（上接B189版）

基金的投资	在“3.本基金投资的短期融资券的信用评级应不低于以下标准”增加“5.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。”
基金资产的估值	“（六）暂停估值的情形”中，增加： “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，基金管理人应当暂停估值；”
基金的信息披露	“（七）基金年度报告、基金半年度报告（合称“基金定期报告”）”中，增加： “6.基金运作期间，如现有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本基金的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。 7.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。 8.本基金应当在年度报告、半年度报告中，至少披露报告期末基金前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。”
基金的信息披露	“（八）临时报告与公告”中，增加： “27.发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资人赎回等重大事项时； 28.本基金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；”

关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改信诚货币市场证券投资基金托管协议的内容说明

章节	修订内容
全文	“信诚基金管理有限公司”修改为： “中信保诚基金管理有限公司”
一、基金托管协议当事人	“（二）基金托管人”中， “法定代表人：王洪章”修改为“法定代表人：田国立” “注册资本：叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元”修改为“注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾捌万陆仟肆佰捌拾陆元整”
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	“（六）投资限制”之“2.本基金的投资组合将遵循以下比例限制”中加 “（9）当基金管理人管理且由本基金托管人托管的金融货币市场基金投资于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%； （10）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6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%； （11）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30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6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%； （12）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。 （13）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的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本条所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资。 （14）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； 将原文： “除上述第(5)条外，因基金规模或市场变化导致本基金投资组合不符合以上比例限制的，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。” 修改为： “除上述第(1)、(8)、(13)、(14)条外，因基金规模或市场变化导致本基金投资组合不符合以上比例限制的，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。”
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	在“（二）”增加“6.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。”
八、基金资产净值计算和会计核算	（四）暂停估值的情形 增加“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，基金管理人应当暂停估值；”
十、基金信息披露	在“（三）”中增加： “(4)发生基金合同规定的暂停基金资产估值情形；”

中信保诚基金管理有限公司关于信诚季季定期开放债券型证券投资基金修订基金合同、托管协议部分条款及调整赎回费相关规则的公告

根据《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《流动性风险管理规定》）及基金合同和托管协议的有关规定，经与基金托管人协商一致并报监管机构备案，中信保诚基金管理有限公司决定对信诚季季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、托管协议进行修订，并对本基金赎回费相关规则进行调整。现将相关事宜公告如下：

一、基金合同和托管协议修订

基金合同、托管协议具体修订内容详见附件《关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改信诚季季定期开放债券型证券投资基金合同的内容说明》、《关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改信诚季季定期开放债券型证券投资基金托管协议的内容说明》。本次修订属于基金合同约定的基金管理人与基金托管人可以协商一致变更基金合同的事项，并已履行规定程序，符合相关法律法规及基金合同的规定。

二、赎回费相关规则调整

鉴于《流动性风险管理规定》规定“基金管理人应当强化对投资者短期投资行为的管理，对除货币市场基金与交易型开放式指数基金以外的开放式基金，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”，基金管理人将本基金持续持有期少于7日（不含）对应的赎回费率调整为1.5%，上述对投资者收取的赎回费计入基金财产的比例调整为100%（转换业务涉及的本基金赎回费相关规则按上述规则进行调整）。

三、上述基金合同、托管协议的修订及赎回费相关规则调整等事宜自2018年3月31日起生效。对于2018年3月30日15:00之前的赎回申请，适用调整前的赎回费规则；对于2018年3月30日15:00之后的赎回申请，适用调整后的赎回费规则。基金管理人将在届时更新本基金招募说明书时一并更新相关内容。

四、投资者可通过以下途径了解或咨询详请：

中信保诚基金管理有限公司

公司网址：www.citicprufunds.com.cn

客服电话：400-666-0066

五、风险提示

（1）本次基金管理人系根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修订本基金的《基金合同》和《托管协议》，所修订内容可能对本基金投资运作及投资者办理基金申购、赎回业务产生一定影响，包括且不限于：出于流动性风险管理需要增加或调整了基金的部分投资限制规定；对投资者持有本基金少于7日（不含）收取1.5%的短期赎回费；在规定的特定情形下可能会对投资者的申购/赎回申请数量进行限制、临时拒绝或暂停申购/赎回申请、对部分赎回申请进行延期办理等，由此可能导致投资者的申购/赎回申请无法全部及时处理，从而可能影响投资者的资金安排及投资计划。敬请投资者关注以上变化和影响，并仔细阅读本基金修订后的基金合同及相关法律文件，审慎进行投资决策。

