（上接B177版）

工银瑞信基金管理有限公司 关于工银瑞信信用纯债两年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《工银瑞信信用纯债两年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，对工银瑞信信用纯债两年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《工银瑞信信用纯债两年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《工银瑞信信用纯债一年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，敢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：《工银瑞信信用纯债两年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
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》”)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 四、申购与赎回的数量限制		新增： 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 五、申购和赎回的数量限制	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）的投资者收取的赎回费用，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、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）的投资者收取的赎回费用，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、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。
第七部分 基金份额的申购与赎回 七、拒绝或暂停申购的情形	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%，或者受相关限额50%集中度的情形时。 6、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，从而损害现有基金份额持有人利益的情形。 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。 9、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 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。	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%，或者受相关限额50%集中度的情形时。 6、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，从而损害现有基金份额持有人利益的情形。 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。 9、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 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。
第八部分 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。
第八部分 基金份额的申购与赎回 九、巨额赎回的处理方式		新增： （3）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赎金延期支付，该单个基金份额持有人的赎回申请按照当日的基金份额净值计算。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放弃赎回，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，但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。	
第九部分 基金份额的申购与赎回 十、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）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按照时间先后顺序处理，依次延期办理。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，但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。
第十部分 基金份额持有人权利义务 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 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：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：[2005]103号 组织形式：有限责任公司 注册资本：人民币贰亿元 存续期限：持续经营 联系电话：400 811 9999	（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 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】103号 组织形式：有限责任公司 注册资本：人民币贰亿元 存续期限：持续经营 联系电话：400-811-9999
第十一部分 基金份额持有人大会召集、议事及表决的主要程序 一、召集人和召集方式	（一）基金管理人简况 名称：招商银行股份有限公司(简称：招商银行) 住所：深圳市深南大道7088号招商银行大厦 法定代表人：傅育宁 成立时间：1987年4月8日 组织形式：股份有限公司 注册资本：215,777亿元人民币 存续期限：持续经营 基金托管资格批文及文号：证监基金字[2002]83号	（一）基金托管人简况 名称：招商银行股份有限公司(简称：招商银行) 住所：深圳市深南大道7088号招商银行大厦 法定代表人：李建红 成立时间：1987年4月8日 组织形式：股份有限公司 注册资本：25,220亿元人民币 存续期限：持续经营 基金托管资格批文及文号：证监基金字[2002]83号
第十二部分 基金的投资 一、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净值的比例不低于80%，其中信用债的投资比例不低于本基金固定收益类资产投资的80%，但在每个发现开放期前的10个工作日、受限开放期期间及受限开放期的后10个工作日、自由开放期前三个月、自由开放期期间及自由开放期结束后三个月的期间内，基金投资不受此约束。 本基金不封闭期内，基金投资不受前述投资组合比例限制，本基金在封闭期内持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不受限制，但在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%。	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净值的比例不低于80%，其中信用债的投资比例不低于本基金固定收益类资产投资的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；开放期内及受限期内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
第十二部分 基金的投资 二、投资范围 1.组合限制	（2）本基金在封闭期内持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不受限制，但在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。 …… （2）本基金在封闭期内持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不受限制，但在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%。 …… 因证券市场波动、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。	（2）本基金在封闭期内持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不受限制，但在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、应收申购款等。 …… （10）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述所规定比例限制的，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。 （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）、（9）、（10）、（11）项规定外，因证券市场波动、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个交易日内调整完毕。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。
第十二部分 基金的投资 三、投资禁止行为与限制	（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）、（9）、（10）、（11）项规定外，因证券市场波动、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。	（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%； …… 因证券市场波动、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不符合前述所规定比例限制的，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。 （11）本基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）、（9）、（10）、（11）项规定外，因证券市场波动、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。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。
第十四部分 基金资产的估值 三、估值方法	6、当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。	新增： 6、当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	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后，基金管理人应当暂停基金估值。	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后，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 （六）公开披露的基金信息 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	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，如投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本基金的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。	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，如投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本基金的特有风险，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 （七）临时报告	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； 28. 当基金管理人采用摆动定价机制进行估值；	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	（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8层 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：李晓鹏 成立日期：2005年6月21日 批准设立机关及批准设立文号：中国证券监督管理委员会【2005】103号 组织形式：有限责任公司 注册资本：人民币贰亿元 存续期限：持续经营 联系电话：400-811-9999	（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 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】103号 组织形式：有限责任公司 注册资本：人民币贰亿元 存续期限：持续经营 联系电话：400-811-9999
