信诚全球商品主题证券投资基金(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2011年12月20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20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

信诚全球商品主题证券投资基金(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

通过在全球范围内积极配置商品类相关资产,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:在已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的公募基金(以下无特别说明,均包括exchange traded fund, 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。

本基金的投资组合比例为:

本基金为基金中的基金,因此,投资于公募基金的比例不低于基金资产的60%。

本基金以商品主题投资为主,因此,投资于商品类基金的比例不低于本基金非固定收益类资产的80%。就基金合同而言,商品类基金是指业绩比较基准中90%以上为商品指数或商品价格的基金。商品主要指能源、贵金属、基础金属及农产品等大宗商品。

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%。法律、法规另有规定的,从其规定。

五、基金的投资策略

本基金将根据宏观及商品分析进行资产配置,并通过全球范围内精选基金构建组合,以达到预期的风险收益水平。

(一)资产配置策略:

1、自上而下的大类资产配置策略

本基金的战略性资产配置以大宗商品为主,并不因市场的中短期变化而改变。在特定时常状况下,当基金无法通过商品分散投资等方式避险时,本基金将投资于固定收益类资产、货币市场工具及现金等进行战术性资产配置调整,抵御下行风险。必要时,将使用金融衍生品进行组合避险和有效管理。

一般而言,由于商品走势与景气循环存在正向关系,债券表现则与景气循环呈反向关系,因此,本基金将重点观测以下经济景气度指标,用以大类资产配置决策:

- 宏观经济指标:生产指数、物流指数及产销率;投资新开工项目;就业状况(如失业率);美国救济金申领人数等;
- 流动性指标:货币供应量M2;各国基准利率水平及伦敦银行同业拆放利率(LIBOR);长短期无风险利差等;
- 经济信心指标:泰德价差(Treasury Eurodollar Spread,TED)及其它各国信用利差水平;信用违约互换率等;投资者信心指标;
- 社会需求指标:消费品零售指标、外贸进出口指标、消费者预期指标等。

按统计指标变动轨迹与经济变动轨迹之间的关系划分,上述景气指标又分先行指标、一致指标与滞后指标。本基金将保持对先行指标的跟踪,辅以一致与滞后指标作为巩固,以预测经济景气变化。

2、商品配置策略

根据市场惯例,大宗商品一般分为四大类别:能源、基础金属、贵金属及农产品。总体而言,商品具有商品属性和金融属性,各类商品所体现出的两类属性的强弱各异。这也决定了影响不同商品类别的价格波动因素既具有共通性又存在差异性。

本基金将主要从以下五个方面进行商品基本面的共性分析:

(1)需求状况

商品需求往往与经济行为紧密相连,体现出其强烈的周期性。这是因为景气上升期一般伴随不断攀升的通胀水平,以及大量的要素投入等扩张性经济行为,因此商品需求随之拉升,助推商品价格上升。反之,当景气下降,商品需求一般随之下降,价格存在下行压力。因此,本基金将使用上述分析框架重点观测经济景气变化进行需求预测。除此之外,商品本身的价格水平也会反作用于商品需求,而这种反作用的大小亦取决于其需求弹性。

(2)供给状况

本基金主要从产出意愿、产能限制和库存情况等方面分析商品的供给。大宗商品的供给变化可以分为两类:一、供给的扩张或收缩效应,这种效应仅指由于商品价格变化对供给的反作用。由于商品的金属属性,这类反作用尤其显著,即商品供给方可能由于价格波动而影响产出意愿,这种反作用程度同样受供给弹性所限;二、供给的一般变化,这种变化指的是除了价格因素以外的其他影响商品供给的因素,如产能限制、气候状况、政府干预、地缘政治等。产能限制可能受到产出成本、科技发展水平及当地行业格局及产业政策等因素而变化。除了前瞻性的对潜在供给情况做如上的分析外,本基金还将紧密跟踪商品的当前库存及产能利用情况判定供给是否趋紧。

