（上接B21版）

电话：021-63333389
网站：www.lingxianfund.com
客户服务电话：4000178000
（44）大泰金石基金销售有限公司
注册地址：南京市建邺区江东中路359号国睿大厦一号楼B区4楼A506室
办公地址：上海市长宁区虹桥路1386号文广大厦15楼
法定代表人：袁顾明
电话：021-22267995
传真：021-22268089
网站：www.dtfunds.com
客户服务电话：4009282266
（45）北京增财基金销售有限公司
注册地址：北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208室
办公地址：北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208室
法定代表人：罗细安
电话：010-67000988-6003
传真：010-67000988-6000
网址：www.zcvc.com.cn
客户服务电话：400-001-8811
（46）上海利得基金销售有限公司
注册地址：上海市宝山区蕴川路5475号1033室
办公地址：上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼
法定代表人：沈继伟
电话：021-50583533
传真：021-50583633
网址：http://a.leadfund.com.cn/
客户服务电话：400-067-6266
（47）上海好买基金销售有限公司
注册地址：上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号
办公地址：上海市浦东新区浦东南路 1118号903-906室
法定代表人：杨文斌
联系电话：021-20613999
传真：021-68596916
公司网址：www.howbuy.com
客服电话：400-700-9665
（48）上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册地址：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址：上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层
法定代表人：张跃伟
电话：021-20691832
传真：021-20691861
公司网站：www.erichfund.com
客服电话：400-089-1289
（49）深圳众禄基金销售股份有限公司
注册地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼801
办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼801
法定代表人：薛峰
联系电话：0755-33227950
传真：0755-33227951
公司网址：www.zlfund.cn
客服电话：4006-788-887
（50）上海云湾投资管理有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路27号13号楼2层
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路27号13号楼2层
法定代表人：王爱玲
电话：021-68783068
传真：021-20539999
官网网址：www.zhengtongfunds.com
客服电话：400-820-1515
（51）北京晟视天下投资管理有限公司
注册地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室
办公地址：北京市朝阳区朝外大街甲6号万通中心D座28层
法定代表人：蒋煜
联系电话：010-58170949
官网网址：www.shengshiview.com
客服电话：400-818-8866
（52）奕丰金融服务（深圳）有限公司
注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室
办公地址：深圳市南山区海德三路海岸大厦东座1115室，1116室及1307室
法定代表人：TAN YIK KUAN
联系电话：021-20567288
传真：0755-21674453
公司网址：www.ifastps.com.cn
客服电话：400-684-0500
（53）北京汇成基金销售有限公司
注册地址：北京市海淀区中关村大街11号1108
办公地址：北京市海淀区中关村大街11号1108
法定代表人：王伟刚
联系电话：010-56282140
公司传真：010-62680827
官网网址：www.fundzone.cn
客服电话：400-068-1176
（54）浙江金观诚财富管理有限公司
注册地址：杭州市拱墅区登云路45号（锦昌大厦）1幢10楼1001室
办公地址：杭州市拱墅区登云路45号锦昌大厦一楼金观诚财富
法定代表人：徐黎云
联系电话：0571-88337717
公司传真：0571-88337666
官网网址：www.jincheng-fund.com
客服电话：400-068-0058
（55）泰诚财富基金销售（大连）有限公司
注册地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
法定代表人：林卓
电话：0411-88891212
传真：0411-84396536
客服电话：4006411999
公司网站：www.taichengcaifu.com
