

信诚双盈债券型证券投资基金(LOF)2017 年半年度报告

2017 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：2017 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

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2017年8月28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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年1月1日起至6月30日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	2
§ 2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	5
3.3 其他指标	6
§ 4 管理人报告	6
4.1 基金管理人及基金经理情况	6
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	8
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	8
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	9
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
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	10
§ 5 托管人报告	10
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	10
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	10
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	10
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)	11
6.1 资产负债表	11

6.2	利润表	12
6.3	所有者权益（基金净值）变动表	13
6.4	报表附注	14
§ 7	投资组合报告	28
7.1	期末基金资产组合情况	28
7.2	期末按行业分类的股票投资组合	28
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.....	29
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	29
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	29
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.....	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.....	30
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.....	30
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.....	30
7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	30
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	31
7.12	投资组合报告附注	31
§ 8	基金份额持有人信息	32
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	32
8.2	期末上市基金前十名持有人	32
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	32
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.....	32
8.5	发起式基金发起资金持有份额情况	33
§ 9	开放式基金份额变动	33
§ 10	重大事件揭示	33
10.1	基金份额持有人大会决议	33
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.....	33
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	33
10.4	基金投资策略的改变	33
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	33
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.....	33
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	33
10.8	其他重大事件	35
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	36
§ 12	备查文件目录	36
12.1	备查文件名称	36
12.2	备查文件存放地点	36
12.3	备查文件查阅方式	37

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	3,212,679,374.97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)	2015年4月23日

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的基础上,通过主动管理,力争追求超越业绩比较基准的投资收益。
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。
业绩比较基准	中证综合债指数收益率
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	周浩	王永民
	联系电话	021-68649788	010-66594896
	电子邮箱	Hao.zhou@xcfunds.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-666-0066	95566
传真		021-50120888	010-66594942
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区世纪大道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		中国(上海)自由贸易试验区世	北京市西城区复兴门内大街1号

	纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 9 层	
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	

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东长安街 1 号东方广场东二办公楼八层

§ 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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017年1月1日至2017年6月30日)
本期已实现收益	27,685,225.52
本期利润	34,886,946.36
加权平均基金份额本期利润	0.0108
本期加权平均净值利润率	1.44%
本期基金份额净值增长率	1.48%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	480,774,125.11
期末可供分配基金份额利润	0.1496
期末基金资产净值	2,419,319,303.62
期末基金份额净值	0.753
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	15.99%

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。

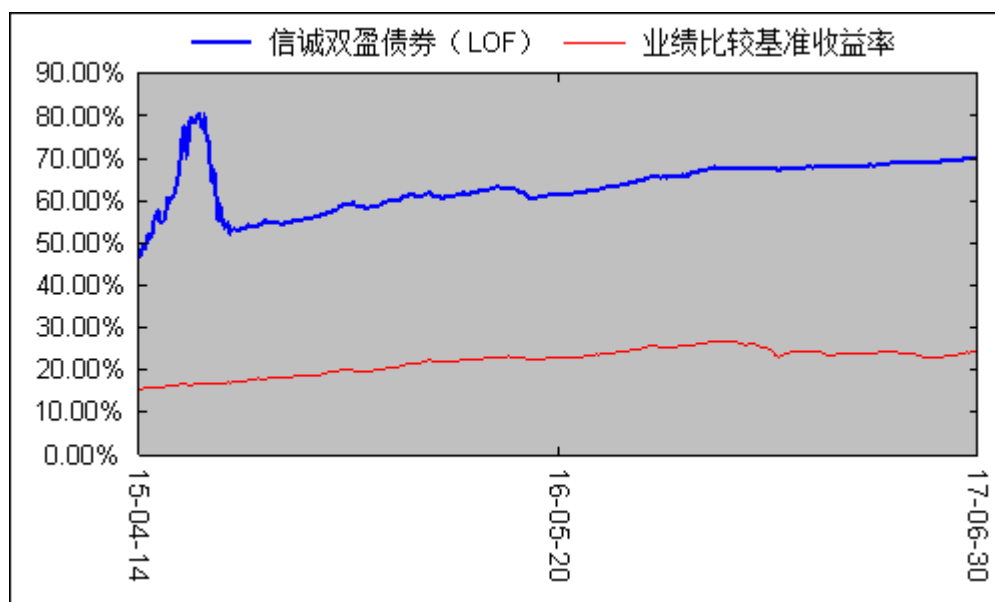
3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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
过去一个月	0.40%	0.05%	1.06%	0.05%	-0.66%	0.00%
过去三个月	0.94%	0.05%	0.26%	0.06%	0.68%	-0.01%
过去六个月	1.48%	0.05%	0.12%	0.06%	1.36%	-0.01%
过去一年	4.55%	0.06%	0.65%	0.08%	3.90%	-0.02%
自基金合同生效起至今 (2015/4/14至 2017/6/30)	15.99%	0.46%	7.82%	0.07%	8.17%	0.39%

