信诚永丰一年定期开放混合型证券投资基金招募说明书摘要

（2017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：中信银行股份有限公司

重要提示

本基金于2017年3月1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9月1日，有关财务数据和净值表现截止日为2017年6月30日（未经审计）。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：信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

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

组织形式：有限责任公司

注册资本：2亿元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、境外证券投资管理和中国证监会许可的其他业务（涉及行政许可的凭许可证经营）

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。

Guy Robert STRAPP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

杨旭先生，理学硕士、文学硕士。曾任职于美国对冲基金Robust methods公司，担任数量分析师；于华尔街对冲基金WSFA Group公司，担任Global Systematic Alpha Fund助理基金经理。2012年8月加入信诚基金，历任助理投资经理、专户投资经理。现任量化投资副总监，信诚中证500指数分级基金、信诚沪深300指数分级基金、信诚中证800医药指数分级基金、信诚中证800有色指数分级基金、信诚中证800金融指数分级基金、信诚中证TMT产业主题指数分级基金、信诚中证信息安全指数分级基金、信诚中证智能家居指数分级基金、信诚中证基建工程指数型证券投资基金（LOF）、信诚鼎利定增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、信诚至裕灵活配置混合型证券投资基金、信诚新悦回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚新兴产业混合型证券投资基金、信诚永丰一年定期开放混合型证券投资基金、信诚至泰灵活配置混合型证券投资基金、信诚新泽回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚至信灵活配置混合型证券投资基金、信诚量化阿尔法股票型证券投资基金、信诚至盛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

1、基本情况

名称：中信银行股份有限公司（简称“中信银行”）

住所：北京市东城区朝阳门北大街9号

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街9号

法定代表人：李庆萍

成立时间：1987年4月20日

组织形式：股份有限公司

注册资本：489.35亿元人民币

存续期间：持续经营

批准设立文号：中华人民共和国国务院办公厅国办函[1987]14号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[2004]125号

联系人：中信银行资产托管部

联系电话：4006800000

传真：010-85230024

客服电话：95558

网址：bank.ecitic.com

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项；提供保管箱服务；结汇、售汇业务；代理开放式基金业务；办理黄金业务；黄金进出口；开展证券投资基金、企业年金基金、保险资金、合格境外机构投资者托管业务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务；保险兼业代理业务（有效期至2017年09月08日）。（依法须经批准的项目，经相关部门批准后依批准的内容开展经营活动。）

中信银行（601998.SH、0998.HK）成立于1987年，原名中信实业银行，是中国改革开放中最早成立的新兴商业银行之一，是中国最早参与国内外金融市场融资的商业银行，并以屡创中国现代金融史上多个第一而蜚声海内外。伴随中国经济的快速发展，中信实业银行在中国金融市场改革的大潮中逐渐成长壮大，于2005年8月，正式更名“中信银行”。2006年12月，以中国中信集团和中信国际金融控股有限公司为股东，正式成立中信银行股份有限公司。同年，成功引进战略投资者，与欧洲领先的西班牙对外银行（BBVA）建立了优势互补的战略合作关系。2007年4月27日，中信银行在上海交易所和香港联合交易所成功同步上市。2009年，中信银行成功收购中信国际金融控股有限公司（简称：中信国金）70.32%股权。经过三十年的发展，中信银行已成为国内资本实力最雄厚的商业银行之一，是一家快速增长并具有强大综合竞争力的全国性股份制商业银行。2009年，中信银行通过了美国SAS70内部控制审订并获得无保留意见的SAS70审订报告，表明了独立公正第三方对中信银行托管服务运作流程的风险管理和内部控制的健全有效性全面认可。

