

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修订基金合同、托管协议部分条款的公告

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《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理财28日盈债券型证券投资基金（以下简称本基金）的基金合同、托管协议进行修订。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《信诚理财 28 日盈债券型证券投资基金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、上述基金合同、托管协议的修订自2018年3月31日起生效。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。

三、其他事项

1. 投资者可通过以下途径咨询有关详情

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

2. 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；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）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。销售机构根据法规要求对投资者类别、风险承受能力和基

金的风险等级进行划分，并提出适当性匹配意见。投资者在投资基金前应认真阅读《基金合同》和《招募说明书》等基金法律文件，全面认识基金产品的风险收益特征，在了解产品情况及听取销售机构适当性意见的基础上，根据自身的风险承受能力、投资期限和投资目标，对基金投资作出独立决策，选择合适的基金产品。

特此公告。

附件：《信诚理财 28 日盈债券型证券投资基金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：

信诚理财 28 日盈债券型证券投资基金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
全文	“信诚基金管理有限公司”修改为“中信保诚基金管理有限公司”
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《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及发布机关对其不时做出的修订；”
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、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	“（五）申购与赎回的数额限制”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	“（八）拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理”之“1、在出现或可能出现

额的申购与赎回	如下情况时，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资人的申购申请：”中，增加：“（7）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；”
基金份额的申购与赎回	“（八）拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理”之“1、在出现或可能出现如下情况时，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资人的申购申请：”中， “（7）法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。 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）、（7）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。 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）、（7）、（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。”
基金份额的申购与赎回	“（八）拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理”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： “（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；”
基金份额的申购与赎回	“（九）巨额赎回的认定及处理方式”之“2、巨额赎回的处理方式”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。”
基金合同当事人及其权利义务	“（一）基金管理人”之“1、基金管理人基本情况”中， “住所：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 9 层”修改为： “住所：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”
基金合同当事人及其权利义务	“（二）基金托管人”之“1、基金托管人基本情况”中， “法定代表人：田国立”修改为： “法定代表人：陈四清” “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： “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”
基金的投资	“（六）投资禁止行为与限制”之“2、基金投资组合比例限制”中，增加： “10）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、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； 11)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；”
基金的投资	“（六）投资禁止行为与限制”之“2、基金投资组合比例限制”中， “10）中国证监会规定的其他比例限制。 因基金规模或市场变化导致本基金投资组合不符合以上比例限制的，基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到上述标准，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定时，从其规定。”修改为： “12）中国证监会规定的其他比例限制。 除上述第 10）、11）项以外，因基金规模或市场变化导致本基金投资组合不符合以上比例限制的，基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到上述标准，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定时，从其规定。”
基金资产估值	“（六）暂停估值的情形”中，增加： “4、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；”
基金的信息披露	“（五）定期报告”中， “报告期内出现单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情形，基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告文件中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产品的特有风险。” 修改为：“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。” 增加： “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。”
基金的信息披露	“（六）临时报告与公告”中，增加： “27、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；”

二、 基金托管协议主要修订内容

章节	修订内容
全文	“信诚基金管理有限公司”修改为： “中信保诚基金管理有限公司”
一、托管协议当事人	“（一）基金管理人（或简称“管理人”）”中， “住所：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 9 层”修改为： “住所：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”
一、托管协议当事人	“（二）基金托管人（或简称“托管人”）”中， “法定代表人：田国立”修改为： “法定代表人：陈四清”

	<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，增加：</p> <p>“10）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、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>11）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>
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>“10）中国证监会规定的其他比例限制。</p> <p>因基金规模或市场变化导致本基金投资组合不符合以上比例限制的，基金管理人应在10个交易日内进行调整，以达到上述标准，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定时，从其规定。”修改为：</p> <p>“12）中国证监会规定的其他比例限制。</p> <p>除上述第10）、11）项以外，因基金规模或市场变化导致本基金投资组合不符合以上比例限制的，基金管理人应在10个交易日内进行调整，以达到上述标准，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定时，从其规定。”</p>