（56）北京钱景财富投资管理有限公司
注册地址：北京市海淀区丹棱街丹棱SOHO 1008-1012
办公地址：北京市海淀区丹棱街丹棱SOHO 1008-1012
法定代表人：赵荣春
电话：010-59158281
传真：010-57569671
网址：www.qianjing.com
客户服务电话：400-893-6885
（57）一路财富信息科技有限公司
住所：北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208
办公地址：北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208
法定代表人：吴雪秀
客服电话：400 001 1566
网址：www.yilucaifu.com
（58）北京恒天明泽基金销售有限公司
注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路10号5层5122室
办公地址：北京市朝阳区亮马桥路39号第一上海中心C座6层
法定代表人：李悦
联系人：张晔
电话：010-56642602
网址：http://htmz.lhygcn.com/
（59）乾道金融信息服务（北京）有限公司
注册地址：北京市海淀区东北旺村南1号楼7层7117室
办公地址：北京市西城区德外大街合生财富广场1302室
法定代表人：王兴吉
电话：010-62062880
传真：010-82057741
官网网址：http://www.qiandaojr.com
客服电话：400-088-8080
（60）北京新浪仓石基金销售有限公司
注册地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室
办公地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室
法人代表：李昭琛
联系电话：010-82628888
公司传真：010-62676582
官网网址：www.xincai.com
客服电话：010-62675369
（61）上海基煜基金销售有限公司
注册地址：上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室（上海泰和经济发展区）
办公地址：上海市杨浦区昆明路518号A1002室
法定代表人：王翔
电话：021-65370077-220
传真：021-55085991
网址：www.jiyufund.com.cn
客户服务电话：021-65370077
（62）杭州科地瑞富基金销售有限公司
注册地址：杭州市下城区武林时代商务中心1604室
办公地址：杭州市下城区上塘路15号武林时代20F
法定代表人：陈刚
联系电话：0571-85267500
公司传真：0571-8526 9200
官网网址：www.cd121.com
客服电话：0571-86655920
（63）南京苏宁基金销售有限公司
注册地址：南京市玄武区苏宁大道1-5号
办公地址：南京市玄武区苏宁大道1-5号
法人代表：钱燕飞
联系人：王锋
联系电话：025-66996699-887226
传真：025-66008800-887226
官网网址：www.snjijin.com
客服电话：95177
（64）深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#
办公地址：北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦A座7层
法人代表：张彦
联系电话：010-83363101
公司传真：010-83363072
客服电话：400-166-1188
官网网址：http://8.jrj.com.cn/
（65）北京肯特瑞财富投资管理有限公司
注册地址：北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06
办公地址：北京市大兴区亦庄经济开发区科创十一街十八号院京东集团总部
法人代表：陈超
联系电话：010-89189285
公司传真：010-89189566
客服电话：个人业务：95118 企业业务：400 088 8816
官网网址：http://jr.jd.com
（66）北京广源达信基金销售有限公司
注册地址：北京市西城区新街口外大街28号C座六层605室
办公地址：北京市朝阳区望京东园四区13号楼浦项中心B座19层
法定代表人：齐剑辉
传真：010-82055860
官网网址：www.niuniufund.com
客服电话：400-6236-060
（67）深圳金斧子基金销售有限公司
注册地址：深圳市南山区粤海街道科苑路16号东方科技大厦18楼
办公地址：深圳市南山区粤海街道科苑路科兴科学园B3单元7楼
法定代表人：赖任军
电话：0755-66892301
传真：0755-66892399
公司官网：www.jfzinv.com
客服电话：400-950-0888
（68）上海朝阳永续基金销售有限公司
注册地址：上海浦东新区上丰路977号1幢B座812室
办公地址：上海市浦东新区碧波路690号4号楼2楼
法人代表：廖冰
联系电话：021-80234888
官网网址：www.998fund.com
客服电话：4009987172
（69）武汉市伯嘉基金销售有限公司
注册地址：武汉市江汉区中央商务区泛海国际SOHO城（一期）第七幢23层1号、4号
办公地址：武汉市江汉区中央商务区泛海国际SOHO城（一期）第七幢23层1号、4号
法人代表：陶捷
公司传真：027-87006010
客服电话：400-027-9899
