信诚中证800金融指数分级证券投资基金招募说明书摘要

（2018年第2次更新）

基金管理人：中信保诚基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司

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。

本基金于2013年12月20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2018年6月20日，有关财务数据和净值表现截止日为2018年3月31日（未经审计）。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

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
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（中外合资）
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。
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、中信信托有限责任公司副董事长。现任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。

Guy Robert STRAPP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、瀚亚投资管理(上海)有限公司董事。

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、瀚亚投资管理(上海)有限公司监事。

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，美国籍，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

张翔燕女士，董事长，工商管理硕士。历任中信银行总行综合计划部总经理，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、中信信托有限责任公司副董事长。现任中信保诚基金管理有限公司董事长。

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

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月加入中信保诚基金，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。

HAN YILING先生，计算机学硕士、信息技术硕士。曾任职于澳大利亚国立信息通信技术研究院，担任研究员；于中信保诚基金管理有限公司，担任量化投资部金融工程师；于华宝兴业基金管理有限公司，担任量化部投资经理。2016年6月重新加入中信保诚基金管理有限公司，历任投资经理、基金经理助理。现任信诚沪深300指数分级证券投资基金、信诚中证800金融指数分级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：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)
住所：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
法定代表人：田国立
成立时间：2004年09月17日
组织形式：股份有限公司
注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整
存续期间：持续经营
基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12号
联系人：田青
联系电话：(010)6759 5096

中国建设银行成立于1954年10月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。本行于2005年10月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码939)，于2007年9月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码601939)。

2017年6月末，本集团资产总额216,920.67亿元，较上年末增加7,283.62亿元，增幅3.47%。上半年，本集团实现利润总额1,720.93亿元，较上年同期增长1.30%；净利润较上年同期增长3.81%至1,390.09亿元，盈利水平实现平稳增长。

2016年，本集团先后获得国内外知名机构授予的100余项重要奖项。荣获《欧洲货币》“2016中国最佳银行”，《环球金融》“2016中国最佳消费者银行”、“2016亚太区最佳流动性管理银行”，《机构投资者》“人民币国际化服务钻石奖”，《亚洲银行家》“中国最佳大型零售银行奖” 及中国银行业协会“年度最具社会责任金融机构奖”。本集团在英国《银行家》2016年“世界银行1000强排名”中，以一级资本总额继续位列全球第2；在美国《财富》2016年世界500强排名第22位。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、养老金托管处、清算处、核算处、跨境托管运营处、监督稽核处等10个职能处室，在上海设有投资托管服务上海备份中心，共有员工220余人。自2007年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

（二）主要人员情况

纪伟，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行南通分行、总行计划财务部、信贷经营部任职，并在总行公司业务部、投资托管业务部、授信审批部担任领导职务。其拥有八年托管从业经历，熟悉各项托管业务，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部并担任副行长，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部、战略客户部，长期从事客户服务、信贷业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

原玎，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行国际业务部，长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

（三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2017年二季度末，中国建设银行已托管759只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行连续11年获得《全球托管人》、《财资》、《环球金融》“中国最佳托管银行”、“中国最佳次托管银行”、“最佳托管专家——QFII”等奖项，并在2016年被《环球金融》评为中国市场唯一一家“最佳托管银行”。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构

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：蒋焱
电话：021- 68649788
网址：www. citicprufunds.com

2、销售机构

（1）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
法定代表人：田国立
电话：010-67596219
客服电话：95533
公司网站：www.ccb.com

（2）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：陈四清
联系人：刘岫云
客服电话：95566
网址：www.boc.cn

（3）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：彭纯
电话：（021）58781234
传真：（021）58408483
联系人：陆志俊
客户服务电话：95559
网址：www.bankcomm.com

（4）中信证券股份有限公司
注册地址：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：王东明
联系人：侯艳红
电话：010－60838995
传真：0755－23835861，010－60836029
网址：http ://www.cs.ecitic.com

（5）中信证券（山东）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（1507－1510室）
办公地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第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：95548
网址：www.zxwt.com.cn

