信诚智惠金货币市场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

本基金于2017年8月14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2018年8月14日,有关财务数据和净值表现截止日为2018年6月30日(未经审计)。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

名称:中信保诚基金管理有限公司

注册地址: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

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

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: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、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、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,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、瀚亚投资管理(上海)有限公司董事。

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、瀚亚投资管理(上海)有限公司监事。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。

孙麟麟先生,独立董事,美国籍,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 Trust独立受托人、Nippon Wealth Bank独立董事、Ironwood Institutional Multi Strategy Fund LLC and 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、基金管理人监事会成员

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、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。

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,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,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董事。

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;中信保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。现任中信保诚基金管理有限公司副总经理、首席市场官。

4、督察长

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

吴胤希先生,理学硕士。曾任职于远东国际租赁有限公司,担任投资分析员;于Excel Markets担任外汇交易员;于重庆农村商业银行股份有限公司,担任债券交易员。2016年7月加入中信保诚基金管理有限公司。现任信诚智惠金货币市场基金、中信保诚嘉鑫定期开放债券型发起式证券投资基金、信诚理财28日盈债券型证券投资基金的基金经理。

6、投资决策委员会成员

胡喆女士,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:010-85230024

客服电话:95558

网址:bank.ecitic.com

经营范围:保险兼业代理业务(有效期至2020年09月09日);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托管业务;经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。(企业依法自主选择经营项目,开展经营活动;依法须经批准的项目,经相关部门批准后依批准的内容开展经营活动;不得从事本市产业政策禁止和限制类项目的经营活动。)

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资的商业银行,并以屡创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,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。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月起任本行党委副书记;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、海淀区支行、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月任中国工商银行北京分行行长助理、副行长,1999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。

杨毓先生,中信银行副行长,分管托管业务。杨先生自2015年7月起任本行党委委员,2015年12月起任本行副行长。此前,杨先生2011年3月至2015年6月任中国建设银行江苏省分行党委书记、行长;2006年7月至2011年2月任中国建设银行河北省分行党委书记、行长;1982年8月至2006年6月在中国建设银行河南省分行工作,历任计财处副处长,信阳分行副行长、党委委员,计财处处长,郑州市铁道分行党委书记、行长,郑州分行党委书记、行长,河南省分行党委副书记、副行长(主持工作)。杨先生为高级经济师,研究生学历,管理学博士。

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,教授级注册咨询师。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、贵宾理财部总经理、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2018年6月末,中信银行已托管154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、QDII等其他托管资产,托管总规模达到8.56万亿元人民币。

三、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1、直销机构

中信保诚基金管理有限公司及其网上交易平台

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

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

电话:(021)6864 9788

联系人:蒋焱

投资人可以通过基金管理人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基金管理人网站公告。网上交易网址:http://www.citicprufunds.com.cn/。

2、其他销售机构

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。

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

注册地址: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

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:金芬泉

电话:021-68649788

(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:021-23238800

联系人:赵钰

经办注册会计师:陈熹、赵钰

四、基金的名称

信诚智惠金货币市场基金

五、基金的类型

货币型

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,期限在一年以内(含一年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单,剩余期限在397天以内(含397天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券,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。

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人创造稳定的收益。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、政策取向等跟踪分析,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、债券市场与资本市场资金互动等,合理预期市场利率曲线动态变化,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,合理运用量化模型,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。作为现金管理工具,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,以确定本基金的流动性目标。在此基础上,基金管理人在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;从收益性角度来说,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,寻找具有投资价值的投资品种,增持相对低估、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的债券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,在具体的券种选择上,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离的原因。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结构化管理。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。

6、资产支持证券的投资策略

本基金将综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成和质量等因素,研究资产支持证券的收益和风险匹配情况。采用数量化的定价模型来跟踪债券的价格走势,在严格控制投资风险的基础上选择合适的投资对象以获得稳定收益。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准:人民币活期存款利率(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2018年7月18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2018年6月30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	35,856,857.78	71.26
	其中:债券	35,856,857.78	71.26
	资产支持证券	–	–
2	买入返售金融资产	–	–
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
3	银行存款和结算备付金合计	14,405,329.26	28.63
4	其他资产	56,907.59	0.11
5	合计	50,319,094.63	100.00

2. 报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	–	3.77
	其中:买断式回购融资	–	–
2	报告期末债券回购融资余额	–	–
	其中:买断式回购融资	–	–

报告期内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。

5.2.1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	60
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	62
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	17

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,以规避较长期限债券的利率风险。

2) 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存续期违规超过120天的情况.

