

# 信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

## 招募说明书摘要

基金管理人：信诚基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

### 重要提示

本基金于 2015 年 6 月 19 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 6 月 19 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2017 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：信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、中信信诚资产管理有限公司（信诚基金管理有限公司之子公司）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，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。现任信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. 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。现任信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。现任信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，信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。现任信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；信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。现任信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。现任信诚基金管理有限公司督察长，中信信诚资产管理有限公司监事。

## 5. 基金经理

提云涛先生，经济学博士。曾任职于大鹏证券股份有限公司上海分公司，担任研究部分析师；于上海申银

万国证券研究所，历任宏观策略部副总监、金融工程部总监；于平安资产管理有限责任公司，担任量化投研部总经理；于中信证券股份有限公司，担任研究部金融工程总监。2015年6月加入信诚基金管理有限公司，担任数量投资总监。现任信诚沪深300指数分级证券投资基金、信诚至利灵活配置混合型证券投资基金、信诚至益灵活配置混合型证券投资基金、信诚至优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、信诚至瑞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、信诚新选回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金、信诚永鑫一年定期开放混合型证券投资基金、信诚永利一年定期开放混合型证券投资基金的基金经理。

历任基金经理：

杨旭先生，自2015年6月19日至2016年11月23日担任此基金的基金经理。

## 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) 基金托管人概况

公司法定中文名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

公司法定英文名称：BANK OF COMMUNICATIONS CO., LTD

法定代表人：牛锡明

住所：上海市浦东新区银城中路188号

办公地址：上海市浦东新区银城中路188号

邮政编码：200120

注册时间：1987年3月30日

注册资本：742.62亿元

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]25号

联系人：陆志俊

电话：95559

交通银行始建于1908年，是中国历史最悠久的银行之一，也是近代中国的发钞行之一。1987年重新组建后的交通银行正式对外营业，成为中国第一家全国性的国有股份制商业银行，总部设在上海。2005年6月交通银行在香港联合交易所挂牌上市，2007年5月在上海证券交易所挂牌上市。根据2016年英国《银行家》杂志发布的全球千家大银行报告，交通银行一级资本位列第13位，较上年上升4位；根据2016年美国《财富》杂志发布的世界500强公司排行榜，交通银行营业收入位列第153位，较上年上升37位。

截至2017年3月31日，交通银行资产总额为人民币87337.11亿元。2017年一季度，交通银行实现净利润(归属于母公司股东)人民币193.23亿元。

交通银行总行设资产托管业务中心（下文简称托管中心）。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验，具备基金从业资格，以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称，员工的学历层次较高，专业分布合理，职业技能优良，职业道德素质过硬，是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

### (二) 主要人员情况

牛锡明先生，董事长、执行董事。

牛先生 2013 年 10 月至今任本行董事长、执行董事，2013 年 5 月至 2013 年 10 月任本行董事长、执行董事、行长，2009 年 12 月至 2013 年 5 月任本行副董事长、执行董事、行长。牛先生 1983 年毕业于中央财经大学金融系，获学士学位，1997 年毕业于哈尔滨工业大学管理学院技术经济专业，获硕士学位，1999 年享受国务院颁发的政府特殊津贴。

彭纯先生，副董事长、执行董事、行长。

彭先生 2013 年 11 月起任本行副董事长、执行董事，2013 年 10 月起任本行行长；2010 年 4 月至 2013 年 9 月任中国投资有限责任公司副总经理兼中央汇金投资有限责任公司执行董事、总经理；2005 年 8 月至 2010 年 4 月任本行执行董事、副行长；2004 年 9 月至 2005 年 8 月任本行副行长；2004 年 6 月至 2004 年 9 月任本行董事、行长助理；2001 年 9 月至 2004 年 6 月任本行行长助理；1994 年至 2001 年历任本行乌鲁木齐分行副行长、行长，南宁分行行长，广州分行行长。彭先生 1986 年于中国人民银行研究生部获经济学硕士学位。

袁庆伟女士，资产托管业务中心总裁。

袁女士 2015 年 8 月起任本行资产托管业务中心总裁；2007 年 12 月至 2015 年 8 月，历任本行资产托管部总经理助理、副总经理，本行资产托管业务中心副总裁；1999 年 12 月至 2007 年 12 月，历任本行乌鲁木齐分行财务会计部副科长、科长、处长助理、副处长，会计结算部高级经理。袁女士 1992 年毕业于中国石油大学计算机科学系，获得学士学位，2005 年于新疆财经学院获硕士学位。

