中信保诚基金管理有限公司关于以现场方式召开信诚理财28日盈债券型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告

中信保诚基金管理有限公司已于2020年5月22日在《证券时报》、中信保诚基金管理有限公司网站(www.citicprufunds.com.cn)及中国证监会基金电子披露网站(http://eid.csrc.gov.cn/fund/)发布了《中信保诚基金管理有限公司关于以现场方式召开信诚理财28日盈债券型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》。为了使本次基金份额持有人大会顺利召开,根据基金合同的相关规定,现发布本次基金份额持有人大会的第一次提示性公告。

一、会议基本情况

中信保诚基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)依据中国证监会证监许可[2013]328号文,于2017年5月16日至2017年5月19日期间公开发售信诚理财28日盈债券型证券投资基金(以下简称“本基金”),经中国证监会书面确认,本基金的基金合同于2017年5月25日生效。

综合市场需求分析,为维护基金份额持有人利益,根据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《关于规范理财债券基金业务的通知》和《信诚理财28日盈债券型证券投资基金基金合同》有关规定,本基金管理人决定召开本基金的基金份额持有人大会,审议《关于信诚理财28日盈债券型证券投资基金转型有关事项的议案》。会议的具体安排如下:

1、会议召开方式:现场方式。

2、会议召开时间:2020年6月22日上午9:30。

3、会议召开地点:中信保诚基金管理有限公司(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)

二、会议审议事项

本次持有人大会审议的事项为《关于信诚理财28日盈债券型证券投资基金转型有关事项的议案》(以下简称“《议案》”),《议案》详见附件一。

三、权益登记日

本次大会的权益登记日为2020年5月25日,即在2020年5月25日交易时间结束后,在本基金登记机构登记在册的本基金全体基金份额持有人均有权参加本次基金份额持有人大会。

四、会议的议事程序和表决方式

1、大会主持人宣布会议开始。

2、大会主持人宣布出席会议的基金份额持有人和代理人人数及所持有基金份额的总数、占权益登记日基金总份额的比例。

3、大会主持人宣布会议议事程序及注意事项。

4、大会主持人公布监票人(包括召集人授权的一名监督员和从出席大会的基金份额持有人及代理人中选举的两名监票人)、见证律师、公证机关和公证员。

5、大会主持人宣读议案。

6、与会人员对议案进行审议讨论,并以提交表决票(见附件二)的方式进行表决。

7、监票人在基金份额持有人表决后立即进行清点,公证员对计票过程予以公证。

8、大会主持人当场公布计票结果。

9、公证员宣读公证词。

10、大会见证律师就本次会议召开的程序以及持有人大会形成的决议的合法性、合规性发表法律意见。

五、基金份额持有人出席会议需要准备的文件

1、个人投资者出席会议的,需要提供本人的身份证件原件及复印件。

2、机构投资者出席会议的,需要提供加盖公章(包括基金管理人认可的业务专用章,下同)的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户正明或登记证书复印件等)和代表机构出席会议的个人的身份证件原件及复印件及机构授权委托书(出席的受托人非法定代表人的,提供加盖公章的授权委托书;出席的受托人为法定代表人的,提供加盖公章的法定代表人身份证明书)。

3、个人投资者委托他人出席会议的,需要提供被代理的个人投资者身份证件复印件,以及填妥的授权委托书原件(见附件二)。如代理人为个人,还需提供代理人的身份证件原件及复印件;如代理人为机构,还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户正明或登记证书复印件等)和代表机构出席会议的个人的身份证件原件及复印件及机构授权委托书(出席的受托人非法定代表人的,提供加盖公章的授权委托书;出席的受托人为法定代表人的,提供加盖公章的法定代表人身份证明书)。

4、机构投资者委托他人出席会议的,需要提供被代理的机构投资者加盖公章的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户正明或登记证书复印件等)以及填妥的授权委托书原件(见附件二)。如代理人为个人,还需提供代理人的身份证件原件及复印件;如代理人为机构,还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户正明或登记证书复印件等)和代表机构出席会议的个人的身份证件原件及复印件及机构授权委托书(出席的受托人非法定代表人的,提供加盖公章的授权委托书;出席的受托人为法定代表人的,提供加盖公章的法定代表人身份证明书)。

