

信诚薪金宝货币基金招募说明书摘要

(2015年第1次更新)

基金管理人:信诚基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司

重要提示

本基金于2014年5月14日基金合同正式生效。
投资有风险,投资者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2015年5月14日,有关财务数据和净值表现截止日为2015年3月31日(未经审计)。

一、基金管理人
(一)基金管理人概况
名称: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
设立日期: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
组织形式:有限责任公司
注册资本:2亿元人民币
存续期间:持续经营
电话:(021)68649788
联系人:林军
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	9000	49
英国保诚集团控股有限公司	9000	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、基金管理人董事会成员
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、中信控股有限责任公司副总经。现任中国中信集团有限公司业务协同部主任、中信信托有限责任公司董事、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)监事。

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助办主任、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办公室副主任、中信信托有限责任公司总经理。现任中信信托有限责任公司董事长。

包学勤先生,董事,新加坡,经济学博士。历任招商银行证券业务部市代表、南方证券有限公司投资银行部总经理助理、国信证券股份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助理、中信信托有限责任公司业务协同部主任、中信信托有限责任公司董事、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)监事。

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。现任瀚亚投资执行副董事长。

黄慧敏女士,董事,新加坡,经济学学士。历任花旗银行消费金融事业部业务副理、新加坡大华银行业务开发副理、华资产管理公司营销企划经理、瀚亚投资(新加坡)有限公司营销部主管、瀚亚投资(台湾)有限公司市场总监。现任瀚亚投资(台湾)有限公司总经理。

魏秀彬女士,董事,新加坡,工商管理硕士。历任施罗德国际商业银行东南亚区域合规经理、施罗德投资管理(新加坡)有限公司亚太地区风险及合规总监。现任瀚亚投资首席风险官。

何德旭先生,独立董事,经济学博士。历任中国社会科学院财经经济研究所副所长、研究员,中国社会科学院数量经济与技术经济研究所副所长、金融研究所中心副主任等职。现任中国社会科学院金融研究所副所长、研究员、博士生导师。

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经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。

注:原“英国保诚集团亚洲区总部基金管理服务”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、基金管理人监事会成员
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、北京证券投资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咨询有限公司副总经理、苏州元禾控股股份有限公司财务总监。现任苏州元禾控股有限公司副总裁。

於乐女士,监事,经济学硕士。历任日本兴业银行上海分行营业管理部主管、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。

3、高级管理人员情况
吕涛先生,总经理,工商管理硕士。历任中信证券股份有限公司资产管理部总经理、中信基金管理有限公司(中信证券股份有限公司的全资子公司,2009年2月已与华夏基金管理有限公司合并)总经理、中信证券股份有限公司董事总经理、中信资产管理有限公司副总经理。现任信诚基金管理有限公司总经理、首席执行官。

桂思毅先生,副总经理,工商管理硕士。历任安达信咨询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,德国德累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。历任浙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。

隋晓伟先生,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、首席运营官。现任信诚基金管理有限公司副总经理、兼任中信信诚资产管理有限公司董事、总经理。

4、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,兼任中信信诚资产管理有限公司董事。

5、基金经理
张倩女士,工商管理学硕士。2003年7月至2007年4月曾任职于申银万国证券股份有限公司,担任固定收益部交易员;2008年11月至2013年4月于信诚基金管理有限公司担任交易员,现任信诚货币市场证券投资基金、信诚理财7日盈债券型证券投资基金、信诚薪金宝货币市场基金及信诚3个月理财债券型证券投资基金的基金经理。

