

中信保诚基金管理有限公司关于信诚双盈债券型证券投资基金(LOF)修订基金合同、托管协议部分条款及调整赎回费相关规则的公告

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称《流动性风险管理规定》)及基金合同和托管协议的有关规定,经与基金托管人协商一致并报监管机构备案,中信保诚基金管理有限公司决定对信诚双盈债券型证券投资基金(LOF)(以下简称本基金)的基金合同、托管协议进行修订,并对本基金赎回费相关规则进行调整。现将相关事宜公告如下:

一、基金合同和托管协议修订

基金合同、托管协议具体修订内容详见附件《信诚双盈债券型证券投资基金(LOF)基金合同和托管协议修改对照表》。本次修订属于基金合同约定的基金管理人与基金托管人可以协商一致变更基金合同的事项,并已履行规定程序,符合相关法律法规及基金合同的规定。

二、赎回费相关规则调整

鉴于《流动性风险管理规定》规定“基金管理人应当强化对投资者短期投资行为的管理,对除货币市场基金与交易型开放式指数基金以外的开放式基金,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,并将上述赎回费全额计入基金财产”,基金管理人将本基金持续持有期少于7日(不含)对应的赎回费率调整为1.5%,上述对投资者收取的赎回费计入基金财产的比例调整为100%(转换业务涉及的本基金赎回费相关规则按上述规则进行调整)。

三、上述基金合同、托管协议的修订及赎回费相关规则调整等事宜自2018年3月31日起生效。对于2018年3月30日15:00之前的赎回申请,适用调整前的赎回费规则;对于2018年3月30日15:00之后的赎回申请,适用调整后的赎回费规则。基金管理人将在届时更新本基金招募说明书时一并更新相关内容。

四、投资者可通过以下途径了解或咨询详请:

中信保诚基金管理有限公司

公司网址: www.citicprufunds.com.cn

客服电话: 400-666-0066

五、风险提示

(1) 本次基金管理人系根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修订本基金的《基金合同》和《托管协议》,所修订内容可能对本基金投资运作及投资者办理

基金申购、赎回业务产生一定影响，包括且不限于：出于流动性风险管理需要增加或调整了基金的部分投资限制规定；对投资者持有本基金少于7日（不含）收取1.5%的短期赎回费；在规定的特定情形下可能会对投资者的申购/赎回申请数量进行限制、临时拒绝或暂停申购/赎回申请、对部分赎回申请进行延期办理等，由此可能导致投资者的申购/赎回申请无法全部及时处理，从而可能影响投资者的资金安排及投资计划。敬请投资者关注以上变化和影响，并仔细阅读本基金修订后的基金合同及相关法律文件，审慎进行投资决策。

(2) 本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财产，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，投资者投资于基金前应认真阅读本基金的基金合同、招募说明书等文件。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

附件：《信诚双盈债券型证券投资基金（LOF）基金合同和托管协议修改对照表》

中信保诚基金管理有限公司

2018年3月24日

附件：

信诚双盈债券型证券投资基金（LOF）基金合同和托管协议

修改对照表

一、 基金合同主要修订内容

章节	修订内容
前言	增加： “《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称《流动性风险管理规定》）”的表述
释义	增加： “《流动性风险管理规定》：指中国证监会2017年8月31日发布并于2017年10月1日实施的《流动性风险管理规定》及不时作出的修订；”
释义	增加： “流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在10个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等；”
基金份额的申购与赎回	“（二）基金合同生效后3年期届满并进行基金份额转换后的申购与赎回”之“4、申购与赎回的程序”中，增加： “（3）当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。具体请参见相关公告。”
基金份额的申购与赎回	“（二）基金合同生效后3年期届满并进行基金份额转换后的申购与赎回”之“5、申购与赎回的费用及其用途”中， “1）本基金申购费率最高不超过申购金额的5%，赎回费率最高不超过赎回金额的5%。”中增加“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。” “4）本基金的申购费用由申购人承担，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金财产。 本基金的赎回费用由基金份额持有人承担，其中不低于25%的部分归入基金财产，其余部分用于支付注册登记等相关手续费。”中增加“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，”
基金份额的申购与赎回	“（二）基金合同生效后3年期届满并进行基金份额转换后的申购与赎回”之“7、巨额赎回的认定及处理方式”中，增加： “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）接受全额赎回”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。”
基金份	“（二）基金合同生效后3年期届满并进行基金份额转换后的申购与赎回”之“8、拒

