

中信保诚基金管理有限公司关于以通讯方式召开信诚惠泽债券型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会的第二次提示性公告

中信保诚基金管理有限公司已于 2018 年 7 月 31 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及中信保诚基金管理有限公司网站（www.citicprufunds.com.cn）发布了《中信保诚基金管理有限公司关于以通讯方式召开信诚惠泽债券型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会的公告》，并于 2018 年 8 月 1 日发布了第一次提示性公告。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二次提示性公告。

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[2016]1244 号文注册的信诚惠泽债券型证券投资基金的基金合同于 2016 年 9 月 9 日生效。根据《信诚惠泽债券型证券投资基金基金合同》的约定，《信诚惠泽债券型证券投资基金基金合同》生效 18 个月的封闭期届满后，信诚惠泽债券型证券投资基金自动转换为信诚惠泽债券型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”），本基金管理人已于 2018 年 3 月 9 日发布《关于信诚惠泽债券型证券投资基金转换为上市开放式基金（LOF）及基金名称变更的公告》，自 2018 年 3 月 10 日起，信诚惠泽债券型证券投资基金转换为上市开放式基金（LOF）。自 2018 年 3 月 12 日起，信诚惠泽债券型证券投资基金的基金名称变更为“信诚惠泽债券型证券投资基金（LOF）”。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》和《信诚惠泽债券型证券投资基金（LOF）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《关于信诚惠泽债券型证券投资基金（LOF）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：通讯方式。

2、会议投票表决起止时间：自 2018 年 8 月 3 日起，至 2018 年 8 月 31 日 17:00 止（以表决票收件人收到表决票时间为准）。

3、通讯表决票将送达至本基金管理人，具体地址和联系方式如下：

收件人：中信保诚基金管理有限公司客户服务部

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

邮政编码：200120

联系电话：4006660066

请在信封表面注明：“信诚惠泽债券型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会表决专用”

二、会议审议事项

本次持有人大会审议的事项为《关于信诚惠泽债券型证券投资基金（LOF）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 2018 年 8 月 2 日，即在 2018 年 8 月 2 日深圳证券交易所交易时间结束后，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、投票方式

本次持有人大会的表决方式仅限于纸质表决。纸质表决票的填写和寄交方式如下：

1、本次会议表决票见附件三。基金份额持有人可通过剪报、复印或登陆基金管理人网站

（<http://www.citicprufunds.com/>）下载等方式获取表决票。

2、基金份额持有人应当按照表决票的要求填写相关内容，其中：

（1）个人投资者自行投票的，需在表决票上签字，并提供本人身份证件复印件。

（2）机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章（包括基金管理人认可的业务专用章，下同），并提供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事业单位法人登记证书、有权部门的批文或登记证书复印件等）。

（3）合格境外机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本机构公章（如有）或由授权代表在表决票上签

字（如无公章），并提供该授权代表的有效身份证件、护照或其他身份证明文件的复印件，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，以及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。

（4）基金份额持有人可根据本公告“五、授权”的规定授权其他个人或机构代其在本次基金份额持有人大会上投票。

（5）以上各项中的公章、批文、开户证明及登记证书，以基金管理人的认可为准。

3、基金份额持有人或其代理人需将填妥的表决票和所需的相关文件于会议投票表决起止时间内（以本基金管理人收到表决票时间为准）通过专人送交或邮寄的方式送达至本基金管理人的办公地址（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），请在信封表面注明：“信诚惠泽债券型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会表决专用”。

五、授权

为便于基金份额持有人有尽可能多的机会参与本次大会，使基金份额持有人在本次大会上充分表达其意志，基金份额持有人除可以直接投票外，还可以授权他人代其在基金份额持有人大会上投票。根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，基金份额持有人授权他人在基金份额持有人大会上表决需符合以下规则：

1、委托人

本基金的基金份额持有人自本公告发布之日起可委托他人代理行使本次基金份额持有人大会的表决权。投资者在申购本基金的同时也可以签署授权委托书，待申购申请确认后，授权委托书自动有效。

基金份额持有人（含新申购投资者，下同）授权他人行使表决权的票数按该基金份额持有人在权益登记日所持有的全部基金份额数计算，一份基金份额代表一票表决权。基金份额持有人在权益登记日未持有本基金基金份额的，授权无效。

基金份额持有人在权益登记日是否持有基金份额以及所持有的基金份额的数额以本基金登记机构的登记为准。

2、受托人（代理人）

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、授权方式

本基金的基金份额持有人仅可通过纸面授权方式授权代理人代为行使表决权。授权委托书的样本请见本公告附件二。基金份额持有人可通过剪报、复印或登录基金管理人网站下载（<http://www.citicprufunds.com/>）等方式获取授权委托书样本。