3) 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	48.59	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
2	30天(含)—60天	19.86	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
3	60天(含)—90天	19.74	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
4	90天(含)—120天	–	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
5	120天(含)—397天(含)	11.99	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
	合计	100.18	–

4. 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本基金本报告期内未出现投资组合平均剩余存续期违规超过240天的情况.

5. 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	国家债券	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	6,017,151.98	11.99
	其中:政策性金融债	6,017,151.98	11.99
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	同业存单	29,839,705.80	59.47
8	其他	–	–
9	合计	35,856,857.78	71.46
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	–	–

6. 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	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111816196	18上海银行CD196	100,000	9,973,335.76	19.88
2	111781992	17广州农村商业银行CD137	100,000	9,962,892.28	19.86
3	111899507	18杭州银行CD046	100,000	9,903,477.76	19.74
4	018005	国开1701	60,000	6,017,151.98	11.99

本基金本报告期末仅持有上述债券投资。

7. “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	–
报告期内偏离度的最高值	0.1263%
报告期内偏离度的最低值	-0.0326%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0402%

1) 报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本基金本报告期内未出现负偏离度的绝对值达到0.25%的情况.

2) 报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本基金本报告期内未出现正偏离度的绝对值达到0.5%的情况.

8. 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。

9. 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) 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的说明

2017年11月3日,中国银监会嘉兴监管分局行政处罚信息公开表显示,杭州银行嘉兴分行存在发放用途不真实贷款;信贷资金挪用违法违规行为,嘉兴监管分局对其罚款人民币40万元。

2017年11月2日,中国人民银行上海分行公布行政处罚信息显示,杭州银行股份有限公司上海分行违反银行结算账户业务规定,给予其警告,并处以罚款人民币15000元。

2017年12月27日,银监会发布的浙江监管局行政处罚信息公开表,杭州银行存在个人消费贷款资金流入股市;虚增存贷款;贷款“三查”不到位;办理未发生现金转移的存取现业务等违法违规行为,银监会浙江监管局对其罚款人民币140万元。

对18杭州银行CD046的投资决策程序的说明:本基金管理人长期跟踪研究该公司债的发行主体,我们认为,上述处罚事项未对杭州银行的长期企业经营和投资价值产生实质性影响,并且估值水平已反映了行业和公司经营风险。我们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。

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。

3) 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,289.71
2	应收证券清算款	–
3	应收利息	55,617.88
4	应收申购款	–
5	其他应收款	–
6	待摊费用	–
7	其他	–
8	合计	56,907.59

4) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因,投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

十二、基金的业绩

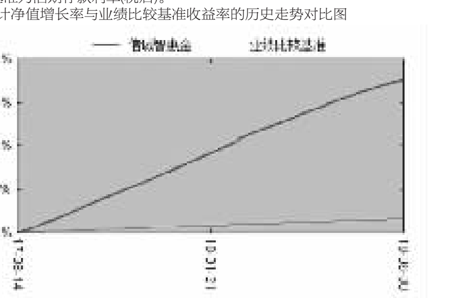
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。基金业绩数据截至2018年6月30日。

(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	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2017年8月14日至2017年12月31日	1.5777%	0.0018%	0.1342%	–	1.4435%	0.0018%
2017年8月14日至2018年6月30日	3.5323%	0.0038%	0.3078%	–	3.2245%	0.0038%

注:业绩比较基准为活期存款利率(税后)。

(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.基金合同生效起至本报告期末不满一年(本基金合同生效日为2017年8月14日)。

2.本基金建仓期自2017年8月14日至2018年2月14日, 建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

十三、费用概览

(一) 与基金运作有关的费用

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、仲裁费和诉讼费;

(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)基金的账户开户费用、账户维护费用;

(10)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0.22%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为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起第3个工作日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)基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.08%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×年托管费率÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人复核后于次月首日起第3个工作日从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

(3)基金销售服务费

本基金年销售服务费率为0.15%,销售服务费计提的计算公式具体如下:

H=E×年销售服务费率÷当年天数

H为每日基金份额应计提的基金销售服务费

E为前一日基金份额的基金资产净值

基金销售服务费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人复核后于次月首日起第3个工作日从基金财产中一次性支付给登记机构,由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类”中第4-10项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

3、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

(1)基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;

(2)基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

(3)《基金合同》生效前的相关费用;

(4)其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

(二)与基金销售有关的费用

本基金在一般情况下不收取申购费用和赎回费用,但是出现以下情形之一:

(1)基金持有的现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计低于5%且偏离度为负时;

(2)当本基金前10名基金份额持有人的持有份额合计超过基金总份额50%,且本基金投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计低于10%且偏离度为负时;

为确保基金平稳运作,避免诱发系统性风险,对当日单个基金份额持有人申请赎回基金份额超过基金总份额的1%以上的赎回申请(超过基金总份额1%以上的部分)征收1%的强制赎回费用,并将上述赎回费用全额计入基金资产。基金管理人与基金托管人协商确认上述做法无益于基金利益最大化的情形除外。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其它有关法律法规的要求,结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动,对原《信诚智惠金货币市场基金招募说明书》进行了更新,主要更新的内容如下:

1. 在“重要提示”部分更新了相应日期。
2. 在“三、基金管理人”中的“主要人员情况”部分,更新了相关成员的内容。
3. 在“四、基金托管人”中,根据实际情况更新了基金托管人的相关信息;
4. 在“五、相关服务机构”部分,根据实际情况对会计师事务所的相关信息进行了更新。
5. 在“九、基金的投资”部分,更新了“基金投资组合报告”,财务数据截至2018年6月30日。
6. 在“十、基金的业绩”部分,更新了该节的内容,数据截止至2018年6月30日。
7. 在“二十一、对基金份额持有人的服务”部分,更新了网上交易及对账单服务内容。
8. 在“二十二、其他应披露事项”部分,披露了自2018年2月15日以来涉及本基金的相关公告。

中信保诚基金管理有限公司
2018年9月27日

关于中信保诚稳达债券型证券投资基金提高份额净值精度的公告

中信保诚稳达债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)于2018年9月26日发生大额赎回。为确保基金持有人利益不因份额净值的小数点保留精度受到不利影响,经本公司与托管人协商一致,决定自2018年9月26日起提高本基金的基金份额净值精度至小数点后8位, 小数点后第9位四舍五入。本基金将自大额赎回对基金份额持有人利益不再产生重大影响时,恢复基金合同约定的净值精度,届时不再另行公告。

投资者可通过以下途径咨询有关详情:

中信保诚基金管理有限公司网站:www.citicprufunds.com.cn

客户服务电话:400-666-0066

风险提示:本公司承诺以诚实信用、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。基金的过往业绩并不预示其未来表现。投资者投资于本公司管理的基金时应认真阅读《基金合同》、《招募说明书》等法律文件,并注意投资风险。

特此公告。

中信保诚基金管理有限公司
2018年9月27日

信诚中证信息安全指数分级证券投资基金之信息安B交易价格波动提示公告

近期,中信保诚基金管理有限公司(以下简称“本基金管理人”)旗下信诚中证信息安全指数分级证券投资基金B 份额(场内简称:信息安B,代码:150310)二级市场交易价格连续大幅波动,2018年9月25日,信息安B二级市场收盘价为0.399元,相对于当日0.308元的基金份额净值,溢价幅度达到29.5%。截止2018年9月26日,信息安B二级市场收盘价为0.418元,明显高于基金份额参考净值,投资者如果盲目投资,可能遭受重大损失

为此,本基金管理人提示如下:

1、信息安B具有预期风险、预期收益较高的特征。由于信息安B内含杠杆机制的设计,信息安B基金份额参考净值的变动幅度将大于信诚信息安全份额(场内简称:信息安全,基础份额,代码:165523)净值和信诚信息安全A份额(场内简称:信息安A,代码:150309)参考净值的变动幅度,即信息安B的波动性要高于其他两类份额,其承担的风险也较高。信息安B的持有人会因杠杆倍数的变化而承担不同程度的投资风险。