6、投资决策委员会成员
胡皓女士,副首席投资官、特定资产投资管理总监;
王旭巍先生,副首席投资官;
董越先生,交易总监;
张光成先生,股票投资副总监;
王睿先生,研究副总监、基金经理。
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:中信银行股份有限公司(简称“中信银行”)
住所:北京东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
办公地址:北京东城区朝阳门北大街9号东方文化大厦北楼
法定代表人:常振明
成立时间:1987年4月7日
组织形式:股份有限公司
注册资本:467.873亿元人民币
存续期间:持续经营
批准设立文号:中华人民共和国国务院办公厅国办函[1987]114号
基金托管业务批准文号:中国证监会证监基金字[2004]125号
联系人:中信银行资产管理部
联系电话:010-89936330
传真:010-85230024
客服电话:95558
网址:bank.citic.com
经营范围:吸收公众存款;发放短期、中期和长期贷款;办理国内外结算;办理票据承兑与贴现;发行金融债券;代理发行、代理兑付、承销政府债券;买卖政府债券、金融债券;从事银行同业拆借;买卖、代理买卖外汇;从事银行卡业务;提供信用证服务及担保;代理收付款项;提供保管箱服务;结汇、售汇业务;经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。
中信银行(601998.SH,00988.HK)成立于1987年,原名中国中信实业银行,是中国改革开放中最早设立的新兴商业银行之一,是中国最早参与国际金融市场融资的商业银行,并以股份制中国现代金融史上多个第一而蜚声海内外。伴随中国经济的快速发展,中信实业银行在中国金融市场化改革的大潮中逐渐成长壮

大,于2006年8月,正式更名“中信银行”。2006年12月,以中国中信集团和中信国际金融控股有限公司为股东,正式成立中信银行股份有限公司。同年,成功引进战略投资者,与欧洲领先的西班牙对外银行(BBVA)建立了优势互补的战略合作关系。2007年4月27日,中信银行在上海交易所和香港联合交易所成功同步上市。2008年,中信银行成功收购中信国际金融控股有限公司(简称:中信国金)70.32%股权。经过二十多年的发展,中信银行已成为中国资本实力最雄厚的商业银行之一,是一家快速增长并具有强大综合竞争力的全国性商业银行。

2009年,中信银行通过了美国SAS70内部控制审计并获得无保留意见的SAS70审计报告,表明了独立公正第三方对中信银行托管服务运作流程的风险管理和内部控制的健康有效性全面认可。

(二)主要人员情况
李庆萍,行长,高级经济师。1984年8月至2007年1月,任中国农业银行总行国际业务部干部、副处长、处长、副总经理、总经理。2007年1月至2008年12月,任中国农业银行广西分行党委书记、行长。2009年1月至2009年5月,任中国农业银行零售业务总监兼个人业务部、个人信贷业务部总经理。2009年5月至2013年9月,任中国农业银行总行零售业务总监兼个人金融部总经理。2013年9月至2014年7月,任中国中信股份有限公司副总经理。2014年7月,任中国中信股份有限公司副总经理、中信银行行长。

苏国新先生,中信银行副行长,分管托管业务。曾担任中信集团办公厅副主任,同时兼任中信集团董事长及中信银行董事长秘书。1997年6月开始担任中信集团董事长秘书。1991年8月至1993年10月,在中国外交部工作。1993年10月至1997年5月在中信集团负责外事工作。1996年1月至1997年1月,在瑞士银行SBC和瑞士联合银行UBS等金融机构工作。

刘泽云先生,现任中信银行股份有限公司资产托管部总经理,经济学博士。1996年8月进入本行工作,历任总行行长秘书室科长、总行投资银行部处经理、总行资产保全部主管、总行国际业务部总经理助理、副总经理、副总经理(主持工作)。

(三)基金托管业务经营情况
2004年8月18日,中信银行经中国证券监督管理委员会和中国银行业监督管理委员会批准,取得基金托管人资格。中信银行本着“诚实信用、勤勉尽责”的原则,切实履行托管人职责。

截至2015年11月31日,中信银行已托管52只开放式证券投资基金及证券公司资产管理产品、信托产品、企业年金、股权基金、QDII等其他托管资产,托管总资产规模3.5万亿元人民币。

三、相关服务机构
(一)基金发售机构
1)中信银行
注册地址:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
办公地址: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:常振明
客服电话:95558
传真:010-66594946
电话:010-66594977
网址:www.citic.com

