信诚三得益债券型证券投资基金

2012 第二季度 报告

[illegible]年[illegible]月[illegible]日

基金管理人:信诚基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:[illegible]年[illegible]月[illegible]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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于[illegible]年[illegible]月[illegible]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。

本报告期自[illegible]年[illegible]月[illegible]日起至[illegible]年[illegible]月[illegible]日止。

§2 基金产品概况

基金简称	信诚三得益债券
基金主代码	[illegible]
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	[illegible]年[illegible]月[illegible]日
报告期末基金份额总额	[illegible]份
投资目标	本基金在保证基金资产的较高流动性和稳定性基础上,严格控制风险,同时通过主动管理,追求超越业绩比较基准的投资收益率。
投资策略	[illegible]券类资产的投资策略 本基金将采取自上而下、积极投资和控制风险的债券投资策略,在战略配置上,主要通过对收益率的预期,进行有效的久期管理,实现债券的整体配置;在战术配置上采取跨市场套利、收益率曲线策略和信用利差策略等对个券进行选择,在严格控制固定收益品种的流动性和信用等风险的基础上,获取超额收益。对于可转债的投资采用公司分析法和价值分析。 [illegible]股申购策略 本基金将结合市场的资金状况预测拟发行上市的新股(或增发新股)的申购中签率,考察它们的内在价值以及上市溢价可能,判断新股申购收益率,制定申购策略和卖出策略。 [illegible]级市场股票投资策略 本基金股票投资将注重基本面研究,选择流动性好、估值水平较低、具有中长期投资价值的个股进行投资。同时分散个股,构建组合,以避免单一股票的特定风险。 [illegible]生金融工具投资策略 本基金对衍生金融工具的投资主要以对冲投资风险或无风险套利为主要目的。基金将在有效进行风险管理的前提下,通过对标的证券的研究,结合衍生工具定价模型预估衍生工具价值或风险对冲比例,谨慎投资。
业绩比较基准	[illegible]中信标普全债指数收益率与[illegible]一年期银行定期存款税后收益率
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	中国建设银行股份有限公司
下属两级基金的基金简称	信诚三得益债券粤 / 信诚三得益债券月
下属两级基金的交易代码	[illegible] / [illegible]
报告期末下属两级基金的份额总额	[illegible]份 / [illegible]份

§3 主要财务指标

[illegible] 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	信诚三得益债券粤[illegible]	信诚三得益债券月[illegible]
[illegible]本期已实现收益	[illegible]	[illegible]
[illegible]本期利润	[illegible]	[illegible]
[illegible]加权平均基金份额本期利润	[illegible]	[illegible]
[illegible]期末基金资产净值	[illegible]	[illegible]
[illegible]期末基金份额净值	[illegible]	[illegible]

注:[illegible]员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。

[illegible]园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。

[illegible]基金净值表现

[illegible]园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

信诚三得益债券粤

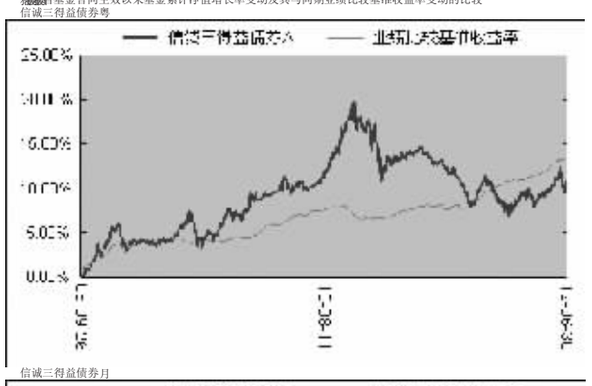
阶段	净值增长率[illegible]	净值增长率标准差[illegible]	业绩比较基准收益率[illegible]	业绩比较基准收益率标准差[illegible]	[illegible]	[illegible]
[illegible]年第[illegible]季度	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]

