

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年第二季度报告

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

报告送出日期：2015年7月20日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2015 年 7 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

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 4 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 基金产品概况

### 2.1 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
报告期末基金份额总额	129,984,408.22 份
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。
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

### 2.2 原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	
报告期末基金份额总额	263, 324, 324. 85 份	
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。	
基金管理人	信诚基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	信诚双盈分级债券 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
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。

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。

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

#### 信诚双盈债券型证券投资基金(LOF)

单位: 人民币元

主要财务指标	转型后	
	报告期 (2015 年 4 月 14 日-2015 年 6 月 30 日)	
1. 本期已实现收益	17, 273, 271. 66	
2. 本期利润	18, 399, 295. 00	
3. 加权平均基金份额本期利润	0. 1105	
4. 期末基金资产净值	140, 303, 431. 29	

5. 期末基金份额净值	1.079
-------------	-------

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。

### 3.1 主要财务指标

#### 原信诚双盈分级债券型证券投资基金

单位:人民币元

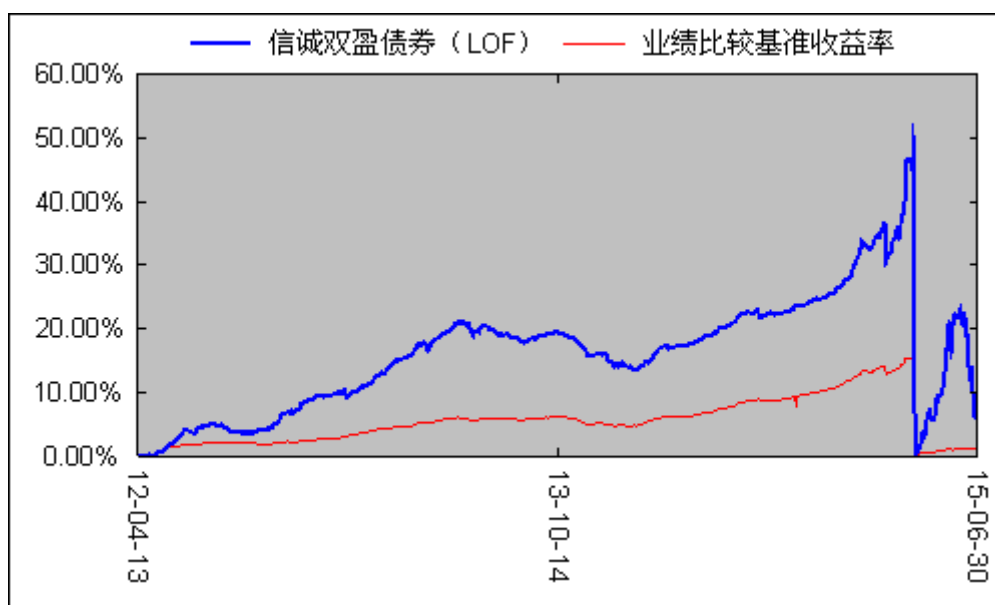
主要财务指标	转型前
	报告期(2015年4月1日-2015年4月13日)
1. 本期已实现收益	2,000,164.37
2. 本期利润	2,827,415.93
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0158
4. 期末基金资产净值	263,324,325.42
5. 期末基金份额净值	1.000

### 3.2 基金净值表现 (信诚双盈债券型证券投资基金(LOF))

#### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
2015年4月14 日-2015年6月 30日	7.90%	1.43%	1.10%	0.05%	6.80%	1.38%

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



注: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

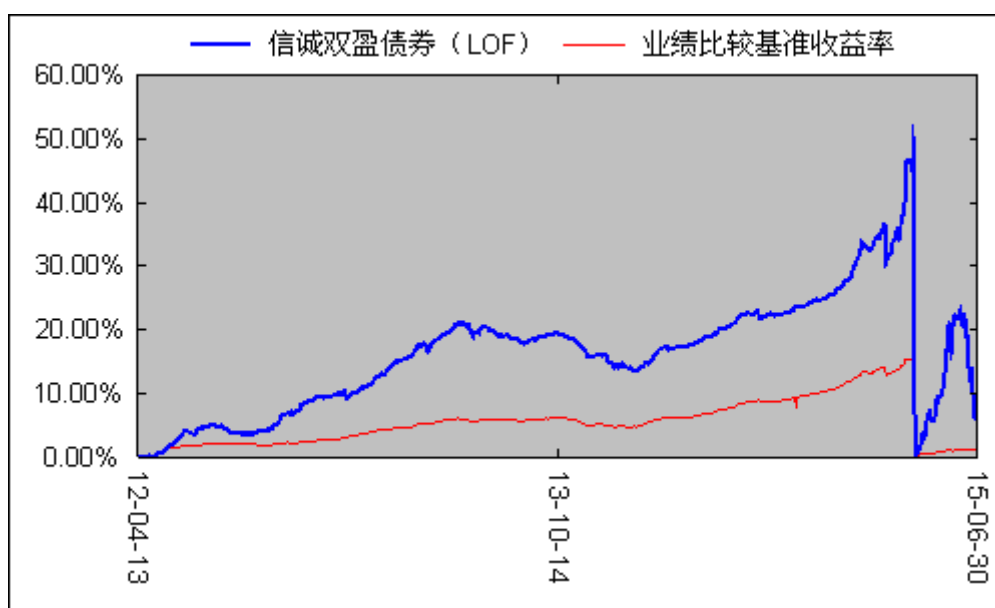
各项投资比例已达到基金合同投资限制中规定的各项比例。

### 3.2 基金净值表现（原信诚双盈分级债券型证券投资基金）

#### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
2015年4月1日 -2015年4月13 日	1.03%	0.41%	0.05%	0.03%	0.98%	0.38%