(2)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
联系人:钱慧
电话:021-68649788
网址:http://www.citicprufunds.com.cn或www.xcfunds.com

重要提示:本基金目前仅开通直销柜台业务,网上直销业务暂不开通。

(二)登记机构
名称: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
联系人:金琴泉
电话:021-68649788
网址:http://www.xcfunds.com.cn/

(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:黎明、孙睿
电话:021-31358666
传真:021-31358600
联系人:俞伟敏
经办注册会计师:薛竟、俞伟敏

四、基金名称
信诚薪金宝货币市场基金
五、基金类型
契约型开放式
六、基金的投资目标
本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,力争获得超越业绩比较基准的投资收益率

七、基金的投资范围
本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具,包括现金,通知存款,短期融资券,一年以内(含一年)的银行定期存款,大额存单,期限在一年以内(含一年)的债券回购,期限在一年以内(含一年)的中央银行票据,剩余期限在397天以内(含397天)的债券、资产支持证券、中期票据,以及中国证监会及/或中国人民银行认可的其他具有良好流动性的金融工具。
法律法规或监管机构允许基金投资其他基金的,在不改变基金投资目标、不改变基金风险收益特征的前提下,本基金可参与其他货币市场基金的投资。基金投资其他货币市场基金的比例不超过基金资产的30%。
未来若法律法规或监管机构允许基金投资同业存单的,本基金可参与同业存单的投资。

如果法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他品种,基金管理人将在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

八、基金的投资策略
本基金将综合考虑各类投资品种的收益性、流动性和风险特征,在保证基金资产的安全性和流动性的基础上力争为投资者创造稳定的收益。同时,通过对国内外宏观经济走势、货币政策和财政政策的研究,结合对市场利率变动的预期,进行积极的投资组合管理。

1、整体资产配置策略
整体资产配置策略主要体现在:1)根据宏观经济形势、央行货币政策、短期资金市场状况等因素对短期利率走势进行综合判断;2)根据前述判断形成的利率预期动态调整基金投资组合的平均剩余期限。
(1)利率预期分析
通过对通货膨胀率、GDP增长率、货币供应量、国际利率水平、汇率、政策取向等因素分析,形成对基本面的宏观研判。同时,结合微观层面研究,主要考察指标包括:央行公开市场操作、主流机构投资者的短期投资倾向、债券供给、债券市场与资本金市场互动等,合理预期市场利率由线动态变化,据此决定整体资产配置策略。

(2)动态调整投资组合平均剩余期限
结合利率预期分析,合理运用利率模型,动态确定并控制投资组合平均剩余期限在120天以内,以规避较长长期限债券的利率风险。当市场利率看涨时,适度缩短投资组合平均剩余期限,即减持剩余期限较长投资品种增持剩余期限较短品种,降低组合整体净值损失风险;当市场看跌时,则相对延长投资组合平均剩余期限,增持较长剩余期限的投资品种,获取超额收益。

2、类属配置策略
类属配置指组合在各类短期金融工具如央行票据、国债、金融债、企业短期融资券以及现金等投资品种之间的配置比例。作为现管理工具,货币市场基金类属配置策略主要实现两个目标:一是通过类属配置满足基金流动性需求,二是通过类属配置获得投资收益。从流动性的角度来说,基金管理人需对市场资金面、基金申购赎回金额的变化进行动态分析,以确定本基金的低资产性目标。在此基础上,基金管理人将高流动性资产和相对流动性较低资产之间寻找平衡,以满足组合的日常流动性需求;从收益性角度来看,基金管理人将通过分析各类属的相对收益、利差变化、流动性风险、信用风险等因素来确定类属配置比例。从流动性的角度来说,基金管理人需对低估值、价格将上升的,能给组合带来相对较高回报的类属;减持相对高估、价格将下降的,给组合带来相对较低回报的类属,借以取得较高的总回报。