(3)贸易政策

大宗商品在国际贸易及全球GDP中占据重要地位,因此,各国贸易政策将会深刻影响商品价格走势。本基金将对世界经济中掌握主要定价权的国家以及主要商品进出口国的政策动向进行剖析,例如进出口限制、关税及征费调整、贸易保护主义情绪等。

(4)外汇关联

由于大多商品交易以美元为计价货币,以美元为基准的汇率变动将直接影响商品进出口商的成本和利润。本基金将关注外汇市场对商品走势的影响,例如美元贬值,往往伴随商品价格上升。

(5)流动性状况

除上述因素,全球流动性状况亦会对商品中短期价格变化具有直截的影响。本基金将预测及追踪利率变化、资金流向、投资者风险偏好等因素,判断商品波动情况。一般而言,利率高或上升,流动性趋紧,商品价格降低;利率较低或下降,流动性宽裕,商品价格上涨。

共性之外,不同商品子行业因其各自特殊的属性、用途、定价机制、周期敏感度等而表现各异。

(1)能源:能源主要包括石油及天然气,其中以石油为主。石油既为各国政治博弈所牵,又是利益谈判的政治筹码。因此,本基金将密切关注全球时事政治,尤其关注重要产油国家的地缘政治动向,如中东、北非等国。另外,本基金还将深入研析全球石油剩余产能、季节性需求变化及不同油品差异(低硫原油的供应量)等作为投资依据。

(2)基础金属:相比其他商品类别,基础金属与宏观经济活动关联尤为明显,例如铜、镍、铁矿石等。本基金将重点关注新兴市场,尤其是中国的经济增速、基建投入和产业政策预期,以判断基础金属需求变化。另外,基础金属的产销成本也会直接影响其走势,例如重要生产国的公用事业成本(水、电费率)、劳工政策及运输成本等。

(3)贵金属:相比其他商品类别,贵金属的价格规律与金融参数相关度最高,这是由于其价格构成中保值因子较大。相关金融指标包括美元指数走势、美国名义利率和实际利率水平及变化、通胀水平及预期。少数贵金属亦广泛用于工业制造,例如白银、铂金、钯金。因此,针对具体金属类别,相关产业的需求分析尤为重要。

(4)农产品:由于制约因素的不同,农产品的价格逻辑有所差异。本基金将特别关注以下因素:供给方面包括作物生长周期、耕地面积变化、气候变化、重要出口国的政策动向及季节性库存变化等;需求方面包括重要消费国的政策动向、全球人口结构变化、替代能源科技进展等。

独立分析之外,本基金还将充分借鉴国际专业预测机构的资源和判断,例如能源观察机构有国际能源署(IEA)、美国能源信息署(EIA);基础金属及贵金属研究机构主要以黄金矿业服务公司(GFMS)为首;农产品则有美国农业部、澳洲农业局。除此之外,权威券商的研究报告亦是重要参考,如高盛、巴克莱等。

基本面分析是本基金商品配置的主要策略,但由于商品价格从历史来看具有较强的趋势性和周期性,本基金将结合技术指标,如一个月价格动量等,对不同商品类别进行战术调整。

3、ETF投资策略

本基金将主要以风险为主要考量,通过以下流程筛选ETF。

(1)商品类ETF库的建设

通过基金资讯系统(如理柏、晨星、彭博等,视基金需要而定),搜集符合基金合同定义的商品类ETF并对其进行多维的细分分类。按标的资产分,有a)实物商品ETF;b)商品衍生品ETF;按商品类别分,有追踪能源、基础金属、贵金属和农产品及单一商品种类的ETF。

(2)ETF流动性筛选

ETF的流动性是最重要的筛选准则之一,本基金将考察以下方面对ETF进行筛选:

- ETF规模,规模过小可能存在提前清算或变现成本过大的问题;辅以观察日均成交量及换手率等指标;
- ETF的做市活跃程度,主要观察买卖价差(bid-ask spread)是否合理;
- ETF的折溢价水平,折溢价水平直接决定了ETF的交易风险,而ETF标的资产的波动率则决定了折溢价水平的合理区间。

