信诚新泽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:华夏银行股份有限公司

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”签署的的法律文件(包括但不限于公司合同、公告等,以下简称“原法律文件”)不受任何影响,我司将按照约定履行权利义务。如原法律文件在对生效条件、有效期限进行特别说明的,以原法律文件的说明为准。

本基金于2017年6月27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2017年12月27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,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,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,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、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

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

杨旭先生,理学硕士、文学硕士。曾任职于美国对冲基金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。现任量化投资副总监,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、信诚中证基建工程指数型证券投资基金(LOF)、信诚至裕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、信诚新兴产业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、信诚至信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、信诚至盛灵活配置混合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;
董毓先生,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: 华夏银行股份有限公司
住所: 北京市东城区建国门内大街22号(100005)
办公地址:北京市东城区建国门内大街22号(100005)
法定代表人:李民吉
成立时间:1992年10月14日
组织形式:股份有限公司
注册资本: 10,685,572,211元人民币
批准设立机关和设立文号: 中国人民银行[银复(1992)391号]
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基金字[2005]25号
联系人:郑鹏
电话:(010)85238667
传真:(010)85238680

(二)主要人员情况

华夏银行资产托管部内设市场一室、市场二室、风险与合规管理室和运营室4个职能处室。资产托管部共有员工38人,高管人员拥有硕士以上学位或高级职称。

(三)基金托管业务经营情况

华夏银行于2005年2月23日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核准,获得证券投资基金托管资格,是《证券投资基金法》和《证券投资基金托管资格管理办法》实施后取得证券投资基金托管资格的第一家银行。自成立以来,华夏银行资产托管部本着“诚实信用、勤勉尽责”的行业精神,始终遵循“安全保管基金资产,提供优质托管服务”的原则,坚持以客户为中心的服务理念,依托严格的内控管理、先进的技术系统、优秀的业务团队、丰富的业务经验,严格履行法律和托管协议所规定的各项义务,为广大基金份额持有人和资产管理机构提供安全、高效、专业的托管服务,取得了优异业绩。截至2017年6月末,托管证券投资基金、券商资产管理计划、银行理财、资产支持专项计划、股权投资基金等各类产品合计1,197只,托管规模达到24,559.27亿元,同比增长52.45%。

三、相关服务机构

(一)销售机构及联系人

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
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:杨德智

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)华夏银行股份有限公司
住所:北京市东城区建国门内大街 22 号
办公地址:北京市东城区建国门内大街 22 号
法定代表人:李民吉
(2)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
电 话:021-54660526
传 真:021-54660501
公司网址:www.1234567.com.cn
客服电话:400-1818-188
(3)天津万家财富资产管理有限公司
注册地址:天津自贸区(中心商务区)迎宾大道1988号滨海浙商大厦公寓2-2413室
办公地址:北京西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦5层
法定代表人:李修辉
http://www.wanjiawealth.com
(4)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:洪诚
电话:0755-23953913
网址:http://www.citicsf.com/
(5)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168号上海银行大厦29楼
法定代表人:杨德红
联系人:朱雅崴
电话:021-38676767
客户服务热线:95521
网址:www.gtja.com
(6)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
联系人:魏明
联系电话:(010)85130579
开放式基金咨询电话:4008888108
网址:www.csc108.com
(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
法定代表人:宫少林
联系人:黄婵君
电话:0755-82960167
传真:(0755)82943636
网址:www.newone.com.cn
客服电话:95565、4008888111
(8)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号中信证券大厦
法定代表人:王东明
联系人:侯艳红
电话:010-60838995
传真:0755-23835861、010-60836029
网址:http://www.cs.ecitic.com
(9)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:邓颜
联系电话:010-66568292
客户服务电话:4008-888-888
网站:www.chinastock.com.cn
(10)申万宏源证券有限公司
注册地址:上海市徐汇区长乐路989号45层
办公地址:上海市徐汇区长乐路989号45层
法定代表人:李梅
联系人:黄莹
联系电话:021-33389888
传真:021-33388224
客服电话:95523或4008895523
网址:www.swhysc.com
(11)万联证券股份有限公司
办公地址:广东省广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F座18层
法定代表人:张建军
客服电话:4008888133
网址:http://www.wlzq.cn
(12)中信证券(山东)有限责任公司
注册地址: 青岛市崂山苗岭路29号澳柯玛大厦15层(1507-1510室)
办公地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层(266061)
法定代表人:杨宝林
联系人:吴忠超
联系电话:0532-85022326
客服电话:95548
网址:www.zxwt.com.cn
(13)光大证券股份有限公司
注册地址:上海市静安区新闸路1508号
办公地址:上海市静安区新闸路1508号
法定代表人:薛峰
客服电话:4008888788、10108998
联系人:刘晨
联系电话:021-22169081
传真:021-22169134
网址:www.ebscn.com
(14)申万宏源西部证券有限公司
注册地址:新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室
办公地址:新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室(邮编:830002)
法定代表人:韩志谦
电话:0991-2307105
传真:0991-2301927
客户服务电话:400-800-0562
网址:www.hysec.com
联系人:王怀春
(15)中泰证券股份有限公司
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
联系电话:0531-68889155
传真:0531-81283900
客服电话:95538
公司网址:www.zts.com.cn

