

# 信诚新悦回报灵活配置混合型证券投资基金招募说明书摘要

(2018年第2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“信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需通知合同的履行。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(包括但不限于公司公告、公告等,以下简称“原法律文件”)不受任何影响,我司将按照本款履行权利义务。如原法律文件对生效条件、有效期限进行特别说明的,以该法律文件的说明为准。

本基金于2015年6月29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,投资人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至日若无特别说明为2018年6月29日,有关财务数据和净值表现截止日为2018年3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一层

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]1142号

组织形式:有限责任公司(中外合资)

注册资本:贰亿元人民币

存续期间:持续经营

经营范围:基金募集、基金销售、资产管理、境外证券投资管理和其他中国证监会许可的其他业务(涉及行政许可的凭许可证经营)

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
中新苏州工业园创业投资有限公司	400	2
合计	20000	100

## 二、主要人员情况

### 1.董事及成员

张翔燕女士,董事长,工商管理硕士。历任中信银行总行综合计划部总经理,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经理,中信控股有限公司业务协调部主任,中信信托有限责任公司副董事长。现任中信保诚基金管理有限公司董事长。

王道先生,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经理、董事会秘书,固有业务审查委员会主任兼天津信盾货币经纪有限责任公司董事长。

Gu 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。

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。

吕涛先生,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门总经理,中信基金管理有限公司(中信证券股份有限公司)总经理,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、中信保诚基金管理有限公司董事长。

孙麟先生,独立董事,商科学士。历任安永会计师事务所(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人,现就中南财经大学金融硕士学士。

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,现就中南财经大学金融系副教授。

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,执行监事,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。现任中信保诚基金管理有限公司首席人力资源官。

### 3.经营管理人员情况

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经理,中信控股有限公司业务协调部主任,中信信托有限责任公司副董事长。现任中信保诚基金管理有限公司董事长。

周浩先生,董事,总经理,工商管理硕士。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,上海航运业基金安全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,中信保诚资产管理有限公司董事。

### 4.基金经理

杨旭先生,理学硕士,文学硕士。曾任美国对冲基金Robust methods公司,担任数量分析师,于华尔街对冲基金WSFA Group公司,担任Global Systematic Alpha Fund助理基金经理。2012年8月加入中信保诚基金,历任助理投资经理,专户投资经理。现就中南财经大学金融硕士,信诚至裕灵活配置混合型证券投资基金基金经理,信诚中证TMT主题指数分级基金,信诚中证信息消费服务指数分级基金,信诚中证智能家居指数分级基金,信诚中证基建工程指数型证券投资基金,信诚至裕灵活配置混合型证券投资基金,信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金,信诚至盈灵活配置混合型证券投资基金,信诚永丰一年定期开放混合型证券投资基金,信诚至润回报灵活配置混合型证券投资基金,信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金,信诚至盈灵活配置混合型证券投资基金,信诚保诚基金管理有限公司董事。

### 5.基金总经理

周浩先生,督察长,法学硕士。历任中国证监会监督委员会主任科员,公职律师、副调研员,上海航运业基金安全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,中信保诚资产管理有限公司董事。

### 6.基金委员会

胡皓先生,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;张光武先生,研究总监,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。

### 7.基金托管人

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“信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需通知合同的履行。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(包括但不限于公司公告、公告等,以下简称“原法律文件”)不受任何影响,我司将按照本款履行权利义务。如原法律文件对生效条件、有效期限进行特别说明的,以该法律文件的说明为准。

本基金于2015年6月29日基金合同正式生效。

### 8.基金的投资目标

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、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、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、资产支持证券、证券公司债及其他经中国证监会允许投资的债券)、债券回购、货币市场工具、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)。

## 二、基金托管人基本情况

名称:中信银行股份有限公司(简称“中信银行”)

住所:北京市朝阳区朝阳门北大街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:李庆海

成立时间:1987年4月20日

组织形式:股份有限公司

注册资本:498.35亿元人民币

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函[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:010-85220024

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;汇兑、售汇业务;代理开放式基金业务;办理黄金业务;黄金进出口;从事证券投资基金、企业年金基金、保险资金、合格境外机构投资者托管业务;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;有从业资格至2017年09月08日)。(依法须经批准的项目,经相关部门批准后依法开展经营活动。)

中信银行(601998.SH,0998.HK)成立于1987年,原名中信实业银行,是中国改革开放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资的商业银行,并以屡创中国现代金融史上第一个第一蜚声海内外。伴随中国经济的快速发展,中信实业银行在中国金融市场改革的大潮中逐渐成长壮大,于2005年8月,正式更名“中信银行”。2006年12月,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,中信银行在上海证券交易所和香港联合交易所同步上市。2009年,中信银行成功收购中信国际金融控股有限公司(简称:中信国金)70.32%股权。经过多年的发展,中信银行已成为国内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S&P600内部控制审定并获得了无保留意见的SA7000审定报告,表明了独立第三方对中信银行托管服务运作流程的风险管理及内部控制的健全有效性全面认可。

九、基金的投资策略

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,在评价未来一段时期股票、债券市场相对收益率的基础上,动态优化调整权益类、固定收益类大类资产的配置,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。

十、基金的估值

在适当的估值方法的基础上,本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质上市公司的投资机会,严控组合中的个股结构性风险,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,把握其投资机会;自下而上地评判企业的产品、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。

十一、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。

十二、股票投资策略

本基金可投资股指期货、权证和其他经中国证监会允许的金融衍生产品。

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幅申赎赎回、大量分红等特殊情况下流动性风险以进行有效的现金管理。

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。本基金将通过权证投资时,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,运用数量化分析模型,确定其内在价值。

十三、主要人员情况

孙德生先生,中信银行执行董事、行长。孙先生自2016年7月20日起任行长。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、党委副书记,2011年10月起任本行党委副书记、纪委书记,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;2006年12月至2009年12月任交通银行北京市分行党委副书记、纪委书记,2005年1月至2006年12月任交通银行北京市分行党委副书记、纪委书记,2004年1月至2005年11月任中国工商银行北京分行行长助理、副行长,1999年1月至2005年11月任中国工商银行北京分行行长助理、副行长,1998年1月至2004年1月兼任中国工商银行北京分行数据中心(北京)总经理,1998年4月至1999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,中信银行执行董事、副行长。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月曾兼任本行公司银行部总经理,中信控股有限公司副经理,中信集团有限公司业务协调部主任,中信信托有限责任公司副董事长。现任中信保诚基金管理有限公司副董事长。

王道先生,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经理、董事会秘书,固有业务审查委员会主任兼天津信盾货币经纪有限责任公司董事长。

Gu 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。

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。

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,现就中南财经大学金融系副教授。

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。

十四、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,包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、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、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、资产支持证券、证券公司债及其他经中国证监会允许投资的债券)、债券回购、货币市场工具、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)。

十五、基金的投资策略

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,在评价未来一段时期股票、债券市场相对收益率的基础上,动态优化调整权益类、固定收益类大类资产的配置,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。

十六、股票投资策略

在适当的估值方法的基础上,本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质上市公司的投资机会,严控组合中的个股结构性风险,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,把握其投资机会;自下而上地评判企业的产品、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。

十七、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。

十八、股票投资策略

本基金可投资股指期货、权证和其他经中国证监会允许的金融衍生产品。