信诚新双盈分级债券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：中国建设银行股份有限公司

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。如原法律文件件对生效条件、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2013年5月9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5月9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
任所：　　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
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
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（中信保诚基金管理有限公司之子公司）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

杨立春先生，经济学博士。曾任职于江苏省社会科学院，担任助理研究员。2011年7月加入信诚基金管理有限公司，担任固定收益分析师。现任信诚双盈债券型证券投资基金（LOF）、信诚新双盈分级债券型证券投资基金、信诚新鑫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、信诚惠泽债券型证券投资基金（LOF）、信诚至诚灵活配置混合型证券投资基金、信诚新丰回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

历任基金经理：

曾丽琼女士，自2014年2月11日至2016年1月20日曾担任本基金的基金经理。

王旭巍先生，自2013年5月9日至2016年8月5日曾担任本基金的基金经理。

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：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)
住所：北京市西城区金融大街25号
办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人：田国立
成立时间：2004年09月17日
组织形式：股份有限公司
注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整
存续期间：持续经营
基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12号
联系人：田青
联系电话：(010)6759 5096

中国建设银行成立于1954年10月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。本行于2005年10月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码939)，于2007年9月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码601939)。

2017年6月末，本集团资产总额216,920.67亿元，较上年末增加7,283.62亿元，增幅3.47%。上半年，本集团实现利润总额1,720.93亿元，较上年同期增长1.30%；净利润较上年同期增长3.81%至1,390.09亿元，盈利水平实现平稳增长。

2016年，本集团先后获得国内外知名机构授予的100余项重要奖项。荣获《欧洲货币》“2016中国最佳银行”，《环球金融》“2016中国最佳消费者银行”、“2016亚太区最佳流动性管理银行”，《机构投资者》“人民币国际化服务钻石奖”，《亚洲银行家》“中国最佳大型零售银行奖”及中国银行业协会“年度最具社会责任金融机构奖”。本集团在英国《银行家》2016年“世界银行1000强排名”中，以一级资本总额继续位列全球第2；在美国《财富》2016年世界500强排名第22位。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、养老金托管处、清算处、核算处、跨境托管运营处、监督稽核处等10个职能处室，在上海设有投资托管服务上海备份中心，共有员工220余人。自2007年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

（二）主要人员情况

纪伟，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行南通分行、总行计划财务部、信贷经营部任职，并在总行公司业务部、投资托管业务部、授信审批部担任领导职务。其拥有八年托管从业经历，熟悉各项托管业务，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部并担任副行长，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部、战略客户部，长期从事客户服务、信贷业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

原玎，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行国际业务部，长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

（三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2017年二季度末，中国建设银行已托管759只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行连续11年获得《全球托管人》、《财资》、《环球金融》“中国最佳托管银行”、“中国最佳次托管银行”、“最佳托管专家——QFII”等奖项，并在2016年被《环球金融》评为中国市场唯一一家“最佳托管银行”。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1.直销机构

名称：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：www.citicprufunds.com.cn

2. 代销机构

（1）中国建设银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街25号
办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼长安兴融中心
法定代表人：田国立
联系人：田青
电话：010-67596219
传真：010－66275654
客服电话：95533
公司网站：www.ccb.com

（2）中国银行股份有限公司
注册地址：北京西城区复兴门内大街1号
办公地址：北京西城区复兴门内大街1号
法定代表人：陈四清
联系人：刘岫云
客服电话：95566
传真：010-66594946
电话：010-66594907
网址：www.boc.cn

（3）招商银行股份有限公司
注册地址：深圳市福田区深南大道7088号
办公地址：深圳市福田区深南大道7088号
法定代表人：李建红
联系人：邓炯鹏
电话：0755－83077278
传真：0755－83195049
客户服务电话：95555
网址：www.cmbchina.com/

（4）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：彭纯
电话：（021）58781234
传真：（021）58408483
联系人：陆志俊
客户服务电话：95559
网址：www.bankcomm.com

