

## 关于中金增强型债券收益集合资产管理计划变更为中金恒瑞债券型集合资产管理计划及法律文件变更的公告

尊敬的中金增强型债券收益集合资产管理计划委托人：

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引（证监会公告[2018]39号）等法律法规的规定及中国证监会《关于准予中金增强型债券收益集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函[2019]2355号），中国国际金融股份有限公司（简称“我司”）作为中金增强型债券收益集合资产管理计划（简称“中金强债集合计划”）管理人，经与托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，我司拟将中金强债集合计划变更为中金恒瑞债券型集合资产管理计划（简称“中金恒瑞集合计划”），并按照《中金增强型债券收益集合资产管理计划集合资产管理合同》（简称《中金强债资管合同》）、《中金增强型债券收益集合资产管理计划托管协议》（简称《中金强债托管协议》）、《中金增强型债券收益集合资产管理计划说明书》（简称《中金强债说明书》）有关约定履行法律文件变更程序。

中金强债集合计划变更为中金恒瑞集合计划，其法律文件相应变更为《中金恒瑞债券型集合资产管理计划资产管理合同》（简称《中金恒瑞资管合同》）、《中金恒瑞债券型集合资产管理计划托管协议》（简称《中金恒瑞托管协议》）、《中金恒瑞债券型集合资产管理计划

招募说明书》(简称《中金恒瑞说明书》)。上述法律文件已同步在管理人网站披露, 敬请投资者仔细阅读。

本次中金强债集合计划变更为中金恒瑞集合计划的主要变更和具体流程说明如下。

## 一、主要变更

### (一) 变更产品名称

产品名称由“中金增强型债券收益集合资产管理计划”变更为“中金恒瑞债券型集合资产管理计划”。

### (二) 产品存续期

中金强债集合计划合同约定存续期为无固定存续期限。

《中金恒瑞资管合同》生效后, 中金恒瑞集合计划存续期自中金恒瑞资管合同生效日起, 不得超过 3 年。中金恒瑞资管合同生效日 3 年后按照中国证监会有关规定执行。

### (三) 份额类别设置

中金强债集合计划不对集合计划份额进行分类。

《中金恒瑞资管合同》生效后, 中金恒瑞集合计划分为 A 类份额及 C 类份额, 在投资者申购时收取申购费用, 在赎回时根据持有期限收取赎回费用的集合计划份额, 称为 A 类集合计划份额; 从本类别集合计划资产中计提销售服务费, 在赎回时根据持有期限收取赎回费用, 而不收取申购费用的集合计划份额, 称为 C 类集合计划份额。

若中金强债集合计划原份额持有人未在异议期内退出，则原中金强债集合计划份额自动转为 A 类集合计划份额。

#### （四）申购赎回费率及安排

##### 1、申购费率及安排

中金强债集合计划存续期参与集合计划的参与费如下：

参与金额（M）	费率
M < 50 万	0.80%
50 万 ≤ M < 200 万	0.50%
200 万 ≤ M < 500 万	0.20%
M ≥ 500 万	1000 元/笔

参与期参与中金强债集合计划采用前端收费模式，即在参与集合计划时缴纳参与费。委托人参与份额的计算方式如下：

参与费用 = 参与金额 × 参与费率

净参与金额 = 参与金额 - 参与费用

参与份额 = 净参与金额 / T 日集合计划单位净值

《中金恒瑞资管合同》生效后，中金恒瑞集合计划 A 类份额和 C 类份额的具体申购费率如下：

A 类集合计划份额		C 类集合计划份额
申购金额（M）	费率	费率
M < 100 万	0.60%	0%
100 万 ≤ M < 300 万	0.40%	
300 万 ≤ M < 500 万	0.20%	
M ≥ 500 万	0	

募集期间投资人多次申购的，费用按每笔申购金额对应的费率档次分别计算。

A 类集合计划份额的计算公式为：

① 申购费用适用比例费率时：

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日 A 类份额的集合计划份额净值

② 申购费用为固定金额时:

申购费用 = 固定金额

净申购金额 = 申购金额 - 申购费用

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日 A 类份额的集合计划份额净值

C 类集合计划份额的计算公式为:

申购份额 = 申购金额 / 申购当日 C 类份额的集合计划份额净值

## 2、赎回费率及安排

中金强债集合计划退出费率如下:

持有期限 (T)	退出费率
T < 1 年	0.2%
1 年 ≤ T < 2 年	0.1%
T ≥ 2 年	0

退出费中 25% 归入集合计划资产, 其余部分作用于支付必要费用。委托人在退出中金强债集合计划时缴纳退出费, 委托人的退出净额为退出净额扣减退出费用。其中:

退出金额 = 退出份额 × T 日集合计划份额净值

退出费用 = 退出金额 × 退出费率

退出净额 = 退出金额 - 退出费用

《中金恒瑞资管合同》生效后, 中金恒瑞集合计划 A 类份额和 C 类份额的具体赎回费率如下:

持有期限 (T)	A 类份额赎回费率	C 份额赎回费率
T < 7 日	1.5%	1.5%

7≤T<30 日	1.0%	0
T≥30 日	0	0

对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费全额归入集合计划财产；对持续持有期不少于 7 日的投资人收取的赎回费归入集合计划财产的比例为 25%。未归入集合计划财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

#### A 类及 C 类份额赎回金额的计算

中金恒瑞集合计划的赎回采用“份额赎回”方式，赎回价格以 T 日的该类别集合计划份额净值为基准进行计算，中金恒瑞集合计划的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。

当投资者赎回集合计划份额时，赎回金额的计算方法如下：

赎回总额 = 赎回份额 × 赎回当日该类别集合计划份额净值

赎回费用 = 赎回总额 × 赎回费率

赎回金额 = 赎回总额 - 赎回费用

#### （五）集合计划的费用

中金强债集合计划管理费率按集合计划前一日资产净值的 0.75% 年费率计提，托管费率按照集合计划前一日资产净值的 0.2% 年费率计提。

《中金恒瑞资管合同》生效后，中金恒瑞集合计划管理费按前一日集合计划资产净值的 0.30% 年费率计提；托管费按前一日集合计划资产净值的 0.1% 的年费率计提；中金恒瑞集合计划 A 类份额不收取销售服务费，C 类份额销售服务费年费率为 0.4%。中金恒瑞集合计划销售服务费按前一日 C 类集合计划资产净值的 0.4% 年费率

计提。

### (六) 产品申购起点

中金强债集合计划初次参与最低金额为 50,000 元人民币，无追加参与金额限制。

《中金恒瑞资管合同》生效后，中金恒瑞集合计划申购起点为 1 元人民币，无追加参与金额限制。

### (七) 产品投资目标、范围及比例

在投资目标、范围及比例上，我司根据公募基金法律法规要求，对中金强债集合计划投资相关条款进行了调整。

	中金强债集合计划	中金恒瑞集合计划
投资目标	本集合计划旨在为投资者提供高流动性的稳定增值投资公募，投资过程中将在优先考虑委托资产安全性和流动性前提下，追求资产的长期稳定增值。	本集合计划主要投资于债券资产，在保持集合计划资产流动性和严格控制集合计划资产风险的前提下，通过积极主动的管理，力争实现集合计划资产的长期稳健增值。
投资范围	投资标的为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的公司债、国债、央行票据、金融债、企业债、可转换公司债券、分离交易的可转换公司债券、资产支持证券、短期融资券、中期票据、货币市场基金、债券型基金等固定收益品种，包括股票在内的各类证券一级市场申购，以及法律法规允许集合计划投资的其他金融工具。	投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括债券(含国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债、可转换债券(含分离交易可转换债券)、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等债券)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、国债期货、货币市场工具、现金等，以及法律法规或中国证监会允许集合资产管理计划投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本集合计划不直接买入股票等权益类资产，也不参与新股申购和新股增发，但可持有因可转换债券转股所形成的股票，该等股

		票应当在其可交易之日起 15 个交易日内卖出。
投资比例	<p>固定收益品种：5 -95%，包括公司债、国债、央行票据、金融债、企业债、可转换公司债券、分离交易的可转换公司债券、资产支持证券、短期融资券、中期票据、货币市场基金、债券型基金等。其中公司债投资比例为集合计划资产净值的 5 -70%。除公司债之外的企业债、可转换公司债券、分离交易的可转换公司债券、资产支持证券、短期融资券、中期票据等信用类债券的投资比例不超过集合计划资产净值的 50%。</p> <p>权益类资产：0 -20%。本集合计划对权益类资产的投资主要是通过包括股票在内的各类证券首次发行一级市场申购来实现的，持有因在一级市场申购所形成的股票、持有股票所派发的权证、因可转换公司债券转股所形成的股票和因分离交易的可转换公司债券产生的权证等权益类资产。本集合计划不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产。</p> <p>现金及现金等价物：5% -95%。现金及现金等价物指银行存款、到期日在一年以内的政府债券。</p> <p>如因包括股票在内的各类证券一级市场申购而发生投资比例超标的情况时，应在该证券可流通后 10 个交易日内将持仓比例降至许可范围内。</p>	<p>集合计划的投资组合比例为：债券资产的投资比例不低于集合计划资产的 80%；每个交易日日终，在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本集合计划保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</p>
投资限制	<p>1、本集合计划投资本集合计划投资固定收益类产品（公司债、国债、央行票据、金融债、企业债、可转换公司债券、分离交易的可转换公司债券、资产支持证券、短期融资券、中期</p>	<p>1、本集合计划对债券资产的投资比例不低于集合计划资产总值的 80%；</p> <p>2、每个交易日日终，在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于集合计划资产</p>