### （三）基金托管业务经营情况

截至 2017 年 3 月 31 日，交通银行共托管证券投资基金 288 只。此外，交通银行还托管了基金公司特定客户资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、银行理财产品、信托计划、私募投资基金、保险资金、全国社保基金、养老保障管理基金、企业年金基金、QFII 证券投资资产、RQFII 证券投资资产、QDII 证券投资资产和 QDLP 资金等产品。

## 三、相关服务机构

### （一）基金份额销售机构

#### 1、场外销售机构

##### （1）直销机构

信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.xcfunds.com/>。

##### （2）其他销售机构

#### 1) 交通银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

联系人：张宏革

联系电话：021-58781234

客服电话：95559

公司网站：[www.bankcomm.com](http://www.bankcomm.com)

#### 2) 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

3) 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

4) 珠海盈米财富管理有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼

法定代表人：肖雯

电话：020-89629021

传真：020-89629011

网址：www.yingmi.cn

客户服务电话：020-89629066

5) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903-906 室

法定代表人：杨文斌

电话：021-58870011

传真：021-68596919

公司网址：www.howbuy.com

客服电话：400-700-9665

6) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人：张跃伟

电话：021-20691832

传真：021-20691861

公司网站：www.erichfund.com

客服电话：400-089-1289

7) 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](http://www.zlfund.cn)

客服电话：4006-788-887

8) 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](http://www.lufunds.com)

客服电话：4008219031

9) 上海云湾投资管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路 27 号 13 号楼 2 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路 27 号 13 号楼 2 层

法定代表人：王爱玲

电话：021-68783068

传真：021-20539999

官网网址：[www.zhengtongfunds.com](http://www.zhengtongfunds.com)

客服电话：400-820-1515

10) 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

官网地址：[www.shengshiview.com](http://www.shengshiview.com)

客服电话：400-818-8866

11) 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：TANYIKKUAN

联系电话：02120567288

传真：075521674453

公司网址：[www.ifastps.com.cn](http://www.ifastps.com.cn)

客服电话：400-684-0500

12) 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](http://www.niuniufund.com)

客服电话：400-6236-060

13) 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.fundzone.cn](http://www.fundzone.cn)

客服电话：400-068-1176

14) 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](http://www.jincheng-fund.com)

客服电话：400-068-0058

15) 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：0571-85269200

官网网址：[www.cd121.com](http://www.cd121.com)

客服电话：0571-86655920

16) 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/>

17) 北京肯特瑞财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村东路 66 号 1 号楼 22 层 2603-06

办公地址：北京市大兴区亦庄经济开发区科创十一街十八号院京东集团总部

法人代表：陈超

联系电话：010-89189285

公司传真：010-89189566

客服电话：个人业务：95118 企业业务：4000888816

官网网址：<http://jr.jd.com>

18) 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：4000011566

网址：[www.yilucaifu.com](http://www.yilucaifu.com)

19) 上海朝阳永续基金销售有限公司

注册地址: 上海浦东新区上丰路 977 号 1 幢 B 座 812 室

办公地址: 上海市浦东新区碧波路 690 号 4 号楼 2 楼

法人代表: 廖冰

联系电话: 021-80234888

官网地址: [www.998fund.com](http://www.998fund.com)

客服电话: 4009987172

20) 武汉市伯嘉基金销售有限公司

注册地址: 武汉市江汉区中央商务区泛海国际 SOHO 城 (一期) 第七幢 23 层 1 号、4 号

办公地址: 武汉市江汉区中央商务区泛海国际 SOHO 城 (一期) 第七幢 23 层 1 号、4 号

法人代表: 陶捷

公司传真: 027-87006010

客服电话: 400-027-9899

官网网址: [www.buyfunds.cn](http://www.buyfunds.cn)

21) 上海大智慧财富管理有限公司

注册地址: 中国 (上海) 自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102、1103 单元

办公地址: 中国 (上海) 自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102、1103 单元

法人代表: 申健

联系电话: 021-20219988

公司传真: 021-20219988

客服电话: 021-20292031

官网网址: <https://8.gw.com.cn>

22) 南京苏宁基金销售有限公司

注册地址: 南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

办公地址: 南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法人代表: 钱燕飞

联系人: 王锋

联系电话: 025-66996699-887226

传真: 025-66008800-887226

官网网址: [www.snjijin.com](http://www.snjijin.com)