（6）中信期货有限公司
注册地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301－1305室、14层
办公地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301－1305室、14层
法定代表人：张皓
联系人：洪诚
电话：0755－23953913
网址：http://www.citicsf.com/

（7）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：张鹏
联系电话：0755－82023442
客服电话：400－600－8008、95532
公司网站：www.china－invs.cn

（8）中信建投证券股份有限公司
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
联系人：魏明
联系电话：(010)85130579
客服电话：400－8888－108
网址：www.csc108.com

（9）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：黄婵君
电话：0755－82960167
传真：（0755）82943636
网址：www.newone.com.cn
客服电话：95565、4008888111

（10）国泰君安证券股份有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路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：杨德红
联系人：朱雅崴
电话：021－38676767
客户服务热线：400－8888－666 / 95521

（11）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
联系人：刘洋
联系电话：0755－83516289
客服电话：400－6666－888
公司网址：www.cgws.com

（12）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号国信证券大厦十六层至二十六层
法定代表人：何如
基金业务联系人：李颖
联系电话：0755－82133066
传真：0755－82133952
全国统一客户服务电话：95536
公司网址：www.guosen.com.cn

（13）海通证券股份有限公司
地址：上海市广东路689号海通证券大厦
法定代表人：王开国
联系电话：021－23219275
客户服务电话：021－95553或4008888001
联系人：李笑鸣
网址：www.htsec.com

（14）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：邓颜
联系电话：010－66568292
客户服务电话：4008－888－888
网站：www.chinastock.com.cn

（15）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

（16）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

（17）上海好买基金销售有限公司
注册地址：上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号
办公地址：上海市浦东新区浦东南路 1118号903－906室
法定代表人：杨文斌
联系电话：021－20613999
传真：021－68596916
公司网址：www.howbuy.com
客服电话：400－700－9665

（18）深圳众禄基金销售股份有限公司
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
客服电话：4006－788－887

(19)和讯信息科技有限公司
注册地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
办公地址：上海市浦东新区东方路18号保利广场E座18F
法定代表人：王莉
联系电话：010－85650628
传真：010－65884788
官网网址：www.licaike.com
客服电话：400－920－0022

（20）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
联系人：单丙烨
电 话：021－20691832
传 真：021－20691861

（21）上海汇付金融服务有限公司
注册地址：上海市黄浦区西藏中路336号1807－5室
办公地址：上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼
法定代表人：张晶
电 话：021－33323998
传 真：021－33323993
网址：fund.bundtrade.com
客户服务电话：400－820－2819

（22）浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址：浙江省杭州市文二西路1号元茂大厦903
办公地址：浙江省杭州市西湖区翠柏路7号电子商务产业园2号楼2楼
法定代表人：凌顺平
电 话：0571－88911818
传 真：0571－86800423
公司网站：www.5ifund.com
客服电话：4008－773－772

（23）上海联泰资产管理有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室
办公地址：上海市长宁区金钟路658弄2号楼B座6楼
法定代表人：燕斌
电 话：021－51507071
传 真：021－62990063
网址：www.66zichan.com
客服电话：4000－466－788

（24）北京创金启富投资管理有限公司
注册地址：北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A
办公地址：北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A
法定代表人：梁蓉
电 话：010－66154828
传 真：010－88067526
网址： www.5irich.com
客户服务电话：400－6262－818

（25）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

（26）上海陆金所基金销售有限公司
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
网址： www.lufunds.com
客户服务电话：4008219031

（27）泰诚财富基金销售（大连）有限公司
注册地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
邮政编码：116000
法定代表人：林卓
电 话：0411－88891212
传 真：0411－84396536
客服电话：4006411999
公司网站：www.taichengcaifu.com

（28）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：20539999
客服电话：400－820－1515
官网网址：www.zhengtongfunds.com

（29）北京钱景财富投资管理有限公司
注册地址：北京市海淀区丹棱街丹棱SOHO 1008－1012
办公地址：北京市海淀区丹棱街丹棱SOHO 1008－1012
法定代表人：赵荣春
电话：010－59158281
传真：010－57569671
网址：www.qianjing.com
客户服务电话：400－893－6885