3、个券选择策略
在个券选择层面,本基金将首先从安全性角度出发,优先选择央票、短期国债等高信用等级品种以回避信用违约风险。对于外部信用评级等级较高(符合法规规定的级别)的企业债、短期融资券等信用类债券,本基金也可以进行配置。除考虑安全性因素外,在具体品种的个券选择上,基金管理人将在正确拟合收益率曲线的基础上,找出收益率出现明显偏高的券种,并客观分析收益率出现偏高的原因。若出现因市场原因所导致的收益率高于公允水平,则该券种价格出现低估,本基金将对此类低估值品种进行重点关注。此外,鉴于收益率曲线可以判断出定价偏高或偏低的期限段,从而指导相对价值投资,这也可以帮助基金管理人选择投资于定价低估的短期债券品种。

4、现金流管理策略
本基金作为现金管理工具,必须具备较高的流动性。基金管理人将密切关

注基金的申购赎回情况、季节性资金流动情况和日历效应等因素,对投资组合的现金比例进行动态化管理。基金管理人将在遵循流动性优先的原则下,综合平衡基金资产在流动性资产和收益性资产之间的配置比例,通过现金留存、持有高流动性券种、正向回购、降低组合久期等方式提高基金资产整体的流动性,也可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,以满足日常的基金资产变现需求。

5、套利策略
由于市场环境差异、交易市场分割、市场参与者差异,以及资金供求失衡导致的中短期利率异常差异,使得债券现券市场上存在着套利机会。本基金通过分析货币市场变动趋势、各市场和品种之间的风险收益差异,把握无风险套利机会,包括银行间和交易所市场出现的跨市场套利机会、在充分论证套利可行性的基础上的跨期限套利等。无风险套利主要包括银行间市场、交易所市场的跨市场套利和同一交易市场中不同品种的跨品种套利。基金管理人将在保证基金的安全性和流动性的前提下,适当参与市场的套利,捕捉和把握无风险套利机会,进行跨市场、跨品种操作,以期获得安全的超额收益。

九、基金的业绩比较基准
本基金的业绩比较基准:活期存款利率(税后)
十、基金的风险收益特征
本基金为货币市场基金,是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

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法律责任。
基金托管人中信银行股份有限公司根据基金合同的约定,于2015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。

本报告投资组合报告的财务数据截止至2015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	固定收益投资	2,798,063,932.36	19.89
	其中:债券	2,798,063,932.36	19.89
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	388,602,142.00	2.77
	其中:买断式回购融资	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	10,670,369,394.53	76.33
4	其他资产	188,729,746.06	1.37
5	合计	14,004,345,187.06	100.00

2. 报告期末债券回购融资情况		
序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期末债券回购融资余额	0.03
	其中:买断式回购融资	-
序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	529,599,215.60
	其中:买断式回购融资	3.93

注:报告期末债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明
在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

3.基金投资组合平均剩余期限
1)投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	78
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	83
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	69

注:本基金合同约定,本基金管理人将动态确定并控制投资组合平均剩余期限在120天以内,以规避较长长期限债券的利率风险。

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明
本基金本报告期内,未出现投资组合平均剩余期限超过120天情况。
2)报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	26.64	3.93
2	30天(含)-60天	-	-
3	60天(含)-90天	12.63	-
4	90天(含)-180天	42.00	-
5	180天(含)-397天(含)	-	-
6	397天以上	0.66	-
7	合计	102.89	3.93

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	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	790,383,273.76	5.79
4	其中:政策性金融债	790,383,273.76	5.79
5	企业债券	-	-
6	企业中期融资券	2,006,670,658.00	14.89
7	中期票据	-	-
8	其他	-	-
9	合计	2,798,063,932.36	20.69
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券面值(元)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	041402062	14国债(国)001	1,500,000	149,874,766.79	1.11
2	140207	14国债(7)	1,400,000	140,008,522.77	1.04
3	140210	14国债(10)	1,200,000	120,076,046.62	0.89
4	041470001	14广佛铁路债	1,000,000	100,000,022.72	0.74
5	140444	14农发债4	900,000	90,184,333.93	0.67
6	140212	14国债(12)	900,000	90,061,342.23	0.67
7	140213	14国债(13)	900,000	90,022,569.36	0.67
8	041602011	16鲁农发债(01)	800,000	79,970,842.89	0.59
9	041500009	15城投债(09)	600,000	60,004,068.08	0.45
10	041469034	14豫农发债(3)	600,000	60,000,069.03	0.45

