, 追求超越业绩比较基准的投资收益, 力争实现基金资产的长期稳定增值。

投资策略	本基金投资组合中债券、股票、现金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,其战略性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,在一定的范围内作战术性资产配置调整,以降低系统性风险对基金收益的影响。
业绩比较基准	中信标普全债指数收益率
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。

### 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	唐世春
	联系电话	021-68649788
	电子邮箱	shichun.tang@citicpru.com.cn
客户服务电话	400-666-0066	95566
传真	021-50120888	010-66594942
注册地址	上海市浦东世纪大道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	上海市浦东世纪大道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	张翔燕	田国立

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报、中国证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.xcfunds.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标 (转型前)

金额单位: 人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2015年1月1日至2015年4月13日)
本期已实现收益	22,863,796.31
本期利润	14,015,108.72
加权平均基金份额本期利润	0.0786
本期加权平均净值利润率	5.16

本期基金份额净值增长率	5.27%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年4月13日)
期末可供分配利润	98,209,063.39
期末可供分配基金份额利润	0.5914
期末基金资产净值	263,324,325.42
期末基金份额净值	1.586
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015年4月13日)
基金份额累计净值增长率	46.69%

### 3.1 主要会计数据和财务指标 (转型后)

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2015年4月14日至2015年6月30日)
本期已实现收益	17,273,271.66
本期利润	18,399,295.00
加权平均基金份额本期利润	0.1105
本期加权平均净值利润率	10.13
本期基金份额净值增长率	7.90%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配利润	61,881,298.78
期末可供分配基金份额利润	0.4761
期末基金资产净值	140,303,431.29
期末基金份额净值	1.079
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015年6月30日)
基金份额累计净值增长率	7.90%

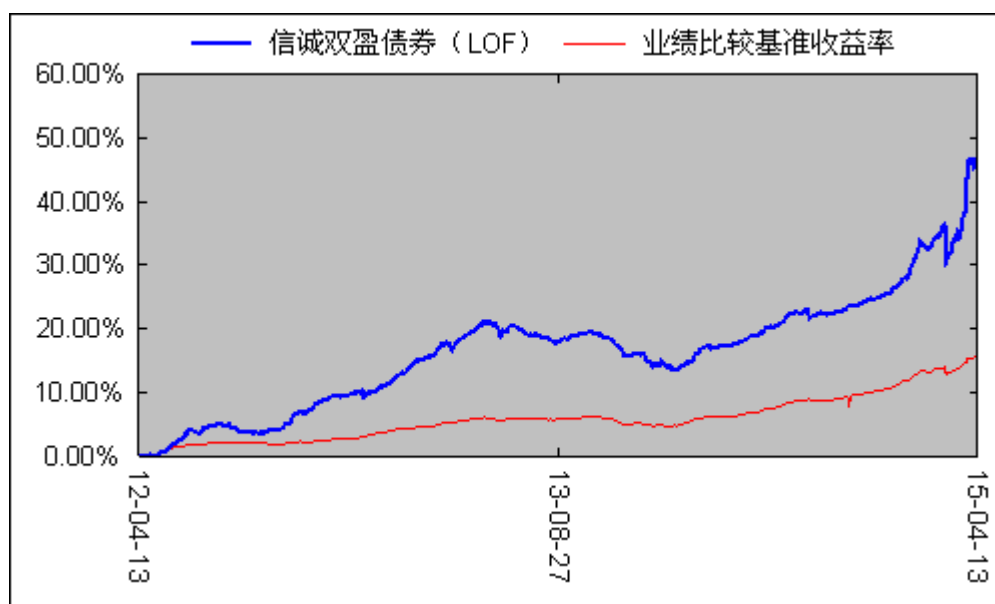
### 3.2 基金净值表现 (转型前)

#### 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 (2015-4-1至2015-4-13)	1.03%	0.41%	0.05%	0.03%	0.98%	0.38%
过去六个月 (2015-1-1至2015-4-13)	5.27%	0.41%	0.67%	0.09%	4.60%	0.32%
过去一年 (2014-7-1至2015-4-13)	20.51%	0.46%	6.04%	0.18%	14.47%	0.28%
过去三年 (2012-7-	40.51%	0.29%	13.35%	0.11%	27.16%	0.18%

1 至 2015-4-13)						
自基金合同生效起至今 (2012-4-13 至 2015-4-13)	46.69%	0.28%	15.44%	0.10%	31.25%	0.18%

### 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



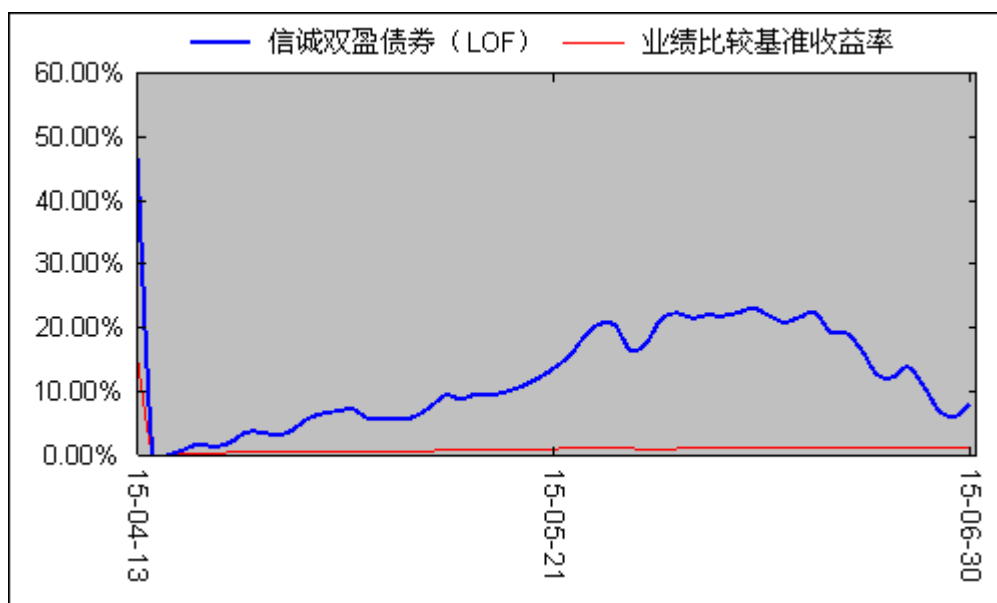
注:按照本基金合同规定,本基金建仓期为基金合同生效之日起六个月。截止 2015 年 4 月 13 日,本基金的各项投资比例已达到基金合同投资限制中规定的各项比例。