（30）上海凯石财富基金销售有限公司
注册地址：上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼
办公地址：上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼
法定代表人：陈继武
联系电话：021－63333389
传真：021－63332523
网站：www.lingxianfund.com
客户服务电话：4000178000

（31）大泰金石基金销售有限公司
注册地址：南京市建邺区江东中路359号国睿大厦一号楼B区4楼A506室
办公地址：上海市长宁区虹桥路1386号文广大厦15楼
法定代表人：袁顾明
电话：021－22267995
传真：021－22268089
网站：www.dtfunds.com
客服电话：4009282266

（32）上海利得基金销售有限公司
注册地址：上海市宝山区蕴川路5475号1033室
办公地址：上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼
法人代表：沈继伟
联系电话：021－60195148
传真：021－50583633
公司网址：www.leadbank.com.cn
客服电话：400－067－6266

（33）北京增财基金销售有限公司
注册地址：北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208室
办公地址：北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208室
法定代表人：罗细安
公司网址：www.zcvc.com.cn
客服电话：400－001－8811

（34）北京虹点基金销售有限公司
注册地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元
办公地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元
法定代表人：胡伟
电话：010－65951887
网址：http://www.hongdianfund.com/
客服电话：400－618－0707

（35）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：TAN YIK KUAN
联系电话：021－20567288
传真：0755－21674453
公司网址： www.ifastps.com.cn
客服电话： 400－684－0500

（36）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
客服电话：400－6236－060

（37）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
客服电话：010－62675369

（38）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
客服电话：400－068－1176

（39）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
客服电话：400－068－0058

（40）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：0571－8526 9200
官网网址：www.cd121.com
客服电话：0571－86655920

（41）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
官网网址：www.shengshiview.com
客服电话：400－818－8866

（42）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/

（43）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：400 088 8816
官网网址：http://jr.jd.com

（44）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：400 001 1566
网址： www.yilucaifu.com

（45）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
客服电话：4009987172

（46）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

（47）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

（48）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：上海市杨浦区昆明路518号A1002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：021－65370077

（49）乾道金融信息服务（北京）有限公司
注册地址：北京市海淀区东北旺村南1号楼7层7117室
办公地址：北京市西城区德外大街合生财富广场1302室
法定代表人：王兴吉
电话：010－62062880
传真：010－82057741
官网网址：http://www.qiandaojr.com
客服电话：400－088－8080

（50）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
客服电话：95177

（51）深圳金斧子基金销售有限公司
注册地址：深圳市南山区粤海街道科苑路16号东方科技大厦18楼
办公地址：深圳市南山区粤海街道科苑路科兴科学园B3单元7楼
法定代表人：赖任军
电话：0755－66892301
传真：0755－66892399
公司官网：www.jfzinv.com
客服电话：400－950－0888

（52）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司
注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1栋202室
法定代表人：陈柏青
客服电话： 4000－766－123
官网网址：www.fund123.cn

（53）厦门市鑫鼎盛控股有限公司
注册地址：厦门市思明区鹭江道2号第一广场15楼
办公地址：厦门市思明区鹭江道2号第一广场15楼
法人代表： 陈洪生
联系人：陈承智
联系电话：0592－3122673
客服电话：400－918－0808
公司官网：www.xds.com.cn

（54）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

（55）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

（56）中民财富基金销售（上海）有限公司
注册地址：上海市黄浦区中山南路100号7层05单元
办公地址：上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼27层
法人代表：弭洪军
联系电话：021－33355392
公司传真：021－63353736
客服电话：400－876－5716
官网网址：www.cmiwm.com

（57）上海万得投资顾问有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座
办公地址：上海市浦东新区福山路33号8楼
法定代表人：王廷富
电 话：021－51327185
传 真：021－50710161
客服电话：400－821－0203

（58）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

（59）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
网址：http://www.jianfortune.com/

（60）北京恒天明泽基金销售有限公司
注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路10号5层5122室
办公地址：北京市朝阳区亮马桥路39号第一上海中心C座6层
法定代表人：李悦
联系人：张晔
电话：010－56642602
http://htmz.lhygcn.com/