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



注：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。截至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。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券 从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
曾丽琼	本基金基金经理，信诚货币市场基金、信诚新双盈	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

	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。				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. 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 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,以及公司拟定的《信诚基金公平交易管理制度》,公司采取了一系列的行动实际落实公平交易管理的各项要求。各部门在公平交易执行中各司其职,投资研究前端不断完善研究方法和投资决策流程,确保各投资组合享有公平的投资决策机会,建立公平交易的制度环境;交易环节加强交易执行的内部控制,利用恒生交易系统公平交易相关程序,及其它的流程控制,确保不同基金在一、二级市场对同一证券交易时的公平;公司同时不断完善和改进公平交易分析系统,在事后加以了严格的行为监控,分析评估以及报告与信息披露。当期公司整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情况。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金与其它投资组合之间有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。报告期内,未出现参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的交易(完全复制的指数基金除外)。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2015年二季度,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。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 年二季度以来,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,对可转债和股票投资更趋谨慎,加强波段操作。

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,信用债投资将更偏重于个券筛选。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。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内,原信诚双盈分级债券型证券投资基金(2015.4.1-2015.4.13)基金份额净值增长率为 1.03%,同期业绩比较基准收益率为 0.05%。信诚双盈债券型证券投资基金(LOF)(2015.4.14-2015.6.30)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%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

## § 5 投资组合报告

### 信诚双盈债券型证券投资基金(LOF)

报告期(2015 年 4 月 14 日-2015 年 6 月 30 日)

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	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	其他资产	5,200,658.23	2.05
8	合计	253,480,709.05	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	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	10,721,560.50	7.64
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

## 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	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

注：本基金本报告期末仅持有上述4只股票。

## 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	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
8	其他	-	-
9	合计	186,955,383.10	133.26

#### 5.5 报告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(元)	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

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 5.7 报告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

本基金本报告期内未进行贵金属投资。

#### 5.8 报告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。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 5.9.1 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。

##### 5.9.2 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。

#### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 5.10.1 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。

##### 5.10.2 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。

##### 5.10.3 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。

#### 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金本期投资的前十名证券的发行主体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。

5.11.2 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。

##### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
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

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 5.11.6 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。

## § 5 投资组合报告

### 原信诚双盈分级债券型证券投资基金

报告期(2015年4月1日-2015年4月13日)

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	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	-	-
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	17,796,267.49	5.52
7	其他资产	13,680,002.11	4.24
8	合计	322,265,863.18	1.00

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	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

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	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

注：本基金本报告期末仅持有上述2只股票。

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	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
8	其他	-	-
9	合计	262,695,627.36	99.76

### 5.5 报告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(元)	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

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 5.7 报告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

本基金本报告期内未进行贵金属投资。

#### 5.8 报告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。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 5.9.1 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。

##### 5.9.2 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。

#### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 5.10.1 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。

##### 5.10.2 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。

##### 5.10.3 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。

#### 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金本期投资的前十名证券的发行主体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。

5.11.2 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。

##### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
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

##### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	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

##### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

##### 5.11.6 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。

## § 6 开放式基金份额变动

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
基金转型后期初至本报告期末基金总申购份额	5,269,424.01
减:基金转型后期初至本报告期末基金总赎回份额	138,609,340.64
基金转型后期初至本报告期末基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	
报告期期末基金份额总额	129,984,408.22

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 信诚双盈债券型证券投资基金(LOF)

#### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	-
报告期期间买入/申购总份额	56,695,529.78
报告期期间卖出/赎回总份额	56,695,529.78
报告期期末管理人持有的本基金份额	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	-

#### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	-	2015-04-14	30,001,600.00	-	-
2	-	2015-04-14	18,897,313.08	-	-
3	-	2015-04-14	37,798,216.70	-	-
4	赎回	2015-04-24	56,695,529.78	58,736,568.85	-
合计			143,392,659.56	58,736,568.85	

### 原信诚双盈分级债券型证券投资基金

#### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金本报告期基金管理人未持有本基金。

#### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

无

## §9 备查文件目录

### 9.2 备查文件目录

- 1、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、本报告期内按照规定披露的各项公告

### 9.3 存放地点

信诚基金管理有限公司办公地—上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 9 层。

### 9.4 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](http://www.xcfunds.com)。

信诚基金管理有限公司  
2015 年 7 月 20 日