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:薛竞、赵钰

四、基金的名称

信诚新泽回报灵活配置混合型证券投资基金

五、基金的类型

契约型开放式

六、基金的投资目标

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。

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、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、资产支持证券、证券公司短期债及其他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)。

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%;基金持有全部权证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交易保证金后,基金保留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%。

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

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、债券市场相对收益率的基础上,动态优化调整权益类、固定收益类等大类资产的配置。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。

2、股票投资策略

在灵活的类别资产配置的基础上,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。

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、股指期货、权证等投资策略

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额申赎赎回、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。

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进行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更新相关投资策略,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

本基金的业绩比较基准为:一年期银行定期存款利率(税后)+3%,其中,一年期银行定期存款利率是指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。

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。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据基金合同的约定,于2018年1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至2017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	71,835,890.45	33.18
	其中:股票	71,835,890.45	33.18
2	固定收益投资	118,464,000.00	54.72
	其中:债券	118,464,000.00	54.72
	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	25,799,867.08	11.92
7	其他资产	395,050.70	0.18
8	合计	216,494,808.23	100.00

2 报告期末按行业分类的股票投资组合

1)报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	5,998,205.00	2.78
C	制造业	31,365,301.71	14.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,143.20	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	5,423,398.00	2.51
G	交通运输、仓储和邮政业	17,957.94	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	14,163,128.60	6.55
K	房地产业	14,851,756.00	6.87
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	71,835,890.45	33.25

2)报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例(%)
-	-	-
合计	-	-

本基金本报告期末未持有沪港通投资的股票。

3. 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股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	12,600	8,788,374.00	4.07
2	600048	保利地产	594,200	8,407,930.00	3.89
3	600690	青岛海尔	433,900	8,174,676.00	3.78
4	600887	伊利股份	242,900	7,818,951.00	3.62
5	601939	建设银行	922,870	7,087,641.60	3.28
6	600036	招商银行	240,000	6,964,800.00	3.22
7	600104	上汽集团	202,800	6,497,712.00	3.01
8	600383	金地集团	510,200	6,443,826.00	2.98
9	600028	中国石化	978,500	5,998,205.00	2.78
10	601607	上海医药	224,200	5,423,398.00	2.51

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	同业存单	118,464,000.00	54.83
9	其他	-	-
10	合计	118,464,000.00	54.83

5. 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	111712305	17北京银行CD305	300,000	29,619,000.00	13.71
2	111720283	17广发银行CD283	300,000	29,619,000.00	13.71
3	111716287	17上海银行CD287	300,000	29,616,000.00	13.71
4	111771105	17宁波银行CD240	300,000	29,610,000.00	13.70

注:本基金本报告期末仅持有上述债券。

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

本基金本报告期内未进行贵金属投资。

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

本基金本报告期内未进行权证投资。

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

按照股指期货每日无负债结算的结算规则,《基金股指期货投资会计业务核算细则(试行)》及《企业会计准则-金融工具列报》的相关规定,“其他衍生工具-股指期货投资”与“证券清算款-股指期货每日无负债结算暂收暂付款”,符合金融资产与金融负债相抵销的条件,故将“其他衍生工具-股指期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报,净额为零。

本基金本报告期内未进行股指期货投资。

2)本基金投资股指期货的投资政策

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赎赎回、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。

10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1)本期国债期货投资政策

本基金投资范围不包括国债期货投资。

2)报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内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)本基金本期投资的前十名证券的发行主体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。