信诚三得益债券月

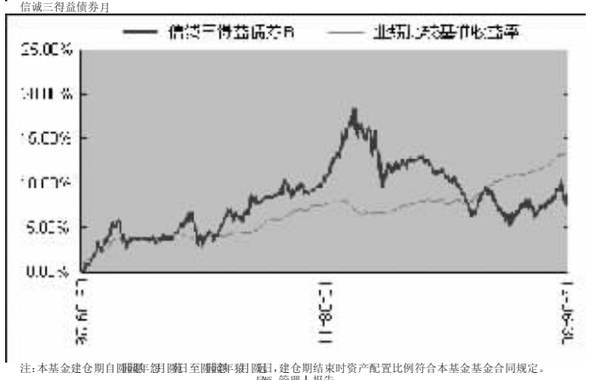
阶段	净值增长率[illegible]	净值增长率标准差[illegible]	业绩比较基准收益率[illegible]	业绩比较基准收益率标准差[illegible]	[illegible]	[illegible]
[illegible]年第[illegible]季度	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]

[illegible]园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

信诚三得益债券粤



信诚三得益债券月



注:本基金建仓期自[illegible]年[illegible]月[illegible]日至[illegible]年[illegible]月[illegible]日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

§4 管理人报告

[illegible] 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		
王国强	本基金基金经理	[illegible]年[illegible]月[illegible]日	原	[illegible]	管理学硕士,[illegible]年证券、基金从业经验。曾先后任职于浙江国际信托投资公司、健桥证券股份有限公司和银河基金管理有限公司。[illegible]年加盟信诚基金管理有限公司,现任信诚三得益债券型基金的基金经理。
李仆	本基金基金经理	[illegible]年[illegible]月[illegible]日	原	[illegible]	[illegible]年证券从业经验。曾任职于宝钢集团财务有限责任公司资金部、宝钢集团有限公司资产部、宝岛(香港)贸易有限公司、华宝信托有限责任公司。[illegible]年[illegible]月加入信诚基金管理有限公司。

注:[illegible]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。

[illegible]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。

[illegible]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《信诚三得益债券型证券投资基金基金合同》、《信诚三得益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。

[illegible]公平交易专项说明

[illegible]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[illegible]》,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。

[illegible]异常交易行为的专项说明

报告期内本基金未有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[illegible]的交易。

[illegible]报告期内基金的投资策略和运作分析

今年以来,经济增长延续放缓趋势,投资、出口回落幅度较大,消费增长略有回落,物价呈下行态势。美国宽松的货币政策推动就业改善,居民收入和消费信贷平稳增长,受此诸多因素推动,消费增长较快,但是核心资本支出增长缓慢,显示美国经济增长后劲不足。欧元区经济不堪债务重压,迫于削减债务和赤字压力而推行的财政紧缩措施势必进一步抑制经济增长,欧元区经济增长滑走在衰退的边缘。投资方面,企业综合融资成本仍然较高,融资渠道不畅,抑制投资增长。上半年,物价持续下行,[illegible]月份已降到[illegible]的较低水平。当前宏观调控稳增长的压力较大,央行对货币政策进行预调微调,远[illegible]两月央行连续两次降息,一年期贷款利率累计降幅达[illegible]存款准备金率下调两次至[illegible],但仍居高位。上半年,货币流通速度减慢明显,广义货币增长仍然较低,[illegible]末配[illegible]比[illegible],仍低于[illegible]的目标水平。由于经济增长放缓,二季度权益市场呈震荡走势。债市收益率小幅下行,[illegible]年期中长期端利率[illegible]个基点至[illegible],公司债等信用债涨幅较大,中信标普全债指数上涨[illegible]。

二季度,本基金在债券投资方面,重点配置公司债,组合久期维持在接近基准的水平,并加大杠杆,增强收益。减持了全部权益投资,规避了权益市场调整的风险。

展望下半年,国内经济受外需下滑和经济结构调整因素影响,经济增速难以明显回升。物价方面,三季度物价仍将维持下行态势,四季度小幅回升,总体上维持较低水平,预计央行仍将继续对货币政策进行微调,降息空间仍然较大。因此,债券市场利率将延续下行态势,信用债投资收益较为突出。

