

信诚至利灵活配置混合型证券投资基金招募说明书摘要

(2018年第1次更新)

基金管理人:中信保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

信诚基金管理有限公司经中国证监会批准于2005年9月30日注册成立。因业务发展需要,经国家工商总局核准,公司名称由“信诚基金管理有限公司”变更为“中信保诚基金管理有限公司”(以下简称“我司”),并由上海市工商行政管理局于2017年12月18日核发新的营业执照。

根据《中华人民共和国合同法》第七十六条的规定,合同当事人名称变动不影响合同义务的履行。本次我司名称变更后,以“信诚基金管理有限公司”或“中信保诚基金管理有限公司”签署的法律文件(包括但不限于公司合同、公告等,以下简称“法律法规”)不受任何影响,我司将按照约定履行权利义务,如原法律文件对生效条件、有效期限进行特别约定的,以原法律文件的说明为准。

信诚至利灵活配置混合型证券投资基金经2016年7月19日中国证监会证监许可[2016]1623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。本招募说明书经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)注册,但中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

证券投资基金(以下简称“基金”)是一种长期投资工具,其主要功能分散投资,降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具,投资人购买基金,既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益,也可能承担基金投资所带来的损失。

基金投资人应当充分了解基金定期定额投资和零存整取等储蓄方式的区别。定期定额投资是引导投资人进行长期投资、平均投资成本的一种简单可行的投资方式,但不能规避基金投资所固有的风险,不能保证投资人获得收益,也不是替代储蓄的等效理财方式。

基金在投资运作过程中可能面临各种风险,既包括市场风险、估值风险,也包括流动性风险、特有风险及其他风险等风险。

本基金为混合型基金,其预期风险、预期收益高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。

投资有风险,投资人在认购(或申购)本基金时应仔细阅读本招募说明书,全面了解本基金的投资理念、投资策略、资产配置、风险控制、资产状况等判断本基金的风险收益特征和产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对认购/申购基金的意愿、时机、数量等投资行为做出独立、谨慎决策,获得基金投资收益,亦承担基金投资中出现的各类风险。

投资人应当认真阅读基金合同、招募说明书等基金信息披露文件,了解本基金的风险收益特征,并根据自身对基金的投资期限、投资期限、投资经验、资产状况等判断本基金的风险收益特征和产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对认购/申购基金的意愿、时机、数量等投资行为做出独立、谨慎决策,获得基金投资收益,亦承担基金投资中出现的各类风险。

基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。本基金的投资业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现,基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”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,由投资人自行承担。

本招募说明书所载内容截止日若无特别说明为2018年3月2日,有关财务数据和净值表现截止日为2017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:中信保诚基金管理有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层

办公地址:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道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: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)	出资比例 (%)
中信银行股份有限公司	9900	49
英国保诚集团(中国)有限公司	9900	49
中国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,工商管理硕士。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理,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、中信保诚基金管理有限公司董事长。

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、信託管理部总经理、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、固有业务审查委员会主任兼天津信唐货币经纪有限责任公司董事长。

Guy Robert STRAPP先生,董事,澳大利亚籍,南科学士。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及投资组合、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。

魏秀彬先生,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)有限公司亚太地区区域合规及合规总监。现任瀚亚投资首席风险官。

吕海生,董事,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、华夏基金管理有限公司副总经理。现任中信保诚基金管理有限公司总经理、首席执行官。

孙麒麟先生,独立董事,南科学士。历任安永会计师事务所(香港)资产管理部计划部亚太区联合领导、安永会计师事务所(旧金山)美国西部资产管理市场计划部领导等职。现任Lattice Securities Trust独立受托人、Nilpon Wealth Bank独立董事、Ironwood Institutional Multi Strategy Fund LLC and Ironwood Multi Strategy Fund LLC独立董事。

夏扶东先生,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. 基金管理人监事会成员

乐于女士,执行董事,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(中国)有限公司人力资源经理。现任中信保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

张翔燕女士,董事长,工商管理硕士。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理,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、中信保诚基金管理有限公司董事长。

吕海生,董事,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。现任中信保诚基金管理有限公司总经理、首席执行官。

桂思毅先生,独立董事,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、中信保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。现任中信保诚基金管理有限公司副总经理、首席财务官,中信信诚资产管理有限公司(中信保诚基金管理有限公司之子公司)董事。

周浩先生,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。现任中信保诚基金管理有限公司督察长、中信信诚资产管理有限公司董事。

5. 基金经理

王颖女士,经济学硕士。曾就职于平安资产管理有限责任公司,担任研究员。2016年9月加入中信保诚基金管理有限公司,担任助理投资经理。现任信诚主题轮动灵活配置混合型证券投资基金、信诚至利灵活配置混合型证券投资基金基金、信诚至鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