<p>票据、货币市场基金、债券型基金等)的比例为计划净值的5-95%;</p> <p>2、本集合计划投资公司债的比例为计划净值的5-70%;</p> <p>3. 本集合计划投资公司债之外的企业债、可转换公司债券、分离交易的可转换公司债券、资产支持证券、短期融资券、中期票据等信用类债券的比例不得超过计划净值的50%;</p> <p>4. 本集合计划投资于权益类资产(包括因在一级市场申购所形成的股票、持有股票所派发的权证、因可转换公司债券转股所形成的股票和因分离交易的可转换公司债券产生的权证等权益类资产)的比例不得超过计划净值的20%;</p> <p>5、本集合计划投资现金及现金等价物(指银行存款、到期日在一年以内的政府债券)比例在开放期为计划净值的5~95%;</p> <p>6. 除被动获得权证外,本集合计划不得进行权证投资,本集合计划持有的全部权证,其市值不超过集合计划资产净值的3%;</p> <p>7. 本公司所管理的客户资产(包括本集合计划资产)投资于一家公司发行的证券,按证券面值计算,不得超过该证券发行总量的10%;</p> <p>8. 本集合计划投资于一家公司发行的证券不得超过计划资产净值的10%;</p> <p>9. 本集合计划投资的债券或资产支持证券的信用级别评级应为BBB以上(含BBB)。持有期间,如果其信用等级下降,应在评级报告公开发布之日起3个月内全部卖出;</p> <p>10. 本集合计划投资于管理</p>	<p>净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等;</p> <p>3、本集合计划持有一家发行的证券,其市值不超过集合计划资产净值的10%;</p> <p>4、本集合计划管理人管理的全部集合资产管理计划持有一家发行的证券,不超过该证券的10%;</p> <p>5、本集合计划投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过集合计划资产净值的10%;</p> <p>6、本集合计划持有的全部资产支持证券,其市值不得超过集合计划资产净值的20%;</p> <p>7、本集合计划持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的10%;</p> <p>8、本集合计划管理人管理的全部集合资产管理计划投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%;</p> <p>9、本集合计划应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。集合计划持有资产支持证券期间,如果其信用等级下降、不再符合投资标准,应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出;</p> <p>10、本集合计划进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过集合计划资产净值的40%,进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为1年,债券回购到期后不展期;</p> <p>11、本集合计划投资于国债期货的,应满足如下限制:</p> <p>1)、本集合计划在任何交易日</p>
---	--



	<p>人、托管人及与管理人、托管人有关联方关系的公司发行的证券，不得超过计划资产净值的3%。</p> <p>管理人应自本集合计划投资运作期开始之日起6个月内使集合资产管理计划的投资组合比例符合上述资产组合设计的要求。</p> <p>如因包括股票在内的各类证券一级市场申购而发生投资比例超标的情况时，应在该证券可流通后10个交易日内将持仓比例降至许可范围内。由于本集合计划规模或市场的变化导致投资组合超过上述约定的比例不在限制之内，管理人将在合理期限内进行调整以达到标准。</p>	<p>日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过集合计划资产净值的15%；</p> <p>2)、本集合计划在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过集合计划持有的债券总市值的30%；</p> <p>3)、本集合计划所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应不低于集合计划资产的80%；</p> <p>4)、集合计划在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日集合计划资产净值的30%；</p> <p>12、本集合计划管理人管理的全部开放式集合资产管理计划（包括开放式集合资产管理计划以及处于开放期的定期开放集合资产管理计划）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>13、本集合计划主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过集合计划资产净值的15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、集合计划规模变动等管理人之外的因素致使集合计划不符合该比例限制的，管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>14、本集合计划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集合计划合同约定的投资范围保持一致；</p>
--	---	---

		<p>15、本集合计划资产总值不超过集合计划资产净值的 140%；</p> <p>16、法律法规及中国证监会规定的和《集合计划合同》约定的其他投资限制。</p> <p>除上述第 2、9、13、14 项情形之外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、集合计划规模变动等管理人之外的因素致使集合计划投资比例不符合上述规定投资比例的，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。法律法规另有规定的，从其规定。</p> <p>管理人应当自集合计划合同生效之日起 6 个月内使集合计划的投资组合比例符合集合计划合同的有关约定。在上述期间内，本集合计划的投资范围、投资策略应当符合集合计划合同的约定。托管人对集合计划的投资的监督与检查自本集合计划合同生效之日起开始。</p>
--	--	---

### (八) 合同终止及变更

按照公募基金法律法规要求，我司调整了中金强债资管计划产品终止相关条款。

	中金强债集合计划	中金恒瑞集合计划
合同终止情形	<p>各方一致同意，出现下列情形之一时，本集合计划应当终止：</p> <p>1、管理人因重大违法、违规行为，被中国证监会取消业务许可的；</p> <p>2、托管人因重大违法、违规行为，被监管机构取消业务资格而管理人未能在合理时间与新的托管人签订托管协议的；</p> <p>3、管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责的；</p> <p>4、存续期内，集合计划净值低</p>	<p>有下列情形之一的，经履行相关程序后，《集合计划合同》应当终止：</p> <p>1、集合计划份额持有人大会决定终止的；</p> <p>2、管理人、托管人职责终止，在 6 个月内没有新管理人、新托管人承接的；</p> <p>3、《集合计划合同》约定的其他情形；</p> <p>4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。</p>