[illegible]报告期内基金的业绩表现

二季度本基金比较基准收益率为[illegible],本基金粤、月份额净值分别增长[illegible]和[illegible],分别超越基准[illegible]和[illegible]。

§5 投资组合报告

[illegible]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(%)
[illegible]	权益投资	[illegible]	[illegible]
	其中:股票	[illegible]	[illegible]
[illegible]	固定收益投资	[illegible]	[illegible]
	其中:债券	[illegible]	[illegible]
	资产支持证券	[illegible]	[illegible]
[illegible]	金融衍生品投资	[illegible]	[illegible]
[illegible]	买入返售金融资产	[illegible]	[illegible]
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	[illegible]	[illegible]
[illegible]	银行存款和结算备付金合计	[illegible]	[illegible]
[illegible]	其他资产	[illegible]	[illegible]
[illegible]	合计	[illegible]	[illegible]

[illegible]报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

[illegible]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

本基金本报告期末未持有股票。

[illegible]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(%)
[illegible]	国家债券	[illegible]	[illegible]
[illegible]	央行票据	[illegible]	[illegible]
[illegible]	金融债券	[illegible]	[illegible]
	其中:政策性金融债	[illegible]	[illegible]
[illegible]	企业债券	[illegible]	[illegible]
[illegible]	企业短期融资券	[illegible]	[illegible]
[illegible]	中期票据	[illegible]	[illegible]
[illegible]	可转债	[illegible]	[illegible]
[illegible]	其他	[illegible]	[illegible]
[illegible]	合计	[illegible]	[illegible]

[illegible]报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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(%)
[illegible]	[illegible]	[illegible]华泰债	[illegible]	[illegible]	[illegible]
[illegible]	[illegible]	[illegible]江阳债	[illegible]	[illegible]	[illegible]
[illegible]	[illegible]	[illegible]鹏博债	[illegible]	[illegible]	[illegible]
[illegible]	[illegible]	[illegible]中孚债	[illegible]	[illegible]	[illegible]
[illegible]	[illegible]	[illegible]海债	[illegible]	[illegible]	[illegible]

[illegible]报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

[illegible]报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

[illegible]投资组合报告附注

[illegible]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。

[illegible]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。

[illegible]其他资产构成

序号	名称	金额(元)
[illegible]	存出保证金	[illegible]
[illegible]	应收证券清算款	[illegible]
[illegible]	应收股利	[illegible]
[illegible]	应收利息	[illegible]
[illegible]	应收申购款	[illegible]
[illegible]	其他应收款	[illegible]
[illegible]	待摊费用	[illegible]
[illegible]	其他	[illegible]
[illegible]	合计	[illegible]

[illegible]报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末持有处于转股期的可转换债券。

[illegible]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。

[illegible]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

项目	信诚三得益债券粤	信诚三得益债券月
报告期期初基金份额总额	[illegible]	[illegible]
报告期期间基金总申购份额	[illegible]	[illegible]
减:报告期期间基金总赎回份额	[illegible]	[illegible]
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	[illegible]	[illegible]
报告期期末基金份额总额	[illegible]	[illegible]

§7 备查文件目录

[illegible]备查文件目录

1、信诚三得益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、信诚三得益债券型证券投资基金基金合同
4、信诚三得益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

[illegible]存放地点

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

[illegible]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:[illegible]

信诚基金管理有限公司
[illegible]年[illegible]月[illegible]日

信诚盛世蓝筹股票型证券投资基金

2012 第二季度 报告

[illegible]年[illegible]月[illegible]日

基金管理人:信诚基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:[illegible]年[illegible]月[illegible]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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于[illegible]年[illegible]月[illegible]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。

本报告期自[illegible]年[illegible]月[illegible]日起至[illegible]年[illegible]月[illegible]日止。