官网网址：www.buyfunds.cn
（70）上海大智慧财富管理有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102、1103单元
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102、1103单元
法人代表：申健
联系电话：021-20219988
公司传真：021-20219988
客服电话：021-20292031
官网网址：http<//8.gw.com.cn
（71）厦门市鑫鼎盛控股有限公司
注册地址：厦门市思明区鹭江道2号第一广场15楼
办公地址：厦门市思明区鹭江道2号第一广场15楼
法人代表：陈洪生
联系人：陈泽智
联系电话：0592-3122673
客服电话：400-918-0808
公司官网：www.xds.com.cn
（72）北京电盈基金销售有限公司
注册地址：北京市朝阳区呼家楼（京广中心）1号楼36层3603室
办公地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦F座12B
法人代表：程刚
客服电话：400-100-3391
公司官网：www.bjdyfund.com
（73）北京格上富信基金销售有限公司
注册地址：北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室
办公地址：北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室
法定代表人：李悦章
电 话：010-85594745
传 真：010-85932427
客服电话：400-066-8586
官网网址：www.igesafe.com
（74）中民财富基金销售（上海）有限公司
注册地址：上海市黄浦区中山南路100号7层05单元
办公地址：上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼27层
法人代表：弭洪军
联系电话：021-33355392
公司传真：021-63353736
客服电话：400-876-5716
官网网址：www.cmiwm.com
（75）第一创业证券股份有限公司
办公地址：广东省深圳福田区福华一路115号投行大厦20楼
电话：0755-23838888
网址：https://www.firstcapital.com.cn/
客户服务电话：95358
（76）天津万家财富资产管理有限公司
注册地址：天津自贸区（中心商务区）迎宾大道1988号滨海浙商大厦公寓2-2413室
办公地址：北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦5层
法定代表人：李修辞
http://www.wanjiawealth.com
（77）济安财富（北京）资本管理有限公司
注所：北京市朝阳区东三环中路7号4号楼40层4601室
办公地址：北京市朝阳区东三环中路7号4号楼40层4601室
法定代表人：杨健
联系人：李海燕
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）基金注册登记机构
名称：中国证券登记结算有限责任公司
住所：北京市西城区太平桥大街17号
办公地址：北京西城区太平桥大街17 号
法定代表人：周明
电话：010-59378835
传真：010-59378839
联系人：朱立元
（三）出具法律意见书的律师事务所和经办律师
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：俞卫锋
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和经办注册会计师
名称：毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)
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
法定代表人：姚建华
电话：8621 2212 2888
传真：8621 6288 1889
联系人：王国蓓
经办注册会计师：王国蓓、黄小熠
**四、基金的名称**
信诚双盈债券型证券投资基金（LOF）
**五、基金的类型**
契约型。
基金合同生效之日起3年内，双盈A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，本基金将不再进行基金份额分级。
**六、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。
**七、基金的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“信诚双盈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%。其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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。
**八、基金的投资策略**
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。
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）目标久期控制