	<p>于人民币 3000 万元时,管理人有权公告终止并清算本集合计划;</p> <p>5、存续期内,任一开放日集合计划委托人少于 2 人时;</p> <p>6、不可抗力的发生导致本集合计划不能存续;</p> <p>7、法律、法规规定或中国证监会规定的其他情况。</p>	
<p>合同变更</p>	<p>本合同签署后,因法律、法规、规章、中国证监会的规定、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所等交易规则修订,自该修订生效之日起,本合同相关内容及条款按该修订办理并在管理人网站公告。委托人特此授权管理人经与托管人协商,可以对本集合计划合同及说明书与新的法律法规或有关政策不一致的内容进行更新或修改,更新或修改的内容不得违反法律法规和中国证监会的有关规定,更新或修改的内容在管理人网站公告满 10 个工作日后生效。委托人对更新或修改的内容有异议,可在更新或修改内容生效前按照本合同的规定申请退出本集合计划。</p> <p>由于其他原因需要变更合同的,管理人和托管人应以书面方式就合同变更内容达成一致,并由管理人以管理人网站公告的方式予以公布并征询委托人意见。委托人不同意合同变更的,应在管理人公告指定的期限内(自公告之日起不少于10个工作日,下称“异议期”)提出退出本集合计划的申请,管理人将按照本合同约定为其办理集合计划份额退出。委托人在异议期内未回复意见或未提出退出申请的(包括书面回复不同意合同变更但未提出退</p>	<p>1、变更集合计划合同涉及法律法规规定或本合同约定应经集合计划份额持有人大会决议通过的事项的,应召开集合计划份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和集合计划合同约定可不经集合计划份额持有人大会决议通过的事项,由管理人和托管人同意后变更并公告,并报中国证监会备案。</p> <p>2、关于《集合计划合同》变更的集合计划份额持有人大会决议自生效后方可执行,并自决议生效后两日内在指定媒介公告。</p>

	<p>出申请的), 视为委托人同意合同变更。委托人同意, 无论其是否提出退出申请, 按照上述约定进行的合同变更均不应被视为或裁定为管理人或托管人的违约行为。委托人在异议期内参与集合计划的, 视为同意合同变更并接受变更后的合同。</p> <p>合同变更自异议期届满时起生效。同意合同变更的委托人无需就合同变更与管理人、托管人另行签署变更后的合同或关于合同变更的补充协议, 经管理人公告的合同变更内容自变更生效时起自动成为变更后合同的组成部分。合同变更生效后, 委托人、管理人和托管人的应当按照变更后的合同行使相关权利, 履行相应义务。</p> <p>委托人、管理人、托管人不得通过签订补充协议、修改合同等任何方式, 约定保证集合计划资产投资收益、承担投资损失, 或排除委托人自行承担投资风险和损失。</p>	
--	--	--

### (九) 份额持有人大会

《中金强债资管合同》无份额持有人大会设置,《中金恒瑞资管合同》增加了份额持有人大会相关条款: 集合计划份额持有人大会由集合计划份额持有人组成, 集合计划份额持有人的合法授权代表有权代表集合计划份额持有人出席会议并表决。集合计划份额持有人持有的每一集合计划份额拥有平等的投票权。本集合计划份额持有人大会不设日常机构。在本集合计划存续期内, 根据本集合计划的运作需要, 份额持有人大会可以设立日常机构, 日常机构的设立与运作应当根据相关法律法规和中国证监会的规定进行。

份额持有人大会召开事由、召集方式、召集程序等见《中金恒瑞资管合同》。

### (十) 估值方法

根据公募基金法律法规要求，我司对中金强债集合计划估值方法进行了调整，详细情况如下。

	中金强债集合计划	中金恒瑞集合计划
估值对象	运用本集合计划资产所购买的一切有价证券、银行存款及其他资产。	集合计划所拥有的股票、债券、国债期货合约和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。
估值日	本集合计划成立后，每个交易日对资产进行估值。	本集合计划的估值日为本集合计划相关的证券交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露集合计划净值的非交易日。
估值方法	<p>除投资管理人在资产购入时特别标注并给托管人正式书面通知及另有规定外，本计划购入的资产均默认按交易性金融资产核算与估值。</p> <p>1. 股票估值方法：</p> <p>(1) 上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。</p> <p>(2) 未上市股票的估值：</p> <p>1) 首次发行未上市的股票，按成本计量；</p> <p>2) 送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价估值；</p> <p>3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价估值；</p> <p>4) 非公开发行有明确锁定期的流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允</p>	<p>1、证券交易所上市的有价证券的估值</p> <p>(1) 交易所上市的有价证券（包括股票等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价。</p> <p>(2) 交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；</p> <p>(3) 交易所上市交易或挂牌转</p>