## 3.2 基金净值表现 (转型后)

### 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 (2015-6-1 至 2015-6-30)	-8.17%	1.71%	0.22%	0.04%	-8.39%	1.67%
过去三个月 (2015-4-14 至 2015-6-30)	7.90%	1.43%	1.10%	0.05%	6.80%	1.38%

### 3.2.3 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、本基金转型日期为 2015 年 4 月 13 日,截止报告期末,本基金转型未满一年。

2、按照本基金合同规定,本基金建仓期为基金合同生效之日起六个月。建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同投资限制中规定的各项比例。

## § 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 6 月 30 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、信诚精萃成长股票型证券投资基金、信诚盛世蓝筹股票型证券投资基金、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、信诚优胜精选股票型证券投资基金、信诚中小盘股票型证券投资基金、信诚深度价值股票型证券投资基金(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、信诚新机遇股票型证券投资基金(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)、信诚周期轮动股票型证券投资基金(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、信诚新兴产业股票型证券投资基金、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、信诚幸福消费股票型证券投资基金、信诚薪金宝货币市场基金、信诚 3 个月理财债券型证券投资基金、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、信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)和信诚新鑫回报灵活配置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		
曾丽琼	本基金基金经理，信诚货币市场基金、信诚新双盈分级债券基金、信诚季季定期支付债券基金和信诚月月定期支付债券基金的基金经理、固定收益总监。	2012年4月13日	-	12	金融学硕士，12年金融、基金从业经验；拥有丰富的债券投资和流动性管理经验；曾任职于杭州银行和华宝兴业基金管理有限公司，历任华宝兴业现金宝货币市场基金和华宝兴业增强收益债券基金的基金经理。2010年7月加入信诚基金管理有限公司，现任信诚基金管理有限公司固定收益总监、信诚货币市场基金、信诚双盈债券基金（LOF）、信诚新双盈分级债券基金、信诚季季定期支付债券基金和信诚月月定期支付债券基金的基金经理。
杨立春	本基金基金经理，信诚新双盈分级债券基金、信诚新鑫回报灵活配置混合基金的基金经理	2015年4月9日	-	3	复旦大学经济学博士。2005年7月至2011年6月期间于江苏省社会科学院担任助理研究员，从事产业经济和宏观经济研究工作。2011年7月加入信诚基金管理有限公司，担任固定收益分析师。现任信诚双盈债券基金（LOF）、信诚新双盈分级债券基金、信诚新鑫回报灵活配置混合基金的基金经理。

注：1. 本基金管理人于2015年4月30日发布公告，基金经理曾丽琼女士因个人原因（休产假）无



法正常履行职务, 本公司根据有关法规和公司制度批准曾丽琼女士自 2015 年 4 月 30 日至 2015 年 10 月 10 日休产假。在曾丽琼女士休假期间, 其所管理的信诚双盈债券型证券投资基金 (LOF) 由该基金的另一基金经理杨立春先生单独管理。

2. 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。

3. 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 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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《信诚双盈分级债券型证券投资基金基金合同》、《信诚双盈分级债券型证券投资基金招募说明书》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。

##### 4.3.2 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 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 年上半年以来, A 股冲高回落出现巨幅调整, 债券市场走势相对平稳。从经济基本面看, 我国经济结构调整进程仍在继续, 主要经济数据包括出口、制造业投资、地产投资和基建投资难言企稳, 从主要经济指标看, 断言经济见底尚为时过早。受国内需求不足影响, 消费物价上涨压力下降, 工业品价格持续通缩; 房地产市场虽有转暖, 但基建投资并无显著改善; 此外, 财政支出增速也从 4 月高点回落, 财政对于经济的支持力度显著弱于预期。受上述因素影响, 2015 年宽松货币、积极财政的政策基调得以贯彻, 同时出于稳定 A 股市场的目的, 央行持续通过定向放松政策、降息降准措施向市场注入流动性。在基本面明显利好的背景下, 债券投资者对债市的预期相对乐观, 加上权益市场的巨幅调整使得债市的吸引力上升, 2015 年内债券牛市格局初显, 当前债券收益率的配置价值显著提升。

2015 年上半年以来, 鉴于市场资金成本较低, 双盈基金管理人维持了较高的债券品种配置, 同时降低权益资产仓位, 减少净值波动。大类资产配置方面, 自二季度以来, 对可转债和股票投资更趋谨慎, 加强波段操作。