（1）基金份额持有人进行纸面授权所需提供的文件

①个人基金份额持有人委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，代理人应提供由委托人填妥并签署的授权委托书原件（授权委托书的格式可参考附件二的样本），并提供基金份额持有人的个人身份证明文件复印件。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证明文件复印件；如代理人为机构，还需提供该代理人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、开户证明或登记证书复印件等）。

②机构基金份额持有人委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，代理人应提供由委托人填妥的授权委托书原件（授权委托书的格式可参考附件二的样本），并在授权委托书上加盖该机构公章，并提供该机构持有人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、开户证明或登记证书复印件等）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证明文件复印件；如代理人为机构，还需提供该代理人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、开户证明或登记证书复印件等）。

③合格境外机构投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并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，以及填妥的授权委托书原件。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件复印件；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事业单位法人登记证书、有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

④以上各项中的公章、批文、开户证明及登记证书，以基金管理人的认可为准。

（2）对基金管理人的纸面授权文件的送达

基金份额持有人通过纸面方式对基金管理人进行授权的，可通过邮寄授权文件和所需的相关文件或在基金管理人柜台办理授权事宜。

基金份额持有人也可将其填妥的授权委托书和所需的相关文件专人送交基金管理人办公地点。

4、授权效力确定规则

（1）如果同一基金份额持有人持有的全部基金份额存在多次有效纸面方式授权的，以最后一次纸面授权为准。不能确定最后一次纸面授权的，如最后时间收到的授权委托有多次，以表示具体表决意见的纸面授权为准；

（2）如果委托人签署的授权委托书没有表示具体表决意见的，视为委托人授权代理人按照代理人意志行使表决权；

（3）基金份额以非纸面方式进行授权的，为无效授权；

（4）如委托人在授权委托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；

（5）如委托人既进行委托授权，又送达了有效表决票，则以有效表决票为准。

5、对基金管理人的授权截止时间

基金管理人接受基金份额持有人授权的截止时间为 2018 年 8 月 24 日 16: 30 时。将纸面授权委托书和所需的相关文件寄送或专人送达给基金管理人的指定地址的，授权时间以收到时间为准。

六、计票

1、本次通讯会议的计票方式为：由本基金管理人授权的两名监督员在基金托管人（中信银行股份有限公司）授权代表的监督下在表决截止日后 2 个工作日内进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

2、基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权。

3、表决票效力的认定如下：

（1）纸面表决票通过专人送交的，表决时间以实际递交时间为准；邮寄送达本公告规定的收件人的，表决时间以收件人收到时间为准。2018 年 8 月 31 日 17: 00 以后送达基金管理人的，为无效表决。

（2）纸面表决票的效力认定

①纸面表决票填写完整清晰，所提供文件符合本会议通知规定，且在截止时间之前送达本公告规定的收件人的，为有效表决票；有效表决票按表决意见计入相应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

②如纸面表决票上的表决意见未选、表决意见模糊不清或相互矛盾的，但其他各项符合会议通知规定的，视为弃权表决，计入有效表决票；并按“弃权”计入对应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

③如纸面表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的，或未能提供有效证明基金份额持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的，或未能在截止时间之前送达本公告规定的收件人的，均为无效表决票；无效表决票不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

④基金份额持有人重复提交纸面表决票的，如各表决票表决意见相同，则视为同一表决票；如各表决票表决意见不相同，则按如下原则处理：

i.送达时间不是同一天的，以最后送达的填写有效的表决票为准，先送达的表决票视为被撤回；

ii.送达时间为同一天的，视为在同一表决票上做出了不同表决意见，计入弃权表决票；

iii.送达时间按如下原则确定：专人送达的以实际递交时间为准，邮寄的以本公告规定的收件人收到的时间为准。

七、决议生效条件

- 1、本人直接出具书面意见和授权他人代表出具书面意见的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、《关于信诚惠泽债券型证券投资基金（LOF）转型有关事项的议案》应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方为有效；
- 3、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。

八、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：4006660066

联系人：金芬泉

联系电话：4006660066 转 9

电子邮件：ds@citicprufunds.com.cn

传真：(021)50120886

网址：<http://www.citicprufunds.com.cn>

- 2、公证机构：上海市东方公证处

地址：上海市凤阳路 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)31358666

九、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《信诚惠泽债券型证券投资基金（LOF）基金合同》的约定，本次持有人大会需要直接出具书面意见和授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额合计占权益登记日基金份额的 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成功召开，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。重新召集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、重要提示

- 1、请基金份额持有人在邮寄表决票时，充分考虑邮寄在途时间，提前寄出表决票。
- 2、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。
- 3、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 4006660066 咨询。
- 4、为保护基金份额持有人利益，本基金将在计票日当日起停牌并暂停赎回业务。本基金复牌、恢复赎回业务的安排详见基金管理人届时发布的相关公告。
- 5、本公告的有关内容由中信保诚基金管理有限公司解释。

