信诚双盈分级债券型证券投资基金招募说明书(摘要)

(2013年第1次更新)

【重要提示】

本基金于2012年4月13日基金合同正式生效。

投资有风险,投资人申购本基金时应认真阅读招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》,基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

本更新招募说明书所载内容截止日若无特别说明为2013年4月13日,有关财务数据和净值表现截止日为2012年12月31日(未经审计)。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

基金管理人:信诚基金管理有限公司

住所: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

办公地址: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

法定代表人:张翔燕

成立日期:2005年9月30日

批准设立机关及批准设立文号:中国证券监督管理委员会证监基金字【2005】142号

注册资本:2亿元人民币

电话:(021)6864 9788

联系人:蒋晓伟

股权结构:

股东	出资额(万元人民币)	出资比例(%)
中信信托有限责任公司	9800	49
英国保诚集团股份有限公司	9800	49
中新苏州工业园区创业投资有限公司	400	2
合计	20000	100

(二)主要人员情况

1. 基金管理人董事、监事基本情况

张翔燕女士,董事长,硕士学位。历任中信银行总行营业部副总经理、综合计划部总经理,中信银行北京分行副行长、中信银行总行营业总部副总经理,中信证券股份有限公司副总经济师,中信控股有限责任公司风险管理部总经理。现任中信控股有限责任公司副总裁。

陈一松先生,董事,金融学硕士。历任中信实业银行资金部科长、中信证券股份有限公司总裁办主任、长城科技股份有限公司董事会秘书、中国建设银行股份有限公司行长秘书兼行长办公室副主任。现任中信信托有限责任公司总经理。

包学勤先生,董事,研究生。历任招商银行证券业务部出市代表、南方证券有限公司投资银行部总经理助理、国信证券有限公司投资银行二部总经理、中信证券股份有限公司深圳投资银行部总经理、中信信托有限责任公司投资银行二部总经理。现任中信信托有限责任公司副总经理。

Graham David Mason先生,董事,南非籍,保险精算专业学士。历任南非公募基金投资分析师、南非Norwich公司基金经理、英国保诚集团(南非)执行总裁。现任瀚亚投资执行总裁。

叶小琪女士,董事,高级工商管理硕士。历任汇丰投资管理有限公司副总监、保德信集团亚洲资产管理亚洲区区域总监、法国兴业资产管理(香港)有限公司首席市场总监、法国兴业证券董事总经理。现任瀚亚投资亚洲区零售业务总监。

郑美美女士,董事,工商管理硕士。历任新加坡金融管理局金融市场发展规划部处长。现任瀚亚投资(新加坡)有限公司督察长。

何德旭先生,独立董事,经济学博士。历任中国科学研究院财贸所处长、研究员等职。现任中国社会科学院数量经济与技术经济研究所副所长、金融研究中心副主任。

夏执东先生,独立董事,经济学硕士。历任财政部财政科学研究所副主任、中国建设银行总行国际部副处长、安永华明会计师事务所副总经理、北京天华中兴会计师事务所首席合伙人。现任致同会计师事务所管委会副主席。

杨思群先生,独立董事,经济学博士。历任中国社会科学院财贸经济研究所副研究员,现任清华大学经济管理学院经济系副教授。

李莹女士,监事会主席,金融学硕士。历任中国建设银行沧浪办事处信贷科长、中国建设银行苏州分行中间业务部总经理助理、北京证券投行华东部一级项目经理、中新苏州工业园区创业投资有限公司投资银行部总经理、苏州工业园区银杏投资管理有限公司副总经理。现任苏州元禾控股有限公司财务总监。

解晓然女士,监事,双学位,历任上海市共青团闸北区委员会宣传部副部长、天治基金管理有限公司监察稽核部总监助理。现任信诚基金管理有限公司监察稽核总监。

注:原"英国保诚集团亚洲区总部基金管理业务"自2012年2月14日起正式更名为瀚亚投资,其旗下各公司名称自该日起进行相应变更。瀚亚投资为英国保诚集团成员。

2.经营管理层人员情况

王俊锋先生,总经理,工商管理硕士。历任国泰基金管理有限公司市场部副总监、华宝兴业基金管理有限公司市场总监、瑞银环球资产管理(香港)有限公司北京代表处首席代表、瑞银证券有限责任公司资产管理部总监。现任信诚基金管理有限公司总经理、首席执行官。

