# 信诚金砖四国积极配置证券投资基金(LOF)招募说明书摘要

(2014年第1次更新)

## 基金管理人:信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】

本基金于2010年12月17日基金合同正式生效。

投资有风险,投资人申购本基金时应认真阅读招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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2013年12月17日,有关财务数据和净值表现截止日为2013年9月30日(未经审计)。

**一、基金的名称**

信诚金砖四国积极配置证券投资基金(LOF)

**二、基金的类型**

上市契约型开放式,基金中的基金

**三、基金的投资目标**

通过对"金砖四国"各地区间的积极配置,以及对"金砖四国"相关ETF和股票的精选,在有效分散风险的基础上,追求基金资产的长期稳定增值。

**四、基金的投资范围**

本基金可投资于下列金融产品或工具:交易型开放式指数基金(以下简称"ETF");普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证;政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券;银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具;金融衍生产品,结构性投资产品以及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本基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金合同中,"金砖四国"是指巴西、俄罗斯、印度、中国(含香港),本基金主要投资于"金砖四国"相关的金融资产,包括以"金砖四国"至少一国/地区为主要投资范围的ETF以及两类上市公司的股票:(1)在"金砖四国"登记注册的企业,(2)主营业务收入主要来自于"金砖四国"相关的金融资产的比例不低于基金权益类资产的80%,其余不高于20%的权益类资产可投资于非符合本基金定义的"金砖四国"相关金融资产,如台湾股票等。

本基金投资于ETF的比例不低于基金资产的60%,且本基金所投资的ETF应在与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册。

本基金投资于权益类资产的比例不低于基金资产的60%。

本基金持有现金或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%(若法律法规变更或取消本限制的,则本基金按变更或取消后的规定执行)。

**五、基金的投资策略**

本基金着重于自上而下的投资策略,通过对"金砖四国"各国家地区间的积极配置以及进一步的个券精选,构建组合,追求超越比较基准的收益。

1、资产配置策略

资产配置策略包括大类资产配置和地区配置两个层面。

在大类资产配置层面,原则上,本基金将积极投资于ETF和股票等权益类资产。当权益类市场整体系统性风险突出,无法通过地区配置降低组合风险的市场情况下,本基金将降低权益类资产的配置比例,但权益类资产的比例不低于基金资产的60%。

同时,本基金将运用积极的地区配置策略,在追求超额收益的同时,分散组合风险。地区配置通过定量和定性分析相结合的方式,依据对全球和投资目标市场的经济和金融参数的分析,综合决定主要目标市场国家地区的投资吸引力和投资风险,进而决定各个国家地区市场的投资比例。

(1)定量分析

本基金的定量分析主要从估值指标和动量指标两类指标入手。

长期看,价格必将回归价值。估值指标包括预期盈利收益率(E/Y)和市净率(P/B)。本基金将对各个市场的估值水平进行横向比较,选择相对低估的市场。同时,将各个市场当期值与其历史水平相比较,判断是否存在较大程度的低估或高估。

短期看,价格回归价值的路径各不相同,市场动量因素会影响短期收益。因此,本基金在考察价值的同时还将引入动量指标,主要包括1个月价格动量和12个月价格动量。

综合估值水平判断和动量分析的结果,得出初步地区配置建议。

(2)定性分析

本基金的定性分析将检验定量分析,并对初步配置进行校准,主要分析投资者情绪及风险偏好、政府政策转变、经济结构变化和特殊事件冲击等,例如,低估的市场可能会继续下行或者在长时间都处于低估状态。同时,结构性变化可能导致最初的估值信号变得不那么强烈或者不足以触发市场表现。另外,定性分析还将客观审慎的对分析师预测值进行合理调整,以克服预测值的"过分乐观偏差",该过程实质上包括了对定量分析中所采用的因子进行深入分析,以及对定量分析不能覆盖到的一切有效信息进行处理。

基金管理人将综合以上的定量分析和定性分析决定各国家地区的配置权重。

2、拟投资ETF和个股的选择

(1)拟投资ETF的选择

本基金在甄选ETF时将主要考虑以下因素:

1)标的指数的市场代表性。指数的市场代表性不仅体现在其能够较好反映全市场收益,更在于其与市场经济运行情况及预期的较高的相关性。因此,选择具有市场代表性的ETF有利于地区配置策略的有效执行。