##### 4.4.2 报告期内基金业绩表现

本报告期内, 原信诚双盈分级债券型证券投资基金 (2015-1-1 至 2015-4-13) 基金份额净值增长率为 5.27%, 同期业绩比较基准收益率为 0.67%, 基金超越业绩比较基准 4.60%。信诚双盈债券型证券投资基金 (LOF) (2015-4-14 至 2015-6-30) 基金份额净值增长率为 7.90%, 同期业绩比较基准收益率为 1.10%, 基金超越业绩比较基准 6.80%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2015 年下半年，债市表现恐难及 2014 年，但仍可获得良好回报，主要依据有：从基本面看，经济下行趋势不改，短期内难言见底。制造业投资增速持续下滑，国内外需求不振，基建投资短期内不会大幅扩张，今年经济增速大概率会低于去年。此外，受经济疲弱和国际大宗商品下跌的影响，通胀压力也不大。从政策面看，在经济下行的压力下，货币环境仍将维持宽松，而财政政策转向积极，但由于决策周期等因素，短期内难以对经济数据的改善起到直接作用。从债市供需看，2015 年债券发行量可能会对债市形成冲击，但权益市场巨幅波动背景下，债券的配置需求预计也会出现明显的改善。

预计 2015 年下半年信用债走势将会进一步分化。宽松货币环境下信用利差整体收窄，但受湘鄂债、天威 MTN、中富债违约等公募债违约事件影响，高风险信用债低等级与高等级利差处于高位。随着未来信用违约常态化，等级利差仍有进一步走阔的风险，低等级信用债将持续承压，信用债投资将更侧重于个券筛选。总体上看，城投债仍是最看好的债券品种，且老债优于新债。我们将重点关注负债率较低、政治地位较高地区的品种，资金投向则尽量选择与政府信用和民生工程等项目。

转债投资方面，在权益市场大幅调整的背景下，可转债的表现大幅落后同期股指。此外，在打新基金规模飙升的背景下，转债打新收益的吸引力大幅下降，转债一级市场已成鸡肋。在权益走势未形成确定性趋势前，将继续维持转债品种低配策略。

本基金将继续把流动性管理和风险控制放在首位，认真研究各个潜在投资领域的机会，发挥管理人的综合优势，积极稳健地做好配置策略，一如既往地依靠团队的努力和智慧，投资人创造应有的回报。

#### 4.6 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

本基金管理人的估值人员平均拥有 6 年金融从业经验和 3 年本基金管理公司的基金从业和基金估值经验

##### 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。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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。

#### 4.8 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”)在信诚双盈债券型证券投资基金(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 托管人对本半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 半年度财务会计报告(未经审计)(转型前)

#### 6.1 资产负债表

会计主体:信诚双盈分级债券型证券投资基金

报告截止日:2015年4月13日(封闭期届满日)

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2015年4月13日(封闭期 届满日)	上年度末 2014年12月31日
资产:			
银行存款	6.4.7.1	15,698,592.95	34,761.81
结算备付金		2,097,674.54	5,502,982.66

存出保证金		29,846.38	10,166.01
交易性金融资产	6.4.7.2	290,789,593.58	391,024,563.54
其中：股票投资		28,093,966.22	-
基金投资		-	-
债券投资		262,695,627.36	391,024,563.54
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		7,160,280.55	38,893.66
应收利息	6.4.7.5	6,489,875.18	9,619,669.39
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	0	-
资产总计		322,265,863.18	406,231,037.07
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015年4月13日（封闭期 届满日）</b>	<b>上年度末 2014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		29,400,000.00	142,500,000.00
应付证券清算款		15,339,595.20	-
应付赎回款		13,735,017.83	-
应付管理人报酬		68,815.84	151,106.37
应付托管费		19,661.66	43,173.23
应付销售服务费		8,781.30	20,658.95
应付交易费用	6.4.7.7	175.00	242.75

应交税费		19,368.48	19,368.48
应付利息		-	445.08
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	350,122.45	450,000.00
负债合计		58,941,537.76	143,184,994.86
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	158,868,708.73	170,860,957.40
未分配利润	6.4.7.10	104,455,616.69	92,185,084.81
所有者权益合计		263,324,325.42	263,046,042.21
负债和所有者权益总计		322,265,863.18	406,231,037.07

注：截至本报告期末（封闭期届满日），基金份额总额 166,060,887.75 份。下属两级基金：双盈 A 的基金份额净值 1.000 元，基金份额 56,745,445.01 份；双盈 B 的基金份额净值 1.890 元，基金份额 109,315,442.74 份。

## 6.2 利润表

会计主体：信诚双盈分级债券型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 4 月 13 日（封闭期届满日）

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 4 月 13 日（封闭期届满日）	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
一、收入		15,806,449.82	22,317,509.90
1. 利息收入		5,410,254.04	15,015,792.61
其中：存款利息收入	6.4.7.11	32,950	79,586.26
债券利息收入		5,363,793.91	14,865,675.86
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		13,510.13	70,530.49
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”		19,244,431.44	-5,369,004.85

”填列)			
其中：股票投资收益	6.4.7.12	0	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	19,244,431.44	-5,369,004.85
资产支持证券投资 收益	6.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	0	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.17	-8,848,687.59	12,669,593.97
4. 汇兑收益（损失以“- ”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“- ”号填列）	6.4.7.18	451.93	1,128.17
<b>减：二、费用</b>		1,791,341.10	5,673,730.42
1. 管理人报酬		536,280.31	998,416.73
2. 托管费		153,222.95	285,261.97
3. 销售服务费		69,201.01	232,084.47
4. 交易费用	6.4.7.19	1,556.15	4,025.72
5. 利息支出		902,340.59	3,922,178.51
其中：卖出回购金融资产 支出		902,340.59	3,922,178.51
6. 其他费用	6.4.7.20	128,740.09	231,763.02
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		14,015,108.72	16,643,779.48
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以 “-”号填列）</b>		14,015,108.72	16,643,779.48