本基金亦会根据不同资金规模投资对标的ETF进行市场冲击检验,把握ETF买卖的显性成本和隐性成本。

(3)积极风险最小化

投资ETF的目标一般以获取其该ETF所追踪资产的收益,因此,ETF净值与其标的资产价格之间的差异愈小愈好,即追求积极风险最小化。本基金主要考察ETF的跟踪误差及跟踪偏离度来考核其积极风险。

(4)上市地及计价币别考量

现实投资环境下不得不考虑拟投资ETF的上市地分布和其计价币种。上市地分布过于分散,跨越时区过多,易提高管理成本和交易风险;计价货币尽量以流动性好的主流货币为主,提高换汇效率。

(5)总费用率控制

本基金还将比较并尽量选择总费用率(Total Expense Ratio)较具竞争力的ETF品种,包括其购买及持有成本,例如管理费、托管费及前端收费等。

(6)对手方风险控制

对于合成ETF,本基金不仅将重点评估单个发行人的违约风险,并引鉴国际评级等其他第三方评估报告,还将通过分散投资的方式降低集中化的对手方风险。

4、非上市基金投资策略

非上市基金的投资主要有两类目的:一是在ETF投资品种缺失或流动性不足的情况下,投资于跟踪某一或某几类商品走势的指数基金;二是意在间接获取管理业绩优良的主动型公募基金的超额收益。

(1)商品类非上市基金库的建设

与ETF库的建设一样,主要通过基金资讯系统搜集符合基金合同定义的商品类非上市基金并对其进行多维的细分分类。分类方式除了上述ETF分类维度外,还包括不同投资目标和投资策略的基金分类等。

(2)定量筛选:

本基金的量化筛选主要依次包括基金稳定性、收益性和风险调整绩效这三个方面。

稳定性方面主要考察基金成立年限和基金经理变动情况,基金成立时间较短和基金经理变动频繁的基金易缺乏业绩一致性。

收益性方面主要考察基金的短、中、长期业绩,并对其进行排序,选择其中短期业绩(3个月及1个月的回报率)排名靠前、中期业绩(6个月及1年的回报率)及长期业绩(3年回报率)突出的基金;

单纯追求收益率可能导致本基金组合的风险定位偏离,因此本基金将重点考察风险调整绩效,如夏普比率和信息比率较高的基金,其单位风险收益较大。

(3)定性筛选:

定量筛选是基于过往数据的分析,而定性分析则可通过多种形式挖掘基金收益因素中更具延续性、更具预测性的特质,以完善基金投资决策过程。

首先,评估基金经理及投资团队:关于在任基金经理,将主要了解其投资年限及履历,过往投资绩效、风险偏好程度及团队合作方式;关于投资团队,将主要了解其研究团队的人数、覆盖及所拥有的资料库情况等;

其次,检视基金的操作逻辑:例如该基金采用自上而下还是自下而上或兼有的逻辑、基金的战略及战术资产配置布局、组合构建方法论,等;

再次,了解市场前瞻:通过访谈、电话会议等知悉该基金经理对未来市场的看法及下一步操作思路,例如对不同行业/地区/货币的配置将会相对基准超配或低配等;

最后,掌握风险管理流程:例如单一持股比例、单一行业比例、久期配比等。

5、股票投资策略

个股投资为本基金组合的卫星配置,仅在确定性较高的情况下进行增强性投资。本基金的股票投资偏向绩优蓝筹股,通过投资大市值股票来获取该股票所处产业或行业的整体平均表现。

6、固定收益资产投资策略

本基金的固定收益资产投资仅作战术性规避风险之用。当经济进入中期回调或衰退时,本基金将适度投资于债券等固定收益品种以降低组合波动性。具体而言,在衰退期,本基金将主要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等,例如美国国债、七大工业国(G7)发行的主权债券等;当经济出现复苏迹象时,公司债等信用类债券一般将因信用评级回升而有所表现,在风险控制情况下将会适当配置。投资工具上,本基金既可直接投资于债券,亦可投资于债券ETF或基金。