2)流动性。关注ETF的流动性包括两个层面:第一,ETF标的指数成份股的流动性情况。一般而言,成分股的流动性愈好,ETF的流动性愈好。第二,ETF本身的流动性指标,例如ETF市值规模、日均成交量及换手率,ETF买卖价差(bid-ask spread)等。本基金亦会根据不同资金规模假设对标的ETF进行市场冲击检验。

3)跟踪误差。跟踪误差即意味着积极风险(active risk)。积极风险愈低,ETF的跟踪效果愈好。

4)总费用率(Total Expense Ratio)。ETF是一种间接投资工具,投资人在投资时须考虑其购买和持有成本,例如管理费、托管费及前端收费等等。

5)折溢价情况。由于ETF存在以实物申赎(股票组合和ETF份额互换)为基础的套利机制,折溢价水平一般较低。本基金将选择折溢价波动较小的ETF。

(2)个股的选择

本基金的股票投资将秉承价值主导的投资理念,甄选具有一定安全边际的个股。

本基金将根据调研考察和案头分析寻找基本面优良的股票,指标方面主要关注税后盈余增长情况、毛利率情况及资产回报情况等,同时强调上市公司治理情况,是否为股东创造最大价值。在此基础上,本基金将通过估值指标识别低估品种,主要关注市盈率、市净率和市现率。若为成长型股票,还将考察"市盈率相对盈利增长比率"(PEG)辅以判断。

本基金还将结合行业研究分析进行个股的行业配置调整,实现风险分散化。本基金管理人行业研究包括宏观经济周期、行业生命周期、行业结构升级、宏观和产业政策等内容。

3、固定收益资产的投资

本基金的固定收益资产投资仅作战术性规避风险之用。当全球股市整体估值过高或基金由于市场流动性不足而无法充分分散风险时,本基金将适度投资于国家信用债券、中国证监会认可的国际金融组织发行的债券或其他投资级及投资级以上的债券,例如美国国债、七大工业国(G7)发行的主权债券等。本基金的固定收益资产投资不限于"金砖四国"。

4、金融衍生品风险管理策略及流程

(1)运用原则

为了服务于"金砖四国"投资配置、投资策略执行以及风险管理的需要,本基金可能会进行一定的金融衍生品投资。本基金的金融衍生品投资应当仅限于投资组合避险或有效管理,不得用于投机或放大交易。

本基金运用金融衍生品遵循避险和有效管理两项原则:

1)避险

目前全球股票市场之相关连动性越来越高,提高了齐涨齐跌的风险,股指期货、期权等金融衍生品是系统性风险避险操作的有效工具,可减小基金因市场下跌而遭受的市场风险;另一方面,外汇远期合约、外汇期货、外汇互换等操作,亦可为控制外汇汇兑风险的重要策略。

2)有效管理

金融衍生品具有交易成本低及流动性佳等优点,通过对金融衍生品的有效管理,可提高基金投资组合的管理效率。

(2)风险管理流程

本基金在投资金融衍生品时的风险管理流程如下:

1)投资分析

在投资金融衍生品时,须进行周密的投资分析,分析本身要有严格的论证基础和根据。

2)交易执行

依据投资分析,来进行投资决定,并由交易部门来执行交易,做成交易执行纪录。

3)投资检讨

在金融衍生品的交易过后,须进行投资检讨,以落实投资的事后评价。

4)交易限制

严格遵守监管机关对金融衍生品的各种法规限制,并根据风险状况设立交易限额。

**六、基金的业绩比较基准**

本基金的业绩比较基准为:标准普尔金砖四国(含香港)市场指数(总回报)。

**七、基金的风险收益特征**

本基金主要投资于与"金砖四国"相关的权益类资产。从所投资市场看,"金砖四国"均属于新兴市场,其投资风险往往高于成熟市场;同时,"金砖四国"经济联动性和市场相关性存在日益加大的可能性,因此本基金国家配置的集中性风险也可能较其他分散化程度较高的新兴市场投资基金更高。从投资工具看,权益类投资的风险高于固定收益类投资的风险。因此,本基金是属于高预期风险和高预期收益的证券投资基金品种,其预期风险和预期收益水平高于一般的投资于全球或成熟市场的偏股型基金。

**八、投资限制**

1、组合投资比例限制

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点,通过分散投资降低基金财产的非系统性风险,保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制:

(1)本基金持有同一家银行的存款不得超过基金净值的20%。在托管账户的存款可以不受上述限制。

(2)本基金持有同一机构(政府、国际金融组织除外)发行的证券市值(不包括ETF)不得超过基金净值的10%。

(3)本基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产(不包括ETF)不得超过基金资产净值的10%,其中,持有任一国家或地区市场的证券资产(不包括ETF)不得超过基金资产净值的3%。

(4)不得购买证券(不包括ETF)用于控制或影响发行该证券的机构或其管理层。本基金管理人管理的全部基金不得持有同一机构10%以上具有投票权的证券发行总量。

前项投资比例限制应当合并计算同一机构境内外上市的总股本,同时应当一并计算全球存托凭证和美国存托凭证所代表的基础证券,并假设对持有的股本权证行使转换。

(5)本基金持有非流动性资产市值不得超过基金净值的10%。

前项非流动性资产是指法律或基金合同规定的流通受限证券以及中国证监会认定的其他资产。

(6)本基金管理人管理的全部基金持有任何一只境外基金,不得超过该境外基金总份额的20%。

(7)本基金为应付赎回、交易清算等临时用途借入现金的比例不得超过基金资产净值的10%,临时借入现金的期限以中国证监会规定的期限为准。

2、关于投资境外基金的限制

(1)每只境外基金投资比例不超过本基金基金资产净值的20%。本基金投资境外伞型基金的,该伞型基金应当视为一只基金。

(2)本基金不得投资于以下基金:

1)其他基金中基金;

2)联接基金(A Feeder Fund);

3)投资于前述两项基金的伞型基金子基金。

3、金融衍生品投资

本基金投资金融衍生品应当仅限于投资组合避险或有效管理,不得用于投机或放大交易,同时应当严格遵守下列规定:

(1)本基金的金融衍生品全部敞口不得高于基金资产净值的100%。

(2)本基金投资期货支付的初始保证金、投资期权支付或收取的期权费、投资柜台交易衍生品支付的初始费用的总额不得高于基金资产净值的10%。

(3)本基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品,应当符合以下要求:

1)所有参与交易的对手方(中资商业银行除外)应当具有不低于中国证监会认可的信用评级机构评级;

2)交易对手方应当至少每个工作日对交易进行估值,并且基金可在任何时候以公允价值终止交易;

3)任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的20%。

(4)本基金不得直接投资与实物商品相关的衍生品。

(5)在任何交易日日终,本基金所持有的有价证券和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)不得超过前一日基金资产的100%。本基金不做杠杆放大交易。

其中,有价证券指股票、ETF、债券(不含到期日一年以内的政府债券)等。

(6)在任何交易日日终,本基金所持有的权益类资产市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)不得低于前一日基金资产的60%。

4、证券借贷交易

本基金可以参与证券借贷交易,并且应当遵守下列规定:

(1)所有参与交易的对手方(中资商业银行除外)应当具有中国证监会认可的信用评级机构评级。

(2)应当采取市值计价制度进行调整以确保担保物市值不低于已借出证券市值的102%。

(3)借方应当在交易期内及时向本基金支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红。一旦借方违约,本基金根据协议和有关法律有权保留和处置担保物以满足索赔需要。

(4)除中国证监会另有规定外,担保物可以是以下金融工具或品种:

1)现金;

2)存款证明;

3)商业票据;

4)政府债券;

5)中资商业银行或由不低于中国证监会认可的信用评级机构评级的境外金融机构(作为交易对手方或其关联方的除外)出具的不可撤销信用证。

(5)本基金有权在任何时候终止证券借贷交易并在正常市场惯例的合理期限内要求归还任一或所有已借出的证券。

(6)基金参与证券借贷交易,所有已借出而未归还证券总市值不得超过基金总资产的50%。

上述比例限制计算,基金因参与证券借贷交易而持有的担保物不得计入基金总资产。

5、证券回购交易

本基金可以根据正常市场惯例参与正回购交易、逆回购交易,并且应当遵守下列规定:

(1)所有参与正回购交易的对手方(中资商业银行除外)应当具有中国证监会认可的信用评级机构信用评级。

(2)参与正回购交易,应当采取市值计价制度对卖出收益进行调整以确保现金不低于已售出证券市值的102%。一旦买方违约,本基金根据协议和有关法律有权保留或处置卖出收益以满足索赔需要。