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：信诚双盈分级债券型证券投资基金

本报告期：2015年1月1日至2015年4月13日（封闭期届满日）

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2015年1月1日至2015年4月13日(封闭期届满日)		
	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)	170,860,957.40	92,185,084.81	263,046,042.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	14,015,108.72	14,015,108.72
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)	-11,992,248.67	-1,744,576.84	-13,736,825.51
其中: 1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-11,992,248.67	-1,744,576.84	-13,736,825.51
四、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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	158,868,708.73	104,455,616.69	263,324,325.42
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30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)	261,117,098.41	50,700,229.21	311,817,327.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	16,643,779.48	16,643,779.48
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)	-69,096,466.08	-6,598,159.93	-75,694,626.01
其中: 1. 基金申购款	585,734.92	55,933.00	641,667.92
2. 基金赎回款	-69,682,201.00	-6,654,092.93	-76,336,293.93
四、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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	192,020,632.33	60,745,848.76	252,766,481.09

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:

吕涛  
基金管理公司负责人

陈逸辛  
主管会计工作负责人

时慧  
会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

信诚双盈分级债券型证券投资基金(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”)《关于核准信诚双盈分级债券型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2012]88号文)和《关于信诚双盈分级债券型证券投资基金备案确认的函》(基金部函[2012]229号文)批准,由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》及其配套规则和《信诚双盈分级债券型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2012年4月13日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为信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。

本基金于2012年3月26日至2012年4月9日期间公开发售。其中双盈B的发售时间为自2012年3月26日至2012年4月6日,双盈A的发售时间为2012年4月9日。

信诚双盈分级债券型证券投资基金首次发售募集扣除认购费后的有效认购资金人民币364,373,474.19元,利息人民币110,822.08元,合计人民币364,484,296.27元。其中双盈A有效认购资金人民币255,080,004.95元,利息人民币88,848.58元,合计人民币255,168,853.53元,双盈B有效认购资金人民币109,293,469.24元,利息人民币21,973.50元,合计人民币109,315,442.74元;

上述认购资金折合364,484,296.27份基金份额。其中:双盈A为255,168,853.53份;双盈B为109,315,442.74份。有效认购户数为7,480户,其中双盈A认购户数7,445户,双盈B认购户数35户。与上述投入的资金相关的资产总额为货币资金人民币364,484,296.27元。

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.0033号验资报告。

根据《信诚双盈分级债券型证券投资基金基金合同》,本基金的封闭期于基金合同生效后三年即2015年4月13日到期。本基金管理人于2015年4月15日发布《信诚双盈分级债券型证券投资基金份额转换结果的公告》,本基金于2015年4月13日进行基金份额权益登记,双盈B于2015年4月13日终止上市。本基金在封闭期届满后,按照基金合同在封闭期内的资产及收益的分配约定分别对双盈A份额和双盈B份额计算封闭期末基金份额净值,并以各自的份额净值为基础,按照本基金的基金份额净值转换为同一上市开放式基金(LOF)的份额。基金份额转换完成后,本基金更名为“信诚双盈债券型证券投资基金(LOF)”。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《信诚双盈分级债券型证券投资基金基金合同》和《信诚双盈分级债券型证券投资基金招募说明书》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、资产支持证券及法律法规或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。

本基金投资于固定收益类证券(包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、资产支持证券、可转换债券(含分离交易可转债)、回购、银行定期存款、中期票据等)的比例不低于基金资产的80%。其中,转换后的“信诚信用添利债券型证券投资基金(LOF)”投资于金融债(不包括政策性金融债)、企业债、公司债、短期融资券、资产支持证券、可转换债券等非国家信用的固定收益类证券的比例不低于固定收益类证券的80%。本基金可以参与一级市场新股申购和增发新股申购,但不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产。本基金投资于权益类资产(包括股票、权证等)的比例不高于基金资产的20%,其中持有的全部权证市值不超过基金资产净值的3%。本基金投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。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。

本基金的业绩比较标准为中信标普全债指数收益率。

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。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金按照财政部颁布的企业会计准则、中国证券业协会于2012年颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《信诚双盈分级债券型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的基金行业实务操作的规定编制会计报表。

#### 6.4.3 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会计报表附注6.4.2所列示的其他有关规定的要求。

#### 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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计除6.4.5所列变更外,与最近一期年度报告相一致。

#### 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

本基金本报告期无需说明的会计政策变更事项。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

为确保证券投资基金估值的合理性和公允性,根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》(以下简称“估值处理标准”),自2015年3月30日起,本公司对旗下证券投资基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)的估值方法进行调整,采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。于2015年3月30日,相关调整对前一估值日基金资产净值的影响不超过0.50%。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本期间无差错事项。

#### 6.4.6 税项

根据财税字[1998]55号文、[2001]61号文《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》、财税字[2005]11号文《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税[2005]107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2007]84号文《财政部国家税务总局关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、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)基金买卖股票、债券的投资收益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)自2005年1月24日起,基金买卖A股、B股股权所书立的股权转让书据按照0.1%的税率征收证券(股票)交易印花税。自2007年5月30日起,该税率上调至0.3%。自2008年4月24日起,根据上海证券交易所与深圳证券交易所的相关规定,调整证券(股票)交易印花税税率,由0.3%降至0.1%。自2008年9月19日起,根据上海证券交易所与深圳证券交易所的相关规定,证券交易印花税改为单边征收,即仅对卖出A股、B股股权按0.1%的税率征收。(5)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。

自2013年1月1日起,根据财税[2012]85号《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》,个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,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,暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

**6.4.7 关联方关系**

**6.4.7.1 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关系的关联方未发生变化。

**6.4.7.2 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
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

**6.4.8 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。

**6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易**

本基金在本报告期内未通过关联方交易单元进行过交易。

**6.4.8.2 关联方报酬**

**6.4.8.2.1 基金管理费**

项目	本期 2015年1月1日至2015年 4月13日(封闭期届满日)	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	536,280.31	998,416.73
其中:支付销售机构的客户维护费	102,819.44	296,525.30

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0.7%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×0.7%/当年天数。

