(上接B163版)

第六部分 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	1、本基金不收取申购费用和赎回费用。但在满足相关流动性风险管理要求的前提下，当本基金持有的现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计低于5%且偏离度为负时，为确保基金平稳运作，避免诱发系统性风险，基金管理人将对当日单个基金份额持有人申请赎回基金份额超过基金总份额1%以上的赎回申请，对超过1%的部分征收1%的强制赎回费用，并将上述赎回费用全额计入基金财产。基金管理人与基金托管人协商确认上述做法无益于基金利益最大化的情形除外。	1、通常情况下，本基金不收取申购费用和赎回费用。但在满足相关流动性风险管理要求的前提下，当本基金持有的现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计低于5%且偏离度为负时，为确保基金平稳运作，避免诱发系统性风险，基金管理人将对当日单个基金份额持有人申请赎回基金份额超过基金总份额1%以上的赎回申请，对超过1%的部分征收1%的强制赎回费用，并将上述赎回费用全额计入基金财产。基金管理人与基金托管人协商确认上述做法无益于基金利益最大化的情形除外。 新增： 2、当前10名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额50%，且投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计低于10%且偏离度为负时，为确保基金平稳运作，避免诱发系统性风险，基金管理人将对当日单个基金份额持有人超过基金总份额1%以上的赎回申请征收1%的强制赎回费用，并将上述赎回费用全额计入基金财产。基金管理人与基金托管人协商确认上述做法无益于基金利益最大化的情形除外。
第六部分 基金份额的申购与赎回 七、拒绝或暂停申购的情形		新增： 8、接受某笔或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超过50%，或者变相规避50%集中度的情形时。 9、某笔或某些申购申请超过基金管理人设定的单日净申购比例上限、单一投资者单日或单笔申购金额上限的。 10、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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。
第六部分 基金份额的申购与赎回 八、拒绝或暂停申购的情形	发生上述第1、2、3、4、8、9、10项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介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。	发生上述第1、2、3、4、10、11、12、13、14项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介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。
第六部分 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		新增： 9、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，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。
第六部分 基金份额的申购与赎回 九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式		新增： （3）若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的10%，基金管理人有权先行对该单个基金份额持有人超出10%的赎回申请实施延期办理，而对该单个基金份额持有人10%以内（含10%）的赎回申请与其他基金份额持有人的赎回申请，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况或巨额赎回份额占比情况决定全额赎回或部分延期赎回。所有延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。具体见相关公告。
第七部分 基金合同当事人及权利义务 二、基金托管人	（一）基金托管人简况 名称：中国民生银行股份有限公司 组织形式：股份有限公司	（一）基金托管人简况 名称：中国民生银行股份有限公司 组织形式：其他股份有限公司（上市）
第十二部分 基金的投资 四、投资限制	（1）本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天，平均剩余存续期不得超过240天； （3）本基金投资组合中的现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券占基金资产净值的比例合计不得低于5%；现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及五个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于10%；到期日在10个交易日以上的逆回购、银行定期存款等流动性受限资产投资占基金资产净值的比例合计不得超过30%；除发生巨额赎回、连续3个交易日累计赎回20%以上或者连续5个交易日累计赎回30%以上的情形外，债券正回购的资金余额占基金资产净值的比例不得超过20%；	（1）除第（13）、（14）项外，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天，平均剩余存续期不得超过240天； （3）本基金投资组合中的现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券占基金资产净值的比例合计不得低于5%；除第（13）、（14）项外，现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及五个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于10%；到期日在10个交易日以上的逆回购、银行定期存款等流动性受限资产投资占基金资产净值的比例合计不得超过30%；除发生巨额赎回、连续3个交易日累计赎回20%以上或者连续5个交易日累计赎回30%以上的情形外，债券正回购的资金余额占基金资产净值的比例不得超过20%；前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；
第十二部分 基金的投资 四、投资限制		新增： （5）本基金投资于主体信用评级低于AAA的机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过10%，其中单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过2%。前述金融工具包括债券、非金融企业债务融资工具、银行存款、同业存单、相关机构作为原始权益人的资产支持证券及中国证监会认定的其他品种。 本基金拟投资于主体信用评级低于AA+的商业银行的银行存款与同业存单的，应当经基金管理人董事会审议批准，相关交易应当事先征得基金托管人的同意，并作为重大事项履行信息披露程序。； （9）本基金管理人管理的全部货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券，不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的10%； （13）当本基金前10名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的50%时，本基金投资组合的平均剩余期限不得超过60天，平均剩余存续期不得超过120天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于30%；基金管理人对本基金前10名份额持有人的持有份额占比进行测算时，可不将其固有资金投资的基金份额纳入测算范围； （14）当本基金前10名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的20%时，本基金投资组合的平均剩余期限不得超过90天，平均剩余存续期不得超过180天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于20%；基金管理人对本基金前10名份额持有人的持有份额占比进行测算时，可不将其固有资金投资的基金份额纳入测算范围； （15）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的10%；因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资； （16）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；
第十二部分 基金的投资 四、投资限制	除法律法规另有规定或上述另有约定外，因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、基金份额持有人赎回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除外。法律法规另有规定的，从其规定。 基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。	除上述第（1）项、第（3）项第1点、第（11）项、第（15）项、第（16）项外，因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、基金份额持有人赎回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除外。法律法规另有规定的，从其规定。 基金管理人应当对本基金的份额持有人集中度实施严格的监控与管理，根据份额持有集中度情况对本基金的投资组合实施调整。基金管理人应当在每个交易日10:00前将本基金前一交易日前10名基金份额持有人合计持有比例等信息报送基金托管人，基金托管人依法履行投资监督职责。 基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。但本基金不符合上述第（5）、（9）、（13）、（14）项规定的，基金管理人应当自《流动性风险管理规定》施行之日（2017年10月1日）起6个月内予以调整。
第十四部分 基金资产的估值 六、暂停估值的情形		新增： 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一致的，基金管理人应当暂停基金估值；
第十八部分 基金的信息披露 五、公开披露的基金信息 （五）基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告		新增： 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。 基金运作期间，如报告期内出现单一投资者持有基金份额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基金定期报告"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产品的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。 基金管理人应当在年度报告、半年度报告中，至少披露报告期末本基金前10名份额持有人的类别、持有份额及占总份额的比例等信息。
第十八部分 基金的信息披露 五、公开披露的基金信息 （七）临时报告	26、当"摊余成本法"计算的基金资产净值与"影子定价"确定的基金资产净值的负偏离度绝对值达到或超过0.25%或正偏离度绝对值达到0.5%时情形；	26、当"摊余成本法"计算的基金资产净值与"影子定价"确定的基金资产净值的正负偏离度绝对值达到0.5%的情形； 新增： 29、本基金拟投资于主体信用评级低于AA+的商业银行的银行存款与同业存单； 30、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；