5、合格境外机构投资者出席会议的,需要提供该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件,以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件和代表该合格境外机构投资者出席会议的授权代表的有效身份证件、护照或其他身份证明文件的原件和复印件,该合格境外机构投资者所签署的授权委托书或者证明该授权代表有权代表该合格境外机构投资者签署表决票的其他证明文件。

6、合格境外机构投资者委托他人出席会议的,需要提供该合格境外机构投资者签署的授权委托书(见附件二)和该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件。如代理人为个人,还需提供代理人的身份证件原件及复印件;如代理人为机构,还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户正明或登记证书复印件等)和代表机构出席会议的个人的身份证件原件及复印件及机构授权委托书(出席的受托人非法定代表人的,提供加盖公章的授权委托书;出席的受托人为法定代表人的,提供加盖公章的法定代表人身份证明书)。

7、以上各项中的公章、批文、开户正明及登记证书,以基金管理人的认可为准。

六、会议出席对象

1、本次大会的权益登记日为2020年5月25日,权益登记日在本基金登记机构登记在册的本基金份额持有人或其代理人。

2、基金管理人代表。

3、基金托管人代表。

4、基金管理人聘请的见证律师。

5、基金管理人聘请的公证机关人员。

七、会议的预登记

1、预登记时间:2020年5月26日至2020年6月19日,每个工作日上午9:00—下午4:00。本基金管理人将为基金份额持有人办理现场方式预登记或传真方式预登记。

2、现场方式预登记:在预登记时间内,基金份额持有人采用现场方式进行预登记的,应当按照本公告第五条的规定提供相关资料。

现场方式预登记地址: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,中信保诚基金管理有限公司;联系人:金芬泉。

3、传真方式预登记:在预登记时间内,基金份额持有人可凭本公告第五条规定需提供的相关资料的传真件向基金管理人进行预登记,传真号为021-50120886,确认电话为400-6660066转9,传真收件人为:金芬泉。

4、关于预登记的说明:基金管理人可以通过预登记估计持有人到会情况,以便为持有人大会召开进行相应准备,请各基金份额持有人予以积极配合。持有人大会会议入场前仍需按照本公告第五条的规定提供相关资料办理现场会议登记,未能按时依据本公告第五条的规定及重要提示出示及提供相关资料的,不能入场出席会议并表决。

八、会议召开的条件

1、亲自出席会议者持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定;

2、经核对,汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示,全部有效凭证所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的50%以上(含50%,下同)。

九、会议的计票

1、基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中推举两名基金份额持有人代表与基金管理人授权的一名监督员共同担任监票人。

2、监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

3、如果大会主持人对于提交的表决结果有怀疑,可以对所投票数进行重新清点;如果大会主持人未进行重新清点,而出席大会的基金份额持有人或者基金份额持有人代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议,其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点,大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

十、决议生效条件

1、基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金份额的50%以上(含50%,下同)。

2、基金份额持有人应在表决票(见附件三)上填写“同意”、“反对”或者“弃权”。

3、基金份额持有人虽提供了符合本公议公告规定的文件,但表决意见未选、表决意见模糊不清或相互矛盾的表决票(但其他各项符合会议通知规定的)均视为投票人放弃表决权利,其所持全部基金份额的表决结果均计为“弃权”。签名或盖章部分填写不完整、不清晰的表决票计为无效表决票。

4、《关于信诚理财28日盈债券型证券投资基金转型有关事项的议案》应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方为有效。

5、本次基金份额持有人大会决议通过的事项,本基金管理人自通过之日起五日内报中国证监会备案,基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

十一、本次大会相关机构

1、召集人:中信保诚基金管理有限公司

客服电话:400 666 0066

联系人:金芬泉

联系电话:400 666 0066 转9

电子邮件:ds@citicprufunds.com.cn

传真:(021) 5012 0886

网址:http://www.citicprufunds.com.cn

2、基金托管人:中国银行股份有限公司

3、公证机构:上海市东方公证处

地址:上海市风阳路660号

联系电话:(021)62154848,62178903(直线)