**6.4.8.2.2 基金托管费**

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年 4月13日(封闭期届满日)	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	153,222.95	285,261.97

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0.20%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×0.20%/当年天数。

**6.4.8.2.3 销售服务费**

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年4月13日
中国银行	35,691.06
信诚基金管理有限公司	108.98

获得销售服务费的	上年度可比期间
----------	---------

各关联方名称	2014年1月1日至2014年6月30日
中国银行	99,677.14
信诚基金管理有限公司	2,587.46

注：基金合同生效之日起3年内，本基金A类基金份额的年销售服务费率为0.35%，B类基金份额不收取销售服务费。

A类基金份额销售服务费按前一日A类基金份额资产净值的0.35%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：A类基金日销售服务费=A类基金份额前一日资产净值×0.35%/当年天数。

#### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内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。

#### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

基金管理人运用自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。

#### 信诚双盈分级债券B

份额单位：

份

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年4月13日（封闭期届满日）	2014年1月1日至2014年6月30日
基金合同生效日(2012年4月13日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	30,001,600.00	30,001,600.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	30,001,600.00	30,001,600.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	27.44%	27.44%

##### 6.4.8.4.2 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

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本报告期末及上年度末未持有本基金。

#### 6.4.8.5 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		上年度可比期间	
	2015年1月1日至2015年4月13日（封闭期届满日）		2014年1月1日至2014年6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	15,698,592.95	11,833.59	480,642.70	24,888.17

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的结算备付金，于2015年4月13日的相关余额为人民币2,097,674.54元。（2014年6月30日余额为8,709,773.94）。

#### 6.4.9 期末（报告期间结束日期）本基金持有的流通受限证券

**6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

于本报告期末,本基金未持有因认购新发/增发流通受限证券。

**6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

于本报告期末,本基金未持有暂时停牌等流通受限的股票。

**6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购**

于本报告期末,本基金未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

**6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末 2015 年 4 月 13 日止,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 29,400,000.00 元,于 2014 年 4 月 14 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

**§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型后）****6.1 资产负债表**

会计主体：信诚双盈债券型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日
<b>资 产:</b>		
银行存款	6.4.7.1	38,339,304.77
结算备付金		4,659,623.71
存出保证金		68,543.64
交易性金融资产	6.4.7.2	205,281,122.34
其中：股票投资		18,325,739.24
基金投资		-
债券投资		186,955,383.10
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	5,099,643.96
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	32,470.63
资产总计		253,480,709.05
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015 年 6 月 30 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		76,000,000.00
应付证券清算款		35,883,232.94
应付赎回款		761,966.14
应付管理人报酬		89,358.41
应付托管费		25,531.00
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	23,804.76
应交税费		19,368.48
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	374,016.03
负债合计		113,177,277.76
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	6.4.7.9	78,422,132.51
未分配利润	6.4.7.10	61,881,298.78
所有者权益合计		140,303,431.29
负债和所有者权益总计		253,480,709.05

注：截止本报告期末，基金份额净值为 1.079 元，基金份额总额为 129,984,408.22 份。

## 6.2 利润表

会计主体：信诚双盈债券型证券投资基金（LOF）

本报告期：2015 年 4 月 14 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本 期
		2015 年 4 月 14 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		19,269,044.75

1. 利息收入		2,709,202.92
其中：存款利息收入	6.4.7.11	25,586.70
债券利息收入		2,683,348.72
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		267.5
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		15,418,832.49
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,227,780.92
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	14,132,848.81
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	58,202.76
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,126,023.34
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	14,986.00
<b>减：二、费用</b>		869,749.75
1. 管理人报酬		270,393.67
2. 托管费		77,255.35
3. 销售服务费		0
4. 交易费用	6.4.7.19	54,223.65
5. 利息支出		369,938.37
其中：卖出回购金融资产支出		369,938.37
6. 其他费用	6.4.7.20	97,938.71
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		18,399,295.00

减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>18,399,295.00</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：信诚双盈债券型证券投资基金（LOF）

本报告期：2015年4月14日至2015年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2015年4月14日至2015年6月30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）	158,868,708.73	104,455,616.69	263,324,325.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	18,399,295.00	18,399,295.00
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）	-80,446,576.22	-60973,612.91	-141,420,189.13
其中：1. 基金申购款	3,179,146.45	2,856,891.40	6,036,037.85
2. 基金赎回款	-83,625,722.67	-63,830,504.31	-147,456,226.98
四、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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	78,422,132.51	61,881,298.78	140,303,431.29

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：

_____ 吕涛	_____ 陈逸辛	_____ 时慧
基金管理公司负责人	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

信诚双盈分级债券型证券投资基金(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”)《关于核准信诚双盈分级债券型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2012]88号文)和《关于信诚双盈分级债券型证券投资基金备案确认的函》(基金部函[2012]229号文)批准,由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》及其配套规则和《信诚双盈分级债券型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2012年4月13日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为信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。

本基金于2012年3月26日至2012年4月9日期间公开发售。其中双盈B的发售时间为自2012年3月26日至2012年4月6日,双盈A的发售时间为2012年4月9日。

信诚双盈分级债券型证券投资基金首次发售募集扣除认购费后的有效认购资金人民币 364,373,474.19 元,利息人民币 110,822.08 元,合计人民币 364,484,296.27 元。其中双盈 A 有效认购资金人民币 255,080,004.95 元,利息人民币 88,848.58 元,合计人民币 255,168,853.53 元,双盈 B 有效认购资金人民币 109,293,469.24 元,利息人民币 21,973.50 元,合计人民币 109,315,442.74 元;

上述认购资金折合 364,484,296.27 份基金份额。其中:双盈 A 为 255,168,853.53 份;双盈 B 为 109,315,442.74 份。有效认购户数为 7,480 户,其中双盈 A 认购户数 7,445 户,双盈 B 认购户数 35 户。与上述投入的资金相关的资产总额为货币资金人民币 364,484,296.27 元。