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、本基金转型日期为2015年4月13日。

2、本基金建仓期自2012年4月13日至2012年10月13日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

3、自2015年10月1日起,本基金的业绩比较基准由“中信标普全债指数收益率”变更为“中证综合债指数收益率”。

3.3 其他指标

§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2017年6月30日,本基金管理人共管理70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型证券投资基金、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、信诚新鑫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、信诚中证建筑工程指数型证券投资基金(LOF)、信诚惠报债券型证券投资基金、信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金、信诚稳利债券型证券投资基金、信诚惠盈债券型证券投资基金、信诚稳健债券型证券投资基金、信诚至利灵活配置混合型证券投资基金、信诚至益灵活配置混合型证券投资基金、信诚惠泽债券型证券投资基金、信诚稳瑞债券型证券投资基金、信诚稳益债券型证券投资基金、信诚至优灵活配置混合型证券投资基金、信诚至裕灵活配置混合型证券投资基金、信诚至鑫灵活配置混合型证券投资基金、信诚至瑞灵活配置混合型证券投资基金、信诚至选灵活配置混合型证券投资基金、信诚景瑞债券型证券投资基金、信诚新悦回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚主题轮动灵活配置混合型证券投资基金、信诚稳丰债券型证券投资基金、信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金、信诚稳悦债券型证券投资基金、信诚稳泰债券型证券投资基金、信诚永鑫一年定期开放混合型证券投资基金、信诚永利一年定期开放混合型证券投资基金、信诚永丰一年定期开放混合型证券投资基金、信诚稳鑫债券型证券投资基金、信诚至诚灵活配置混合型证券投资基金、信诚理财28日盈债券型证券投资基金、信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金、信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金、信诚新泽回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚至信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		
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、信诚货币市场证券投资基金、信诚新锐回报灵活配置混合基金、信诚惠泽债券基金、信诚至诚灵活配置混	2015年4月9日	-	6	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、信诚货币市场证券投资基金、信诚新锐

	合基金的基金经理			回报灵活配置混合基金、信诚惠泽债券基金、信诚至诚灵活配置混合基金的基金经理。
--	----------	--	--	--

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 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《信诚双盈债券型证券投资基金(LOF)基金合同》、《信诚双盈债券型证券投资基金(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 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

2017 年以来, 我国经济基本面总体维持平稳, 但制造业边际转弱, 乘用车增速回落, 但基础设施建设发力明显, 房地产在年初的超预期增长后由于限贷限购政策加码而面临诸多不确定性, 此外中游行业发电耗煤仍偏高, 高炉开工率有所回升, 出口数据平稳回升, 居民消费基本与去年持平。通货膨胀方面整体压力不大, PPI 高位回落, 基本符合市场预期, 但 CPI 明显低于年初预期。PMI 则出现了明显分化, 中小企业的生存空间进一步收窄。货币政策方面, 偏紧的货币政策继续维持, 市场资金面保持紧平衡状态, 资金拆借利率波动较大, 整体维持在较高水平, 市场对未来流动性预期较为悲观。但自年初以来, 美元汇率持续下跌, 人民币汇率逐渐走稳并稳健升值, 外部流动性压力得以缓解。目前的市场资金面整体偏紧, 央行对市场资金面的微调更为精准, 缴税、监管、公开市场操作等短期因素对市场的短期资金面扰动十分明显。