（二）主要人员情况

孙德顺先生，中信银行执行董事、行长。孙先生自2016年7月20日起任本行行长。孙先生同时担任中信银行（国际）董事长。此前，孙先生于2014年5月至2016年7月任本行常务副行长；2014年3月起任本行执行董事；2011年12月至2014年5月任本行副行长，2011年10月起任本行党委副书记；2010年1月至2011年10月任交通银行北京管理部副总裁兼交通银行北京市分行党委书记、行长；2005年12月至2009年12月任交通银行北京市分行党委书记、行长；1984年5月至2005年11月在中国工商银行海淀区办事处、海淀区支行、北京分行、数据中心（北京）等单位工作，期间，1995年12月至2005年11月任中国工商银行北京分行行长助理、副行长，1999年1月至2004年4月曾兼任中国工商银行数据中心（北京）总经理；1981年4月至1984年5月就职于中国人民银行。孙先生拥有三十多年的中国银行业从业经验。孙先生毕业于东北财经大学，获经济学硕士学位。

张强先生，中信银行副行长，分管托管业务。张先生自2010年3月起任本行副行长。此前，张先生于2006年4月至2010年3月任本行行长助理、党委委员，期间，2006年4月至2007年3月曾兼任总行公司银行部总经理。张先生2000年1月至2006年4月任本行总行营业部副总经理、常务副总经理和总经理；1990年9月至2000年1月先后在本行信贷部、济南分行和青岛分行工作，曾任总行信贷部副总经理、总经理、分行副行长和行长。自1990年9月至今，张先生一直为本行服务，在中国银行业拥有近三十年从业经历。张先生为高级经济师，先后于中南财经大学（现中南财经政法大学）、辽宁大学获得经济学学士学位、金融学硕士学位。

杨洪先生，现任中信银行资产托管部总经理，硕士研究生学历，高级经济师，教授级注册咨询师。先后毕业于四川大学和北京大学工商管理学院。曾供职于中国人民银行四川省分行、中国工商银行四川省分行。1997年加入中信银行，相继任中信银行成都分行信贷部总经理、支行行长，总行零售银行部总经理助理兼市场营销部总经理、贵宾理财部总经理、中信银行贵阳分行党委书记、行长、总行行政管理部总经理。

（三）基金托管业务经营情况

2004年8月18日，中信银行经中国证券监督管理委员会和中国银行业监督管理委员会批准，取得基金托管人资格。中信银行本着“诚实信用、勤勉尽责”的原则，切实履行托管人职责。

截至2017年半年末，中信银行已托管136只公开募集证券投资基金，以及证券公司资产管理产品、信托产品、企业年金、股权基金、QDII等其他托管资产，托管总规模达到7.41万亿元人民币。

三、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及其网上交易平台

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

投资人可以通过基金管理人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基金管理人网站公告。网上交易网址：http://www.xcfunds.com/。

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

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：信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：上海源泰律师事务所

注册地址：上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼

办公地址：上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼

负责人：廖海

经办律师：廖海、刘佳

电话：（021）51150298

传真：（021） 51150398

联系人：刘佳

（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

信诚永丰一年定期开放混合型证券投资基金

五、基金的类型

契约型、定期开放式

六、基金的投资目标

在严格控制风险的前提下，通过合理的资产配置，综合运用多种投资策略，力争获得超越业绩比较基准的回报。

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、可交换债券及其他中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、银行存款、同业存单、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%－30%；开放期内，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%，在封闭期内，本基金不受前述5%限制，但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，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。

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

本基金主要通过对宏观经济运行状况、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、债券投资策略

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。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、相对价值配置、回购放大策略等策略进行主动投资。

4、资产支持证券投资策略

资产支持证券的定价受市场利率、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率等多种因素影响。本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上，对资产支持证券的交易结构风险、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行分析，采取包括收益率曲线策略、信用利差曲线策略、预期利率波动率策略等积极主动的投资策略，投资于资产支持证券。

5、股指期货投资策略

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。

6、权证投资策略

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：沪深300指数收益率×30%+中证综合债指数收益率×70%。