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高盛商品总收益指数(S&P GSCI Commodity Total Return Index)。

七、基金的风险收益特征

本基金主要投资全球商品类基金,商品价格具有较高的波动性,因此,本基金属于较高预期风险和较高预期收益的证券投资基金品种。

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、境外基金投资

(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。

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,基金因参与逆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	1,274,493.40	14.81
	其中:普通股	1,274,493.40	14.81
	优先股	–	–
	存托凭证	–	–
2	基金投资	6,619,911.87	76.92
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	691,474.07	8.03
8	其他资产	20,811.49	0.24
9	合计	8,606,690.83	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	780,538.49	9.70
美国	493,954.91	6.14
合计	1,274,493.40	15.84

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(%)
材料	362,655.81	4.51
信息技术	288,689.35	3.59
非必须消费品	155,501.63	1.93
金融	148,651.23	1.85
工业	147,632.39	1.84
能源	71,096.65	0.88
保健	59,465.25	0.74
必须消费品	28,020.03	0.35
其他	12,781.06	0.16
合计	1,274,493.40	15.84

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	EGO US	ELDORADO金业有限公司	EGO US	纽约	美国	5,100	210,390.71	2.62
2	ABX US	BARRICK金业有限公司	ABX US	纽约	美国	1,300	148,818.49	1.85
3	CHINA MINSHENG –H	中国民生银行股份有限公司	1988 HK	香港证券交易所	中国香港	13,000	95,548.76	1.19
4	ANHUI CONCH CEMENT	安徽海螺水泥股份有限公司	0914 HK	香港证券交易所	中国香港	4,500	88,841.08	1.10
5	YY INC-ADR	YY通信有限公司	YY US	纽约	美国	300	86,281.03	1.07
6	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	2,500	83,350.46	1.04
7	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	34,000	73,863.77	0.92
8	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	20,000	72,151.17	0.90
9	CHINA DATANG	中国大唐集团新能源股份有限公司	1798 HK	香港证券交易所	中国香港	61,000	71,096.65	0.88
10	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	3,000	59,465.25	0.74

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	POWERSHARES DB AGRICULTURE F	ETF基金	契约型开放式	DEUTSCHE BANK AG	1,477,087.74	18.36
2	POWERSHARES DB ENERGY FUND	ETF基金	契约型开放式	DEUTSCHE BANK AG	1,471,585.28	18.29
3	UNITED STATES BRENT OIL FUND	ETF基金	契约型开放式	UNITED STATES COMMODITIES FUND LLC	1,462,397.71	18.18
4	UNITED STATES OIL FUND LP	ETF基金	契约型开放式	UNITED STATES COMMODITIES FUND LLC	815,593.68	10.14
5	POWERSHARES DB OIL F	ETF基金	契约型开放式	POWERSHARES DB OIL FUND	489,233.25	6.08
6	POWERSHARES DB BASE	ETF基金	契约型开放式	POWERSHARES DB METALS F	411,424.16	5.11
7	UNITED STATES DIESEL–HEATING	ETF基金	契约型开放式	UNITED STATES DIESEL–HEATING	276,377.19	3.44
8	POWERSHARES DB PREC METALS F	ETF基金	契约型开放式	DEUTSCHE BANK AG	216,212.86	2.69

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	–
3	应收股利	223.17
4	应收利息	2,263.66
5	应收申购款	3,200.40
6	其他应收款	–
7	待摊费用	15,124.26
8	其他	–
9	合计	20,811.49