本基金基金合同生效起3年内，将根据分级基金的剩余运作期限以及宏观经济因素（包含消费物价指数、固定资产投资、工业品价格指数、货币供应量等）与不同种类债券收益率之间的数量关系，确定债券组合的久期。
转换后的“信诚双盈债券型证券投资基金（LOF）”在制定目标久期时，将首先建立包含消费物价指数、固定资产投资、工业品价格指数、货币供应量等众多宏观经济因素的回归模型。通过回归分析建立宏观经济指标与不同种类债券收益率之间的数量关系，在此基础上结合当前市场状况，预测未来市场利率及不同期限债券收益率走势变化，确定目标久期。
2）期限结构配置
在确定债券组合的目标久期之后，本基金将通过对央行政策、经济增长率、通货膨胀率等众多因素的分析来预测收益率曲线形状的可能变化（在基金合同生效的前3年内，本基金将同时对双盈A在开放日的净赎回进行预测分析）；在上述基础上，本基金将运用子弹型、哑铃型或梯形等配置方法，确定短、中、长期债券的配置比例。
3）信用利差策略
信用债券的收益率主要由基准收益率与反应信用债券信用水平的信用利差组成。
基准收益率由宏观经济因素及市场资金状况等决定。本基金将从宏观经济环境与市场供需状况两个方面对市场整体信用利差进行分析。首先，对于宏观经济环境，当宏观经济向好时，企业盈利能力好，资金充裕，市场整体信用利差将可能收窄；当宏观经济恶化时，企业盈利能力差，资金紧缺，市场整体信用利差将可能扩大。其次，对于市场供给，本基金将从市场容量、信用债结构及流动性等几方面进行分析。
而信用利差受市场整体信用水平、个券信用影响。本基金通过公司内部债券信用评级体系，对债券发行人的公司治理结构、融资能力、抗风险能力、经营状况等进行综合评估，确定发行人的信用风险及债券的信用级别。
4）流动性管理策略
在基金合同生效起的前3年内，本基金对流动性进行积极管理以应对：a、双盈A每6个月开放时可能的净赎回；b、双盈分级3年到期时转开放时可能的净赎回。在预期份额持有人净赎回比例较高时，本基金将采用持续滚动投资方法，将回购或债券的到期日进行均衡等量配置，以应对大量赎回产生的流动性需求。本基金将通过发行量、前一个月日均成交量、前一个月的交易频率、买卖价差、剩余到期期限等指标甄别个券的流动性。
5）相对价值配置
本基金将对市场上同类债券的收益率、久期、信用度、流动性等指标进行比较，寻找其他指标相同而某一指标相对更具有投资价值的债券，并进行投资。
（3）可转换债券的投资策略
对于可转换债券，本基金采用期权定价模型等数量化估值工具，选择基础股票基本面优良的可转换债券，从可转换债券的内在债券价值（如票面利息、利息补偿及无条件回售价格）、保护条款的适用范围、期权价值的大小、基础股票的质地和成长性、基础股票的流通性等方面进行研究，评定其投资价值并以合理价格买入并持有，充分享受股票的长期增长潜力和债券的安全收入优势，并积极寻找各种套利机会，以获取更高的投资收益。本基金持有的可转换债券可以转换为股票。
（4）资产支持证券的投资策略
对于资产支持证券，本基金将综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成和质量等因素，研究资产支持证券的收益和风险匹配情况，采用数量化的定价模型跟踪债券的价格走势，在严格控制投资风险的基础上选择合适的投资对象以获得稳定收益。
3、新股申购策略
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。
4、其他金融工具的投资策略
如法律法规或监管机构以后允许基金投资于其他衍生金融工具，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，通过对标的品种的基本面研究，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。
在符合法律、法规相关限制的前提下，基金管理人按谨慎原则确定本基金衍生工具的总风险暴露。
**九、基金的业绩比较基准**
本基金的业绩比较基准：中证综合债指数收益率
**十、基金的风险收益特征**
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。
**十一、基金投资组合报告（未经审计）**
本基金管理人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，并对本报告内容的真实性、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基金合同的约定，于2018年4月20日复核了本招募说明书中的投资组合报告，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
本投资组合报告的财务数据截止至2018年3月31日。
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 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 固定收益投资 | 2,813,672,957.95 | 97.62 |
| | 其中：债券 | 2,813,672,957.95 | 97.62 |
| | 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 | 2,500,000.00 | 0.09 |
| | 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 | 15,750,419.98 | 0.55 |
| 7 | 其他资产 | 50,402,095.36 | 1.75 |
| 8 | 合计 | 2,882,325,473.29 | 100.00 |