§2 基金产品概况

基金简称	信诚盛世蓝筹股票
基金主代码	[illegible]
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	[illegible]年[illegible]月[illegible]日
报告期末基金份额总额	[illegible]份
投资目标	通过投资于较大市值且业绩优良的蓝筹上市公司,追求基金财产的长期稳定增值。
投资策略	本基金投资组合中股票、债券、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。本基金定位为股票型基金,其战略性资产配置以股票为主,并不因市场的中短期变化而改变。在不同的市场条件下,本基金允许在一定的范围内作战术性资产配置调整,以规避市场风险。
业绩比较基准	[illegible]%×中信标普综合指数收益率+[illegible]%×[illegible]一年定存指数收益率
风险收益特征	本基金为主动投资的股票型基金,属于证券投资基金中的高风险、高收益品种。
基金管理人	信诚基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

[illegible] 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期([illegible]年[illegible]月[illegible]日至[illegible]年[illegible]月[illegible]日)
[illegible]本期已实现收益	[illegible]
[illegible]本期利润	[illegible]
[illegible]加权平均基金份额本期利润	[illegible]
[illegible]期末基金资产净值	[illegible]
[illegible]期末基金份额净值	[illegible]

注:员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。

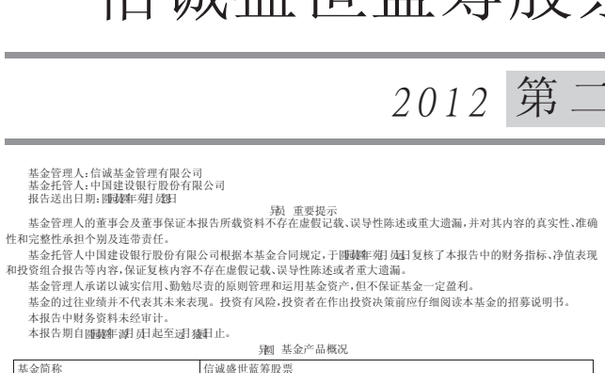
[illegible]园本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

[illegible]基金净值表现

[illegible]园本报告期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率[illegible]	净值增长率标准差于	业绩比较基准收益率盂	业绩比较基准收益率标准差榆	淤[illegible]	于[illegible]榆
[illegible]年第[illegible]季度	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]

[illegible]园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:本基金建仓期自[illegible]年[illegible]月[illegible]日至[illegible]年[illegible]月[illegible]日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

§4 管理人报告

[illegible] 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		
张光成	本基金基金经理	[illegible]年[illegible]月[illegible]日	原	苑	悦[illegible]年证券、基金从业经验。曾任欧洲货币(上海)有限公司研究总监、兴业全球基金管理有限公司基金经理。[illegible]年[illegible]月加入信诚基金管理有限公司,担任投资经理。现任信诚盛世蓝筹股票型基金基金经理。

注:[illegible]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。

[illegible]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。

[illegible]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《信诚盛世蓝筹股票型证券投资基金基金合同》、《信诚盛世蓝筹股票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。

[illegible]公平交易专项说明

[illegible]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[illegible]》,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。

[illegible]异常交易行为的专项说明

报告期内本基金未有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[illegible]的交易。

[illegible]报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为[illegible],同期业绩比较基准收益率为[illegible],基金份额净值增长率表现领先基准[illegible]个百分点。

§5 投资组合报告

[illegible]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(%)
[illegible]	权益投资	[illegible]	[illegible]
	其中:股票	[illegible]	[illegible]
[illegible]	固定收益投资	[illegible]	[illegible]
	其中:债券	[illegible]	[illegible]
	资产支持证券	[illegible]	[illegible]
[illegible]	金融衍生品投资	[illegible]	[illegible]
[illegible]	买入返售金融资产	[illegible]	[illegible]
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	[illegible]	[illegible]
[illegible]	银行存款和结算备付金合计	[illegible]	[illegible]
[illegible]	其他资产	[illegible]	[illegible]
[illegible]	合计	[illegible]	[illegible]

