

信诚理财 28 日盈债券型证券投资基金  
2020 年第二季度报告

2020 年 06 月 30 日

基金管理人：中信保诚基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2020 年 07 月 21 日

## § 1 重要提示

基金管理人的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，并对其内容的真实性、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本基金合同规定，于 2020 年 07 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 04 月 01 日起至 2020 年 06 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	信诚 28 日盈
基金主代码	000134
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 05 月 25 日
报告期末基金份额总额	7,514,566,260.87 份
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。
投资策略	<p>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。</p> <p>1、整体资产配置策略</p> <p>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。</p> <p>2、类属配置策略</p> <p>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</p>

	<p>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。</p> <p>3、个券选择策略</p> <p>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离的原因。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。此外,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。</p> <p>4、现金流管理策略</p> <p>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购赎回情况、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优先的原则下,综合平衡基金资产在流动性资产和收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整体的流动性,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。</p> <p>5、套利策略</p> <p>由于市场环境差异、交易市场分割、市场参与者差异,以及资金供求失衡导致的中短期利率异常差异,使得债券现券市场上存在着套利机会。本基金通过分析货币市场变动趋势、各市场和品种之间的风险收益差异,把握无风险套利机会,包括银行间和交易所市场出现的跨市场套利机会、在充分论证套利可行性的基础上的跨期限套利等。无风险套利主要包括银行间市场、交易所市场的跨市场套利和同一交易市场中不同品种的跨品种套利。基金管理人将在保证基金的安全性和流动性的前提下,适当参与市场的套利,捕捉和把握无风险套利机会,进行跨市场、跨品种操作,以期获得安全的超额收益。</p>
业绩比较基准	活期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的低风险品种,其预期风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票

	型基金。	
基金管理人	中信保诚基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	信诚 28 日盈 A	信诚 28 日盈 B
下属分级基金的交易代码	000134	000135
报告期末下属分级基金的份额总额	6,563,398.83 份	7,508,002,862.04 份
下属分级基金的风险收益特征	-	-

注：本基金管理人法定名称于 2017 年 12 月 18 日起变更为“中信保诚基金管理有限公司”。

本基金管理人已于 2017 年 12 月 20 日在中国证监会指定媒介以及公司网站上刊登了公司法定名称变更的公告。

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2020 年 04 月 01 日-2020 年 06 月 30 日）	
	信诚 28 日盈 A	信诚 28 日盈 B
1. 本期已实现收益	37,064.93	47,803,588.59
2. 本期利润	31,923.18	42,284,502.52
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0045	0.0053
4. 期末基金资产净值	6,559,858.96	7,504,397,541.46
5. 期末基金份额净值	0.9995	0.9995

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、根据《中信保诚基金管理有限公司关于信诚理财 28 日盈债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金转型选择期时间为自 2020 年 6 月 23 日起至 2020 年 7 月 22 日止，转型选择期间，为公平对待所有投资者，本基金将采用市值法进行估值，基金份额净值不再保持在人民币 1.00 元，改为采用浮动基金份额净值。本基金 2020 年 4 月 1 日至 2020 年 6 月 22 日采用摊余成本法估值。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

信诚 28 日盈 A:

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
过去三个月	0.46%	0.02%	0.09%	0.00%	0.37%	0.02%
过去六个月	1.09%	0.02%	0.17%	0.00%	0.92%	0.02%
过去一年	2.51%	0.01%	0.35%	0.00%	2.16%	0.01%
过去三年	10.21%	0.01%	1.05%	0.00%	9.16%	0.01%
自基金合同生效起至	10.64%	0.01%	1.09%	0.00%	9.55%	0.01%