二、托管协议修改前后文对照表

章节	修改前	修改后
一、基金托管协议当事人	（二）基金托管人 名称：中国民生银行股份有限公司 组织形式：股份有限公司 经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项；保险兼业代理业务（有效期至2017年02月18日）；提供保管箱服务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。	（二）基金托管人 名称：中国民生银行股份有限公司 组织形式：其他股份有限公司（上市） 经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项；保险兼业代理业务（有效期至2020年02月18日）；提供保管箱服务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。
二、基金托管协议的依据、目的和原则 （一）订立托管协议的依据	本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称"《基金法》"）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称"《运作办法》"）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称"《信息披露办法》"）、《货币市场基金监督管理办法》、《关于实施〈货币市场基金监督管理办法〉有关问题的规定》等有关法律法规、基金合同及其他有关规定制订。	本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称"《基金法》"）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称"《运作办法》"）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称"《信息披露办法》"）、《货币市场基金监督管理办法》、《关于实施〈货币市场基金监督管理办法〉有关问题的规定》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法律法规、基金合同及其他有关规定制订。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查 （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。	2、本基金投资组合遵循以下投资限制： （1）本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天，平均剩余存续期不得超过240天； （3）本基金投资组合中的现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券占基金资产净值的比例合计不得低于5%；现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及五个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于10%；到期日在10个交易日以上的逆回购、银行定期存款等流动性受限资产投资占基金资产净值的比例合计不得超过30%；除发生巨额赎回、连续3个交易日累计赎回20%以上或者连续5个交易日累计赎回30%以上的情形外，债券正回购的资金余额占基金资产净值的比例不得超过20%；	2、本基金投资组合遵循以下投资限制： （1）除第（13）、（14）项外，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天，平均剩余存续期不得超过240天； （3）本基金投资组合中的现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券占基金资产净值的比例合计不得低于5%；除第（13）、（14）项外，现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及五个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于10%；到期日在10个交易日以上的逆回购、银行定期存款等流动性受限资产投资占基金资产净值的比例合计不得超过30%；除发生巨额赎回、连续3个交易日累计赎回20%以上或者连续5个交易日累计赎回30%以上的情形外，债券正回购的资金余额占基金资产净值的比例不得超过20%；前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等； 新增： （5）本基金投资于主体信用评级低于AAA的机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过10%，其中单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过2%。前述金融工具包括债券、非金融企业债务融资工具、银行存款、同业存单、相关机构作为原始权益人的资产支持证券及中国证监会认定的其他品种。 本基金拟投资于主体信用评级低于AA+的商业银行的银行存款与同业存单的，应当经基金管理人董事会审议批准，相关交易应当事先征得基金托管人的同意，并作为重大事项履行信息披露程序。； （9）本基金管理人管理的全部货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券，不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的10%； （13）当本基金前10名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的50%时，本基金投资组合的平均剩余期限不得超过60天，平均剩余存续期不得超过120天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于30%；基金管理人对本基金前10名份额持有人的持有份额占比进行测算时，可不将其固有资金投资的基金份额纳入测算范围； （14）当本基金前10名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的20%时，本基金投资组合的平均剩余期限不得超过90天，平均剩余存续期不得超过180天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于20%；基金管理人对本基金前10名份额持有人的持有份额占比进行测算时，可不将其固有资金投资的基金份额纳入测算范围； （15）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的10%；因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资； （16）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 （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。	除法律法规另有规定或上述另有约定外，因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、基金份额持有人赎回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除外。法律法规另有规定的，从其规定。 基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。	除上述第（1）项、第（3）项第1点、第（11）项、第（15）项、第（16）项外，因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、基金份额持有人赎回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除外。法律法规另有规定的，从其规定。 基金管理人应当对本基金的份额持有人集中度实施严格的监控与管理，根据份额持有集中度情况对本基金的投资组合实施调整。基金管理人应当在每个交易日10:00前将本基金前一交易日前10名基金份额持有人合计持有比例等信息报送基金托管人，基金托管人依法履行投资监督职责。 基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。但本基金不符合上述第（5）、（9）、（13）、（14）项规定的，基金管理人应当自《流动性风险管理规定》施行之日（2017年10月1日）起6个月内予以调整。
八、基金资产净值计算和会计核算 （三）可以暂停估值的情形		新增： 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一致的，基金管理人应当暂停基金估值；

工银瑞信基金管理有限公司
关于工银瑞信产业债债券型证券投资基金修改基金合同、托管协议有关条款的公告

根据有关法律法规要求和《工银瑞信产业债债券型证券投资基金基金合同》（以下简称"《基金合同》"）的约定，工银瑞信基金管理有限公司（以下简称"本基金管理人"或"本公司"）经与基金托管人中信银行股份有限公司协商一致，对工银瑞信产业债债券型证券投资基金（以下简称"本基金"）的《基金合同》、《托管协议》有关条款进行修改。现将有关情况说明如下：

一、根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法律法规的要求和《基金合同》的约定，对《基金合同》的前言、释义、申购赎回、投资限制、估值和信息披露等章节的相关内容进行了修改，《托管协议》对应部分内容同步修改。同时，对《基金合同》、《托管协议》中的基金管理人和基金托管人的基本信息进行了更新。

《基金合同》和《托管协议》的修改详见附件《工银瑞信产业债债券型证券投资基金基金合同、托管协议修改前后文对照表》。

二、自2018年4月1日（含该日）起，投资者赎回时，对持续持有期少于7日的投资者收取1.5%的赎回费并全额计入基金财产。

三、修改后的《基金合同》、《托管协议》自4月1日起生效。本基金管理人将于公告当日将修改后的《基金合同》、《托管协议》登载于公司网站，并在下期更新的《工银瑞信产业债债券型证券投资基金招募说明书》中对上述相关内容进行相应修改。投资者欲了解基金信息，请仔细阅读本基金的《基金合同》、《招募说明书》及相关法律文件。