联系人:林奇

3、见证律师:上海市通力律师事务所

注册及办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼

联系电话:(021) 3135 8666

十二、二次召集基金份额持有人大会及二次授权

根据《基金法》的规定及《信诚理财28日盈债券型证券投资基金基金合同》的约定,本次持有人大会需要出席大会的基金份额持有人或其代理人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的50%以上(含50%,下同)。如果本次基金份额持有人大会不符合前述要求而不能够成功召开,根据《基金法》及《基金合同》相关规定,本基金管理人可在规定时间内就同一议案重新召集基金份额持有人大会。重新召开基金份额持有人大会时,除非授权文件另有载明,本次基金份额持有人大会授权期间基金份额持有人作出的各类授权依然有效,但如果授权方式发生变化或者基金份额持有人重新作出授权,则以最新方式或最新授权为准,详细说明见届时发布的重新召集基金份额持有人大会的通知。

十三、重要提示

1、本次会议将于2020年6月22日上午9:30召开,届时基金管理人、基金托管人和基金管理人聘请的见证律师、公证机关人员将对与会人员资格的合法性进行审查并予以登记,请出席会议人员务必按照本公告的要求,携带必需的文件提前半小时到达会议地点,以便验证入场。主持人宣布会议开始后,不再对未登记的基金份额持有人进行登记,未登记的基金份额持有人不得入场参加会议。

2、基金份额持有人应当保持会议秩序,服从召集人的引导,除出席会议的基金份额持有人(或代理人)、会务人员、聘任律师和公证机构及召集人邀请的人员以外,召集人有权依法拒绝其他人士入场,对于干扰基金份额持有人大会秩序、寻衅滋事和侵犯其他基金份额持有人合法权益的行为,召集人有权采取措施加以制止并及时报告有关部门查处。

3、特别提醒各位基金份额持有人在进行预登记及会议现场登记时,需要提供的是开立持有本基金基金份额的基金账户所使用的相关证件及(或)其复印件,如若开立有多个账户且使用的是不同的证件,需要分别提供各账户对应的相关证件及(或)其复印件。

4、如基金份额持有人授权他人出席本次大会后,又亲自出席本次大会进行投票表决的,以其本人亲自投票的表决意见为准。

5、基金管理人将在基金份额持有人大会召开前发布提示性公告,就基金份额持有人大会相关情况做必要说明,请予以留意。

6、如本次基金份额持有人大会不能成功召开或未能通过本次大会审议的议案,根据《基金法》及《基金合同》的有关规定,本基金可能会再次召开基金份额持有人大会。

7、上述基金份额持有人大会有关公告可通过中信保诚基金管理有限公司网站查阅,投资者如有任何疑问,可致电400 666 0066咨询。

8、本公告的有关内容由中信保诚基金管理有限公司解释。

十四、持有人大会联系方式

持有人可通过以下方式联系召集人(基金管理人)获取相应信息:

联系机构:中信保诚基金管理有限公司

客服咨询专线 400-6660066 转9

联系人:金芬泉

电子邮件:ds@citicprufunds.com.cn

传真:(021) 5012 0886

网址:http://www.citicprufunds.com.cn

附件一:《关于信诚理财28日盈债券型证券投资基金转型有关事项的议案》

附件二:授权委托书(样本)

附件三:信诚理财28日盈债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决票

附件四:信诚理财28日盈债券型证券投资基金转型方案说明书

中信保诚基金管理有限公司

2020年5月28日

附件一:

关于信诚理财28日盈债券型证券投资基金转型有关事项的议案

信诚理财28日盈债券型证券投资基金基金份额持有人:

综合市场需求分析,为维护基金份额持有人利益,根据《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》、《关于规范理财债券基金业务的通知》等法律法规的规定和《信诚理财28日盈债券型证券投资基金基金合同》有关约定,经基金管理人与基金托管人中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)协商一致,决定召开本基金的基金份额持有人大会,对本基金实施转型。转型方案说明见附件四《信诚理财28日盈债券型证券投资基金转型方案说明书》。

同时,为实施本基金转型方案,提议本基金的基金份额持有人授权基金管理人办理本次基金转型的有关具体事宜,并根据持有人大会决议以及转型后基金运作的特点及现时有效的法律法规,对《信诚理财28日盈债券型证券投资基金基金合同》进行修改和补充。

以上提案,请予审议。

中信保诚基金管理有限公司

二〇二〇年五月二十二日

附件二:

授权委托书

本人(或本机构)持有了信诚理财28日盈债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)的基金份额,就于2020年6月22日以现场方式召开的信诚理财28日盈债券型证券投资基金基金份额持有人大会,本人(或本机构)的意见为(请在意见栏下方划“√”):