今						
---	--	--	--	--	--	--

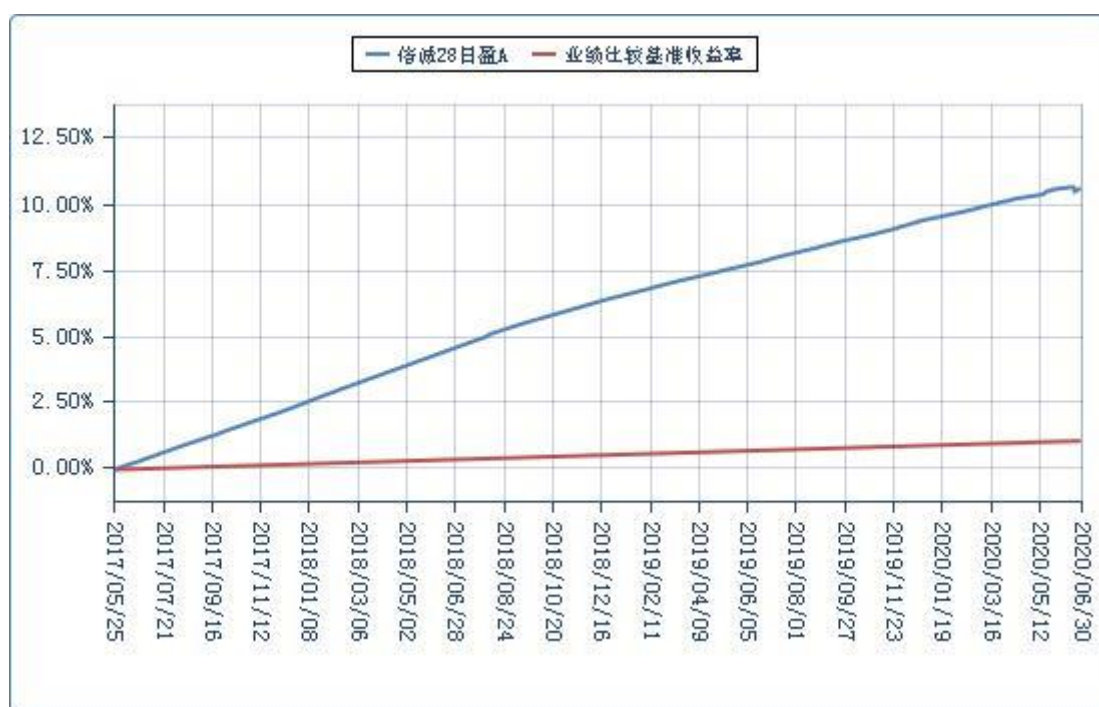
信诚 28 日盈 B:

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
过去三个月	0.53%	0.02%	0.09%	0.00%	0.44%	0.02%
过去六个月	1.23%	0.02%	0.17%	0.00%	1.06%	0.02%
过去一年	2.80%	0.01%	0.35%	0.00%	2.45%	0.01%
过去三年	11.17%	0.01%	1.05%	0.00%	10.12%	0.01%
自基金合同生效起至今	11.64%	0.01%	1.09%	0.00%	10.55%	0.01%