<p>价值;</p> <p>(3) 在任何情况下,管理人如采用本项第(1) - (2)小项规定的方法对集合计划资产进行估值,均应被认为采用了适当的估值方法。但是,如果管理人认为按本项第(1) - (2)小项规定的方法对集合计划资产进行估值不能客观反映其公允价值的,管理人可根据具体情况,并与托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值;</p> <p>(4) 国家有最新规定的,按其规定进行估值。</p> <p>2. 债券估值方法:</p> <p>(1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值,估值日没有交易的,按最近交易日的收盘价估值;</p> <p>(2) 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的应收利息得到的净价进行估值,估值日没有交易的,以最近交易日的收盘净价估值;</p> <p>(3) 发行未上市债券采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本进行后续计量;</p> <p>(4) 在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种,采用估值技术确定公允价值;</p> <p>(5) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的,按债券所处的市场分别估值;</p> <p>(6) 在任何情况下,管理人如采用本项第(1) - (5)小项规定的方法对集合计划资产进行估值,均应被认为采用了适当的估值方法。但是,如果管理人认为按本项第(1) - (5)小项规定的方法对集合计划资产进行估值不能客观反映其公允价值</p>	<p>让的含权固定收益品种,选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值;</p> <p>(4) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券,采用估值技术确定公允价值。交易所市场挂牌转让的资产支持证券,采用估值技术确定公允价值;</p> <p>(5) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券,对存在活跃市场的情况下,应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值;对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下,应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值;对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下,应采用估值技术确定其公允价值。</p> <p>2、首次公开发行未上市的债券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。</p> <p>3、对全国银行间市场上不含权的固定收益品种,按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种,按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种,回售登记期截止日(含当日)后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市,且第三方估值机构未提供估值价格的债券,在发行利率与二级市场利率不存在明显差异,未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下,按成本估值。</p> <p>4、同一债券或股票同时在两个或两个以上市场交易的,按债券或股票所处的市场分别估值。</p>
---	---

	<p>的，管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上形成的债券估值，管理人可根据具体情况与托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值；</p> <p>(7) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。</p> <p>3. 权证估值方法：</p> <p>(1) 持有的权证，从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证按估值日在证券交易所挂牌的该权证的收盘价估值；估值日没有交易的，按最近交易日的收盘价估值；未上市交易的权证采用估值技术确定公允价值；在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；</p> <p>(2) 在任何情况下，管理人如采用本项第(1)小项规定的方法对集合计划资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果管理人认为按本项第(1)小项规定的方法对集合计划资产进行估值不能客观反映其公允价值的，管理人可根据具体情况，并与托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值；</p> <p>(3) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。</p>	<p>5、国债期货合约一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。</p> <p>6、同业存单按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值；选定的第三方估值机构未提供估值价格的，按成本估值。</p> <p>7、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，管理人可根据具体情况与托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。</p> <p>8、当发生大额申购或赎回情形时，管理人可以采用摆动定价机制，以确保集合计划估值的公平性。</p> <p>9、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。</p>
--	---	---

### (十一) 信息披露

根据公募基金法律法规要求，我司对中金强债集合计划信息披露频率、方式等进行了调整，详细情况如下。

	中金强债集合计划	中金恒瑞集合计划
估值对象	定期报告。包括集合计划净值通告、对账单、集合资产管理计划的季度（年度）资产管理报告、季度（年度）托管报告	一、本集合计划的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》、《集合计划合同》及其他