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. 0033 号验资报告。

根据《信诚双盈分级债券型证券投资基金基金合同》,本基金的封闭期于基金合同生效日后三年即 2015 年 4 月 13 日到期。本基金管理人于 2015 年 4 月 15 日发布《信诚双盈分级债券型证券投资基金份额转换结果的公告》,本基金于 2015 年 4 月 13 日进行基金份额权益登记,双盈 B 于 2015 年 4 月 13 日终止上市。本基金在封闭期届满后,按照基金合同在封闭期内的资产及收益的分配约定分别对双盈 A 份额和双盈 B 份额计算封闭期末基金份额净值,并以各自的份额净值为基础,按照本基金的基金份额净值转换为同一上市开放式基金(LOF)的份额。基金份额转换完成后,本基金更名为“信诚双盈债券型证券投资基金(LOF)”。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《信诚双盈分级债券型证券投资基金基金合同》和《信诚双盈分级债券型证券投资基金招募说明书》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、资产支持证券及法律法规或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。

本基金投资于固定收益类证券(包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、资产支持证券、可转换债券(含分离交易可转债)、回购、银行定期存款、中期票据等)的比例不低于基金资产的 80%。其中,转换后的“信诚信用添利债券型证券投资基金(LOF)”投资于金融债(不包括政策性金融债)、企业债、公司债、短期融资券、资产支持证券、可转换债券等非国家信用的固定收益类证券的比例不低于固定收益类证券的 80%。本基金可以参与一级市场新股申购和增发新股申购,但不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产。本基金投资于权益类资产(包括股票、权证等)的比例不高于基金资产的 20%,其中持有的全部权证市值不超过基金资产净值的 3%。本基金投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。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。

本基金的业绩比较标准为中信标普全债指数收益率。

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。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金按照财政部颁布的企业会计准则(2006)、中国证券业协会于 2007 年颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《信诚双盈分级债券型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的基金行业实务操作的规定编制会计报表。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则-基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“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会计报表附注 6.4.2 所列示的其他有关规定的要求。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计(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)

本基金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。

#### 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

本基金本报告期无需说明的会计政策变更事项。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

为确保证券投资基金估值的合理性和公允性,根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》(以下简称“估值处理标准”),自 2015 年 3 月 30 日起,本公司对旗下证券投资基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)的估值方法进行调整,采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。于 2015 年 3 月 30 日,相关调整对前一估值日基金资产净值的影响不超过 0.50%。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本期间无差错事项。

#### 6.4.6 税项

根据财税字[1998]55 号文、[2001]61 号文《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》、财税字[2005]11 号文《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税[2005]107 号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2007]84 号文《财政部国家税务总局关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、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) 基金买卖股票、债券的投资收益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) 自 2005 年 1 月 24 日起,基金买卖 A 股、B 股股权所书立的股权转让书据按照 0.1%的税率征收证券(股票)交易印花税。自 2007 年 5 月 30 日起,该税率上调至 0.3%。自 2008 年 4 月 24 日起,根据上海证券交易所与深圳证券交易所的相关规定,调整证券(股票)交易印花税税率,由 0.3%降至 0.1%。自 2008 年 9 月 19 日起,根据上海证券交易所与深圳证券交易所的相关规定,证券交易印花税改为单边征收,即仅对卖出 A 股、B 股股权按 0.1%的税率征收。(5) 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。

自 2013 年 1 月 1 日起,根据财税[2012]85 号《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》,个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,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,暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

#### 6.4.7 关联方关系

##### 6.4.7.1 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关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.7.2 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
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
--------------------	-------

#### 6.4.8 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。

##### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行过交易。

##### 6.4.8.2 关联方报酬

###### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2015年4月14日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	270,393.67
其中:支付销售机构的客户维护费	49,817.84

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0.7%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×0.7%/当年天数。

###### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年4月14日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	77,255.35

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0.20%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×0.20%/当年天数。

###### 6.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2015年4月14日至2015年6月30日
中国银行	0.00
信诚基金管理有限公司	0.00

注:基金合同生效之日起3年内,本基金A类基金份额的年销售服务费率为0.35%,B类基金份额不收取销售服务费。

A类基金份额销售服务费按前一日A类基金份额资产净值的0.35%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:A类基金日销售服务费=A类基金份额前一日资产净值×0.35%/当年天数。

##### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内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。

##### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

###### 6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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。

份额单位:份

项目	本期 2015年4月13日至2015年6月30日
基金合同生效日(2015年4月14日)持有的基金份额	-

报告期初持有的基金份额	30,001,600.00
报告期内申购/买入总份额	-
报告期内因拆分变动份额	26,693,929.78
减: 报告期内赎回/卖出总份额	56,695,529.78
报告期末持有的基金份额	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00

注: 根据《信诚双盈分级债券型证券投资基金基金合同》和《信诚双盈分级债券型证券投资基金份额转换结果的公告》的规定,基金管理人于 2015 年 4 月 13 日完成了基金的份额转换, 上表所列“报告期内因拆分变动份额”即为此次份额转换新增的份额。

#### 6.4.8.4.2 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

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本报告期末及上年度末未持有本基金。

#### 6.4.8.5 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4月14日至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	38,339,304.77	15,907.53

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的结算备付金,于 2015 年 6 月 30 日的相关余额为人民币 4,659,623.71 元。

#### 6.4.9 期末(2015年6月30日)本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

于本报告期末,本基金未持有因认购新发/增发流通受限证券。

##### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于本报告期末,本基金未持有暂时停牌等流通受限的股票。

##### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

于本报告期末,本基金未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

###### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 6 月 30 日止,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 76,000,000.00 元,分别于 2015 年 7 月 1 日、2015 年 7 月 2 日(先后)到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