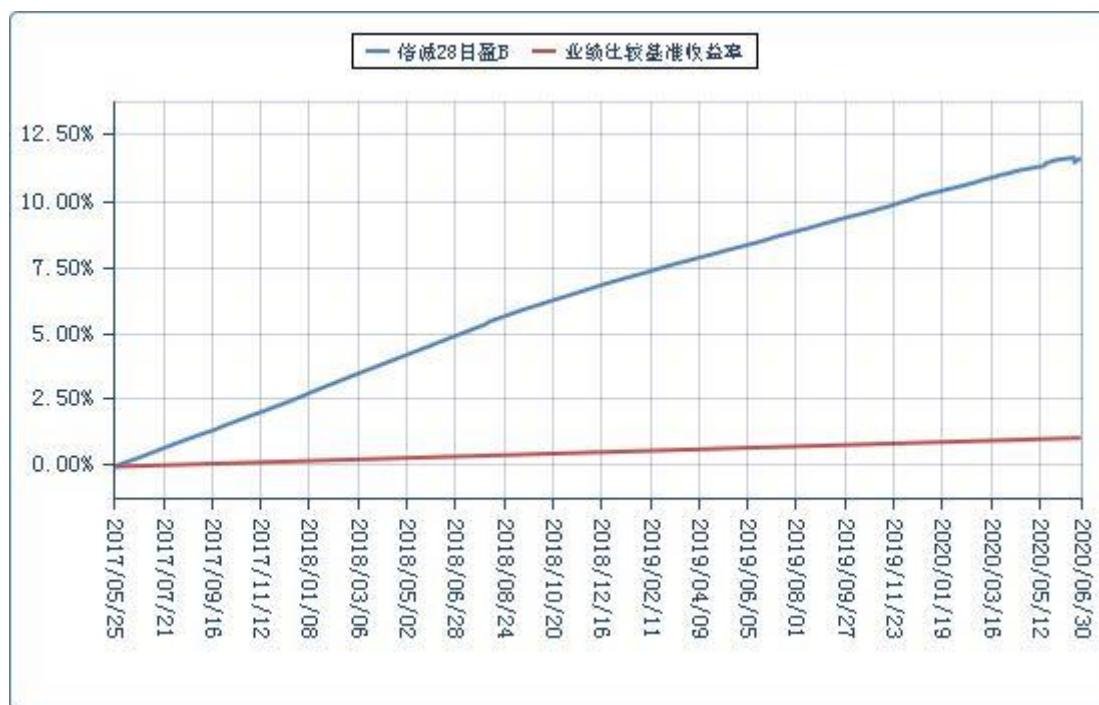
注：根据《中信保诚基金管理有限公司关于信诚理财 28 日盈债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金转型选择期时间为自 2020 年 6 月 23 日起至 2020 年 7 月 22 日止，转型选择期间，为公平对待所有投资者，本基金将采用市值法进行估值，基金份额净值不再保持在人民币 1.00 元，改为采用浮动基金份额净值。本基金自成立日起至 2020 年 6 月 22 日采用摊余成本法估值。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

信诚 28 日盈 A:



信诚 28 日盈 B:



注：根据《中信保诚基金管理有限公司关于信诚理财 28 日盈债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金转型选择期时间为自 2020 年 6 月 23 日起至 2020 年 7 月 22 日止，转型选择期间，为公平对待所有投资者，本基金将采用市值法进行估值，基金份额净值不再保持在人民币 1.00 元，改为采用浮动基金份额净值。本基金自成立日起至 2020 年 6 月 22 日采用摊余成本法估值。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴胤希	本基金基金经理，兼任中信保诚嘉鑫 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中信保诚稳达债券型证券投资基金、中信保诚景丰债券型证券投资基金、信诚年年有余定期开放债券型证券投资基金、信诚优质纯债债券型证券投资基金、中信保诚嘉裕五年定期开放债券型证券投资基金、中信保诚嘉丰一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中信保诚中债 1-3 年国开行债券	2018 年 05 月 31 日	-	4	理学硕士。曾任职于远东国际租赁有限公司，担任投资分析师；于 Excel Markets 担任外汇交易员；于重庆农村商业银行股份有限公司，担任债券交易员。2016 年 7 月加入中信保诚基金管理有限公司。现任中信保诚嘉鑫 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、信诚理财 28 日盈债券型证券投资基金、中信保诚稳达债券型证券投资基金、中信保诚景丰债券型证券投资

	指数证券投资基金的基金经理。			基金、信诚年年有余定期开放债券型证券投资基金、信诚优质纯债债券型证券投资基金、中信保诚嘉裕五年定期开放债券型证券投资基金、中信保诚嘉丰一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中信保诚中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金的基金经理。
--	----------------	--	--	---

注：1. 上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内, 本基金管理人严格按照《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《信诚理财 28 日盈债券型证券投资基金基金合同》、《信诚理财 28 日盈债券型证券投资基金招募说明书》的约定, 本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金财产。本基金管理人通过不断完善法人治理结构和内部控制制度, 加强内部管理, 规范基金运作。本报告期内, 基金运作合法合规, 没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》, 以及公司拟定的《信诚基金公平交易管理制度》, 公司采取了一系列的行动实际落实公平交易管理的各项要求。各部门在公平交易执行中各司其职, 投资研究前端不断完善研究方法和投资决策流程, 确保各投资组合享有公平的投资决策机会, 建立公平交易的制度环境; 交易环节加强交易执行的内部控制, 利用恒生交易系统公平交易相关程序, 及其它的流程控制, 确保不同基金在一、二级市场对同一证券交易时的公平; 公司同时不断完善和改进公平交易分析系统, 在事后加以了严格的行为监控, 分析评估以及报告与信息披露。当期公司整体公平交易制度执行情况良好, 未发现有违背公平交易的相关情况。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内, 未发现本基金与其它投资组合之间有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。报告期内, 未出现参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的交易 (完全复制的指数基金除外)。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

