

信诚全球商品主题证券投资基金（LOF）招募说明书摘要

(2014年第1次更新)

Commodity Total Return Index)。七、基金的风险收益特征

本基金主要投资全球商品类基金,商品价格具有较高的波动性,因此,本基金属于较高预期风险和较高预期收益的证券投资基金品种。

八、投资策略

1.组合投资比例限制

(1)本基金持有同一机构发行的存款不得超过基金净值的20%。在托管账户的存款可以不受上述限制。

(2)本基金持有同一机构政府、国际金融组织除外发行的证券市值(不包括ETF)不得超过基金净值的10%。

(3)本基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产(不包括ETF)不得超过基金资产净值的10%,其中,持有一国或地区发行的证券资产(不包括ETF)不得超过该证券资产净值的3%。

(4)不得购买证券(不包括ETF)用于控制或影响发行该证券的机构或其管理层。本基金管理人管理的全部基金不得持有同一机构10%以上具有投票权的证券发行总额。

前项投资比例限制应当合并计算同一机构境内外的总股本,同时应当一并计算全球存托凭证和美国存托凭证所代表的基础证券,并假设对持有的股本权证行使转换。

(5)本基金持有非流动性资产市值不得超过基金净值的10%。

前项非流动性资产是指法律法规基金合同约定规定的流通受限证券以及中国证监会认定的其他资产。本基金管理人管理的全部基金持有同一只境外基金,不得超过该境外基金总规模的20%。

(7)本基金应投资于资产减值、交易清算等临时用途现金的比例不得超过该基金资产净值的10%,应付赎回、交易清算等临时用途现金规定的期限有限。

2.海外资产配置

(1)除货币类基金投资比例不超过本基金基金资产净值的20%。本基金投资境外市场的,除货币类基金投资比例外,还应遵守以下规定:

(1)其他基金资产;

(2)联接基金(A Feeder Fund);

(3)投资于前述两项基金的非货币类基金;

3.金融衍生品投资

本基金投资金融衍生品应当仅限于投资组合避险或有效管理,不得用于投机或放大交易,同时应当严格遵守下列规定:

(1)本基金的金融衍生品头寸不得超过基金资产净值的100%。

(2)本基金投资期货支付的初始保证金、投资期货支付或收取的保证金、投资期货台交易衍生品支付的初始保证金总额不得高于基金资产净值的10%。

(3)本基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品,应当符合以下要求:

(1)所有参与交易对手方(中资商业银行除外)应当具有不低于中国证监会认可的信用评级评级;

(2)交易对手方应当至少每个工作日对交易进行估值,并且基金可在任何时候以公允价值终止交易;

(3)任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的20%。

(4)本基金不得直接投资于实物商品和金融衍生品。

4.证券借贷交易

本基金可以参与证券借贷交易,并且应当遵守下列规定:

(1)所有参与交易对手方(中资商业银行除外)应当具有中国证监会认可的信用评级机构评级;

(2)应当采取市值计价制度调整以确保担保物市值不低于已借出证券市值的102%。

(3)借方应当在交易期内及时向本基金支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红。一旦借方违约,本基金根据协议有权处置担保物以弥补全部损失。

(4)参与证券借贷交易,所有已借出但未归还证券总市值不得超过基金总资产的50%。

上述比例限制计算,基金因参与证券借贷交易而持有的担保物不得计入基金总资产。

5.证券回购交易

本基金可以根据正常市场惯例参与正回购交易、逆回购交易,并且应当遵守下列规定:

(1)所有参与证券回购交易对手方(中资商业银行除外)应当具有中国证监会认可的信用评级机构信用评级;

(2)参与回购交易,应当采取市值计价制度对卖出收益进行调整以确保现金不低于已借出证券市值的102%。一旦买卖违约,本基金根据协议有权处置有保留担保物以弥补全部损失。