[illegible]报告期末按行业分类的股票投资组合

[illegible]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

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
[illegible]	农、林、牧、渔业	[illegible]	[illegible]
[illegible]	采掘业	[illegible]	[illegible]
[illegible]	制造业	[illegible]	[illegible]
[illegible]	食品、饮料	[illegible]	[illegible]
[illegible]	纺织、服装、皮毛	[illegible]	[illegible]
[illegible]	木材、家具	[illegible]	[illegible]
[illegible]	造纸、印刷	[illegible]	[illegible]
[illegible]	石油、化学、塑胶、塑料	[illegible]	[illegible]
[illegible]	电子	[illegible]	[illegible]
[illegible]	金属、非金属	[illegible]	[illegible]
[illegible]	机械、设备、仪表	[illegible]	[illegible]
[illegible]	医药、生物制品	[illegible]	[illegible]
[illegible]	其他制造业	[illegible]	[illegible]
[illegible]	电力、煤气及水的生产和供应业	[illegible]	[illegible]
[illegible]	建筑业	[illegible]	[illegible]
[illegible]	交通运输、仓储业	[illegible]	[illegible]
[illegible]	信息技术业	[illegible]	[illegible]
[illegible]	批发和零售贸易	[illegible]	[illegible]
[illegible]	金融、保险业	[illegible]	[illegible]
[illegible]	房地产业	[illegible]	[illegible]
[illegible]	社会服务业	[illegible]	[illegible]
[illegible]	传播与文化产业	[illegible]	[illegible]
[illegible]	综合类	[illegible]	[illegible]
	合计	[illegible]	[illegible]

[illegible]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(%)
员	[illegible]	科伦药业	[illegible]	[illegible]	[illegible]
圆	[illegible]	贵州茅台	[illegible]	[illegible]	[illegible]
猿	[illegible]	金地集团	[illegible]	[illegible]	[illegible]
源	[illegible]	老凤祥	[illegible]	[illegible]	[illegible]
缘	[illegible]	洋河股份	[illegible]	[illegible]	[illegible]
远	[illegible]	广汇能源	[illegible]	[illegible]	[illegible]
苑	[illegible]	保利地产	[illegible]	[illegible]	[illegible]
愿	[illegible]	泸州老窖	[illegible]	[illegible]	[illegible]
怨	[illegible]	三一重工	[illegible]	[illegible]	[illegible]
园	[illegible]	巨星科技	[illegible]	[illegible]	[illegible]

[illegible]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(%)
员	国家债券	[illegible]	[illegible]
圆	央行票据	[illegible]	[illegible]
猿	金融债券	[illegible]	[illegible]
	其中:政策性金融债	[illegible]	[illegible]
源	企业债券	[illegible]	[illegible]
缘	企业短期融资券	[illegible]	[illegible]
远	中期票据	[illegible]	[illegible]
苑	可转债	[illegible]	[illegible]
愿	其他	[illegible]	[illegible]
怨	合计	[illegible]	[illegible]

[illegible]报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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(%)
员	[illegible]	[illegible]央行票据[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]
圆	[illegible]	[illegible]央行票据[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]
猿	[illegible]	重工转债	[illegible]	[illegible]	[illegible]

注:本基金本报告期末仅持有上述三只债券。

[illegible]报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

[illegible]报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

[illegible]投资组合报告附注

[illegible]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。

[illegible]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。

[illegible]其他资产构成

序号	名称	金额(元)
[illegible]	存出保证金	[illegible]
[illegible]	应收证券清算款	[illegible]
[illegible]	应收股利	[illegible]
[illegible]	应收利息	[illegible]
[illegible]	应收申购款	[illegible]
[illegible]	其他应收款	[illegible]
[illegible]	待摊费用	[illegible]
[illegible]	其他	[illegible]
[illegible]	合计	[illegible]

[illegible]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。

[illegible]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。

[illegible]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

报告期期初基金份额总额	[illegible]
报告期期间基金总申购份额	[illegible]
减:报告期期间基金总赎回份额	[illegible]
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	[illegible]
报告期期末基金份额总额	[illegible]

