（上接B181版）

3.基金托管人对基金管理人的监督管和核查	（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。 1.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而临时停牌的证券、已发行未上市证券、同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。 1.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而临时停牌的证券、已发行未上市证券、同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。
8.基金资产净值计算和会计核算（四）暂停估值与公告的情形		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
关于工银瑞信中证新能源指数分级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《工银瑞信中证新能源指数分级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河证券股份有限公司协商一致，对工银瑞信中证新能源指数分级证券投资基金（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《工银瑞信主题策略混合型证券投资基金修改基金合同、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《工银瑞信中证新能源指数分级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：《工银瑞信中证新能源指数分级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、1.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》”)、《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		
3.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、融资比例进行监督。基金托管人在下达比例调整指令时，应当保持不低于基金资产净值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。 …… （13）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。 新增： （15）本基金主动投资于流动性受限资产的市值不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；	（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、融资比例进行监督。基金托管人在下达比例调整指令时，应当保持不低于基金资产净值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。 …… （13）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。 新增： （15）本基金主动投资于流动性受限资产的市值不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；
第三部分、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	（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，对基金投资比例进行监督。	（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；本基金不受此条款比例限制） …… （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； …… 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。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基金合同约定的投资比例限定的，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。法律法规或监管部门修改或取消上述限制规定时，从其规定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。
3.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。 1.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而临时停牌的证券、已发行未上市证券、同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。 1.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而临时停牌的证券、已发行未上市证券、同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。
8.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	（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
关于工银瑞信主题策略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《工银瑞信主题策略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”）经与基金托管人交通银行股份有限公司协商一致，对工银瑞信主题策略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《工银瑞信主题策略混合型证券投资基金修改基金合同、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《工银瑞信主题策略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：《工银瑞信主题策略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》