附件一：《关于信诚惠泽债券型证券投资基金（LOF）转型有关事项的议案》

附件二：授权委托书（样本）

附件三：信诚惠泽债券型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会表决票

附件四：信诚惠泽债券型证券投资基金（LOF）转型方案说明书

中信保诚基金管理有限公司

2018年8月2日

附件一:

关于信诚惠泽债券型证券投资基金(LOF)转型有关事项的议案

信诚惠泽债券型证券投资基金(LOF)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》等法律法规的规定和《信诚惠泽债券型证券投资基金(LOF)基金合同》有关约定,经基金管理人与基金托管人中信银行股份有限公司(以下简称“中信银行”)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《信诚惠泽债券型证券投资基金(LOF)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《信诚惠泽债券型证券投资基金(LOF)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

二〇一八年七月三十一日

附件二:

授权委托书

本人(或本机构)特此授权代表本人(或本机构)参加投票截止日为2018年8月31日的以通讯方式召开的信诚惠泽债券型证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会,并代为全权行使所有议案的表决权。表决意见以受托人(代理人)的表决意见为准。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。若信诚惠泽债券型证券投资基金(LOF)在法定时间内重新召开审议相同议案的持有人大会的,本授权继续有效。

委托人(签字/盖章):

委托人证件号码(填写):

受托人(代理人)(签字/盖章):

受托人(代理人)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《信诚惠泽债券型证券投资基金(LOF)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. 以上授权是基金份额持有人就其持有的本基金全部份额(含截至权益登记日的未付累计收益)向代理人所做授权。
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:

信诚惠泽债券型证券投资基金(LOF)

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

关于信诚惠泽债券型证券投资基金(LOF)转型有关事项的议案

基金份额持有人（或受托人、代理人）签名或盖章

2018 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，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：

信诚惠泽债券型证券投资基金（LOF）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》和《信诚惠泽债券型证券投资基金（LOF）基金合同》有关规定，经基金管理人与基金托管人中信银行股份有限公司（以下简称“中信银行”）协商一致，拟对信诚惠泽债券型证券投资基金（LOF）实施转型。

本次信诚惠泽债券型证券投资基金（LOF）（以下简称“信诚惠泽”或“本基金”）转型方案应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出，存在无法获得持有人大会表决通过的可能。

信诚惠泽债券型证券投资基金（LOF）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惠泽债券型证券投资基金（LOF）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本基金的价值或投资者的收益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“信诚惠泽债券型证券投资基金（LOF）”变更为“中信保诚惠泽 18 个月定期开放债券型证券投资基金”。

变更注册前 变更注册后

基金名称 信诚惠泽债券型证券投资基金（LOF） 中信保诚惠泽 18 个月定期开放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原上市开放式变更为定期开放式，不再上市交易。

变更注册前 变更注册后

基金的基本情况 三、基金的运作方式

上市开放式基金（LOF）。

三、基金的运作方式

契约型定期开放式

四、基金的封闭期与开放期

本基金以封闭期和开放期滚动的方式运作。

本基金的封闭期为自基金合同生效之日起（包括基金合同生效之日）或自每一开放期结束之日次日起（包括该日）18 个月的期间。本基金的首个封闭期为自基金合同生效之日起（包括基金合同生效之日）18 个月的期间，如果封闭期到期日的次日为非工作日的，封闭期相应顺延。首个封闭期结束之后第一个工作日起（包括该日）进入首个开放期，第二个封闭期为首个开放期结束之日次日起（包括该日）18 个月的期间，如果封闭期到期日的次日为非工作日的，封闭期相应顺延，以此类推。本基金封闭期内不办理申购与赎回业务，也不上市交易。本基金自每个封闭期结束之后第一个工作日起（包括该日）进入开放期。投资人办理基金份额的申购和赎回等业务的开放日为本基金开放期的每个工作日。本基金每个开放期不少于 5 个工作日且不超过 20 个工作日，开放期的具体时间以基金管理人届时公告为准。

如封闭期结束后或在开放期内发生不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放申购与赎回业务，或依据基

金合同需暂停申购或赎回业务的，开放期时间顺延，直至满足开放期的时间要求，具体时间以基金管理人届时公告为准。

（三）修改基金份额的申购与赎回的相关条款

由于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对应的修改。

变更注册前 变更注册后

基金份额的申购与赎回 二、申购和赎回的开放日及时间

1、开放日及开放时间

本基金转为上市开放式基金（LOF）后，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、赎回时除外。

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，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

2、申购、赎回开始日及业务办理时间

本基金的申购、赎回自转换为上市开放式基金（LOF）之日起不超过 30 天开始办理，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介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基金份额申购、赎回的价格。