（61）民商基金销售（上海）有限公司
住所：上海市黄浦区北京东路666号H区东座6楼A31室
办公地址：上海市浦东新区张杨路707号生命人寿大厦32楼
联系电话：021－50206003
网站：www.msftec.com

（62）北京蛋卷基金销售有限公司
办公地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层
法定代表人：钟斐斐
电话：010－61840688
网址：https://danjuanapp.com

（63）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

基金管理人可根据有关法律法规要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金或变更上述代销机构，并及时公告。

（二）注册登记机构

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：吕红、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

信诚中证800金融指数分级证券投资基金

五、基金的类型

契约型开放式

六、基金的投资目标

本基金进行数量化指数投资，通过严谨的数量化管理和投资纪律约束，实现对中证800金融指数的有效跟踪，为投资者提供一个有效的投资工具。

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，包括中证800金融指数的成份股、备选成份股、新股（含首次公开发行和增发）、债券、债券回购、中期票据、银行存款、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为85%－100%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的85%，投资于中证800金融指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金资产的80%；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，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

八、基金的投资策略

本基金原则上采用完全复制法跟踪指数，即原则上按照标的指数中成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整，力争保持基金净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。

当发生特殊情况（如成份股长期停牌、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量发生变化、成份股公司行为、市场流动性不足等），或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或法律法规禁止投资等其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。

基金管理人将对成份股的流动性进行分析，如发现流动性欠佳的个股将可能采用合理方法寻求替代。基金管理人运用以下策略构造替代股组合：

(1)基本面替代：按照与被替代股票基本面及规模相似的原则，选取一揽子标的指数成份股票作为替代股备选库；

(2)相关性检验：计算备选库中各股票与被替代股票日收益率的相关系数并选取与被替代股票相关性较高的股票组成模拟组合，以组合与被替代股票的日收益率序列的相关系数最大化为优化目标，求解组合中替代股票的权重，并构建替代股组合。

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特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理，如预期大额申购赎回、大量分红等，以及对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险。

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。

九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：95%×中证800金融价格指数收益率+5%×金融同业存款利率。

十、基金的风险收益特征

本基金为跟踪指数的股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。从本基金所分离的两类基金份额来看，信诚金融A份额具有预期风险、预期收益较低的特征；信诚金融B份额具有预期风险、预期收益较高的特征。

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据基金合同的约定，于2018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2018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	870,527,892.71	94.38
	其中：股票	870,527,892.71	94.38
2	固定收益投资	828,400.00	0.09
	其中：债券	828,400.00	0.09
	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	–	–
	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	50,829,451.61	5.51
7	其他资产	182,704.66	0.02
8	合计	922,368,448.98	100.00

2.报告期末按行业分类的股票投资组合

1)指数投资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	–	–
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	–	–
G	交通运输、仓储和邮政业	–	–
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	–	–
J	金融业	870,289,257.42	94.59
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	870,289,257.42	94.59

2)积极投资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	141,368.84	0.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	26,402.87	–
G	交通运输、仓储和邮政业	36,659.62	–
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	34,203.96	–
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	238,635.29	0.03

3)报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

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股票投资明细

1)报告期末指数投资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	1,655,797	108,140,102.07	11.75
2	600036	招商银行	1,991,180	57,923,426.20	6.30
3	601166	兴业银行	3,117,256	52,027,002.64	5.65
4	600016	民生银行	6,069,988	48,499,204.12	5.27
5	601328	交通银行	7,241,692	44,753,656.56	4.86
6	601288	农业银行	10,437,284	40,809,780.44	4.44
7	600000	浦发银行	3,289,368	38,321,137.20	4.17
8	000001	平安银行	2,721,250	29,661,625.00	3.22
9	600030	中信证券	1,528,650	28,402,317.00	3.09
10	601988	中国银行	7,122,505	27,991,444.65	3.04

2)报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	300504	天邑股份	3,062	57,596.22	0.01
2	600929	湖南盐业	5,696	44,542.72	–
3	002930	宏川智慧	2,467	36,659.62	–
4	300634	彩讯股份	2,058	34,203.96	–
5	603897	长城科技	1,595	28,167.70	–

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	828,400.00	0.09
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	828,400.00	0.09

