中信保诚基金管理有限公司关于信诚中小盘混合型证券投资基金修订基金合同、托管协议部分条款及调整赎回费相关规则的公告

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中小盘混合型证券投资基金（以下简称本基金）的基金合同、托管协议进行修订,并对本基金赎回费相关规则进行调整。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>修改信诚中小盘混合型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>修改信诚中小盘混合型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、赎回费相关规则调整

鉴于《流动性风险管理规定》规定“基金管理人应当强化对投资者短期投资行为的管理，对除货币市场基金与交易型开放式指数基金以外的开放式基金，对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产”，基金管理人将本基金持续持有期少于7日（不含）对应的赎回费率调整为1.5%，上述对投资者收取的赎回费计入基金财产的比例调整为100%（转换业务涉及的本基金赎回费相关规则按上述规则进行调整）。

三、上述基金合同、托管协议的修订及赎回费相关规则调整等事宜自2018年3月31日起生效。对于2018年3月30日15：00之前的赎回申请，适用调整前的赎回费规则；对于2018年3月30日15：00之后的赎回申请，适用调整后的赎回费规则。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。

四、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

五、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；对投资者持有本基金少于 7 日（不含）收取 1.5%的短期赎回费；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>修改信诚中小盘混合型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>修改信诚中小盘混合型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》修改信诚中小盘混合型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）、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”
基金份额的申购与赎回	“(五)申购和赎回的金额”中，增加： “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	“(六)申购和赎回的价格、费用及其用途”之“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。不低于赎回费总额的 25%应归基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。 6.本基金的申购费率最高不超过申购金额的 5%，赎回费率最高不超过赎回金额的 5%。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。基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日 2 日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。 ”修改为： “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。对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费将全额计入基金资产,对持续持有期不少于 7 日的投资者收取的赎回费，其中不低于赎回费总额的 25%应归基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。 6.本基金的申购费率最高不超过申购金额的 5%，赎回费率最高不超过赎回金额的 5%，其中对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5%的赎回费。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。基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日 2 日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。”
基金份	“(七)拒绝或暂停申购的情形”之“4、基金管理人合理判断认为接受某笔或某些申

额的申购与赎回	购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。”中，增加： “或对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响”
基金份额的申购与赎回	“(七)拒绝或暂停申购的情形”中，增加： “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。 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。”
基金份额的申购与赎回	“(七)拒绝或暂停申购的情形”中， “发生上述暂停申购情形且基金管理人决定暂停申购的时，除以上第4项情形外，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。”修改为： “发生上述暂停申购情形且基金管理人决定暂停申购的时，除以上第4、7项情形外，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。”
基金份额的申购与赎回	“(八)暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形”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)巨额赎回的情形及处理方式”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)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” “办公地址：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： “办公地址：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”中， “法定代表人：王洪章”修改为“法定代表人：田国立”
基金的投资	“(二)投资范围”中， “基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的60%-95%；债券、资产支持证券等固定收益类证券品种占基金资产的0-40%；现金或到期日在一年内的政府债券不低于

	基金资产净值的 5%；权证不超过基金资产净值的 3%。本基金将不低于 80%的股票资产投资于中小盘股票。”增加： “其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等”
基金的投资	“（六）投资限制”之“1、组合限制　基金的投资组合应遵循以下限制：”中， “（3）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；”中增加“本基金管理人管理的全部开放式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%；” “（14）保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；”中增加“其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等” 增加： “（16）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； （17）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）投资限制”之“1、组合限制　基金的投资组合应遵循以下限制：”中， “因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价及中小盘股票范围调整等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合本基金合同规定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规另有规定的从其规定。”修改为： “除上述第（11）、（14）、（16）、（17）项以外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价及中小盘股票范围调整等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合本基金合同规定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规另有规定的从其规定。”
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；”
基金资产估值	“（六）暂停估值的情形”中： “4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。”修改为： “5、法律法规、中国证监会和基金合同认定的其它情形。”
基金的信息披露	“(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： “6.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有风险。中国证监会认定的特殊情形除外。 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	“(八)临时报告与公告”中，增加： “26、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；”

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》修改信诚中小盘混合型证券投资基金托管协议的内容说明

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”
一、托管协议当事人	“（一）基金管理人”中， “注册地址：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： “注册地址：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” “办公地址：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： “办公地址：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、基金托管协议当事人	“（二）基金托管人”中， “法定代表人：王洪章”修改为“法定代表人：田国立”
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	在“（一）”中 “基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的60%-95%；债券、资产支持证券等固定收益类证券品种占基金资产的0-40%；现金或到期日在一年内的政府债券不低于基金资产净值的5%；权证不超过基金资产净值的3%。本基金将不低于80%的股票资产投资于中小盘股票。” 增加“其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等”
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	在“（二）”中， “（11）本基金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%的现金或者到期日在一年以内的政府债券”中增加“其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等” “（12）本基金持有的所有流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的20%；本基金持有的同一流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的8%；”修改为“（12）本基金持有的所有流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的15%；本基金持有的同一流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的8%； 此处流通受限证券定义见下文第（五）项；” 增加： “（13）本基金管理人管理且由本基金托管人托管的全部开放式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%；本基金管理人管理且由本基金托管人托管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%； （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基金合同约定的投资范围保持一致。”
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	在“（二）”中， “因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价及中小盘股票范围调整等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合本基金合同规定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规另有规定的从其规定。” 修改为：“除上述第（8）、（11）、（14）、（15）项以外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价及中小盘股票范围调整等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合本基金合同规定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规另有规定的从其规定。”
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	在“（五）”中： “1.本基金投资的流通受限证券须为经中国证监会批准的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。本基金不投资有锁定期但锁定期不明确的证券。”修改为： “1.本基金投资的流通受限证券与上文所述流动性受限资产并不相同，须为经中国证监会批准的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。本基金不投资有锁定期但锁定期不明确的证券。”
八、基金资产净值计算和会计核算	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；” “（4）中国证监会和基金合同认定的其他情形。”修改为“（5）法律法规、中国证监会和基金合同认定的其他情形。”
十、基金信息披露	在“（三）”中增加： “(4)发生基金合同规定的暂停基金资产估值情形；”