（5）中信银行股份有限公司
注册地址：北京市东城区朝阳门北大街9号
法定代表人：李庆萍
客服电话：95558
电话：010-89937333
网址：www.ecitic.com

（6）天津银行股份有限公司
注册地址：天津市河西区友谊路15 号
办公地址：天津市河西区友谊路15 号
法定代表人：袁福华
联系人：李岩
电话：02228405684
客服热线：4006-960296
网址http://www.tccb.com.cn/

(7) 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号卓越时代广场（二期）北座（邮编：518048）
法定代表人：王东明
联系人：侯艳红
电话：010－60838995
公司网站：www.cs.ecitic.com

（8）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/

（9）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：山东省青岛崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼20层
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

（10）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：北京市朝内大街188号
法定代表人：王常青
联系人：魏明
联系电话：(010)85130579
统一客户服务电话：4008888108
公司网站：www.csc108.com

（11）海通证券股份有限公司
地址：上海市广东路689号海通证券大厦
法定代表人：王开国
客户服务电话：021-23219275
联系人：李笑鸣
电话：021-23219275
传真：021－23219100
网址：www.htsec.com

（12）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

（13）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16层至26层
办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16层至26层
法人代表人：何如
联系电话：0755－82130833
基金业务联系人：李颖
联系电话：0755-82133066
传真：0755－8213395
全国统一客户服务电话：95536
网址：www.guosen.com.cn

（14）长城证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17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
法定代表人：黄耀华
联系人：刘洋
联系电话：0755-83516289
客服电话：400-6666-888
公司网址：www.cgws.com

（15）中国邮政储蓄银行股份有限公司（仅代销新双盈A）
注册地址：北京市西城区金融大街3号
办公地址：北京市西城区金融大街3号
法定代表人：李国华
客户服务电话：95580
传真：(010)68858117
网址：www.psbc.com

（16）平安证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼
办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼（518048）
法定代表人：杨宇翔
联系人：周一涵
电话：021-38637436
全国免费业务咨询电话：95511-8
开放式基金业务传真：0755-82400862
全国统一总机：95511-8
网址：stock.pingan.com

（17）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

（18）上海好买基金销售有限公司
注册地址：上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号
办公地址：上海市浦东新区浦东南路 1118号903-906室
法定代表人：杨文斌
联系电话：021-20613999
传真：021-68596916
公司网址：www.howbuy.com
客服电话：400-700-9665

（19）深圳众禄金融控股股份有限公司
注册地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼801
办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼801
法定代表人：薛峰
联系电话：0755-33227950
传真：0755-33227951
公司网址：www.zlfund.cn
客服电话：4006-788-887

（20）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18号保利广场E座18F
法定代表人：王莉
联系电话：010—85650628
传真：010-65884788
官网网址：www.licaike.com
客服电话：400-920-0022

（21）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：张皛
电　　话：021-33323998
传　　真：021-33323993
网址：fund.bundtrade.com
客户服务电话：400-820-2819

（22）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：凌顺平
电　　话：0571-88911818
传　　真：0571-86800423
公司网站：www.5ifund.com
客服电话：4008-773-772

（23）北京钱景财富投资管理有限公司
注册地址：北京市海淀区丹棱街丹棱SOHO　1008-1012
办公地址：北京市海淀区丹棱街丹棱SOHO　1008-1012
法定代表人：赵荣春
电　　话：010-59158281
传　　真：010-57569671
网址：www.qianjing.com
客户服务电话：400-893-6885

（24）北京创金启富投资管理有限公司
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：梁蓉
电话：010-66154828
传真：010-88067526
网址：www.5irich.com
客户服务电话：400-6262-818

（25）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.vstonewealth.com客户服务电话：4000178000

（26）大泰金石基金销售有限公司
注册地址：南京市建邺区江东中路359号国睿大厦一号楼B区4楼A506室
办公地址：上海市长宁区虹桥路1386号文广大厦15楼
法定代表人：袁顾明
电话：021-22267995
传真：021-22268089
网站：www.dtfunds.com
客户服务电话：4009282266

