

信诚中证800医药指数分级证券投资基金招募说明书摘要

(2016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:中国银行股份有限公司
 重要提示
 本基金于2013年8月16日基金合同正式生效。
 基金的过往业绩并不预示其未来表现。
 投资有风险,投资者申购本基金时应认真阅读招募说明书。
 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2016年2月16日,有关财务数据和净值表现截止日为2015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: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
英国保诚集团控股有限公司	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裁、中国中信集团有限公司业务协同部主任,现任中信信托有限责任公司副董事长、中信基金管理有限责任公司(信诚基金管理有限责任公司)之子公司董事。

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、中信证券资产管理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。

王道远先生,董事,工商管理硕士。历任中信信托有限责任公司综合管理部总经理、信托管理部总经理、总经理助理,董事会秘书、副总经理。现任中信信托有限责任公司副总经理、董事会秘书、固有风险审查委员会主任兼天津信唐街市经纪有限责任公司董事。

Chuy 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,美国保诚集团亚洲区资产管理与投资总裁、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。

孙麒麟先生,独立董事,商科学士。历任安永会计师事务所(香港)资产管理审计团队亚太区联合领导人、安永会计师事务所(旧金山)美国西部资产管理市场审计团队领导等职。现任Lattice Strategies Fund 受托人、Nippon Wealth Bank 独立董事、Ironwood Multi Strategy Fund LLC 独立董事。

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主管、北京天华会计师事务所首席合伙人。现任安永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部”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。

3.经营管理层人员情况
 吕海生先生,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。

桂毅毅先生,副总经理,工商管理硕士。历任安达信会计师事务所有限公司高级审计员,中乔智德汤逊广告有限公司财务主管,德国莱纳堡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、总经理助理兼董事办秘书,信诚基金管理有限公司督察长兼董事办秘书,中信信托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、首席财务官。

阚晓伟先生,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责任公司董事、总经理。

4.督察长
 周浩生先生,督察长,法学硕士,历任中国证券监督管理委员会主任科员、公职律师、副调研员,上海航运产业基金管理有限公司合规总监,国联安基金管理有限公司督察长。现任信诚基金管理有限公司督察长。

5.基金经理
 杨旭先生,数学金融硕士、运筹管理学硕士、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WSPA Group公司Rothschild管理,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产业主题指数分级证券投资基金、信诚中证新兴产业指数分级基金、信诚中证智能家居指数分级基金、信诚中证基建工程指数分级证券投资基金、信诚新选回报灵活配置混合基金及信诚新旺回报灵活配置混合基金的基金经理。

6.投资决策委员会成员
 胡洁女士,总经理助理,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,基金经理;
 董越先生,交易总监;
 张光成先生,股票投资总监,基金经理;
 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:人民币贰仟玖佰玖拾叁亿元人民币贰仟叁仟叁佰玖拾叁亿玖仟玖拾玖元
 法定代表人:田国立
 基金托管业务批准文号:中国证监会证监基金字[1998]24号
 托管部门信息联络处联系人:王禹民

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,且具备海外工作、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、OPF、ROFII、ODII、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12月31日,中国银行已托管418只证券投资基金,其中境内基金390只,ODII基金28只,覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型和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
 投资者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)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
 网站:www.boc.com.cn
 2)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:李建强
 电话:(0755-12388888
 传真:(0755-12388888
 联系人:李娜
 客服电话:95555
 网站:www.cmbchina.com
 3)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)58409483
 联系人:张宏章
 客户服务电话:95559
 网站:www.bankcomm.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
 开放式基金业务咨询:4008888108
 网站:www.csc108.com

5)中信证券股份有限公司
 住所: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:胡蝶
 电话:(0755)82962232
 传真:(0755)82963636
 网站:www.newone.com.cn
 6)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
 办公地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦
 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
 全国统一客户服务热线:95536
 网站:www.guosen.com.cn
 7)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
 办公地址:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