(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。

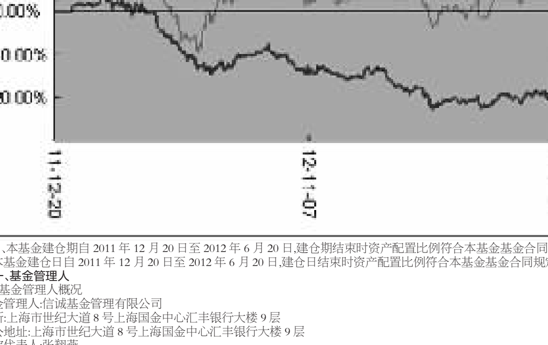
十、基金的业绩

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
2012年	–15.30%	0.62%	0.08%	1.07%	–15.38%	–0.45%
2013年1月1日至2013年6月30日	–7.79%	0.61%	–5.41%	0.74%	–2.3800%	–0.1300%
2013年1月1日至2013年9月30日	–7.91%	0.62%	–0.89%	0.75%	–7.0200%	–0.1300%
2011年12月20日至2013年9月30日	–22.00%	0.61%	3.25%	0.95%	–25.25%	–0.34%

(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、本基金建仓期自2011年12月20日至2012年6月20日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

2、本基金建仓日自2011年12月20日至2012年6月20日,建仓日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。

於乐女士,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市场总监、首席市场官、首席运营官。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董事。

4、基金经理

李舒禾,台湾国立成功大学会计研究所硕士,历任台湾宝来投信指数投资部资深研究员、环球市场投资部基金经理、期货信托处基金经理。现任信诚基金管理有限公司基金经理。

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、信诚全球商品主题证券投资基金(LOF)和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,特定资产投资管理总监、研究总监;

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、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以及其他为基金利益而产生的中介费用;

8、基金的资金汇划费用;

9、外汇兑换交易的相关费用;

10、与基金财产缴纳税收有关的手续费、汇款费等;

11、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、税收及费用);

12、按照国家有关规定可以列支的其他费用。

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

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12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,列入或摊入当期基金费用。

3、不列入基金费用的项目

本条第(一)款约定以外的其他费用,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,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

4、基金费用调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费、基金托管费,无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前依照《信息披露办法》在指定媒体予以披露。

(二)与基金销售有关的费用

1、本基金申购费率最高不高于净申购金额的5%,且按照申购金额递减,即申购金额越大,所适用的申购费率越低,如下表所示:

申购金额(M)	申购费率
M<100万	1.6%
100万≤M<200万	1.2%
200万≤M<500万	0.8%
M≥500万	1000元/笔

(注:M:认购金额;单位:元)

本基金的申购费用由申购人承担,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用,不列入基金财产。

2、本基金场外赎回费率最高不超过赎回金额的5%,按照持有时间递减,即相关基金份额持有时间越长,所适用的赎回费率越低,赎回费用等于赎回金额乘以所适用的赎回费率(其中1年为365天),具体如下表所示:

申请份额持有时间(N)	赎回费率
N<1年	0.5%
1年≤N<2年	0.25%
N≥2年	0

本基金场内赎回费率为0.5%。

本基金的赎回费用由赎回本基金份额的基金份额持有人承担,赎回费用在扣除手续费后余额不得低于赎回费总额的25%应当归入基金财产,其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。

3、基金管理人可以在法律法规和基金合同规定范围内调整申购费率、调低赎回费率或调整收费方式。费率或收费方式如发生变更,基金管理人应在调整实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上刊登公告。

十三、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:人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟捌佰肆拾捌万壹仟玖佰叁拾捌元整

法定代表人:田国立

基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字【1998】24号

托管及投资者服务部总经理:李爱华

托管部门信息披露联系人:唐州徽

电话:(010)66594855

传真:(010)66594942

(二)基金托管部门及主要人员情况

中国银行于1998年设立基金托管部,中国银行于2005年3月23日正式将基金托管部更名为托管及投资者服务部,现有员工120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、境外三类机构银行间债券、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、产品丰富的托管产品体系。在国内,中国银行是首家开展绩效评估绩效评估、风险管理等增值服务,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2013年9月30日,中国银行已托管233只证券投资基金,其中境内基金209只,QDII基金24只,覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金,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。