（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：罗细安
电话：010-67000988-6003
传真：010-67000988-6000
网址：www.zcvc.com.cn
客户服务电话：400-001-8811

（28）上海利得基金销售有限公司
注册地址：上海市宝山区蕴川路5475号1033室
办公地址：上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼
法定代表人：沈继伟
电话：021-50583533
传真：021-50583633
网址：www.leadbank.com.cn

（29）泰诚财富基金销售（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
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

（30）和耕传承基金销售有限公司
注册地址：郑州市郑东新区心怡路广场南路（高铁东站）升龙广场2号楼1号门701
办公地址：郑州市郑东新区东风东路康宁街北6号楼6楼
法定代表人：李淑慧
电话：0371-85518395
传真：0371-85518397
官网网址：www.hgccpb.com
客服电话：4000-555-671

（31）北京晟视天下投资管理有限公司
注册地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室
办公地址：北京市朝阳区朝外大街甲6号万通中心D座28层
法定代表人：蒋煜
联系电话：010-58170949
官网网址：www.shengshiview.com
客服电话：400-818-8866

（32）深圳金斧子基金销售有限公司
注册地址：深圳市南山区南山街道科苑路18号东方科技大厦18F
办公地址：深圳市南山区南山街道科苑路18号东方科技大厦18F
法定代表人：何昆鹏
联系电话：0755-84034499
公司官网：www.jfzinv.com
客服电话：400-950-0888

（33）乾道金融信息服务（北京）有限公司
注册地址：北京市海淀区东北旺村南1号楼7层7117室
办公地址：北京市西城区德外大街合生财富广场1302室
法定代表人：王兴吉
电话：010-62062880
传真：010-82057741
官网网址：www.qiandaojr.com
客服电话：400-088-8080

（34）奕丰金融服务(深圳)有限公司
注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室
办公地址：深圳市南山区海德三路海岸大厦东座1115室，1116室及1307室
法定代表人：TAN YIK KUAN
联系电话：021—20567288
传真：0755—21674453
公司网址：www.ifastps.com.cn
客服电话：400-684-0500

（35）北京广源达信基金销售有限公司
注册地址：北京市西城区新街口外大街28号C座六层605室
办公地址：北京市朝阳区望京东园四区13号楼浦项中心B座19层
法定代表人：齐剑辉
传真：010-82055860
官网网址：www.niuniufund.com
客服电话：400-6236-060

（36）上海万得投资顾问有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座
办公地址：上海市浦东新区福山路33号8楼
法定代表人：王廷富
电　　话：021-51327185
传　　真：021-50710161
客服电话：400-821-0203

（37）北京新浪仓石基金销售有限公司
注册地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室
办公地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室
法人代表：李昭琛
联系电话：010-82628888
公司传真：010-62676582
官网网址：www.xincai.com
客服电话：010-62675369

（38）北京汇成基金销售有限公司
注册地址：北京市海淀区中关村大街11号1108
办公地址：北京市海淀区中关村大街11号1108
法定代表人：王伟刚
联系电话：010-56282140
公司传真：010-62680827
官网网址：www.hcjijin.com
客服电话：400-068-1176

（39）浙江金观诚财富管理有限公司
注册地址：杭州市拱墅区登云路45号（锦昌大厦）1幢10楼1001室
办公地址：杭州市拱墅区登云路45号锦昌大厦一楼金观诚财富
法定代表人：徐黎云
联系电话：0571-88337717
公司传真：0571-88337666
官网网址：www.jincheng-fund.com
客服电话：400-068-0058

（40）杭州科地瑞富基金销售有限公司
注册地址：杭州市下城区武林时代商务中心1604室
办公地址：杭州市下城区上塘路15号武林时代20F
法定代表人：陈刚
联系电话：0571-85267500
公司传真：0571-8526 9200
官网网址：www.cd121.com
客服电话：0571-86655920

（41）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：021-20665952
传真：021-22066653
官网网址：www.lufunds.com
客服电话：4008219031