担任基金经理:
从任浩先生,于2016年9月2日至2017年9月14日担任此基金的基金经理。

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;
王国强先生,固定收益总监、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:中信银行股份有限公司(简称“中信银行”)
住所:北京市东城区朝阳门北大街9号
办公地址:北京市东城区朝阳门北大街9号
法定代表人:李庆萍
成立时间:1987年4月20日
组织形式:股份有限公司
注册资本:489.35亿元人民币
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发[1987]14号
基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字[2004]125号
联系人:中信银行资产托管部
联系电话:4006800000
传真:010-85233004
客服电话:95558
网址:bank.ecitic.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;代理开放式基金业务;办理黄金业务;黄金进出口;开展证券投资基金、企业年金基金、保险资金、合格境外机构投资者委托业务;经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务;保险兼业代理业务(有效期至2017年09月08日)。(依法须经批准的项目,经相关部门批准后方可开展经营活动)

中信银行(601998.SH,0098.HK)成立于1987年,原名中信实业银行,是中国改革开放中最早成立的新兴商业银行之一,是中国最早参与国内外金融市场融通的商业银行,并先后成为国内资本实力最强而资产规模最大、伴随中国经济的快速发展,中信实业银行在中国金融市场改革的大潮中逐渐成长壮大,于2005年8月,正式更名为“中信银行”。2006年12月,以中国中信集团和中国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。2009年,中信银行成功收购中信国际金融控股有限公司(简称:中信国际)70.32%股权。经过三十年的发展,中信银行已成为国内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股份制商业银行。2009年,中信银行通过了美国AS70内部控制系统并获颁无保留意见的AS70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全有效性全面认可。

(二)主要人员情况

孙德顺先生,中信银行执行董事、行长。孙先生自2016年7月20日起任本行行长。孙先生同时担任中信银行(国际)董事长。此前,孙先生于2014年5月至2016年7月任本行常务副行长;2014年3月起任本行执行董事;2011年12月至2014年5月任本行副行长;2011年10月起任本行党委书记;2010年1月至2011年10月任交通银行北京管理部副总裁兼交通银行北京市分行党委书记、行长;2005年12月至2009年12月任交通银行北京市分行党委书记、行长;1984年5月至2005年11月在中国工商银行海淀区办事处、海淀支行、北京分行、数据中心(北京)等单位工作,期间,1995年12月至2005年11月兼任中国工商银行北京分行行长助理、副行长,1996年1月至2004年4月曾兼任中国工商银行数据中心(北京)总经理;1981年4月至1984年5月就职于中国人民银行。孙先生拥有三十多年的中国银行业从业经验。孙先生毕业于东北财经大学,获经济学硕士学位。

张强先生,中信银行副行长,分管托管业务。张先生自2010年3月起任本行副行长。此前,张先生于2006年4月至2010年3月任本行行长助理、党委委员,期间,2006年4月至2007年3月曾兼任总行公司银行部总经理。张先生2000年1月至2006年4月任本行总行营业部副总经理、常务副总经理和总经理;1990年9月至2000年1月先后在本行信贷部、济南分行和青岛分行工作,曾任总行信贷部副总经理、总经理、分行副行长和行长。自1990年9月至今,张先生一直为本行服务,在中国银行业拥有近三十年从业经历。张先生为高级经济师,先后于中南财经大学(现中南财经政法大学)、辽宁大学获得经济学学士学位、金融学硕士学位。

杨洪先生,现任中信银行资产托管部总经理,硕士研究生学历,高级经济师,教授级注册税务师。先后毕业于四川大学和北京大学工商管理学院。曾供职于中国人民银行四川省分行、中国工商银行四川省分行。1997年加入中信银行,相继任中信银行成都分行信贷部总经理、支行行长,总行零售银行部总经理助理兼市场营销部总经理、资产管理部总经理、中信银行贵阳分行党委书记、行长,总行行政管理部总经理。

(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2017年末,中信银行已托管1443只公开募集证券投资基金,以及基金公司、证券公司资产管理产品、信托产品、企业年金、股权基金、ODII等其他托管资产,托管总规模达8106.67亿元人民币。

(四)基金托管人的内部控制制度

1. 内部控制目标。强化内部控制,确保有关法律法规及规章在基金托管业务中得到全面系统的贯彻执行;建立完善的规章制度和操作程序,保证基金托管业务持续、稳健发展;加强稽核监督,保证高风险的风险监控体系,及时有效地发现、分析、控制和避免风险,确保基金财产安全,维护基金份额持有人的利益。