(3)买方应当在正回购交易期内及时向本基金支付售出证券产生的所有股息、利息和分红。

(4)参与逆回购交易,应当对购入证券采取市值计价制度进行调整以确保已购入证券市值不低于支付现金的102%。一旦卖方违约,本基金根据协议和有关法律有权保留或处置已购入证券以满足索赔需要。

(5)基金参与正回购交易,所有已售出而未回购证券总市值不得超过基金总资产的50%。

上述比例限制计算,基金因参与正回购交易而持有的现金不得计入基金总资产。

**九、基金的投资组合报告(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2013年10月18日复核了本招募说明书中的投资组合报告和业绩数据等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告的报告期为2013年7月1日至2013年9月30日。

1、报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(人民币元) | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 12,632,415.53 | 26.25 |
| | 其中:普通股 | 12,632,415.53 | 26.25 |
| | 优先股 | - | - |
| | 存托凭证 | - | - |
| 2 | 基金投资 | 30,708,235.04 | 63.81 |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中:债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| | 其中:远期 | - | - |
| | 期货 | - | - |
| | 期权 | - | - |
| | 权证 | - | - |
| 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 | 货币市场工具 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 4,551,879.09 | 9.46 |
| 8 | 其他资产 | 235,548.51 | 0.49 |
| 9 | 合计 | 48,128,078.17 | 100.00 |

2、报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

| 国家(地区) | 公允价值(人民币元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|
| 中国香港 | 11,380,295.41 | 24.07 |
| 美国 | 1,252,120.12 | 2.65 |
| 合计 | 12,632,415.53 | 26.72 |

3、报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

| 行业类别 | 公允价值(人民币元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|
| 信息技术 | 3,514,000.63 | 7.43 |
| 金融 | 2,283,645.19 | 4.83 |
| 保健 | 1,750,371.53 | 3.70 |
| 工业 | 1,702,268.09 | 3.60 |
| 非必须消费品 | 1,520,803.95 | 3.22 |
| 其他 | 1,038,342.55 | 2.20 |
| 能源 | 558,283.55 | 1.18 |
| 必须消费品 | 168,120.15 | 0.36 |
| 材料 | 96,579.89 | 0.20 |
| 合计 | 12,632,415.53 | 26.72 |

注:本基金持有的股票及存托凭证采用全球行业分类标准(GICS)进行行业分类。

4、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及存托凭证投资明细

| 序号 | 公司名称(英文) | 公司名称(中文) | 证券代码 | 所在证券市场 | 所属国家(地区) | 数量(股) | 公允价值(人民币元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | CHINA MERCHANTS BK-H | 招商银行股份有限公司 | 3968 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 72,965 | 815,709.81 | 1.73 |
| 2 | CHINA LONGYUAN-H | 龙源电力股份有限公司 | 916 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 120,000 | 766,863.86 | 1.62 |
| 3 | GREAT WALL MOTOR | 长城汽车股份有限公司 | 2333 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 23,000 | 766,824.22 | 1.62 |
| 4 | WEIQIAO TEXTILE CO-H | 魏桥纺织股份有限公司 | 2698 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 209,000 | 753,979.73 | 1.59 |
| 5 | YY INC-ADR | YY通信有限公司 | YY US | 纽约 | 美国 | 2,500 | 719,008.60 | 1.52 |
| 6 | HUANENG RENEWABLES CORP LTD(HONG KONG) | 华能新能源股份有限公司 | 958 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 330,000 | 716,913.05 | 1.52 |
| 7 | ZTE CORP - H | 中兴通讯股份有限公司 | 763 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 55,400 | 704,556.97 | 1.49 |
| 8 | SINO BIOPHARMACEUTICAL | 中国生物制药股份有限公司 | 1177 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 168,000 | 699,311.34 | 1.48 |
| 9 | TONG REN TANG-H | 北京同仁堂科技发展股份有限公司 | 8069 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 33,000 | 654,117.75 | 1.38 |
| 10 | SEMICONDUCTOR MFG | 中芯国际股份有限公司 | 981 HK | 香港证券交易所 | 中国香港 | 1,569,000 | 646,886.78 | 1.37 |

注:本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

5、报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7、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。

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五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品