十四、境外托管人

名称:中国银行(香港)有限公司

住所:香港花园道1号中银大厦

办公地址:香港花园道1号中银大厦

法定代表人:和广北总裁

成立时间:1964年10月16日

组织形式:股份有限公司

存续期间:持续经营

联系人:黄晚仪 副总经理 托管业务主管

联系电话:852-3982-3753

中国银行(香港)有限公司("中银香港")早于1964年成立,并在2001年10月1日正式重组为中国银行(香港)有限公司,是一家在香港注册的持牌银行。其控股公司-中银香港(控股)有限公司("中银香港(控股)")-则于2001年2日在香港注册成立,并于2002年7月25日开始在香港联合交易所主板上市,2002年12月2日被纳入为恒生指数成分股。中银香港目前主要受香港金管局、证监会以及联交所等机构的监管。

	穆迪投资服务	标准普尔	惠誉国际评级
评级展望	稳定	稳定	稳定
长期	Aa3	A+	A
短期	P–1	A–1	F1
基本实力/财务实力	C+		–

中银香港作为香港第二大银行集团,亦为三家本地发钞银行之一,拥有最庞大分行网络与广阔的客户基础。

托管服务是中银香港企业银行业务的核心产品之一,目前为超过六十万企业及工商客户提供一站式的证券托管服务。对于服务国内企业及机构性客户(包括各类QDII及其理财产品等),亦素有经验,于行业处于领先地位,包括于2006年被委任为国内首只银行类QDII产品之境外托管行,及于2007年被委任为国内首只券商类QDII集成计划之境外托管行等,其业务专长及全方位的配备,令中银香港成为目前本地唯一的中资全面性专业全球托管银行,亦是唯一荣获「亚洲投资人杂志」颁发奖项的中资托管行(2012年服务提供者奖项「最佳跨境托管亚洲银行奖」)。截至2012年12日31日止,中银香港(控股)的托管资产规模为6,190亿港元。

十五、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1、直销机构

信诚基金管理有限公司

注册地址:上海市世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层

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

联系人:杨雁

联系电话:021-68649788

客服电话:400-6660066,021-51085168

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.xcfunds.com 或 www.citicprufunds.com.cn