(3)基金参与正回购交易,所有已借出而未回购证券总市值不得超过基金总资产的50%。

上述比例限制计算,基金因参与正回购交易而持有的现金不得计入基金总资产。

九、基金的投资组合报告(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约定,于2013年10月18日复核了本报告投资中的投资组合报告数据与信息,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述。

本报告组合报告的报告期为2013年7月1日至2013年9月30日。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	1,274,493.40	14.81
2	固定收益	1,274,493.40	14.81
3	银行存款	7,109,625.33	82.38
4	其他资产	6,619,911.87	76.92
5	应收利息	17,096.65	0.20
6	其他应收款	12,310.66	0.14
7	其他	691,470.07	8.01
8	待摊费用	20,811.68	0.24
9	合计	8,666,690.83	100.00

2、报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票资产分布

国家/地区	公允价值(人民币元)	占基金总资产比例(%)
中国内地	780,538.40	9.00
香港	495,954.91	5.72
合计	1,276,493.31	14.72

3、报告期末按行业分类的股票资产分布

行业名称	公允价值(人民币元)	占基金总资产比例(%)
医药生物	862,855.81	4.51
食品饮料	228,689.23	2.62
公用事业	155,501.63	1.78
农林牧渔	148,621.23	1.70
交通运输	147,696.65	1.69
计算机	117,096.65	1.34
其他	59,865.23	0.68
合计	20,811.68	0.24
合计	1,274,493.40	14.81

4、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资产持仓

序号	公司名称(中文)	公司简称(中文)	证券代码	所在证券市场	股票数量(股)	公允价值(人民币元)	占基金总资产比例(%)
1	REGO US	瑞格公司	REGO US	美国	5,100	210,900.71	2.62
2	ABX US	阿克斯公司	ABX US	美国	1,300	148,814.49	1.85
3	MINI HONGKONG	中国香港	1988 HK	香港	11,000	95,848.76	1.19
4	ANHUI KONCH	安徽康达	0914 HK	中国香港	4,500	88,581.00	1.10
5	NY INC	纽约	NY US	美国	300	86,283.03	1.07
6	WALAT	华乐	2333 HK	中国香港	2,500	83,350.46	1.04
7	MINI HONGKONG	中国香港	1988 HK	香港	34,000	73,863.77	0.92
8	WENGLI HONGKONG	香港	2098 HK	中国香港	20,000	72,151.17	0.90
9	CHINA TIANHUANG	天煌	1798 HK	中国香港	61,000	71,096.65	0.88
10	DONG RENG TANG-H	东菱	8869 HK	中国香港	3,000	59,865.23	0.74

5、报告期末按信用评级等级分类的债券投资组合

6、报告期末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组合

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十名资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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金融衍生品投资

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

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指期货持仓

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(元)	占基金总资产比例
1	POWERSHARES DOW JONES INDUSTRIAL	ETF基金	契约型 开放式	DRISCHKE BANK AG	1,477,087.74	18.36
2	IBERDROLA ENERGI	ETF基金	契约型 开放式	DEUTSCHE BANK AG	1,471,588.28	18.29
3	UNITED STATES BURENT	ETF基金	契约型 开放式	UNITED STATES COMMODITIES	1,462,397.71	18.18
4	UNITED STATES OF AMERICA FUND	ETF基金	契约型 开放式	FUND L.L.C.	815,590.67	10.14
5	POWERSHARES RUSSELL 2000	ETF基金	契约型 开放式	PENNY FUND INC.	489,233.25	6.08
6	POWERSHARES S&P 500	ETF基金	契约型 开放式	POWERSHARES	414,124.16	5.11
7	UNITED STATES HEATING	ETF基金	契约型 开放式	UNITED STATES	276,371.49	3.44
8	POWERSHARES 10+Y	ETF基金	契约型 开放式	DEUTSCHE BANK AG	216,213.86	2.69
9	POWERSHARES MSCI WORLD	ETF基金	契约型 开放式	DEUTSCHE BANK AG	15,814.26	0.20