债市方面, 供需情况不乐观, 2017 年以来的金融监管和去杠杆压力下理财规模停滞不前, 增量资金的匮乏使得信用债市场的增配需求较为薄弱。此外, 由于上半年债券收益率的迅速飙升, 债券取消发行的数量大幅增加, 债券发行量出现负增长, 在信贷和非标资产均被明显压制的背景下, 下半年债券到期量仍然较大, 未来的债券供给可能对脆弱的配置需求形成冲击。总体上看, 金融监管加强协调, 货币政策趋于中性稳健, 出现超预期流动性冲击的风险有所降低。二季度以来利率债收益率在冲高回落维持震荡格局, 长短端债券品种的绝对收益率中枢均有所抬升, 债市对新增的委外资金和配置资金的吸引力也在上升。总体上判断, 预计在宏观监管趋严的背景下, 由于监管政策及多因素交互影响, 未来资金面预期仍不乐观, 虽然机构投资者的配置意愿仍较强, 但债券到期收益率大幅下行的动能不足, 配置性需求较为确定, 但趋

势性行情仍不明朗。

报告期内信诚双盈基金的资产规模保持稳定,基金对债券投资操作整体偏谨慎,进一步减仓利率债仓位,投资组合维持短久期、高等级的基本仓位配置。未来基金投资方向以纯债为主,保持低杠杆低久期操作,择机增加收益率合适的短融、短久期中高等级信用品种,保持适度的组合久期,同时视市场情况减仓长久期品种,适度增持2年之内到期的信用债。信用品种选择方面,积极规避存在业绩风险的个券和产能过剩行业,通过精细化信用分析,谨慎甄选投资标的,严控信用风险并平滑组合净值波动。权益方面,对权益资产投资谨慎参与,积极参与转债网下申购的套利机会,适度加仓确定性强的转债品种,增强组合投资收益。

4.4.2 报告期内基金业绩表现

本报告期内,本基金份额净值增长率为1.48%,同期业绩比较基准收益率为0.12%,基金超越业绩比较基准1.36%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

虽然有多方不利影响,我们对当前债市的判断整体较为乐观,由于到期收益率回升抬升了债券的配置价值,未来债券配置和投资需求将进一步释放。在当前经济基本面、资金面和政策面等多因素影响下,我们认可当前的配置价值,但对债市后续走势保持谨慎。总体看来,经过大幅调整之后的债市风险已得到有效释放,未来债市的好转有待于经济基本面的超预期下行、货币政策的边际放松、CPI低于预期等多因素的综合影响,目前的债市已经具有较高的配置价值。基金的操作总体上保持谨慎,在积极获取票息收益的同时,严格控制杠杆和久期风险,将组合久期控制在适度水平。此外,基于对中小企业信用风险恶化的基本判断,组合严控信用风险,我们认为随着未来去产能的继续推进,企业盈利状况总体上继续好转,但低评级品种的风险仍较高,预期内个券违约仍对市场形成冲击;短期内依然关注流动性的波动和银行负债端监管的变化对信用债估值和成交收益率的影响。

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

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

1、基金合同生效之日起3年内,本基金的收益分配原则如下:

- 1) 基金合同生效之日起3年内,本基金不进行收益分配。
- 2) 法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

2、基金合同生效后3年期届满并转换为上市开放式基金(LOF)后,本基金的收益分配原则如下:

1) 场外转入或申购的基金份额,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;若投资人不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;投资人在不同销售机构的不同交易账户可选择不同的分红方式,如投资人在某一销售机构交易账户不选择收益分配方式,则按默认的收益分配方式处理;场内转入、申购和上市交易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) 每份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可供分配利润的20%。收益分配基准日可供分配利润指收益分配基准日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;

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;

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）

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：2017年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	736,249.19	58,192,110.70
结算备付金		2,045,854.47	182,301.18
存出保证金		53,079.33	756.68
交易性金融资产	6.4.7.2	2,268,714,531.50	2,530,780,997.80
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		2,268,714,531.50	2,530,780,997.80
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	99,305,588.96	300,635,890.95
应收证券清算款		17,010,768.65	-
应收利息	6.4.7.5	33,911,186.11	32,177,893.61
应收股利		-	-
应收申购款		2,134.01	12,934.01
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,421,779,392.22	2,921,982,884.93
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
负 债：			
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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		16,152.34	14,054.79
应付管理人报酬		1,388,538.60	1,804,059.11
应付托管费		396,725.31	515,445.47
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	31,031.85	30,826.79
应交税费		19,368.48	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	608,272.02	530,000.44
负债合计		2,460,088.60	2,913,755.08
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1,938,545,178.51	2,372,729,841.65
未分配利润	6.4.7.10	480,774,125.11	546,339,288.20
所有者权益合计		2,419,319,303.62	2,919,069,129.85
负债和所有者权益总计		2,421,779,392.22	2,921,982,884.93

