

信息披露

信诚新双盈分级债券型证券投资基金

【2015】半年度报告摘要

本基金于本期间未进行过利润分配, 该处暂符合基金利润分配原则。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵守情况声明

本报告期, 中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中, 严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议及其他有关规定, 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基金托管人应尽的义务。

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, 本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定, 对本基金的基本资产净值计算、基金份额净值计算等方面进行了认真的复核, 对本基金的投资运作方面进行了监督, 未发现基金管理人有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涉及财务信息内容的核实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务信息、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。

5.6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体: 信诚新双盈分级债券型证券投资基金

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 | 上年度末 2014年12月31日 |
|------------|-----|-------------------|---------------------|
| 货币资产 | | 8,874,036.17 | 1,546,413.19 |
| 结算备付金 | | 8,723,687.21 | 10,444,058.46 |
| 存出保证金 | | 146,106.01 | 28,294.06 |
| 交易性金融资产 | | 249,464,194.1 | 1,436,414,969.01 |
| 其中: 股票投资 | | 8,471,290.56 | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 241,392,893.55 | 1,436,414,969.01 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 买入返售金融资产 | | - | - |
| 应收证券清算款 | | - | 11,249,239.12 |
| 应收利息 | | 4,753,765.59 | 31,827,241.39 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | | - | - |
| 资产总计 | | 272,351,004.54 | 1,498,519,370.03 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2015年6月30日 | 上年度末 2014年12月31日 |
| 负债: | | - | - |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | 131,300,000.00 | 633,100,000.00 |
| 应付证券清算款 | | 8,726,222.16 | 499,369.02 |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 82,014.67 | 501,606.71 |
| 应付托管费 | | 23,432.76 | 143,215.91 |
| 应付销售服务费 | | 29,547.24 | 154,969.01 |
| 应付交易费用 | | 78,102.03 | 1,191.26 |
| 应交税费 | | 201,761.84 | 201,761.84 |
| 应付利息 | | - | 127,788.02 |
| 应付股利 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | | 388,437.29 | 460,000.00 |
| 负债合计 | | 140,566,338.89 | 635,288,686.46 |
| 所有者权益: | | - | - |
| 实收基金 | | 108,300,000.00 | 743,506,758.31 |
| 未分配利润 | | 22,261,074.71 | 1,121,762.26 |
| 所有者权益合计 | | 131,400,665.65 | 863,238,710.57 |
| 负债和所有者权益总计 | | 272,351,004.54 | 1,498,519,370.03 |

注: 截至本报告期末, 基金份额总额127,844,062.95份。下属两级基金: 新双盈A的基金份额净值1.007元, 基金份额总额889,461,487.14份; 新双盈B的基金份额净值1.076元, 基金份额总额382,382,575.81份。

6.2 利润表

会计主体: 信诚新双盈分级债券型证券投资基金

报告期间: 2015年1月1日至2015年6月30日

单位: 人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期 2015年1月1日至2015年6月30日 | 上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日 |
|-----------------------|-----|----------------------------|---------------------------------|
| 一、收入 | | 67,962,759.64 | 76,366,166.47 |
| 1. 利息收入 | | 22,904,181.03 | 52,979,552.77 |
| 其中: 存款利息收入 | | 171,795.64 | 2,478,942.92 |
| 债券利息收入 | | 22,733,086.42 | 48,776,746.16 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 10,096.67 | 1,723,843.08 |
| 其他利息收入 | | 63,569,042.17 | -40,496,671.27 |
| 2. 投资收益(损失以“-”填列) | | 63,569,042.17 | -40,496,671.27 |
| 其中: 股票投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | | 5,254,526.64 | - |
| 资产支持证券投资损益 | | 58,197,942.40 | -40,496,671.27 |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | | - | - |
| 公允价值变动收益(损失以“-”填列) | | - | - |
| 3. 公允价值变动收益(损失以“-”填列) | | -18,911,294.35 | 64,373,249.94 |
| 4. 汇兑收益(损失以“-”号填列) | | - | - |
| 5. 其他收入(损失以“-”号填列) | | - | - |
| 二、费用 | | 8,915,304.06 | 13,539,172.12 |
| 1. 管理人报酬 | | 1,747,146.36 | 4,377,287.29 |
| 2. 托管费 | | 469,184.00 | 1,250,633.43 |
| 3. 销售服务费 | | 363,479.06 | 806,300.26 |
| 4. 交易费用 | | 209,079.10 | 8,508.60 |
| 5. 利息支出 | | 6,798,543.78 | 6,896,450.44 |
| 其中: 买入返售金融资产支出 | | 6,798,543.78 | 6,896,450.44 |
| 6. 其他费用 | | 297,815.27 | 200,462.62 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | | 58,747,455.59 | 63,286,994.32 |
| 减: 所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | | 58,747,455.59 | 63,286,994.32 |

注: 截至本报告期末, 基金份额总额127,844,062.95份。下属两级基金: 新双盈A的基金份额净值1.007元, 基金份额总额889,461,487.14份; 新双盈B的基金份额净值1.076元, 基金份额总额382,382,575.81份。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 信诚新双盈分级债券型证券投资基金