解晓然先生,副总经理,经济学硕士,注册会计师。历任中信证券股份有限公司高级经理、中信控股有限责任公司高级经理、信诚基金管理有限公司市场总监、首席市场官。现任信诚基金管理有限公司首席运营官。

黄小坚先生,副总经理,经济学硕士。历任中银万国证券公司研究所行业分析师,银华基金管理有限公司行业研究员、投资管理部组合经理、基金经理,华宝兴业基金管理有限公司基金经理。现任信诚基金管理有限公司副总经理、首席投资官、股票投资总监、信诚优胜精选股票型证券投资基金基金经理。

桂思毅先生,副总经理,工商管理硕士。历任安达信咨询管理有限公司高级审计员,中乔智威汤逊广告有限公司财务主管,德国德意斯登银行上海分行财务经理,信诚基金管理有限公司风险控制总监、财务总监、首席财务官、首席运营官。现任信诚基金管理有限公司副总经理、首席财务官。

林军女士,副总经理,经济学硕士。历任折江省证券公司投资银行部副总经理、市场总监,西南证券有限责任公司国际业务部总经理,招商基金管理有限公司总经理助理、营销总监,汇添富基金管理有限公司市场总监、副总经理,交银施罗德基金管理有限公司总经理助理、市场总监。现任信诚基金管理有限公司副总经理、首席市场官。

3.督察长

唐世春先生,督察长,法学硕士,历任北京天平律师事务所律师、国泰基金管理有限公司监察稽核部法务主管、友邦华泰基金管理有限公司法律监察部总监、总经理助理兼董事会秘书。现任信诚基金管理有限公司督察长。

4.基金经理

曾丽琼女士,金融学硕士,11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,2007年2月至2010年6月期间,担任华宝兴业现金宝货币市场基金的基金经理,2009年2月至2010年6月期间,兼任华宝兴业增强收益债券基金的基金经理。2010年8月加入信诚基金,现任信诚货币市场证券投资基金基金经理。

5.投资决策委员会成员

黄小坚先生,副总经理/首席投资官/股票投资总监;

王旭巍先生,固定收益总监;

董越先生,交易总监;

胡喆女士,研究总监;

张光成先生,股票投资总监助理。

上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一)基本情况

名称:中国银行股份有限公司(简称"中国银行")

住所及办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期:1983年10月31日

注册资本:人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

法定代表人:肖钢

基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字【1998】24 号

托管及投资者服务部总经理:李爱华

托管部门信息披露联系人:唐州徽

电话:(010)66594855

传真:(010)66594942

(二)基金托管部门及主要人员情况

中国银行于1998年设立基金托管部,为进一步树立以投资者为中心的服务理念,中国银行于2005年3月23日正式将基金托管部更名为托管及投资者服务部,现有员工120余人。另外,中国银行在重点分行已开展托管业务。

目前,中国银行拥有证券投资基金、一对多专户、一对一专户、社保基金、保险资产、QFII资产、QDII资产、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、信托资产、年金资产、理财产品、海外人民币基金、私募基金等门类齐全的托管产品体系。在国内,中国银行率先开展绩效评估、风险管理等增值服务,为各类客户提供个性化的托管服务。2011年末,中国银行各类托管资产规模突破两万亿元,居同业前列。

