

工银瑞信基金管理有限公司关于 修订旗下工银瑞信创新精选一年定期 开放混合型证券投资基金基金合同和 托管协议的公告

根据《北京证券交易所股票上市规则（试行）》的相关规定，全国中小企业股份转让系统精选层（以下简称“新三板精选层”）挂牌公司调整为北京证券交易所上市公司，北京证券交易所上市的股票是国内依法发行上市的股票，属于公募基金的法定投资范围。根据《中华人民共和国证券投资基金法》等法律法规，工银瑞信基金管理有限公司（以下简称“本公司”）旗下管理的公开募集证券投资基金可按照各自基金合同的约定，在遵守基金合同所约定的投资目标、投资策略、投资范围、资产配置比例、风险收益特征及相关风险控制指标的前提下，参与北京证券交易所上市股票的投资。本公司已就前述事项于2021年11月17日发布了《工银瑞信基金管理有限公司关于旗下基金投资北京证券交易所上市股票的公告》。

鉴于上述情形，经与基金托管人兴业银行股份有限公司协商一致，本公司修订旗下工银瑞信创新精选一年定期开放混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金合同和托管协议，删除新三板精选层的各项相关表述，包括风险揭示、投资范围、投资策略、投资比例、估值方法及信息披露等相关内容，并依据2020年8月1日起施行的《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》要求对基金合同、托管协议进行相应修订。此外，为了适应市场环境变化，更好地服务于投资者，本基金还依据《存托凭证发行与交易管理办法（试行）》，将存托凭证纳入投资范围。本次修订同时更新了基金管理人信息并根据法律法规变动及本基金实际运作情况修改相关内容。

本次在基金合同、托管协议中删除新三板精选层、中小板的各项相关表述等系为反映最新的资本市场情况，不需就相关修改召开基金份额持有人大会；本基金因侧袋机制、将存托凭证纳入投资范围及法律法规变动而对基金合同、托管协议作出的修改系根据法律法规作出，其余修改对原有基金份额持有人的利益无实质性不利影响，结合相关法律法规规定及基金合同约定，均无需召开基金份额持有人大会，且本公司已与基金托管人协商一致并向中国证监会履行备案程序。本次修订将自2022年8月24日起正式生效。具体修订内容详见公告附件《基金合同和托管协议修订对照表》，招募说明书、基金产品资料概要等信息披露文件将根据如上修订一并修改，投资者可登录本基金管理人网站（www.icbccs.com.cn）和中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）查阅修订后的基金合同、托管协议、招募说明书、基金产品资料概要等信息披露文件，也可拨打本基金管理人客户服务电话（400-811-9999）了解相关信息。