央行货币政策的微调, 成为二季度影响债市走势的主线。货币政策经历了从极度宽松到略微收敛的回调, 二季度债券的收益率也是先下后上。

4 月份, 央行定向降准 1% 并下调超储利率至 0.35%。短端资金极度宽松, DR001 加权利率创近 10 年新低。短端利率大幅下行近 80bp, 长端利率下行 20bp 左右, 牛陡行情极致演绎。5 月份, 宏观基本面呈现经济反弹、货币边际收紧、信用宽松发力的组合。复产复工全面推进, 经济数据环比持续反弹; 同时天量债券供给, 叠加央行连续 37 个交易日暂停逆回购, 资金利率大幅反弹至政策利率附近; 社融增速也快速反弹。长端利率大幅反弹 35bp 左右, 短端上行超 90bp, 出现熊平行行情。6 月份, 利率再次上行。财政部宣布近两月 1 万亿特别国债市场化发行, 央行缩量续作 MLF, OMO 利率维持不变。除特别国债外, 一级市场招标利率持续高于二级利率, 6 月 23 日国开招标将短期观望情绪推向极致, 利率大幅上行 15bp 左右。

信诚理财 28 日盈债券型证券投资基金在 2 季度开始转型, 6 月末开始转型成为债基。目前利率债占比 81.5%, 信用债占比 23.7%, 总资产久期 1.57 年, 策略较为中性。我们将继续坚持在保障基金资产本金安全和流动性的前提下为持有人争取有竞争力的收益。

展望三季度，由于收益率快速上行，已较大程度反应了市场对货币政策和基本面的预期。后续收益率还是有下行的机会。一方面，政策力度边际收敛后，消费和制造业投资等内生性经济活动恢复速度可能有所减慢，7 月前后的经济基本面恢复进度可能不及预期；另一方面，7-8 月将有接近 900 万高校毕业生进入劳动力市场，考虑到经济基本面大概率不会复原，就业市场将面临比往年更大的压力，调查失业率很可能出现更明显的季节性提升。如果 7 月调查失业率升至 6.2% 甚至更高，则货币政策可能在 8 月左右再加码。

利率策略方面，适度控制久期，灵活交易。短期来看，股市火爆从资金分流、风险偏好等方面对债市形成压制，但考虑到债市累计调整幅度已经不小，部分利空已逐步消化，尤其是对货币政策的宽松预期明显收敛，预计利率在目前水平以震荡为主，虽然不至于出现大幅度调整，但也较难回到前期的低位，中短端安全边际好于长端。

信用策略方面，坚持票息策略。年初以来中高等级信用利差明显走阔，信用债的票息优势明显提升。同时，理财、广义基金等对信用债的刚性配置力量较强，信用债利率波动的风险相对更小。考虑到下半年随着疫情冲击逐步缓解，经济向常态逐步回归，企业经营状况将有所修复，适度关注城投、地产下沉，挖掘经营及融资修复的产业债，关注 abs、永续债等小品种局部机会。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，信诚 28 日盈 A 份额净值增长率为 0.46%，同期业绩比较基准收益率为 0.09%；信诚 28 日盈 B 份额净值增长率为 0.53%，同期业绩比较基准收益率为 0.09%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金未出现连续 20 个工作日基金资产净值低于五千万元（基金份额持有人数量不满二百人）的情形。

### § 5 投资组合报告

#### 5.1 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	固定收益投资	7,335,255,000.00	97.63
	其中：债券	7,335,255,000.00	97.63
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	29,800,254.90	0.40
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	35,481,226.17	0.47
4	其他资产	113,121,632.54	1.51
5	合计	7,513,658,113.61	100.00