二、基金托管协议当事人 （一）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》、《工银瑞信信用纯债两年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。	本基金投资组合比例为：债券等固定收益类资产占基金资产净值的比例不低于80%，其中信用债券投资比例不低于本基金固定收益类资产投资的80%，但在每个发现开放期前的10个工作日、受限开放期期间及受限开放期的后10个工作日、自由开放期前三个月、自由开放期期间及自由开放期结束后三个月的期间内，基金投资不受前述投资组合比例限制，本基金在封闭期内持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不受限制，但在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。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	1. 本基金持有的债券等固定收益类资产占基金资产净值的比例不低于80%，其中信用债券的投资比例不低于本基金固定收益类资产投资的80%，但在每个发现开放期前的10个工作日、受限开放期期间及受限开放期的后10个工作日、自由开放期前三个月、自由开放期期间及自由开放期结束后三个月的期间内，基金投资不受前述投资组合比例限制，本基金在封闭期内持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不受限制，但在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。 …… 2. 本基金在封闭期内持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不受限制，但在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%。 …… 调整标准和权序： 6. 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的10%。 6. 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%，中国证监会规定的特殊品种除外。 7. 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；本基金投资于资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%，中国证监会规定的特殊品种除外； …… 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约定，除第2,9,10,11项规定外，因证券市场波动、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不符合上述约定比例的，基金管理人应当在10个工作日内进行调整。	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净值的比例不低于80%，其中信用债券的投资比例不低于本基金固定收益类资产投资的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，开放期内及受限期内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；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。 对于因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等原因导致基金的投资不符合基金合同的约定，基金管理人应在10个交易日内进行调整，以达到上述标准。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述所规定比例限制的，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。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	（六）本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。 1.本协议所称的流通受限证券，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、公开发行股票则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。	（六）本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。 1.本协议的流通受限证券，与上文提及的流动性受限资产的定义并不一致，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、公开发行股票则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 …… （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。	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后，基金管理人应当暂停基金估值。	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后，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 关于工银瑞信信用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《工银瑞信信用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”）经与基金托管人招商银行股份有限公司协商一致，对工银瑞信信用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《工银瑞信信用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《工银瑞信信用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，敢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：《工银瑞信信用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
一、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》”)和其他有关法律法规。
二、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
二、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
六、基金份额的申购与赎回 （一）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。
六、基金份额的申购与赎回 （二）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。	新增： 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。
六、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.本基金的申购费用应在投资者申购基金份额（除于A类基金份额）时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。本基金的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）的投资者收取的赎回费用，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%。 …… 5.6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%，或者受相关限额50%集中度的情形时。	5.本基金的申购费用应在投资者申购基金份额（除于A类基金份额）时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。本基金的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）的投资者收取的赎回费用，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%。 …… 5.6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%，或者受相关限额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。
六、基金份额的申购与赎回 （七）拒绝或暂停申购的情形	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、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不符合前述所规定比例限制的，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2,7,9,10,11条外，因证券市场波动、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各项规定的，基金管理人应当在10个交易日内调整完毕。法律、法规另有规定时，从其规定。	新增： 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、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述所规定比例限制的，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。 10.本基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3,10,11条外，因证券市场波动、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各项规定的，基金管理人应当在10个交易日内调整完毕。法律、法规另有规定时，从其规定。
七、基金合同当事人及权利义务 （一）基金管理人	（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 邮政编码：100033 法定代表人：李晓鹏 成立日期：2005年6月21日 批准设立机关及批准设立文号：中国证券监督管理委员会【2005】103号 组织形式：有限责任公司 注册资本：人民币贰亿元 存续期限：持续经营 联系电话：400 811 9999	（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 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】103号 组织形式：有限责任公司 注册资本：人民币贰亿元 存续期限：持续经营 联系电话：400-811-9999
七、基金合同当事人及权利义务 （二）基金托管人	（二）基金托管人 名称：中国农业银行股份有限公司 住所：北京市东城区建国门内大街69号 办公地址：北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座几层 法定代表人：蒋