投资者可登录本基金管理人网站（www.icbccs.com.cn）或拨打本基金管理人的客户服务电话（400-811-9999）获取相关信息。

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
二〇一八年三月二十四日

附件：《工银瑞信产业债债券型证券投资基金基金合同、托管协议修改前后文对照表》

一、基金合同修改前后文对照表

章节	修改前	修改后
第一部分 前言 一、订立本基金合同的目的、依据和原则	2.订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称"《合同法》")、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称"《基金法》")、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称"《运作办法》")、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称"《销售办法》")、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称"《信息披露办法》")和其他有关法律法规。	2.订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称"《合同法》")、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称"《基金法》")、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称"《运作办法》")、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称"《销售办法》")、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称"《信息披露办法》")、《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"《流动性风险规定》")和其他有关法律法规。
第二部分 释义		新增： 13.《流动性风险规定》：指中国证监会2017年8月31日颁布、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》及颁布机关对其不时做出的修订
第二部分 释义		新增： 56.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 57.摆动定价机制：指当本基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待
第六部分 基金份额的申购与赎回 三、申购与赎回的原则		新增： 5. 当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。
第六部分 基金份额的申购与赎回 五、申购和赎回的数量限制		新增： 4.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，具体规定请参见相关公告。
第六部分 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	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，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。 6、本基金A类基金份额的申购费用最高不超过申购金额的5%，赎回费用最高不超过赎回金额的5%。……	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，其中对持续持有期少于7日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产。对持续持有期为7日以上（含7日）的，不低于赎回费总额的25%应归基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。 6、本基金A类基金份额的申购费用最高不超过申购金额的5%，赎回费用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。……
第六部分 基金份额的申购与赎回 七、拒绝或暂停申购的情形		新增： 5.接受某笔或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超过50%，或者变相规避50%集中度的情形时。 7.某笔或某些申购申请超过基金管理人设定的单日净申购比例上限、单一投资者单日或单笔申购金额上限的。 8.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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。
第六部分 基金份额的申购与赎回 七、拒绝或暂停申购的情形	发生上述第1、2、3、5、6项暂停申购情形时，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，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。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。	发生上述第1、2、3、6、8、9项暂停申购情形时，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，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。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。
第六部分 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		新增： 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，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。
第六部分 基金份额的申购与赎回 九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式		新增： （3）若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的10%，基金管理人有权先行对该单个基金份额持有人超出10%的赎回申请实施延期办理，而对该单个基金份额持有人10%以内（含10%）的赎回申请与其他基金份额持有人的赎回申请，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况或巨额赎回份额占比情况决定全额赎回或部分延期赎回。所有延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。具体见相关公告。
第七部分 基金合同当事人及权利义务	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 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丙17号北京银行大厦8层 法定代表人：李晓鹏 设立日期：2005年6月21日 批准设立机关及批准设立文号：中国证券监督管理委员会证监基金字[2005]93号 组织形式：有限责任公司 注册资本：2亿元人民币 存续期限：持续经营 联系电话：010-66583333 二、基金托管人 （一）基金托管人简况 名称：中信银行股份有限公司 住所：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座 法定代表人：田国立 成立时间：1987年4月7日 批准设立机关和批准设立文号：国办函[1987]14号 组织形式：股份有限公司 注册资本：467.873亿元人民币 存续期间：持续经营 基金托管资格批文及文号：证监基金字[2004]125号	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 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：郭特华 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】93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 二、基金托管人 （一）基金托管人简况 名称：中信银行股份有限公司 住所：北京市东城区朝阳门北大街9号 法定代表人：李庆萍 成立时间：1987年4月7日 批准设立机关和批准设立文号：国办函[1987]14号 组织形式：股份有限公司 注册资本：489.347亿元人民币 存续期间：持续经营 基金托管资格批文及文号：证监基金字[2004]125号
第十二部分 基金的投资 二、投资范围	基金的投资组合比例为：债券等固定收益类资产占基金资产的比例不低于80%；其中产业债的投资比例不低于固定收益类资产的80%；股票等权益类资产占基金资产的比例不超过20%，现金及到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%。	基金的投资组合比例为：债券等固定收益类资产占基金资产的比例不低于80%；其中产业债的投资比例不低于固定收益类资产的80%；股票等权益类资产占基金资产的比例不超过20%，现金及到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。
第十二部分 基金的投资 四、投资限制 1.组合限制	基金的投资组合应遵循以下限制： …… （2）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； …… （15）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 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。法律、法规另有规定时，从其规定。	基金的投资组合应遵循以下限制： …… （2）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，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等； 新增： （15）本基金主动投资于流动性受限资产的市值不得超过本基金资产净值的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前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资； （16）本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)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%；完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制； （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； （18）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 除第（2）、（12）、（15）、（17）条外，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。法律、法规另有规定时，从其规定。
第十四部分 基金资产的估值 三、估值方法		新增： 7. 当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。
第十四部分 基金资产的估值 六、暂停估值的情形		新增： 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一致的，基金管理人应当暂停基金估值；
第十八部分 基金的信息披露 五、公开披露的基金信息 （六）基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告		新增： 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。 基金运作期间，如报告期内出现单一投资者持有基金份额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基金定期报告"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产品的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。
第十八部分 基金的信息披露 五、公开披露的基金信息 （七）临时报告		新增： 26.发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时； 27. 当基金管理人采用摆动定价机制进行估值；