8)中信证券股份有限公司
 注册地址:北京市朝阳区亮马桥路48号
 办公地址:北京市朝阳区亮马桥路48号
 法定代表人:王东明
 联系人:胡蝶
 电话:(0755)82962232
 传真:(0755)82963636
 网站:www.newone.com.cn
 9)中信证券股份有限公司
 注册地址:北京市朝阳区亮马桥路48号
 办公地址:北京市朝阳区亮马桥路48号
 法定代表人:王东明
 联系人:胡蝶
 电话:(0755)82962232
 传真:(0755)82963636
 网站:www.newone.com.cn
 10)国泰君安证券股份有限公司
 注册地址:中国(上海)自由贸易试验区商城路618号
 办公地址:上海市浦东新区银城中路188号上海银行大厦29楼
 法定代表人:杨德红
 联系人:芮敬祺
 电话:(021)38676666
 客户服务电话:400-888-666 / 95521
 11)中国中投证券有限公司
 注册地址:深圳市福田区益田路5033号平安金融中心A座18层、21层及第04层01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23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4、18层及21层
 法定代表人:龙增来
 统一客户服务热线:400-600-8888、95532
 公司网站:www.china-invnc.com
 12)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:邓琳
 联系电话:010-66568292
 客户服务电话:4008-888-888
 网站:www.chinastock.com.cn
 13)和讯信息科技有限公司
 注册地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
 办公地址:上海市浦东新区东方路180号泛利广场B座18F
 法定代表人:王娟
 联系人:魏亚雯
 电话:(021)-20835787
 传真:(021)-20835879
 14)上海长量基金销售投资顾问有限公司
 住所: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南路555号裕景国际B座16层
 法定代表人:张跃伟
 联系人:单丙辉
 电话:(021)-20691832
 传 真:(021)-20691861
 15)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:上海市徐汇区龙田路195号3C座10楼
 法定代表人:其实
 电 话:(021)-54509988
 传 真:(021)-64385308
 16)上海汇付金融服务有限公司
 注册地址:上海市黄浦区西藏中路336号1807-5室
 办公地址:上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼
 法定代表人:张磊
 电 话:(021)-33323998
 传 真:(021)-33323993
 网站:fundbundtrade.com
 客户服务电话:400-820-2819
 17)中信期货有限公司
 注册地址:深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1305室、14层
 办公地址:深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1305室、14层
 法定代表人:张皓
 联系人:洪轶
 电话:(0755-23953913
 网址:http://www.citicsf.com
 18)浙江同花顺基金销售有限公司
 注册地址:浙江省杭州市文二西路1号元茂大厦903
 办公地址:浙江省杭州市西湖区翠柏路7号电子商务产业园2号楼2楼
 法定代表人:凌骥平
 电 话:(0571)-88911818
 传 真:(0571)-88900423
 公司网站:www.5ifund.com
 客服电话:4008-773-773
 19)上海联泰资产管理有限公司
 注册地址:中国(上海)自由贸易试验区富特北路277号3层310室
 办公地址:上海市长寿区金钟路558弄2号楼B座6楼
 法定代表人:吕世龙
 电 话:(021)-51507071
 传 真:(021)-62900663
 网站:http://www.91fund.com.cn
 客服电话:4000-466-788
 20)北京创金启源投资管理有限公司
 注册地址:北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A
 办公地址:北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A
 法定代表人:梁睿
 电 话:(010)-66154828
 传 真:(010)-68067526
 网站:www.5irich.com
 客户服务电话:400-662-818
 21)北京乐融多源投资管理咨询有限公司
 注册地址:北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603
 办公地址:北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603
 法定代表人:董浩
 电话:(010)-65400010
 网站:www.jimifund.com
 客户服务电话:400-068-1176
 22)珠海盈嘉财富管理咨询有限公司
 注册地址:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
 办公地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼
 法定代表人:肖雯
 电话:(020)-89629021
 传真:(020)-89629011
 网站:www.yingm.com.cn
 客户服务电话:(020)-89629066
 23)上海陆金所资产管理有限公司
 注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
 办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
 法定代表人:郭坚
 电话:(021)-20669592
 传真:(021)-22066653
 网站:www.lufunds.com
 客户服务电话:4008219031
 24)泰诚财富基金销售有限公司(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
 邮政编码:116000
 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
 25)大泰金石投资管理有限公司
 注册地址:南京市建邺区江东中路359号国睿大厦一号B区4楼
 办公地址:上海市市长宁区虹桥路1386号文广大厦15楼
 法定代表人:袁颖明
 电 话:(021)-22267995
 传 真:(021)-22268089
 网站:www.dtfunds.com
 客户服务电话:4009282266
 26)上海凯石财富基金销售有限公司
 注册地址:上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼
 办公地址:上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼
 法定代表人:陈继武
 电 话:(021)-63333389
 网站:www.lingxiangfund.com
 客户服务电话:4000178000
 27)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:罗智安
 电 话: 010-67009888-6003
 传 真: 010-67009888-6000
 网站: www.zvcw.com.cn
 客户服务电话:400-001-8811
 2)场内发售机构:深圳证券交易所内具有基金销售业务资格的会员单位,具体名单见本基金发售公告。
 基金管理人可根据有关法律法规要求,根据实际情况,选择其他符合要求的机构代理销售本基金或变更上述代销机构,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
 住所:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
 办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
 负责人:韩朝
 联系电话:(021)31358666
 传真:(021)31358600
 联系人:孙晔
 (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(特殊普通合伙)
 住所: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:戴建华
 电话:8621 2212 2888
 传真:8621 6288 1889
 联系人:王丽荷
 经办注册会计师:王丽荷、黄小熠
 四、基金的名称
 信诚中证800医药指数分级证券投资基金
 基金的类型
 契约型开放式
 本基金的投资目标
 本基金进行数量化指数投资,通过严谨的数量化管理和投资纪律约束,实现对中证800制药与生物科技指数的有效跟踪,为投资者提供一个有效的投资工具。
 七、基金的投资范围
 本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括标的指数的成份股、备选成份股、新股(含首次公开发行和增发)、债券、债券回购、中期票据、银行存款、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许本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)。本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)占基金资产的比例为85%-100%,其中投资于股票的资产不低于基金资产的85%,投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金资产的80%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。
 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。
 八、基金的投资策略
 本基金跟踪中证800医药指数,即原则上按照标的指数的成份股成份权重或其相应权重构建投资组合,并根据标的指数的成份及其权重变化进行相应调整,力争将跟踪误差率与业绩比较基准之间日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差率不超过4%。
 当发生特殊情形(如成份股长期停牌、成份股发生变更、成份股由于自资流融资导致其公允价值与市场价格不一致、市场流动性不足等),或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的有效复制构成不利影响时,或法律法规禁止投资等其他原因导致无法有效复制跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,力求降低跟踪误差。
 六、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,也不保证最低收益。本基金管理人提醒投资者知晓基金投资的“卖者自危”原则,在做出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行承担。敬请投资者投资于本基金前认真阅读本基金的基金合同和招募说明书等相关法律文件。
 特此公告。
 信诚基金管理有限公司
 2016年4月1日