2. 内部控制控制措施。中信银行总行建立了风险管理委员会、负责全行的风险控制和风险防范工作;托管部内设内控合规岗,专门负责托管部内控合规控制,对基金托管业务的各个环节和工作环节和业务流程进行独立、客观、公正的稽核监督。

3. 内部控制制度。中信银行严格按照《基金法》以及其他法律法规及规章的规定,以控制和防范基金托管业务风险为主线,制定了《中信银行基金托管业务管理办法》、《中信银行基金托管业务内部控制管理办法》和《中信银行托管业务内控检查实施规程》等一系列规章制度,涵盖证券投资基金托管业务的各个环节,保证证券投资基金托管业务合法、合规、持续、稳健发展。

4. 内部控制措施。建立了各项规章制度、操作流程、岗位职责、行为规范等,从制度上、人员上保证基金托管业务稳健发展;建立了安全保管基金财产的物质保障条件,对业务运行场所实行封闭管理,在要害部门和岗位设立了安全保护区,安装了录像、录音监控系统,保证基金信息的安全;建立严密的内部控制防线和业务授权管理等制度,确保所托管的基金财产独立运作;营造良好的内部控制环境,开展多种形式的持续培训,加强职工道德教育。

(五)基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人根据《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同、托管协议和有关法律法规及规章的规定,对基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中载誉的基金业绩表现数据等进行监督和复核。

如基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同和有关法律法规及规章的行为,将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正。在限期内,基金托管人有权随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。基金托管人发现基金管理人有关重大违规行为或违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人将以书面形式报告中国证监会。

三、相关服务机构
(一)基金份额销售机构

1. 直销机构

中信保诚基金管理有限公司及本公司的网上交易平台
住所:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道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:杨德慧

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.citicprufunds.com.cn/>。

2. 其他销售机构

(1)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:上海市徐汇区宛平南路88号金座
法定代表人:其实
公司网站:www.1234567.com.cn

客服电话:400-1818-188
客服务名单详见基金份额发售公告以及基金管理人网站发布的相关公告。

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:中信保诚基金管理有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道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:金琴芳
电话:021-68494788

(三)出具法律意见书的律师事务所
名称:上海源泰律师事务所
注册地址:上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼
办公地址:上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼
负责人:廖海
经办律师:廖海、刘佳
电话:(021)51150298
传真:(021)51150398

联系人:刘佳
(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:上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心

11楼
法定代表人:李丹
电话:021-23238888
传真:021-23238900
联系人:赵钰
经办注册会计师:薛竞、赵钰

四、基金的名称
信诚至利灵活配置混合型证券投资基金
五、基金的类型
混合型开放式

六、基金的投资目标
在严格控制风险的前提下,通过合理的资产配置,综合运用多种投资策略,力争获得超越业绩比较基准的绝对回报。

七、投资范围
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(含国债、金融债、地方政府债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券、证券公司短期公司债券及其他中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、银行存款、同业存单、权证、股指期货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。

基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例为0%~95%;基金持有全部权益的市值不得超过基金资产净值的3%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后,基金应持有的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计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。

如果法律法规对上述比例要求有变更的,以变更后的比例为准,本基金的投资范围做相应调整。

八、基金的投资策略

1. 资产配置策略
本基金主要通过对宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势的分析,在评价未来一段时间股票、债券市场相对收益的基础上,动态优化调整权益类、固定收益类等各类资产的配置。在严格控制风险的前提下,力争获得超越业绩比较基准的绝对回报。

2. 股票投资策略
在灵活的风格资产配置的基础上,本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的上市公司,严选其中安全边际较高的个股构建投资组合;自上而下地分析行业的增长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会;自下而上地研判行业的产品、核心竞争力、管理层、治理结构等;并结合企业基本面和估值水平进行综合的研判,严选安全边际较高的个股。

3. 固定收益投资策略
本基金将根据当前宏观经济形势、金融市场环境,运用基于债券研究的各种投资分析技术,进行个券精选。

4. 证券公司短期公司债券投资策略
本基金管理人将对证券公司短期公司债券发行人基本面的深入调研分析,结合发行人资产负债状况、盈利能力、现金流、经营稳定性以及债券流动性、信用利差、信用评级、违约风险等的综合评估结果,选取具备价格优势和套利机会的优质信用债券进行投资。

5. 资产支持证券投资策略
资产支持证券的定价受市场利率、发行条款、标的资产的结构及质量、提前偿还率等多种因素影响。本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上,对资产支持证券的投资进行风险、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行分析,采取包括收益曲线策略、信用利差曲线策略、预期利率波动率策略等积极主动的投资策略,投资于资产支持证券。