#### 5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额（元）	占基金资产净值的比例（%）
1	报告期内债券回购融资余额	-	0.51
	其中：买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

#### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

根据法规规定，货币市场基金债券正回购的资金余额不得超过基金资产净值的 20%，本基金为债券型基金，不适用上述规定，本基金在本报告期内操作未违反基金合同约定及监管要求。



### 5.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	537
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	538
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	23

注：本基金合同约定，本基金管理人将动态确定并控制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。根据《中信保诚基金管理有限公司关于信诚理财 28 日盈债券型证券投资基金基金  
份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金转型选择期时间为自 2020 年 6 月 23 日起至 2020 年  
7 月 22 日止，转型选择期间，为确保投资者的赎回选择权，本基金豁免相关投资组合比例及限制要求。

#### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

序号	发生日期	平均剩余期限	原因	调整期
1	2020 年 06 月 23 日	386	-	-
2	2020 年 06 月 24 日	385	-	-
3	2020 年 06 月 28 日	382	-	-
4	2020 年 06 月 29 日	538	-	-
5	2020 年 06 月 30 日	537	-	-

注：根据《中信保诚基金管理有限公司关于信诚理财 28 日盈债券型证券投资基金基金份额持有人大会表  
决结果暨决议生效的公告》，本基金转型选择期时间为自 2020 年 6 月 23 日起至 2020 年 7 月 22 日止，转  
型选择期间，为确保投资者的赎回选择权，本基金豁免相关投资组合比例及限制要求。

#### 5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值 的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值 的比例 (%)
1	30 天以内	4.23	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利 率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	2.14	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利 率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	2.00	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利 率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	2.01	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利 率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	33.51	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利 率债	-	-
	合计	43.89	-

#### 5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

序号	发生日期	平均剩余存续期	原因	调整期
----	------	---------	----	-----

1	2020 年 06 月 23 日	386	-	-
2	2020 年 06 月 24 日	385	-	-
3	2020 年 06 月 28 日	382	-	-
4	2020 年 06 月 29 日	538	-	-
5	2020 年 06 月 30 日	537	-	-

注：根据《中信保诚基金管理有限公司关于信诚理财 28 日盈债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金转型选择期时间为自 2020 年 6 月 23 日起至 2020 年 7 月 22 日止，转型选择期间，为确保投资者的赎回选择权，本基金豁免相关投资组合比例及限制要求。

#### 5.5 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	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	5,218,637,500.00	69.48
	其中：政策性金融债	4,254,892,500.00	56.65
4	企业债券	175,633,500.00	2.34
5	企业短期融资券	571,536,000.00	7.61
6	中期票据	101,208,000.00	1.35
7	同业存单	1,268,240,000.00	16.89
8	其他	-	-
9	合计	7,335,255,000.00	97.66
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量 (张)	公允价值 (人民币元)	占基金资产净值比例 (%)
1	180413	18 农发 13	10,700,000	1,090,544,000.00	14.52
2	170206	17 国开 06	6,200,000	635,686,000.00	8.46
3	160218	16 国开 18	4,900,000	496,664,000.00	6.61
4	112014007	20 江苏银行 CD007	5,000,000	487,250,000.00	6.49
5	1820023	18 徽商银行绿色金融 01	4,000,000	407,040,000.00	5.42
6	1928005	19 浦发银行小微债 01	3,000,000	304,410,000.00	4.05
7	112092275	20 广州农村商业银行 CD009	3,000,000	292,500,000.00	3.89
8	160316	16 进出 16	2,600,000	262,964,000.00	3.50
9	150221	15 国开 21	2,500,000	255,050,000.00	3.40
10	170409	17 农发 09	2,300,000	236,256,000.00	3.15

## 5.7 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。

## 5.8 投资组合报告附注

### 5.8.1 基金计价方法说明

根据《中信保诚基金管理有限公司关于信诚理财 28 日盈债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金转型选择期时间为自 2020 年 6 月 23 日起至 2020 年 7 月 22 日止，转型选择期间，为公平对待所有投资者，本基金将采用市值法进行估值。基金份额净值不再保持在人民币 1.00 元，改为采用浮动基金份额净值