《工银瑞信主题策略混合型证券投资基金基金合同》修改前后对照表

章节	修改前	修改后
1、前言 （一）订立本基金合同的目的、依据和原则	订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《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和补充。	订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《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和补充。
2、释义	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：指当下赎回能源份额遭遇大额申购赎回时，通过调整下期申购份额的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，从而减少对存续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。	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。
第七部分、工银新能源份额的申购与赎回（三）、申购与赎回的原则	7、当工银新能源份额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： （18）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；
第七部分、工银新能源份额的申购与赎回（六）申购份额的份额、费用及其计算	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日的投资者收取不低于1.5%的赎回费并全额计入基金财产，对持续持有期为7日以上（含7日）的赎回费用归入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于支付注册登记费和其他必要的手续费。	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日的投资者收取不低于1.5%的赎回费并全额计入基金财产，对持续持有期为7日以上（含7日）的赎回费用归入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于支付注册登记费和其他必要的手续费。
第七部分、工银新能源份额的申购与赎回（八）巨额赎回的认定及处理方式	2.巨额赎回的处理方式 增加： （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%的赎回申请实施赎回处理，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，基金管理人应按照基金份额持有人超出10%的赎回申请的比例对其赎回申请实施部分顺延赎回，所有延期的赎回申请与下一开放日赎回申请按比例顺延，以此类推，直到全部赎回为止。	2.巨额赎回的处理方式 增加： （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%的赎回申请实施赎回处理，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，基金管理人应按照基金份额持有人超出10%的赎回申请的比例对其赎回申请实施部分顺延赎回，所有延期的赎回申请与下一开放日赎回申请按比例顺延，以此类推，直到全部赎回为止。具体见相关公告。
第十一部分、基金合同当事人及权利义务（一）基金管理人	1.基金托管人基本情况 名称：中国银河证券股份有限公司 住所：中国北京西城区金融大街35号国际企业大厦C座 成立日期：2005年4月26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；资产管理及中国证监会许可的其他业务 联系电话：400-888-8888	1.基金托管人基本情况 名称：中国银河证券股份有限公司 住所：中国北京西城区金融大街35号国际企业大厦C座 成立日期：2007年1月26日 批准设立机关及批准设立文号：证监会、证监机构字[2007]25号 组织形式：股份有限公司（上市） 注册资本：人民币75.37亿元人民币 存续期间：持续经营 基金托管资格批文及文号：证监许可【2014】629号 经营范围：证券经纪；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券承销与保荐；证券自营；融资融券；证券投资基金托管；为期货公司提供中间介绍业务；代销金融产品业务；基金托管。
第十一部分、基金合同当事人及权利义务（二）基金托管人	1.基金托管人基本情况 名称：中国银河证券股份有限公司 住所：中国北京西城区金融大街35号国际企业大厦C座 成立日期：2007年1月26日 批准设立机关及批准设立文号：证监会、证监机构字[2007]25号 组织形式：股份有限公司（上市） 注册资本：人民币75.37亿元人民币 存续期间：持续经营 基金托管资格批文及文号：证监许可【2014】629号 经营范围：证券经纪；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券承销与保荐；证券自营；融资融券；证券投资基金托管；为期货公司提供中间介绍业务；代销金融产品业务；基金托管。	1.基金托管人基本情况 名称：中国银河证券股份有限公司 住所：中国北京西城区金融大街35号国际企业大厦C座 成立日期：2007年1月26日 批准设立机关及批准设立文号：证监会、证监机构字[2007]25号 组织形式：股份有限公司（上市） 注册资本：人民币75.37亿元人民币 存续期间：持续经营 基金托管资格批文及文号：证监许可【2014】629号 经营范围：证券经纪；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券承销与保荐；证券自营；融资融券；证券投资基金托管；为期货公司提供中间介绍业务；代销金融产品业务；基金托管。
第十七部分 基金的投资（二）、投资范围	本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的90%，其中权证于申证新能源指数成分股和备选成分股的资产不低于非现金基金资产的80%。任何交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。股指期货、权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。	本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的90%，其中权证于申证新能源指数成分股和备选成分股的资产不低于非现金基金资产的80%。任何交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。股指期货、权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。
第十七部分、基金的投资（四）、投资限制1.组合限制	…… （13）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。 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；	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；
第十七部分、基金的投资（五）、投资比例	1.基金投资组合比例限制 （1）本基金投资于股票、债券、权证等资产的比例为：股票资产占基金资产的比例为60%-95%，债券、现金等金融工具及其他资产占基金资产的比例为5%-40%。现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。	1.基金投资组合比例限制 （1）本基金投资于股票、债券、权证等资产的比例为：股票资产占基金资产的比例为60%-95%，债券、现金等金融工具及其他资产占基金资产的比例为5%-40%。现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的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。
第十八部分、基金的申购、赎回与转换（一）申购与赎回的原则	1.在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资人的申购申请： …… （6）接受某笔或者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达50%，或者变相规避50%集中度的情形； （7）某笔或某些申购申请超过基金管理人设定的单日单一申购金额上限的； （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一致的，基金管理人应当暂停基金估值；	1.在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资人的申购申请： …… （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达50%，或者变相规避50%集中度的情形； （7）某笔或某些申购申请超过基金管理人设定的单日单一申购金额上限的； （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一致的，基金管理人应当暂停接受基金申购申请的措施；
第十八部分、基金的申购、赎回与转换（二）申购与赎回的限制	1.（1）在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资人的申购申请： …… （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一致的，基金管理人应当暂停基金估值；	发生上述1）、2）、3）、4）项情形时，基金管理人应根据有关规定在指定媒体上发表基金管理人网站上刊登暂停申购公告。 如果因为上述原因而暂停申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。
第十八部分、基金的申购、赎回与转换（三）申购与赎回的原则		发生上述1）、2）、3）、4）、8）、9）项情形时，基金管理人应根据有关规定在指定媒体上及基金管理人网站上刊登暂停申购公告。 如果因为上述原因而暂停申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。
第十八部分、基金的申购、赎回与转换（四）申购份额的计算方法		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接受基金申购申请的措施。
第十八部分、基金的申购、赎回与转换（五）申购与赎回的数额限制		新增： 6、当基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人在履行适当程序后，可以采用摆动定价机制，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。
第十八部分、基金的申购、赎回与转换（六）申购与赎回的价格、费用及其他事项		新增： （18）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。
第十八部分、基金的申购、赎回与转换（七）拒绝或暂停申购的情形及处理		新增： （19）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； 14）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）、（18）、（20）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，但中国证监会规定的特殊情形或本合同另有约定的除外。
第十八部分、基金的申购、赎回与转换（八）巨额赎回的认定及处理方式	2.基金投资组合比例限制 （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%的赎回申请实施赎回处理，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。	2.基金投资组合比例限制 （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%的赎回申请实施赎回处理，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按比例顺延，以此类推，直到全部赎回为止。具体见相关公告。
第十八部分、基金的申购、赎回与转换（九）巨额赎回的认定及处理方式		（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%的赎回申请实施赎回处理，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按比例顺延，以此类推，直到全部赎回为止。具体见相关公告。
第十八部分、基金的申购、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： 5）授受某笔或某些申购申请有可能导致单一投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）授受某笔或某些申购申请有可能导致单一投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； 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
第十八部分、基金的申购、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1）、2）、3）、4）、8）、9）项情形时，基金管理人应根据有关规定在指定媒体上及基金管理人网站上刊登暂停申购公告。
第十八部分、基金的申购、赎回与转换（十一）拒绝或暂停赎回的情形及处理		新增： 6、当基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人在履行适当程序后，可以采用摆动定价机制，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。
第十八部分、基金的申购、赎回与转换（十二）在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资人的赎回申请：		新增： （18）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；
第十八部分、基金的申购、赎回与转换（十三）巨额赎回的处理方式		新增： （19）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； 20）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）、（12）、（18）、（20）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，但中国证监会规定的特殊情形或本合同另有约定的除外。
第十八部分、基金的申购、赎回与转换（十四）暂停接受投资人的赎回申请的情形		新增： （20）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、基金的申购、赎回与转换（十五）临时报告与公告		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；

