

关于中金恒瑞债券型集合资产管理计划增加侧袋机制

并相应修改资产管理合同等法律文件的公告

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信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》等法律法规的要求，以及中金恒瑞债券型集合资产管理计划（以下简称“本产品”）相关法律文件的约定，经与本产品托管人中国建设银行股份有限公司协商一致并报证监会备案，中国国际金融股份有限公司（以下简称“本公司”）对本产品增加侧袋机制，并相应调整资产管理合同、托管协议、招募说明书等法律文件。

本次修订对集合计划份额持有人利益无实质性不利影响，无需召开集合计划份额持有人大会，现将相关事宜公告如下：

1、本次资产管理合同的修订主要为增加侧袋机制相关表述，内容包括前言、释义、集合计划份额的申购与赎回、集合计划份额持有人大会、集合计划的投资、集合计划资产估值、集合计划费用与税收、集合计划的收益与分配、集合计划的信息披露等条款。上述对资产管理合同的修订对照表详见附件。

托管协议、招募说明书涉及到上述修改的内容进行相应更新，在招募说明书中补充侧袋机制章节、增加启用侧袋机制的风险揭示。此外，根据实际情况更新本产品管理人与托管人信息、托管协议修改清算交收时限。涉及上述修改的具体内容详见相关法律文件。

2、本次修订自本公告发布之日起生效。

本次中金恒瑞债券型集合资产管理计划资产管理合同、托管协议、招募说明书修订的内容和程序符合有关法律法规和资产管理合同的规定。投资者可通过本公司网站

(<http://www.cicc.com>) 查阅修订后的本产品法律文件, 也可以通过拨打本公司客户服务电话 (010-65050105) 进行咨询。

风险提示: 本产品管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用本产品资产, 但不保证本产品一定盈利, 也不保证最低收益。投资者投资于本产品时应认真阅读本产品资产管理合同、招募说明书、产品资料概要等法律文件, 了解所投资产品的风险收益特征, 并根据自身风险承受能力选择适合自己的产品。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

中国国际金融股份有限公司

2022年1月1日

附件:《中金恒瑞债券型集合资产管理计划资产管理合同》修改前后文对照表

章节	修订前	修订后
	内容	内容
第三部分 释义	无	58、侧袋机制: 指将集合计划投资组合中的特定资产从原有账户分离至一个专门账户进行处置清算, 目的在于有效隔离并化解风险, 确保投资者得到公平对待, 属于流动性风险管理工具。侧袋机制实施期间, 原有账户称为主袋账户, 专门账户称为侧袋账户 59、特定资产: 包括: (一) 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的资产; (二) 按摊余成本计量

		<p>且计提资产减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产；</p> <p>(三) 其他资产价值存在重大不确定性的资产。</p>
第五部分 集合计划份额的申购与赎回	无	<p>十八、实施侧袋机制期间本集合计划的申购与赎回</p> <p>本集合计划实施侧袋机制的，本集合计划的申购和赎回安排详见招募说明书或相关公告。</p>
第七部分 集合计划份额持有人大会	无	<p>九、实施侧袋机制期间集合计划份额持有人大会的特殊约定</p> <p>若本集合计划实施侧袋机制，则相关集合计划份额或表决权的比例指主袋份额持有人和侧袋份额持有人分别持有或代表的集合计划份额或表决权符合该等比例，但若相关集合计划份额持有人大会召集和审议事项不涉及侧袋账户的，则仅指主袋份额持有人持有或代表的集合计划份额或表决权符合该等比例：</p> <p>1、集合计划份额持有人行使提议权、召集权、提名权所需单独或合计代表相关集合计划份额10%以上（含10%）；</p> <p>2、现场开会的到会者在权益登记日代表的集合计划份额不少于本集合计划在权益登记日相关集合计划份额的二分之一（含二分之一）；</p> <p>3、通讯开会的直接出具书面意见或</p>

		<p>授权他人代表出具书面意见的集合计划份额持有人所持有的集合计划份额不小于在权益登记日相关集合计划份额的二分之一（含二分之一）；</p> <p>4、在参与集合计划持有人大会投票的集合计划持有人所持有的集合计划份额小于在权益登记日相关集合计划份额的二分之一、召集人在原公告的集合计划份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内就原定审议事项重新召集的集合计划持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）相关集合计划份额的持有人参与或授权他人参与集合计划持有人大会投票；</p> <p>5、现场开会由出席大会的集合计划份额持有人和代理人所持表决权的50%以上（含50%）选举产生一名集合计划份额持有人作为该次集合计划持有人大会的主持人；</p> <p>6、一般决议须经参加大会的集合计划份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过；</p> <p>7、特别决议应当经参加大会的集合计划份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过。</p> <p>同一主侧袋账户内的每份集合计划份额具有平等的表决权。</p>
--	--	--

<p>第十一部分 集合计划的投 资</p>	<p>无</p>	<p>八、侧袋机制的实施和投资运作安排</p> <p>当集合计划持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护集合计划份额持有人利益的原则，集合计划管理人经与集合计划托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及集合计划合同的约定启用侧袋机制。</p> <p>侧袋机制实施期间，本部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。</p> <p>侧袋账户的实施条件、实施程序、运作安排、投资安排、特定资产的处置变现和支付等对投资者权益有重大影响的事项详见招募说明书的规定。</p>
<p>第十三部分 集合计划资产 估值</p>	<p>无</p>	<p>九、实施侧袋机制期间的集合计划资产估值</p> <p>本集合计划实施侧袋机制的，应根据本部分的约定对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的集合计划净值信息，暂停披露侧袋账户份额净值。</p>
<p>第十三部分 集合计划资产 估值</p>	<p>七、暂停估值的情形</p> <p>1、集合计划投资所涉及的证券/期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</p> <p>2、因不可抗力致使管理人、托</p>	<p>七、暂停估值的情形</p> <p>1、集合计划投资所涉及的证券/期货交易遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</p> <p>2、因不可抗力致使管理人、托管人</p>

	<p>管人无法准确评估集合计划资产价值时；</p> <p>3、当前一估值日集合计划资产净值 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，经与托管人协商确认后，管理人应当暂停估值；</p> <p>4、中国证监会和集合计划合同认定的其它情形。</p>	<p>无法准确评估集合计划资产价值时；</p> <p>3、当特定资产占前一估值日集合计划资产净值 50%以上时，经与托管人协商确认后，管理人应当暂停估值；</p> <p>4、中国证监会和集合计划合同认定的其它情形。</p>
第十四部分 集合计划费用 与税收	无	<p>四、实施侧袋机制期间的集合计划费用本集合计划实施侧袋机制的，与侧袋账户有关费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费，详见招募说明书的规定。</p>
第十五部分 集合计划的收 益与分配	无	<p>七、实施侧袋机制期间的收益分配本集合计划实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配，详见招募说明书的规定。</p>
第十七部分 集合计划的信 息披露	无	<p>(十一) 实施侧袋机制期间的信息披露</p> <p>本集合计划实施侧袋机制的，相关信息披露义务人应当根据法律法规、集合计划合同和招募说明书的规定进行信息披露，详见招募说明书的规定。</p>