审议事项	同意	反对	弃权
关于信诚理财28日盈债券型证券投资基金转型有关事项的议案			

本人(或本机构)特此授权 代表本人(或本机构)参加审议上述事项的基金份额持有人大会,并按照上述意见行使表决权。本人(或本机构)同意代理人转授权,转授权仅限一次。

上述授权有效期自签署日起至审议上述事项的基金份额持有人大会会议结束之日止。若信诚理财28日盈债券型证券投资基金重新召开审议上述事项的基金份额持有人大会会议结束之日止。

委托人(签字/盖章):

委托人证件号码(填写):

签署日期: 年 月 日

授权委托书填写注意事项:

1、本授权书仅为样本供基金份额持有人参考使用。基金份额持有人也可以自行制作符合法律规定及《信诚理财28日盈债券型证券投资基金基金合同》要求的授权委托书。

2. 基金份额持有人可以委托本基金的基金管理人以及其他符合法律规定的机构和个人,代为行使本次基金份额持有人大会上的表决权。

3. 如委托人未在授权委托书表示中明确其表决意见的,视为委托人授权代理人按照代理人的意志行使表决权;如委托人在授权委托书表示中表达多种表决意见的,视为委托人授权代理人选择其中一种授权表示行使表决权。

4. 本授权委托书(样本)中“委托人证件号码”,指基金份额持有人认购或申购本基金时的证件号码或该证件号码的更新。

5. 如本次持有人大会权益登记日,投资者未持有本基金的基金份额,则其授权无效。

附件三:
信诚理财28日盈债券型证券投资基金
基金份额持有人大会表决票

基金份额持有人姓名或名称:
证件号码(身份证件号/营业执照号)

审议事项	同意	反对	弃权
关于信诚理财28日盈债券型证券投资基金转型有关事项的议案			

基金份额持有人签名或盖章 2020年 月 日

说明:
请以打“√”方式在审议事项后注明表决意见。持有人必须选择一种且只能选择一种表决意见。表决意见代表基金份额持有人所持全部基金份额的表决意见。表决意见未选、表决意见模糊不清或相互矛盾的表决票(但其他各项符合会议通知规定的)均视为投票人放弃表决权利,其所持全部基金份额的表决结果均计为“弃权”。签名或盖章部分填写不完整、不清晰的表决票计为无效表决票。

附件四:

信诚理财28日盈债券型证券投资基金转型方案说明书

一、声明

综合市场需求分析,为维护基金份额持有人利益,根据《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》、《关于规范理财债券基金业务的通知》和《信诚理财28日盈债券型证券投资基金基金合同》有关规定,经基金管理人与基金托管人中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)协商一致,拟对信诚理财28日盈债券型证券投资基金实施转型。

本次信诚理财28日盈债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)转型方案需经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过,存在无法获得持有人大会表决通过的可能。

信诚理财28日盈债券型证券投资基金的转型已经中国证监会变更注册,基金份额持有人大会表决通过的决议需依法报中国证监会备案。中国证监会对本次信诚理财28日盈债券型证券投资基金转型方案所作的任何决定或意见,均不表明其对本次转型方案或中信保诚嘉鸿债券型证券投资基金的投资价值或市场前景做出实质性判断或保证。

二、转型方案要点

(一)变更基金名称

基金名称由“信诚理财28日盈债券型证券投资基金”变更为“中信保诚嘉鸿债券型证券投资基金”。

(二)变更基金的运作方式

本基金的运作方式由每份基金份额以运作周期运作变更为开放式运作。

	转型前	转型后
基金的基本情况	(三)基金的运作方式 契约型开放式 (1)每个运作期到期日前,基金份额持有人不能提出赎回申请 对于每份基金份额,第一个运作期指基金合同生效日(对认购份额而言,下同)或基金份额申购确认日(对申购份额而言,下同)起(即第一个运作起始日),至基金合同生效日或基金份额申购申请日次四周的对日(即第一个运作期到期日,如该对应日为非工作日,则顺延到下一工作日)止。第二个运作期指第一个运作期到期日的次一工作日起,至基金合同生效日或基金份额申购申请日次六周的对日(如该日为非工作日,则顺延至下一工作日)止,依此类推。每个运作期到期日前,基金份额持有人不能提出赎回申请。 (2)每个运作期到期日,基金份额持有人可提出赎回申请 每个运作期到期日,基金份额持有人可提出赎回申请。如果基金份额持有人在每个运作期到期日未申请赎回,则自该运作期到期日下一工作日起该基金份额进入下一个运作期。 在基金份额对应的每个运作期到期日,基金管理人办理该基金份额对应的未支付收益的结转。	三、基金的运作方式 契约型开放式