9、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基金投资明细

| 序号 | 基金名称 | 基金类型 | 运作方式 | 管理人 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | TRACKER FUND OF HONG KONG | ETF基金 | 契约型开放式 | STATE STREET GLOBAL ADVISORS ASIA LT | 6,951,408.44 | 14.70 |
| 2 | HANG SENG INVESTMENT INDEX FUNDS SERIES II-HSI ETF | ETF基金 | 契约型开放式 | HANG SENG INVESTMENT MANAGEMENT LTD | 6,040,955.82 | 12.78 |
| 3 | MARKET VECTORS RUSSIA ETF | ETF基金 | 契约型开放式 | VAN ECK ASSOCIATES CORP | 5,741,526.21 | 12.14 |
| 4 | ISHARES MSCI INDIA | ETF基金 | 契约型开放式 | BLACKROCK FUND ADVISORS | 3,521,771.14 | 7.45 |
| 5 | DB X-TRACKERS MSCI BRAZIL TRN INDEX ETF | ETF基金 | 契约型开放式 | db PLATINUM ADVISORS | 3,070,837.85 | 6.50 |
| 6 | ISHARES MSCI BRAZIL INDEX FUND | ETF基金 | 契约型开放式 | BLACKROCK FUND ADVISORS | 2,497,789.77 | 5.28 |
| 7 | ISHARES MSCI BRAZIL | ETF基金 | 契约型开放式 | BLACKROCK ASSET MANAGEMENT IRELAND L | 1,926,450.63 | 4.07 |
| 8 | DB CSI300 HEALTH CARE UCITS | ETF基金 | 契约型开放式 | APT SATELLITE HOLDINGS LIMITED | 957,495.18 | 2.03 |

注:本基金本报告期末仅持有上述8只基金。

10、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(人民币元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | 233,661.83 |
| 3 | 应收股利 | 1,339.03 |
| 4 | 应收利息 | 251.44 |
| 5 | 应收申购款 | 296.21 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 235,548.51 |

(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未存在流通受限情况。

**十、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2013年9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 | 净值增长率① | 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 2010年12月16日至2010年12月31日 | 0.00% | 0.00% | 2.19% | 0.53% | -2.19% | -0.53% |
| 2011年1月1日至2011年12月31日 | -20.80% | 1.09% | -26.41% | 1.36% | 5.61% | -0.27% |
| 2012年1月1日至2012年12月31日 | 7.83% | 0.87% | 15.73% | 0.94% | -7.90% | -0.07% |
| 2013年1月1日至2013年3月31日 | -4.10% | 0.76% | -1.69% | 0.76% | -2.41% | 0.00% |
| 2010年12月16日至2013年3月31日 | -18.10% | 0.96% | -14.45% | 1.13% | -3.65% | -0.17% |

(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:本基金建仓期自2010年12月17日至2011年6月16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:上海市世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层

办公地址:上海市世纪大道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:2亿元人民币

电话:(021)68649788

联系人:林军

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、监事基本情况

张翔燕女士,董事长,硕士学位。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。现任中信控股有限责任公司副总裁。

陈一松先生,董事,金融学硕士。历任中信实业银行资金部科长、中信证券股份有限公司总裁办主任、长城科技股份有限公司董事会秘书、中国建设银行股份有限公司行长秘书兼行长办公室副主任。现任中信信托有限责任公司总经理。

包学勤先生,董事,研究生。历任招商银行证券业务部出市代表、南方证券有限公司投资银行部总经理助理、国信证券有限公司投资银行二部总经理、中信证券股份有限公司深圳投资银行部总经理、中信信托有限责任公司投资银行二部总经理。现任中信信托有限责任公司副总经理。

Graham David Mason先生,董事,南非籍,保险精算专业学士。历任南非公募基金投资分析师、南非Norwich公司基金经理、英国保诚集团(南非)执行总裁。现任瀚亚投资执行副董事长。

黄慧敏女士,董事,新加坡籍,经济学学士。历任花旗银行消费金融事业部业务副理、新加坡大华银行业务开发副理、大华资产管理公司营销企划经理、瀚亚投资(新加坡)有限公司营销部主管、瀚亚投资(台湾)有限公司市场总监。现任瀚亚投资(台湾)有限公司总经理。

郑美美女士,董事,新加坡籍,工商管理硕士。历任新加坡金融管理局金融市场发展规划部处长。现任瀚亚投资(新加坡)有限公司督察长。

何德旭先生,独立董事,经济学博士。历任中国科学研究院财贸所处长、研究员等职。现任中国社会科学院数量经济与技术经济研究所副所长、金融研究中心副主任。

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、北京天华中兴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。