1、开放日及开放时间

本基金办理基金份额的申购和赎回的开放日为开放期内的每个工作日。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、赎回时除外。封闭期内，本基金不办理申购与赎回业务，也不上市交易。

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，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

2、申购、赎回开始日及业务办理时间

本基金的封闭期为自基金合同生效之日起（包括基金合同生效之日）或自每一开放期结束之日次日起（包括该日）18 个月的期间。本基金的首个封闭期为自基金合同生效之日起（包括基金合同生效之日）18 个月的期间，如果封闭期到期日的次日为非工作日的，封闭期相应顺延。首个封闭期结束之后第一个工作日起（包括该日）进入首个开放期，第二个封闭期为首个开放期结束之日次日起（包括该日）18 个月的期间，如果封闭期到期日的次日为非工作日的，封闭期相应顺延，以此类推。本基金封闭期内不办理申购与赎回业务，也不上市交易。本基金自每个封闭期结束之后第一个工作日起（包括该日）进入开放期。投资人办理基金份额的申购和赎回等业务的开放日为本基金开放期的每个工作日。本基金每个开放期不少于 5 个工作日且不超过 20 个工作日，开放期的具体时间以基金管理人届时公告为准。

如封闭期结束后或在开放期内发生不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放申购与赎回业务，或依据基金合同需暂停申购或赎回业务的，开放期时间顺延，直至满足开放期的时间要求，具体时间以基金管理人届时公告为准。

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。在开放期内，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、赎回价格为开放期内下一开放日基金份额申购、赎回的价格；但若投资人在开放期最后一日业务办理时间结束之后提出申购、赎回或者转换申请的，视为无效申请。

九、巨额赎回的情形及处理方式

1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一开放日的基金总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

2、场外巨额赎回的处理方式

当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。

(1) 全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回区别处理。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

本基金发生巨额赎回时，在单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额 10%以上的赎回申请的情形下，基金管理人可以延期办理赎回申请：对于该基金份额持有人当日超过上一开放日基金总份额 10%以上的那部分赎回申请，基金管理人可以进行延期办理；对于该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人根据前段“(1) 全额赎回”或“(2) 部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。但是，如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。

(3) 暂停赎回：连续 2 日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。

3、巨额赎回的公告

当发生上述延期赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个工作日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒介上刊登公告。

4、场内巨额赎回的处理方式按照深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关规定执行。九、巨额赎回的情形及处理方式

1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一工作日的基金总份额的 20%，即认为是发生了巨额赎回。

2、场外巨额赎回的处理方式

当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或采取相应措施。

(1) 全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

(2) 延缓支付赎回款项：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人可以对当日全部赎回申请进行确认，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一工作日基金总份额的 20%的前提下，可对其余赎回申请延缓支付赎回款项，但延缓支付的期限不得超过 20 个工作日，并在指定媒介上予以公告。

(3) 在开放期内，本基金发生巨额赎回时，在单个基金份额持有人超过上一工作日基金总份额 20%以上的赎回申请的情形下，基金管理人认为支付该投资人的赎回申请有困难或认为因支付该投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人可以在当日接受该基金份额持有人的全部赎回比例不低于上一工作日基金总份额 20%的前提下，其余赎回申请可以延期办理。对于未能赎回部

分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回区别处理。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。部分延期赎回不受单笔赎回最低份额的限制。但延期办理的期限不得超过 20 个工作日，如延期办理期限超过开放期的，开放期相应延长，延长的开放期内不办理申购，亦不接受新的赎回申请，即基金管理人仅为原开放期内因提交赎回申请超过上一工作日基金总份额 20%以上而被延期办理赎回的单个基金份额持有人办理赎回业务。

3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延缓支付赎回款项时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个工作日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒介上刊登公告。

4、场内巨额赎回的处理方式按照深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关规定执行。

（四）修改基金的投资范围及投资策略等投资相关条款

对信诚惠泽债券型证券投资基金（LOF）原《基金合同》中投资范围、投资策略、投资限制等内容进行了调整。

投资范围中基金的投资组合比例根据基金封闭期、开放期内投资组合不同情况分别设定比例要求。

投资策略中根据基金封闭期、开放期内的不同投资安排区分约定。

投资限制中根据基金封闭期、开放期内投资组合不同情况分别设定比例限制的要求。

变更注册前 变更注册后

基金的投资 二、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、银行存款、同业存单、货币市场工具、权证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：投资于债券的比例不低于基金资产的 80%（但应转换为上市开放式基金（LOF）的流动性需要，为保护基金份额持有人利益，在封闭期结束前 10 个工作日、封闭期结束后 10 个工作日的期间内，基金投资不受上述比例限制）；本基金持有的股票、权证等权益类资产的比例不超过基金资产的 20%，其中持有的全部权证市值不超过基金资产净值的 3%；转为上市开放式基金（LOF）后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制。