(三)证券投资基金托管情况

截至2012年6月末,中国银行已托管长盛创新先锋混合、长盛同盛封闭、长盛同智优势混合(LOF)、大成2020生命周期混合、大成蓝筹稳健混合、大成优选封闭、大成景宏封闭、工银大盘蓝筹股票、工银核心价值股票、国泰沪深300指数、国泰金鹏保本混合、国泰金鹏蓝筹混合、国泰区位优势股票、国投瑞银稳定增利债券、海富通股票、海富通货币、海富通精选成号混合、海富通收益增长混合、海富通中证100指数(LOF)、华宏兴业大盘精选股票、华宏兴业动力组合股票、华宏兴业先进成长股票、华夏策略混合、华夏大盘精选混合、华夏回报二号混合、华夏回报混合、华夏行业股票(LOF)、嘉实超短债债券、嘉实成长收益混合、嘉实服务增值行业混合、嘉实沪深300指数(LOF)、嘉实货币、嘉实稳健混合、嘉实研究精选股票、嘉实增长混合、嘉实债券、嘉实主题混合、嘉实回报混合、嘉实价值优势股票型、金鹰成份优选股票、金鹰行业优势股票、银河成长股票、易方达平稳增长混合、易方达策略成长混合、易方达策略成长二号混合、易方达积极成长混合、易方达货币、易方达稳健收益债券、易方达深证100ETF、易方达中小盘股票、易方达深证100ETF联接、万家180指数、万家稳健增利债券、银华优势企业混合、银华优质增长股票、银华领先策略股票、景顺长城动力平衡混合、景顺长城优选股票、景顺长城货币、景顺长城鼎益股票(LOF)、泰信天天收益货币、泰信优质生活股票、泰信蓝筹精选股票、泰信债券增强收益、招商先锋混合、泰达宏利精选股票、泰达宏利集利债券、泰达宏利中证财富大盘指数、华泰柏瑞盛世中国股票、华泰柏瑞积极成长混合、华泰柏瑞价值增长股票、华泰柏瑞货币、华泰柏瑞量化现行股票型基金、南方高增长股票(LOF)、国富潜力组合股票、国富强化收益债券、国富成长动力股票、宝盈核心优势混合、招商行业领先股票、东方核心动力股票、华安行业轮动股票型、摩根士丹利华鑫强收益债券型、诺德中小盘股票型、民生加银稳健成长股票型、博时宏观回报债券型、易方达岁丰添利债券型、富兰克林国海中小盘股票型、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接、上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接、长城中小盘成长股票型、易方达医疗保健行业股票型、景顺长城稳定收益债券型、上证180金融交易型开放式指数、国泰上证180金融交易型开放式指数证券投资基金联接、诺德优选30股票型、泰达宏利聚利分级债券型、国联安优选行业股票型、长盛同鑫保本混合型、金鹰中证技术领先指数增强型、泰信中证200指数、大成内需增长股票型、银华永祥保本混合型、招商深圳电子信息传媒产业(TMT)50交易型开放式指数、招商深证TMT50交易型开放式指数证券投资基金联接、嘉实深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金联接、深证基本面120交易型开放式指数、上证180成长交易型开放式指数、华宝兴业上证180成长交易型开放式指数证券投资基金联接、易方达资源行业股票型、华安深证300指数、嘉实信用债券型、平安大华行业先锋股票型、华泰柏瑞信用增利债券型、泰信中小盘精选股票型、海富通国策导向股票型、中邮上证380指数增强型、泰达宏利中证500指数分级、长盛同禧信用增利债券型、银华中证内地资源主题指数分级、平安大华深证300指数增强型、嘉实安心货币市场、上投摩根健康品质生活股票型、工银瑞信睿智中证500指数分级、招商优势企业灵活配置混合型、国泰中小板300成长交易型开放式指数、国泰中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金联接、景顺长城优信增利债券型、诺德周期策略股票型、长盛电子信息产业股票型、诺安中证创业成长指数分级、信诚双盈分级债券型、嘉实沪深300交易型开放式指数、民生加银信用双利债券型、工银瑞信基本面量化策略股票型、信诚周期轮动股票型、富兰克林国海研究精选股票型、诺安汇鑫保本混合型、平安大华策略先锋混合型、华宝兴业中证短融50指数债券型、180等权重交易型开放式指数、华安双月鑫短期理财债券型、大成景恒保本混合型、景顺长城上证180等权重交易型开放式指数证券投资基金联接、上投摩根分红添利债券型、嘉实优化红利股票型、嘉实海外中国股票(QDII)、银华全球优选(QDII-FOF)、长盛环球景气行业大盘精选股票型(QDII)、华泰柏瑞亚洲领导企业股票型(QDII)、信诚金砖四国积极配置(QDII)、海富通大中华精选股票型(QDII)、招商标普金砖四国指数(LOF-QDII)、华宝兴业成熟市场动量优选(QDII)、大成标普500等权重指数(QDII)、长信标普100等权重指数(QDII)、博时抗通胀增强回报(QDII)、华安大中华升级股票型(QDII)、信诚全球商品主题(QDII)、上投摩根全球天然资源股票型、工银瑞信中国机会全球配置股票型(QDII)、易方达标普全球高端消费品指数增强型、建信全球资源股票型等164只证券投资基金,覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金,满足了不同客户多元化的投资理财需求,基金托管规模位居同业前列。