注：截止本报告期末，基金份额净值为0.753元，基金份额总额为3,212,679,374.97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：2017年1月1日至2017年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
一、收入		46,210,577.11	1,774,022.76
1. 利息收入		43,975,817.98	3,585,146.00
其中：存款利息收入	6.4.7.11	521,343.97	23,105.26
债券利息收入		41,249,448.68	3,561,086.88
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,205,025.33	953.86
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-5,098,340.39	100,144.75
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-5,098,340.39	100,144.75
资产支持证券投资	6.4.7.13.1	-	-
收益			
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	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	7,201,720.84	-1,919,241.24
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	131,378.68	7,973.25
减：二、费用		11,323,630.75	1,096,957.00
1. 管理人报酬		8,419,741.30	372,193.90

2. 托管费		2,405,640.41	106,341.18
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	16,526.40	489.50
5. 利息支出		237,961.09	403,598.99
其中：卖出回购金融资产支出		237,961.09	403,598.99
6. 其他费用	6.4.7.20	243,761.55	214,333.43
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		34,886,946.36	677,065.76
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		34,886,946.36	677,065.76

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：2017年1月1日至2017年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017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）	2,372,729,841.65	546,339,288.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	34,886,946.36	34,886,946.36
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）	-434,184,663.14	-100,452,109.45	-534,636,772.59
其中：1. 基金申购款	1,403,319.64	332,923.96	1,736,243.60
2. 基金赎回款	-435,587,982.78	-100,785,033.41	-536,373,016.19
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）	1,938,545,178.51	480,774,125.11	2,419,319,303.62
项目	上年度可比期间 2016年1月1日至2016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）	69,517,797.85	57,244,384.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利	-	677,065.76	677,065.76

润)			
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)	-18,723,257.03	-15,388,691.82	-34,111,948.85
其中: 1. 基金申购款	3,086,117.68	2,561,353.73	5,647,471.41
2. 基金赎回款	-21,809,374.71	-17,950,045.55	-39,759,420.26
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)	50,794,540.82	42,532,758.45	93,327,299.27

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	刘卓
基金管理人负责人	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:中证综合债指数收益率。

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。

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、会计估计除6.4.5所列变更外,与最近一期年度报告相一致。

6.4.4.1 会计年度

6.4.4.2 记账本位币

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

6.4.4.7 实收基金

6.4.4.8 损益平准金

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

6.4.4.10 费用的确认和计量

6.4.4.11 基金的收益分配政策

6.4.4.12 分部报告

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

本基金本报告期无需说明的会计估计变更事项。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期未发生会计差错。

6.4.6 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[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》、财税[2016]36号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2015]125号文《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、《关于资管产品增值税有关问题的通知》(财税[2017]56号)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:

(a)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。

(b)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。

(c)自2016年5月1日起,在全国范围内全面推开营业税改征增值税(以下称营改增)试点,建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人,纳入试点范围,由缴纳营业税改为缴纳增值税。

证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券收入免征增值税。

对香港市场投资者(包括单位和个人)通过基金互认买卖内地基金份额免征增值税。

2018年1月1日(含)以后,资管产品管理人(以下称管理人)运营资管产品(含公开募集证券投资基金)过程中发生的增值税应税行为(以下称资管产品运营业务),以管理人为增值税纳税人,暂适用简易计

税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。管理人接受投资者委托以及管理人发生的除资管产品运营业务以外的其他增值税应税行为(以下称其他业务),继续按照现行规定缴纳增值税。管理人应分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额,未分别核算的,资管产品运营业务不得适用于简易计税方法。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。因此,截至2017年6月30日,本基金没有计提有关增值税费用。

(d)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。

(e)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。

(f)关于香港市场投资者通过基金互认买卖内地基金份额的所得税问题:

对香港市场投资者(包括企业和个人)通过基金互认买卖内地基金份额取得的转让差价所得,暂免征收所得税。

对香港市场投资者(包括企业和个人)通过基金互认从内地基金分配取得的收益,由内地上市公司向该内地基金分配股息红利时,对香港市场投资者按照10%的税率代扣所得税;或发行债券的企业向该内地基金分配利息时,对香港市场投资者按照7%的税率代扣所得税,并由内地上市公司或发行债券的企业向其主管税务机关办理扣缴申报。该内地基金向投资者分配收益时,不再扣缴所得税。