二、托管协议修改前后文对照表

章节	修改前	修改后
一、基金托管协议当事人	（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丙17号北京银行大厦8层 法定代表人：李晓鹏 成立日期：2005年6月21日 批准设立机关：中国证券监督管理委员会 批准设立文号：中国证监监督管理委员会证监基金字[2005]93号 组织形式：有限责任公司 注册资本：贰亿元 经营范围：基金募集；基金销售；资产管理以及中国证监会许可的其它业务。 存续期间：持续经营 （二）基金托管人 名称：中信银行股份有限公司 住所：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座 法定代表人：田国立 成立时间：1987年4月7日 批准设立文号：国办函[1987]14号 基金托管业务批准文号：证监基金字[2004]125号 组织形式：股份有限公司 注册资本：467.873亿元人民币 存续期间：持续经营 经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项；提供保管箱服务；结汇、售汇业务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。	（一）基金管理人 名称：工银瑞信基金管理有限公司 注册地址：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 办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦A座6-9层 邮政编码：100033 法定代表人：郭特华 成立时间：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】93号 组织形式：有限责任公司 注册资本：贰亿元人民币 存续期间：持续经营 经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务 （二）基金托管人 名称：中信银行股份有限公司 住所：北京市东城区朝阳门北大街9号 法定代表人：李庆萍 成立时间：1987年4月7日 批准设立文号：国办函[1987]14号 基金托管业务批准文号：证监基金字[2004]125号 组织形式：股份有限公司 注册资本：489.347亿元人民币 存续期间：持续经营 经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项；提供保管箱服务；结汇、售汇业务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。
二、基金托管协议的依据、目的和原则 （一）订立托管协议的依据	订立本协议的依据是《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称"《基金法》"）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称"《运作办法》"）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称"《销售办法》"）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称"《信息披露办法》"）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第7号〈托管协议的内容与格式〉》、《工银瑞信产业债债券型证券投资基金基金合同》（以下简称"基金合同"）及其他有关规定。	订立本协议的依据是《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称"《基金法》"）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称"《运作办法》"）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称"《销售办法》"）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称"《信息披露办法》"）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第7号〈托管协议的内容与格式〉》、《工银瑞信产业债债券型证券投资基金基金合同》（以下简称"基金合同"）及其他有关规定。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	本基金投资组合资产配置比例：债券等固定收益类资产占基金资产的比例不低于80%；其中产业债的投资比例不低于固定收益类资产的80%；股票等权益类资产占基金资产的比例不超过20%，现金及到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%。	本基金投资组合资产配置比例：债券等固定收益类资产占基金资产的比例不低于80%；其中产业债的投资比例不低于固定收益类资产的80%；股票等权益类资产占基金资产的比例不超过20%，现金及到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%，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	…… （2）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； …… （15）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 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。法律、法规另有规定时，从其规定。	…… （2）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，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等； …… 增加： （15）本基金主动投资于流动性受限资产的市值不得超过本基金资产净值的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前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资； （16）本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)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%；完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制； （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； （18）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 除第（2）、（12）、（15）、（17）条外，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。法律、法规另有规定时，从其规定。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	6. 基金托管人对基金投资流通受限证券的监督 （1）基金投资流通受限证券，应遵守《关于规范基金投资非公开发行证券行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。流通受限证券指由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、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。	6. 基金托管人对基金投资流通受限证券的监督 （1）基金投资流通受限证券，应遵守《关于规范基金投资非公开发行证券行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。流通受限证券与上文提及的流动性受限资产的定义并不一致，指由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、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。
八、基金资产净值计算和会计核算 （二）基金资产估值方法	2.估值方法	2.估值方法 新增： （7）当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。
八、基金资产净值计算和会计核算 （六）暂停估值的情形		新增： 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一致的，基金管理人应当暂停基金估值；

工银瑞信基金管理有限公司
关于工银瑞信创新动力股票型证券投资基金修改基金合同、托管协议有关条款的公告

根据有关法律法规要求和《工银瑞信创新动力股票型证券投资基金基金合同》（以下简称"《基金合同》"）的约定，工银瑞信基金管理有限公司（以下简称"本基金管理人"或"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，对工银瑞信创新动力股票型证券投资基金（以下简称"本基金"）的《基金合同》、《托管协议》有关条款进行修改。现将有关情况说明如下：

一、根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法律法规的要求和《基金合同》的约定，对《基金合同》的前言、释义、申购赎回、投资限制、估值和信息披露等章节的相关内容进行了修改，《托管协议》对应部分内容同步修改。同时，对《基金合同》、《托管协议》中的基金管理人和基金托管人的基本信息进行了更新。

《基金合同》和《托管协议》的修改详见附件《工银瑞信创新动力股票型证券投资基金基金合同、托管协议修改前后文对照表》。

二、自2018年4月1日（含该日）起，投资者赎回时，对持续持有期少于7日的投资者收取1.5%的赎回费并全额计入基金财产。

三、修改后的《基金合同》、《托管协议》自4月1日起生效。本基金管理人将于公告当日将修改后的《基金合同》、《托管协议》登载于公司网站，并在下期更新的《工银瑞信创新动力股票型证券投资基金招募说明书》中对上述相关内容进行相应修改。投资者欲了解基金信息，请仔细阅读本基金的《基金合同》、《招募说明书》及相关法律文件。

投资者可登录本基金管理人网站（www.icbccs.com.cn）或拨打本基金管理人的客户服务电话（400-811-9999）获取相关信息。

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
二〇一八年三月二十四日

附件：《工银瑞信创新动力股票型证券投资基金基金合同、托管协议修改前后文对照表》

一、基金合同修改前后文对照表

章节	修改前	修改后
第一部分 前言 一、订立本基金合同的目的、依据和原则	2. 订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称"《合同法》")、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称"《基金法》")、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称"《运作办法》")、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称"《销售办法》")、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称"《信息披露办法》")和其他有关法律法规。	2. 订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称"《合同法》")、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称"《基金法》")、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称"《运作办法》")、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称"《销售办法》")、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称"《信息披露办法》")、《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"《流动性风险规定》")和其他有关法律法规。
第二部分 释义		新增： 13.《流动性风险规定》：指中国证监会2017年8月31日颁布、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》及颁布机关对其不时做出的修订
第二部分 释义		新增： 53.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 54.摆动定价机制：指当本基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待
第六部分 基金份额的申购与赎回 三、申购与赎回的原则		新增： 6. 当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。
第六部分 基金份额的申购与赎回 五、申购和赎回的数量限制		新增： 4.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，具体规定请参见相关公告。
第六部分 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	3.赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见《招募说明书》。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后2位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。	3.赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见《招募说明书》。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示，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，并将上述赎回费全额计入基金财产。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后2位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。
第六部分 基金份额的申购与赎回 七、拒绝或暂停申购的情形		新增： 5、接受某笔或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超过50%，或者变相规避50%集中度的情形时。 7.某笔或某些申购申请超过基金管理人设定的单日净申购比例上限、单一投资者单日或单笔申购金额上限的。 8.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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。
第六部分 基金份额的申购与赎回 七、拒绝或暂停申购的情形	发生上述第1、2、3、5、6项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。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。	发生上述第1、2、3、5、66、8、9项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介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，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。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。
第六部分 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		新增： 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，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。
第六部分 基金份额的申购与赎回 九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式		新增： （3）若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的10%，基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出10%的赎回申请实施延期办理，而对该单个基金份额持有人10%以内（含10%）的赎回申请与其他基金份额持有人的赎回申请，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况或巨额赎回份额占比情况决定全额赎回或部分延期赎回。所有延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。具体见相关公告。
第七部分 基金合同当事人及权利义务 一、基金管理人 （一）基金管理人简况	住所：北京市西城区金融大街丙17号北京银行大厦	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北京市西城区金融大街丙17号北京银行大厦
第七部分 基金合同当事人及权利义务 二、基金托管人 （一）基金托管人简况	法定代表人：蒋超良	法定代表人：周慕冰蒋超良
第十二部分 基金的投资 二、投资范围	基金的投资组合比例为：股票占基金资产的比例为80%－95%，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的5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。	基金的投资组合比例为：股票占基金资产的比例为80%－95%，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的5%的现金或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。
第十二部分 基金的投资 四、投资限制 1.组合限制	基金的投资组合应遵循以下限制： （1）本基金股票资产占基金资产的比例为80%－95%； （2）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，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； …… (16)在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的10%；在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一个交易日基金资产净值的20%；在任何交易日终，持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为80%－95%； …… 因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价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。	基金的投资组合应遵循以下限制： （1）本基金股票资产占基金资产的比例为80%－95%； （2）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，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，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等； …… 新增： （17）本基金主动投资于流动性受限资产的市值不得超过本基金资产净值的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前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资； （18）本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)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%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制； （19）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； …… 除上述第（2）、（12）、（17）、（19）项规定外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价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。
第十四部分 基金资产的估值 三、估值方法		新增： 6. 当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可在履行适当程序后采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。
第十四部分 基金资产的估值 六、暂停估值的情形		新增： 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一致的，基金管理人应当暂停基金估值；
第十八部分 基金的信息披露 五、公开披露的基金信息 （六）基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告、基金季度报告		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。 基金运作期间，如报告期内出现单一投资者持有基金份额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基金定期报告"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产品的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。
第十八部分 基金的信息披露 五、公开披露的基金信息 （七）临时报告		新增： 27.发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时； 28. 当基金管理人采用摆动定价机制进行估值；