三、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1.直销机构

信诚基金管理有限公司

注册地址: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

办公地址: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

法定代表人:张翔燕

客服电话:400-6660066,021- 51085168

联系人:殷宇飞

电话:021- 68649788

网址:http://www.citicprufunds.com.cn或www.xcfunds.com

2.代销机构

(1)中国银行股份有限公司

注册地址:北京西城区复兴门内大街1号

办公地址:北京西城区复兴门内大街1号

法定代表人:肖钢

客服电话:95566

传真:010-66594946

电话:010-66594977

网址:www.boc.cn

(2)中国建设银行股份有限公司

注册地址:北京市西城区金融大街25号

办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人:王洪章

传真:010-66275654

联系人:张静

客服电话:95533

公司网站:www.ccb.com

(3)中国农业银行股份有限公司

注册地址:北京市东城区建国门内大街69号

办公地址:北京市东城区建国门内大街69号

法定代表人:蒋超良

客服电话:95599

网址:www.95599.cn

(4)交通银行股份有限公司

住所:上海市浦东新区银城中路188号

法定代表人:胡怀邦

电话:(021)58781234

传真:(021)58408483

联系人:曹榕

客户服务电话:95559

网址:www.bankcomm.com

(5)招商银行股份有限公司

注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦

法定代表人: 傅育宁

电话:0755-83198888

传真:0755-83195049

联系人:邓鹏鹏

客服电话:95555

网址:www.cmbchina.com

(6)中信银行股份有限公司

注册地址:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

法定代表人:田国立

客服电话:95558

联系人:丰靖

网址:http://bank.ecitic.com

(7)华夏银行股份有限公司

地址:北京市东城区建国门内大街22号

法定代表人:吴建

联系人:马旭

客户服务电话:95577

网址:www.hxb.com.cn

(8)宁波银行股份有限公司

注册地址:宁波市江东区中山东路294号

办公地址:宁波市江东区中山东路294号

法定代表人:陆华裕

客户服务统一咨询电话:96528,上海地区:962528

网址: www.nbcb.com.cn

联系人:胡技勋

联系方式:021-63586210

传真:021-63586215

(9)中信证券股份有限公司

注册地址:深圳深南大道7088号招商银行大厦A层

法定代表人:王东明

联系人:陈忠

电话:010-84863893

传真:010-84865560

网址:www.ecitic.com

(10)中信建投证券有限责任公司

注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址:北京市朝阳门内大街188号

法定代表人:张佑君

联系人:权唐

联系电话:(010)85130588

开放式基金咨询电话:4008888108

网址:www.csc108.com

(11)中信证券(浙江)有限责任公司

注册地址:浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19层、20层

办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19层、20层

法定代表人:沈强

开放式基金咨询电话:0571-96598

开放式基金业务传真:0571-85783771

联系人:俞会亮

网址:www.bigsun.com.cn

(12)中信万通证券有限责任公司

注册地址:青岛市崂山区崂路29号澳柯玛大厦15层(1507-1510室)

