信诚中证基建工程指数分级证券投资基金招募说明书

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

重要提示

信诚中证基建工程指数分级证券投资基金经2015年5月12日中国证监会证监许可[2015] 892号文准予募集注册。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同和其他有关法律法规规定募集,并经中国证监会注册。中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的投资价值、收益和市场前景做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

本基金投资于证券市场,基金份额净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资者根据所持有的基金份额享受基金收益,同时承担相应的投资风险。投资人在投资本基金前,需充分了解本基金的产品特性,并承担基金投资中出现的各类风险,包括:因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险,基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险,本基金的指数投资风险、杠杆机制风险、折/溢价交易风险、以及份额配对转换及基金份额折算等业务办理过程中的特定风险等。本基金为跟踪指数的股票型基金,具有较高预期风险、较高预期收益的特征,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。从本基金所分离的两类基金份额来看,信诚基建A份额具有预期风险、预期收益较低的特征;信诚基建B份额具有预期风险、预期收益较高的特征。投资人在进行投资决策前,请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

基金管理人建议投资人根据自身的风险收益偏好,选择适合自己的基金产品,并且中长期持有。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

基金管理人提醒投资者基金投资的"买者自负"原则,在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行负责。

第一部分 绪言

《信诚中证基建工程指数分级证券投资基金招募说明书》(以下简称"招募说明书"或"本招募说明书")依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称 "《基金法》")、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称 "《销售办法》")、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称 "《运作办法》")、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称"《信息披露办法》")及其他有关法律法规与《信诚中证基建工程指数分级证券投资基金基金合同》(以下简称"基金合同")编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息,或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写,并经中国证监会注册。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》、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。

第二部分 释义

本招募说明书中,除非文意另有所指,下列词语或简称具有如下含义:

1、基金或本基金:指信诚中证基建工程指数分级证券投资基金

2、基金管理人:指信诚基金管理有限公司

3、基金托管人:指中国银行股份有限公司

4、基金合同:指《信诚中证基建工程指数分级证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充

5、托管协议:指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《信诚中证基建工程指数分级证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

6、招募说明书或本招募说明书:指《信诚中证基建工程指数分级证券投资基金招募说明书》及其定期的更新

7、基金份额发售公告:指《信诚中证基建工程指数分级证券投资基金基金份额发售公告》

8、上市交易公告书:指《信诚中证基建工程指数分级证券投资基金之信诚基建A份额与信诚基建B份额上市交易公告书》

9、法律法规:指中国(为本合同之目的,不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区)现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等

10、《基金法》:指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过,2012年12月28日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订,自2013年6月1日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订

11、《销售办法》:指中国证监会2013年3月15日颁布、同年6月1日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

12、《信息披露办法》:指中国证监会2004年6月8日颁布、同年7月1日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

13、《运作办法》:指中国证监会2014年7月7日颁布、同年8月8日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

14、中国证监会:指中国证券监督管理委员会

15、银行业监督管理机构:指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会

16、基金份额分级:指本基金的基金份额包括信诚中证基建工程指数分级证券投资基金之基础份额、信诚中证基建工程指数分级证券投资基金之A份额与信诚中证基建工程指数分级证券投资基金之B份额。其中,信诚中证基建工程指数分级证券投资基金之A份额与信诚中证基建工程指数分级证券投资基金之B份额的基金份额配比始终保持1:1的比例不变

17、信诚基建份额:指信诚中证基建工程指数分级证券投资基金之基础份额

18、信诚基建A份额:指本基金份额按基金合同约定规则所分离的预期风险、预期收益较低的子份额

19、信诚基建B份额:指本基金份额按基金合同约定规则所分离的预期风险、预期收益较高的子份额

20、基金合同当事人:指受基金合同约束,根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体,包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人

21、个人投资者:指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

22、机构投资者:指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

23、合格境外机构投资者:指符合现时有效的相关法律法规规定可投资于中国境内证券市场的中国境外的机构投资者

24、投资人:指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称

25、基金份额持有人:指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

26、基金销售业务:指基金管理人或销售机构宣传推介基金,发售基金份额,办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务

27、销售机构:指信诚基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件,取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议,代为办理基金销售业务的机构,以及可通过深圳证券交易所交易系统办理基金销售业务的会员单位

28、场外:通过深圳证券交易所交易系统以外的销售机构利用其自身柜台或其他交易系统办理本基金基金份额的认购、申购和赎回的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购和赎回也称为场外认购、场外申购和场外赎回

29、场内:通过具有相应业务资格的深圳证券交易所会员单位利用深圳证券交易所交易系统办理本基金基金份额的认购、申购、赎回和上市交易的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购、赎回也称为场内认购、场内申购、场内赎回

30、登记业务:指基金登记、存管、过户、清算和结算业务,具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等

31、登记机构:指办理登记业务的机构。基金的登记机构为信诚基金管理有限公司或接受信诚基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构,本基金的登记机构为中国证券登记结算有限责任公司

32、登记结算系统:指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统,通过场外销售机构认购、申购的基金份额登记在登记结算系统

33、证券登记系统:指中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记系统,通过场内会员单位认购、申购或买入的基金份额登记在证券登记系统

34、开放式基金账户:指投资人通过场外销售机构在中国证券登记结算有限责任公司注册的开放式基金账户,用于记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户

35、基金交易账户:指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构买卖基金的基金份额变动及结余情况的账户

36、深圳证券账户:指在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开设的深圳证券交易所人民币普通股票账户或证券投资基金账户;基金投资者通过深证证券交易所交易系统办理基金交易、场内认购、场内申购和场内赎回等业务时需持有深圳证券账户。记录在该账户下的基金份额登记在登记机构的证券登记系统

37、基金合同生效日:指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件,基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕,并获得中国证监会书面确认的日期

38、基金合同终止日:指基金合同规定的基金合同终止事由出现后,基金财产清算完毕,清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期