2.报告期末按行业分类的股票投资组合
1)报告期末按行业分类的境内股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。
2)报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别 | 公允价值（人民币） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|
| - | - | - |
| 合计 | - | - |

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。
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
本基金本报告期末未持有股票。
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 | 11,001,100.00 | 0.50 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 470,604,505.62 | 21.39 |
| | 其中：政策性金融债 | 428,566,804.40 | 19.48 |
| 4 | 企业债券 | 727,992,834.30 | 33.09 |
| 5 | 企业短期融资券 | 1,135,984,000.00 | 51.63 |
| 6 | 中期票据 | 151,145,000.00 | 6.87 |
| 7 | 可转债 | 84,038,518.03 | 3.82 |
| 8 | 同业存单 | 232,907,000.00 | 10.59 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 2,813,672,957.95 | 127.89 |

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 | 170206 | 17国开06 | 1,200,000 | 117,684,000.00 | 5.35 |
| 2 | 112353 | 16TCL02 | 1,150,000 | 109,997,500.00 | 5.00 |
| 3 | 112352 | 16TCL01 | 1,100,000 | 108,097,000.00 | 4.91 |
| 4 | 011754166 | 17新希望SCP002 | 1,000,000 | 100,450,000.00 | 4.57 |
| 5 | 011754182 | 17徐工SCP006 | 1,000,000 | 100,420,000.00 | 4.56 |

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。
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。
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。
9.报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
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。
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。
10.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
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。
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。
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。
11.投资组合报告附注
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。
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。
3)其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 30,920.19 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 50,371,175.17 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 50,402,095.36 |

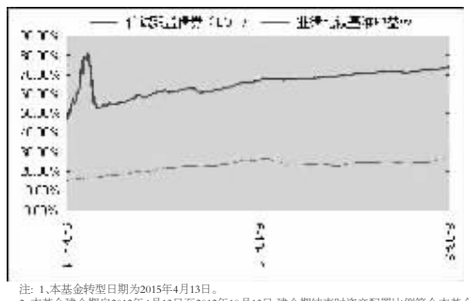
4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 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 | 128016 | 雨虹转债 | 23,931,711.09 | 1.09 |
| 2 | 110032 | 三一转债 | 1,151,800.00 | 0.05 |
| 3 | 113011 | 光大转债 | 1,084,800.00 | 0.05 |

5)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末未持有股票,不存在流通受限的情况。
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。
**十二、基金的业绩**
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招募说明书。基金业绩数据截至2018年3月31日。
（一）基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 2012年4月13日至2012年12月31日 | 9.42% | 0.15% | 2.98% | 0.04% | 6.44% | 0.11% |
| 2013年1月1日至2013年12月31日 | 4.98% | 0.19% | 1.78% | 0.05% | 3.20% | 0.14% |
| 2014年1月1日至2014年12月31日 | 21.31% | 0.37% | 9.41% | 0.16% | 11.90% | 0.21% |
| 2015年1月1日至2015年12月31日 | 15.84% | 0.71% | 6.16% | 0.07% | 9.68% | 0.64% |
| 2016年1月1日至2016年12月31日 | 3.87% | 0.08% | 2.12% | 0.08% | 1.75% | 0.00% |
| 2017年1月1日至2017年12月31日 | 2.29% | 0.05% | 0.28% | 0.05% | 2.01% | 0.00% |
| 2018年1月1日至2018年3月31日 | 1.58% | 0.07% | 2.03% | 0.04% | -0.45% | 0.03% |
| 2012年4月13日至2018年3月31日 | 74.21% | 0.34% | 27.20% | 0.08% | 47.01% | 0.26% |