2)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。

3)其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	42,636.67
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	348,414.03
5	应收申购款	4,000.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	395,050.70

4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

6)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2017年12月31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

信诚新泽A

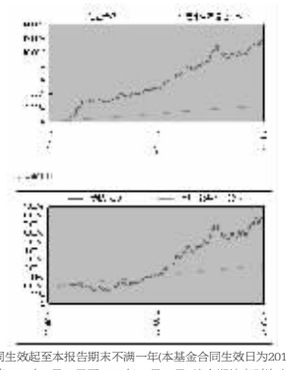
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2017年6月27日至2017年12月31日	11.8%	0.29%	2.32%	0.01%	9.48%	0.28%

信诚新泽B

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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6月27日至2017年12月31日	7.7%	0.27%	2.32%	0.01%	5.38%	0.26%

(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

信诚新泽A



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6月27日)。

2、本基金建仓期自2017年6月27日至2017年12月27日,建仓期结束时资产配合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)B类份额的销售服务费;
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、律师费和诉讼费;
6)基金份额持有人大会费用;
7)基金的证券、期货交易费用;
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0.60%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.60%÷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

基金管理费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。

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0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.10%÷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

基金托管费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,经基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。

3)销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费,B类基金份额的销售服务费年费率为0.10%。本基金B类基金份额的销售服务费按前一日B类份额基金资产净值的0.10%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.10%÷当年天数

H为B类基金份额每日应计提的销售服务费

E为B类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令,基金托管人复核后于次月前3个工作日内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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。

经基金管理人和基金托管人协商一致,基金管理费、基金托管费和销售服务费的复核程序、支付方式和时间可以变更,无须召开基金份额持有人大会。

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。

(三)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

1、本基金A类份额在申购时收取申购费用。本基金B类份额不收取申购费用。A类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。

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。

2、本基金A类份额的申购费率如下:

单笔申购金额(含申购费)	申购费率
M(50万	1.00%
50万≤M(200万	0.80%
200万≤M(500万	0.60%
M≥500万	1000元/笔

(注:M:申购金额;单位:元)

3、基金份额的赎回费率

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。

(1)本基金A类份额的赎回费率如下:

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(6个月	0.50%
6个月≤Y(1年	0.1%
Y≥1年	0

注:1年指365天;6个月指180天;

(2)本基金B类份额的赎回费率如下:

对持续持有期少于30日的投资人收取不低于0.5%的赎回费,并将上述赎回费全额计入基金财产。具体赎回费率结构如下:

持续持有期(Y)	赎回费率
Y(30天	0.50%
Y≥30天	0

4、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。

5、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定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。

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》(以下简称“运作办法”)、《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》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《信诚新泽回报灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》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及公司更名事项。

2、在“第三部分 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“第四部分 基金托管人”中,更新了基金托管人的相关信息。

4、在“第五部分 相关服务机构”部分,根据实际情况对销售机构的相关信息进行了更新。

5、在“第六部分 基金的募集”部分,删除了募集目标等内容,增加了本基金的实际募集期限以及募集的基本情况;

6、在“第七部分 基金合同的生效”部分,删除了基金备案的条件等内容,增加了本基金的实际合同生效日期。

7、在“第十部分 基金的投资”部分,增加了“基金投资组合报告”,财务数据截止至2017年12月31日。

8、在“第十一部分 基金的业绩”部分,增加了该节的内容,数据截止至2017年12月31日。

9、在“第二十二部分 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相关信息。

10、在“第二十三部分 其他应披露事项”部分,披露了自2017年6月27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2月14日

中信保诚基金管理有限公司关于以通讯方式召开信诚经典优债债券型证券投资基金基金份额持有人大会的公告

一、会议基本情况

中信保诚基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)依据中国证监会证监许可[2009]39号文核准的信诚经典优债债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)的基金合同于2009年3月11日生效。

鉴于市场环境的变化,为保护基金份额持有人利益,根据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《信诚经典优债债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)有关规定,本基金管理人决定召开本基金的基金份额持有人大会,审议《关于终止信诚经典优债债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。会议的具体安排如下:

1、会议召开方式:通讯方式。

2、会议投票表决起止时间:自2018年2月26日起,至2018年3月20日17:00止(以表决票收件人收到表决票时间为准)。

3、通讯表决票将送达至本基金管理人,