<p>和年度审计报告。</p> <p>1、集合计划净值通告。每开放日披露截止前一个开放日的经过托管人审核的集合计划的每份额净值。</p> <p>2、对账单。集合计划存续期间，管理人应当按照说明书的约定每季度向委托人提供对账单，说明委托人持有集合计划份额的数量及净值，期间参与、退出明细以及收益分配等情况。</p> <p>3、集合计划的季度资产管理报告和季度托管报告。管理人、托管人分别在每季度结束之日起15日（以《实施细则》规定的工作日计算，不含法定节假日）内向委托人提供季度资产管理报告和季度托管报告。资产管理报告对报告期内集合计划资产的配置状况、价值变动情况做出说明；托管报告对报告期内集合计划资产的托管情况做出说明。集合计划季度资产管理报告的财务数据经托管人审核并出具意见。季度报告应报中国证券业协会备案，同时抄送管理人住所地中国证监会派出机构。</p> <p>4、集合计划的年度资产管理报告和年度托管报告。管理人、托管人在每年度结束之日起3个月内向委托人提供年度资产管理报告和年度托管报告。资产管理报告对报告期内集合计划资产的配置状况、价值变动情况做出说明；托管报告对报告期内集合计划资产的托管情况做出说明。年度资产管理报告的财务数据经托管人审核并出具意见。年度报告应报中国证券业协会备案，同时抄送管理人住所地中国证监会派出机构。</p> <p>5、管理人聘请会计师事务所对</p>	<p>有关规定。</p> <p>二、信息披露义务人</p> <p>本集合计划信息披露义务人包括管理人、托管人、召集集合计划份额持有人大会的集合计划份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和非法人组织。</p> <p>本集合计划信息披露义务人以保护集合计划份额持有人利益为根本出发点，按照法律法规和中国证监会的规定披露集合计划信息，并保证所披露信息的真实性、准确性、完整性、及时性、简明性和易得性。</p> <p>本集合计划信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的集合计划信息通过中国证监会指定的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）及指定互联网网站（以下简称“指定网站”）等媒介披露，并保证集合计划投资者能够按照《集合计划合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。</p> <p>三、本集合计划信息披露义务人承诺公开披露的集合计划信息，不得有下列行为：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；</li> <li>2、对证券投资业绩进行预测；</li> <li>3、违规承诺收益或者承担损失；</li> <li>4、诋毁其他管理人、托管人或者集合计划销售机构；</li> <li>5、登载任何自然人、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；</li> <li>6、中国证监会禁止的其他行为。</li> </ol> <p>四、本集合计划公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，集合计划信息披露义务人应保证不同文本的内容一</p>
---	---



	<p>集合计划的运营情况进行年度审计,并在每年度结束之日起3个月内将审计报告提供给委托人和托管人,并报中国证券业协会备案,同时抄送管理人住所地中国证监会派出机构。</p> <p>本集合计划存续期间,发生对集合计划持续运营、客户利益、资产净值产生重大影响的事件,如集合计划分红、决定终止计划、更换计划托管人、变更投资主办人员、变更推广机构、巨额退出并导致延期退出以及托管人或管理人认为需披露的其他事项,管理人将通过管理人的网站(www.cicc.com.cn)等多种方式在重大事项发生之日起两个工作日内通告委托人,并及时向管理人住所地中国证监会派出机构报告;其中,如果管理人将集合计划的资产投资于管理人、及与管理人有关联方关系的公司发行的证券,管理人将按照法律法规及中国证监会的有关规定,在首次交易完成之日起2个工作日内同时向交易所报告。</p>	<p>致。不同文本之间发生歧义的,以中文文本为准。</p> <p>本集合计划公开披露的信息采用阿拉伯数字;除特别说明外,货币单位为人民币元。</p> <p>五、公开披露的集合计划信息</p> <p>公开披露的集合计划信息包括:</p> <p>(一) 招募说明书、《集合计划合同》、托管协议、产品资料概要</p> <p>1、《集合计划合同》是界定《集合计划合同》当事人的各项权利、义务关系,明确集合计划份额持有人大会召开的规则及具体程序,说明集合计划产品的特性等涉及集合计划投资者重大利益的事项的法律文件。</p> <p>2、招募说明书应当最大限度地披露影响集合计划投资者决策的全部事项,说明集合计划申购和赎回安排、集合计划投资、集合计划产品特性、风险揭示、信息披露及集合计划份额持有人服务等内容。《集合计划合同》生效后,招募说明书的信息发生重大变更的,管理人应当在三个工作日内,更新招募说明书并登载在指定网站上;招募说明书其他信息发生变更的,管理人至少每年更新一次。集合计划终止运作的,管理人不再更新招募说明书。</p> <p>3、托管协议是界定托管人和管理人在集合计划财产保管及集合计划运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。</p> <p>4、产品资料概要是招募说明书的摘要文件,用于向投资者提供简明的集合计划概要信息。《集合计划合同》生效后,产品资料概要的信息发生重大变更的,管理人应当在三个工作日内更新产品资料概要,并登载在指定网站及销售机构网站或营业网点;</p>
--	--	---

		<p>产品资料概要其他信息发生变更的，管理人至少每年更新一次。集合计划终止运作的，管理人不再更新产品资料概要。</p> <p>管理人应将招募说明书提示性公告和《集合计划合同》提示性公告登载在指定报刊上，将招募说明书、产品资料概要、《集合计划合同》和托管协议登载在指定网站上，并将产品资料概要登载在销售机构网站或营业网点；托管人应当将《集合计划合同》、托管协议登载在指定网站上。</p> <p>（二）《集合计划合同》生效公告</p> <p>管理人应当在指定媒介上登载《集合计划合同》生效公告。</p> <p>（三）集合计划净值信息</p> <p>《集合计划合同》生效后，在开始办理集合计划份额申购或者赎回前，管理人应当至少每周在指定网站披露一次各类集合计划份额净值和集合计划份额累计净值。</p> <p>在开始办理集合计划份额申购或者赎回后，管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过指定网站、销售机构网站或者营业网点披露开放日的各类集合计划份额净值和集合计划份额累计净值。</p> <p>管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在指定网站披露半年度和年度最后一日的各类集合计划份额净值和集合计划份额累计净值。</p> <p>（四）集合计划份额申购、赎回价格</p> <p>管理人应当在《集合计划合同》、招募说明书等信息披露文件上载明集合计划份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在集合计划销售机构网站或营业网点</p>
--	--	---

