

信诚主题轮动灵活配置混合型证券投资基金招募说明书摘要

基金管理人：中信保诚基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

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。

信诚主题轮动灵活配置混合型证券投资基金经 2016 年 5 月 3 日中国证监会证监许可[2016]971 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投资价值、收益和前景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，其主要功能是分散投资，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易行的投资方式，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、也包括流动性风险、特有风险及其它风险等风险。

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，全面认识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，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。投资人应当通过本基金管理人或销售机构购买本基金，各销售机构的具体名单见基金份额发售公告以及基金管理人届时发布的调整销售机构的相关公告。

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。本基金的过往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。

本更新招募说明书所载内容截止日若无特别说明为 2018 年 1 月 23 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. 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。

GuyRobertSTRAPP 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。

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 LatticeStrategiesTrust 独立受托人、NipponWealthBank 独立董事、

IronwoodInstitutionalMultiStrategyFundLLCandIronwoodMultiStrategyFundLLC.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

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

张光成先生，工商管理硕士，CFA。曾任职于欧洲货币(上海)有限公司，担任研究总监；于兴业全球基金管理有限公司，担任基金经理。2011 年 7 月加入中信保诚基金管理有限公司，历任投资经理，信诚盛世蓝筹股票型证券投资基金的基金经理。现任股票投资总监，信诚周期轮动混合型证券投资基金（LOF）、信诚幸福消费混合型证券投资基金、信诚主题轮动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

王颖女士，经济学硕士。曾任职于平安资产管理有限责任公司，担任研究经理。2016 年 9 月加入中信保诚基金管理有限公司，历任助理投资经理、基金经理助理。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、信诚至鑫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：中国银行股份有限公司（简称中国银行）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

首次注册登记日期：1983 年 10 月 31 日

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

法定代表人：陈四清

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管部门信息披露联系人：王永民

传真：（010）66594942

中国银行客服电话：95566

（二）基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

（三）证券投资基金托管情况

截至2017年12月31日，中国银行已托管650只证券投资基金，其中境内基金613只，QDII基金37只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

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

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）68649788

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.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

电话：021-54660526

传真：021-54660501

公司网址：www.1234567.com.cn

客服电话：400-1818-188

2) 上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室（上海泰和经济发展区）

办公地址：上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1503室

法定代表人：王翔

电话：021-65370077-220

传真：021-55085991

网址：www.jiyufund.com.cn

客户服务电话：400-820-5639

3) 北京电盈基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区呼家楼（京广中心）1号楼36层3603室

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦F座12B

法人代表：程刚

客服电话：400-100-3391

公司官网：www.bjdyfund.com

4) 北京格上富信基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室

法定代表人：李悦章

电话：010-85594745

传真：010-85932427

客服电话：400-066-8586

官网网址：www.igesafe.com

5) 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>

6) 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：北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦5层

法定代表人：李修辞

<http://www.wanjiawealth.com>

7) 济安财富（北京）资本管理有限公司

住所：北京市朝阳区东三环中路7号4号楼40层4601室

办公地址：北京市朝阳区东三环中路7号4号楼40层4601室

法定代表人：杨健

联系人：李海燕

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

信诚主题轮动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

在严格控制风险并保证流动性的前提下，追求超越业绩比较基准的收益。

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收益。

2、主题投资策略

本基金的股票投资将运用主题投资策略构建投资组合。随着中国经济发展和经济结构的转型，在技术经济效益、人口年龄结构变化以及国家政策导向等因素的影响下，将不断涌现出的有影响力的投资主题。

（1）挖掘投资主题

基金管理人通过系统、细致、前瞻性的宏观经济和国家政策等因素研究，发掘具备成长性、具有投资价值的主题行业；

（2）主题投资

每个细分主题行业都有一个成长周期，通常可以分为引入期、成长期、成熟期和衰退期四个阶段，处于不同成长阶段的主题具有不同的市场走势。引入期即起步时期，该主题还未成熟，技术也缺乏成功的经验，但具有较大的发展潜力。处于成长期中的主题产品市场需求迅速上升，企业利润不断增加，盈利机会较多，也是较好的介入时机。处在成熟期的主题市场占有率较高，产品生产技术成熟，是主题成长周期的鼎盛时期，是实现投资收益的时期。衰退期是主题成长周期的最后阶段，技术水平落后，利润持续降低，主题发展出现停滞甚至衰退趋势。通过判断主题的成长周期进行主题配置，可以增厚投资收益和规避投资风险。

（3）主题轮动

经济发展具备多层次、多元化、长周期的特点，资本市场上会同时出现多个相关或独立的投资主题，在不同阶段各投资主题的效应也强弱有别。本基金通过紧密跟踪经济发展趋势，关注因内在驱动因素变化所引起的投资主题的转换和轮动，根据投资主题的传导路径和轮动效应，把握新旧投资主题的转换时机，适时调整基金资产在不同的投资主题间的配置比例，分享不同投资主题兴起所带来的投资机遇。

3、股票投资策略

在确定各投资主题相关行业与领域的基础上，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。

4、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。

5、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。

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。

6、资产支持证券投资策略

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。

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：**65%沪深 300 指数收益率+35%中证综合债指数收益率**