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

2022年8月24日

章节	原托管协议 内容	修改后托管协议 内容
		若本基金实施侧袋机制的，侧袋机制实施期间的相关安排见基金合同和招募说明书的规定。
一、基金 托管协 议当事 人	<p>(一)基金管理人 名称:工银瑞信基金管理有限公司 住所:北京市西城区金融大街5号、甲5号6层甲5号601,甲5号7层甲5号701,甲5号8层甲5号801,甲5号9层甲5号901 法定代表人:王海璐 设立日期:2005年6月21日 批准设立机关及批准设立文号:中国证监会证监基金字〔2005〕3号 组织形式:有限责任公司 注册资本:贰亿元人民币 存续期限:持续经营 联系电话:400-811-9999</p>	<p>(一)基金管理人 名称:工银瑞信基金管理有限公司 住所:北京市西城区金融大街5号、甲5号9层甲5号901 法定代表人:赵桂才 设立日期:2005年6月21日 批准设立机关及批准设立文号:中国证监会证监基金字〔2005〕3号 组织形式:有限责任公司 注册资本:贰亿元人民币 存续期限:持续经营 联系电话:400-811-9999</p>
三、基金 托管人 对基金 管理人 的业务 监督和 核查	<p>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市交易的股票(包括主板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票)、新三板精选层股票、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)、股指期货、债券(包括国债、地方政府债、政府支持机构债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、分离交易可转债的纯债部分、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、国债期货、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、现金,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入投资范围。</p> <p>本基金可以根据有关法律法规的规定参与融资及转融券出借业务。</p> <p>本基金所投资精选层股票被调整进入创新层或基础层或终止挂牌(因转板上而被调出精选层的除外),自调出之日起,基金管理人不得新增投资该股票,并应当及时将该股票调出投资组合。</p> <p>本基金的投资组合比例为:封闭期内,股票资产占基金资产的比例为60%-100%;在开放期开始前一个月和结束后一个月以及开放期内基金投资不受该比例限制),其中投资港股通标的股票不超过股票资产的20%。封闭期内,本基金投资新三板精选层股票的市值不得超过基金资产净值的20%;开放期内,本基金投资新三板精选层股票的市值不得超过基金资产净值的15%。</p> <p>(二)基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金投资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督:</p> <p>03 在封闭期内,本基金投资于新三板精选层股票的市值不得超过基金资产净值的20%;在开放期内,本基金投资于新三板精选层股票的市值不得超过基金资产净值的15%;本基金所投资精选层股票被调整进入创新层或基础层或终止挂牌(因转板上而被调出精选层的除外),自调出之日起,基金管理人不得新增投资该股票,并应当及时将该股票调出投资组合;</p> <p>04 本基金持有一家新三板精选层挂牌公司发行的股票市值(同一公司在境内和香港同时挂牌/上市的股票合并计算)不得超过基金资产净值的5%;</p> <p>05 本基金管理人管理的全部基金持有一家新三板精选层挂牌公司发行的股票(同一公司在境内和香港同时挂牌/上市的股票合并计算),不得超过该股票的5%;</p> <p>除第 02)、03)、04)、05)、06)、08)、09)项规定外,因证券、期货市场波动、上市公司合并、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或基金合同另有约定的除外,法律法规另有规定的从其规定。</p> <p>因证券市场波动、挂牌公司或上市公司合并、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第 03)、04)、05)项规定投资比例的,基金管理人应当在20个交易日内进行调整。</p>	<p>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市交易的股票(包括主板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证)、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)、股指期货、债券(包括国债、地方政府债、政府支持机构债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、分离交易可转债的纯债部分、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、国债期货、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、现金,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入投资范围。</p> <p>本基金可以根据有关法律法规的规定参与融资及转融券出借业务。</p> <p>本基金的投资组合比例为:封闭期内,股票资产占基金资产的比例为60%-100%;在开放期开始前一个月和结束后一个月以及开放期内基金投资不受该比例限制),其中投资港股通标的股票不超过股票资产的20%。</p> <p>(二)基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金投资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督:</p> <p>09 本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行,与境内上市交易的股票合并计算;</p> <p>除第 02)、03)、04)、05)、07)项规定外,因证券、期货市场波动、上市公司合并、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或基金合同另有约定的除外,法律法规另有规定的从其规定。</p>
八、基金 资产净 值计算 和会计 核算	<p>2.估值方法</p> <p>0 证券交易所上市或全国中小企业股份转让系统挂牌的有价证券的估值</p> <p>1 交易所上市的有价证券(包括股票等)或全国中小企业股份转让系统挂牌的股票,以其估值日在证券交易所或全国中小企业股份转让系统挂牌的市价(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,确定公允价值;</p> <p>5)交易所上市或全国中小企业股份转让系统挂牌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,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>0 处于未上市或未挂牌期间的有价证券应区分如下情况处理:</p> <p>1 送股、转增股、配股和公开增发的新股,按估值日在证券交易所或全国中小企业股份转让系统)挂牌的同一股票的估值方法估值;该日无交易的,以最近一日的市价(收盘价)估值;</p> <p>2)首次公开发行未上市、未挂牌的股票和债券,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>00)基金管理人及基金托管人应当采用公允价值方法对非挂牌股票进行估值,并妥善留存估值数据和依据;基金管理人可基于保护基金份额持有人利益的原则,履行法定程序后启用熔断机制。</p> <p>0 暂停估值的情形</p> <p>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,经与基金托管人协商确认后,基金管理人应当暂停估值;</p>	<p>2.估值方法</p> <p>0 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,确定公允价值;</p> <p>5)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,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>0 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:</p> <p>1)送股、转增股、配股和公开增发的新股,按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值;该日无交易的,以最近一日的市价(收盘价)估值;</p> <p>2)首次公开发行未上市、未挂牌的股票和债券,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>00)本基金投资存托凭证的估值核算,依照境内上市交易的股票进行。</p> <p>0 暂停估值的情形</p> <p>3、当特定资产占前一估值日基金资产净值50%以上的,经与基金托管人协商确认后,基金管理人应当暂停估值;</p>
十一、基 金费用		<p>四)实施侧袋机制期间的基金费用</p> <p>本基金实施侧袋机制的,与侧袋账户有关的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,其他费用详见招募说明书或相关公告的规定。</p>