信诚中证800医药指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告

根据《信诚中证800医药指数分级证券投资基金基金合同》关于不定期份额折算的相关规定,当信诚中证800医药指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)之B份额的基金份额净值小于或等于0.250元时,本基金将在基金份额折算日分别对信诚中证800医药指数分级证券投资基金A份额(场内简称:信诚医药,代码:165519)、信诚中证800医药指数分级证券投资基金A份额(场内简称:信诚医药A,代码:150148)、信诚中证800医药指数分级证券投资基金B份额(场内简称:信诚医药B,代码:150149)进行不定期份额折算。

由于近期A股市场波动较大,截至2016年3月31日,医药800B的基金份额净值接近基金合同规定的不定期份额折算的阈值0.250元,在此提请投资者密切关注医药800B份额近期净值的波动情况,并警惕可能出现的风险。

针对可能发生的不定期份额折算,本基金管理人特别提示如下:
 一、由于医药800A份额、医药800B份额在不定期折算前可能存在折溢价交易情形,不定期份额折算后,其所溢价/折价可能产生较大变化。特别提醒参与二级市场买卖医药800B份额近期净值的波动情况,并警惕可能出现的风险。
 二、医药800B份额具有大幅溢价、预期收益较高的特征。不定期份额折算后其溢价水平将大幅缩水,将恢复至初始溢价水平。相应地,医药800B份额的参考净值随市场涨跌而增长或者下降的幅度也会大幅减小。

三、医药800A份额具有预期风险、预期收益较低的特征。当发生合同规定的不定期份额折算时,医药800A持有人的风险特征将发生一定变化,由持有单一的低风险收益特征的医药800A变为同时持有较高风险收益特征的信诚800A与较高风险收益特征的信诚医药A,因此原医药800A持有人预期收益实现的不确定性将增加。此外,信诚医药为跟踪指数的基础份额,其份额净值将随市场涨跌而变化,因此原医药800A持有人还可能承担因市场下跌而遭受损失的风险。

注册地: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南路555号裕景国际B座16层
 法定代表人:张跃伟
 联系人:单丙辉
 电话:(021)-20691832
 传 真:(021)-20691861
 15)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:上海市徐汇区龙田路195号3C座10楼
 法定代表人:其实
 电 话:(021)-54509988
 传 真:(021)-64385308
 16)上海汇付金融服务有限公司
 注册地址:上海市黄浦区西藏中路336号1807-5室
 办公地址:上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼
 法定代表人:张磊
 电 话:(021)-33323998
 传 真:(021)-33323993
 网站:fundbundtrade.com
 客户服务电话:400-820-2819
 17)中信期货有限公司
 注册地址:深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1305室、14层
 办公地址:深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1305室、14层
 法定代表人:张皓
 联系人:洪轶
 电话:(0755-23953913
 网址:http://www.citicsf.com
 18)浙江同花顺基金销售有限公司
 注册地址:浙江省杭州市文二西路1号元茂大厦903
 办公地址:浙江省杭州市西湖区翠柏路7号电子商务产业园2号楼2楼
 法定代表人:凌骥平
 电 话:(0571)-88911818
 传 真:(0571)-88900423
 公司网站:www.5ifund.com
 客服电话:4008-773-773
 19)上海联泰资产管理有限公司
 注册地址:中国(上海)自由贸易试验区富特北路277号3层310室
 办公地址:上海市长寿区金钟路558弄2号楼B座6楼
 法定代表人:吕世龙
 电 话:(021)-51507071
 传 真:(021)-62900663
 网站:http://www.91fund.com.cn
 客服电话:4000-466-788
 20)北京创金启源投资管理有限公司
 注册地址:北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A
 办公地址:北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A
 法定代表人:梁睿
 电 话:(010)-66154828
 传 真:(010)-68067526
 网站:www.5irich.com
 客户服务电话:400-662-818
 21)北京乐融多源投资管理咨询有限公司
 注册地址:北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603
 办公地址:北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603
 法定代表人:董浩
 电话:(010)-65400010
 网站:www.jimifund.com
 客户服务电话:400-068-1176
 22)珠海盈嘉财富管理咨询有限公司
 注册地址:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
 办公地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼
 法定代表人:肖雯
 电话:(020)-89629021
 传真:(020)-89629011
 网站:www.yingm.com.cn
 客户服务电话:(020)-89629066
 23)上海陆金所资产管理有限公司
 注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
 办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
 法定代表人:郭坚
 电话:(021)-20669592
 传真:(021)-22066653
 网站:www.lufunds.com
 客户服务电话:4008219031
 24)泰诚财富基金销售有限公司(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
 邮政编码:116000
 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
 25)大泰金石投资管理有限公司
 注册地址:南京市建邺区江东中路359号国睿大厦一号B区4楼
 办公地址:上海市市长宁区虹桥路1386号文广大厦15楼
 法定代表人:袁颖明
 电 话:(021)-22267995
 传 真:(021)-22268089
 网站:www.dtfunds.com
 客户服务电话:4009282266
 26)上海凯石财富基金销售有限公司
 注册地址:上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼
 办公地址:上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼
 法定代表人:陈继武
 电 话:(021)-63333389
 网站:www.lingxiangfund.com
 客户服务电话:4000178000
 27)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:罗智安
 电 话: 010-67009888-6003
 传 真: 010-67009888-6000
 网站: www.zvcw.com.cn
 客户服务电话:400-001-8811
 2)场内发售机构:深圳证券交易所内具有基金销售业务资格的会员单位,具体名单见本基金发售公告。
 基金管理人可根据有关法律法规要求,根据实际情况,选择其他符合要求的机构代理销售本基金或变更上述代销机构,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
 住所:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
 办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
 负责人:韩朝
 联系电话:(021)31358666
 传真:(021)31358600
 联系人:孙晔
 (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(特殊普通合伙)
 住所: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:戴建华
 电话:8621 2212 2888
 传真:8621 6288 1889
 联系人:王丽荷
 经办注册会计师:王丽荷、黄小熠
 四、基金的名称
 信诚中证800医药指数分级证券投资基金
 基金的类型
 契约型开放式
 本基金的投资目标
 本基金进行数量化指数投资,通过严谨的数量化管理和投资纪律约束,实现对中证800制药与生物科技指数的有效跟踪,为投资者提供一个有效的投资工具。
 七、基金的投资范围
 本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括标的指数的成份股、备选成份股、新股(含首次公开发行和增发)、债券、债券回购、中期票据、银行存款、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许本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)。本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)占基金资产的比例为85%-100%,其中投资于股票的资产不低于基金资产的85%,投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金资产的80%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。
 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。
 八、基金的投资策略
 本基金跟踪中证800医药指数,即原则上按照标的指数的成份股成份权重或其相应权重构建投资组合,并根据标的指数的成份及其权重变化进行相应调整,力争将跟踪误差率与业绩比较基准之间日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差率不超过4%。
 当发生特殊情形(如成份股长期停牌、成份股发生变更、成份股由于自资流融资导致其公允价值与市场价格不一致、市场流动性不足等),或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的有效复制构成不利影响时,或法律法规禁止投资等其他原因导致无法有效复制跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,力求降低跟踪误差。