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	127005	长证转债	8,284	828,400.00	0.09

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

本基金本报告期内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

按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《基金股指期货投资会计业务核算细则(试行)》及《企业会计准则－金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具－股指期货投资”与“证券清算款－股指期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“其他衍生工具－股指期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。本基金本报告期内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特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理，以及对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险。

本基金本报告期末进行股指期货投资。

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)中国民生银行股份有限公司(以下简称“民生银行”)民生银行南京分行于2017年5月8日收到江苏证监局发出的《关于对中国民生银行南京分行采取责令改正措施的决定》，因该分行销售的私募基金“民生加银资管慧选6号之紫鑫专项资产管理计划”存在以下问题：一是未由投资者书面承诺符合合格投资者条件；二是提供给个别投资者的内部培训材料部分表述不严谨，有误导投资者之嫌。依据《私募投资基金监督管理暂行办法》(中国证监会令第105号)等相关法律法规，江苏证监局对民生银行南京分行采取责令改正的行政监管措施。又于2017年4月28日发布公告，北京分行航天桥支行行长张颖使用伪造的理财合同和银行印章，公安部门予以立案调查。

2)对民生银行投资决策程序的说明：民生银行属于中证800金融的成分股。根据基金合同，中证800金融为指数基金，投资配置权重应以标的指数权重为准。经检查，民生银行在信诚中证800金融分级基金中占比在合理范围内，投资严格执行内部决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

3)中信证券股份有限公司(以下简称“中信证券”或“公司”)曾于2015年公告收到中国证监会调查通知书(稽查总队调查通字153121号)，该次调查的范围是公司在融资融券业务开展过程中，存在违反《证券公司监督管理条例》第八十四条“未按照规定与客户签订业务合同”规定之嫌。2017年5月24日，公司公告就前述调查收到中国证监会《行政处罚事先告知书》(处罚字[2017]57号)。中国证监会依据《证券公司监督管理条例》第八十三条第(七)项的规定，拟决定责令中信证券改正，给予警告，没收违法所得人民币61,655,849.78元，并处人民币308,279,248.90元罚款。

4)对中信证券投资决策程序的说明：中信证券属于中证800金融的成分股。根据基金合同，中证800金融为指数基金，投资配置权重应以标的指数权重为准。经检查，中信证券在信诚中证800金融分级基金中占比在合理范围内，投资严格执行内部决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

5)除此之外，本基金指数投资的前十名证券的发行主体及积极投资的前五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。

6)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。

7)其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	131,399.45
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	10,938.02
5	应收申购款	40,367.19
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	182,704.66

8)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。

9)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

i.报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

ii.报告期末积极投资前五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	603897	长城科技	28,167.70	0.00	网下新股待上市

10)投资组合报告附注的其他文字描述部分

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。

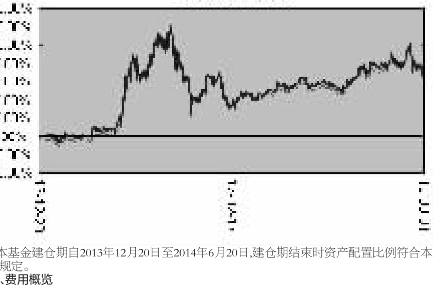
十二、基金的业绩

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2018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

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
2013年12月20日–2013年12月31日	0.20%	0.05%	0.00%	1.61%	0.20%	–1.56%
2014年1月1日–2014年12月31日	85.89%	1.59%	81.86%	1.65%	4.03%	–0.06%
2015年1月1日–2015年12月31日	–11.89%	2.50%	–10.01%	2.51%	–1.88%	–0.01%
2016年1月1日–2016年12月31日	–5.93%	1.24%	–8.28%	1.24%	2.35%	0.00%
2017年1月1日–2017年12月31日	14.56%	0.76%	15.93%	0.77%	–1.37%	–0.01%
2018年1月1日–2018年3月31日	–4.51%	1.28%	–5.04%	1.30%	0.53%	–0.02%
2013年12月20日–2018年3月31日	68.88%	1.62%	65.24%	1.65%	3.64%	–0.03%

（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2013年12月20日至2014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。