二、托管协议修改前后文对照表

章节	修改前	修改后
一、基金托管协议当事人 （一）基金管理人	名称：工银瑞信基金管理有限公司 注册地址：北京市西城区金融大街丙17号北京银行大厦 办公地址：北京市西城区金融大街丙17号北京银行大厦	名称：工银瑞信基金管理有限公司 注册地址：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北京市西城区金融大街丙17号北京银行大厦 办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦A座6-9层北京市西城区金融大街丙17号北京银行大厦
一、基金托管协议当事人 （二）基金托管人	法定代表人：蒋良超	法定代表人：周慕冰蒋良超
二、基金托管协议的依据、目的和原则 （一）订立托管协议的依据	本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称"《基金法》")等有关法律、法规(以下简称"法律法规")、基金合同及其他有关规定制订。	本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称"《基金法》")、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法律、法规(以下简称"法律法规")、基金合同及其他有关规定制订。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	本基金的配置比例为股票占基金资产的比例为80%－95%，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的5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。	本基金的配置比例为股票占基金资产的比例为80%－95%，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的5%的现金或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。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	（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、融资、融券比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： 1、本基金股票资产占基金资产的比例为80%－95%； 2、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，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； …… 16. 在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的10%；在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一个交易日基金资产净值的20%；在任何交易日终，持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为80%－95%； …… 因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价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。	（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、融资、融券比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： 1、本基金股票资产占基金资产的比例为80%－95%； 2、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，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，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等； …… 新增： 17. 本基金主动投资于流动性受限资产的市值不得超过本基金资产净值的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前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资； 18. 本基金管理人管理的、且由本基金托管人托管的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)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、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%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制； 19. 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； …… 除上述第2、12、17、19项规定外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价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。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	（七）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资流通受限证券进行监督。 1、基金投资流通受限证券，应遵守《关于规范基金投资非公开发行证券行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。 2、流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、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。	（七）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资流通受限证券进行监督。 1、基金投资流通受限证券，应遵守《关于规范基金投资非公开发行证券行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。 2、本部分的流通受限证券，与上文提及的流动性受限资产并不完全一致，包括流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、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。
八、基金资产净值计算和会计核算 （二）基金资产估值方法和特殊情形的处理	2.估值方法	2.估值方法 新增： (6) 当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可在履行适当程序后采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。
八、基金资产净值计算和会计核算 （四）暂停估值与公告基金份额净值的情形		新增： （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一致的，基金管理人应当暂停基金估值；

工银瑞信基金管理有限公司
关于工银瑞信纯债定期开放债券型证券投资基金修改基金合同、托管协议有关条款的公告

根据有关法律法规要求和《工银瑞信纯债定期开放债券型证券投资基金基金合同》（以下简称"《基金合同》"）的约定，工银瑞信基金管理有限公司（以下简称"本基金管理人"或"本公司"）经与基金托管人交通银行股份有限公司协商一致，对工银瑞信纯债定期开放债券型证券投资基金（以下简称"本基金"）的《基金合同》、《托管协议》有关条款进行修改。现将有关情况说明如下：

一、根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法律法规的要求和《基金合同》的约定，对《基金合同》的前言、释义、申购赎回、基金合同当事人简况、投资限制、估值和信息披露等章节的相关内容进行了修改，《托管协议》对应部分内容同步修改。同时，对《基金合同》、《托管协议》中的基金管理人和基金托管人的基本信息进行了更新。

《基金合同》和《托管协议》的修改详见附件《工银瑞信纯债定期开放债券型证券投资基金基金合同、托管协议修改前后文对照表》。

二、自2018年4月1日（含该日）起，投资者赎回时，对持续持有期少于7日的投资者收取1.5%的赎回费并全额计入基金财产。

三、修改后的《基金合同》、《托管协议》自4月1日起生效。本基金管理人将于公告当日将修改后的《基金合同》、《托管协议》登载于公司网站，并在下期更新的《工银瑞信纯债定期开放债券型证券投资基金招募说明书》中对上述相关内容进行相应修改。投资者欲了解基金信息，请仔细阅读本基金的《基金合同》、《招募说明书》及相关法律文件。