39、基金募集期:指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间,最长不得超过三个月

40、存续期:指基金合同生效至终止之间的不定期期限

41、工作日:指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

42、T日:指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的工作日

43、T+n日:指自T日起第n个工作日(不包含T日)

44、开放日:指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

45、交易时间:指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

46、认购:指在基金募集期内,投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

47、申购:指基金合同生效后,投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

48、赎回:指基金合同生效后,基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为

49、份额配对转换:指根据基金合同的约定,本基金的信诚基建份额与信诚基建A份额、信诚基建B份额之间的配对转换,包括分拆与合并两个方面

50、分拆:指根据基金合同的约定,基金份额持有人将其持有的每两份信诚基建份额的场内份额申请转换成一份信诚基建A份额与一份信诚基建B份额的行为

51、合并:指根据基金合同的约定,基金份额持有人将其持有的每一份信诚基建A份额与一份信诚基建B份额进行配对申请转换成两份信诚基建份额的场内份额的行为

52、会员单位:指具有基金销售业务资格、并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的、可通过深圳证券交易所交易系统办理本基金销售业务的深圳证券交易所会员单位

53、日常交易:指场外申购和赎回、转换等场外基金交易,以及场内申购和赎回、转换及上市交易等场内基金交易

54、上市交易:指基金合同生效后投资人通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖基金份额的行为

55、基金转换:指基金份额持有人按照基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件,申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的行为

56、转托管:指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作,转托管包括系统内转托管和跨系统转托管

57、系统内转托管:指基金份额持有人将持有的基金份额在登记结算系统内不同销售机构(网点)之间或证券登记系统内不同会员单位(交易单元)之间进行转托管的行为

58、跨系统转托管:指基金份额持有人将持有的基金份额在登记结算系统和证券登记系统间进行转托管的行为

59、定期定额投资计划:指投资人通过有关销售机构提出申请,约定每期申购日、扣款金额及扣款方式,由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及受理基金申购申请的一种投资方式

60、巨额赎回:指本基金单个开放日,信诚基建份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过上一开放日基金总份额(包括信诚基建份额、信诚基建A份额和信诚基建B份额)的10%

61、元:指人民币元

62、基金收益:指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约

63、基金资产总值:指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和

64、基金资产净值:指基金资产总值减去基金负债后的价值

65、基金份额净值:指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

66、基金资产估值:指计算评估基金资产和负债的价值,以确定基金资产净值和基金份额净值的过程

67、固定收益品种:指在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所及中国证监会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的国债、中央银行债、政策性银行债、短期融资券、中期票据、企业债、公司债、商业银行金融债、可转换债券、证券公司短期债、资产支持证券、同业存单等债券品种

68、指定媒介:指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒介

69、标的指数:指中证基建工程指数

70、第三方估值机构:指中央国债登记结算有限责任公司和中证指数有限公司或者在法律法规允许的情况下,基金管理人和基金托管人经协商一致后确定的其他估值机构

71、不可抗力:指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件。

第三部分 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

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: 贰亿元人民币

电话: (021)68649788

联系人: 唐世春

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、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、中信控股有限责任公司副总裁。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、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,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。

Guy Robert STRAPP先生,董事,商科学士。历任瀚亚投资(香港)有限公司首席执行官,英国保诚集团亚洲区资产管理业务投资总裁、瀚亚投资(新加坡)有限公司首席执行官。现任瀚亚投资集团首席执行官兼瀚亚投资(香港)有限公司首席执行官。

黄慧敏女士,董事,新加坡籍,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、大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,新加坡籍,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贸经济研究所副所长、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。

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、监事

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、经营管理层人员情况

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。

唐世春先生,副总经理,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;信诚基金管理有限公司督察长兼董事会秘书、中信信诚资产管理有限公司董事。现任信诚基金管理有限公司副总经理、首席市场官,代为履行督察长职务。

隋晓炜先生,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,副总经理、首席市场官,代为履行督察长职务。

5、基金经理

杨旭先生,哥伦比亚大学数学金融硕士、运筹管理学硕士,纽约大学化学硕士。曾担任美国对冲基金Robust methods公司数量分析师,华尔街对冲基金WSFA Group公司助理基金经理,该基金为股票多空型对冲基金。2012年8月加入信诚基金,曾分别担任助理投资经理、专户投资经理。现任信诚中证500指数分级基金、信诚沪深300指数分级基金、信诚中证800医药指数分级基金、信诚中证800有色指数分级基金、信诚中证800金融指数分级基金、信诚中证TMT产业主题指数分级基金、信诚中证信息安全指数分级基金、信诚中证智能家居指数分级基金、信诚新选回报灵活配置混合基金、信诚新旺回报灵活配置混合基金(LOF)的基金经理的基金经理。

6、投资决策委员会成员

胡喆女士,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、投资经理。

上述人员之间不存在近亲属关系。

三、基金管理人的职责

1、依法募集资金,办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;

2、办理基金备案手续;

3、自《基金合同》生效之日起,以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产;

4、配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策,以专业化的经营方式管理和运作基金财产;

5、建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立,对所管理的不同基金分别管理,分别记账,进行证券投资;

6、除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外,不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人运作基金财产;

7、依法接受基金托管人的监督;

8、采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定,按有关规定计算并公告基金资产净值,确定信诚基建份额、信诚基建A份额与信诚基建B份额的基金份额净值,信诚基建A份额与信诚基建B份额终止运作后的份额转换比例和信诚基建份额申购、赎回的价格;

9、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

10、编制季度、半年度和年度基金报告;

11、严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;

12、保守基金商业秘密,不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予保密,不向他人泄露;

13、按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配基金收益;

14、按规定受理信诚基建份额申购与赎回申请,及时、足额支付赎回款项;

15、依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;

16、按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料15年以上;

17、确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出,并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式,随时查阅到与基金有关的公开资料,并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件;