如果法律法规或监管机构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。

三、投资策略

1、资产配置策略

本基金的大类资产配置主要通过自上而下的配置完成，主要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，预测宏观经济的发展趋势等，并据此评价未来一段时间股票、债券市场相对收益率，在限定投资范围内，决定债券类资产、股票类等工具的配置比例，动态调整股票、债券类资产在给定区间内的配置比例。

2、固定收益类资产的投资策略

（1）类属资产配置策略

在整体资产配置的基础上，本基金将通过考量不同类型固定收益品种的信用风险、市场风险、流动性风险、税收等因素，研究各投资品种的利差及其变化趋势，制定债券类属资产配置策略，以获取债券类属之间利

差变化所带来的潜在收益。

（2）普通债券投资策略

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、流动性管理、相对价值配置、杠杆策略等策略进行主动投资。

1) 目标久期控制

本基金首先建立包含消费物价指数、固定资产投资、工业品价格指数、货币供应量等众多宏观经济变量的回归模型。通过回归分析建立宏观经济指标与不同种类债券收益率之间的数量关系，在此基础上结合当前市场状况，预测未来市场利率及不同期限债券收益率走势变化，确定目标久期。当预测未来市场利率将上升时，降低组合久期；当预测未来利率下降时，增加组合久期。

2) 期限结构配置

本基金将通过对央行政策、经济增长率、通货膨胀率等众多因素的分析来预测收益率曲线形状的可能变化；在上述基础上，本基金将运用子弹型、哑铃型或梯形等配置方法，从而确定短、中、长期债券的配置比例。

3) 信用利差策略

本基金将通过严格的内部投资风险管理体系，对关注的信用债进行独立的内部评级，并持续动态跟踪调整，以此作为品种选择的基本依据。

本基金将首先根据债券发行人的长期信用评级、对外担保情况、可能面临巨大损失的诉讼、过往融资记录等进行初步的风险排查，并以此计算债券的可能违约率。符合要求的信用债，本基金将采用不同评级序列，对长期和短期债券的信用评级进行初步评估。在初步评级的基础上，进一步将根据行业特征、竞争优势、管理水平、财务质量、抗风险能力等因素对债券的信用评级进行重新调整，并以此作为评级的结果。对于列入考查范围的信用债，本基金将持续动态跟踪，根据债券发行人自身情况的变化，动态调整信用评级。信用利差策略的核心是各项债券信用评级差异能获得充分的利差补偿。本基金将对债券组合总体信用评级水平予以控制，严格控制低评级债券的配置比例；在券种选择上遵循“个券分散、行业分散”的原则。本基金通过公司内部债券信用评级体系，对债券发行人的公司治理结构、融资能力、抗风险能力、经营状况等进行综合评估，确定发行人的信用风险及债券的信用级别。

4) 相对价值投资策略

本基金将对市场上同类债券的收益率、久期、信用度、流动性等指标进行比较，寻找其他指标相同而某一指标相对更具有投资价值的债券，并进行投资。

5) 杠杆策略

本基金投资于固定收益类资产可采用杠杆策略。本基金将在控制杠杆风险的前提下，适当时机使用资金杠杆以博取利差收益，以增强组合收益。开放期内，本基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；封闭期内，本基金资产总值不得超过基金资产净值的 200%。

（3）资产支持证券的投资策略

对于资产支持证券，本基金将综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成和质量等因素，研究资产支持证券的收益和风险匹配情况，采用量化的定价模型跟踪债券的价格走势，在严格控制投资风险的基础上选择合适的投资对象以获得稳定收益。

3、股票投资策略

（1）股票二级市场投资策略

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。

本基金在进行个股筛选时，将主要从定性和定量两个角度对上市公司的投资价值进行综合评价，精选具有较高投资价值的上市公司：1) 定性分析：根据对行业的发展情况和盈利状况的判断，从公司的经济技术领先程度、市场需求前景、公司的盈利模式、主营产品或服务分析等多个方面对上市公司进行分析。2) 定量

分析：主要考察上市公司的成长性、盈利能力及其估值指标，选取具备选成长性好，估值合理的股票，主要采用的指标包括但不限于：公司收入、未来公司利润增长率等；ROE、ROIC、毛利率、净利率等；PE、PEG、PB、PS 等。

(2) 定向增发股票投资策略

定向增发是指上市公司向特定投资者（包括大股东、机构投资者、自然人等）非公开发行股票的方式。本基金将过宏观经济、行业分析、实施定向增发公司的定增条款和基本面深入研究基础上，利用定向增发项目的事件性特征与折价优势，优选具有较高折价保护并通过定向增发能够改善企业基本面与经营状况的定向增发股票进行投资。