投资者可登录本基金管理人网站（www.icbccs.com.cn）或拨打本基金管理人的客户服务电话（400-811-9999）获取相关信息。

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
二〇一八年三月二十四日

附件：《工银瑞信纯债定期开放债券型证券投资基金基金合同、托管协议修改前后文对照表》

一、基金合同修改前后文对照表

章节	修改前	修改后
一、前言	订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称"《合同法》")、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称"《基金法》")、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称"《运作办法》")、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称"《销售办法》")、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称"《信息披露办法》")和其他有关法律法规。	订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称"《合同法》")、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称"《基金法》")、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称"《运作办法》")、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称"《销售办法》")、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称"《信息披露办法》")、《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"《流动性风险规定》")和其他有关法律法规。
二、释义		新增： 《流动性风险规定》：指中国证监会2017年8月31日颁布、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》及颁布机关对其不时做出的修订
二、释义		新增： 《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 《摆动定价机制》：指当本基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待
八、基金份额的申购、赎回与转换 （五）申购与赎回的数额限制		新增： （4）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，具体规定请参见相关公告。
八、基金份额的申购、赎回与转换 （六）申购与赎回的价格、费用及其用途	（7）赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，所收取的赎回费的归入基金财产的比例不得低于法律法规或中国证监会规定的比例下限，其余部分用于支付注册登记费和其他必要的手续费。	（7）赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，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，并将上述赎回费全额计入基金财产，对持续持有期为7日以上（含7日）的投资者所收取的赎回费的归入基金财产的比例不得低于法律法规或中国证监会规定的比例下限，其余部分用于支付注册登记费和其他必要的手续费。
八、基金份额的申购、赎回与转换 （七）申购份额与赎回金额的计算		新增： （4）当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。
八、基金份额的申购、赎回与转换 （九）巨额赎回的认定及处理方式		新增： 在开放期内，若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的单日赎回申请超过上一工作日基金总份额10%的，基金管理人有权对该单个基金份额持有人超出该比例的赎回申请实施延期办理，该单个基金份额持有人的剩余赎回申请与其他份额持有人的赎回申请参照前述条款处理。但是，对于未能赎回部分，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。如延期办理期限超过开放期的，开放期相应延长，延长的开放期内不办理申购，亦不接受新的赎回申请，即基金管理人仅为原开放期内因提交赎回申请超过基金总份额10%以上而被延期办理赎回的单个基金份额持有人办理赎回业务。
八、基金份额的申购、赎回与转换 （十）拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理		新增： 6）接受某笔或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超过50%，或者变相规避50%集中度的情形时； 7）某笔或某些申购申请超过基金管理人设定的单日净申购比例上限、单一投资者单日或单笔申购金额上限的； 8）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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施；
八、基金份额的申购、赎回与转换 （十）拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理	发生上述除第5)项情形且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应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。基金管理人及基金托管人不承担该退回款项产生的利息等损失。	发生上述除第5)、6)、7)项情形且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应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。基金管理人及基金托管人不承担该退回款项产生的利息等损失。
八、基金份额的申购、赎回与转换 （十）拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理		新增： （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，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施；
九、基金合同当事人及其权利义务 （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丙17号北京银行大厦 法定代表人：李晓鹏 成立日期：2005年6月21日 批准设立机关：中国证券监督管理委员会 批准设立文号：中国证监会证监基金字[2005]93号 经营范围：基金募集；基金销售；资产管理以及中国证监会许可的其它业务。 组织形式：有限责任公司 注册资本：人民币贰亿元 存续期间：持续经营	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：郭特华 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】93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
九、基金合同当事人及其权利义务 （一）基金托管人	法定代表人：胡怀邦	法定代表人：彭纯
十四、基金的投资 （三）投资范围	本基金投资组合资产配置比例：债券等固定收益类资产占基金资产的比例不低于80%，但在每次开放期前三个月、开放期及开放期结束后三个月的期间内，基金投资不受上述比例限制；开放期内现金及到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%。	本基金投资组合资产配置比例：债券等固定收益类资产占基金资产的比例不低于80%，但在每次开放期前三个月、开放期及开放期结束后三个月的期间内，基金投资不受上述比例限制；开放期内现金及到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；封闭期内，本基金不受该比例的限制。
十四、基金的投资 （八）投资禁止行为与限制	（6）本基金开放期内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 …… 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。法律、法规另有规定时，从其规定。	（6）本基金开放期内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，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等，封闭期内，本基金不受该比例的限制； （7）开放期内，本基金主动投资于流动性受限资产的市值不得超过本基金资产净值的15%；因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；在封闭期内，本基金不受该比例的限制； （8）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； …… 除第（5）、（6）、（7）、（8）项规定外，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。法律、法规另有规定时，从其规定。
十六、基金资产的估值 （四）估值方法		新增： 5、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。
十六、基金资产的估值 （六）暂停估值的情形		新增： （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一致的，基金管理人应当暂停基金估值；
二十、基金的信息披露 （四）定期报告		新增： （5）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。 （6）基金运作期间，如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基金定期报告"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产品的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。
二十、基金的信息披露 （六）临时报告与公告		新增： （28）发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时； （29）当基金管理人采用摆动定价机制进行估值；
二十六、基金合同内容摘要	本基金投资组合资产配置比例：债券等固定收益类资产占基金资产的比例不低于80%，但在每次开放期前三个月、开放期及开放期结束后三个月的期间内，基金投资不受上述比例限制；开放期内现金及到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%。 …… 6）本基金开放期内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； …… 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。法律、法规另有规定时，从其规定。	本基金投资组合资产配置比例：债券等固定收益类资产占基金资产的比例不低于80%，但在每次开放期前三个月、开放期及开放期结束后三个月的期间内，基金投资不受上述比例限制；开放期内现金及到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；封闭期内，本基金不受该比例的限制。 …… 6）本基金开放期内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，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等； 7）开放期内，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的15%；因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；在封闭期内，本基金不受该比例的限制； 8）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；相关法律法规、监管部门及基金合同规定的其他投资限制。 …… 除第（5）、（6）、（7）、（8）项规定外，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。法律、法规另有规定时，从其规定。