工银瑞信基金管理有限公司
关于工银瑞信总回报灵活配置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《工银瑞信总回报灵活配置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，对工银瑞信总回报灵活配置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《工银瑞信总回报灵活配置混合型证券投资基金修改基金合同、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《工银瑞信总回报灵活配置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：《工银瑞信总回报灵活配置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》

《工银瑞信总回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》修改前后文对照表

章节	修改前	修改后
第一部分 前言 1.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》”)、《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
第七部分 基金份额的申购与赎回 五、申购和赎回的数额限制		新增： 70.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。
第七部分 基金份额的申购与赎回 五、申购和赎回的数额限制		新增： 3、当授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份额上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，以保护存量基金份额持有人的合法权益，具体规定请参阅相关公告。
第七部分 基金份额的申购与赎回 六、基金份额的申购、赎回及转换的价格、费用及其他事项	6、当基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人在履行适当程序后，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： 7、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、基金的投资 一、投资目标	1.基金托管人基本情况 名称：中国银行股份有限公司 住所：北京市西城区金融大街1号 成立日期：1983年10月31日 批准设立机关及批准设立文号：国务院国发(1983)字第81号文和中国人民银行复字【1987】140号文 基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】26号 组织形式：股份有限公司 注册资本：569310亿元人民币 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；办理票据贴现；买卖政府债券、金融债券；买卖或代理买卖股票以外的有价证券；从事外汇业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；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；经营结汇、售汇业务。 注册资本：人民币1707亿元人民币 组织形式：股份有限公司 存续期间：持续经营	1.基金托管人基本情况 名称：中国银行股份有限公司 住所：北京市西城区金融大街1号 成立日期：1983年10月31日 批准设立机关及批准设立文号：国务院国发(1983)字第81号文和中国人民银行复字【1987】140号文 基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】26号 组织形式：股份有限公司 注册资本：569310亿元人民币 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；办理票据贴现；买卖政府债券、金融债券；买卖或代理买卖股票以外的有价证券；从事外汇业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；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；经营结汇、售汇业务。 注册资本：人民币1707亿元人民币 组织形式：股份有限公司 存续期间：持续经营
第十四部分、基金的投资 四、投资限制 1.组合限制	1.（1）在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资人的赎回申请： …… （10）当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无