客服电话: 95177

23) 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](http://www.xincai.com)

客服电话: 010-62675369

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。

2、场内销售机构: 深圳证券交易所内具有基金销售业务资格、并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的会员单位, 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：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：周明

联系电话：010-59378835

传真：010-59378839

联系人：朱立元

## （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

信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

## 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、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、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。

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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据基金合同的约定，于2017年4月20日复核了本招募更新中的投资组合报告的内容，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 122,072,009.80 16.08

其中：股票 122,072,009.80 16.08

2 固定收益投资 496,278,055.20 65.38

其中：债券 496,278,055.20 65.38

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 30,000,165.00 3.95  
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 102,748,743.86 13.54  
7 其他资产 7,919,011.74 1.04  
8 合计 759,017,985.60 100.00

## 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 2,518,448.00 0.38  
B 采矿业 1,497,344.00 0.23  
C 制造业 46,826,124.94 7.13  
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 5,222,634.00 0.79  
E 建筑业 2,148,345.30 0.33  
F 批发和零售业 1,981,779.00 0.30  
G 交通运输、仓储和邮政业 3,829,368.29 0.58  
H 住宿和餐饮业 --  
I 信息传输、软件和信息技术服务业 416,031.20 0.06  
J 金融业 47,002,239.91 7.15  
K 房地产业 6,960,431.00 1.06  
L 租赁和商务服务业 1,394,518.00 0.21  
M 科学研究和技术服务业 16,930.16 -  
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 2,257,816.00 0.34  
S 综合 --

合计 122,072,009.80 18.58

### 2)报告期末按行业分类的沪港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 601318 中国平安 177,200 6,558,172.00 1.00  
2 601398 工商银行 847,200 4,100,448.00 0.62  
3 601288 农业银行 1,157,600 3,866,384.00 0.59  
4 601988 中国银行 1,032,000 3,818,400.00 0.58  
5 601818 光大银行 903,500 3,713,385.00 0.57  
6 601166 兴业银行 207,700 3,366,817.00 0.51  
7 600036 招商银行 174,813 3,351,165.21 0.51  
8 601939 建设银行 507,600 3,015,144.00 0.46  
9 601788 光大证券 162,900 2,495,628.00 0.38

10 601009 南京银行 182,980 2,199,419.60 0.33

#### 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 33,078,771.00 5.04

2 央行票据 --

3 金融债券 39,244,000.00 5.97

其中：政策性金融债 39,244,000.00 5.97

4 企业债券 180,905,780.20 27.54

5 企业短期融资券 150,191,000.00 22.86

6 中期票据 --

7 可转债 5,014,504.00 0.76

8 同业存单 87,844,000.00 13.37

9 其他 --

10 合计 496,278,055.20 75.54

#### 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 111790462 17 杭州银行 CD012 500,000 48,960,000.00 7.45

2 160402 16 农发 02 400,000 39,244,000.00 5.97

3 019546 16 国债 18 331,650 33,078,771.00 5.04

4 011698084 16 厦翔业 SCP008 300,000 30,105,000.00 4.58

5 011698266 16 东华能源 SCP002 300,000 30,093,000.00 4.58

#### 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进行资产支持证券投资。

#### 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

本基金本报告期末未进行权证投资。

#### 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

本基金本报告期末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。

#### 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 68,212.04

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 -

4 应收利息 7,850,799.70

5 应收申购款 -

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 7,919,011.74

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。

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 3 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

信诚新旺混合 A

阶段 净值增长率 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 --

2015 年 6 月 19 日至 2015 年 12 月 31 日 0.50% 0.07% 2.56% 0.01% -2.06% 0.06%

2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 2.89% 0.10% 4.51% 0.01% -1.62% 0.09%

2017 年 1 月 1 日至 2017 年 3 月 31 日 1.45% 0.11% 1.11% 0.01% 0.34% 0.10%

2015 年 6 月 19 日至 2017 年 3 月 31 日 4.90% 0.09% 8.18% 0.01% -3.28% 0.08%

信诚新旺混合 C

阶段 净值增长率 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 --

2015 年 12 月 7 日至 2015 年 12 月 31 日 0.20% 0.05% 0.31% 0.01% -0.11% 0.04%

2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 2.79% 0.11% 4.51% 0.01% -1.72% 0.10%