李莹女士,监事会主席,金融学硕士。历任中国建设银行沧浪办事处信贷科长、中国建设银行苏州分行中间业务部总经理助理、北京证券投行华东部一级项目经理、中新苏州工业园区创业投资有限公司投资银行部总经理、苏州工业园区银杏投资管理有限公司副总经理。现任苏州元禾控股有限公司财务总监。

於乐,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。

解晓然女士,监事,双学位,历任上海市共青团闸北区委员会宣传部副部长、天治基金管理有限公司监察稽核部总监助理。现任信诚基金管理有限公司监察稽核总监。

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、经营管理层人员情况

王俊锋先生,总经理,工商管理硕士。历任国泰基金管理有限公司市场部副总监、华宝兴业基金管理有限公司市场总监、瑞银环球资产管理(香港)有限公司北京代表处首席代表、瑞银证券有限责任公司资产管理部总监。现任信诚基金管理有限公司总经理、首席执行官,兼任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。

黄小坚,副总经理,经济学硕士。历任申银万国证券公司研究所行业分析师、银华基金管理有限公司行业研究员、投资管理部组合经理、基金经理、华宝兴业基金管理有限公司基金经理。现任信诚基金管理有限公司副总经理、首席投资官、股票投资总监、信诚优胜精选股票型证券投资基金基金经理。

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。

林军女士,副总经理,经济学硕士。历任浙江省证券公司投资银行部副总经理、市场总监、西南证券有限责任公司国际业务部总经理、招商基金管理有限公司总经理助理、营销总监、汇添富基金管理有限公司市场总监、副总经理、交银施罗德基金管理有限公司总经理助理、市场总监。现任信诚基金管理有限公司副总经理、首席市场官。

隋晓炜先生,副总经理,经济学硕士,注册会计师,历任中信证券股份有限公司高级经理、中信控股有限责任公司高级经理、信诚基金管理有限公司首席市场官。现任信诚基金管理公司副总经理,兼任中信信诚资产管理有限公司总经理。

3、督察长

唐世春先生,督察长,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。现任信诚基金管理有限公司督察长,兼任中信信诚资产管理有限公司。

4、基金经理

刘儒明先生,电机工程硕士,历任富国基金管理有限公司境外投资部经理、台湾工银证券投资信托股份有限公司基金经理、金复华证券投资信托股份有限公司基金经理、富邦证券投资信托股份有限公司基金经理、永昌证券投资信托股份有限公司基金经理。现任信诚基金管理有限公司海外投资副总监。

王肇先生,于2005至2007年间任职于毕马威会计师事务所(香港)担任中国税务顾问的职务;在2007至2010年间任职于国泰君安证券(香港)有限公司担任研究员的职务从事证券分析。2010年加入信诚基金管理有限公司,现任信诚金砖四国积极配置证券投资基金(LOF)的基金经理。

5、QDII投资决策委员会成员

黄小坚先生,副总经理,首席投资官,股票投资总监;

王旭巍先生,副首席投资官,固定收益总监;

胡喆女士,研究总监,特定资产投资管理总监;

吴雅楠,数量分析总监;

刘儒明先生,海外投资副总监。

上述人员之间不存在近亲属关系。

**十二、境外投资顾问**

(一)境外投资顾问基本情况

名称:瀚亚投资(新加坡)有限公司(Eastspring Investments (Singapore) Limited)(原"英国保诚资产管理(新加坡)有限公司(Prudential Asset Management (Singapore) Limited,简称"PAMS""))

注册地址:新加坡

办公地址:新加坡滨海林荫道10号32楼01室,滨海湾金融中心2座(10 Marina Boulevard #32-01, Marina Bay Financial Centre Tower 2, Singapore)

邮编:018983

成立时间:1994年

联系人:Nicholas Leigh Ferres

电话:65-63499758

电子邮箱:Nicholas.Ferres@eastspringinvestments.com

传真:65-6536-7020

公司简介:

瀚亚投资(新加坡)有限公司(原"英国保诚资产管理(新加坡)有限公司(Prudential Asset Management (Singapore) Limited,简称"PAMS""))是全球领先的金融服务机构之一英国保诚集团旗下的一家全资子公司,亦是英国保诚集团亚洲资产管理业务的区域总部。近年来,瀚亚投资(新加坡)有限公司及其所属的英国保诚集团的亚洲业务得到了迅猛的发展,其管理资金来自于亚洲各主要国家、地区的机构客户及零售客户。英国保诚集团的基金业务遍及香港、新加坡、印度、日本、台湾、马来西亚、韩国、越南、中国、印度尼西亚及阿联酋。截至2013年9月末,瀚亚投资(新加坡)有限公司(原"英国保诚资产管理(新加坡)有限公司")资产管理规模总计约达631亿美元,其中,拥有投资管理决定权(discretionary power)的账户资产规模合计约447亿美元。