2、信息安B的交易价格,除了有份额参考净值变化的风险外,还会受到市场的系统性风险、流动性风险等其他风险影响,可能使投资人面临损失。

3、截至2018年9月26日,信息安B的基金份额参考净值接近基金合同约定的不定期份额折算阈值。不定期份额折算后,信息安B的溢价率可能发生较大变化。

特提请参与二级市场交易的投资者注意高溢价所带来的风险。

4、截至本公告披露日,信诚中证信息安全指数分级证券投资基金运作正常。本基金管理人仍将严格按照法律法规及基金合同进行投资运作。

5、截至本公告披露日,信诚中证信息安全指数分级证券投资基金无其他应披露而未披露的重大信息。本基金管理人仍将严格按照有关规定和要求,及时做好信息披露工作。

6、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。投资者投资于本基金前应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。

敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

中信保诚基金管理有限公司
2018年9月27日

中信保诚基金管理有限公司关于中信保诚新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金开展基金赎回费费率优惠活动的公告

为了更好地向投资者提供投资理财服务,满足投资者的理财需求,根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定和《中信保诚新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关约定,中信保诚基金管理有限公司(以下简称“本公司”)决定自2018年10月8日起至2018年11月8日期间对赎回中信保诚新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金份额(基金代码:006209,以下简称“本基金”)的投资者给予赎回费费率优惠,具体安排如下:

一、适用渠道

本基金直销柜台,以及代销渠道:光大证券

二、优惠活动时间

本次优惠活动时间自2018年10月8日起至2018年11月8日。

三、优惠活动内容

优惠活动期间,对通过本基金适用销售渠道办理赎回(含转换转出)本基金业务的,在赎回(含转换转出)时享有赎回费率优惠,具体如下:

1、赎回费调整,具体如下:

持有时间	原赎回费率	原计入基金资产比例	优惠后赎回费率	优惠后计入基金资产比例
Y〈7天	1.5%	100%	1.5%	100%
7天≤Y〈30天	0.75%	100%	0.75%	100%
30天≤Y〈3个月	0.50%	75%	0.375%	100%
3个月≤Y〈6个月	0.50%	50%	0.25%	100%
6个月≤Y〈1年	0.50%	25%	0.125%	100%
1年≤Y〈2年	0.25%	25%	0.0625%	100%
Y≥2年	0	25%	0	100%

(本次优惠后的赎回费归入基金资产的部分不低于基金招募说明书中相对应需计入基金资产部分的比例规定,不会对基金份额持有人利益造成不利影响。)

四、重要提示

1、本费率优惠仅适用于通过本基金适用销售渠道赎回(含转换转出)本基金的投资者。本次优惠活动结束后,基金赎回费费率继续按原标准实施。

2、凡在活动时间及适用产品范围以外的基金赎回不享受以上优惠。

3、本次优惠活动内容发生调整的,以本公司相关公告为准。

4、本公告的解释权归本公司所有。投资者欲了解本基金的详细情况,请仔细阅读本基金的基金合同、招募说明书及其更新等法律文件。

五、投资者可通过以下途径了解或咨询详请:

中信保诚基金管理有限公司

公司网址:www.citicprufunds.com.cn

客服电话:400-666-0066

六、风险提示

本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。投资人应当认真阅读《基金合同》、《招募说明书》等基金法律文件,了解基金的风险收益特征,并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资人的风险承受能力相适应。

特此公告。

中信保诚基金管理有限公司
2018年9月27日

中信保诚新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告

公告送出日期:2018年9月27日

1 公告基本信息

基金名称	中信保诚新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	中信保诚新蓝筹	
基金主代码	006209	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年9月4日	
基金管理人名称	中信保诚基金管理有限公司	
基金托管人名称	中国建设银行股份有限公司	
基金注册登记机构名称	中信保诚基金管理有限公司	
公告依据	《中信保诚新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《中信保诚新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》	
申购起始日	2018年10月8日	
赎回起始日	2018年10月8日	
转换转入起始日	2018年10月8日	
转换转出起始日	2018年10月8日	
定期定额投资起始日	2018年10月8日	
是否开放申购、赎回、转换、定期定额投资	是	是

2 日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务的办理时间

投资人在开放日办理中信保诚新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)基金份额的申购、赎回、转换、定期定额投资业务,具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所及相关期货交易所的正常交易日的交易时间,若本基金参与港股通交易且该工作日为非港股通交易日时,则基金管理人可根据实际情况决定本基金是否开放申购、赎回及转换业务,具体以届时提前发布的公告为准。但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