18、组织并参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;

19、面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会并通知基金托管人;

20、因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时,应当承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;

21、监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务,基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时,基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;

22、当基金管理人将其义务委托第三方处理时,应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任;

23、以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为;

24、基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件,《基金合同》不能生效,基金管理人承担全部募集费用,将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人;

25、执行生效的基金份额持有人大会的决议;

26、建立并保存基金份额持有人名册;

27、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

四、基金管理人承诺

1、基金管理人承诺严格遵守《中华人民共和国证券法》、《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等法律法规的相关规定,并建立健全的内部控制制度,采取有效措施,防止违法违规行为的发生。

2、基金管理人及其董事、监事、高级管理人员和其他从业人员承诺严格遵守《基金法》、《运作办法》,建立健全的内部控制制度,采取有效措施,防止以下《基金法》、《运作办法》禁止的行为发生:

(1)将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资;

(2)不公平地对待其管理的不同基金财产;

(3)利用基金财产或者职务之便为基金份额持有人以外的人牟取利益;

(4)向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失;

(5)侵占、挪用基金财产;

(6)泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动;

(7)玩忽职守,不按照规定履行职责;

(8)法律、行政法规和中国证监会禁止的其他行为。

3、基金管理人承诺加强人员管理,强化职业操守,督促和约束员工遵守国家有关法律法规及行业规范,诚实信用、勤勉尽责,不从事以下活动:

(1)越权或违规经营;

(2)违反基金合同或托管协议;

(3)损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法利益;

(4)在向中国证监会报送的资料中弄虚作假;

(5)拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管;

(6)玩忽职守、滥用职权,不按照规定履行职责;

(7)泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密,尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息,或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动;

(8)未按法律法规、基金管理公司内部制度进行证券投资,未事先向基金管理人申报,与基金份额持有人发生利益冲突;

(9)违反证券交易场所业务规则,利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格,扰乱市场秩序;

(10)故意损害投资人及其他同业机构、人员的合法权益;

(11)以不正当手段谋求业务发展;

(12)有悖社会公德,损害证券投资基金人员形象;

(13)信息披露不真实,有误导、欺诈成分;

(14)法律、行政法规和中国证监会禁止的其他行为。

4、本基金管理人将根据基金合同的规定,按照招募说明书列明的投资目标、策略及限制等全权处理本基金的投资。

5、本基金管理人不从事违反《基金法》的行为,并建立健全内部控制制度,采取有效措施,保证基金财产不用于下列投资或者活动:

(1)承销证券;

(2)违反规定向他人贷款或者提供担保;

(3)从事承担无限责任的投资;

(4)买卖其他基金份额,但是中国证监会另有规定的除外;

(5)向其基金管理人、基金托管人出资;

(6)从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;

(7)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,则本基金投资不再受相关限制。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销的证券,或者从事其他重大关联交易的,应当符合基金的投资目标和投资策略,遵循基金份额持有人利益优先原则,防范利益冲突,建立健全内部审批机制和评估机制,按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意,并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议,并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

五、基金经理的承诺

1、依照有关法律法规和基金合同的规定,本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益;

2、不利用职务之便为自己及其被代理人、受雇人或任何第三人谋取利益;

3、不违反现行有效的有关法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定,泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息;

4、不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

六、基金管理人的内部控制制度

1、内部控制的总体目标和原则

公司内部控制制度,是指公司为了保障业务正常运作、实现既定的经营目标、防范经营风险而设立的各种内控机制和一系列内部运作程序、措施和方法等文本制度的总称。内部控制的总体目标是:建立一个决策科学、营运高效、稳健发展的机制,使公司的决策和运营尽可能免受各种不确定因素或风险的影响。内部控制遵循以下原则:

全面性原则:内部控制渗透到公司的决策、执行和监督层次,贯穿了业务流程的所有环节,覆盖了公司所有的部门、岗位和各级人员。

有效性原则:各项内部控制制度必须符合国家和主管机关所制定的法律法规和规章,不得与之相抵触;具有高度的权威性,是所有员工严格遵守的行动指南。

相互制约原则:在公司的各个部门之间、各业务环节及重要岗位体现相互监督、相互制约,作到公司决策、执行、监督体系的分离以及公司各职能部门中关键部门、岗位的设置分离(如交易执行部门和基金清算部门的分离、直接操作人员和控制人员的分离等),形成权责分明、相互牵制的局面,并通过切实可行的相互制衡措施来降低各种内控风险的发生。

及时性原则:内部控制应随着公司经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化而不断修正,并随国家法律、法规、政策等外部环境因素的改变及时进行相应的修改和完善;

成本效益原则:公司将充分发挥各机构、各部门及广大员工的工作积极性,尽量降低经营运作成本,保证以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

防火墙原则:公司基金投资、基金交易、投资研究、市场开发、绩效评估等相关部门,应当在空间和制度上适当分离,以达到防范风险的目的。对因业务需要知悉内幕信息的人员,应制定严格的审批程序和监督措施。

2、风险防范体系

公司根据基金管理的业务特点设置内部机构,并在此基础上建立层层递进、严密有效的多级风险防范体系:

(1)一级风险防范

一级风险防范是指在公司董事会层面对公司的风险进行的预防和控制。

董事会下设风险与审计委员会,对公司经营管理与基金运作的合规性进行全面和重点的分析检查,发现其中存在的和可能出现的风险,并提出改进方案。

公司设督察长。督察长对董事会负责,组织、指导公司监察稽核和风险管理工作,监督检查基金及公司运作的合法合规情况和公司的内部风险控制情况,并定期或不定期地向董事会或者董事会下设的相关专门委员会报告工作。

(2)二级风险防范

二级风险防范是指在公司风险控制委员会、投资决策委员会、监察稽核部和风险管理部层次对公司的风险进行的预防和控制。

总经理下设风险管理委员会,对公司在经营管理和基金运作中的风险进行全面的研究、分析、评估,制定相应的风险管理制度并监督制度的执行,全面、及时、有效地防范公司经营过程中可能面临的各种风险。