(三)修改基金份额的申购与赎回相关条款

由于调整为采用浮动基金份额净值及基金的运作方式变更,基金份额的申购与赎回的相关条款进行了相应的修改。

	转型前	转型后
基金份额的申购与赎回	(二)申购与赎回办理的开放日及时间 1、开放日及开放时间 基金管理人在开放日办理基金份额的申购,在每个运作期到期日办理基金份额赎回。具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间,但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回除外。 基金合同生效后,若出现新的证券交易市场、证券交易时间变更或其他特殊情况,基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整,但应在实施日前依据《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。 2、申购、赎回开始日及业务办理时间 基金管理人自基金合同生效之日起不超过1周开始办理申购,具体业务办理时间在申购开始公告中规定。 基金份额个运作期到期日,基金份额持有人方可就该基金份额提出赎回申请。基金管理人自基金合同生效之日次四周的周对日起开始办理赎回,具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。 在确定申购开始与赎回开始时间后,基金管理人应在申购、赎回开始日前依据《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告申购与赎回的开始时间。 基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换,投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购或者转换入本基金的申请且注册登记机构确认接受的,视为下一开放日提出的有效申购或转换入本基金申请。 在注册登记机构及注册登记系统等支持的情况下,本基金将可以办理申购预约和赎回预约。 (三)申购与赎回的原则 1、“确定价”原则,即本基金的申购、赎回的价格为每份基金份额人民币1.00元; 2、采用金额申购和份额赎回的方式,即申购以金额申请,赎回以份额申请; 3、基金份额持有人在赎回本基金时,基金管理人按运作期到期日可赎回份额先进先出的原则,即对该基金份额持有人在该销售机构托管的本基金基金份额进行处理时,申购确认日期在先的基金份额先赎回,申购确认日期在后的基金份额后赎回; 4、当日的申购与赎回申请可以在当日业务办理时间结束前撤销,在当日的业务办理时间结束后不得撤销;基金管理人、基金注册登记机构另有规定的,从其规定; 5、基金份额持有人赎回其持有的本基金基金份额时,基金管理人在扣除该基金份额可应的特支付收益后,向该基金份额持有人支付赎回款项。 基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则,但应在新的原则实施日前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。	二、申购和赎回的开放日及时间 1、开放日及开放时间 投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回。具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间,但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回除外。 基金合同生效后,若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况,基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整,但应在实施日前依据《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。 2、申购、赎回开始日及业务办理时间 基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个开放日办理申购,具体业务办理时间在申购开始公告中规定。 在确定申购开始与赎回开始时间后,基金管理人应在申购、赎回开始日前依据《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告申购与赎回的开始时间。 基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换,投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的,其基金份额申购、赎回价格为下一开放日该类基金份额申购、赎回的价格。 三、申购与赎回的原则 1、“未知价”原则,即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算; 2、“金额申购、份额赎回”原则,即申购以金额申请,赎回以份额申请; 3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销; 4、赎回遵循“先进先出”原则,即按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回; 5、办理申购、赎回业务时,应当遵循基金份额持有人利益优先原则,确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待。 基金管理人可在不违背法规允许的情况下,对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