## §7 投资组合报告(转型前)

### 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	28,093,966.22	8.72
	其中: 股票	28,093,966.22	8.72
2	固定收益投资	262,695,627.36	81.52

	其中：债券	262,695,627.36	81.52
	资产支持证券	0.00	0.00
3	贵金属投资	0.00	0.00
4	金融衍生品投资	0.00	0.00
5	买入返售金融资产	0.00	0.00
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	0.00	0.00
6	银行存款和结算备付金合计	17,796,267.49	5.52
	其他各项资产	13,680,002.11	4.24
	合计	322,265,863.18	100.00

## 7.2 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	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	18,264,129.60	6.94
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	-	-
J	金融业	9,829,836.62	3.73
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	28,093,966.22	10.67

## 7.3 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	600023	浙能电力	2,208,480	18,264,129.60	6.94
2	601318	中国平安	114,022	9,829,836.62	3.73

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 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	占期初资产净值比例(%)
1	600023	浙能电力	18,264,129.60	6.94
2	601318	中国平安	8,683,915.52	3.30

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。

##### 7.4.2 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

本基金本报告期内未发生卖出股票交易。

##### 7.4.3 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	26,948,045.12
卖出股票收入(成交)总额	-

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。

#### 7.5 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	14,106,000.00	5.36
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	193,190,432.30	73.37
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	55,399,195.06	21.04
	其他	-	-
	合计	262,695,627.36	99.76

#### 7.6 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

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	122619	12 迁安债	178,410	18,026,546.40	6.85

2	113008	电气转债	118,530	16,384,401.90	6.22
3	122937	PR 辽源债	223,800	15,956,940.00	6.06
4	019407	14 国债 07	141,060	14,106,000.00	5.36
5	110023	民生转债	100,000	13,966,000.00	5.30

#### 7.7 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。

#### 7.8 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持有贵金属投资。

#### 7.9 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。

#### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 7.10.1 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。

##### 7.10.2 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。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.11.1 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。

##### 7.11.2 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。

##### 7.11.3 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。

#### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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

7.12.2 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。

##### 7.12.3 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	29,846.38
2	应收证券清算款	7,160,280.55
3	应收股利	-
4	应收利息	6,489,875.18
5	应收申购款	
6	其他应收款	
7	待摊费用	
8	其他	-
9	合计	13,680,002.11

##### 7.12.4 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	110023	民生转债	13,966,000.00	5.30
2	128007	通鼎转债	13,082,441.56	4.97

#### 7.12.5 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。

#### 7.12.6 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。

### § 7 投资组合报告 (转型后)

#### 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	18,325,739.24	7.23
	其中:股票	18,325,739.24	7.23
2	固定收益投资	186,955,383.10	73.76
	其中:债券	186,955,383.10	73.76
	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	42,998,928.48	16.96
7	其他各项资产	5,200,658.23	2.05
8	合计	253,480,709.05	100.00

#### 7.2 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	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	10,721,560.50	7.64

	服务业		
J	金融业	7,604,178.74	5.42
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	18,325,739.24	13.06

### 7.3 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	600037	歌华有线	340,367	10,721,560.50	7.64
2	600016	民生银行	493,521	4,905,598.74	3.50
3	601318	中国平安	30,000	2,458,200.00	1.75
4	601211	国泰君安	7,000	240,380.00	0.17

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 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	占期初资产净值比例（%）
1	600037	歌华有线	9,639,193.44	3.66
2	600016	民生银行	4,898,196.18	1.86
3	601211	国泰君安	137,970.00	0.05
4	601985	中国核电	64,410.00	0.02

注：1、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。

2、本基金本报告期仅发生上述交易。

#### 7.4.2 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	600023	浙能电力	18,761,931.02	7.13
2	601318	中国平安	6,928,455.02	2.63
3	601985	中国核电	265,050.00	0.10

注：1、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。

2、本基金本报告期仅发生上述交易。



## 7.4.3 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	14,739,769.62
卖出股票收入（成交）总额	25,955,436.04

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。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	12,075,196.40	8.61
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	162,916,067.20	116.12
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	11,964,119.50	8.53
	其他	-	-
	合计	186,955,383.10	133.25

## 7.6 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	122619	12 迁安债	178,410	18,140,728.80	12.93
2	122504	12 通天诚	122,850	12,793,599.00	9.12
3	124709	14 安吉债	100,000	10,661,000.00	7.60
4	124747	14 太仓港	100,000	10,577,000.00	7.54
5	124072	12 曲公路	100,000	10,575,000.00	7.54

## 7.7 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。

## 7.8 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持有贵金属投资。

## 7.9 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。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

## 7.10.1 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。

## 7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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

7.12.2 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。

7.12.3 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	68,543.64
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	
4	应收利息	5,099,643.96
5	应收申购款	
6	其他应收款	
7	待摊费用	32,470.63
8	其他	-
9	合计	5,200,658.23

7.12.4 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。

7.12.5 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。

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息 (转型前)

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额 级别	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
信诚 双盈 分级	2,265	25,053.18	3,239.27	0.01%	56,742,205.74	99.99%

债券 A						
信诚双盈分级债券 B	310	352,630.46	93,728,212.00	85.74%	15,587,230.74	14.26%
合计	2,575	64,489.67	93,731,451.27	56.44%	72,329,436.48	43.56%