内地基金管理人应当向相关证券登记结算机构提供内地基金的香港市场投资者的相关信息。

(g)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。

(h)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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
活期存款	736,249.19
定期存款	-
其中:存款期限1-3个月	-
其他存款	-
合计	736,249.19

6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2017年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-

债券	交易所市场	214,241,740.86	213,398,531.50	-843,209.36
	银行间市场	2,047,505,615.58	2,055,316,000.00	7,810,384.42
	合计	2,261,747,356.44	2,268,714,531.50	6,967,175.06
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		2,261,747,356.44	2,268,714,531.50	6,967,175.06

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间市场买入返售金融资产	99,305,588.96	-
合计	99,305,588.96	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金于本报告期末未持有任何买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	7,544.17
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	828.54
应收债券利息	33,826,371.89
应收买入返售证券利息	76,420.00
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	21.51
合计	33,911,186.11

注：其他指应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

本基金于本报告期末未持有其他应收款、待摊费用等其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	-

银行间市场应付交易费用	31,031.85
合计	31,031.85

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.75
预提审计费	29,752.78
预提信息披露费	548,765.71
基金上市费	29,752.78
合计	608,272.02

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	3,932,160,310.58	2,372,729,841.65
本期申购	2,325,439.08	1,403,319.64
本期赎回(以“-”号填列)	-721,806,374.69	-435,587,982.78
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	3,212,679,374.97	1,938,545,178.51

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	768,886,029.08	-222,546,740.88	546,339,288.20
本期利润	27,685,225.52	7,201,720.84	34,886,946.36
本期基金份额交易产生的变动数	-140,953,746.51	40,501,637.06	-100,452,109.45
其中：基金申购款	463,646.72	-130,722.76	332,923.96
基金赎回款	-141,417,393.23	40,632,359.82	-100,785,033.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	655,617,508.09	-174,843,382.98	480,774,125.11

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	201,713.28
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	292,638.89
结算备付金利息收入	26,595.54
其他	396.26
合计	521,343.97

注：1、其他存款利息收入指有存款期限、但根据协议可提前支取且没有利息损失的协议存款利息收入。

2、其他指申购款利息收入，结算保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期无股票投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-5,098,340.39
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-5,098,340.39

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	2,912,972,914.98
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,871,696,869.34
减：应收利息总额	46,374,386.03
买卖债券差价收入	-5,098,340.39

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
申购基金份额对价总额	-
减：现金支付申购款总额	-
减：申购债券成本总额	-
减：申购债券应收利息总额	-

申购差价收入	-
--------	---

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具投资收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

6.4.7.16 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1. 交易性金融资产	7,201,720.84
——股票投资	-
——债券投资	7,201,720.84
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	7,201,720.84

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	131,378.68
合计	131,378.68

注：本基金赎回费和转换费的25%归入基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	1,576.40
银行间市场交易费用	14,950.00
合计	16,526.40

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	148,765.71
银行费用	16,690.28
债券账户维护费	18,000.00
基金上市费	29,752.78
上清所 CFA 数字证书服务费	500.00
其他	300.00
合计	243,761.55

6.4.7.21 分部报告**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.4.8.1 或有事项**

截至本报告期末,本基金未发生需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日,本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系**6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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

6.4.10 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。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**6.4.10.1.1 股票交易**

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。

6.4.10.1.2 权证交易**6.4.10.1.3 债券交易**

6.4.10.1.4 债券回购交易

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	8,419,741.30	372,193.90
其中：支付销售机构的客户维护费	37,961.41	80,216.62

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×0.7%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,405,640.41	106,341.18

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 0.2%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×0.2%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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。本基金的基金管理人在本报告期内及上年度可比期间均未投资过本基金。

6.4.10.4.2 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

1、本基金其它关联方在本报告期末与上年度可比期间均未持有本基金。

2、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。

6.4.10.5 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	
	2017年1月1日至2017年6月30日		2016年1月1日至2016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	736,249.19	201,713.28	725,401.99	12,467.83

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2017年6月30日的相关余额为人民币2,045,854.47元。(2016年6月30日余额为1,666,483.39元)

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间,均未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明**6.4.11 利润分配情况**

本基金本报告期内未进行过利润分配。

6.4.12 期末(2017年6月30日)本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位:人民币元

于本报告期末,本基金未持有因认购新发/增发证券等流通受限证券。

6.4.12.2 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股票等流通受限证券。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.12.3.1 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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于本报告期末,本基金未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理**6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金金融工具的风险主要包括:信用风险、流动性风险、市场风险。