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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据基金合同的约定，于2017年7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2017年6月30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	124,142,796.59	18.54
	其中：股票	124,142,796.59	18.54
2	固定收益投资	369,811,400.00	55.22
	其中：债券	319,691,400.00	47.73
	资产支持证券	50,120,000.00	7.48
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	45,011,307.52	6.72
	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	125,433,061.88	18.73
7	其他资产	5,359,503.99	0.80
8	合计	669,758,069.98	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	825,088.00	0.14
B	采矿业	1,396,964.00	0.23
C	制造业	51,121,735.90	8.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,062,608.00	0.51
E	建筑业	1,327,741.00	0.22
F	批发和零售业	2,078,746.00	0.34
G	交通运输、仓储和邮政业	6,062,384.00	1.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,718,629.62	0.45
J	金融业	40,238,949.28	6.64
K	房地产业	6,142,960.79	1.01
L	租赁和商务服务业	2,525,692.00	0.42
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	4,167,158.00	0.69
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	2,474,140.00	0.41
S	综合	-	-
	合计	124,142,796.59	20.49

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	600000	浦发银行	336,050	4,251,032.50	0.70
2	601328	交通银行	589,500	3,631,320.00	0.60
3	000538	云南白药	36,500	3,425,525.00	0.57
4	000333	美的集团	77,900	3,352,816.00	0.55
5	601166	兴业银行	198,200	3,341,652.00	0.55
6	000568	泸州老窖	65,900	3,333,222.00	0.55
7	002142	宁波银行	165,300	3,190,290.00	0.53
8	000001	平安银行	330,900	3,107,151.00	0.51
9	000069	华侨城A	294,300	2,960,658.00	0.49
10	000858	五 粮 液	52,400	2,916,584.00	0.48

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	78,246,000.00	12.91
5	企业短期融资券	95,310,500.00	15.73
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	同业存单	146,134,900.00	24.12
9	其他	-	-
10	合计	319,691,400.00	52.76

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	111794346	17广州农村商业银行CD056	1,000,000	96,670,000.00	15.95
2	011769016	17康富租赁SCP002	400,000	40,156,000.00	6.63
3	011751023	17日照港SCP002	300,000	30,087,000.00	4.96
4	136304	16紫金01	300,000	29,331,000.00	4.84
5	136459	16上港02	300,000	29,313,000.00	4.84

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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1789141	17浔银1A	500,000	50,120,000.00	8.27

注:本基金本报告期末仅持有上述资产支持证券投资。

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

本基金本报告期内未进行权证投资。

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持有股指期货投资。

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	66,239.15
2	应收证券清算款	463,786.77
3	应收股利	-
4	应收利息	4,829,478.07
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,359,503.99

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。

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6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

信诚永丰A

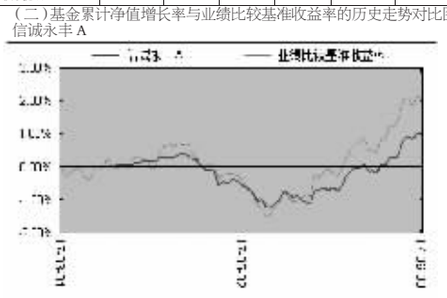
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2017年3月1日至2017年6月30日	0.99%	0.12%	2.09%	0.19%	-1.10%	-0.07%

信诚永丰C

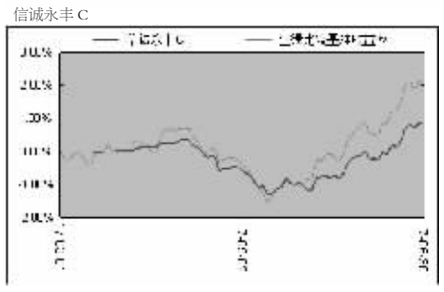
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2017年3月1日至2017年6月30日	0.86%	0.12%	2.09%	0.19%	-1.23%	-0.07%