	转型前	转型后
基金的投资	(一)投资目标 本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,追求基金资产稳定增值,力争成为投资者短期理财的理想工具。 (二)投资范围和投资比例 本基金投资于法律法规允许:现金,通知存款,一年以内(含一年)的银行定期存款,剩余期限(或回售期限)在397天以内(含397天)的债券、资产支持证券、中期票据,期限在一年以内(含一年)的债券回购,期限在一年以内(含一年)的中央银行票据,短期融资券,及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他固定收益类金融工具。 本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过148天。 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。 (三)投资策略 本基金将综合考虑各类投资品种的收益性、流动性和风险特征,在保证基金资产的安全性和流动性的基础上力争为投资人创造稳定的收益。同时,通过对国内外宏观经济走势、货币政策和财政政策的研究,结合对市场利率变动的预期,进行积极的投资组合管理。 1、整体资产配置策略 整体资产配置策略主要体现在:1)根据宏观经济形势、央行货币政策、短期资金市场状况等因素对短期利率走势进行综合判断;2)根据前述判断形成的利率预期动态调整基金投资组合的平均剩余期限。 (1)利率预期分析 通过对通货膨胀率、GDP增长率、货币供应量、国际利率水平、汇率、政策取向等跟踪分析,形成对基本面的宏观研判。同时,结合微观层面研究,主要考察指标包括:央行公开市场操作、主流机构投资者的短期投资倾向、债券供给、债券市场与资本市场资金互动等,合理预期市场利率曲线动态变化,据此决定整体资产配置策略。 (2)动态调整投资组合平均剩余期限 结合利率预期分析,合理运用量化模型,动态确定并按照投资组合平均剩余期限在148天以内,以规避较长期限债券的利率风险,当市场利率看涨时,适度缩短投资组合平均剩余期限,即减持剩余期限较长投资品种增持剩余期限较短品种,降低组合整体净值损失风险;当市场看跌时,则相对延长投资组合平均剩余期限,增持较长剩余期限的投资品种,获取超额收益。 2、类属配置策略 类属配置指组合在各类短期金融工具如央行票据、国债、金融债、企业短期融资券以及现金等投资品种之间的配置比例,作为现金管理工具,货币市场基金类属配置策略主要实现两个目标:一是通过类属配置满足基金流动性需求,二是通过类属配置获得投资收益。从流动性的角度来说,基金管理人需对市场资金面、基金申购赎回金额的变化进行动态分析,以确定本基金的流动性目标。在此基础上,基金管理人在高流动性资产和相对流动性较低资产之间寻找平衡,以满足组合的日常流动性需求;从收益性角度来说,基金管理人将通过分析各类属的相对收益、利差变化、流动性风险、信用风险等因素来确定类属配置比例,寻找具有投资价值的投资品种,增持相对低估、价格将上升的,能给组合带来相对较高回报的类属;减持相对高估、价格将下降的,给组合带来相对较低回报的类属,借以取得较高的总回报。 3、个券选择策略 在个券选择层面,本基金将首先从安全性角度出发,优先选择央票、短期国债等高信用等级的债券品种以回避信用违约风险,对于外部信用评级等级较高(符合法规规定的级别)的企业债、短期融资券等信用类债券,本基金也可以进行配置。除考虑安全性因素外,在具体的券种选择上,基金管理人将在正确拟合收益率曲线的基础上,找出收益率出现明显偏高的券种,并客观分析收益率出现偏高的原因。若出现因市场原因所导致的收益率高于公允水平,则该券种价格出现低估,本基金将对此类低估品种进行重点关注,并从,鉴于收益率曲线可以判断出定价偏高或偏低的期限段,从而指导相对价值投资,这也可以帮助基金管理人选择投资于定价低估的短期债券品种。 4、现金流管理策略 本基金作为现金管理工具,必须具备较高的流动性。基金管理人将密切关注基金的申赎赎回情况、季节性资金流动情况和日历效应等因素,对投资组合的现金比例进行结构化管理。基金管理人将在遵循流动性先生的原则下,综合平衡基金资产在流动性资产和取益性资产之间的配置比例,通过现金留存、持有高流动性券种、正向回购、降低组合久期等方式提高基金资产的流动性,也可采用持续滚动投资方法,将回购或债券的到期日进行均衡等量配置,以满足日常的基金资产变现需求。 