本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险,并设定适当的风险限额及内部控制流程,通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设,在董事会下设立风控与审计委员会,负责制定风险管理的宏观政策,设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策等;在管理层层面设立风险管理委员会,实施董事会风控与审计委员会制定的各项风险管理和内部控制政策;在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责,协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部和风险管理部对公司首席执行官负责,其中监察稽核部还须向督察长报告工作。

本基金管理人建立了以风险管理委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任,或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息,导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款存放在本基金的托管行,因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程,通过对投资品种和证券发行人进行信用等级评估来控制信用风险,本基金均投资于具有良好信用等级的证券,且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%,且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券,不得超过该证券的10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算,因此违约风险发生的可能性很小;本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估,以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度与可能遭受的损失。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现,另一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求,并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求,对流动性指标进行持续的监测和分析。

针对投资品种变现的流动性风险,本基金的基金管理人对流通受限证券的投资交易进行限制和控制,对缺乏流动性的证券投资比率事先确定最高上限,控制基金的流动性结构;加强对投资组合变现周期和冲击成本的定量分析,定期揭示基金的流动性风险;通过分散投资降低基金财产的非系统性风险,保持基金组合良好的流动性。本基金所持证券均可在证券交易所或银行间同业市场交易,均能及时变现。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

针对兑付赎回资金的流动性风险,本基金的基金管理人根据申购赎回变动情况,制定现金头寸预测表,及时采取措施满足流动性需要;分析基金持有人结构,加强与主要持有机构的沟通,及时揭示可能的赎回需求;按照有关法律法规规定应对固定赎回,并进行适当报告和披露;在基金合同中设计了巨额赎回条款,约定在非常情况下赎回申请的处理方式,控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险,有效保障基金持有人利益。

本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或合同约定到期日均为一个月以内且不计息,可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

6.4.13.4 市场风险

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

本基金主要投资于交易所市场及银行间市场交易的固定收益证券,因此存在一定的利率风险。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控,并通过对所持投资品种修正久期等参数的监控进行利率风险管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2017年6月30 日	1个月以内	1-3 个月	3个月 -1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	736,249.19	-	-	-	-	-	736,249.19
结算备付金	2,045,854.47	-	-	-	-	-	2,045,854.47
存出保证金	53,079.33	-	-	-	-	-	53,079.33
交易性金融资产	330,558,000.00	947,482,000.00	868,761,299.60	112,555,231.90	9,358,000.00	-	2,268,714,531.50
买入返售金融资产	99,305,588.96	-	-	-	-	-	99,305,588.96
应收证券清算款	-	-	-	-	-	17,010,768.65	17,010,768.65

应收利息	-	-	-	-	-	33,911,186.11	33,911,186.11
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	2,134.01	2,134.01
待摊费用	-	-	-	-	-	-	-
其他应收款	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	432,698,771.95	947,482,000.00	868,761,299.60	112,555,231.90	9,358,000.00	50,924,088.77	2,421,779,392.22
负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	16,152.34	16,152.34
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,388,538.60	1,388,538.60
应付托管费	-	-	-	-	-	396,725.31	396,725.31
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	31,031.85	31,031.85
应交税费	-	-	-	-	-	19,368.48	19,368.48
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	608,272.02	608,272.02
负债总计	-	-	-	-	-	2,460,088.60	2,460,088.60
利率敏感度缺口	432,698,771.95	947,482,000.00	868,761,299.60	112,555,231.90	9,358,000.00	48,464,000.17	2,419,319,303.62
上年度末 2016年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产	-	-	-	-	-	-	-
银行存款	58,192,110.70	-	-	-	-	-	58,192,110.70
结算备付金	182,301.18	-	-	-	-	-	182,301.18
存出保证金	756.68	-	-	-	-	-	756.68
交易性金融资产	1,386,166,000.00	553,186,494.00	533,665,269.80	48,175,466.00	9,587,768.00	-	2,530,780,997.80
买入返售金融资产	300,635,890.95	-	-	-	-	-	300,635,890.95
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	32,177,893.61	32,177,893.61
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	12,934.01	12,934.01
待摊费用	-	-	-	-	-	-	-
其他应收款	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,745,177,059.51	553,186,494.00	533,665,269.80	48,175,466.00	9,587,768.00	32,190,827.62	2,921,982,884.93
负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	14,054.79	14,054.79