办公地址:青岛市东海西路28号

法定代表人:杨宝林

联系人:吴忠超

联系电话:0532-85022326

(13) 中国中投证券有限责任公司

注册地址:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层至21层

办公地址:深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第18层至21层

法定代表人:龙增来

统一客户服务电话:400-600-8008

公司网站:www.cjis.cn

(14)招商证券股份有限公司

注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层

法定代表人:宫少林

联系人:林生迎

电话:(0755)82960223

传真:(0755)82943636

网址:www.newone.com.cn

客服电话:95565 ,4008888111

(15) 国信证券股份有限公司

注册地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层

法人代表人:何如

联系电话:0755-82130833

基金业务联系人:齐晓燕

联系电话:0755-82130833

传真:0755-82133302

全国统一客户服务电话:95536

公司网址: www.guosen.com.cn

(16) 海通证券股份有限公司

地址:上海市广东路689号海通证券大厦

法定代表人:王开国

客户服务电话:021-95553或4008888001

联系人:李笑鸣

网址:www.htsec.com

(17)申银万国证券股份有限公司

注册地址:上海市常熟路171号

办公地址:上海市常熟路171号

法定代表人:储晓明

联系人:邓寒冰

联系电话:021-54033888

传真:021-54035333

客服电话:021-962505

网址:www.sywg.com.cn

(18)中国银河证券股份有限公司

注册地址:北京市西城区金融大街35 号国际企业大厦C 座

办公地址:北京市西城区金融大街35 号国际企业大厦C 座

法定代表人:陈有安

联系人:田薇

联系电话:010-66568047

客户服务电话:4008-888-888

网站:www.chinastock.com.cn

(19)国泰君安证券股份有限公司

注册地址:上海市浦东新区商城路618号

办公地址:上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼

法定代表人:万建华

联系人:芮敏祺

电话:021-62580818-213

客户服务热线:4008888666

(20) 华福证券有限责任公司

注册地址:福建省福州市五四路157号新天地大厦7、8层

办公地址:福建省福州市五四路157号新天地大厦7至10层

法定代表人:黄金琳

联系人:张鹏

联系电话:0591-87383623

业务传真:0591-87383610

统一客户服务电话:96326(福建省外请先拨0591)。

公司网址:www.hfzq.com.cn

(21) 西藏同信证券有限责任公司

注册地址:拉萨市北京中路101号

办公地址:上海市永和路118弄24号

法定代表人:贾绍君

统一客户服务电话:4008811177

(22) 光大证券股份有限公司

注册地址:上海市静安区新闸路1508号(200040)

法定代表人:徐浩明

联系人:刘晨、李芳芳

电话: 021-22169999

传真: 021-22169134

客户服务电话: 4008888788、10108998

公司网址: www.ebscn.com

(23) 安信证券股份有限公司

注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元

办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元

深圳市福田区深南大道凤凰大厦1栋9层

法定代表人:牛冠兴

联系人:陈剑虹

联系电话:0755-82825551

客服电话:4008001001

公司网站:www.essence.com.cn

(24) 齐鲁证券有限公司

注册地址:山东省济南市经十路20518号

办公地址:山东省济南市经七路86号

法定代表人:李玮

联系人:吴阳

电话:0531-81283938

传真:0531-81283900

客服电话:95538

网址:www.qlzq.com.cn

(25) 长江证券股份有限公司

注册地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人:胡运钊

客户服务热线:95579或4008-888-999

联系人:李良

电话:027-65799999

传真:027-85481900

长江证券客户服务网站:www.95579.com

(26) 东方证券股份有限公司

注册地址:上海市中山南路318号2号楼22层-29层

办公地址:上海市中山南路318号2号楼22层-29层

法定代表人:潘鑫军

联系人:吴宇

联系电话:021-63325888

客服电话:95503

公司网站:www.dfzq.com.cn

(27) 平安证券有限责任公司

注册地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼

办公地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼(518048)

法定代表人:杨宇翔

全国免费业务咨询电话:4008816168

开放式基金业务传真:0755-82400862

全国统一总机:4008866338

联系人:周璐 (zhoulu002@pingan.com.cn,0755-22626172)

网址: www.pingan.com

(28)华泰证券股份有限公司

注册地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦

办公地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦

法定代表人:吴万善

客服电话:95597

(29)天相投资顾问有限公司

注册地址:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701

办公地址:北京市西城区金融街5号新盛大厦B座4层

法定代表人:林义相

客服电话: 010-66045678

联系人:林爽

联系电话:010-66045608

传真: 010-66045500

天相投顾网址: http://www.txsec.com

天相基金网网址:http://jijin.txsec.com

(30)信达证券股份有限公司

注册地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人:张志刚

联系人:唐静

联系电话:010-63081000

传真:010-63080978

客服电话:400-800-8899

公司网址:www.cindasc.com

(31)宏源证券股份有限公司

注册地址:新疆维吾尔自治区乌鲁木齐市建设路2号

办公地址:北京市西城区太平桥大街19号

法定代表人:冯戎

客服电话:4008-000-562

网址:www.hysec.com

(32)广发证券股份有限公司

法定代表人:林治海

注册地址:广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼(4301-4316房)