（二）基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金转型日期为2015年4月13日。
2、本基金建仓期自2012年4月13日至2012年10月13日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。
3、自2015年10月1日起,本基金的业绩比较基准由“中信标普全债指数收益率”变更为“中证综合债指数收益率”。
**十三、费用概览**
(一)与基金运作有关的费用
1. 基金费用的种类
1）基金管理人的管理费；
2）基金托管人的托管费；
3）双盈A的销售服务费；
4）因基金的证券交易或结算而产生的费用；
5）基金合同生效以后的信息披露费用；
6）基金份额持有人大会费用；
7）基金合同生效以后的会计师费和律师费；
8）基金资产的资金汇划费用；
9）基金上市初费和上市月费；
10）账户开户费和账户维护费；
11）按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。
2. 基金费用计提方法、计提标准和支付方式
1）基金管理人的管理费
在基金合同生效之日起3年内或基金合同生效后3年期届满转为上市开放式基金（LOF）后，基金管理人的基金管理费均按基金资产净值的0.7%年费率计提。
在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的0.7%年费率计提。计算方法如下：
H＝E×0.7%÷当年天数
H 为每日应计提的基金管理费
E 为前一日基金资产净值
基金管理费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。
2）基金托管人的基金托管费
在基金合同生效之日起3年内或基金合同生效后3年期届满转为上市开放式基金（LOF）后，基金托管人的基金托管费均按基金资产净值的0.20%年费率计提。
在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.20%年费率计提。计算方法如下：
H＝E×0.20%÷当年天数
H 为每日应计提的基金托管费
E 为前一日的基金资产净值
基金托管费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。
3）基金合同生效之日起3年内双盈A的销售服务费
基金合同生效之日起3年内，双盈A的年销售服务费率为0.35%，双盈B不收取销售服务费。
销售服务费用于支付销售机构佣金、基金的营销费用以及基金份额持有人服务费等。
双盈A的销售服务费按前一日双盈A资产净值的0.35%年费率计提。计算方法如下：
H＝E×0.35%÷当年天数
H 为双盈A每日应计提的销售服务费
E 为双盈A前一日资产净值
双盈A销售服务费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给注册登记机构，由注册登记机构代付给销售机构，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。
基金合同生效后3年期届满自动转换为“信诚双盈债券型证券投资基金（LOF）”后，不再收取销售服务费。
4）本条第1款第4至第11项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。
3、不列入基金运作费用的项目
本条第1款约定以外的其他费用，以及基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失等不列入基金费用。
(二)与基金销售有关的费用
1、本基金申购费率最高不超过申购金额的5%，赎回费率最高不超过赎回金额的5%，其中对持续持有期少于7日的投资者收取不低于1.5%的赎回费。
2、本基金申购费率按照申购金额递减，即申购金额越大，所适用的申购费率越低。本基金的场外申购费率如下表所示：

| 单笔申购金额（M：申购金额；单位：元） | 费率 |
|---|---|
| M＜100万 | 0.8% |
| 100万≤M＜200万 | 0.5% |
| 200万≤M＜500万 | 0.3% |
| M≥500万 | 1000元/笔 |

场内申购费率由基金代销机构参照场外申购费率执行。
投资人在一天之内如有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。当需要采取比例配售方式对有效申购金额进行部分确认时，投资人申购费率按照申购申请确认金额所对应的费率计算，申购申请确认金额不受申购最低限额的限制。
3、本基金的赎回费率按照持有时间递减，即相关基金份额持有时间越长，所适用的赎回费率越低。本基金的场外赎回费率如下表所示：

| 持有时间（Y：持有时间） | 场外赎回费率 |
|---|---|
| Y＜7天 | 1.5% |
| 7天≤Y＜180天 | 0.1% |
| Y≥180天 | 0 |

由场内转托管至场外的基金份额，从场外赎回时，其持有期限从转托管至场外之日开始计算。由双盈A和双盈B转换而来的基金份额，其持有期限按照双盈A和双盈B的认购或申购确认日开始计算。
本基金的场内赎回费率为固定值0.10%，对于持续持有期少于7日的赎回费率为1.50%。
4. 基金管理人可以在法律法规和本基金合同规定范围内调低申购费率和赎回费率。费率如发生变更，基金管理人应在调整实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在至少一种指定媒介上公告。
**十四、对招募说明书更新部分的说明**
本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“运作办法”）、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其它有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对原《信诚双盈债券型证券投资基金（LOF）招募说明书》进行了更新，主要更新的内容如下：
1.在“重要提示”部分更新了相应日期，并增加了基金管理人名称变更的相关信息。
2.在“一、绪言”中，增加了《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》作为招募说明书编写依据。
3.在“二、释义”中，增加了对“《流动性风险管理规定》”、“流动性受限资产”的释义。
4.在“三、基金管理人”中的“主要人员情况”部分，更新了相关成员的内容。
5.在“四、基金托管人”部分，更新了托管人的有关信息。
6.在“五、相关服务机构”部分，根据实际情况对销售机构的相关信息进行了更新。
7.在“十一、基金份额的申购、赎回”部分，根据《流动性风险管理规定》更新了“4、申购与赎回的程序” “5、申购与赎回的费用及其用途” “7、巨额赎回的认定及处理方式” “8、拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理”等部分的相关内容。
8.在“十四、基金的投资”部分，根据《流动性风险管理规定》更新了“（二）投资范围和投资比例”“（七）投资禁止行为与限制”等部分相关内容，并更新了“（十）基金投资组合报告”，财务数据截止至2018年3月31日。
9.在“十五、基金的业绩”部分，更新了该节的内容，数据截止至2018年3月31日。
10.根据《流动性风险管理规定》，在“十八、基金资产估值”中更新了“（六）暂停估值的情形”的相关情形内容，在“二十二、基金的信息披露”中增加了“定期报告”、“临时报告”中需要披露的相关内容，并更新了“二十三、风险揭示”中流动性风险的相关内容。
11.在“二十七、对基金份额持有人的服务”部分，删除了寄送对账单及资讯刊物的相关内容。
12.在“二十八、其他应披露事项”部分，披露了自2017年10月14日以来涉及本基金的相关公告。