应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,804,059.11	1,804,059.11
应付托管费	-	-	-	-	-	515,445.47	515,445.47
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	30,826.79	30,826.79
应交税费	-	-	-	-	-	19,368.48	19,368.48
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	530,000.44	530,000.44
负债总计	-	-	-	-	-	2,913,755.08	2,913,755.08
利率敏感度缺口	1,745,177,059.51	553,186,494.00	533,665,269.80	48,175,466.00	9,587,768.00	29,277,072.54	2,919,069,129.85

注：上表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期（2017年6月30日）	上年度（2016年12月31日）
	市场利率下降25个基点	1,927,225.15	1,463,887.80
	市场利率上升25个基点	-1,918,151.89	-1,455,057.62

6.4.13.4.2 外汇风险

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金承受的其他市场价格风险，主要是基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金的其他市场价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

本基金本报告期末及上年度末均未持有受其他市场价格影响的交易性金融资产，因此无重大市场价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

	假设
	-

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

假设	1. -		
	2. -		
假设	-		
	-		
分析	风险价值 (单位：人民币)	本期末(2017年6月30日)	上年度末(2016年12月31日)

	元)		
	-	-	-

6.4.14 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。

§7 投资组合报告

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	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	2,268,714,531.50	93.68
	其中：债券	2,268,714,531.50	93.68
	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	99,305,588.96	4.10
	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	2,782,103.66	0.11
7	其他各项资产	50,977,168.10	2.10
8	合计	2,421,779,392.22	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末按行业分类的境内股票投资组合

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、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
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	-	-

本基金本报告期末未持有股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
-	-	-
合计	-	-

本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

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（%）
-	-	-	-	-	-

本基金本报告期末未持有股票。

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	占期初基金资产净值比例（%）
-	-	-	-	-

本基金本报告期末未进行股票买入交易。

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（%）
-	-	-	-	-

本基金本报告期末未进行股票卖出交易。

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	-
卖出股票收入（成交）总额	-

本基金本报告期内未发生股票买卖交易。

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	7,992,000.00	0.33
2	央行票据	-	-

3	金融债券	137,842,173.60	5.70
	其中：政策性金融债	137,842,173.60	5.70
4	企业债券	146,930,367.30	6.07
5	企业短期融资券	1,683,745,000.00	69.60
6	中期票据	-	-
7	可转债	466,990.60	0.02
8	同业存单	291,738,000.00	12.06
9	其他	-	-
10	合计	2,268,714,531.50	93.77

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	011698824	16 联通 SCP005	2,000,000	200,420,000.00	8.28
2	011760025	17 苏国信 SCP003	1,000,000	100,220,000.00	4.14
3	011752003	17 日照港 SCP001	1,000,000	100,190,000.00	4.14
4	111714078	17 江苏银行 CD078	800,000	77,456,000.00	3.20
5	011756004	17 平安租赁 SCP001	700,000	70,252,000.00	2.90

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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
-	-	-	-	-	-

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

金额单位：人民币元

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
-	-	-	-	-	-

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

金额单位：人民币元

序号	权证代码	权证名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
-	-	-	-	-	-

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

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计(元)				-	

股指期货投资本期收益(元)	-
股指期货投资本期公允价值变动(元)	-

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

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险指标说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计(元)				-	-
国债期货投资本期收益(元)				-	-
国债期货投资本期公允价值变动(元)				-	-

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 本基金本报告期末未持有股票投资,没有超过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	53,079.33
2	应收证券清算款	17,010,768.65
3	应收股利	-
4	应收利息	33,911,186.11
5	应收申购款	2,134.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	50,977,168.10

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	132001	14 宝钢 EB	314,797.50	0.01

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净	流通受限情况说
----	------	------	-------------	--------	---------

				值比例 (%)	明
-	-	-	-	-	-

本基金本报告期末未持有股票,不存在流通受限情况。

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

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
1,206	2,663,913.25	3,185,941,402.92	99.17%	26,737,972.05	0.83%

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	君康人寿保险股份有限公司-万能	1,840,489,921.12	57.29%
2	昆仑健康保险股份有限公司-万能保险产品	552,145,486.42	17.19%
3	君康人寿保险股份有限公司-自有	438,211,218.23	13.64%
4	长城人寿保险股份有限公司银保万能	262,926,380.37	8.18%
5	长城人寿保险股份有限公司自有	87,641,542.51	2.73%
6	中国太保集团股份有限公司一本级一集团自有资金-012G-ZY001	1,834,297.00	0.06%
7	张中香	1,479,963.63	0.05%
8	江苏省电力公司(国网)企业年金计划-招商银行股份有限公司	1,031,029.00	0.03%
9	刘芳	621,584.63	0.02%
10	太平智富企业年金集合计划-上海浦东发展银行股份有限公司	600,941.00	0.02%

