

信诚双盈分级债券型证券投资基金

[2014] 第一季度报告

基金管理人:信诚基金管理有限公司

基金托管人:中国银行股份有限公司

报告送出日期:2014年4月19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2014年4月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告内容，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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至3月31日止。

§2基金产品概况

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:契约型开放式基金,每6个月开放申购和赎回一次,在第六个开放日开放赎回,不开放申购;双A份额封闭运作,双B份额开放申购和赎回,在开放日的交易时间通过基金管理人网站、基金管理人客户服务电话、基金管理人营业场所等向投资者开放;基金管理人可根据实际情况调整开放时间。

基金合同生效日:2012年4月13日

报告期末基金的份额总额:271,683,300.09份

投资目标:在严控风险的基础上,通过主动管理,力争超越业绩比较基准的收益率。

投资策略:本基金的投资组合由债券、股票、现金组成的长期配置比例,依据本基金的资产配置策略,通过定期调整资产配置结构,降低组合久期,大类资产配置方面,仍将坚持以纯债为主,增强未来收益的稳定性。具体品种上,仍强调“自下而上”个券选择必要性,继续低配产业债,同时强调规避债务风险,选择信用自现金流高、违约率低、资产盈利能力高于贷款利率的行业。

4.5报告期末基金的业绩表现

本基金报告期基金份额净值增长率为2.35%,同期业绩比较基准收益率为1.42%,基金表现超越基准0.03个百分点。

§3基金产品概况

§4基金管理人

§5报告期末基金资产组合情况

§6报告期末按行业分类的股票投资组合

§7报告期末按债券品种的债券投资组合

§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十名债券投资明细

§9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

§10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债券投资明细

§11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贵金属投资明细

§12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买入返售金融资产明细

§13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应收票据明细

§14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应收账款明细

§15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其他应收款明细

§16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投资收益明细

§17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公允价值变动收益明细

§18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持有待售资产明细

§19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一年内到期的可转换债券明细

§20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短期投资明细

§21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衍生金融工具明细

§22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买入返售金融资产明细

§23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应收款项类投资明细

§24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其他投资明细

§25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明细

§26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贵金属投资明细

§27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买入返售金融资产明细

§28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应收票据明细

§29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应收账款明细

§30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其他应收款明细

§31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投资收益明细

§32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公允价值变动收益明细

§33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持有待售资产明细

§34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一年内到期的可转换债券明细

§35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短期投资明细

§36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衍生金融工具明细

§37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买入返售金融资产明细

§38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应收款项类投资明细

§39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其他投资明细

§40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明细

§41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贵金属投资明细

§42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买入返售金融资产明细

§43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应收票据明细

§44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应收账款明细

§45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其他应收款明细

§46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投资收益明细

§47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公允价值变动收益明细

§48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持有待售资产明细

§49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一年内到期的可转换债券明细

§50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短期投资明细

§51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衍生金融工具明细

§52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买入返售金融资产明细

§53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应收款项类投资明细

§54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其他投资明细

§55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明细

§56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贵金属投资明细

§57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买入返售金融资产明细

§58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应收票据明细

§59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应收账款明细

§60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其他应收款明细

§61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投资收益明细

§62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公允价值变动收益明细

§63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持有待售资产明细

§64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一年内到期的可转换债券明细

§65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短期投资明细

§66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衍生金融工具明细

§67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买入返售金融资产明细

§68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应收款项类投资明细

§69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其他投资明细

§70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明细

§71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贵金属投资明细

§72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买入返售金融资产明细

§73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应收票据明细

§74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应收账款明细

§75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其他应收款明细

§76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投资收益明细

§77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公允价值变动收益明细

§78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持有待售资产明细

§79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一年内到期的可转换债券明细

§80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短期投资明细

§81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衍生金融工具明细

§82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买入返售金融资产明细

§83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应收款项类投资明细

§84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其他投资明细

§85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明细

§86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贵金属投资明细

§87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买入返售金融资产明细

§88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应收票据明细

§89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应收账款明细

§90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其他应收款明细

§91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投资收益明细

§92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公允价值变动收益明细

§93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持有待售资产明细

§94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一年内到期的可转换债券明细

§95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短期投资明细

§96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衍生金融工具明细

§97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买入返售金融资产明细

§98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应收款项类投资明细

§99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其他投资明细

§100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明细

§101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贵金属投资明细

§102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买入返售金融资产明细

§103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应收票据明细

§104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应收账款明细

§105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其他应收款明细

§106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投资收益明细

§107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公允价值变动收益明细

§108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持有待售资产明细

§109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一年内到期的可转换债券明细

§110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短期投资明细

§111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衍生金融工具明细

§112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买入返售金融资产明细

§113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应收款项类投资明细

§114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其他投资明细

§115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明细

§116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贵金属投资明细

§117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买入返售金融资产明细

§118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应收票据明细

§119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应收账款明细

§120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其他应收款明细

§121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投资收益明细

§122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公允价值变动收益明细

§123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持有待售资产明细

§124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一年内到期的可转换债券明细

§125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短期投资明细

§126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衍生金融工具明细

§127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买入返售金融资产明细

§128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应收款项类投资明细

§129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其他投资明细