42）深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#
办公地址：北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦A座7层
法人代表：张彦
联系电话：010-83363101
公司传真：010-83363072
客服电话：400-166-1188
官网网址：http://8.jrj.com.cn/

43）一路财富信息科技有限公司
住所：北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208
办公地址：北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208
法定代表人：吴雪秀
客服电话：400 001 1566
网址：www.yilucaifu.com

基金管理人可根据有关法律法规要求，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
网址：http://www.citicprufunds.com.cn/

（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：俞卫锋
联系电话：（021）31358666
传真：（021）31358600
联系人：安冬
经办律师：吕红、孙睿

（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)
注册地址：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
法人代表：姚建华
经办注册会计师：王国蓓、黄小熠
电话：8621 2212 2888
传真：8621 6288 1889
联系人：王国蓓
传真：8621 6288 1889
联系人：王国蓓

四、基金的名称

信诚新双盈分级债券型证券投资基金

五、基金的类型

契约型，开放式

本基金以“运作周年滚动”的方式运作。新双盈A自基金合同生效日起每4个月开放申购和赎回一次，每次开放仅开放一个工作日。新双盈B在任一运作周年内封闭运作，仅在每个运作周年到期日当天开放申购和赎回。

新双盈A在任一运作周年的第三个开放日即为运作周年到期日，也即新双盈B的开放日。

六、基金的投资目标

在严格控制风险的基础上，通过主动管理，力争追求超越业绩比较基准的投资收益。

七、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(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、货币市场工具、银行定期存款、中期票据、权证、资产支持证券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

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。

本基金投资于固定收益类证券（包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、资产支持证券、可转换债券（含分离交易可转债）、逆回购、银行定期存款、中期票据等）的比例不低于基金资产的80%。其中，本基金在任一开放日及开放日前二十个工作日内及开放日后二十个工作日内可不受上述比例限制。但在开放日本基金投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例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。

本基金不参与一级市场新股申购和增发新股申购，也不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，但允许将可转换债券转股。本基金投资于权益类资产（包括股票、权证等）的比例不高于基金资产的10%，其中持有的全部权证市值不超过基金资产净值的3%。

当法律法规的相关规定变更时，基金管理人在履行适当程序后可对上述资产配置比例进行适当调整。

八、基金的投资策略

1、资产配置策略

本基金投资组合中债券类、货币类等大类资产各自的长期均衡比重，依照本基金的特征和风险偏好而确定。本基金定位为债券型基金，其资产配置以债券为主，并不因市场的中短期变化而改变。在不同的市场条件下，本基金将综合考虑宏观环境、市场估值水平、风险水平以及市场情绪，在一定的范围内对资产配置调整，以降低系统性风险对基金收益的影响。

2、固定收益类资产的投资策略

（1）类属资产配置策略

在整体资产配置的基础上，本基金将通过考量不同类型固定收益品种的信用风险、市场风险、流动性风险、税收等因素，研究各投资品种的利差及其变化趋势，制定债券类属资产配置策略，以获取债券类属之间利差变化所带来的潜在收益。

（2）普通债券投资策略

对于普通债券，本基金将在严格控制目标久期及保证基金资产流动性的前提下，采用目标久期控制、期限结构配置、信用利差策略、流动性管理、相对价值配置等策略进行主动投资。

1）目标久期控制

本基金将根据分级基金的剩余运作期限以及宏观经济因素（包含消费物价指数、固定资产投资、工业品价格指数、货币供应量等）与不同种类债券收益率之间的数量关系，确定债券组合的久期。

2）期限结构配置

在确定债券组合的目标久期之后，本基金将通过对央行政策、经济增长率、通货膨胀率等众多因素的分析来预测收益率曲线形状的可能变化；在上述基础上，本基金将运用子弹型、哑铃型或梯形等配置方法，从而确定短、中、长期债券的配置比例。

3）信用利差策略

信用债为本基金的主要投资品种之一，因此信用风险控制成为了本基金投资的风险控制重点之一。本基金将通过严格的内部投资风险管理体系，对关注的信用债进行独立的内部评级，并持续动态跟踪调整，以此作为品种选择的基本依据。

