

中信保诚基金管理有限公司关于信诚货币市场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《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货币市场证券投资基金（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《关于根据〈公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定〉修改信诚货币市场证券投资基金基金合同的内容说明》、《关于根据〈公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定〉修改信诚货币市场证券投资基金托管协议的内容说明》。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、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

四、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）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：《关于根据〈公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定〉修改信诚货币市场证券投资基金基金合同的内容说明》、《关于根据〈公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定〉修改信诚货币市场证券投资基金托管协议的内容说明》

中信保诚基金管理有限公司

2018年3月24日

附件：

关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》 修改信诚货币市场证券投资基金基金合同的内容说明

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： “13. 《流动性风险管理规定》：指中国证监会 2017 年 8 月 31 日发布、同年 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： “14. 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）、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	“（五）申购和赎回的金额”中，增加： “4、基金管理人可以依照相关法律法规以及基金合同的约定，在特定市场条件下暂停或者拒绝接受一定金额以上的资金申购，具体以基金管理人的公告为准。 5、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	<p>“（六）申购和赎回的价格、费用及其用途”中</p> <p>原文“4. 本基金的申购费率和赎回费率均为0%。本基金的申购费率、申购份额具体的计算方法、赎回费率、赎回金额具体的计算方法和收费方式由基金管理人根据基金合同的规定确定，并在招募说明书中列示。”</p> <p>修改为：“4. 通常情况下，本基金的申购费率和赎回费率均为0%。本基金的申购费率、申购份额具体的计算方法、赎回费率、赎回金额具体的计算方法和收费方式由基金管理人根据基金合同的规定确定，并在招募说明书中列示。</p> <p>本基金在一般情况下不收取申购费用和赎回费用，但是当本基金前10名基金份额持有人的持有份额合计超过基金总份额50%，且本基金投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计低于10%且偏离度为负时，为确保基金平稳运作，避免诱发系统性风险，对当日单个基金份额持有人申请赎回基金份额超过基金总份额的1%以上的赎回申请（超过基金总份额1%以上的部分）征收1%的强制赎回费用，并将上述赎回费用全额计入基金资产。基金管理人与基金托管人协商确认上述做法无益于基金利益最大化的情形除外。”</p>
基金份 额的申 购与赎 回	<p>“（七）拒绝或暂停申购的情形”中，</p> <p>将“4. 基金管理人合理判断认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。”修改为“4. 基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益或对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时。”</p> <p>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>“（七）拒绝或暂停申购的情形”</p> <p>原文“发生上述情形时且基金管理人决定拒绝或暂停申购的，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。”</p> <p>补充修改为：“发生上述第1、2、3、5、6、8项情形时且基金管理人决定拒绝或暂停申购的，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。”</p>
基金份 额的申 购与赎 回	<p>“（八）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形”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>
基金份 额的申 购与赎 回	<p>“（九）巨额赎回的情形及处理方式”之“2、巨额赎回的处理方式”中，增加：</p> <p>“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</p>

	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。”
基金合同当事人及权利义务	<p>“（二）基金托管人”中，补充修改为： 原文“法定代表人：王洪章” 补充修改为：“法定代表人：田国立” “注册资本：叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元”修改为“注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整”</p>
基金的投资	<p>“（六）投资限制”之“2. 本基金的投资组合将遵循以下比例限制”中增加： “（10）本基金管理人管理的全部货币市场基金投资于同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券，不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的 10%； （11）当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 50%时，本基金投资组合的平均剩余期限不得超过 60 天，平均剩余存续期不得超过 120 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 30%； （12）当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 20%时，本基金投资组合的平均剩余期限不得超过 90 天，平均剩余存续期不得超过 180 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 20%； （13）本基金投资于主体信用评级低于 AAA 的机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 10%，其中单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 2%；前述金融工具包括债券、非金融企业债务融资工具、银行存款、同业存单、相关机构作为原始权益人的资产支持证券及中国证监会认定的其他品种； （14）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 10%。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； （15）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本基金合同约定的投资范围保持一致；”</p> <p>将原文： “除上述第(9)条外，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。法律法规另有规定时，从其规定。” 修改为： “除上述第(1)、(8)、(14)、(15)条外，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。法律法规另有规定时，从其规定。”</p>
基金的投资	在“3. 本基金投资的短期融资券的信用评级应不低于以下标准”增加“5. 本基金拟投资于主体信用评级低于 AA+的商业银行的银行存款与同业存单的，应当经基金管理人董事会审议批准，相关交易应当事先征得基金托管人的同意，并作为重大事项履行信息披露程序。”
基金资产的估值	<p>“（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；”</p>

基金的 信息披 露	<p>“(七)基金年度报告、基金半年度报告、基金季度报告(合称“基金定期报告”)”中,增加:</p> <p>“6.基金运作期间,如报告期内出现单一投资者持有基金份额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基金定期报告“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>7.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> <p>8.本基金应当在年度报告、半年度报告中,至少披露报告期末基金前10名份额持有人的类别、持有份额及占总份额的比例等信息。”</p>
基金的 信息披 露	<p>“(八)临时报告与公告”中,增加:</p> <p>“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;</p> <p>28.本基金投资于主体信用评级低于AA+的商业银行的银行存款与同业存单;”</p>

关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改 信诚货币市场证券投资基金托管协议的内容说明

章节	修订内容
全文	<p>“信诚基金管理有限公司”修改为:</p> <p>“中信保诚基金管理有限公司”</p>
一、基金托管 协议当事人	<p>“(二)基金托管人”中,</p> <p>“法定代表人:王洪章”修改为“法定代表人:田国立”</p> <p>“注册资本:叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元”修改为“注册资本:贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整”</p>
三、基金托管 人对基金管理 人的业务监督 和核查	<p>“(六)投资限制”之“2.本基金的投资组合将遵循以下比例限制”中加</p> <p>“(9)本基金管理人管理且由本基金托管人托管的全部货币市场基金投资于同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券,不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的10%;</p> <p>(10)当本基金前10名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的50%时,本基金投资组合的平均剩余期限不得超过60天,平均剩余存续期不得超过120天;投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于30%;</p> <p>(11)当本基金前10名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的20%时,本基金投资组合的平均剩余期限不得超过90天,平均剩余存续期不得超过180天;投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于20%;</p> <p>(12)本基金投资于主体信用评级低于AAA的机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过10%,其中单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过2%;前述金融工具包括债券、非金融企业债务融资工具、银行存款、同业存单、相关机构作为原始权益人的资产支持证券及中国证监会认定的其他品种;</p> <p>(13)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10%。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>(14) 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本基金合同约定的投资范围保持一致；”</p> <p>将原文：</p> <p>“除上述第(9)条外，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。法律法规另有规定时，从其规定。”</p> <p>修改为：</p> <p>“除上述第(1)、(8)、(13)、(14)条外，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。法律法规另有规定时，从其规定。”</p>
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	<p>在“(二)”增加“5. 本基金拟投资于主体信用评级低于 AA+ 的商业银行的银行存款与同业存单的，应当经基金管理人董事会审议批准，相关交易应当事先征得基金托管人的同意，并作为重大事项履行信息披露程序。”</p>
八、基金资产净值计算和会计核算	<p>(四) 暂停估值的情形</p> <p>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；”</p>
十、基金信息披露	<p>在“(三)”中增加：</p> <p>“(4) 发生基金合同规定的暂停基金资产估值情形；”</p>