注:本表列示“占基金总份额比例”中,对下属分级基金,为占各自级别份额的比例;对合计数,为占期末基金份额总额的比例。

## 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	信诚基金管理有限公司	30,001,600.00	27.44%
2	中国平安人寿保险股份有限公司-分红	10,000,000.00	9.15%
3	信泰人寿保险股份有限公司	9,999,900.00	9.15%
4	中国太保集团股份有限公司—本级—集团自有资金—012G—ZY001	6,233,650.00	5.70%
5	太平智信企业年金集合计划—中国工商银行股份有限公司	5,456,791.00	4.99%
6	太平智诚企业年金集合计划—交通银行股份有限公司	4,769,398.00	4.36%
7	中国太平洋人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品	3,896,245.00	3.56%
8	太平智乐企业年金集合计划—中国建设银行股份有限公司	3,460,042.00	3.17%
9	合众人寿保险股份有限公司-分红账户	2,227,050.00	2.04%
10	合众人寿保险股份有限公司-分红账户	2,000,000.00	1.83%

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	信诚双盈分级债券 A	-	-
	信诚双盈分级债券 B	99,413.16	0.09%
	合计	99,413.16	0.05%

注:1、本表列示“占基金总份额比例”中,对下属分级基金,为占各自级别份额的比例;对合计数,为占期末基金份额总额的比例。

2、期末本公司基金从业人员未持有本基金的 A 级份额。

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的情况

- 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 基金份额持有人信息（转型后）

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
1,835	70,836.19	84,737,873.64	65.19%	45,246,534.58	34.81%

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	信泰人寿保险股份有限公司	18,897,313.00	11.38%
2	中国太保集团股份有限公司—本级—集团自有资金—012G—ZY001	11,780,041.37	7.09%
3	太平智信企业年金集合计划—中国工商银行股份有限公司	10,311,972.00	6.21%
4	太平智诚企业年金集合计划—交通银行股份有限公司	9,012,971.00	5.43%
5	中国太平洋人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品	7,362,930.00	4.43%
6	太平智乐企业年金集合计划—中国建设银行股份有限公司	6,538,615.00	3.94%
7	中国太平洋财产保险—传统—普通保险产品—013C—CT001 深	3,532,888.00	2.13%
8	宁波鼎锋海川投资管理中心（有限合伙）—鼎锋另类策略2期证	2,732,772.00	1.65%
9	太平洋资管—农业银行—卓越财富债基增强型产品	2,623,162.00	1.58%
10	中国太保集团股份有限公司	1,834,297.00	1.10%

司—本级—集团自有资金 —012G—ZY001		
----------------------------	--	--

### 8.3 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	187,864.94	0.14%

### 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的情况

- 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份额。
- 2、期末本基金的基金经理未持有本基金份额。

## §9 开放式基金份额变动

### 9.1 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

项目	双盈 A	双盈 B
基金合同生效日(2012年4月13日)基金份额总额	255,168,853.53	109,315,442.74
本报告期初基金份额总额	68,935,471.86	109,315,442.74
本报告期基金总申购份额		
减:本报告期基金总赎回份额	13,736,825.51	
本报告期基金拆分变动份额	1,546,798.66	-
本报告期末基金份额总额	56,745,445.01	109,315,442.74

注：本基金合同于2012年4月13日生效。本基金于2015年4月13日三年封闭期届满，封闭期届满后本基金自动转换为上市开放式基金（LOF），基金名称变更为“信诚双盈债券型证券投资基金（LOF）”，封闭期届满日为本基金份额转换基准日。

### 9.2 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

基金转型后期初(2015年4月14日)基金份额总额	263,324,324.85
本报告期基金总申购份额	5,269,424.01
减:本报告期基金总赎回份额	138,609,340.64
本报告期基金拆分变动份额	
本报告期末基金份额总额	129,984,408.22

注：1. 本基金合同生效日为2012年4月13日

2. 根据《基金合同》的规定，本基金3年封闭期届满，自动转型为上市开放式基金，并于2015年4月14日正式更名为“信诚双盈债券型证券投资基金（LOF）”。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 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

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机构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。

### 10.3 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。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内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。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

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。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型前)

#### 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

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	
东方证券	1	3.20	19.56%	-	-	
国泰君安	1	-	-	-	-	本期新增
中信证券	1	13.16	80.44%	-	-	
安信证券	1	-	-	-	-	本期新增
大通证券	1	-	-	-	-	
国信证券	1	-	-	-	-	本期新增
海通证券	2	-	-	-	-	本期新增
西南证券	2	-	-	-	-	本期新增
招商证券	2	-	-	-	-	本期新增

浙商证券	1	-	-	-	-	
中信建投	2	-	-	-	-	本期新增

### 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

券商名称	债券交易		回购交易	
	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
东方证券	10,614,252.02	4.07%	29,400,000.00	1.64%
国泰君安	15,675,710.37	6.01%	336,900,000.00	18.77%
中信证券	195,513,646.85	74.95%	1,428,800,000.00	79.59%
安信证券	-	-	-	-
大通证券	15,964,199.71	6.12%		
国信证券	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-
浙商证券	23,080,424.51	8.85%	-	-
中信建投	-	-	-	-

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）

#### 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	
东方证券	1	17,010,699.02	65.54%	15,486.45	65.54%	
国泰君安	1	8,944,758.09	34.46%	8,143.31	34.46%	本期新增
中信证券	1	-	-	-	-	
安信证券	1	-	-	-	-	本期新增
大通证券	1	-	-	-	-	
国信证券	1	-	-	-	-	本期新增
海通证券	2	-	-	-	-	本期新增
西南证券	2	-	-	-	-	本期新增
招商证券	2	-	-	-	-	本期新增
浙商证券	1	-	-	-	-	
中信建投	2	-	-	-	-	本期新增

#### 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
------	------	------

	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
东方证券	-	-	72,000,000.00	3.23%
国泰君安	91,731,063.16	65.73%	2,154,900,000.00	96.58%
中信证券	14,356,466.85	10.28%	-	-
安信证券	33,477,793.36	23.99%	4,200,000.00	0.19%
大通证券	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-

信诚基金管理有限公司  
2015年8月26日