2017 年 1 月 1 日至 2017 年 3 月 31 日 1.17% 0.11% 1.11% 0.01% 0.06% 0.10%

2015 年 12 月 7 日至 2017 年 3 月 31 日 4.20% 0.10% 5.93% 0.01% -1.73% 0.09%

### (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

信诚新旺混合 A

信诚新旺混合 C

注:1.本基金于 2015 年 12 月 7 日起新增 C 类份额。

2.本基金建仓期自 2015 年 6 月 19 日至 2015 年 12 月 19 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) C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) 从A类基金份额的基金财产中计提的基金上市初费和上市月费；
- (10) 基金的账户开户费用、账户维护费用；
- (11) 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：

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

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首日起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，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0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \times \text{当年天数}$$

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首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，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，支付日期顺延。

### (3) 销售服务费

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

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

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C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，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首日起5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，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1、基金费用的种类中第(4)－(11)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

本基金管理人于 2015 年 12 月 5 日发布公告并修改基金合同，自 2015 年 12 月 7 日起增加收取销售服务费的 C 类份额。

本基金基金份额类别包括 A 类和 C 类。A 类基金份额是在投资者认购或申购时收取认购费或申购费，但不再从本类别基金财产中计提销售服务费的一类基金份额；C 类基金份额是在投资者认购或申购时不收取认购费或申购费、但从本类别基金资产中计提销售服务费的一类基金份额。

投资人可自行选择申购的基金份额类别。投资人可通过场内、场外两种渠道申购与赎回 A 类份额；可通过场外渠道申购与赎回 C 类份额。本基金 A 类基金份额参与上市交易，C 类基金份额不参与上市交易。

有关基金份额类别的具体设置、费率水平等由基金管理人确定，并在招募说明书中公告。根据基金销售情况，基金管理人可在不损害已有基金份额持有人权益的情况下，经与基金托管人协商，增加新的基金份额类别、或者调整现有基金份额类别的费率水平、或者停止现有基金份额类别的销售等，调整实施前基金管理人报中国证监会备案，并依照《信息披露办法》的规定公告。

A 类份额和 C 类份额销售费率如下所示：

本基金 A 类份额在申购时收取申购费用。本基金 C 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。

### (一) 信诚新旺 A 类份额

1、本基金 A 类份额的场外申购费率如下：

单笔申购金额（含申购费） 申购费率

$M < 50$  万 1.50%

$50 \text{ 万} \leq M < 200$  万 1.20%

$200 \text{ 万} \leq M < 500$  万 0.80%

$M \geq 500$  万 1000 元/笔

（注：M：申购金额；单位：元）

本基金 A 类份额的场内申购费率由基金销售机构参照场外申购费率执行。

2、本基金 A 类份额的场外赎回费率按照基金份额持有时间逐级递减，场外赎回的实际执行的费率如下：

持有时间 场外赎回费率

$Y < 1$  年 0.125%

$1 \text{ 年} \leq Y < 2$  年 0.063%

$Y \geq 2$  年 0

（注：Y：持有时间，其中 1 年为 365 日，2 年为 730 日）

本基金 A 类份额的场内赎回费率为固定值 0.125%，不按份额持有时间分段设置赎回费率。

上述赎回费计入基金财产比例为 100%。

从场内转托管至场外的基金份额，从场外赎回时，其持有期限从转托管转入确认日开始计算。

### (二) 信诚新旺 C 类份额

新增的 C 类基金份额仅开通场外份额，不开通场内份额。投资人可以场外申购与赎回 C 类基金份额。

1、本基金 C 类份额不收取申购费用。

2、本基金 C 类份额的赎回费率如下：

持续持有期（Y） 赎回费率

$Y < 30$  天 0.50%

$Y \geq 30$  天 0

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。

### 3、基金销售服务费

本基金 C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.10%。本基金 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类份额基金资产净值的 0.10% 年费率计提。

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。

#### 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《信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）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部分，更新了托管人的有关信息。
- 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、在第九部分基金的投资部分，更新了基金投资组合报告，财务数据截止至 2017 年 3 月 31 日。
- 6、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 3 月 31 日；
- 7、在第二十二部分对基金份额持有人的服务部分，更新了二、网上交易服务的相关内容；
- 8、在第二十三部分其他应披露事项部分，披露了自 2016 年 12 月 20 日以来涉及本基金的相关公告。

信诚基金管理有限公司

2017 年 8 月 2 日