总经理下设投资决策委员会,研究并制定公司基金资产的投资战略和投资策略,对基金的总体投资情况提出指导性意见,从而达到分散投资风险,提高基金资产的安全性的目的。

监察稽核部和风险管理部在督察长指导下,独立于公司各业务部门和各分支机构,对各岗位、各部门、各机构、各项业务中的风险控制情况实施监督。

(3)三级风险防范

三级风险防范是指公司各部门对自身业务工作中的风险进行的自我检查和控制。

公司各部门根据经营计划、业务规则及本部门具体情况制定本部门的工作流程及风险控制措施,达到:一线岗位双人双职双责,互相监督;直接与交易、资金、电脑系统、重要空白支票、业务用章接触的岗位,实行双人负责;属于单人、单岗处理的业务,强化后续的监督机制;相关部门、相关岗位之间相互监督制衡。

3、基金管理人关于风险管理和内部控制制度的声明

基金管理人确知建立内部控制系统、维持其有效性以及有效执行内部控制制度是基金管理人董事会及管理层的责任,董事会承担最终责任;基金管理人特别声明以上关于风险管理和内部控制制度的披露真实、准确,并承诺根据市场的变化和基金管理人的发展不断完善风险管理和内部控制制度。

第四部分 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:田国立

基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字【1998】24 号

托管业务部总经理:肖伟

托管部门信息披露联系人:王永民

传真:(010)66594942

中国银行客服电话:95566

(二)基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年,现有员工110余人,大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验,且具有海外工作、学习或培训经历,60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务,中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行,中国银行拥有证券投资基金、基金(一对多、一对一)、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内,中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务,为各类客户提供个性化的托管增值服务,是国内领先的大型中资托管银行。

(三)证券投资基金托管情况

截至2015年3月31日,中国银行已托管328只证券投资基金,其中境内基金303只,QDII基金25只,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。

(四)托管业务的内部控制制度

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成部分,秉承中国银行风险控制理念,坚持"规范运作,稳健经营"的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节,包括风险识别,风险评估,工作程序设计与制度建设,风险检视,工作程序与制度的执行,工作程序与制度执行情况的内部监督、稽核以及风险控制工作的后评价。

2007年起,中国银行连续聘请外部会计会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于 "SAS70"、"AAF01/06" "ISAE3402"和"SSAE16"等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2014年,中国银行同时获得了基于"ISAE3402"和"SSAE16"双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善,内控措施严密,能够有效保证托管资产的安全。

(五)托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》的相关规定,基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定的,应当拒绝执行,及时通知基金管理人,并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定的,应当及时通知基金管理人,并及时向国务院证券监督管理机构报告。

第五部分 相关服务机构

一、基金份额销售机构

1、场外销售机构

(1)直销机构

信诚基金管理有限公司及本公司的网上交易平台

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

电话: (021)6864 9788

联系人:钱慧

投资人可以通过本公司网上交易系统办理本基金的开户、认购、申购及赎回等业务,具体交易细则请参阅本公司网站公告。网上交易网址:http://www.xcfunds.com/。

(2)其他销售机构

1)中国银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号
法定代表人:田国立
客服电话:95566
传真:010-66594946
电话:010-66594977
网址:www.boc.cn

2)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:牛锡明
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

3)中信证券股份有限公司
注册地址:广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座(邮编:518048)
法定代表人:王东明
联系人:顾凌
电话:0755-23835888、010-60838888
传真:0755-23835861、010-60836029
网址:http://www.cs.ecitic.com

4)中信建投证券股份有限公司
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:王常青
联系电话:(010)85130588
开放式基金咨询电话:4008888108
网址:www.csc108.com

5)中信证券(浙江)有限责任公司
注册地址:浙江省杭州市解放东路29号迪凯银座22层
办公地址:浙江省杭州市解放东路29号迪凯银座22层
法定代表人:沈强
开放式基金咨询电话:0571-95548
开放式基金业务传真:0571-85106383
联系人:周妍
网址:www.bigsun.com.cn

6)中信证券(山东)有限责任公司
注册地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼20层(266061)
办公地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场20层(266061)
法定代表人:杨宝林
联系人:吴忠超
联系电话:0532-85022326

7) 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层及第04层01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元
办公地址:深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第4、18层至21层
法定代表人:龙增来
统一客户服务电话:400-600-8008 、95532
公司网站:www.china-invs.cn

8)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)82943666
传真:(0755)82943636
网址:www.newone.com.cn
客服电话:95565、4008888111

9) 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:0755-82133952
全国统一客户服务电话:95536
公司网址: www.guosen.com.cn

10) 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

11)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

12)上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址:徐汇区龙田路195号3C座10楼
法定代表人:其实
电 话:021-54509998
传 真:021-64385308

13)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:常振明
客服电话:95558
网址:http://bank.ecitic.com

具体名单详见基金份额发售公告以及基金管理人届时发布的相关公告。

2、场内销售机构:深圳证券交易所内具有基金销售业务资格、并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的会员单位,具体名单见基金份额发售公告。

基金管理人可根据有关法律法规要求,根据实情,选择其他符合要求的机构销售本基金或变更上述销售机构,并及时公告。

二、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:北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人:周明
联系电话: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
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:黎明、孙睿
电话:021-31358666
传真:021-31358600
联系人:孙睿

四、审计基金财产的会计师事务所
名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
法定代表人:杨绍信
电话:021-23238888
传真:021-23238800
联系人:俞伟敏
经办注册会计师:薛竞、俞伟敏

第六部分 基金份额分级

本基金的基金份额分级及其基本运作如下:

一、基金份额结构

本基金的基金份额包括"信诚基建份额"、"信诚基建A份额"与"信诚基建B份额"。其中,信诚基建A份额、信诚基建B份额的基金份额配比始终保持1:1的比例不变。

二、基金的基本运作概要

1、本基金通过场外、场内两种方式公开发售。基金发售结束后,场外认购的全部份额将确认为信诚基建份额;场内认购的全部份额将按1:1的比例确认为信诚基建A份额与信诚基建B份额。(具体认购方法参见基金份额发售公告)

2、基金合同生效后,信诚基建份额接受场外与场内申购和赎回;信诚基建A份额、信诚基建B份额只上市交易,不接受申购和赎回。

3、基金合同生效后,基金管理人将根据基金合同的约定办理信诚基建份额与信诚基建A份额、信诚基建B份额之间的份额配对转换业务。

4、基金合同生效后,基金管理人按照基金合同约定在基金份额折算日对基金份额进行折算。折算后基金运作方式及信诚基建A份额与信诚基建B份额配比不变。

三、信诚基建A份额、信诚基建B份额概要

1、存续期限

自基金合同生效之日起存续。

2、基金份额配比

信诚基建A份额与信诚基建B份额的基金份额配比始终保持1:1的比例不变。

3、信诚基建A份额与信诚基建B份额的基金份额净值计算

信诚基建A份额与信诚基建B份额的基金份额净值是对相应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。

信诚基建A份额和信诚基建B份额具有不同的净值计算规则,即信诚基建A份额和信诚基建B份额的预期风险和预期收益特征不同。

在本基金的存续期内,本基金将在每个工作日按照基金合同约定的净值计算规则对信诚基建A份额和信诚基建B份额分别进行基金份额净值计算。

本基金净资产优先分配信诚基建A份额的本金及信诚基建A份额的约定收益,本基金在优先分配信诚基建A份额的本金及信诚基建A份额的约定收益后的剩余净资产分配予信诚基建B份额。

信诚基建A份额的约定年收益率为一年期银行定期存款年利率(税后)加计3%。本基金将以基金合同生效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利率为准,设定该日起(含该日)至第一个定期份额折算的折算日(含该日,定期份额折算日原则上为每年的12月5日,若该日为非工作日,则提前至该日之前的最后一个工作日。详见本招募说明书基金份额的折算)期间信诚基建A份额适用的年约定收益率;此后,将以每个定期份额折算的折算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利率为准,重新设定该日次日起(含该日的次日)至下一个定期份额折算日(含该日)期间信诚基建A份额适用的年约定收益率。

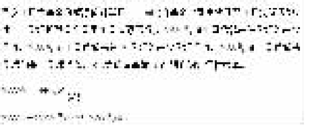
例如:若基金合同生效日为2015年5月5日,则以2015年5月5日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币一年期整存整取基准年利率(税后)加计3%作为该日起(含该日)至第一个定期份额折算的折算日(含该日)期间(2015年5月5日至2015年12月4日。2015年12月5日为非工作日,根据定期份额折算规则,第一个定期份额折算的折算日为该日之前的最后一个工作日)的约定年收益率。本基金将以2015年12月4日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币一年期整存整取基准年利率(税后)加计3%作为该日次日(含该次日)起至第二个定期份额折算的折算日(含该日)期间的约定年收益率,依此类推。

信诚基建A份额的约定年收益率除以365天得到信诚基建A份额的约定日收益率。信诚基建A份额的基金份额净值以1.000元为基础,采用信诚基建A份额的约定日收益率乘以应计约定收益的天数进行单利计算。信诚基建A份额在净值计算日应计约定收益的天数为自基金合同生效日或最近一个份额折算日次日至净值计算日的实际天数。

基金管理人并不承诺或保证信诚基建A份额的约定收益,如在本基金存续期内基金资产出现极端损失的情况下,信诚基建A份额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。

(1)信诚基建份额的基金份额净值计算公式

T日信诚基建份额的基金份额净值=T日闭市后的基金资产净值/T日本基金的基金份额(包括信诚基建份额、信诚基建A份额、信诚基建B份额)余额总数



信诚基建份额、信诚基建A份额与信诚基建B份额的基金份额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。

(3)信诚基建A份额与信诚基建B份额的基金份额净值公告

信诚基建A份额和信诚基建B份额的基金份额净值在当天收市后计算,并在下一日内与信诚基建份额的基金份额净值

(下转A23版)

信诚中证基建工程指数分级证券投资基金基金份额发售公告

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

【重要提示】

1. 信诚中证基建工程指数分级证券投资基金(以下简称"本基金")的募集已获中国证监会2015年5月12日证监许可[2015]892号文批准。中国证监会对本基金的核准并不代表中国证监会对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

2.本基金类别为股票型,运作方式为契约型开放式。

3.本基金的管理人为信诚基金管理有限公司(以下简称"本公司"或"基金管理人"),基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称"中国银行"),注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。

4.本基金的基金份额包括"信诚基建份额"、"信诚基建A份额"与"信诚基建B份额"。其中,信诚基建A份额、信诚基建B份额的基金份额配比始终保持1:1的比例不变。本基金通过场外、场内两种方式公开发售。基金发售结束后,场外认购的全部份额将确认为信诚基建份额;场内认购的全部份额将按1:1的比例确认为信诚基建A份额与信诚基建B份额。

5.本基金《基金合同》生效后,符合基金上市交易条件的,信诚基建A份额与信诚基建B份额将申请在深圳证券交易所上市交易。上市交易的有关事项将另行公告。

6.本基金自2015年7月6日起至2014年7月17日发售,其中,场外通过基金管理人的直销中心和销售机构(详见本公告的附件)公开发售;场内通过具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位公开发售。基金管理人可根据募集情况适当延长或缩短本基金的募集期限并及时公告, 但整个募集期限自基金份额发售之日起不超过三个月。

