（上接B165版）

| | | |
|---|---|---|
| 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<br>1.本部分投资的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。 | （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<br>1.本部分的流通受限证券，与上交规及的流动性受限资产并不完全一致，但按本基金投资的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<br>（三）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<br>新增：<br>（8）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规定。 |
| 八、基金资产净值计算和会计核算<br>（四）暂停估值与公告基金份额净值的情形 | | 新增：<br>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
# 关于工银瑞信国家战略主题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《工银瑞信国家战略主题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”）经与基金托管人交通银行股份有限公司协商一致，对工银瑞信国家战略主题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《工银瑞信国家战略主题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《工银瑞信国家战略主题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。投资者仍应了解基金信息，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。

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：《工银瑞信国家战略主题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<br>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》”）、《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》”）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》”）和其他有关法律法规。 |
| 第二部分 释义 | 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 | 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 |
| 第三部分 基金份额的申购与赎回<br>三、申购与赎回的原则 | 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。 | 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。 |
| 第三部分 基金份额的申购与赎回<br>五、申购和赎回的数量限制 | 4.当投资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。 | 4.当投资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。 |
| 第三部分 基金份额的申购与赎回<br>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，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式，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式，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。 |
| 第三部分 基金份额的申购与赎回<br>七、拒绝或暂停申购的情形 | 6.当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。 | 6.当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。 |
| 第三部分 基金份额的申购与赎回<br>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 | 4.当投资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。 | 4.当投资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<br>七、拒绝或暂停申购的情形 | 6.当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。 | 6.当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<br>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 | 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式，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式，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<br>九、巨额赎回的情形及处理方式 | 3.巨额赎回的计算及处理方式：当单一开放式基金的单个开放日发生巨额赎回时，基金管理人应当根据当时市场状况、基金资产投资组合的流动性情况等因素，在当日接受赎回比例不低于该开放日基金总份额的10%的前提下，对该单个基金份额持有人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，基管理人可以根据基金当时的资产组合状况或三赎赎回份额占比情况决定全赎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的该类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。 | 3.巨额赎回的计算及处理方式：当单一开放式基金的单个开放日发生巨额赎回时，基管理人应当根据当时市场状况、基金资产投资组合的流动性情况等因素，在当日接受赎回比例不低于该开放日基金总份额的10%的前提下，对该单个基金份额持有人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，基管理人可以根据基金当时的资产组合状况或三赎赎回份额占比情况决定全赎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的该类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。 |
| 第六部分 基金份额的申购与赎回<br>九、巨额赎回的情形及处理方式<br>2.巨额赎回的处理方式 | （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实施延期办理。当天的赎回申请当日未受理，应当通知投资者当天赎回申请未受理。未受理的赎回申请在下一开放日重新提交，按照该开放日的赎回申请顺序进行处理，直到全部赎回为止。 | （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，基管理人可以根据基金当时的资产组合状况或三赎赎回份额占比情况决定全赎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的该类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<br>二、基金托管人<br>（一）基金托管人简况 | 法定代表人：刘士余<br>注册地址：北京市西城区金融大街17号北京银行大厦 | 法定代表人：周慕冰刘士余<br>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 |
| 第十二部分 基金的投资<br>四、投资限制<br>1.组合限制 | 基金的投资组合比例为：股票占基金资产的比例为80%－95%，其中，投资于本基金界定的国家战略主题股票占非现金基金资产的比例不低于80%。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%，其中，投资于本基金界定的国家战略主题股票占非现金基金资产的比例不低于80%。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<br>四、投资限制<br>1.组合限制 | （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：<br>1、本基金股票资产占基金资产的比例为80%－95%，其中，投资于本基金界定的国家战略主题股票占非现金基金资产的比例不低于80%。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。 | （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：<br>1.本基金股票资产占基金资产的比例为80%－95%，其中投资于本基金界定的国家战略主题股票占非现金基金资产的比例不低于80%。<br>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。 |
| 第十二部分 基金的投资<br>四、投资限制<br>1.组合限制 | 基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为80%－95%，其中，本基金投资于本基金界定的国家战略主题股票占非现金基金资产的比例不低于80%。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。<br>……<br>（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96%，其中，有价证券指数第一、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，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金资产净值的200%；在任何交易日终，持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约的成交金额不得超过上一个交易日基金资产净值的200%；在任何交易日终，持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约的成交金额之和，卖出股指期货合约的价值，合计（轧差计算）占基金资产净值的比例为80%－95%；<br>……<br>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，但中国证监会规定的特殊情形或本基金合同另有约定的除外。 | （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96%，其中，有价证券指数第一、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，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金资产净值的200%；在任何交易日终，持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约的成交金额不得超过上一个交易日基金资产净值的200%；在任何交易日终，持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约的成交金额之和，卖出股指期货合约的价值，合计（轧差计算）占基金资产净值的比例为80%－95%；<br>……<br>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，但中国证监会规定的特殊情形或本基金合同另有约定的除外。 |
| 第十四部分 基金资产的估值<br>三、估值方法 | | 新增：<br>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<br>六、暂停估值的情形 | | 新增：<br>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<br>五、公开披露的基金信息<br>（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 | 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； | 新增：<br>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； |
| 第十八部分 基金的信息披露<br>五、公开披露的基金信息<br>（七）临时报告 | 28. 当基金管理人采用摆动定价机制进行估值； | 新增：<br>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<br>（一）基金托管人 | 法定代表人：刘士余 | 法定代表人：周慕冰刘士余 |