(4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券品种

(5)报告期末持有的处于转股期的可转换债券

(6)报告期末持有的处于转股期的可转换债券

(7)报告期末持有的处于转股期的可转换债券

(8)报告期末持有的处于转股期的可转换债券

(9)报告期末持有的处于转股期的可转换债券

(10)报告期末持有的处于转股期的可转换债券

(11)报告期末持有的处于转股期的可转换债券

(12)报告期末持有的处于转股期的可转换债券

(13)报告期末持有的处于转股期的可转换债券

(14)报告期末持有的处于转股期的可转换债券

(15)报告期末持有的处于转股期的可转换债券

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

十、基金的业绩

本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预示其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应先仔细阅读招募说明书。基金业绩数据截至2013年9月30日。

(一)基金业绩归因增长率与同期业绩比较基准收益比较表

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
2012年	-15.30%	0.62%	0.08%	1.07%	-15.38%	-0.45%
2013年1月1日至2013年9月30日	-7.79%	0.61%	-5.41%	0.74%	-2.3800%	-0.1300%
2013年9月1日至2013年9月30日	-7.91%	0.62%	-0.89%	0.75%	-7.0200%	-0.1000%
2013年9月1日至2013年9月30日	-22.00%	0.61%	3.25%	0.95%	-25.25%	-0.34%

(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、本基金建仓日期2011年12月20日至2012年6月20日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金合同约定。

2、本基金建仓自2011年12月20日至2012年6月20日,建仓日结束时资产配置比例符合本基金合同约定。

十一、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:上海市虹口区东大名路501号上海国金中心汇丰银行大楼9层

办公地址:上海市虹口区东大名路501号上海国金中心汇丰银行大楼9层

法定代表人:张琦

成立时间: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)68649788

联系人:林军

股权结构:

股东	出资额(万人民币)	出资比例(%)
中信银行有限责任公司	9800	49
中国华能集团有限公司	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

张琦女士,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,中信银行总行营业部副总经理,中信证券有限公司副总经理,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总经理。

陈一松先生,董事,金融硕士学位。历任中信实业银行资金科科长,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兼总裁,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。现任中信银行有限责任公司总经理。

李学勤先生,董事,研究生。历任招商银行证券业务部市场代表,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部二部总经理,中信证券股份有限公司信托资产管理部总经理,中信银行有限公司投资银行部二部总经理。现任中信银行有限公司副行长。

Graham David Mason先生,董事,南非籍,保险精算专业士。历任南非非寿险基金经理,南非Norwich公司基金经理,英国保诚集团(南非)执行董事,现任瀚亚投资执行副董事长。

黄耀女士,董事,新加坡籍,经济学士。历任花旗银行消费金融事业部业务副理,新加坡大华银行市场部副理,华资资产管理公司营销经理,瀚亚投资(中国)有限公司总经理,瀚亚投资(台湾)有限公司市场总监。现任瀚亚投资(中国)有限公司总经理。

郑煜女士,董事,新加坡籍,工商管理硕士。历任新加坡金融管理局市场业务发展副经理处长,现任瀚亚投资(新加坡)有限公司督察长。

何旭先生,董事,经济学博士。历任中国科学院研究所处长,研究员助理。现任中国社会科学院数量经济与技术经济研究所处长,金融研究所主任。

魏东先生,独立董事,管理学博士。历任财政部政府科学研究中心主任,中国建设银行总行国际部副处长,安永华明会计师事务所董事,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首席合伙人。

杨晓玲先生,独立董事,经济学博士。历任中国社会科学院财经战略研究所副研究员,现任清华大学中国经济研究中心副主任。

李莹女士,监事会主席,金融硕士学位。历任中国建设银行银监办处一级调研员,中国建设银行总行分行中间业务部总经理助理,北京证券资产管理部高级项目经理,上海浦东发展银行总行中间业务部总经理助理,四川工业园区银谷投资管理有限公司总经理,现任苏州工业园区控股股份有限公司财务总监。