2、代销机构

(1)中国银行股份有限公司

注册地址:北京市西城区复兴门内大街1号

办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号

法定代表人:田国立

统一客户服务电话:95566

公司网站:http://www.boc.cn

(2)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:王洪章

电话:010-66275654

传真:010-66275654

联系人:张静

客服电话:95533

公司网站:www.ccb.com

(3)中国农业银行股份有限公司

注册地址:北京市东城区建国门内大街69号

办公地址:北京市东城区建国门内大街69号

法定代表人:蒋超良

客服电话:95599

网址:www.95599.cn

(4)招商银行股份有限公司

注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦

法定代表人:傅育宁

电话:0755-83198888

传真:0755-83195049

联系人:邓炯鹏

客服电话:95555

网址:www.cmbchina.com

(5)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:牛锡明

电话:(021)58781234

传真:(021)58408483

联系人:曹榕

客户服务电话:95559

网址:www.bankcomm.com

(6)宁波银行股份有限公司

注册地址:宁波市鄞州区宁南南路700号

办公地址:宁波市鄞州区宁南南路700号

法定代表人:陆华裕

客户服务统一咨询电话: 96528,上海地区:962528

网址: www.nbcb.com.cn

联系人:胡技勋

电话:0574-89068340

传真:0574-87050024(7)东莞银行股份有限公司

注册地址:广东省东莞市莞城区体育路21号东莞银行大厦

办公地址:广东省东莞市莞城区体育路21号东莞银行大厦

法定代表人:廖玉林

客户服务热线:0769-96228

网址:www.dongguanbank.cn

(8)华夏银行股份有限公司

地址:北京市东城区建国门内大街22号

法定代表人:吴建

联系人:马旭

客户服务电话:95577

网址:www.hxb.com.cn

(9)中信证券股份有限公司

注册地址:住所: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:顾凌

联系人:陈忠

电话:0755-23835888、010-60838888

传真:0755-23835861、010-60836029

网址:www.ecitic.com

(10)中信证券(浙江)有限责任公司

注册地址:浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19层、20层

办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19层、20层

法定代表人:沈强

开放式基金咨询电话:0571-95548

开放式基金业务传真:0571-85106383

网址:www.bigsun.com.cn

(11)中信万通证券有限责任公司

注册地址:青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层(1507室)

办公地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场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:0532-96577

网址:www.zxwt.com.cn

(12)中信建投证券有限责任公司

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

开放式基金咨询电话:4008888108

网址:www.csc108.com

(13)中国中投证券有限责任公司

注册地址:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层至21层及第04层01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元

办公地址:深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第4、18层至21层

法定代表人:龙增来

联系人:刘权

联系电话:0755-82026521、95532

客服电话:400-600-8008

公司网站:www.china-invs.cn

(14)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:林生迎

电话:(0755)82960223

传真:(0755)82943636

网址:www.newone.com.cn

客服电话:95565、4008888111

(15)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

法人代表人:何如

联系电话:0755-82130833

基金业务联系人:齐晓燕

联系电话:0755-82130833

传真:0755-82133952

全国统一客户服务电话:95536

网址: www.guosen.com.cn

(16)海通证券股份有限公司

注册地址:上海市广东路689号

办公地址:上海市广东路689号

法定代表人:王开国

电话:021-23219000

传真:021-23219100

联系人:李笑鸣

客服电话:95553或拨打各城市营业网点咨询电话

公司网址:www.htsec.com

(17)申银万国证券股份有限公司

注册地址:上海市常熟路171号

办公地址:上海市常熟路171号

法定代表人:储晓明

联系人:高夫

联系电话:021-54033888

传真:021-33388224

客服电话:95523或者4008895523

网址:www.sywg.com.cn

(18)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:田薇、宋明

联系电话:010-66568450

客户服务电话:4008-888-888

网站:www.chinastock.com.cn

(19)国泰君安证券股份有限公司

注册地址:上海市浦东新区商城路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:万建华

联系人:芮敏祺

电话:021-62580818-213

客户服务热线:4008888666

(20)广发证券股份有限公司

法定代表人:孙树明

注册地址:广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼(4301-4316房)

办公地址:广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼

联系人:黄岚

统一客户服务热线:95575或致电各地营业网点

开放式基金业务传真:(020)87555305

(21)华福证券有限责任公司

注册地址:福建省福州市五四路157号新天地大厦7、8层

办公地址:福建省福州市五四路157号新天地大厦7至10层

法定代表人:黄金琳

联系人:张腾

联系电话:0591-87383623

业务传真:0591-87383610

统一客户服务电话:96326(福建省外请先拨0591)

公司网址:www.hfzq.com.cn

(22)西藏同信证券有限责任公司

注册地址: 拉萨市北京中路101号

办公地址:上海市永和路118弄东方环球企业园24号楼

法定代表人:贾绍君

电话:021-36537114

传真:021-36538467

联系人:汪尚斌

客服电话:400-88111-77

公司网址:www.xzsec.com

(23)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:袁长清(代行)