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）基金财产拨划支付的银行费用；
（4）基金合同生效后的基金信息披露费用；
（5）基金份额持有人大会费用；
（6）基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
（7）基金的证券、期货交易费用；
（8）基金上市初费和上市月费；
（9）基金的账户开户费用、账户维护费用；
（10）基金合同生效后的标的指数许可使用费；
（11）依法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

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的1.00%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×年管理费率÷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。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付，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等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

（2）基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.22%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×年托管费率÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付，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等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

（3）基金合同生效后的标的指数许可使用费

本基金作为指数基金，需根据与指数所有人中证指数有限公司签署的指数许可使用协议的约定向中证指数有限公司支付指数许可使用费。如上述指数许可使用协议约定的费率发生变更，本条下的指数许可使用费将相应变更，基金管理人将在更新的招募说明书或公告中予以披露。

通常情况下，指数许可使用费按前一日基金资产净值的0.02%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×年费率/当年天数
H为每日应计提的指数许可使用费
E为前一日的基金资产净值

指数许可使用费的收取下限为每季度人民币5万元（大写：伍万元整）。计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。计费区间不足一季度的，该季度指数许可使用费收取下限的计算方法如下：许可使用费的收取下限=5万元× 本基金在本季度的实际运作天数 / 所在季度的实际天数

指数许可使用费从基金合同生效日开始每日计算，逐日累计。标的指数许可使用费的支付方式为每季支付一次，基金合同生效后，由基金管理人向基金托管人发送指数许可使用费划付指令，经基金托管人复核后，于每年1月、4月、7月、10月的最后一个工作日前从基金财产中一次性支付给中证指数有限公司上一季度的标的指数许可使用费。

（4）除管理费和托管费、指数许可使用费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

3、不列入基金费用的项目

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。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

(二)与基金销售有关的费用

1、信诚金融份额的申购费用由投资人承担，不列入基金资产，用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。信诚金融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。对持续持有期少于7日的投资者收取的赎回费将全额计入基金资产，对持续持有期不少于7日的投资者收取的赎回费，其中不低于赎回费总额的25%应归基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

2、根据基金合同的规定，信诚金融份额的申购费率不超过5%，赎回费率不超过5%，其中对持续持有期少于7日的投资者收取不低于1.5%的赎回费。

3、信诚金融份额的场外申购费率如下：

单笔申购金额	场外申购费率
M〈50万	1.2%
50万≤M〈200万	0.8%
200万≤M〈500万	0.4%
M≥500万	1000元/笔

（注：M：申购金额；单位：元）

信诚金融份额的场内申购费率由基金代销机构参照场外申购费率执行。

为更好地满足投资者的理财需求，根据相关基金基金合同、招募说明书的有关规定，中信保诚基金管理有限公司（以下简称“本公司”）决定自2015年12月1日起，针对旗下现有所有指数分级证券投资基金基础份额的场内申购费率实施费率优惠，调整后信诚中证800金融指数分级证券投资基金场内申购费率如下：

单笔申购金额	申购费率
M<50万	0
50万≤M<200万	0
200万≤M<500万	0
M≥500万	0

4、信诚金融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<7天	1.5%
7天≤Y<1年	0.5%
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）

信诚金融份额的场内赎回费率为固定值0.5%，对于持续持有期少于7日的赎回费率为1.50%。

从场内转托管至场外的信诚金融份额，从场外赎回时，其持有期限从转托管转入确认日开始计算。

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》、《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》、《流动性风险管理规定》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《信诚中证800金融指数分级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”部分更新了本招募书的内容及数据的截止日期。

2.在“一、绪言”中，增加了《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》作为招募说明书编写依据。

3.在“二、释义”中，增加了对“《流动性风险管理规定》”、“流动性受限资产”的释义。

4.在“三、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。

5.在“四、基金托管人”中，更新了基金托管人的相关信息。

6.在“五、相关服务机构”部分，根据实际情况对基金份额发售机构和登记机构的相关信息进行了更新。

7.在“十、基金份额的申购、赎回”部分，根据《流动性风险管理规定》更新了“（五）申购与赎回的数量限制、（六）申购及赎回费用、（八）拒绝或暂停申购的情形、（九）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形、（十）巨额赎回的情形及处理方式”等部分内容；