		<p>查阅或者复制前述信息资料。</p> <p>(五)集合计划定期报告,包括年度报告、中期报告和季度报告。管理人应当在每年结束之日起三个月内,编制完成年度报告,将年度报告登载在指定网站上,并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。</p> <p>管理人应当在上半年结束之日起两个月内,编制完成中期报告,将中期报告登载在指定网站上,并将中期报告提示性公告登载在指定报刊上。</p> <p>管理人应当在季度结束之日起15个工作日内,编制完成季度报告,将季度报告登载在指定网站上,并将季度报告提示性公告登载在指定报刊上。</p> <p>《集合计划合同》生效不足2个月的,管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。</p> <p>如报告期内出现单一投资者持有集合计划份额达到或超过集合计划总份额20%的情形,为保障其他投资者的权益,管理人至少应当在定期报告“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集合计划的特有风险,中国证监会认定的特殊情形除外。</p> <p>管理人应当在年度报告和中期报告中披露集合计划组合资产情况及其流动性风险分析等。</p> <p>(六)临时报告</p> <p>本集合计划发生重大事件,有关信息披露义务人应当在2日内编制临时报告书,并登载在指定报刊和指定网站上。</p>
--	--	--

		<p>前款所称重大事件,是指可能对集合计划份额持有人权益或者集合计划份额的价格产生重大影响的下列事件:</p> <ol style="list-style-type: none"><li>1、集合计划份额持有人大会的召开及决定的事项;</li><li>2、《集合计划合同》终止、集合计划清算;</li><li>3、转换集合计划运作方式、集合计划合并;</li><li>4、更换管理人、托管人、份额登记机构,集合计划改聘会计师事务所;</li><li>5、管理人委托相关服务机构代为办理集合计划的份额登记、核算、估值等事项,托管人委托相关服务机构代为办理集合计划的核算、估值、复核等事项;</li><li>6、管理人、托管人的法定名称、住所发生变更;</li><li>7、管理人变更持有百分之五以上股权的股东、管理人的实际控制人变更;</li><li>8、管理人的高级管理人员、集合计划投资经理和托管人专门基金托管部门负责人发生变动;</li><li>9、管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十,管理人、托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十;</li><li>10、涉及集合计划财产、集合资产管理计划管理业务、集合资产管理计划托管业务的诉讼或仲裁;</li><li>11、管理人或其高级管理人员、集合计划投资经理因集合资产管理计划管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚,托管人或其专门基金托管部门负责人因集合资产管理计划托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚;</li><li>12、管理人运用集合计划财产</li></ol>
--	--	---

		<p>买卖管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券,或者从事其他重大关联交易事项,但中国证监会另有规定的除外;</p> <p>13、集合计划收益分配事项;</p> <p>14、管理费、托管费、销售服务费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更;</p> <p>15、集合计划份额净值估值错误达集合计划份额净值百分之一零点五;</p> <p>16、本集合计划开始办理申购、赎回;</p> <p>17、本集合计划发生巨额赎回并延期办理;</p> <p>18、本集合计划连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项;</p> <p>19、本集合计划暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请;</p> <p>20、发生涉及集合计划申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时;</p> <p>21、管理人采用摆动定价机制进行估值;</p> <p>22、集合计划信息披露义务人认为可能对集合计划份额持有人权益或者集合计划份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定的其他事项。</p> <p>(七)澄清公告</p> <p>在《集合计划合同》存续期限内,任何公共媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对集合计划份额价格产生误导性影响或者引起较大波动,以及可能损害集合计划份额持有人权益的,相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清,并将有关情况立即报告中国证</p>
--	--	--

		<p>监会。</p> <p>(八)集合计划份额持有人大会决议 集合计划份额持有人大会决定的事项,应当依法报中国证监会备案,并予以公告。</p> <p>(九)投资资产支持证券信息披露 管理人应在年报及中期报告中披露集合计划持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占集合计划净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。管理人应在季度报告中披露集合计划持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占集合计划净资产的比例和报告期末按市值占集合计划净资产比例大小排序的前10名资产支持证券明细。</p> <p>(十)投资国债期货信息披露 管理人应在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露国债期货交易情况,包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等,并充分揭示国债期货交易对集合计划总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。</p> <p>(十一)中国证监会规定的其他信息。</p> <p>六、信息披露事务管理 管理人、托管人应当建立健全信息披露管理制度,指定专门部门及高级管理人员负责管理信息披露事务。 集合计划信息披露义务人公开披露集合计划信息,应当符合中国证监会相关集合计划信息披露内容与格式准则等法规的规定。 托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《集合计划</p>
--	--	---