基金合同生效后,若出现新的证券/期货交易市场、证券/期货交易所交易时间变更或其他特殊情况,基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整,但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的,其基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。

3 日常申购业务

3.1 申购金额限制

通过销售机构申购本基金的单笔最低金额为100元(含申购费)人民币。通过本公司直销中心首次申购最低金额为10万元(含申购费)人民币,追加申购每笔最低金额100元(含申购费)人民币。已有认购本基金记录的投资人不受首次申购最低金额的限制,但受追加申购最低金额的限制。通过本公司网上交易平台办理本基金申购业务的不受直销中心最低申购金额的限制,最低申购金额为单笔100元(含申购费)。本基金直销中心单笔申购最低金额可由基金管理人酌情调整。其它销售机构网点的投资人欲转入直销网点进行交易要受直销网点最低金额的限制。

当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时,基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施,切实保护存量基金份额持有人的合法权益。具体请参见相关公告。

基金管理人可在法律法规允许的情况下,调整上述规定申购金额的数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

3.2 申购费率

1、基金份额申购费用由投资人承担,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

2、本基金申购费率如下:

单笔申购金额(含申购费)	申购费率
M〈 50万	1.50%
50万 ≤ M〈 200万	1.20%
200万 ≤ M〈 500万	0.80%
M ≥ 500万	1000元/笔

(注:M:申购金额;单位:元)

4 日常赎回业务

4.1 赎回份额限制

基金份额持有人在销售机构赎回时,每笔赎回申请不得低于100份;基金份额持有人赎回时或赎回后将导致在销售机构(网点)保留的基金份额余额不足100份的,需一并全部赎回。基金份额持有人每个交易账户的最低份额余额为100份。基金份额持有人因赎回、转换等原因导致其基金账户内剩余的基金份额低于100份时,登记系统可对该剩余的基金份额自动进行强制赎回处理。

基金管理人可在法律法规允许的情况下,调整上述规定赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

4.2 赎回费率

基金份额的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回基金份额时收取。基金管理人可以在不违反法律法规的情形下,确定赎回费用归入基金财产的比例,未计入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

对持续持有期少于7日的投资人收取不低于1.5%的赎回费,对持续持有期少于30日的投资人收取不低于0.75%的赎回费,并将上述赎回费全额计入基金财产;对持续持有期少于3个月的投资人收取不低于0.5%的赎回费,并将不低于赎回费总额的75%计入基金财产;对持续持有期不少于3个月但少于6个月的投资人收取不低于0.5%的赎回费,并将不低于赎回费总额的50%计入基金财产;对持续持有期不少于6个月的投资人,将不低于赎回费总额的25%计入基金财产;其余用于支付登记费和其他必要的手续费。具体赎回费率结构如下:

持续持有期(Y)	赎回费率
Y〈7天	1.50%
7天≤Y〈30天	0.75%
30天≤Y〈1年	0.50%
1年≤Y〈2年	0.25%
Y≥2年	0

注:1年指365天,2年指730天

5 日常转换业务

5.1 转换费率

1、基金的转换按照转出基金的赎回费用加上转出与转入基金申购费用补差的标准收取费用。(1)转出基金赎回费:基于每份转出基金份额在转换申请日的适用赎回费率,计算转出基金赎回费。(2)申购费补差:两只前端收费基金(包括申购费为零的基金)之间的转换,按照转出金额分别计算转换申请日转出基金和转入基金的申购费。如转入基金的申购费大于转出基金申购费,则按差额收取申购补差费;如转入基金的申购费小于等于转出基金申购费,则不收取申购补差费。

具体申购费率标准请见各基金的相关法律文件和最新公告。基金转换费用由基金持有人承担。

2、基金转换的计算公式如下:

转出总额=转出份额×转出基金当日基金份额净值

转出基金赎回费=转出总额×转出基金赎回费率

转出净额=转出总额-转出基金赎回费

申购费补差(外扣)=转出净额×转入基金的申购费率/(1+转入基金申购费率)-转出净额×转出基金申购费率/(1+转出基金申购费率)

由非货币型基金转出时:

转入份额=(转出净额-补差费)/转入基金当日基金份额净值

由货币型基金转出时:

转入份额=(转出净额-补差费+结转收益)/转入基金当日基金份额净值

5.2 其他与转换相关的事项

(1)适用基金范围

本基金转换业务目前暂适用于本基金与本公司募集管理的以下基金:信诚四季红混合型证券投资基金、信诚精萃成长混合型证券投资基金、信诚盛世蓝筹混合型证券投资基金、信诚三得益债券型证券投资基金、信诚优胜精选混合型证券投资基金、信诚中小盘混合型证券投资基金、信诚货币市场证券投资基金、信诚优质纯债债券型证券投资基金、信诚新兴产业混合型证券投资基金、信诚幸福消费混合型证券投资基金、信诚新选回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚新锐回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚稳健债券型证券投资基金、信诚稳瑞债券型证券投资基金、信诚稳利债券型证券投资基金、信诚稳益债券型证券投资基金、信诚至裕灵活配置混合型证券投资基金、信诚惠盈债券型证券投资基金、信诚至利灵活配置混合型证券投资基金、信诚至选灵活配置混合型证券投资基金、信诚至瑞灵活配置混合型证券投资基金、信诚稳丰债券型证券投资基金、信诚稳悦债券型证券投资基金、信诚至远灵活配置混合型证券投资基金、信诚稳泰债券型证券投资基金、信诚景瑞债券型证券投资基金、信诚稳鑫债券型证券投资基金、信诚至诚灵活配置混合型证券投资基金、信诚新悦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、信诚新泽回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚量化阿尔法股票型证券投资基金、信诚年年有余定期开放债券型证券投资基金、信诚新双盈分级债券型证券投资基金、中信保诚稳鸿债券型证券投资基金、中信保诚至兴灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚稳达债券型证券投资基金之间的基金份额转换业务(只适用于前端收费模式)。

本公司今后募集管理的开放式基金将根据具体情况确定是否适用基金转换业务。具体信息可参见届时相关公告文件或致电本公司客户服务电话400-666-0066进行咨询。

(2)业务办理时间

投资者可在对应转换转入与转换转出基金的开放日申请办理基金转换业务,具体办理时间与基金申购、赎回业务办理时间相同(本公司公告暂停申购、赎回时除外)。

(3)有关基金转换业务的具体业务规则敬请查询2015年2月9日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站的《信诚基金管理有限公司关于调整开放式基金转换业务规则的公告》。

6 定期定额投资业务

1、投资者可以与本公司网上直销渠道或下述代销机构约定每月固定扣款金额。

2、投资者通过中信保诚网上直销系统对本基金进行定期定额申购,根据支付渠道不同有如下费率优惠:

(1)招商银行卡:原申购费率高于 0.6%的,享受费率4折优惠,若优惠折扣后费率低于 0.6%,则按 0.6%执行;原申购费率等于或低于 0.6%的,则按原费率执行。

(2)银联通三方支付:原申购费率高于 0.6%的,享受费率4折优惠,若优惠折扣后费率低于0.6%,则按 0.6%执行;原申购费率等于或低于 0.6%的,则按原费率执行。

3、本基金同时开通定期定额投资业务的代销机构包括:中国建设银行股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信证券(山东)有限责任公司、中信期货有限公司、中信建投证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、申万宏源西部证券有限公司、中国银河证券股份有限公司 、华福证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司、平安证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、联讯证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、第一创业证券股份有限公司、太平洋证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、国融证券股份有限公司、北京恒天明泽基金销售有限公司、民商基金销售(上海)有限公司、北京蛋卷基金销售有限公司、深圳前海凯恩斯基金销售有限公司、天津万家财富资产管理有限公司、济安财富(北京)资本管理有限公司、中天证券股份有限公司、上海天天基金销售有限公司、上海好买基金销售有限公司、深圳众禄基金销售股份有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、北京虹点基金销售有限公司、珠海盈米财富管理有限公司、上海陆金所基金销售有限公司、北京新浪仓石基金销售有限公司、南京苏宁基金销售有限公司、北京肯特瑞财富投资管理有限公司、上海挖财金融信息服务有限公司、北京植信基金销售有限公司等基金代销机构的营业网点。

4、投资者可以与上述代销机构或本公司网上直销渠道约定每月固定扣款金额。

5、有关定期定额投资的具体业务规则请查询2008年10月6日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站的《信诚基金管理有限公司关于旗下基金定期定额投资业务规则的公告》。