§7 备查文件目录

[illegible]备查文件目录

员信诚盛世蓝筹股票型证券投资基金相关批准文件
圆信诚基金管理公司营业执照、公司章程
猿信诚盛世蓝筹股票型证券投资基金基金合同
源信诚盛世蓝筹股票型证券投资基金招募说明书
缘本报告期内按照规定披露的各项公告

[illegible]存放地点

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

[illegible]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:[illegible]

信诚基金管理有限公司
[illegible]年[illegible]月[illegible]日

信诚双盈分级债券型证券投资基金

2012 第二季度 报告

[illegible]年[illegible]月[illegible]日

基金管理人:信诚基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:[illegible]年[illegible]月[illegible]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[illegible]年[illegible]月[illegible]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。

本报告期自[illegible]年[illegible]月[illegible]日起至[illegible]年[illegible]月[illegible]日止。

§2 基金产品概况

基金简称	信诚双盈分级债券
基金主代码	[illegible]
基金运作方式	契约型,本基金合同生效后三年内,双盈[illegible]份额每满[illegible]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[illegible]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[illegible]期届满,本基金将不再进行基金份额分级。
基金合同生效日	[illegible]年[illegible]月[illegible]日
报告期末基金份额总额	[illegible]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
下属两级基金的基金简称	信诚双盈分级债券粤(杨内简称:双盈粤) / 信诚双盈分级债券月(杨内简称:双盈月)
下属两级基金的交易代码	[illegible] / [illegible]
报告期末下属两级基金的份额总额	[illegible]份 / [illegible]份
下属两级基金的风险收益特征	基金合同生效之日起至[illegible]年内,本基金经过基金份额分级后,双盈粤份额为低风险、收益相对稳定的基金份额。	基金合同生效之日起至[illegible]年内,本基金经过基金份额分级后,双盈月份额为中高风险、中高收益的基金份额。

§3 主要财务指标

[illegible] 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期([illegible]年[illegible]月[illegible]日-[illegible]年[illegible]月[illegible]日(基金合同生效日)至[illegible]年[illegible]月[illegible]日)
[illegible]本期已实现收益	[illegible]
[illegible]本期利润	[illegible]
[illegible]加权平均基金份额本期利润	[illegible]
[illegible]期末基金资产净值	[illegible]
[illegible]期末基金份额净值	[illegible]

注:员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。

[illegible]园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。

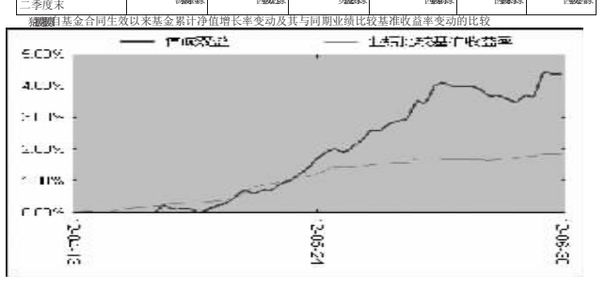
狼本基金合同自[illegible]年[illegible]月[illegible]日起生效,报告期为[illegible]年[illegible]月[illegible]日至[illegible]年[illegible]月[illegible]日。

[illegible]基金净值表现

[illegible]园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[illegible]	净值增长率标准差于	业绩比较基准收益率盂	业绩比较基准收益率标准差榆	淤[illegible]	于[illegible]榆
基金成立日至[illegible]年二季度末	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]

[illegible]园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:基金合同生效起至披露时点不满一年(本基金合同生效日为[illegible]年[illegible]月[illegible]日)。

圆按照基金合同的约定,本基金自基金合同生效日起不超过六个月内完成建仓。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、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。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净值的[illegible]。其中,转换后的(信诚信用添利债券型证券投资基金([illegible]))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[illegible]。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净值的[illegible],其中持有的全部权证市值不超过基金资产净值的[illegible]。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[illegible]。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。截止本报告期末,本基金尚处于建仓期。

§4 管理人报告

[illegible] 基金经理(或基金经理小组)