

关于变更工银瑞信信用纯债债券型证券投资基金 业绩比较基准并修改基金合同的公告

为了保护基金份额持有人的合法权益，以更科学、合理的业绩比较基准评价基金的业绩表现，根据《工银瑞信信用纯债债券型证券投资基金基金合同》的相关规定，工银瑞信基金管理有限公司（以下简称“本公司”）经与基金托管人中国农业银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，决定变更工银瑞信信用纯债债券型证券投资基金的业绩比较基准，并修改基金合同相应条款。现将具体变更事项公告如下：

（一）业绩比较基准的变更

工银瑞信信用纯债债券型证券投资基金成立于 2012 年 11 月 14 日。目前基金合同约定的业绩比较基准为“中债企业债总全价指数收益率×80%+中债国债总全价指数收益率×20%”。中债企业债总全价指数和中债国债总全价指数是由中央国债登记结算有限责任公司（以下简称中债公司）编制并发布。中债企业债总全价指数综合反映了银行间债券市场、柜台以及上海证券交易所流通交易的所有中央企业债和地方企业债的整体价格走势和投资回报情况；中债国债总全价指数综合反映了银行间债券市场、柜台以及上海证券交易所流通交易的记账式国债的整体价格走势和投资回报情况。

本基金为纯债债券型基金，债券等固定收益类资产占基金资产净值的比例不低于 80%；其中公司债、企业债、短期融资券、商业

银行金融债与次级债、资产支持证券、中期票据等企业机构发行的债券占基金固定收益类资产的比例不低于 80%；中债信用债（财富）总指数由中央国债登记结算有限责任公司编制的反映中国债券市场信用类债券市场总体走势的宽基指数。该指数的样本券覆盖我国银行间市场和交易所市场，成份债券包括企业债、公司债、商业银行债、短期融资券和中期票据等发行主体是企业的在境内债券市场公开发行的债券，对信用类债券市场具有广泛的市场代表性。中债国开行债券（1~3 年）总财富指数由中央国债登记结算有限责任公司编制的反映债券市场中国家开发银行在银行间债券市场公开发行的待偿期限在 1~3 年的可流通债券总体走势的分类指数。这两个债券指数具有较好的市场代表性，能够较好的反映我国债券市场的总体走势；对本基金的投资标的具有较好的代表性，适合作为本基金的业绩比较基准。

基于此，本公司决定自 2018 年 9 月 13 日起将本基金的业绩比较基准由“中债企业债总全价指数收益率×80%+中债国债总全价指数收益率×20%”变更为“80%×中债信用债（财富）总指数收益率+20%×中债国开行债券（1~3 年）总财富指数收益率”。

（二）基金合同相应条款的变更

自 2018 年 9 月 13 日起，基金合同“第十二部分 基金的投资”之“（五）业绩比较基准”，同时修改为：

章节	原表述	变更后表述
十二、基金的投资	本基金业绩比较基准： 中债企业债总全价指数收益率	本基金业绩比较基准： 80%×中债信用债（财富）总指数收益

	<p>×80%+中债国债总全价指数收益率×20%。</p>	<p>率+20%×中债国开行债券（1~3年）总财富指数收益率。</p>
	<p>中债企业债总全价指数和中债国债总全价指数是由中央国债登记结算有限责任公司（以下简称中债公司）编制并发布。中债企业债总全价指数综合反映了银行间债券市场、柜台以及上海证券交易所流通交易的所有中央企业债和地方企业债的整体价格走势和投资回报情况；中债国债总全价指数综合反映了银行间债券市场、柜台以及上海证券交易所流通交易的记账式国债的整体价格走势和投资回报情况。这两个债券指数具有较好的市场代表性，能够较好的反映我国企业债市场和国债市场的总体走势。</p>	<p>中债信用债（财富）总指数由中央国债登记结算有限责任公司编制的反映中国债券市场信用类债券市场总体走势的宽基指数。该指数的样本券覆盖我国银行间市场和交易所市场，成份债券包括企业债、公司债、商业银行债、短期融资券和中期票据等发行主体是企业的在境内债券市场公开发行的债券，对信用类债券市场具有广泛的市场代表性。中债国开行债券（1~3年）总财富指数由中央国债登记结算有限责任公司编制的反映债券市场中国家开发银行在银行间债券市场公开发行的代偿期限在1~3年的可流通债券总体走势的分类指数。这两个债券指数具有较好的市场代表性，能够较好的反映我国债券市场的总体走势。</p> <p>本基金为债券型基金，债券等固定收益类资产占基金资产净值的比例不低于80%；其中公司债、企业债、短期融资券、商业银行金融债与次级债、资产支持证券、中期票据等企业</p>

		<p><u>机构发行的债券占基金固定收益类资产的比例不低于 80%；</u> <u>本基金对中债信用债（财富）总指数收益率和中债国开行债券（1~3 年）总财富指数收益率分别赋予 80%和 20%的权重符合本基金的投资特性。</u></p>
--	--	--

上述变更事项对本基金投资及基金份额持有人利益无不利影响。本公司将在今后发布的本基金招募说明书（更新）中相应变更业绩比较基准。

注意事项：

- 1、本公告未尽事宜，敬请投资者参见本基金的《基金合同》、《招募说明书》及其更新等相关的文件；
- 2、投资者也可通过以下渠道咨询相关详情：
 - （1）本公司网站：www.icbccs.com.cn；
 - （2）本公司客户服务电话：400-811-9999；
- 3、本公告的解释权归本公司所有。

风险提示：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。基金的过往业绩并不代表其将来表现。投资有风险，敬请投资者认真阅读基金的相关法律文件，并选择适合自身风险承受能力的投资品种进行投资。

特此公告。

工银瑞信基金管理有限公司

二〇一八年九月十一日