报告期间: 2015年1月1日至2015年6月30日

单位: 人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期 2015年1月1日至2015年6月30日 | 上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日 |
|---------------------|-----|----------------------------|---------------------------------|
| 一、收入 | | 67,962,759.64 | 76,366,166.47 |
| 1. 利息收入 | | 22,904,181.03 | 52,979,552.77 |
| 其中: 存款利息收入 | | 171,795.64 | 2,478,942.92 |
| 债券利息收入 | | 22,733,086.42 | 48,776,746.16 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 10,096.67 | 1,723,843.08 |
| 其他利息收入 | | 63,569,042.17 | -40,496,671.27 |
| 2. 投资收益(损失以“-”填列) | | 63,569,042.17 | -40,496,671.27 |
| 其中: 股票投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | | 5,254,526.64 | - |
| 资产支持证券投资损益 | | 58,197,942.40 | -40,496,671.27 |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | | - | - |
| 公允价值变动收益(损失以“-”填列) | | -18,911,294.35 | 64,373,249.94 |
| 4. 汇兑收益(损失以“-”号填列) | | - | - |
| 5. 其他收入(损失以“-”号填列) | | - | - |
| 二、费用 | | 8,915,304.06 | 13,539,172.12 |
| 1. 管理人报酬 | | 1,747,146.36 | 4,377,287.29 |
| 2. 托管费 | | 469,184.00 | 1,250,633.43 |
| 3. 销售服务费 | | 363,479.06 | 806,300.26 |
| 4. 交易费用 | | 209,079.10 | 8,508.60 |
| 5. 利息支出 | | 6,798,543.78 | 6,896,450.44 |
| 其中: 买入返售金融资产支出 | | 6,798,543.78 | 6,896,450.44 |
| 6. 其他费用 | | 297,815.27 | 200,462.62 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | | 58,747,455.59 | 63,286,994.32 |
| 减: 所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | | 58,747,455.59 | 63,286,994.32 |

注: 截至本报告期末, 基金份额总额127,844,062.95份。下属两级基金: 新双盈A的基金份额净值1.007元, 基金份额总额889,461,487.14份; 新双盈B的基金份额净值1.076元, 基金份额总额382,382,575.81份。

6.4 现金流量表

会计主体: 信诚新双盈分级债券型证券投资基金

报告期间: 2015年1月1日至2015年6月30日

单位: 人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期 2015年1月1日至2015年6月30日 | 上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日 |
|---------------------|-----|----------------------------|---------------------------------|
| 一、收入 | | 67,962,759.64 | 76,366,166.47 |
| 1. 利息收入 | | 22,904,181.03 | 52,979,552.77 |
| 其中: 存款利息收入 | | 171,795.64 | 2,478,942.92 |
| 债券利息收入 | | 22,733,086.42 | 48,776,746.16 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 10,096.67 | 1,723,843.08 |
| 其他利息收入 | | 63,569,042.17 | -40,496,671.27 |
| 2. 投资收益(损失以“-”填列) | | 63,569,042.17 | -40,496,671.27 |
| 其中: 股票投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | | 5,254,526.64 | - |
| 资产支持证券投资损益 | | 58,197,942.40 | -40,496,671.27 |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | | - | - |
| 公允价值变动收益(损失以“-”填列) | | -18,911,294.35 | 64,373,249.94 |
| 4. 汇兑收益(损失以“-”号填列) | | - | - |
| 5. 其他收入(损失以“-”号填列) | | - | - |
| 二、费用 | | 8,915,304.06 | 13,539,172.12 |
| 1. 管理人报酬 | | 1,747,146.36 | 4,377,287.29 |
| 2. 托管费 | | 469,184.00 | 1,250,633.43 |
| 3. 销售服务费 | | 363,479.06 | 806,300.26 |
| 4. 交易费用 | | 209,079.10 | 8,508.60 |
| 5. 利息支出 | | 6,798,543.78 | 6,896,450.44 |
| 其中: 买入返售金融资产支出 | | 6,798,543.78 | 6,896,450.44 |
| 6. 其他费用 | | 297,815.27 | 200,462.62 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | | 58,747,455.59 | 63,286,994.32 |
| 减: 所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | | 58,747,455.59 | 63,286,994.32 |

注: 截至本报告期末, 基金份额总额127,844,062.95份。下属两级基金: 新双盈A的基金份额净值1.007元, 基金份额总额889,461,487.14份; 新双盈B的基金份额净值1.076元, 基金份额总额382,382,575.81份。