(二)境外投资顾问主要人员情况

Kelvin Blacklock先生于2001年加入瀚亚投资(新加坡)有限公司(原"英国保诚资产管理(新加坡)有限公司"),目前担任全球资产配置团队(GAA)的首席投资官。GAA团队不仅管理着各类公募零售基金资产,也负责管理相当规模的保诚人寿委托资产。在过去多年中,Blacklock先生为保诚人寿的全球投资组合贡献颇多,主要体现在其对资产的战略配置及对机构的资产负债管理。近年,Blacklock先生将工作重点主要放在公募零售基金上。

在加入瀚亚投资(新加坡)有限公司之前,Blacklock先生就职于施罗德投资管理公司长达11年之久。他曾在伦敦担任固定收益团队的基金经理,主要关注G10的债券市场及汇率市场;之后他分别在香港和新加坡相继负责组建施罗德亚洲的新兴市场债券团队。

Blacklock先生毕业于苏格兰格拉斯哥的斯特拉斯克莱德大学,数学学士学位(优秀荣誉学位)。

Nick Ferres先生于2007年加入瀚亚投资(新加坡)有限公司(原"英国保诚资产管理(新加坡)有限公司"),目前担任全球资产配置团队投资总监,他主要负责GAA团队的权益类资产配置,具体包括制定大体投资策略及提供权益类资产的国家配置建议。他同时负责保诚香港的相关人寿资产及零售基金、保诚泰国的相关人寿资产以及台湾相关零售基金的投资管理工作。

在加入瀚亚投资(新加坡)有限公司之前,Ferres先生曾在澳大利亚任Goldman Sachs JBWere资产管理公司的平衡型基金的投资策略师及投资组合经理,管理资产规模约为12亿澳元。他所管理的Goldman Sachs JBWere多元化成长型基金,其五年期绩效排名在晨星数据同类型基金的前四分之一。

Ferres先生毕业于澳大利亚的蒙纳士大学,获得文科学士学位(优秀荣誉学位)及经济学毕业文凭。

Henry Hsiao于2011年1月加入瀚亚投资(新加坡)有限公司(原"英国保诚资产管理(新加坡)有限公司"),主要负责全球利率和外汇方面的策略观点的形成和配置建议的提出。他同时负责管理GAA团队的几只全球平衡型零售基金。在加入瀚亚投资(新加坡)有限公司之前,他在保诚亚洲证券投信公司(台湾)主要负责固定收益、数量和资产管理团队。Henry先生拥有10年的投资经验。Henry先生毕业于纽约圣约翰大学,获得工商管理硕士学位。

(三)境外投资顾问的职责

1、以自得的依据提供投资建议;

2、协助寻求基金的最佳交易执行;

3、协助基金管理人进行业绩评估;

4、协助基金管理人进行资产风险管理。

**十三、费用概览**

(一)与基金运作有关的费用

1、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)基金上市费用及年费;

(4)基金的证券交易费用、投资基金时所发生的费用及在境外市场的开户、交易、清算、登记等实际发生的费用;

(5)基金合同生效以后的信息披露费用;

(6)基金份额持有人大会费用;

(7)基金合同生效以后的会计师费和律师费;

(8)基金的资金汇划费用;

(9)基金依照有关法律法规应当缴纳的、购买或处置证券有关的任何税收、征费、关税、印花税、交易及其他税收及预扣提税(以及与前述各项有关的任何利息及费用)(简称"税收");

(10)按照国家有关规定可以列入的其他费用。

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

基金管理人的基金管理费(如基金管理人委托投资顾问,包括投资顾问费)按基金资产净值的1.75%年费率计提。

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的1.75%年费率计提。计算方法如下:

H=E×1.75%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提,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,基金托管人复核后于次月首日起10个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

(2)基金托管人的托管费

基金托管人的基金托管费(如基金托管人委托境外托管人,包括向其支付的相应服务费)按基金资产净值的0.3%年费率计提。

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的0.3%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.3%÷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,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,基金托管人复核后于次月首日起10个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

(3)本条第(一)款第3至第7项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定,列入当期基