6. 股指期货投资策略
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风险管理的原则,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诸如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理。

7. 权证投资策略
本基金将按照相关法律法规通过利用权证进行套利、避险交易,控制基金组合风险,获取超额收益。本基金进行权证投资时,将在对权证标的证券基本面研究及估值的基础上,结合股价波动率等参数,运用数量化定价模型,确定其合理内在价值,构建交易组合。

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,本基金可以相应调整和相关投资组合,并在招募说明书更新或相关公告中公告。

九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准为:30%×沪深300指数收益率+70%×中证综合债指数收益率。

本基金是一只灵活配置混合型基金,该业绩比较基准可以较好地衡量本基金的业绩表现。

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者市场上出现更加适用于本基金业绩比较基准的指数时,本基金管理人可以在与基金托管人协商一致后变更业绩比较基准并及时公告,但不需要召集基金份额持有人大会。

十、基金的风险收益特征

本基金为混合型基金,其预期风险、预期收益高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。

十一、基金投资组合报告(未经审计)

本基金管理人根据《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同、托管协议及相关法律法规的规定,对基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中载誉的基金业绩表现数据等进行监督和复核。

如基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同和有关法律法规及规章的行为,将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正。在限期内,基金托管人有权随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。基金托管人发现基金管理人有关重大违规行为或违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人将以书面形式报告中国证监会。

三、相关服务机构
(一)基金份额销售机构

1. 直销机构

中信保诚基金管理有限公司及本公司的网上交易平

住所:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道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:杨德慧

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.citicprufunds.com.cn/>。

2. 其他销售机构

(1)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:上海市徐汇区宛平南路88号金座
法定代表人:其实
公司网站:www.1234567.com.cn

客服电话:400-1818-188
客服务名单详见基金份额发售公告以及基金管理人网站发布的相关公告。

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:中信保诚基金管理有限公司

住所:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层

办公地址:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道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:金琴芳
电话:021-68494788

(三)出具法律意见书的律师事务所

名称:上海源泰律师事务所

注册地址:上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼

办公地址:上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼

负责人:廖海
经办律师:廖海、刘佳
电话:(021)51150298
传真:(021)51150398

四、基金的投资目标
在严格控制风险的前提下,通过合理的资产配置,综合运用多种投资策略,力争获得超越业绩比较基准的绝对回报。

五、基金的投资范围
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(含国债、金融债、地方政府债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券、证券公司短期公司债券及其他中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、银行存款、同业存单、权证、股指期货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。

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	6,388,300.00	3.01
2	央行票据	-	-
3	金融债	9,978,000.00	4.30
其中:政策性金融债	9,978,000.00	4.30	
4	企业债	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	资产证券	166,062,000.00	71.61
9	其他	-	-
10	合计	183,068,300.00	78.92

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	111711412	17平安银行CD412	600,000	58,578,000.00	25.25
2	111709277	17浦发银行CD277	500,000	48,270,000.00	20.81
3	111715456	17民生银行CD456	300,000	29,619,000.00	12.77
4	111711520	17平安银行CD520	200,000	19,746,000.00	8.51
5	108601	国开债1703	100,000	9,978,000.00	4.30

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

本基金本报告期末未进行贵金属投资。

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投资。

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

本基金本报告期末未持有股指期货投资。

2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末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) 中国民生银行股份有限公司(以下简称“民生银行”)民生银行南京分行于2017年5月8日收到江苏证监局发出的《关于对中国民生银行南京分行采取责令改正监管措施的决定》,因该分行销售的私募基金“民生加银资产精选6号之紫雪专项资产管理计划”存在以下问题:一是未由投资者书面承诺符合合格投资者条件;二是提供给个别投资者的内部材料部分数据不严谨,有误导投资者之嫌。根据《私募投资基金监督管理暂行办法》(中国证监会令第106号)等相关法律法规,江苏证监局对民生银行南京分行采取责令改正的行政监管措施。

2) 对17民生银行CD456(发行人为中国民生银行股份有限公司)的投资决策程序的说明:本基金管理人定期回顾、长期跟踪研究该资产的信用资质,我们认为,该处违约事项未对民生银行的长期企业经营和投资价值产生实质性影响,对大额定期存单发行人的信用资质和清偿能力无法实质性影响,我们认为对该投资标的的投资严格执行内部投资决策流程,符合法律法规和公司制度的规定。

3) 除此之外,其余本基金投资的前十名证券的发行主体均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。

4) 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。

5) 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
----	----	-------