8.在“十四、基金的投资”部分，根据《流动性风险管理规定》更新了“（二）投资范围、（五）投资限制”部分相关内容，并更新了“基金投资组合报告”，财务数据截止至2018年3月31日。

9.在“十五、基金的业绩”部分，更新了该节的内容，数据截止至2018年3月31日。

10.根据《流动性风险管理规定》，在“十七、基金资产的估值”中更新了“（七）暂停估值的情形”的相关情形内容，在“二十二、基金的信息披露”中增加了“定期报告”、“临时报告”中需要披露的相关内容，在“二十三、风险揭示”中更新了流动性风险相关内容；

11.在“二十六、托管协议的内容摘要”部分，更新了“（一）托管协议当事人、（二）基金托管人与基金管理人之间的业务监督、核查、（四）基金资产净值计算与复核”的内容；

在“二十八、其他应披露事项”部分，披露了自2017年12月21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8月3日

信诚中证智能家居指数分级证券投资基金之智能B交易价格波动提示公告

近期，中信保诚基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）旗下信诚中证智能家居指数分级证券投资基金B份额（场内简称：智能B，代码：150312）二级市场交易价格连续大幅波动，2018年8月1日，智能B二级市场收盘价为0.733元，相对于当日0.341元的基金份额参考净值，溢价幅度达到115.0%。截止2018年8月2日，智能B二级市场收盘价为0.660元，明显高于基金份额参考净值，投资者如果盲目投资，可能遭受重大损失。

为此，本基金管理人提示如下：

1、智能B具有预期风险、预期收益较高的特征。由于智能B内含杠杆机制的设计，智能B基金份额参考净值的变动幅度将大于信诚智能家居份额（场内简称：智能家居，基础份额，代码：165524）净值和信诚智能家居A份额（场内简称：智能A，代码：150311）参考净值的变动幅度，即智能B的波动性要高于其他两类份额，其承担的风险也较高。智能B的持有人会因杠杆倍数的变化而承担不同程度的投资风险。

2、智能B的交易价格，除了有份额参考净值变化的风险外，还会受到市场的系统性风险、流动性风险等其他风险影响，可能使投资人面临损失。

3、截至2018 年8月2日，智能B的基金份额参考净值接近基金合同约定的不定期份额折算阀值。不定期份额折算后，智能B的溢价率可能发生较大变化。

特提请参与二级市场交易的投资者注意高溢价所带来的风险。

4、截至本公告披露日，信诚中证智能家居指数分级证券投资基金运作正常。本基金管理人仍将严格按照法律法规及基金合同进行投资运作。

5、截至本公告披露日，信诚中证智能家居指数分级证券投资基金无其他应披露而未披露的重大信息。本基金管理人仍将严格按照有关规定和要求，及时做好信息披露工作。

6、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，也不保证最低收益。投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的基金合同和招募说明书等相关法律文件。

敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

中信保诚基金管理有限公司
2018年8月3日

信诚中证信息安全指数分级证券投资基金之信息安B交易价格波动提示公告

近期，中信保诚基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）旗下信诚中证信息安全指数分级证券投资基金B 份额（场内简称：信息安B，代码：150310）二级市场交易价格连续大幅波动，2018年8月1日，信息安B二级市场收盘价为0.450元，相对于当日0.349元的基金份额净值，溢价幅度达到28.9%。截止2018年8月2日，信息安B二级市场收盘价为0.405元，明显高于基金份额参考净值，投资者如果盲目投资，可能遭受重大损失

为此，本基金管理人提示如下：

1、信息安B具有预期风险、预期收益较高的特征。由于信息安B内含杠杆机制的设计，信息安B基金份额参考净值的变动幅度将大于信诚信息安全份额（场内简称：信息安全，基础份额，代码：165523）净值和信诚信息安全A份额（场内简称：信息安A，代码：150309）参考净值的变动幅度，即信息安B的波动性要高于其他两类份额，其承担的风险也较高。信息安B的持有人会因杠杆倍数的变化而承担不同程度的投资风险。