7.本基金募集对象为个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者。个人投资者指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人;机构投资者指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织;合格境外机构投资者指符合现时有效的相关法律法规规定可投资于中国境内证券市场的中国境外的机构投资者

8.投资人可通过场外认购和场内认购两种方式进行认购。本基金将通过基金管理人直销中心和各销售机构办理基金销售业务的营业场所办理或按基金管理人直销中心、销售机构提供的其他方式办理本基金场外认购业务。办理本基金场内认购的销售机构为具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位,具体名单可在深交所网站查询。

各销售机构认购业务的办理网点、办理日期和时间等事项参照各销售机构的具体规定。

9.本基金注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。

若投资人欲通过场外认购本基金,需开立中国证券登记结算有限责任公司的深圳开放式基金账户。若已经在中国证券登记结算有限责任公司开立深圳开放式基金账户的,则不需要再次办理开户手续。认购期内本公司直销中心、本公司网上交易系统和各销售机构的销售网点同时为投资人办理场外认购的开户和认购手续。

若投资人欲通过场内认购本基金,需持有深圳证券账户。其中,深圳证券账户是指投资人在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开立的深圳证券交易所人民币普通股票账户(以下简称"深圳A股账户")或证券投资基金账户。认购期内具有基金代销资格的深交所会员单位可同时为投资人办理场内认购的开户和认购手续。

10.除法律法规另有规定外,一个投资者只能开设和使用一个基金账户;不得非法利用他人账户或资金进行认购,也不得违规融资或帮助他人违规进行认购。

11.投资者应保证用于认购的资金来源合法,投资者应有权自行支配,不存在任何法律上、合约上或其他障碍。

12.本基金募集份额总额不少于2亿份,基金募集金额不少于2亿元。

13. 在募集期内,投资人通过场外销售机构销售网点每笔认购最低金额为1,000元人民币(含认购费);投资人在直销中心首次认购最低金额为10万元人民币(含认购费),追加认购的最低金额为1,000元人民币(含认购费)。通过本基金管理人网上交易平台办理本基金认购业务的,不受直销网点最低认购金额的限制,最低认购金额为单笔1,000元(含认购费)。本基金直销网点单笔认购最低金额可由基金管理人酌情调整。

通过具有基金代销资格的深交所会员单位场内认购基金,场内认购单笔最低认购份额为50,000份,超过50,000份的须为1000份的整数倍,且每笔认购最大不超过99,999,000份基金份额。

本基金募集期间对单个基金份额持有人不设置最高累计认购金额限制。投资人在募集期内可多次认购基金份额,但认购申请一经销售机构受理,则不可以撤销。

14. 为进一步方便投资人通过网上交易方式投资本公司旗下开放式基金,本公司与中国建设银行股份有限公司(以下简称为"中国建设银行")、中国农业银行股份有限公司(以下简称为"中国农业银行")和招商银行股份有限公司(以下简称为"招商银行")、 汇付天下有限公司(以下简称为"汇付天下")、支付宝(中国)网络技术有限公司(以下简称为"支付宝")和上海银联电子支付服务有限公司(以下简称为"银联通")合作,面向中国建设银行龙卡持卡人、中国农业银行金穗卡(借记卡、准贷记卡)持卡人、招商银行一卡通持卡人、在上海汇付数据服务有限公司开通天天盈账户的投资者、在支付宝开通支付宝基金投资账户的投资者以及银联通基金业务所支持银行的持卡人,推出基金网上交易业务。持有以上银行卡或账户的投资人,通过登录本公司网站,按照网上交易栏目的相关提示即可办理开放式基金的开户、交易及查询等业务。

15.销售网点(指销售网点和/或直销中心和/或本公司网上交易平台)对申请的受理并不表示对该申请的成功确认,而仅代表销售网点确实接受了认购申请,申请的成功确认应以基金注册登记机构的确认登记为准。投资人可以在基金合同生效后到原认购网点查询认购成交确认情况。

16.本公告仅对本基金募集的有关事项和规定予以说明。投资人欲了解本基金的详细情况,请详细阅读刊登在中国证券监督管理委员会指定报刊和网站上的《信诚中证基建工程指数分级证券投资基金招募说明书》(以下简称 "招募说明书")。

17.各销售机构的销售网点、业务办理日期和具体时间等事项以各销售机构在其各销售城市当地的公告为准。

18.在募集期间,除本公告所列的销售机构外,如本基金增加其他销售机构的,本公司将及时公告。

19.投资人如有任何问题,可拨打本公司的客户服务电话400-666-0066咨询购买事宜。

20.基金管理人可综合各种情况对募集安排做适当调整。

21.本发售公告中未明确指明仅适用于"场外认购"或"场内认购"的相关内容,对于"场外认购"、"场内认购"均适用。

22.基金管理人提示投资人充分了解基金投资的风险和收益特征,根据自身的风险承受能力,审慎选择适合自己的基金产品。基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

本基金为跟踪指数的股票型基金,具有较高预期风险、较高预期收益的特征,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。从本基金所分离的两类基金份额来看,信诚基建A份额具有预期风险、预期收益较低的特征;信诚基建B份额具有预期风险、预期收益较高的特征。投资于本基金面临的主要风险有市场风险、管理风险、估值风险、流动性风险、本基金的特有风险、本基金标的指数特有风险、技术风险及其他风险等。本基金以1.00元初始面值发售,但在市场波动等因素的影响下,基金投资仍有可能出现亏损或基金净值仍有可能低于初始面值。基金管理人提醒投资人基金投资的"买者自负"原则,在投资人做出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资人自行承担。投资有风险,投资人在投资本基金前应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。

具体而言,本基金的特有风险包括:

(1)指数投资的特有风险

本基金为跟踪指数的股票型基金,标的指数为中证基建工程指数,在基金的投资运作过程中可能面临指数基金特有的风险:

1)系统性风险

本基金为跟踪指数的股票型基金,基金资产主要投资于中证基建工程指数的成份股及其备选成份股,因此中证基建工程指数的市场表现将影响到基金业绩的表现,当中证基建工程指数出现收益变动、波动提高时,本基金的收益可能会受到影响。

2)指数复制风险

本基金原则上采用完全复制法来跟踪中证基建工程指数,能否有效地复制指数并将跟踪误差控制在可接受范围内,对本基金的收益将产生影响。当复制方法由于市场条件受到限制或者替代股的选择存在错误时,本基金的收益可能会受到影响。

3)标的指数回报与行业平均回报偏离风险

标的指数的样本空间为中证基建工程指数成分股及备选成分股,其并不能完全代表整个基建工程行业,标的指数的回报率与基建工程行业股票的整体回报率可能存在偏离。

4)标的指数变更风险

根据基金合同的规定,因标的指数的编制与发布等原因,导致原标的指数不宜继续作为本基金的投资标的指数及业绩比较基准,本基金可能变更标的指数,基金的投资组合将随之调整,基金的收益风险特征可能发生变化,投资者还须承担投资组合调整所带来的风险与成本。

(2)分级结构运作的特有风险包括:

本基金为分级基金,信诚基建A份额和信诚基建B份额的运作有别于普通的开放式基金和封闭式基金,投资于本基金还将面临以下基金运作特有的风险:

1)上市交易的风险

本基金在基金合同生效后,信诚基建A份额和信诚基建B份额在深圳证券交易所挂牌上市交易。由于上市期间可能因信息披露导致基金停牌,投资人在停牌期间不能买卖基金,产生风险;同时,可能因上市后交易对手不足导致基金流动性风险;另外,当基金份额持有人将份额转向场外交易后导致场内的基金份额或持有人数不满足上市条件时,本基金存在暂停上市或终止上市的可能。

2)杠杆机制风险

本基金为跟踪指数的股票型基金,具有较高预期风险、较高预期收益的特征,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。从本基金所分离的两类基金份额来看,信诚基建A份额具有预期风险、预期收益较低的特征;信诚基建B份额具有预期风险、预期收益较高的特征。

由于信诚基建B份额内含杠杆机制的设计, 信诚基建B份额的净值变动幅度将大于信诚基建份额和信诚基建A份额的净值变动幅度,即信诚基建B份额的净值波动性将高于其他两类基金份额。

3)折/溢价交易风险

信诚基建A份额和信诚基建B份额上市交易后,由于受市场供求关系的影响,基金份额的交易价格与基金份额净值可能发生偏离而出现折/溢价交易风险。尽管份额配对转换机制有助于将折/溢价交易风险降低至较低水平,但信诚基建A份额和信诚基建B份额的某一级份额仍有可能处于折/溢价交易状态。此外,由于份额配对转换机制的影响,信诚基建A份额和信诚基建B份额的交易价格可能会相互影响。

4)风险收益特征变化风险

根据本基金份额折算的设计,本基金将进行定期份额折算和不定期份额折算。在实施基金份额折算后,信诚基建A份额持有人或信诚基建B份额持有人将会获得一定比例的信诚基建份额的场内份额,因此其所持有的基金份额将面临风险收益特征出现变化的风险。

当信诚基建A份额和信诚基建B份额终止运作后, 信诚基建A份额和信诚基建B份额将全部转换成信诚基建份额的场内份额,基金份额持有人所持有的基金份额也将面临风险收益特征出现变化的风险。

5)份额转换的风险

当信诚基建A份额和信诚基建B份额终止运作后, 信诚基建A份额和信诚基建B份额将全部转换成信诚基建份额的场内份额。由于在二级市场可以做交易的证券公司并不全部具备中国证监会颁发的基金销售业务资格,而只有具备基金销售业务资格的证券公司才可以办理投资人赎回基金份额的业务。因此,基金份额持有人可能面临会员单位不具备基金销售业务资格而导致的不能直接赎回信诚基建份额的场内份额的风险。此风险需要引起投资者注意,投资人可以选择在份额转换前将信诚基建A份额或信诚基建B份额卖出,或者将新增的信诚基建份额的场内份额通过转托管业务转入具有基金销售业务资格的证券公司后赎回基金份额。

信诚基建A份额和信诚基建B份额持有人进行份额折算而新增的信诚基建份额亦存在基金份额持有人可能面临会员单位不具备基金销售业务资格而导致的不能直接赎回信诚基建份额的场内份额的风险。

6)基金的收益分配风险

在存续期内,本基金将不进行收益分配。本基金管理人将根据基金合同的约定对本基金的信诚基建A份额和信诚基建B份额实施份额折算。基金份额折算后,如果出现新增份额的情形,投资者可通过卖出或赎回折算后新增份额的方式获取投资回报,但是,投资者通过变现折算后的新增份额以获取投资回报的方式并不等同于基金收益分配,投资者不仅须承担相应的交易成本,还可能面临基金份额卖出或赎回的价格波动风险。

一、本次基金份额发售基本情况

(一)基金名称及代码

信诚中证基建工程指数分级证券投资基金(基金代码:165525)

基金简称:信诚中证基建工程指数分级(场内简称:基建工程)

(二)基金类别

股票型

(三)基金运作方式

契约型、开放式

(四)基金存续期限

不定期

(五)基金份额初始面值(认购价格)

(下转A22版)

信诚中证基建工程指数分级证券投资基金基金合同摘要

一、基金管理人、基金托管人及基金份额持有人的权利与义务

(一)基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人的权利包括但不限于:

(1)依法募集资金;

(2)自《基金合同》生效之日起,根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产;

(3)依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用;

(4)销售基金份额;

(5)按照规定召集基金份额持有人大会;

(6)依据《基金合同》及有关法律规定监督基金托管人,如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定,应呈报中国证监会和其他监管部门,并采取必要措施保护基金投资者的利益;