4、其他金融工具的投资策略

如法律法规或监管机构以后允许基金投资于其他衍生金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金对衍生金融工具的投资主要以对冲投资风险或无风险套利为主要目的。基金将在有效进行风险管理的前提下，通过对标的品种的基本面研究，结合衍生工具定价模型预估衍生工具价值或风险对冲比例，谨慎投资。

在符合法律、法规相关限制的前提下，基金管理人按谨慎原则确定本基金衍生工具的总风险暴露。

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。

四、投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

(1) 投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%（但应转换为上市开放式基金（LOF）的流动性需要，为保护基金份额持有人利益，在封闭期结束前 10 个工作日、封闭期结束后 10 个工作日的期间内，基金投资不受上述比例限制）；本基金持有的股票、权证等权益类资产的比例不超过基金资产的 20%；

(2) 转换为上市开放式基金（LOF）后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者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；在封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制；

(3) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；

(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

(5) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

(6) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

(7) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

(8) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

(9) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%，中国证监会规定的特殊品种除外；

(10) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

(11) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

(12) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

(13) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；

(14) 转为上市开放式基金（LOF）后，本基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；封闭期内，本基金资产总值不得超过基金资产净值的 200%；

(15) 转为上市开放式基金（LOF）后，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净

值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合本条所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(16) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

(17) 法律法规及中国证监会规定的其它投资比例限制。

除上述第(2)、(12)、(15)、(16)项以外，因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合本基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准。

二、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、银行存款、同业存单、货币市场工具、权证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：投资于债券的比例不低于基金资产的 80%。但应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，在每次开放期前 3 个月、开放期及开放期结束后 3 个月的期间内，基金投资不受上述比例限制。本基金持有的股票、权证等权益类资产的比例不超过基金资产的 20%，其中持有的全部权证市值不超过基金资产净值的 3%；开放期内，基金持有现金或者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% 的限制，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如果法律法规或监管机构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。

三、投资策略

1、资产配置策略

本基金的大类资产配置主要通过自上而下的配置完成，主要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，预测宏观经济的发展趋势等，并据此评价未来一段时间股票、债券市场相对收益率，在限定投资范围内，决定债券类资产、股票类等工具的配置比例，动态调整股票、债券类资产在给定区间内的配置比例。

2、固定收益类资产的投资策略

(1) 类属资产配置策略

在整体资产配置的基础上，本基金将通过考量不同类型固定收益品种的信用风险、市场风险、流动性风险、税收等因素，研究各投资品种的利差及其变化趋势，制定债券类属资产配置策略，以获取债券类属之间利差变化所带来的潜在收益。

(2) 普通债券投资策略

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、流动性管理、相对价值配置、回购放大策略、可转换债券及可交换债券投资策略等策略进行主动投资。

1) 目标久期控制

本基金首先建立包含消费物价指数、固定资产投资、工业品价格指数、货币供应量等众多宏观经济变量的回归模型。通过回归分析建立宏观经济指标与不同种类债券收益率之间的数量关系，在此基础上结合当前市场状况，预测未来市场利率及不同期限债券收益率走势变化，确定目标久期。当预测未来市场利率将上升时，降低组合久期；当预测未来利率下降时，增加组合久期。

2) 期限结构配置

本基金将通过对央行政策、经济增长率、通货膨胀率等众多因素的分析来预测收益率曲线形状的可能变化；在上述基础上，本基金将运用子弹型、哑铃型或梯形等配置方法，从而确定短、中、长期债券的配置比例。

3) 信用利差策略

本基金将通过严格的内部投资风险管理体系，对关注的信用债进行独立的内部评级，并持续动态跟踪调整，以此作为品种选择的基本依据。

本基金将首先根据债券发行人的长期信用评级、对外担保情况、可能面临巨大损失的诉讼、过往融资记录等进行初步的风险排查，并以此计算债券的可能违约率。符合要求的信用债，本基金将采用不同评级序列，对长期和短期债券的信用评级进行初步评估。在初步评级的基础上，进一步将根据行业特征、竞争优势、管理水平、财务质量、抗风险能力等因素对债券的信用评级进行重新调整，并以此作为评级的结果。对于列入考查范围的信用债，本基金将持续动态跟踪，根据债券发行人自身情况的变化，动态调整信用评级。信用利差策略的核心是各项债券信用评级差异能获得充分的利差补偿。本基金将对债券组合总体信用评级水平予以控制，严格控制低评级债券的配置比例；在券种选择上遵循“个券分散、行业分散”的原则。

本基金通过公司内部债券信用评级体系，对债券发行人的公司治理结构、融资能力、抗风险能力、经营状况等进行综合评估，确定发行人的信用风险及债券的信用级别。

4) 相对价值投资策略

本基金将对市场上同类债券的收益率、久期、信用度、流动性等指标进行比较，寻找其他指标相同而某一指标相对更具有投资价值的债券，并进行投资。

5) 回购放大策略

本基金将在控制杠杆风险的前提下，适当地通过回购融资来提高资金利用率，以增强组合收益。开放期内，本基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；封闭期内，本基金资产总值不得超过基金资产净值的 200%。