客服电话:95525、4008888788、10108998

联系人:刘晨

联系电话:021-22169999

网址:www.ebscn.com

(24)安信证券股份有限公司

注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元

办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元

法定代表人:牛冠兴

开放式基金咨询电话:4008001001

联系人:陈剑虹

联系电话:0755-82558305

网址:http://www.essence.com.cn

(25)齐鲁证券有限公司

注册地址: 济南市经十路20518号

办公地址:济南市经七路86号23层

法定代表人:李玮

联系人:吴阳

联系电话:0531-68889157

传真:0531-68889752

客服电话:95538

公司网址: www.qlzq.com.cn

(26)长江证券股份有限公司

注册地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人:胡运钊

客户服务热线:95579或4008-888-999

联系人:李良

电话:027-65799999

传真:027-85481900

长江证券客户服务网站:www.95579.com

(27)东方证券股份有限公司

注册地址:上海市中山南路318号2号楼22-29层

法定代表人:潘鑫军

电话: 021-63325888-3108

传真: 021-63326173

联系人:吴宇

客户服务电话:95503

网址:www.dfzq.com.cn

(28)天相投资顾问有限公司(简称"天相投顾")

注册地址:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701

办公地址:北京市西城区金融街5号新盛大厦B座4层

法定代表人:林义相

客服电话: 010-66045678

联系人:林爽

联系电话:010-66045608

传真:010-66045521

天相投顾网址: http://www.txsec.com

天相基金网网址:www.jjm.com.cnm

(29)信达证券股份有限公司

注册(办公)地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人:高冠江

联系人:鹿馨方

联系电话:010-63081000

传真:010-63080978

客服电话:400-800-8899

公司网址:www.cindasc.com

(30)平安证券有限责任公司

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

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

联系人:郑舒丽(zhengshuli001@pingan.com.cn,0755-22626391)

网址: www.pingan.com

(31)宏源证券股份有限公司

注册地址: 新疆乌鲁木齐市文艺路233号

办公地址:北京市西城区太平桥大街19号

法定代表人:冯戎

客服电话:4008-000-562

网址:www.hysec.com

(32)华泰证券股份有限公司

注册地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦

办公地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦

法定代表人:吴万善

客服电话:95597

(33)红塔证券股份有限责任公司

注册地址:云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼

法定代表人:况雨林

传真:0871-3578827

客服电话:4008718880

网址:www.hongtastock.com

(34)世纪证券有限责任公司

注册地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦40/42层

法定代表人:卢长才

电话:0755-83199599

传真:0755-83199545

网址:www.csco.com.cn

(35)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

客服电话: 400-6666-888

网址: www.cgws.com

(二)注册登记机构

名称: 中国证券登记结算有限责任公司

注册地址: 北京西城区金融大街27号投资广场23层

法定代表人: 金颖

电话:(010)58598839

传真:(010)58598907

联系人: 朱立元

(三)律师事务所

名称:通力律师事务所

注册地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人:韩炯

联系人:安冬

电话: (86 21) 3135 8666

传真: (86 21) 3135 8600

经办律师:吕红、安冬

(四)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)

住所: 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

法定代表人:姚建华

电话: 8621 2212 2888

传真: 8621 6288 1889

联系人: 王国蓓

经办注册会计师:王国蓓、黄小熠

十六、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》、《证券投资基金运作管理办法》、《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《全球商品主题证券投资基金(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"部分更新了本招募书的内容及数据的截止日期。

2.在"第四部分 基金的投资"部分,更新了基金投资组合报告的内容,报告期更改为2013年7月1日至2013年9月30日。

3.更新了"第五部分 基金的业绩",数据截止至2013年9月30日。

4.在"第六部分 基金管理人"中的"基金管理人概况"部分,更新了管理人的联系人;在"主要人员情况"部分,更新了董事会成员、监事、经营管理层人员、督察长、基金经理和投资决策委员会成员的相关内容。

5.在"第十部分 基金份额的申购和赎回",更新了本基金投资的主要市场。

6.在"第十九部分 基金托管人" 更新了基金托管人的相关信息。

7.在"第二十一部分 相关服务机构"部分,更新了基金代销机构的有关信息;在"会计师事务所部分",更新了会计师事务所的有关信息。

8.在"第二十三部分 基金托管协议的内容摘要"部分,更新了托管人的基本信息。

9.在"第二十五部分 其他应披露事项",披露了自2013年6月21日以来涉及本基金的相关公告。

信诚基金管理有限公司

2014年1月30日