**中信保诚基金管理有限公司**
**2018年5月28日**

（上接B21版）

4.本授权委托书（样本）中“委托人证件号码”，指基金份额持有人认购或申购本基金时的证件号码或该证件号码的更新。
5.如本次持有人大会权益登记日，投资者未持有本基金的基金份额，则其授权无效。

附件三：
信诚永鑫一年定期开放混合型证券投资基金
基金份额持有人大会表决票

| | | | |
|---|---|---|---|
| 基金份额持有人姓名或名称： | | | |
| 证件号码(身份证件号/营业执照号) | | | |
| | | | |
| 审议事项 | 同意 | 反对 | 弃权 |
| 关于终止信诚永鑫一年定期开放混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案 | | | |
| 基金份额持有人（或受托人、代理人）签名或盖章<br>年 月 日 | | | |

说明：
请以打“√”方式在审议事项后注明表决意见。持有人必须选择一种且只能选择一种表决意见。表决意见代表基金份额持有人所持全部基金份额的表决意见。表决意见未选、表决意见模糊不清或相互矛盾的表决票（但其他各项符合会议通知规定的）均视为投票人放弃表决权利，其所持全部基金份额的表决结果均计为“弃权”。签名或盖章部分填写不完整、不清晰的表决票计为无效表决票。

附件四：
**关于终止信诚永鑫一年定期开放混合型证券投资基金基金合同有关事项议案的说明**
信诚永鑫一年定期开放混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金合同生效日为2017年2月24日，基金管理人为中信保诚基金管理有限公司，基金托管人为中信银行股份有限公司（以下简称“中信银行”）。鉴于市场环境的变化，为保护基金份额持有人利益，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《信诚永鑫一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）有关规定，经基金管理人与基金托管人中信银行协商一致，提议终止《基金合同》。
本次终止《基金合同》方案应当经参加基金份额持有人大会的基金份额持有 人（或其代理人）所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方为有效，因此存在无法获得相关基金份额持有人大会表决通过的可能。
基金份额持有人大会的决议，本基金管理人应当自通过之日起5日内报中国证监会备案。基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效，并在生效后方可执行。法律法规另有规定的，从其规定。
一、终止《基金合同》方案要点
1、基金份额持有人大会决议生效并公告前的基金运作
在通过《关于终止信诚永鑫一年定期开放混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》的基金份额持有人大会决议生效并公告前，本基金份额按照《基金合同》约定的运作方式进行运作。
2、基金财产清算
（1）通过《关于终止信诚永鑫一年定期开放混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》的基金份额持有人大会决议自本次基金份额持有人大会表决通过之日起生效。基金管理人将自决议生效之日起2个工作日内在指定媒介公告。
（2）自基金份额持有人大会决议生效并公告之日起，本基金即进入清算程序。本基金进入清算程序后，停止收取基金管理费、基金托管费和销售服务费。
基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人据此落实相关事项，并授权基金管理人可根据实际情况做相应调整。具体安排详见基金管理人届时发布的相关公告。
（3）基金管理人组