2、信息安B的交易价格，除了有份额参考净值变化的风险外，还会受到市场的系统性风险、流动性风险等其他风险影响，可能使投资人面临损失。

3、截至2018年8月2日，信息安B的基金份额参考净值接近基金合同约定的不定期份额折算阀值。不定期份额折算后，信息安B的溢价率可能发生较大变化。

特提请参与二级市场交易的投资者注意高溢价所带来的风险。

4、截至本公告披露日，信诚中证信息安全指数分级证券投资基金运作正常。本基金管理人仍将严格按照法律法规及基金合同进行投资运作。

5、截至本公告披露日，信诚中证信息安全指数分级证券投资基金无其他应披露而未披露的重大信息。本基金管理人仍将严格按照有关规定和要求，及时做好信息披露工作。

6、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，也不保证最低收益。投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的基金合同和招募说明书等相关法律文件。

敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

中信保诚基金管理有限公司
2018 年8月3日

信诚中证智能家居指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告

根据《信诚中证智能家居指数分级证券投资基金基金合同》关于不定期份额折算的相关规定，当信诚中证智能家居指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）之B份额的基金份额净值小于或等于0.250元时，本基金将在基金份额折算日分别对信诚智能家居份额（场内简称：智能家居，基础份额，代码：165524）、信诚智能家居A份额（场内简称：智能A，代码：150311）、信诚智能家居B份额（场内简称：智能B，代码：150312）进行不定期份额折算。

由于近期A股市场波动较大，截至2018年8月2日，智能B的基金份额净值接近基金合同规定的不定期份额折算的阀值0.250元，在此提请投资者密切关注智能B份额近期净值的波动情况，并警惕可能出现的风险。

针对可能发生的不定期份额折算，本基金管理人特别提示如下：

一、由于智能A份额、智能B份额在不定期折算前可能存在折溢价交易情形，不定期份额折算后，其折溢价率可能发生较大变化。特提醒参与二级市场交易的投资者注意折溢价所带来的风险。

二、智能B份额具有预期风险、预期收益较高的特征。不定期份额折算后其杠杆倍数将大幅降低，将恢复到初始杠杆水平。相应地，智能B份额的参考净值随市场涨跌而增长或者下降的幅度也会大幅减小。

三、智能A份额具有预期风险、预期收益较低的特征。当发生合同规定的不定期份额折算时，原智能A持有人的风险收益特征将发生一定变化，由持有单一的较低风险收益特征的智能A变为同时持有智能A与智能家居份额，因此原智能A持有人预期收益实现的不确定性将会增加。此外，信诚智能家居为跟踪指数的基础份额，其份额净值将随市场涨跌而变化，因此原智能A持有人还可能会承担因市场下跌而遭受损失的风险。

四、由于触发折算阀值当日，智能B净值可能已低于阀值，而折算基准日在触发阀值日后才能确定，因此折算基准日智能B净值可能与折算阀值0.250元有一定差异。

五、本基金管理人的其他重要提示：

根据深圳证券交易所的相关业务规则，场内份额数将取整计算(最小单位为1份)，舍去部分计入基金资产，持有极小数量智能家居份额、智能A份额、智能B份额的持有人存在折算后份额因为不足1份而被强制归入基金资产的风险。

若本基金发生上述不定期份额折算情形，为保证折算期间本基金的平稳运作，本基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停智能A份额与智能B份额的上市交易和智能家居份额的申购及赎回等相关业务。届时本基金管理人将会对相关事项进行公告，敬请投资者予以关注。

投资者若希望了解基金不定期份额折算业务详情，请参阅《信诚中证智能家居指数分级证券投资基金基金合同》及《信诚中证智能家居指数分级证券投资基金招募说明书》。投资者可致电本公司客户服务电话400－666－0066，或登录本公司网站www.citicprufunds.com了解或咨询详情。

七、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，也不保证最低收益。本基金管理人提醒投资者知晓基金投资的“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，由投资者自行承担。敬请投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的基金合同和招募说明书等相关法律文件。

特此公告。

中信保诚基金管理有限公司
2018年8月3日