		<p>合同》的约定，对管理人编制的集合计划资产净值、各类集合计划份额净值、集合计划份额申购赎回价格、定期报告、更新的招募说明书、产品资料概要、集合计划清算报告等公开披露的相关集合计划信息进行复核、审查，并向管理人进行书面或电子确认。</p> <p>管理人、托管人应当在指定报刊中选择一家报刊披露本集合计划信息。管理人、托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的集合计划信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。</p> <p>管理人、托管人除依法在指定媒介上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒介披露信息，但是其他公共媒介不得早于指定媒介披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。</p> <p>为集合计划信息披露义务人公开披露的集合计划信息出具审计报告、法律意见书的专业机构，应当制作工作底稿，并将相关档案至少保存到《集合计划合同》终止后 10 年。</p>
<p>信息披露文件的存放与查阅</p>	<p>经过托管人审核的集合计划净值通告、集合资产管理季度报告和托管季度报告、集合资产管理年度报告和托管年度报告及其他临时通告放置于管理人网站（<a href="http://www.cicc.com.cn">www.cicc.com.cn</a>）供委托人查阅。</p>	<p>依法必须披露的信息发布后，管理人、托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于各自住所，供社会公众查阅、复制。</p>

## （十二）其他变更

其他合同变更内容可查阅管理人网站《中金恒瑞资管合同》、《中金恒瑞说明书》等法律文件。

## 二、相关流程安排

根据《中金强债资管合同》约定，本合同签署后，因法律、法规、规章、中国证监会的规定、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所等交易规则修订，自该修订生效之日起，本合同相关内容及条款按该修订办理并在管理人网站公告。委托人特此授权管理人经与托管人协商，可以对本集合计划合同及说明书与新的法律法规或有关政策不一致的内容进行更新或修改，更新或修改的内容不得违反法律法规和中国证监会的有关规定，更新或修改的内容在管理人网站公告满10个工作日后生效。委托人对更新或修改的内容有异议，可在更新或修改内容生效前按照本合同的规定申请退出本集合计划。由于其他原因需要变更合同的，管理人和托管人应以书面方式就合同变更内容达成一致，并由管理人以管理人网站公告的方式予以公布并征询委托人意见。委托人不同意合同变更的，应在管理人公告指定的期限内（自公告之日起不少于10个工作日，下称“异议期”）提出退出本集合计划的申请，管理人将按照《中金强债资管合同》约定为其办理集合计划份额退出。委托人在异议期内未回复意见或未提出退出申请的（包括书面回复不同意合同变更但未提出退出申请的），视为委托人同意合同变更。委托人同意，无论其是否提出退出申请，按照上述约定进行的合同变更均不应被视为或裁定为管理人或托管人的违约行为。委托人在异议期内参与集合计划的，视为同意合同变更并接受变更后的合同。

我司于2020年5月19日发布本公告。投资者不同意变更的，应在，2020年5月20日至2020年6月2日提出中金强债集合计



划退出的申请，投资者未在上述时间内回复意见也未申请退出中金强债集合计划的，视为同意中金强债集合计划变更为中金恒瑞集合计划及相关法律文件的变更，按照《中金恒瑞资管合同》约定享有权利、承担义务。投资者不同意变更的，管理人保障其推出中金强债集合计划的权利。

本次变更将于 2020 年 6 月 3 日起生效，《中金恒瑞资管合同》《中金恒瑞说明书》同日生效，《中金强债资管合同》《中金强债说明书》《中金增强型债券收益集合资产管理计划集合资产管理合同签署条款》、《中金增强型债券收益集合资产管理计划风险揭示书》同日失效。同意合同变更的委托人无需就合同变更与管理人、托管人另行签署变更后的合同或关于合同变更的补充协议，经管理人公告的合同变更内容自变更生效时起自动成为变更后合同的组成部分。

通过以下代销机构投资中金强债集合计划的投资者在本次合同变更生效后仅能办理赎回，不能办理申购、定投、转换、转托管或其他业务：中国建设银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、南京苏宁基金销售有限公司。如上述代销机构后续可以办理除赎回外的其他业务，管理人将另行通知。

### 三、重要提示

1、敬请投资者仔细阅读《中金恒瑞资管合同》、《中金恒瑞说明书》等法律文件。

2、原中金强债集合计划份额在本次合同变更生效后将转为 A

类份额。

3、如您需更详细了解中金强债集合计划变更为中金恒瑞集合计划相关事宜，可拨打管理人咨询电话或查询管理人网站。

咨询电话：800-810-8802（固话用户免费） | (010)6505-0105  
（直线）

网址：[www.cicc.com](http://www.cicc.com)

中国国际金融股份有限公司

2020年5月19日