陈宇女士,监事,经济学硕士。历任北京兴银银行上海分行运营管理部主任、通用电气金融财务(中国)有限公司人力资源经理。现任信诚基金管理有限公司首席人力资源官。

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副部长,天治基金管理有限公司合规稽核部总监助理。现任信诚基金管理有限公司合规稽核部长。

注:原“美国保诚集团亚太区总部基金业务部”自2012年1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

王峻峰先生,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部总监,瀚亚投资(香港)有限公司北京市场部总监,瀚亚投资(中国)有限公司总经理。现任信诚基金管理有限公司总经理,首席执行长,兼任中信信诚资产管理有限公司(信诚基金管理有限公司之子公司)董事。

黄贞,副总经理,经济学硕士。历任申银万国证券公司产品部执行经理,银华基金管理有限公司行业研究员,投资管理部综合经理,基金经理,华宝兴业基金管理有限公司副总经理,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,信诚优质精选股票型证券投资基金基金经理。

刘明先生,副总经理,工商管理硕士。历任交通银行资产管理部高级产品经理,中开资产管理咨询有限公司财务总监,德国德意志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。

林文女士,副总经理,经济学硕士。历任浙江省证券公司投资银行部副总经理、市场部总监,国信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助理总经理、助理总监,汇添富基金管理有限公司市场部总监、副总经理,交银施罗德基金管理有限公司总经理助理、市场部总监。现任信诚基金管理有限公司副总经理、首席市场官。

陶晓纯先生,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部总监、首席市场官、首席运营官。现任信诚基金管理有限公司,兼任中信信诚资产管理有限公司总经理。3.督察长

唐伟春先生,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合规总监,稽核总监,稽核部基金资产管理部合规稽核部总监,总经理助理兼稽核部负责人。现任信诚基金管理有限公司督察长,兼任中信信诚资产管理有限公司董事。

李静文,台湾国立成功大学会计研究所硕士。历任台湾宝来证券投资部资源部研究员,环球市场资源部研究员,期货信托基金部经理。现任信诚基金管理有限公司基金经理。

刘明先生,电机工程师。历任国信基金管理有限公司境外运营部经理、台湾证券期货交易所股份有限公司基金经理、金鑫华安证券投资信托股份有限公司基金经理,新嘉坡证券投资信托股份有限公司基金经理,永昌证券投资信托股份有限公司基金经理。现任信诚基金管理有限公司海外投资总监、信诚全球商品主题证券投资基金(LOF)和信诚金砖四国积极配置证券投资基金(LOF)的基金经理。

6.ODI投资决策委员会成员

王峻峰先生,副总经理,首席投资官,股票投资总监;

王福顺先生,副总经理,股票投资总监;

胡皓女士,特定资产投资管理总监,研究总监;

胡皓女士,特定资产投资总监;

刘明先生,海外投资总监。

上述人员之间不存在近亲属关系。

十二、费用概览

(一)与基金运作有关的费用

1.基金管理人的管理费;

2.托管人的托管费;

3.基金上市费用及年费;

4.基金的证券交易费用、投资银行所发生的费用及在境外市场的开户、交易、清算、登记等实际发生的费用;

5.基金合理分配及兑付的信息披露费用;

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以及其他为基金利益而产生的中介费用;

8.基金的资金划转费用;

9.外汇兑换交易的相关费用;

10.与基金资产缴纳纳税有关的手续费、汇款费等;

11.基金管理人按照法律法规应缴纳的,购买或处置证券有关的任何税收、证券交易、印花税、交易及其他税费和其他费用,以及与前述各项有关的任何利息、股息及费用;

12.按照国家和有关约定可以列支的其他费用。

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

基金管理费按日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起10个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

(2)基金托管人的托管费

基金托管人的基金托管费(如基金托管人委托境外托管人,包括向其支付的相应服务)按基金资产净值的0.3%年费率计提。

在通常情况下,基金资产净值前一日基金资产净值的0.3%年费率计提。计算方法如下:

H = E × 0.3% × 当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起10个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。