自转型选择期结束之日后的第 2 个工作日起，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，将原信诚理财 28 日盈债券型证券投资基金的 A 类/B 类基金份额结转为中信保诚嘉鸿债券型证券投资基金的 A 类基金份额。

### 5.8.2 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚说明

广州农村商业银行股份有限公司于 2019 年 7 月 29 日、2019 年 10 月 25 日分别收到广东银保监局的处罚（粤银保监罚决字[2019]46 号、粤银保监罚决字[2019]54 号），广州农商行因贷后管理不尽职导致贷款被挪用、违规向客户收取服务费被广东银保监局分别罚款 50 万元、65 万元。广州农村商业银行股份有限公司于 2020 年 4 月 21 日收到中国证监会采取出具警示函监管措施的决定，广州农商行因在申请首次公开发行股票并上市过程中，存在部分金融资产减值准备计提不充分、个别违约债券会计核算前后不一致等问题被中国证监会采取出具警示函的行政监管措施。

对“20 广州农村商业银行 CD009”的投资决策程序的说明：本基金管理人定期回顾、长期跟踪研究该投资标的的信用资质，我们认为，该处罚事项未对广州农村商业银行的长期企业经营和投资价值产生实质性影响。我们对该投资标的的投资严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

除此之外，其余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。

### 5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	113,121,632.54
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	113,121,632.54

### 5.8.4 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。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	信诚 28 日盈 A	信诚 28 日盈 B
报告期期初基金份额总额	7,709,703.52	7,587,018,794.44
报告期期间基金总申购份额	201,585.22	7,546,356,657.42

减：报告期期间基金总赎回份额	1,347,889.91	7,625,372,589.82
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	6,563,398.83	7,508,002,862.04

### § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

#### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

#### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

### § 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

无

### § 9 影响投资者决策的其他重要信息

#### 9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2020-04-01 至 2020-06-03	7,575,526,819.78	29,845,962.74	7,605,372,782.52	-	-
	2	2020-06-01 至 2020-06-30	-	7,508,002,862.04	-	7,508,002,862.04	99.91%
个人							

#### 产品特有风险

本基金如果出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%，则面临大额赎回的情况，可能导致：

(1) 基金在短期内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20% 的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

(2) 基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基

金的投资运作和收益水平；

(3) 因基金净值精度计算问题, 或因赎回费收入归基金资产, 导致基金净值出现较大波动；

(4) 基金资产规模过小, 可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；

(5) 大额赎回导致基金资产规模过小, 不能满足存续的条件, 基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

## 9.2 影响投资者决策的其他重要信息

2020 年 6 月 22 日, 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以现场方式召开, 大会讨论通过了信诚理财 28 日盈债券型证券投资基金转型并修改基金合同的议案, 主要内容包括改为采用浮动基金份额净值、调整基金运作方式、投资范围和限制、投资策略、投资目标、业绩比较基准、基金费用、收益分配方式、估值方法、调整基金份额分类、增加自动清盘条款等, 并同意将“信诚理财 28 日盈债券型证券投资基金”更名为“中信保诚嘉鸿债券型证券投资基金”, 上述基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。自持有人大会表决通过后, 本基金将进入转型选择期, 转型选择期时间为自 2020 年 6 月 23 日起至 2020 年 7 月 22 日止。

## § 10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

- 1、信诚理财 28 日盈债券型证券投资基金相关批准文件
- 2、中信保诚基金管理有限公司营业执照
- 3、信诚理财 28 日盈债券型证券投资基金基金合同
- 4、信诚理财 28 日盈债券型证券投资基金招募说明书
- 5、本报告期内按照规定披露的各项公告

### 10.2 存放地点

中信保诚基金管理有限公司办公地—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。

### 10.3 查阅方式

投资者可在营业时间至公司办公地点免费查阅, 也可按工本费购买复印件。

亦可通过公司网站查阅, 公司网址为 [www.citicprufunds.com.cn](http://www.citicprufunds.com.cn)。

中信保诚基金管理有限公司

2020 年 07 月 21 日