差。
 基金管理人将对成份股的流动性进行分析,如发现流动性欠佳的一个股将可能采用合理方法寻求替代。基金管理人运用以下策略构造替代投资组合:

(1)基本替代:按照与被替代股票基本及规模相似的原则,选取一揽子标的指数成份股作为替代设备选择;
 (2)相关性检验:计算备选池中各股票与被替代股票日收益率的相关系数并选取与被替代股票相关性较高的股票组成模拟组合,以组合与被替代股票的日收益率序列的相关系数最大化为优化目标,求解组合中替代股票的权重,并构建替代投资组合。

基金管理人可运用股指期货,以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据股指期货管理的原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货的投资,以管理投资组合的系统性风险,改善组合的风险收益特性。此外,本基金还将运用股指期货来对冲特殊情况下的流动性风险以进行有效的风险管理,如大额申购赎回、大量分红等,以及对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险。

基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组,授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项,同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。此外,基金管理人还将做好培训和准备工作。

九、基金的业绩比较基准
 本基金业绩比较基准为:95%×中证800制药与生物科技指数收益率+5%×金融同业存款利率。

十、基金的风险收益特征
 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型基金、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,信诚医药A份额具有预期风险、预期收益较低的特征;信诚医药B份额具有预期风险、预期收益较高的特征。

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2016年1月21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2015年12月31日。

1月21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至至2015年12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	263,523,744.03	93.22
	其中：股票	263,523,744.03	93.22
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	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	—	—
	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	18,473,984.90	6.54
7	其他资产	692,377.76	0.24
8	合计	282,690,106.69	100.00