6) 可转换债券及可交换债券投资策略

本基金采用期权定价模型等数量化估值工具，选择基础证券基本面优良的可转换债券、可交换债券，评定其投资价值并以合理价格买入并持有，充分享受股票的长期增长潜力和债券的安全收入优势。本基金持有

的可转换债券、可交换债券可以转换、交换为股票。

（3）资产支持证券的投资策略

对于资产支持证券，本基金将综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成和质量等因素，研究资产支持证券的收益和风险匹配情况，采用数量化的定价模型跟踪债券的价格走势，在严格控制投资风险的基础上选择合适的投资对象以获得稳定收益。

3、股票投资策略

（1）股票二级市场投资策略

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成长前景、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。

本基金在进行个股筛选时，将主要从定性和定量两个角度对上市公司的投资价值进行综合评价，精选具有较高投资价值的上市公司：1）定性分析：根据对行业的发展情况和盈利状况的判断，从公司的经济技术领先程度、市场需求前景、公司的盈利模式、主营产品或服务分析等多个方面对上市公司进行分析。2）定量分析：主要考察上市公司的成长性、盈利能力及其估值指标，选取具备成长性好，估值合理的股票，主要采用的指标包括但不限于：公司收入、未来公司利润增长率等；ROE、ROIC、毛利率、净利率等；PE、PEG、PB、PS等。

（2）定向增发股票投资策略

定向增发是指上市公司向特定投资者（包括大股东、机构投资者、自然人等）非公开发行股票的融资方式。本基金将过宏观经济、行业分析、实施定向增发公司的定增条款和基本面深入研究基础上，利用定向增发项目的事件性特征与折价优势，优选具有较高折价保护并通过定向增发能够改善企业基本面与经营状况的定向增发股票进行投资。

4、其他金融工具的投资策略

如法律法规或监管机构以后允许基金投资于其他衍生金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金对衍生金融工具的投资主要以对冲投资风险或无风险套利为主要目的。基金将在有效进行风险管理的前提下，通过对标的品种的基本面研究，结合衍生工具定价模型预估衍生工具价值或风险对冲比例，谨慎投资。

在符合法律、法规相关限制的前提下，基金管理人按谨慎原则确定本基金衍生工具的总风险暴露。

5、开放期投资安排

在开放期内，本基金将主要采用流动性管理策略进行基金投资管理。基金管理人将采取各种有效管理措施，保障基金运作安排，防范流动性风险，满足开放期流动性的需求。

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。

四、投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；但应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，在每次开放期前 3 个月、开放期及开放期结束后 3 个月的期间内，基金投资不受上述比例限制；本基金持有的股票、权证等权益类资产的比例不超过基金资产的 20%；

（2）开放期内，基金持有现金或者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% 的限制，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

（3）本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；

（4）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金

管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

(5) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

(6) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

(7) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

(8) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

(9) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%，中国证监会规定的特殊品种除外；

(10) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

(11) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

(12) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

(13) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；

(14) 开放期内，本基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；封闭期内，本基金资产总值不得超过基金资产净值的 200%；

(15) 开放期内，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合本条所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(16) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

(17) 法律法规及中国证监会规定的其他投资比例限制。

除上述第(2)、(12)、(15)、(16)项以外，因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合本基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

(1) 承销证券；

(2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；

(3) 从事承担无限责任的投资；

(4) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；

(5) 向其基金管理人、基金托管人出资；

(6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

(7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准。

（五）变更基金的收益与分配

变更注册前 变更注册后

基金收益与分配 三、基金收益分配原则

- 1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配 12 次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的 25%；若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；
- 2、本基金转为上市开放式基金（LOF）后，登记在登记结算系统的基金份额，收益分配方式为现金分红或红利再投资，登记在证券登记系统的基金份额收益分配方式为现金分红；
- 3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；
- 4、同一类别每一基金份额享有同等分配权；
- 5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规的规定且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。 三、基金收益分配原则

- 1、《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；
- 2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在登记结算系统的基金份额，投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。登记在证券登记系统的基金份额只能采取现金分红方式，基金份额持有人不能选择红利再投资；
- 3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；
- 4、同一类别每一基金份额享有同等分配权；
- 5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规的规定且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

（六）其他相关事项的修改

删除基金合同中关于基金份额发售的部分，并补充基金的历史沿革等内容。

基金管理人拟提请基金份额持有人大会授权基金管理人按照法律法规的规定及转型后的中信保诚惠泽 18 个月定期开放债券型证券投资基金的产品特征、根据基金份额持有人大会决议修订基金合同的其他内容。