本基金将在严格控制风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的收益。沪深 300 指数是中证指数有限公司编制的包含上海、深圳两个证券交易所流动性好、规模最大的 300 只 A 股为样本的成分股指数，是目前中国证券市场中市值覆盖率高、代表性强、流动性好，同时公信力较好的股票指数，适合作为本基金股票投资的比较基准。本基金是灵活配置混合型基金，基金在运作过程中将维持 0%-95%的股票资产，其余资产投资于债券及其他具有高流动性的短期金融工具。本基金将业绩比较基准中股票指数与债券指数的权重确定为 65%和 35%，并用中证综合债指数代表债券资产收益率。因此，65%沪深 300 指数收益率+35%中证综合债指数收益率是衡量本基金投资业绩的理想基准。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时，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，预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金、低于股票型基金，属于较高风险、较高收益的品种。

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。

基金托管人中国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止至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	2,710,906.85	5.19
---	------	--------------	------

其中：股票	2,710,906.85	5.19
-------	--------------	------

2	固定收益投资	149,900.00	0.29
---	--------	------------	------

其中：债券	149,900.00	0.29
-------	------------	------

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	42,800,000.00	81.86
---	----------	---------------	-------

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	6,493,717.58	12.42
---	--------------	--------------	-------

7	其他资产	127,060.04	0.24
---	------	------------	------

8	合计	52,281,584.47	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	--	
---	-----	----	--

C	制造业	1,582,035.71	3.07
---	-----	--------------	------

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,143.20	0.03
---	------------------	-----------	------

E	建筑业	--	
---	-----	----	--

F	批发和零售业	--	
---	--------	----	--

G	交通运输、仓储和邮政业	17,957.94	0.03
---	-------------	-----------	------

H	住宿和餐饮业	--	
---	--------	----	--

I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,094,770.00	2.12
---	-----------------	--------------	------

J	金融业	--	
---	-----	----	--

K	房地产业	--	
---	------	----	--

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 2,710,906.85 5.26

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 300383 光环新网 83,000 1,094,770.00 2.12

2 600332 白云山 18,800 604,232.00 1.17

3 300032 金龙机电 36,000 500,040.00 0.97

4 600664 哈药股份 67,500 392,175.00 0.76

5 603477 振静股份 1,955 37,027.70 0.07

6 603161 科华控股 1,239 20,753.25 0.04

7 603283 赛腾股份 1,349 19,614.46 0.04

8 603329 上海雅仕 1,183 17,957.94 0.03

9 603080 新疆火炬 1,187 16,143.20 0.03

10 603655 朗博科技 881 8,193.30 0.02

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 149,900.00 0.29

8 同业存单 --

9 其他 --

10 合计 149,900.00 0.29

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 128024 宁行转债 1,499 149,900.00 0.29

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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。

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。

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。

基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组,授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项,同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。此外,基金管理人还将做好培训和准备工作。

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

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。

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 42,120.16

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 -

4 应收利息 84,939.88

5 应收申购款 -

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 127,060.04

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

序号 股票代码 股票名称 流通受限部分的公允价值(元) 占基金资产净值比例(%) 流通受限情况说明

1 300383 光环新网 1,094,770.00 2.12 非公开发行有明确锁定期

2 600332 白云山 604,232.00 1.17 重大资产重组

3 300032 金龙机电 500,040.00 0.97 筹划发行股份购买资产

4 600664 哈药股份 392,175.00 0.76 重大资产重组

注: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

阶段	份额净值增长率	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	--
2017 年 1 月 23 日至 2017 年 6 月 30 日	13.90%	0.91%	6.03%	0.38%	7.87% 0.53%
2017 年 1 月 23 日至 2017 年 12 月 31 日	25.00%	0.75%	12.90%	0.42%	12.10% 0.33%

(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 1 月 23 日)。

2、本基金建仓期自 2017 年 1 月 23 日至 2017 年 7 月 23 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) 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、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;
- 5、基金份额持有人大会费用;
- 6、基金的证券/期货交易费用;
- 7、基金的银行汇划费用;
- 8、基金的账户开户费用、账户维护费用;
- 9、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。

(二) 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:

$$H=E \times 0.60\% \times \text{当年天数}$$

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,经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前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,基金管理人无需再出具资金划拨指令。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:

$$H=E \times 0.10\% \times \text{当年天数}$$

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,经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前 5 个工作日内从基金财产中一次性提取,基金管理人无需再出具资金划拨指令。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。

上述一、基金费用的种类中第 3—9 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。

（四）申购及赎回费用

1、本基金的基金份额在申购时收取申购费用。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 1.50%

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）

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。

本基金的赎回费率如下：

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，其中，1 个月为 30 日。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：Y：持有时间，其中 1 年为 365 日，2 年为 730 日

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《信诚主题轮动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，更新了基金管理人主要人员情况和基金经理的内容。
- 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中，更新了其他销售机构的内容。
- 5、在第八部分基金份额的申购与赎回中，更新了申购和赎回的数额限制的内容。
- 6、在第九部分基金的投资部分，更新了财务数据截止至 2017 年 12 月 31 日。
- 7、在第十部分基金的业绩部分，更新了该节的内容，数据截止至 2017 年 12 月 31 日。
- 8、在第二十一部分对基金份额持有人的服务部分，更新了资料寄送内容并删除了资讯服务内容。
- 9、在第二十二部分其他应披露事项部分，披露了自 2017 年 7 月 24 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 3 月 8 日