本基金将首先根据债券发行人的长期信用评级、对外担保情况、可能面临巨大损失的诉讼、过往融资记录等进行初步的风险排查，并以此计算债券的可能违约率。符合要求的信用债，本基金将采用不同评级序列，对长期和短期债券的信用评级进行初步评估。在初步评级的基础上，进一步将根据行业特征、竞争优势、管理水平、财务质量、抗风险能力等因素对债券的信用评级进行重新调整，并以此作为评级的结果。对于列入考查范围的信用债，本基金将持续动态跟踪，根据债券发行人自身情况的变化，动态调整信用评级。信用利差策略的核心是各项债券信用评级差异能获得充分的利差补偿。本基金将对债券组合总体信用评级水平予以控制，严格控制低评级债券的配置比例；在券种选择上遵循“个券分散、行业分散”的原则。

信用债券的收益率主要由基准收益率与反映信用债券信用水平的信用利差组成。

基准收益率由宏观经济因素及市场资金状况等决定。本基金将从宏观经济环境与市场供需状况两个方面对市场整体信用利差进行分析。首先，对于宏观经济环境，当宏观经济向好时，企业盈利能力好，资金充裕，市场整体信用利差将可能收窄；当宏观经济恶化时，企业盈利能力差，资金紧缺，市场整体信用利差将可能扩大。其次，对于市场供给，本基金将从市场容量、信用债结构及流动性等几方面进行分析。

而信用利差受市场整体信用水平、个券信用影响。本基金通过公司内部债券信用评级体系，对债券发行人的公司治理结构、融资能力、抗风险能力、经营状况等进行综合评估，确定发行人的信用风险及债券的信用级别。

4）流动性管理策略

本基金对流动性进行积极管理以应对：a、新双盈A每4个月开放时可能的净赎回；b、新双盈B每一年开放时可能的净赎回。在预期份额持有人净赎回比例较高时，本基金将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，以应对大量赎回产生的流动性需求。本基金将通过发行量、前一个月日均成交量、前一个月的交易频率、买卖价差、剩余到期期限等指标甄别个券的流动性。

5）相对价值配置

本基金将对市场上同类债券的收益率、久期、信用度、流动性等指标进行比较，寻找其他指标相同而某一指标相对更具有投资价值的债券，并进行投资。

（3）资产支持证券的投资策略

对于资产支持证券，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。

（4）止损策略

为保障新双盈A的本金及收益安全，本基金将针对基金净值损失的程度，相应采用降低债券组合仓位、降低债券组合久期等止损措施。

3、其他金融工具的投资策略

如法律法规或监管机构以后允许基金投资于其他衍生金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金对衍生金融工具的投资主要以对冲投资风险或无风险套利为主要目的。基金将在有效进行风险管理的前提下，通过对标的品种的基本面研究，结合衍生工具定价模型预估衍生工具价值或风险对冲比例，谨慎投资。

在符合法律、法规相关限制的前提下，基金管理人按谨慎原则确定本基金衍生工具的总风险暴露。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准：中证综合债指数收益率

十、基金的风险收益特征

本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的中偏低风险品种，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。其中，基于本基金的分级机制和收益规则，新双盈A为低风险、收益相对稳定的基金份额，新双盈B为中偏高风险、中偏高收益的基金份额。

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。

基金托管人根据基金合同的约定，于2018年4月20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3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	–	–
	其中：股票	–	–
2	固定收益投资	18,284,115.58	87.59
	其中：债券	18,284,115.58	87.59
	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	1,900,000.00	9.10
	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	134,300.46	0.64
7	其他资产	556,567.10	2.67
8	合计	20,874,983.14	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

本基金本报告期末未持有境内投资股票。

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港股通投资的股票。

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

本基金本报告期末未持有股票投资。

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	16,009,600.00	80.17
	其中：政策性金融债	16,009,600.00	80.17
4	企业债券	11,766.30	0.06
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债	2,262,749.28	11.33
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	18,284,115.58	91.56

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(%)