

创金合信基金管理有限公司关于创金合信鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基金（LOF）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，创金合信基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）决定对创金合信鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基金（LOF）（以下简称本基金）的基金合同、托管协议进行修订。基金合同、托管协议具体修订内容详见附件。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。

重要提示：

1、上述基金合同、托管协议的修订自2018年3月31日起生效。

2、本基金管理人将于公告当日将修改后的基金合同、托管协议登载于公司网站，本基金招募说明书亦同步更新。本公告最终解释权归创金合信基金管理有限公司。投资者欲了解详细信息请仔细阅读基金的基金合同、招募说明书及相关法律文件。

3、投资者可通过本公司的客服热线或网站咨询有关详情：

创金合信基金管理有限公司

客服电话：400-868-0666

网址：www.cjhxfund.com

4、风险提示：

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。敬请投资者留意投资风险。

特此公告。

附件：

1、《创金合信鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基金（LOF）基金合同修

订说明》

2、《创金合信鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基金（LOF）托管协议修订说明》

创金合信基金管理有限公司

二〇一八年三月二十八日

附件 1：《创金合信鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基金（LOF）基金合同修订说明》

章节	原基金合同	修订后的基金合同	修改理由
	内容	内容	
第一部分 前言	一、订立本基金合同的目的、依据和原则 2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》（以下简称“《合同法》”）、《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》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）和其他有关法律、法规和规范性文件。	一、订立本基金合同的目的、依据和原则 2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》（以下简称“《合同法》”）、《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》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、 <u>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</u> （以下简称“ <u>《流动性风险管理规定》</u> ”）和其他有关法律、法规和规范性文件。	根据实际情况增加基金合同的订立依据。
第二部分 释义	无	<u>13、《流动性风险管理规定》：指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、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》及颁布机关对其不时做出的修订</u>	增加《流动性风险管理规定》的法律释义
	无	<u>68、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</u>	根据《流动性风险管理规定》第四十条，增加流动性受限资产的释义。
第七部分 基金份额的 申购与赎回	五、申购和赎回的数量限制 3、基金管理人可以规定单个投资人累计持有的基金份额上限、 <u>当日</u> 申购金额上限，具体规定请参见招募说明书或相关公告。	五、申购和赎回的数量限制 3、基金管理人可以规定单个投资人累计持有的基金份额上限、 <u>单日或单笔申购金额上限</u> ，具体规定请参见招募说明书或相关公告。	完善表述。
	无	<u>4、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</u>	根据《流动性风险管理规定》

	停基金申购等一种或多种措施，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。	第十九条增加。
六、申购和赎回的价格、费用及其用途 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的具体比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。 其中，对持续持有期少于7日的赎回投资者，本基金将按照不低于1.5%的赎回费率计算赎回费，并全额计入基金财产。 赎回费用纳入基金财产的具体比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。	根据《流动性风险管理规定》第二十三条增加强制赎回费的规定。
七、拒绝或暂停申购的情形 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时。 …… 6、 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第1、2、3、5、6项情形之一且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。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，且开放期时间相应顺延。	七、拒绝或暂停申购的情形 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时。 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。 …… 6、在基金管理人就本基金的基金总规模、单日净申购比例、单一投资者单日和/或单笔申购金额设置上限的情况下，接受某笔或某些申购申请超过前述某项或全部上限比例的。 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数的比例达到或者超过本基金基金份额总数的50%，或者变相规避50%集中度的情形时。 8、 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第1、2、3、5、 8 项情形之一且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请 全部或部分被拒绝的 ，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。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，且开放期时间相应顺延。	根据《流动性风险管理规定》第十九条、第二十四条增加应当暂停申购的情形。
八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时。	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时。 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赎回或延缓支付赎回款项。	根据《流动性风险管理规定》第二十四条的规定增加应当

	<p>九、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>当基金出现巨额赎回时，对于场外赎回申请，基金管理人对于符合法律法规及基金合同约定的赎回申请应于当日全部予以接受和确认。但对于已接受的赎回申请，如基金管理人全额支付投资人的赎回款项有困难或全额支付投资人的赎回款项可能会对基金的资产净值造成较大波动的，基金管理人当日按比例办理的赎回份额不得低于基金总份额的20%，其余赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过20个工作日。</p> <p>巨额赎回业务的场内处理按照上海证券交易所及登记机构的有关业务规则办理。</p>	<p>九、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p><u>(1)</u>当基金出现巨额赎回时，对于场外赎回申请，基金管理人对于符合法律法规及基金合同约定的赎回申请应于当日全部予以接受和确认。但对于已接受的赎回申请，如基金管理人全额支付投资人的赎回款项有困难或全额支付投资人的赎回款项可能会对基金的资产净值造成较大波动的，基金管理人当日按比例办理的赎回份额不得低于基金总份额的20%，其余赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过20个工作日。</p> <p>巨额赎回业务的场内处理按照上海证券交易所及登记机构的有关业务规则办理。</p> <p><u>(2)</u> <u>在开放期内，若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的单日赎回申请超过前一工作日基金总份额20%的，基金管理人有权对该单个基金份额持有人超出该比例的赎回申请实施延期办理。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，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；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，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。</u></p> <p><u>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。基金管理人应当对延期办理的事宜在指定媒介上进行公告。</u></p>	<p>暂停赎回的情形。</p> <p>根据《流动性风险管理规定》第二十一条增加。</p>
--	---	--	--