办公地址:广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼

联系人:黄岚

统一客户服务热线:95575或致电各地营业网点

开放式基金业务传真:(020)87555305

公司网站:广发证券网 www.gf.com.cn

(33)长城证券有限责任公司

注册地址:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦16-17层

办公地址:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦16-17层

法定代表人:黄耀华

客服电话:400-6666-888

公司网址:www.cgws.com

2.场内发售机构

双盈B办理场内认购业务的发售机构为具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员(具体名单详见基金份额发售公告或相关业务公告)。尚未取得相应业务资格,但属于深圳证券交易所会员的其他机构,可在本基金上市后,代理投资者通过深圳证券交易所交易系统参与本基金的上市交易。

基金管理人可根据有关法律、法规的要求,增加其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。

(二)注册登记机构

名称:中国证券登记结算有限责任公司

住所:北京西城区金融大街27 号投资广场23 层

法定代表人:金颖

办公地址:北京市西城区太平桥大街17号

联系电话:010-66210988

传真:010-66210938

联系人:朱立元

(三)出具法律意见书的律师事务所

名称:上海市通力律师事务所

注册地址:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19楼

负责人:韩炯

经办律师:吕红、安冬

电话:021-31358666

传真:021-31358600

联系人:安冬

(四)审计基金财产的会计师事务所

名称:毕马威华振会计师事务所

注册地址:北京市东长安街1号东方广场东二办公楼八层

办公地址:北京市东长安街1号东方广场东二办公楼八层

法人代表:萧伟强

经办注册会计师:王国蓓、黄小熠

电话:8621 2212 2888

传真:8621 6288 1889

联系人:王国蓓

四、基金的名称

信诚双盈分级债券型证券投资基金

五、基金的类型

债券型

六、基金份额分级

(一)基金份额结构

基金合同生效之日起3年内,本基金的基金份额分为双盈A份额和双盈B份额,所募集的基金资产合并运作。

(二)基金份额配比及上限

本基金募集设立时,双盈A和双盈B的份额配比为7:3,具体控制措施详见发售公告。

基金合同生效之日起3年内,双盈A的份额余额上限原则上不超过35亿份,双盈B的份额余额上限原则上不超过15亿份,并且双盈A余额原则上不多于双盈B余额的三分之七倍。具体规模限制及控制措施详见发售公告以及基金管理人届时发布的相关公告。

(三)双盈A的运作

1、约定收益

双盈A根据基金合同的规定获取约定收益,年约定收益率将在每个开放日设定并公告,计算公式如下:

双盈A的年约定收益率(单利)= 一年期银行定期存款利率(税后)+ 1.5%

其中计算双盈A的年约定收益率的一年期银行定期存款利率(税后)是指在基金合同生效日或双盈A的每个开放日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币一年期整存整取基准年利率(税后)。在双盈A的每个开放日,基金管理人将根据该日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币一年期整存整取基准年利率重新设定双盈A的年约定收益率。双盈A的年约定收益率计算按照四舍五入的方法保留到小数点后2位。

双盈A持有人需按照基金合同、招募说明书的约定支付赎回费。双盈A的约定收益率为费前收益率。

基金管理人并不承诺或保证双盈A的约定收益,在基金资产出现极端损失的情况下,双盈A的基金份额持有人可能会面临无法取得约定收益甚至损失本金的风险。

2、双盈A的开放日

基金合同生效之日起3年内,双盈A自基金合同生效之日起每满6个月开放一次,接受投资人的申购与赎回,但在第六个开放日仅开放赎回, 不开放申购。双盈A的开放日为自基金合同生效之日起每满6个月的最后一个工作日。因不可抗力或其他情形致使双盈A无法按时开放申购与赎回的,其开放日为该影响因素消除之日的下一个工作日。

双盈A的第一个开放日为基金合同生效之日起至满6个月的最后一个工作日; 双盈A的第二个开放日为自基金合同生效之日起至满12个月的最后一个工作日;双盈A的第三个开放日为自基金合同生效之日起至满18个月的最后一个工作日;依此类推。