二、托管协议修改前后文对照表

章节	修改前	修改后
一、基金托管协议当事人 （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丙17号北京银行大厦 办公地址：北京市西城区金融大街丙17号北京银行大厦8层 法定代表人：李晓鹏 成立时间：2005年6月21日 批准设立机关：中国证券监督管理委员会 批准设立文号：中国证监会证监基金字[2005]93号 经营范围：基金募集；基金销售；资产管理以及中国证监会许可的其它业务。 注册资本：人民币贰亿元 组织形式：有限责任公司 存续期间：持续经营	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：郭特华 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】93号 组织形式：有限责任公司 注册资本：2亿元人民币 存续期限：持续经营 联系电话：400-811-9999
一、基金托管协议当事人 （二）基金托管人	法定代表人：胡怀邦	法定代表人：彭纯
二、基金托管协议的依据、目的和原则	本托管协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称"《基金法》"）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称"《销售办法》"）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称"《运作办法》"）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称"《信息披露办法》"）、《工银瑞信纯债定期开放债券型证券投资基金基金合同》（以下简称"《基金合同》"）及其他有关规定订立。	本托管协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称"《基金法》"）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称"《销售办法》"）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称"《运作办法》"）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称"《信息披露办法》"）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》、《工银瑞信纯债定期开放债券型证券投资基金基金合同》（以下简称"《基金合同》"）及其他有关规定订立。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	本基金投资组合资产配置比例：债券等固定收益类资产占基金资产的比例不低于80%，但在每次开放期前三个月、开放期及开放期结束后三个月的期间内，基金投资不受上述比例限制。开放期内现金及到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%。	本基金投资组合资产配置比例：债券等固定收益类资产占基金资产的比例不低于80%，但在每次开放期前三个月、开放期及开放期结束后三个月的期间内，基金投资不受上述比例限制。开放期内现金及到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；封闭期内，本基金不受该比例的限制。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	（6）本基金开放期内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； （7）相关法律法规、监管部门及基金合同规定的其他投资限制。 …… 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。法律、法规另有规定时，从其规定。	（6）本基金开放期内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，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；封闭期内，本基金不受该比例的限制； （7）开放期内，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的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前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；在封闭期内，本基金不受该比例的限制； （8）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； （9）相关法律法规、监管部门及基金合同规定的其他投资限制。 …… 除第（5）、（6）、（7）、（8）项规定外，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。法律、法规另有规定时，从其规定。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	6、基金托管人对基金投资流通受限证券的监督 （2）流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、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。	6、基金托管人对基金投资流通受限证券的监督 （2）本部分的流通受限证券，与上文提及的流动性受限资产并不完全一致，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、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。
八、基金资产净值计算和会计核算 （一）基金资产净值及基金份额净值的计算与复核		新增： 5、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

工银瑞信基金管理有限公司
关于工银瑞信纯债债券型证券投资基金修改基金合同、托管协议有关条款的公告

根据有关法律法规要求和《工银瑞信纯债债券型证券投资基金基金合同》（以下简称"《基金合同》"）的约定，工银瑞信基金管理有限公司（以下简称"本基金管理人"或"本公司"）经与基金托管人兴业银行股份有限公司协商一致，对工银瑞信纯债债券型证券投资基金（以下简称"本基金"）的《基金合同》、《托管协议》有关条款进行修改。现将有关情况说明如下：

一、根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法律法规的要求和《基金合同》的约定，对《基金合同》的前言、释义、申购赎回、投资限制、估值和信息披露等章节的相关内容进行了修改，《托管协议》对应部分内容同步修改。同时，对《基金合同》、《托管协议》中的基金管理人和基金托管人的基本信息进行了更新。

《基金合同》和《托管协议》的修改详见附件《工银瑞信纯债债券型证券投资基金基金合同、托管协议修改前后文对照表》。

二、自2018年4月1日（含该日）起，投资者赎回时，对持续持有期少于7日的投资者收取1.5%的赎回费并全额计入基金财产。

三、修改后的《基金合同》、《托管协议》自4月1日起生效。本基金管理人将于公告当日将修改后的《基金合同》、《托管协议》登载于公司网站，并在下期更新的《工银瑞信纯债债券型证券投资基金招募说明书》中对上述相关内容进行相应修改。投资者欲了解基金信息，请仔细阅读本基金的《基金合同》、《招募说明书》及相关法律文件。

投资者可登录本基金管理人网站（www.icbccs.com.cn）或拨打本基金管理人的客户服务电话（400-811-9999）获取相关信息。

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
二〇一八年三月二十四日

附件：《工银瑞信纯债债券型证券投资基金基金合同、托管协议修改前后文对照表》

一、基金合同修改前后文对照表

章节	修改前	修改后
第一部分前言 一、订立本基金合同的目的、依据和原则	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称"《合同法》")、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称"《基金法》")、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称"《运作办法》")、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称"《销售办法》")、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称"《信息披露办法》")和其他有关法律法规。	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称"《合同法》")、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称"《基金法》")、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称"《运作办法》")、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称"《销售办法》")、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称"《信息披露办法》")、《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"《流动性风险规定》")和其他有关法律法规。
第二部分释义		新增： 13.《流动性风险规定》：指中国证监会2017年8月31日颁布、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》及颁布机关对其不时做出的修订
第二部分释义		新增： 56.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 57.摆动定价机制：指当本基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待
第六部分基金份额的申购与赎回 三、申购与赎回的原则		新增： 6、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。
第六部分基金份额的申购与赎回 五、申购和赎回的数量限制		新增： 4、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，具体规定请参见相关公告。
第六部分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	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，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。 6、本基金A类基金份额的申购费用最高不超过申购金额的5%，赎回费用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前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。	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，其中对持续持有期少于7日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产。对持续持有期为7日以上（含7日）的，不低于赎回费总额的25%应归基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。 6、本基金A类基金份额的申购费用最高不超过申购金额的5%，赎回费用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前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。
第六部分基金份额的申购与赎回 七、拒绝或暂停申购的情形		新增： 5、接受某笔或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超过50%，或者变相规避50%集中度的情形时。 7、某笔或某些申购申请超过基金管理人设定的单日净申购比例上限、单一投资者单日或单笔申购金额上限的。 8、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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。
第六部分基金份额的申购与赎回 七、拒绝或暂停申购的情形	发生上述第1、2、3、5、6项暂停申购情形时，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，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。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。	发生上述第1、2、3、6、8、9项暂停申购情形时，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，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。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。
第六部分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		新增： 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，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施；
第六部分基金份额的申购与赎回 九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式		新增： （3）若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的10%，基金管理人有权先行对该单个基金份额持有人超出10%的赎回申请实施延期办理，而对该单个基金份额持有人10%以内（含10%）的赎回申请与其他基金份额持有人的赎回申请，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况或巨额赎回份额占比情况决定全额赎回或部分延期赎回。所有延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。具体见相关公告。
第七部分基金合同当事人及权利义务	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丙17号北京银行大厦	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
第七部分基金合同当事人及权利义务	名称：兴业银行股份有限公司(简称：兴业银行) 住所：福建省福州市湖东路154号 法定代表人：高建平 成立时间：1988年8月26日 批准设立机关和批准设立文号：中国人民银行福建省分行闽银1988第【271】号 组织形式：股份有限公司 注册资本：107.86亿元人民币 存续期间：持续经营 基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字【2005】74号	名称：兴业银行股份有限公司(简称：兴业银行) 住所：福建省福州市湖东路154号 法定代表人：高建平 成立时间：1988年8月26日 批准设立机关和批准设立文号：中国人民银行福建省分行闽银1988第【271】号 组织形式：股份有限公司 注册资本：207.74亿元人民币 存续期间：持续经营 基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字【2005】74号
第十二部分基金的投资 二、投资范围	基金的投资组合比例为：债券资产占基金资产的比例不低于80%，现金及到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%。	基金的投资组合比例为：债券资产占基金资产的比例不低于80%，现金及到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。
第十二部分基金的投资 四、投资限制 1.组合限制	（2）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；	（2）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，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；
第十二部分基金的投资 四、投资限制 1.组合限制	（3）本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的10%； （4）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%； …… 因证券市场波动、证券发行人合并、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。法律法规另有规定的从其规定。	（3）本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的10%； （4）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%； …… 新增： （10）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的15%；因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资； （11）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； …… 除第（2）、（8）、（10）、（11）项规定外，因证券市场波动、证券发行人合并、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。法律法规另有规定的从其规定。
第十四部分基金资产的估值 三、估值方法		新增： 6、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。
第十四部分基金资产的估值 六、暂停估值的情形		新增： 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一致的，基金管理人应当暂停基金估值；
第十八部分基金的信息披露 五、公开披露的基金信息 （六）基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告		新增： 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。 基金运作期间，如报告期内出现单一投资者持有基金份额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基金定期报告"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产品的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。
第十八部分基金的信息披露 五、公开披露的基金信息 （七）临时报告		新增： 27.发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时； 28. 当基金管理人采用摆动定价机制进行估值；