	<p>二、投资范围</p> <p>.....</p> <p>封闭期内股票投资比例为基金资产的 50%-100%，但在每个开放期的前 2 个月和后 2 个月以及开放期期间，基金投资不受前述比例限制。权证投资比例为基金资产净值的 0-3%。本基金投资于定向增发主题股票的比例不低于非现金基金资产的 80%。开放期内的每个交易日日终，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制，但每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。</p>	<p>二、投资范围</p> <p>.....</p> <p>封闭期内股票投资比例为基金资产的 50%-100%，但在每个开放期的前 2 个月和后 2 个月以及开放期期间，基金投资不受前述比例限制。权证投资比例为基金资产净值的 0-3%。本基金投资于定向增发主题股票的比例不低于非现金基金资产的 80%。开放期内的每个交易日日终，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金<u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>或到期日在一年以内的政府债券。在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制，但每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金<u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>。</p>	<p>根据《流动性风险管理规定》第十八条修改。</p>
<p>第十三部分 基金的投资</p>	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>.....</p> <p>（2）开放期内的每个交易日日终，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制，但每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；</p>	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>.....</p> <p>（2）开放期内的每个交易日日终，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金<u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>或到期日在一年以内的政府债券。在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制，但每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金<u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>；</p>	<p>根据《流动性风险管理规定》第十八条修改。</p>
	<p><u>(17)</u> 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。</p> <p>因证券、期货市场波动、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，</p>	<p><u>(17)</u> 本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)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%；</p> <p><u>(18)</u> 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</p>	<p>根据《流动性风险管理规定》第十五条、第十六条、第十七条修改。</p>

	但中国证监会规定的特殊情形除外。	<p><u>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项规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u></p> <p><u>(19) 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；</u></p> <p><u>(20) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。</u></p> <p><u>除上述第(2)、(12)、(18)、(19)项外</u>，因证券、期货市场波动、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。</p>	
第十五部分 基金资产估值	无	<p>六、暂停估值的情形</p> <p><u>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，基金管理人经与基金托管人协商一致的；</u></p>	根据《流动性风险管理规定》第二十四条增加。
第十九部分 基金的信息披露	无	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>(六) 基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告</p> <p>……</p> <p><u>如报告期内出现单一投资者持有基金份额数的比例达到或超过基金份额总数 20%的情形，为保障其他投资者利益，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“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。</u></p> <p><u>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。</u></p>	根据《流动性风险管理规定》第二十六条、第二十七条增加定期报告的内容。
	无	<p>(七) 临时报告</p> <p><u>25、发生涉及本基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；</u></p>	根据《流动性风险管理规定》

			第二十六条增加。
第二十五部分 基金合同内容摘要	根据前述修订相应修改。		

附件 2：《创金合信鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基金（LOF）托管协议修订说明》

章节	原托管协议	修订后的托管协议	修改理由
	内容	内容	
二、基金托管协议的依据、目的和原则	订立本协议的依据是《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》（以下简称《运作办法》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 7 号〈托管协议的内容与格式〉》、《创金合信鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称《基金合同》）及其他有关规定。	订立本协议的依据是《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》（以下简称《运作办法》）、 <u>《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》）</u> 、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 7 号〈托管协议的内容与格式〉》、《创金合信鼎鑫睿选定期开放混合型证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称《基金合同》）及其他有关规定。	根据实际情况增加托管协议的订立依据。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	（一）基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权 2、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投融资比例进行监督： （1）封闭期内本基金投资于股票的比例为基金资产的	（一）基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权 2、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投融资比例进行监督： （1）封闭期内本基金投资于股票的比例为基金资产的 50%-100%，但在每个开放期的前	根据基金合同相应内容修改。

<p>50%–100%，但在每个开放期的前 2 个月和后 2 个月以及开放期期间，基金投资不受前述比例限制。权证投资比例为基金资产净值的 0–3%。本基金投资于定向增发主题股票的比例不低于非现金基金资产的 80%。开放期内的每个交易日日终，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制，但每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。</p> <p>.....</p> <p>(2) 根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金投资组合遵循以下投资限制：</p> <p>.....</p> <p>b、开放期内的每个交易日日终，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制，但每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；</p> <p>.....</p> <p>q、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。</p> <p>(3) 法规允许的基金投资比例调整期限</p> <p>因证券、期货市场波动、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，</p>	<p>2 个月和后 2 个月以及开放期期间，基金投资不受前述比例限制。权证投资比例为基金资产净值的 0–3%。本基金投资于定向增发主题股票的比例不低于非现金基金资产的 80%。开放期内的每个交易日日终，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金 <u>(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)</u> 或到期日在一年以内的政府债券。在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制，但每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金 <u>(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)</u>。</p> <p>.....</p> <p>(2) 根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金投资组合遵循以下投资限制：</p> <p>.....</p> <p>b、开放期内的每个交易日日终，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金 <u>(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)</u> 或到期日在一年以内的政府债券。在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制，但每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金 <u>(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)</u>；</p> <p>.....</p> <p>q、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项规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>r、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；</p> <p>s、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。</p> <p>(3) 法规允许的基金投资比例调整期限</p> <p>除上述第 b、l、q、r 项外，因证券、期货市场波动、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</p>	
---	---	--

	但中国证监会规定的特殊情形除外。	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。	
--	------------------	----------------------------------	--