7 基金销售机构

7.1 场外销售机构

7.1.1 直销机构

中信保诚基金管理有限公司

(1)直销柜台: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,邮编200120,直销传真:021-50120895,客服热线:400-666-0066。

(2)网上直销平台:交易网址http://www.citicprufunds.com.cn

(3)关于网上直销平台实行的费率优惠:

投资者通过中信保诚基金网上直销系统申购本基金,根据支付渠道不同有如下费率优惠:

1) 招商银行卡:原申购费率高于 0.6%的,享受费率4折优惠,若优惠折扣后费率低于 0.6%,则按 0.6%执行;原申购费率等于或低于 0.6%的,则按原费率执行。

2) 银联通三方支付:原申购费率高于 0.6%的,享受费率4折优惠,若优惠折扣后费率低于0.6%,则按 0.6%执行;原申购费率等于或低于 0.6%的,则按原费率执行。

7.1.2场外非直销机构

(1)场外非直销机构包括:中国建设银行股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信证券(山东)有限责任公司、中信期货有限公司、中信建投证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、申万宏源西部证券有限公司、中国银河证券股份有限公司、华福证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司、平安证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、联讯证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、第一创业证券股份有限公司、太平洋证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、国融证券股份有限公司、北京恒天明泽基金销售有限公司、民商基金销售(上海)有限公司、北京蛋卷基金销售有限公司、深圳前海凯恩斯基金销售有限公司、天津万家财富资产管理有限公司、济安财富(北京)资本管理有限公司、中天证券股份有限公司、上海天天基金销售有限公司、上海好买基金销售有限公司、深圳众禄基金销售股份有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、北京虹点基金销售有限公司、珠海盈米财富管理有限公司、上海陆金所基金销售有限公司、北京新浪仓石基金销售有限公司、南京苏宁基金销售有限公司、北京肯特瑞财富投资管理有限公司、上海挖财金融信息服务有限公司、北京植信基金销售有限公司等基金代销机构的营业网点(具体申购赎回安排和网点名单请查阅本基金招募说明书和发售公告以及其他相关的业务公告)。

(2)关于场外非直销机构实行的费率优惠:

1)自2018年10月8日起,投资者通过上海天天基金销售有限公司、上海好买基金销售有限公司、深圳众禄基金销售股份有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、北京虹点基金销售有限公司、珠海盈米财富管理有限公司、上海陆金所基金销售有限公司、北京新浪仓石基金销售有限公司、南京苏宁基金销售有限公司、北京肯特瑞财富投资管理有限公司、上海挖财金融信息服务有限公司、北京植信基金销售有限公司办理本基金的申购业务的,放开前端申购费率折扣限制,具体费率详情以前述销售机构公布信息为准。

2)自2018年10月8日起至2018年11月8日期间,投资者通过光大证券股份有限公司办理本基金的赎回业务,享受赎回费率优惠活动,具体活动详情请见《中信保诚基金管理有限公司关于中信保诚新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金开展基金赎回费费率优惠活动的公告》。

8 基金份额净值公告/基金收益公告的披露安排

自2018年10月8日起,基金管理人应当在每个开放日的次日,通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介,披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日,将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒介上。

9 其他需要提示的事项

(1)基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式,并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

(2)基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定,并在不对基金份额持有人权益产生实质性不利影响的情形下根据市场情况制定基金促销计划,针对投资人定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,按相关监管部门要求履行必要手续后,基金管理人可以适当调低基金申购费率和赎回费率。

(3)有关本基金开放申购、赎回、转换、定期定额投资业务的具体规定若有变化,本公司将另行公告。

(4)本公告仅对本基金的开放申购、赎回、转换、定期定额投资业务的有关事项予以说明。投资者欲了解本基金的详细情况,可通过本公司网站或销售机构查阅《中信保诚新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《中信保诚新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》等相关资料,投资者亦可致电中信保诚基金管理有限公司客户服务电话400-666-0066,或登录本公司网站www.citicprufunds.com.cn进行查询。

(5)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。投资者于投资前应认真阅读本基金的《基金合同》和《招募说明书》,了解本基金的风险收益特征,并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资人的风险承受能力相适应。敬请投资者留意投资风险。

特此公告。

中信保诚基金管理有限公司
2018年9月27日