5.套利策略 由于市场环境基等、交易市场分割、市场参与者差异,以及资金供求失衡等因的中短期利率异常发展,使得债券现券市场上存在着套利机会。本基金通过分析市场宏观经济、货币政策、市场利率走向、财政政策、国际利率水平、汇率、政策取向等跟踪分析,形成对基本面的宏观研判。同时,结合微观层面研究,主要考察指标包括:央行公开市场操作、主流机构投资者的短期投资倾向、债券供给、债券市场与资本市场资金互动等,合理预期市场利率曲线动态变化,据此决定整体资产配置策略。 (2)动态调整投资组合平均剩余期限 结合利率预期分析,合理运用量化模型,动态确定并按照投资组合平均剩余期限在148天以内,以规避较长期限债券的利率风险,当市场利率看涨时,适度缩短投资组合平均剩余期限,即减持剩余期限较长投资品种增持剩余期限较短品种,降低组合整体净值损失风险;当市场看跌时,则相对延长投资组合平均剩余期限,增持较长剩余期限的投资品种,获取超额收益。 2,类属配置策略 类属配置指组合在各类短期金融工具如央行票据、国债、金融债、企业短期融资券以及现金等投资品种之间的配置比例,作为现金管理工具,货币市场基金类属配置策略主要实现两个目标:一是通过类属配置满足基金流动性需求,二是通过类属配置获得投资收益。从流动性的角度来说,基金管理人需对市场资金面、基金申购赎回金额的变化进行动态分析,以确定本基金的流动性目标。在此基础上,基金管理人在高流动性资产和相对流动性较低资产之间寻找平衡,以满足组合的日常流动性需求;从收益性角度来说,基金管理人将通过分析各类属的相对收益、利差变化、流动性风险、信用风险等因素来确定类属配置比例,寻找具有投资价值的投资品种,增持相对低估、价格将上升的,能给组合带来相对较高回报的类属;减持相对高估、价格将下降的,给组合带来相对较低回报的类属,借以取得较高的总回报。 3、个券选择策略 在个券选择层面,本基金将首先从安全性角度出发,优先选择央票、短期国债等高信用等级的债券品种以回避信用违约风险,对于外部信用评级等级较高(符合法规规定的级别)的企业债、短期融资券等信用类债券,本基金也可以进行配置。除考虑安全性因素外,在具体的券种选择上,基金管理人将在正确拟合收益率曲线的基础上,找出收益率出现明显偏高的券种,并客观分析收益率出现偏高的原因。若出现因市场原因所导致的收益率高于公允水平,则该券种价格出现低估,本基金将对此类低估品种进行重点关注,并从,鉴于收益率曲线可以判断出定价偏高或偏低的期限段,从而指导相对价值投资,这也可以帮助基金管理人选择投资于定价低估的短期债券品种。 4,现金流管理策略 本基金作为现金管理工具,必须具备较高的流动性。基金管理人将密切关注基金的申赎赎回情况、季节性资金流动情况和日历效应等因素,对投资组合的现金比例进行结构化管理。基金管理人将在遵循流动性先生的原则下,综合平衡基金资产在流动性资产和取益性资产之间的配置比例,通过现金留存、持有高流动性券种、正向回购、降低组合久期等方式提高基金资产的流动性,也可采用持续滚动投资方法,将回购或债券的到期日进行均衡等量配置,以满足日常的基金资产变现需求。 5,套利策略 由于市场环境基等、交易市场分割、市场参与者差异,以及资金供求失衡等因的中短期利率异常发展,使得债券现券市场上存在着套利机会。本基金通过分析市场宏观经济、货币政策、市场利率走向、财政政策、国际利率水平、汇率、政策取向等跟踪分析,形成对基本面的宏观研判。同时,结合微观层面研究,主要考察指标包括:央行公开市场操作、主流机构投资者的短期投资倾向、债券供给、债券市场与资本市场资金互动等,合理预期市场利率曲线动态变化,据此决定整体资产配置策略。 (2)动态调整投资组合平均剩余期限 结合利率预期分析,合理运用量化模型,动态确定并按照投资组合平均剩余期限在148天以内,以规避较长期限债券的利率风险,当市场利率看涨时,适度缩短投资组合平均剩余期限,即减持剩余期限较长投资品种增持剩余期限较短品种,降低组合整体净值损失风险;当市场看跌时,则相对延长投资组合平均剩余期限,增持较长剩余期限的投资品种,获取超额收益。 2,类属配置策略 类属配置指组合在各类短期金融工具如央行票据、国债、金融债、企业短期融资券以及现金等投资品种之间的配置比例,作为现金管理工具,货币市场基金类属配置策略主要实现两个目标:一是通过类属配置满足基金流动性需求,二是通过类属配置获得投资收益。