(7)在基金托管人更换时,提名新的基金托管人;

(8)选择、更换基金销售机构,对基金销售机构的相关行为进行监督和处理;

(9)担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用;

(10)依据《基金合同》及有关法律规定决定基金收益的分配方案;

(11)在《基金合同》约定的范围内,拒绝或暂停受理信诚基建份额申购与赎回申请;

(12)依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利,为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利;

(13)在法律法规允许的前提下,为基金的利益依法为基金进行融资、融券及转融通;

(14)以基金管理人的名义,代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;

(15)选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券、期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构;

(16)在符合有关法律、法规的前提下,制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换等业务规则;

(17)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人的义务包括但不限于:

(1)依法募集资金,办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;

(2)办理基金备案手续;

(3)自《基金合同》生效之日起,以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产;

(4)配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策,以专业化的经营方式管理和运作基金财产;

(5)建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立,对所管理的不同基金分别管理,分别记账,进行证券投资;

(6)除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外,不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人运作基金财产;

(7)依法接受基金托管人的监督;

(8)采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定,按有关规定计算并公告基金资产净值,确定信诚基建份额、信诚基建A份额与信诚基建B份额的基金份额净值,信诚基建A份额与信诚基建B份额终止运作后的份额转换比例和信诚基建份额申购、赎回的价格;

(9)进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

(10)编制季度、半年度和年度基金报告;

(11)严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;

(12)保守基金商业秘密,不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予保密,不向他人泄露;

(13)按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配基金收益;

(14)按规定受理信诚基建份额申购与赎回申请,及时、足额支付赎回款项;

(15)依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;

(16)按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料15年以上;

(17)确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出,并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式,随时查阅到与基金有关的公开资料,并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件;

(18)组织并参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;

(19)面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会并通知基金托管人;

(20)因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时,应当承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;

(21)监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务,基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时,基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;

(22)当基金管理人将其义务委托第三方处理时,应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任;

(23)以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为;

(24)基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件,《基金合同》不能生效,基金管理人承担全部募集费用,将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人;

(25)执行生效的基金份额持有人大会的决议;

(26)建立并保存基金份额持有人名册;

(27)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(二)基金托管人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金托管人的权利包括但不限于:

(1)自《基金合同》生效之日起,依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产;

(2)依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用;

(3)监督基金管理人对本基金的投资运作,如发现基金管理人有违反《基金合同》及国家法律法规行为,对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形,应呈报中国证监会,并采取必要措施保护基金投资者的利益;

(4)根据相关市场规则,为基金开设证券账户和期货账户等投资所需账户、为基金办理证券、期货交易资金清算;

(5)提议召开或召集基金份额持有人大会;

(6)在基金管理人更换时,提名新的基金管理人;

(7)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金托管人的义务包括但不限于:

(1)以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产;

(2)设立专门的基金托管部门,具有符合要求的营业场所,配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员,负责基金财产托管事宜;

(3)建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,确保基金财产的安全,保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立;对所托管的不同的基金分别设置账户,独立核算,分账管理,保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立;

(4)除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外,不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人托管基金财产;

(5)保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证;

(6)按规定开设基金财产的资金账户、证券账户和期货账户等投资所需账户;按照《基金合同》的约定,根据基金管理人的投资指令,及时办理清算、交割事宜;

(7)保守基金商业秘密,除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前予以保密,不得向他人泄露;

(8)复核、审查基金管理人计算的信诚基建份额、信诚基建A份额与信诚基建B份额的基金份额净值、信诚基建A份额与信诚基建B份额终止运作后的份额转换比例和信诚基建份额申购、赎回价格;

(9)办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;

(10)对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见,说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行;如果基金管理人有未执行《基金合同》规定的行为,还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施;

(11)保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料15年以上;

(12)建立并保存基金份额持有人名册;

(13)按规定制作相关账册并与基金管理人核对;

(14)依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项;

(15)依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定,召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;

(16)按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作;

(17)参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;

(18)面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会和银行监督机构,并通知基金管理人;

(19)因违反《基金合同》导致基金财产损失时,应承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;

(20)按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务,基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时,应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿;

(21)执行生效的基金份额持有人大会的决议;

(22)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(三)基金份额持有人的权利与义务

基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受,基金投资者自依据《基金合同》取得基金份额,即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人,直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。

同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金份额持有人的权利包括但不限于:

(1)分享基金财产收益;

(2)参与分配清算后的剩余基金财产;

(3)依法申请赎回或转让其持有的信诚基建份额、依法转让其持有的信诚基建A份额和信诚基建B份额;

(4)按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会;

(5)出席或者委派代表出席基金份额持有人大会,对基金份额持有人大会审议事项行使表决权;

(6)查阅或者复制公开披露的基金信息资料;

(7)监督基金管理人的投资运作;

(8)对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁;

(9)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金份额持有人的义务包括但不限于:

(1)认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件;

(2)了解所投资基金产品,了解自身风险承受能力,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,自行承担投资风险;

(3)关注基金信息披露,及时行使权利和履行义务;

(4)缴纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用;

(5)在其持有的基金份额范围内,承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任;

(6)不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动;

(7)执行生效的基金份额持有人大会的决议;

(8)返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利;

(9)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

二、基金份额持有人大会召集、议事规则及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成,基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人大会的审议事项应分别由信诚基建份额、信诚基建A份额、信诚基建B份额的基金份额持有人独立进行表决。基金份额持有人持有的每一基金份额在其对应的份额级别内拥有平等的投票权。

本基金基金份额持有人大会不设立日常机构。

(一)召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的,应当召开基金份额持有人大会:

(1)终止《基金合同》;

(2)更换基金管理人;

(3)更换基金托管人;

(4)转换基金运作方式;

(5)提高基金管理人、基金托管人的报酬标准,但法律法规要求提高该等报酬标准或销售服务费率的除外;

(6)变更基金类别;

(下转A22版)