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	205,288.88	0.01%

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

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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	-
本基金基金经理持有本开放式基金	-

1、期末本基金管理人的高级管理人员、基金投资和研发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。

8.5 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	-	-	-	-	-
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2012年4月13日)基金份额总额	263,324,324.85
本报告期期初基金份额总额	3,932,160,310.58
本报告期基金总申购份额	2,325,439.08
减:本报告期基金总赎回份额	721,806,374.69
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	3,212,679,374.97

§ 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无重大人事变动。

2、报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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、托管人及其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

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	
安信证券	1	-	-	-	-	-
大通证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
齐鲁证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

注：本基金根据券商的研究实力和服务水平选择选择券商以及分配交易量。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。

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		权证交易		
	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	成交金额	占当期权证成交总额的比例	
安信证券	-	-	-	-	-	-	
大通证券	-	-	-	-	-	-	
东方证券	-	-	-	-	-	-	
国泰君安	-	-	-	-	-	-	
国信证券	-	-	-	-	-	-	
海通证券	-	-	-	-	-	-	
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-	
西南证券	-	-	-	-	-	-	
招商证券	58,048,773.49	28.72%	60,000,000.00	1.69%	-	-	
浙商证券	33,072,500.13	16.36%	-	-	-	-	
中信建投	-	-	-	-	-	-	
中信证券	110,974,318.33	54.91%	3,496,300,000.00	98.31%	-	-	

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	信诚基金管理有限公司旗下证券投资基金 2016 年 12 月 31 日基金资产净值和基金份额净值公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.xcfunds.com)	2017-01-03
2	信诚双盈债券型证券投资基金 (LOF) 2016 年第四季度报告	同上	2017-01-20
3	信诚基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	同上	2017-02-23
4	信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加南京苏宁基金销售有限公司为销售机构并参加申购费率优惠活动的公告	同上	2017-03-28
5	信诚双盈债券型证券投资基金 (LOF) 2016 年年度报告	同上	2017-03-31
6	信诚双盈债券型证券投资基金 (LOF) 2016 年年度报告摘要	同上	2017-03-31
7	信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金参与广发证券股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告	同上	2017-04-07
8	关于旗下部分基金增加上海朝阳永续基金销售有限公司为销售机构并参加基金申购费率优惠活动的公告	同上	2017-04-17
9	信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加深圳金斧子投资咨询有限公司为销售机构并参加基金申购费率优惠活动的公告	同上	2017-04-20
10	信诚双盈债券型证券投资基金 (LOF) 2017 年第一季度报告	同上	2017-04-21
11	信诚基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	同上	2017-04-22
12	信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加武汉市伯嘉基金销售有限公司为销售机构并参加基金申购费率优惠活动的公告	同上	2017-04-27
13	信诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海大智慧财富管理有限公司为销售机构并参加基金申购费率优惠活动的公告	同上	2017-05-18
14	信诚双盈债券型证券投资基金 (LOF) 招募说明书 (2017 年第 1 次更新)	同上	2017-05-27
15	信诚双盈债券型证券投资基金 (LOF) 招募说明书摘要 (2017 年第 1 次更新)	同上	2017-05-27
16	信诚基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	同上	2017-06-30

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170101 至 20170630	1,840,489,921.12			1,840,489,921.12	57.29%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>本基金如果出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%，则面临大额赎回的情况，可能导致：</p> <p>(1) 基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20% 的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；</p> <p>(2) 基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；</p> <p>(3) 因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；</p> <p>(4) 基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；</p> <p>(5) 大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件名称

- 1、(原)信诚双盈分级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、信诚双盈分级债券型证券投资基金基金合同
- 4、信诚双盈分级债券型证券投资基金招募说明书
- 5、信诚双盈债券型证券投资基金(LOF)基金合同
- 6、信诚双盈债券型证券投资基金(LOF)招募说明书
- 7、本报告期内按照规定披露的各项公告

12.2 备查文件存放地点

信诚基金管理有限公司办公地—中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼

9层。

12.3 备查文件查阅方式

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
2017年8月29日