（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

信诚永丰A



信诚永丰C



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3月1日)。

2、本基金建仓期自2017年3月1日至2017年9月1日,截至本报告期末,本基金尚处于建仓期。

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类基金份额的销售服务费；

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、诉讼费和仲裁费；

6）基金份额持有人大会费用；

7）基金的证券交易或结算费用；

8）基金的银行汇划费用；

9）基金的账户开户费用、账户维护费用；

10）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0.6%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.6%÷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，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0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.1%÷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，支付日期顺延。

3）C类基金份额的销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的年销售服务费率为0.4%。

在通常情况下，C类基金份额销售服务费按前一日C类基金份额资产净值的0.4%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×0.4%÷当年天数

H为每日应计提的C类基金份额的销售服务费

E为前一日C类基金份额的基金资产净值

C类基金份额的销售服务费每日计算，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取，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休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4—10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

1、本基金A类基金份额的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。C类基金份额不收取申购费用。本基金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、申购费率如下

申购金额（M）	A类基金份额	C类基金份额
M<50万	0.60%	0
50万≤M<200万	0.40%	
200万≤M<500万	0.20%	
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。对于A类基金份额，对持续持有期少于30日的投资人收取的赎回费全额计入基金财产；对持续持有期长于30日但少于3个月的投资人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的75%计入基金财产；对持续持有期长于3个月但少于6个月的投资人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的50%计入基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。对于C类基金份额，对持续持有期少于30日的投资人收取的赎回费全额计入基金财产；对持续持有期长于30日但少于6个月的投资人收取的赎回费，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。

赎回费率如下：

持续持有期（Y）	A类份额	C类份额
Y<7天	1.50%	0.50%
7天≤Y<30天	0.75%	
30天≤Y<6个月	0.50%	
Y≥6个月	0	0

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，并在不对基金份额持有人权益产生实质性不利影响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《信诚永利一年定期开放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。

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”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”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“第六部分 基金的募集”部分，删除了募集目标等内容，增加了本基金的实际募集期限以及募集的基本情况；

6、在“第七部分 基金合同的生效”部分，删除了基金备案的条件等内容，增加了本基金的实际合同生效日期。

7、在“第十部分 基金的投资”部分，增加了“基金投资组合报告”，财务数据截止至2017年6月30日。

8、在“第十一部分 基金的业绩”部分，增加了该节的内容，数据截止至2017年6月30日。

9、在“第二十二部分 对基金份额持有人的服务”部分，更新了网上交易服务相关信息。

10、在“第二十三部分 其他应披露事项”部分，披露了自2017年3月2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10月14日

证券代码：000801 证券简称：四川九洲 公告编号：2017038

四川九洲电器股份有限公司2017年度前三季度业绩预告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

一、本期业绩预计情况

1. 业绩预告期间：2017年1月1日－2017年9月30日。

2.预计的经营业绩：亏损

（1）2017年1-9月份业绩预告情况

项 目	本报告期(2017年1-9月)	上年同期
归属于上市公司股东的净利润	亏损：-1900万元～-1000万元	盈利：7000.44万元
基本每股收益	亏损：约-0.0186元～-0.0098元	盈利：0.0684元

（2）2017年7-9月份业绩预告情况

项 目	本报告期(2017年7-9月)	上年同期
归属于上市公司股东的净利润	盈利：0万元～900万元	盈利：943.49万元
基本每股收益	盈利：约0元～0.0088元	盈利：0.0093元

二、业绩预告预审计情况

业绩预告未经审计。

三、业绩变动原因说明

报告期内，公司依然面对严峻复杂的市场环境，公司积极应对，努力扭转亏损局面，通过加大市场开发力度、加强供应链管理、降低采购成本、加快市场订单转化等措施，7-9月公司实现盈利，但由于7-9月实现盈利较少，导致公司前三季度仍处于亏损，具体原因如下：

1、数字电视产业：存储芯片价格持续高位，包材、阻容件等其他材料价格上涨，造成公司物料采购成本居高不下，产品毛利率降低，导致数字电视产业净利润同比大幅下降；

2