额的申购与赎回	<p>绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理”中，增加：</p> <p>“（6）当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金申购申请；</p> <p>（7）基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形时；”</p>
基金份额的申购与赎回	<p>“（二）基金合同生效后 3 年期届满并进行基金份额转换后的申购与赎回”之“8、拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理”中，</p> <p>“（6）法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。</p> <p>基金管理人决定拒绝或暂停接受某些投资人的申购申请时，申购款项将退回投资人账户。发生上述（1）-（4）、（6）项暂停申购情形时且基金管理人决定暂停接受申购申请时，应当依法公告。在暂停申购的情形消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理并依法公告。”修改为“（8）法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。</p> <p>基金管理人决定拒绝或暂停接受某些投资人的申购申请时，申购款项将相应退回投资人账户。发生上述（1）-（4）、（6）、（8）项暂停申购情形时且基金管理人决定暂停接受申购申请时，应当依法公告。在暂停申购的情形消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理并依法公告。”</p>
基金份额的申购与赎回	<p>“（二）基金合同生效后 3 年期届满并进行基金份额转换后的申购与赎回”之“2）暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理”中，增加：</p> <p>“（5）当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请；”</p>
基金合同当事人及其权利义务	<p>“二、基金托管人”之“1、基金托管人基本情况”中，</p> <p>“注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整”修改为：</p> <p>“注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整”</p>
基金的投资	<p>“（二）投资范围和投资比例”中，</p> <p>“本基金投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。当法律法规的相关规定变更时，基金管理人在履行适当程序后可对上述资产配置比例进行适当调整。”增加：</p> <p>“其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。”</p>
基金的投资	<p>“（六）投资禁止行为与限制”之“2、基金投资组合比例限制”中，</p> <p>“（2）本基金与基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和，不超过该证券的 10%；”中增加“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股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 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股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 30%；”</p> <p>“（5）本基金投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。”中增加“其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。”</p> <p>增加：</p> <p>“（11）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；</p> <p>（12）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</p>

	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；”
基金的投资	<p>“（七）投资组合比例调整”中，</p> <p>“基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在十个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。”修改为：</p> <p>“基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。除上述第（5）、（11）、（12）项以外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在十个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。”</p>
基金资产估值	<p>“（六）暂停估值的情形”中，增加：</p> <p>“3、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值；”</p>
基金资产估值	<p>“（六）暂停估值的情形”中：</p> <p>“3、中国证监会认定的其他情形。”修改为：</p> <p>“4、法律法规、中国证监会认定的其他情形。”</p>
基金的信息披露	<p>“（六）定期报告”中，增加：</p> <p>“4、报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20%的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告文件中“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特定风险。中国证监会认定的特殊情形除外。</p> <p>本基金持续运作过程中，应当在基金年度报告和半年度报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。”</p>
基金的信息披露	<p>“（七）临时报告与公告”中，增加：</p> <p>“32、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资人赎回等重大事项时；”</p>

二、 基金托管协议主要修订内容

章节	修订内容
一、托管协议当事人	<p>“（二）基金托管人（或简称“托管人”）”中，</p> <p>“注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整”修改为：</p> <p>“注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整”</p>
二、托管协议的依据、目的、原则和解释	<p>“（一）依据”中，增加：</p> <p>“……、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》”</p>
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	<p>在“（一）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面：”之“2、对基金投融资比例进行监督：”中，</p> <p>“（2）本基金投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。”中增加“其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购</p>

	<p>款等。”</p> <p>增加：</p> <p>“（10）本基金管理人管理的且由本托管人托管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且由本托管人托管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%；</p> <p>（11）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；</p> <p>（12）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；本基金管理人承诺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与本基金合同约定的投资范围保持一致，并承担由于不一致所导致的风险或损失；”</p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>	<p>在“（一）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面：”之“2、对基金投融资比例进行监督：”中，</p> <p>“（10）法律法规规定的其他限制。</p> <p>基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在十个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。”修改为：</p> <p>“（13）法律法规规定的其他限制。</p> <p>基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。除上述第（2）、（11）、（12）项以外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在十个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。”</p>