从流动性的角度来说,基金管理人需对市场资金面、基金申购赎回金额的变化进行动态分析,以确定本基金的流动性目标。在此基础上,基金管理人在高流动性资产和相对流动性较低资产之间寻找平衡,以满足组合的日常流动性需求;从收益性角度来说,基金管理人将通过分析各类属的相对收益、利差变化、流动性风险、信用风险等因素来确定类属配置比例,寻找具有投资价值的投资品种,增持相对低估、价格将上升的,能给组合带来相对较高回报的类属;减持相对高估、价格将下降的,给组合带来相对较低回报的类属,借以取得较高的总回报。 3,个券选择策略 在个券选择层面,本基金将首先从安全性角度出发,优先选择央票、短期国债等高信用等级的债券品种以回避信用违约风险,对于外部信用评级等级较高(符合法规规定的级别)的企业债、短期融资券等信用类债券,本基金也可以进行配置。除考虑安全性因素外,在具体的券种选择上,基金管理人将在正确拟合收益率曲线的基础上,找出收益率出现明显偏高的券种,并客观分析收益率出现偏高的原因。若出现因市场原因所导致的收益率高于公允水平,则该券种价格出现低估,本基金将对此类低估品种进行重点关注,并从,鉴于收益率曲线可以判断出定价偏高或偏低的期限段,从而指导相对价值投资,这也可以帮助基金管理人选择投资于定价低估的短期债券品种。 4,现金流管理策略 本基金作为现金管理工具,必须具备较高的流动性。基金管理人将密切关注基金的申赎赎回情况、季节性资金流动情况和日历效应等因素,对投资组合的现金比例进行结构化管理。基金管理人将在遵循流动性先生的原则下,综合平衡基金资产在流动性资产和取益性资产之间的配置比例,通过现金留存、持有高流动性券种、正向回购、降低组合久期等方式提高基金资产的流动性,也可采用持续滚动投资方法,将回购或债券的到期日进行均衡等量配置,以满足日常的基金资产变现需求。 5,套利策略 由于市场环境基等、交易市场分割、市场参与者差异,以及资金供求失衡等因的中短期利率异常发展,使得债券现券市场上存在着套利机会。本基金通过分析市场宏观经济、货币政策、市场利率走向、财政政策、国际利率水平、汇率、政策取向等跟踪分析,形成对基本面的宏观研判。同时,结合微观层面研究,主要考察指标包括:央行公开市场操作、主流机构投资者的短期投资倾向、债券供给、债券市场与资本市场资金互动等,合理预期市场利率曲线动态变化,据此决定整体资产配置策略。 (2)动态调整投资组合平均剩余期限 结合利率预期分析,合理运用量化模型,动态确定并按照投资组合平均剩余期限在148天以内,以规避较长期限债券的利率风险,当市场利率看涨时,适度缩短投资组合平均剩余期限,即减持剩余期限较长投资品种增持剩余期限较短品种,降低组合整体净值损失风险;当市场看跌时,则相对延长投资组合平均剩余期限,增持较长剩余期限的投资品种,获取超额收益。 2,类属配置策略 类属配置指组合在各类短期金融工具如央行票据、国债、金融债、企业短期融资券以及现金等投资品种之间的配置比例,作为现金管理工具,货币市场基金类属配置策略主要实现两个目标:一是通过类属配置满足基金流动性需求,二是通过类属配置获得投资收益。从流动性的角度来说,基金管理人需对市场资金面、基金申购赎回金额的变化进行动态分析,以确定本基金的流动性目标。在此基础上,基金管理人在高流动性资产和相对流动性较低资产之间寻找平衡,以满足组合的日常流动性需求;从收益性角度来说,基金管理人将通过分析各类属的相对收益、利差变化、流动性风险、信用风险等因素来确定类属配置比例,寻找具有投资价值的投资品种,增持相对低估、价格将上升的,能给组合带来相对较高回报的类属;减持相对高估、价格将下降的,给组合带来相对较低回报的类属,借以取得较高的总回报。 3,个券选择策略 在个券选择层面,本基金将首先从安全性角度出发,优先选择央票、短期国债等高信用等级的债券品种以回避信用违约风险,对于外部信用评级等级较高(符合法规规定的级别)的企业债、短期融资券等信用类债券,本基金也可以进行配置。除考虑安全性因素外,在具体的券种选择上,基金管理人将在正确拟合收益率曲线的基础上,找出收益率出现明显偏高的券种,并客观分析收益率出现偏高的原因。若出现因市场原因所导致的收益率高于公允水平,则该券种价格出现低估,本基金将对此类低估品种进行重点关注,并从,鉴于收益率曲线可以判断出定价偏高或偏低的期限段,从而指导相对价值投资,这也可以帮助基金