二、托管协议修改前后文对照表

章节	修改前	修改后
一、基金托管协议当事人	注册地址：北京市西城区金融大街丙17号北京银行大厦 办公地址：北京市西城区金融大街丙17号北京银行大厦8层 邮政编码：100033 法定代表人：郭特华 成立日期：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]93号 组织形式：有限责任公司 注册资本：人民币贰亿元 存续期间：持续经营 经营范围：基金募集；基金销售；资产管理以及中国证监会许可的其它业务。	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：郭特华 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】93号 组织形式：有限责任公司 注册资本：2亿元人民币 存续期限：持续经营 联系电话：400-811-9999
一、基金托管协议当事人	名称：兴业银行股份有限公司(简称：兴业银行) 注册地址：福建省福州市湖东路154号 办公地址：上海市江宁路168号 邮政编码：350013 法定代表人：高建平 成立日期：1988年8月26日 基金托管业务批准文号：中国证监会证监基金字[2005]74号 组织形式：股份有限公司 注册资本：127.02亿元人民币 存续期间：持续经营	名称：兴业银行股份有限公司(简称：兴业银行) 注册地址：福建省福州市湖东路154号 办公地址：上海市江宁路168号 邮政编码：350013 法定代表人：高建平 成立日期：1988年8月26日 基金托管业务批准文号：中国证监会证监基金字[2005]74号 组织形式：股份有限公司 注册资本：207.74亿元人民币 存续期间：持续经营
二、基金托管协议的依据、目的和原则（一）订立托管协议的依据	本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称"《基金法》")、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称"《运作办法》")、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称"《销售办法》")、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称"《信息披露办法》")、《工银瑞信纯债债券型证券投资基金基金合同》(以下简称"《基金合同》")及其他有关规定制订。	本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称"《基金法》")、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称"《运作办法》")、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称"《销售办法》")、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称"《信息披露办法》")、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》、《工银瑞信纯债债券型证券投资基金基金合同》(以下简称"《基金合同》")及其他有关规定制订。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	本基金为债券型基金，投资组合比例为：债券资产占基金资产的比例不低于80%，现金及到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%。	本基金为债券型基金，投资组合比例为：债券资产占基金资产的比例不低于80%，现金及到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	2. 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；	2. 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，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	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%； …… 10. 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 因证券市场波动、证券发行人合并、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。法律法规另有规定的从其规定。	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%； …… 10. 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的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前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资； 11. 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； 12. 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 除第2、8、10、11项规定外，因证券市场波动、证券发行人合并、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。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 （五）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人投资流通受限证券进行监督	基金管理人投资流通受限证券，应事先根据中国证监会相关规定，明确基金投资流通受限证券的比例，制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。基金托管人对基金管理人是否遵守相关制度、流动性风险处置预案以及相关投资额度和比例等的情况进行监督。	基金管理人投资流通受限证券，应事先根据中国证监会相关规定，明确基金投资流通受限证券的比例，制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。基金托管人对基金管理人是否遵守相关制度、流动性风险处置预案以及相关投资额度和比例等的情况进行监督。 本部分的流通受限证券，与上文提及的流动性受限资产并不完全一致，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、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。
八、基金资产净值计算和会计核算 （二）基金资产估值方法和特殊情形的处理		新增： 6）当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。
八、基金资产净值计算和会计核算 （四）暂停估值与公告基金份额净值的情形		新增： 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一致的，基金管理人应当暂停基金估值；

工银瑞信基金管理有限公司
关于工银瑞信大盘蓝筹混合型证券投资基金修改基金合同、托管协议有关条款的公告

根据有关法律法规要求和《工银瑞信大盘蓝筹混合型证券投资基金基金合同》（以下简称"《基金合同》"）的约定，工银瑞信基金管理有限公司（以下简称"本基金管理人"或"本公司"）经与基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，对工银瑞信大盘蓝筹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》有关条款进行修改。现将有关情况说明如下：

一、根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法律法规的要求和《基金合同》的约定，对《基金合同》的前言、释义、申购赎回、投资限制、估值和信息披露等章节的相关内容进行了修改，《托管协议》对应部分内容同步修改。同时，对《基金合同》、《托管协议》中的基金管理人和基金托管人的基本信息进行了更新。

《基金合同》和《托管协议》的修改详见附件《工银瑞信大盘蓝筹混合型证券投资基金基金合同、托管协议修改前后文对照表》。

二、自2018年4月1日（含该日）起，投资者赎回时，对持续持有期少于7日的投资者收取1.5%的赎回费并全额计入基金财产。

三、修改后的《基金合同》、《托管协议》自4月1日起生效。本基金管理人将于公告当日将修改后的《基金合同》、《托管协议》登载于公司网站，并在下期更新的《工银瑞信大盘蓝筹混合型证券投资基金招募说明书》中对上述相关内容进行相应修改。投资者欲了解基金信息，请仔细阅读本基金的《基金合同》、《招募说明书》及相关法律文件。

投资者可登录本基金管理人网站（www.icbccs.com.cn）或拨打本基金管理人的客户服务电话（400-811-9999）获取相关信息。

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
二〇一八年三月二十四日

附件：《工银瑞信大盘蓝筹混合型证券投资基金基金合同、托管协议修改前后文对照表》

一、基金合同主要修订内容

(下转B165版)