6.5 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 信诚新双盈分级债券型证券投资基金

报告期间: 2015年1月1日至2015年6月30日

单位: 人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期 2015年1月1日至2015年6月30日 | 上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日 |
|---------------------|-----|----------------------------|---------------------------------|
| 一、收入 | | 67,962,759.64 | 76,366,166.47 |
| 1. 利息收入 | | 22,904,181.03 | 52,979,552.77 |
| 其中: 存款利息收入 | | 171,795.64 | 2,478,942.92 |
| 债券利息收入 | | 22,733,086.42 | 48,776,746.16 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 10,096.67 | 1,723,843.08 |
| 其他利息收入 | | 63,569,042.17 | -40,496,671.27 |
| 2. 投资收益(损失以“-”填列) | | 63,569,042.17 | -40,496,671.27 |
| 其中: 股票投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | | 5,254,526.64 | - |
| 资产支持证券投资损益 | | 58,197,942.40 | -40,496,671.27 |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | | - | - |
| 公允价值变动收益(损失以“-”填列) | | -18,911,294.35 | 64,373,249.94 |
| 4. 汇兑收益(损失以“-”号填列) | | - | - |
| 5. 其他收入(损失以“-”号填列) | | - | - |
| 二、费用 | | 8,915,304.06 | 13,539,172.12 |
| 1. 管理人报酬 | | 1,747,146.36 | 4,377,287.29 |
| 2. 托管费 | | 469,184.00 | 1,250,633.43 |
| 3. 销售服务费 | | 363,479.06 | 806,300.26 |
| 4. 交易费用 | | 209,079.10 | 8,508.60 |
| 5. 利息支出 | | 6,798,543.78 | 6,896,450.44 |
| 其中: 买入返售金融资产支出 | | 6,798,543.78 | 6,896,450.44 |
| 6. 其他费用 | | 297,815.27 | 200,462.62 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | | 58,747,455.59 | 63,286,994.32 |
| 减: 所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | | 58,747,455.59 | 63,286,994.32 |

注: 截至本报告期末, 基金份额总额127,844,062.95份。下属两级基金: 新双盈A的基金份额净值1.007元, 基金份额总额889,461,487.14份; 新双盈B的基金份额净值1.076元, 基金份额总额382,382,575.81份。

6.6 现金流量表

会计主体: 信诚新双盈分级债券型证券投资基金

报告期间: 2015年1月1日至2015年6月30日

单位: 人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期 2015年1月1日至2015年6月30日 | 上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日 |
|---------------------|-----|----------------------------|---------------------------------|
| 一、收入 | | 67,962,759.64 | 76,366,166.47 |
| 1. 利息收入 | | 22,904,181.03 | 52,979,552.77 |
| 其中: 存款利息收入 | | 171,795.64 | 2,478,942.92 |
| 债券利息收入 | | 22,733,086.42 | 48,776,746.16 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 10,096.67 | 1,723,843.08 |
| 其他利息收入 | | 63,569,042.17 | -40,496,671.27 |
| 2. 投资收益(损失以“-”填列) | | 63,569,042.17 | -40,496,671.27 |
| 其中: 股票投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | | 5,254,526.64 | - |
| 资产支持证券投资损益 | | 58,197,942.40 | -40,496,671.27 |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | | - | - |
| 公允价值变动收益(损失以“-”填列) | | -18,911,294.35 | 64,373,249.94 |
| 4. 汇兑收益(损失以“-”号填列) | | - | - |
| 5. 其他收入(损失以“-”号填列) | | - | - |
| 二、费用 | | 8,915,304.06 | 13,539,172.12 |
| 1. 管理人报酬 | | 1,747,146.36 | 4,377,287.29 |
| 2. 托管费 | | 469,184.00 | 1,250,633.43 |
| 3. 销售服务费 | | 363,479.06 | 806,300.26 |
| 4. 交易费用 | | 209,079.10 | 8,508.60 |
| 5. 利息支出 | | 6,798,543.78 | 6,896,450.44 |
| 其中: 买入返售金融资产支出 | | 6,798,543.78 | 6,896,450.44 |
| 6. 其他费用 | | 297,815.27 | 200,462.62 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | | 58,747,455.59 | 63,286,994.32 |
| 减: 所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | | 58,747,455.59 | 63,286,994.32 |

注: 截至本报告期末, 基金份额总额127,844,062.95份。下属两级基金: 新双盈A的基金份额净值1.007元, 基金份额总额889,461,487.14份; 新双盈B的基金份额净值1.076元, 基金份额总额382,382,575.81份。

6.7 现金流量表

会计主体: 信诚新双盈分级债券型证券投资基金

报告期间: 2015年1月1日至2015年6月30日

单位: 人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期 2015年1月1日至2015年6月30日 | 上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日 |
|-------------------|-----|----------------------------|---------------------------------|
| 一、收入 | | 67,962,759.64 | 76,366,166.47 |
| 1. 利息收入 | | 22,904,181.03 | 52,979,552.77 |
| 其中: 存款利息收入 | | 171,795.64 | 2,478,942.92 |
| 债券利息收入 | | 22,733,086.42 | 48,776,746.16 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 10,096.67 | 1,723,843.08 |
| 其他利息收入 | | 63,569,042.17 | -40,496,671.27 |
| 2. 投资收益(损失以“-”填列) | | 63,569,042.17 | -40,496 |