三、转型前后的申购赎回安排

1、集中赎回选择期

自持有人大会表决通过后，本基金将安排不少于 20 个工作日的集中赎回选择期。在集中赎回选择期间，投资人仅可以申请赎回，不可以申请申购。

集中赎回选择期内，基金赎回费为 0。对持续持有期少于 7 日的投资者收取 1.5% 的赎回费。

集中赎回选择期结束后本基金管理人将对投资者未赎回的基金份额统一结转为中信保诚惠泽 18 个月定期开放债券型证券投资基金的基金份额。

具体集中赎回选择期安排以基金管理人的公告为准。

集中赎回选择期内，为确保投资者的赎回选择权，本基金豁免“投资于债券的比例不低于基金资产的 80%”的投资组合比例要求。

2、《中信保诚惠泽 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》的生效

自集中赎回选择期结束后，本基金管理人将根据持有人大会决议执行基金的正式转型，将原信诚惠泽债券型证券投资基金（LOF）结转后的基金份额结转为中信保诚惠泽 18 个月定期开放债券型证券投资基金的基金份额。

自基金份额转换基准日的下一个工作日起,《中信保诚惠泽 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》生效,《信诚惠泽债券型证券投资基金(LOF)基金合同》同时失效,信诚惠泽债券型证券投资基金(LOF)正式变更为中信保诚惠泽 18 个月定期开放债券型证券投资基金,本基金基金合同当事人将按照《中信保诚惠泽 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》享有权利并承担义务。

3、恢复申购和赎回开始日及业务办理时间

中信保诚惠泽 18 个月定期开放债券型证券投资基金(“本基金”)的封闭期为自《中信保诚惠泽 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》(“基金合同”)生效之日起(包括基金合同生效之日)或自每一开放期结束之日次日起(包括该日)18 个月的期间。本基金的首个封闭期为自基金合同生效之日起(包括基金合同生效之日)18 个月的期间,如果封闭期到期日的次日为非工作日的,封闭期相应顺延。首个封闭期结束之后第一个工作日起(包括该日)进入首个开放期,第二个封闭期为首个开放期结束之日次日起(包括该日)18 个月的期间,如果封闭期到期日的次日为非工作日的,封闭期相应顺延,以此类推。本基金封闭期内不办理申购与赎回业务,也不上市交易。

本基金自每个封闭期结束之后第一个工作日起(包括该日)进入开放期。投资人办理基金份额的申购和赎回等业务的开放日为本基金开放期的每个工作日。本基金每个开放期不少于 5 个工作日且不超过 20 个工作日,开放期的具体时间以基金管理人届时公告为准。

在不违反法律法规的前提下,基金管理人可以对封闭期和开放期的设置规则进行调整,并提前公告。

四、合规、运营可行性

(一) 法律方面

转型后的中信保诚惠泽 18 个月定期开放债券型证券投资基金相关的法律文件经中国证监会变更注册后,基金管理人择时召集基金份额持有人大会。依据《信诚惠泽债券型证券投资基金(LOF)基金合同》和《基金法》的规定,本次信诚惠泽债券型证券投资基金(LOF)转型应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方可做出。因此,信诚惠泽债券型证券投资基金(LOF)的转型不存在法律障碍。

(二) 技术运作方面

自集中赎回选择期结束之日的次日起,《信诚惠泽债券型证券投资基金(LOF)基金合同》终止,《中信保诚惠泽 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》生效。

为实现基金转型的平稳过渡,本基金管理人已就基金变更有关的会计处理、登记、系统准备等方面进行了深入研究,做好了基金运作的相关准备。会计师事务所将继续为转型后的基金提供服务,律师事务所将出具法律意见书,报中国证监会备案并公告。

五、基金转型的主要风险及预备措施

(一) 转型方案被持有人大会否决的风险

为防范转型方案被基金份额持有人大会否决的风险,基金管理人将提前向基金份额持有人征询意见。如有必要,基金管理人将根据基金份额持有人意见,对转型方案进行适当的修订,并重新公告。基金管理人可在必要情况下,推迟基金份额持有人大会的召开时间。

如果议案未获得持有人大会的批准,基金管理人将按照有关规定重新向持有人大会提交转型方案议案。

(二) 基金集中赎回选择期遭遇大规模赎回的风险

为应对集中赎回选择期遭遇大规模赎回,基金在集中赎回选择期间将尽可能保证投资组合的流动性,应对集中赎回选择期可能出现的较大规模赎回,降低净值波动率。

六、基金管理人联系方式

基金份额持有人若对本方案的内容有任何意见和建议,请通过以下方式联系

基金管理人:中信保诚基金管理有限公司

客服电话:400-666-0066

公司网站: www.citicprufunds.com

中信保诚基金管理有限公司

2018 年 7 月 31 日