例如:若基金合同生效日为2011年9月9日(周五),则基金合同生效后每满6个月、满12个月、满18个月的日期分别为2012年3月8日、2012年9月8日、2013年3月8日,依此类推。假设2012年3月8日(周四)为工作日,则双盈A的第一个开放日为2012年3月8日;假设2012年9月8日(周六)为非工作日,该日之前的最后一个工作日为2012年9月7日(周五),则双盈A的第二个开放日为2012年9月7日;假设2013年3月8日(周五)为工作日,则双盈A的第三个开放日为2013年3月8日;其他各个开放日的计算类同。

(四)双盈B的运作

1、剩余收益

本基金在扣除双盈A的应计收益后的全部剩余收益归双盈B享有,亏损以双盈B的资产净值为限由双盈B优先承担。

2、双盈B的开放日

基金合同生效之日起3年内,双盈B封闭运作,不开放申购和赎回。

3、双盈B的上市交易

基金合同生效之日起3年内,在双盈B符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下,双盈B将申请在深圳证券交易所上市交易。

(五)基金份额发售

在基金募集期内,双盈A和双盈B将分别通过各自销售机构的基金销售网点独立进行公开发售。

(六)本基金基金份额的净值计算

T日基金份额净值=T日闭市后的基金资产净值/T日基金份额的余额数量

基金合同生效之日起3年内,T日基金份额的余额数量为双盈A和双盈B的份额总额; 基金合同生效后3年期届满转为上市开放式基金(LOF)后,T日基金份额的余额数量为该上市开放式基金份额总额。

基金份额净值的计算,保留到小数点后3 位,小数点后第4 位四舍五入,由此产生的误差计入基金财产。

T日的基金份额净值在当天收市后计算,并在T+1日内公告。如遇特殊情况,经中国证监会同意,可以适当延迟计算或公告。

(七)双盈A和双盈B的基金份额参考净值计算

基金合同生效之日起3年内(包括基金合同生效后3年期届满日),基金管理人在计算基金资产净值的基础上,采用"虚拟清算"原则分别计算并公告双盈A和双盈B的基金份额参考净值。基金份额参考净值是对两级基金份额价值的一个估算,并不代表基金份额持有人可获得的实际价值。

1、双盈A的基金份额参考净值计算

[illegible]

(2)如果T日闭市后的基金资产净值小于 1.000乘以T日双盈A的份额余额加上T日全部双盈A份额应计收益之和",则

[illegible]

2、双盈B的基金份额参考净值计算

[illegible]

双盈A和双盈B的基金份额参考净值的计算均保留到小数点后3位,小数点后第4位四舍五入,由此误差产生的损失由基金财产承担,产生的收益归基金财产所有。

T 日的双盈A和双盈B的基金份额参考净值在当天收市后计算,并在T+1日内公告。如遇特殊情况,经中国证监会同意,可以适当延迟计算或公告。

(八)基金合同生效后3年期届满时的基金份额转换

基金合同生效后3年期届满,本基金将不再进行基金份额分级,并转换为上市开放式基金(LOF)份额。在份额转换基准日日终,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将以各自的基金份额参考净值为基准转换为上市开放式基金(LOF)份额,并办理基金的申购与赎回业务。

基金合同生效后3年期届满时的基金份额转换见招募说明书第十三部分及基金管理人届时发布的相关公告。

七、双盈A的基金份额折算

基金合同生效之日起3年内,双盈A将按照以下规则进行基金份额折算。

(一)折算基准日

基金合同生效之日起3年内,假设双盈A的开放日为T日,则折算基准日为T日,即双盈A的开放日和折算基准日为同一工作日。

(二)折算对象

折算基准日登记在册的所有双盈A。

(三)折算频率

基金合同生效之日起3年内,基金管理人将每6个月对双盈A进行基金份额折算。

(四)折算方式

在折算基准日日终,双盈A的基金份额参考净值将调整为1.000元,折算后基金份额持有人持有的双盈A的份额数将按照折算比例相应增减。

双盈A的基金份额折算公式如下:

双盈A的折算比例=折算基准日折算前的双盈A基金份额参考净值/1.000

双盈A经折算后的份额数=折算前双盈A的份额数x双盈A的折算比例

双盈A经折算后的份额数按照四舍五入的方法保留到小数点后2位,由此误差产生的损失由基金财产承担,产生的收益归基金财产所有。

在实施基金份额折算时,折算基准日折算前的双盈A基金份额参考净值和双盈A的折算比例的具体计算见基金管理人届时发布的相关公告。

(五)基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作,基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停双盈B 的上市交易等业务,具体见基金管理人届时发布的相关公告。

(六)基金份额折算的公告

1、基金份额折算方案须最迟于实施日前2日在至少一家指定媒体和基金管理人网站公告,并报中国证监会备案。

2、基金份额折算结束后,基金管理人应在2日内在至少一家指定媒体和基金管理人网站公告,并报中国证监会备案。

八、基金合同生效后3年期届满时的基金份额转换

(一)基金存续形式

基金合同生效后3年期届满,本基金无需召开基金份额持有人大会,自动转换为上市开放式基金(LOF),基金名称变更为"信诚信用添利债券型证券投资基金(LOF)"。在份额转换基准日日终,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将以各自的基金份额参考净值为基准转换为上市开放式基金(LOF)份额,并在基金合同生效后3年期届满日起的1个月内,开始办理基金的申购与赎回业务。

(二)基金份额转换前双盈A的处理方式

基金合同生效后3年内双盈A的最后一个开放日,基金份额持有人可将其持有的双盈A赎回。基金份额持有人若不赎回, 其持有的双盈A将在基金合同生效后3年期届满日被默认为转入"信诚信用添利债券型证券投资基金(LOF)"份额。

基金合同生效后3年期届满日为自基金合同生效之日起满3年的对应日。若该对应日为非工作日,则顺延至下一个工作日。

(三)基金份额转换的规则

1、份额转换基准日

基金合同生效后3年期届满日,即基金合同生效之日起满3年的对应日,若该对应日为非工作日,则顺延至下一个工作日。

2、份额转换方式

在份额转换基准日,本基金转换为上市开放式基金(LOF)后的基金份额净值为1.000元。

在份额转换基准日日终,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按照各自的基金份额参考净值转换为上市开放式基金(LOF)份额。

份额转换计算公式如下:

双盈A(或双盈B)的转换比率=份额转换基准日双盈A(或双盈B)的基金份额参考净值/1.000

双盈A(或双盈B)基金份额持有人持有的转换后上市开放式基金(LOF)份额=基金份额持有人持有的转换前双盈A(或双盈B)的份额数x双盈A(或双盈B)的转换比率

在实施基金份额转换时,双盈A(或双盈B)的转换比率、双盈A(或双盈B)基金份额持有人持有的转换后上市开放式基金(LOF)的具体计算见基金管理人届时发布的相关公告。

3、份额转换后的基金运作

本基金将在份额转换之日起不超过1个月的时间内办理申购与赎回。份额转换后本基金开始办理申购与赎回的具体日期见基金管理人届时发布的相关公告。

4、份额转换的公告

(1)基金合同生效后3年期届满时,本基金将转换为上市开放式基金(LOF),基金管理人将依照相关法律法规的规定就本基金进行基金份额转换的相关事宜进行公告,并报中国证监会备案;

(2)在基金合同生效后3年期届满日前30个工作日,基金管理人将就本基金进行基金份额转换的相关事宜进行提示性公告。

(3)双盈A和双盈B进行份额转换结束后,基金管理人应在2日内在至少一家指定媒体和基金管理人网站公告,并报中国证监会备案。

5、份额转换期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作,基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停双盈B 的上市交易等业务,具体见基金管理人届时发布的相关公告。

九、基金的投资目标

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。

十、投资范围和投资比例

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净值的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。

十一、投资策略

1、资产配置策略

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。

2、固定收益类资产的投资策略

(1)类属资产配置策略

在整体资产配置的基础上,本基金将通过考量不同类型固定收益品种的信用风险、市场风险、流动性风险、税收等因素,研究各投资品种的利差及其变化趋势,制定债券类属资产配置策略,以获取债券类属之间利差变化所带来的潜在收益。

(2)普通债券投资策略

对于普通债券,本基金将在严格控制目标久期及保证基金资产流动性的前提下,采用目标久期控制、期限结构配置、信用利差策略、流动性管理、相对价值配置等策略进行主动投资。

1)目