6、“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离程度
报告期内偏离度的绝对值在0.25%-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.0097%
报告期内偏离度的最低值	0.0271%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0278%

7.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。

8.投资组合报告附注
1)基金计价方法说明
本基金估值采用“摊余成本法”,即估值对象以买入成本列示,按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价,在剩余存续期内平均摊销,每日计提损益。

2) 本报告期内,本基金不存在持有到期的剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值20%的情况。

3) 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现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、处罚的情形。

信诚基金管理有限公司关于调整旗下部分基金所持停牌股票估值方法的提示性公告

根据中国证监会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》(【2008】38号文),并参照《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》(以下简称“《参考方法》”),信诚基金管理有限公司(以下简称“本公司”)自2008年9月起,采用中国证券业协会基金估值工作小组提供的关于停牌股票估值的参考方法,对所管理的基金持有的长期停牌股票的成本公允价值进行估值。

经与托管人协商一致,自2015年6月19日起,本公司对旗下证券投资基金持有的停牌股票“云南铜业(证券代码:000878)”、“新界泵业(证券代码:002532)”和“康力电梯(证券代码:002367)”、“好莱客(证券代码:603898)”和“骏轮股份(证券代码:601311)”采用“指数收益法”进行估值。待上述股票交易恢复活跃市场交易特征后,将恢复采用当日收盘价格进行估值,届时不再另行公告。

本公司旗下基金将严格按照《企业会计准则》、指导意见、中国证监会相关法规和基金合同中关于估值的约定对基金所持有的投资品种进行估值,请广大投资者关注。

投资者可登陆基金管理人网站(www.xcfunds.com)或拨打客户服务电话400-666-0066咨询有关信息。

特此公告。

信诚基金管理有限公司
2015年6月20日

信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同生效公告

公告送出日期:2015年6月20日

1 公告基本信息	
基金名称	信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)
基金运作方式	契约型开放式
基金代码	160206
基金管理人名称	信诚基金管理有限公司
基金托管人名称	交通银行股份有限公司
公告日期	2015年6月20日

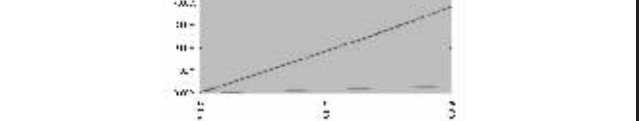
4) 其他资产构成		
序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	--
2	应收证券清算款	10,467,771.23
3	应收利息	148,261,976.63
4	应收申购款	--
5	其他应收款	--
6	待摊费用	--
7	其他	--

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2015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	净值收益率①	业绩比较基准收益率②	净值比较基准收益率标准差③	①-③	②-④
2014年5月14日至2014年12月31日	2.6946%	0.0022%	0.2225%	0.0000%	2.4721%
2015年1月1日至2015年3月31日	1.1125%	0.0006%	0.0863%	0.0000%	1.0262%
2014年5月14日至2015年3月31日	3.8717%	0.0019%	0.3088%	0.0000%	3.8698%

(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、基金合同生效日起至本报告期末不满一年(本基金合同生效日为2014年5月14日)。
2、本基金建仓日自2014年5月14日至2014年11月14日,建仓日结束时资产配置比例符合本基金基金合同约定。

十三、费用概览
(一)与基金运作有关费用
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) 销售服务费;

4)《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
5)《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;
6)基金份额持有人大会费用;
7)基金的证券交易费用;
8)基金的银行汇划费用;
9)按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。
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
本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.33%年费率计提。管理费的计算方法如下:
H=E×年管理费率÷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,逐日累计至每个月月末,按月支付。经基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,由基金托管人复核后于次月前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、公休假等,支付日期顺延。
2) 基金托管人的托管