| 二、基金托管协议的依据、目的和原则<br>（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。 | 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》”）、《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。 |
| 三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查 | 投资资产占基金资产的比例为80%－95%，其中投资于本基金界定的国家战略主题股票不低于非现金资产的80%。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。 | 投资资产占基金资产的比例为80%－95%，其中投资于本基金界定的国家战略主题股票不低于非现金资产的80%。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<br>四、投资限制<br>1.组合限制 | 基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为80%－95%，其中，投资于本基金界定的国家战略主题股票占非现金基金资产的比例不低于80%。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。<br>……<br>（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96%，其中，有价证券指数第一、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，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金资产净值的200%；在任何交易日终，持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约的成交金额不得超过上一个交易日基金资产净值的200%；在任何交易日终，持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约的成交金额之和，卖出股指期货合约的价值，合计（轧差计算）占基金资产净值的比例为80%－95%；<br>……<br>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，但中国证监会规定的特殊情形或本基金合同另有约定的除外。 | 基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为80%－95%，其中，投资于本基金界定的国家战略主题股票占非现金基金资产的比例不低于80%。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。<br>……<br>（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；<br>（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；<br>（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于开展逆回购交易的，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；<br>……<br>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<br>三、估值方法 | | 新增：<br>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<br>六、暂停估值的情形 | | 新增：<br>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<br>五、公开披露的基金信息<br>（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 | 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； | 新增：<br>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； |
| 第十八部分 基金的信息披露<br>五、公开披露的基金信息<br>（七）临时报告 | 28. 当基金管理人采用摆动定价机制进行估值； | 新增：<br>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<br>（一）基金托管人 | 法定代表人：刘士余 | 法定代表人：周慕冰刘士余 |
| 二、基金托管协议的依据、目的和原则<br>（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。 | 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》”）、《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。 |
| 三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查 | 投资资产占基金资产的比例为80%－95%，其中投资于本基金界定的国家战略主题股票不低于非现金资产的80%。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。 | 投资资产占基金资产的比例为80%－95%，其中投资于本基金界定的国家战略主题股票不低于非现金资产的80%。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<br>（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：<br>1、本基金股票资产占基金资产的比例为80%－95%，其中，本基金投资于本基金界定的国家战略主题股票占非现金基金资产的比例不低于80%。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。<br>……<br>16. 本基金在任何交易日日终，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96%，其中，有价证券指数第一、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，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金资产净值的200%；在任何交易日终，持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约的成交金额不得超过上一个交易日基金资产净值的200%；在任何交易日终，持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约的成交金额之和，卖出股指期货合约的价值，合计（轧差计算）占基金资产净值的比例为80%－95%；<br>……<br>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，但中国证监会规定的特殊情形或本基金合同另有约定的除外。 | （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：<br>1.本基金股票资产占基金资产的比例为80%－95%，其中投资于本基金界定的国家战略主题股票占非现金基金资产的比例不低于80%。<br>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。<br>……<br>新增：<br>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； |
| 三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查<br>（三）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》和本协议的约定，对基金投资、融资比例进行监督。<br>1.本基金股票资产占基金资产的比例为80%－95%，其中投资于本基金界定的国家战略主题股票占非现金基金资产的比例不低于80%。<br>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。<br>……<br>新增：<br>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；<br>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；<br>19.本基托人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于开展逆回购交易的，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；<br>……<br>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）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》和本协议的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：<br>1.本基金股票资产占基金资产的比例为80%－95%，其中投资于本基金界定的国家战略主题股票占非现金基金资产的比例不低于80%。<br>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。<br>……<br>新增：<br>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；<br>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；<br>19.本基托人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于开展逆回购交易的，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；<br>……<br>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<br>三、估值方法 | | 新增：<br>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<br>六、暂停估值的情形 | | 新增：<br>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<br>五、公开披露的基金信息<br>（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 | 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； | 新增：<br>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； |
| 第十八部分 基金的信息披露<br>五、公开披露的基金信息<br>（七）临时报告 | 28. 当基金管理人采用摆动定价机制进行估值； | 新增：<br>28.当基金管理人采用摆动定价机制进行估值；” |

# 工银瑞信基金管理有限公司
# 关于工银瑞信国家战略主题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《工银瑞信国家战略主题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”）经与基金托管人交通银行股份有限公司协商一致，对工银瑞信国家战略主题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《工银瑞信国家战略主题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《工银瑞信国家战略主题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。投资者仍了解基金信息，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：《工银瑞信国家战略主题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<br>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》”）、《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》”）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》”）和其他有关法律法规。 |
| 第二部分 释义 | 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 | 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 |
| 第三部分 基金份额的申购与赎回<br>三、申购与赎回的原则 | 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。 | 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。 |
| 第三部分 基金份额的申购与赎回<br>五、申购和赎回的数量限制 | 4.当投资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