（2）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。本基金管理人提醒投资者，投资者投资于基金前应认真阅读本基金的基金合同、招募说明书等文件。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

附件：《关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改信诚季季定期开放债券型证券投资基金托管协议的内容说明》

中信保诚基金管理有限公司

2018年3月24日

附件：

关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改信诚季季定期开放债券型证券投资基金托管协议的内容说明

章节	修订内容
全文	“信诚基金管理有限公司”修改为“中信保诚基金管理有限公司”
一、基金托管协议当事人	“（一）基金管理人”中， “住所：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层”修改为： “住所：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层” “办公地址：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层”修改为： “办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层”
一、基金托管协议当事人	“（二）基金托管人”中， “法定代表人：吕明”修改为： “法定代表人：陈四清” “注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰捌拾玖万叁仟贰佰玖拾元整”修改为： “注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰捌拾玖万叁仟贰佰玖拾元整”
二、基托管协议的依据、目的和原则	“（一）订立托管协议的依据”中，增加： “……、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》。”
三、基托管人对基金管理人的业务监督和核查	在“（一）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》中实际可以监控事项的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督，主要包括以下方面：”之“2.对基金投资比例进行监督”中，增加： “8）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的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本条所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资。”
三、基托管人对基金管理人的业务监督和核查	在“（二）基托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》中实际可以监控事项的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督，主要包括以下方面：”之“2.对基金投资比例进行监督”中，增加： “8）本基金投资境内资产时，本基金管理人管理的日本托管人托管的全部开放式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开放式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%； 9）本基金投资境内资产时，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%； 10.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本条所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资。 12.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；本基金管理人承诺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与基金合同约定的投资范围保持一致，并承担由于不一致所导致的风险或损失；
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 （3）占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障基金份额持有人的利益，已决定延迟估值的； （5）中国证监会和基金合同认定的其他情形。
十、基金信息披露	（三）基金托管人和基金管理人在信息披露中的职责和信息披露程序 1.职责 …… 当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金信息： 无
十八、基金的信息披露	（六）暂停估值的情形 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，基金管理人应当暂停基金估值； 5.法律法规、中国证监会认定的其它情形。
十八、基金的信息披露	（七）基金年度报告、基金半年度报告、基金季度报告 基金管理人应当在基金年度报告、基金半年度报告和半年度报告的披露期限内，将基金投资组合的情况披露于中国证监会指定媒体上。 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季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告文件中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基金的特有风险。 基金管理人应当在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。
八、基金资产净值计算和会计核算	（八）暂停估值的情形 “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，基金管理人应当暂停估值；” “7.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基金份额申购、赎回；”
十八、基金的信息披露	（八）临时报告与公告 26.发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资人赎回等重大事项时；

?信诚精萃成长混合型证券投资基金托管协议修改前后文对照表

章节	原文条款	修改后条款
	内容	内容
二、基金托管协议当事人	（一）基金管理人 名称：信诚基金管理有限公司 住所：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层 办公地址：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层 （二）基金托管人 法定代表人：王洪章	（一）基金管理人 名称：中信保诚基金管理有限公司 住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层 办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层 （二）基金托管人 法定代表人：田国立
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： 9.保持不低于基金资产净值5%的现金或者剩期在一年以内的政府债券；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）本基金管理人管理的全部开放式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本基金托管人托管的全部开放式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%； （11）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%；	（二）基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。基托管人按下述比例和调整期限进行监督： 9.保持不低于基金资产净值5%的现金或者剩期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、应收申购款等； （10）本基金管理人管理的全部开放式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本基托管人托管的全部开放式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%； （11）本基托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金托管人托管的全部开放式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本基托管人托管的全部开放式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%； （12）本基托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基托管人托管的全部开放式基金投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基托管人托管的全部开放式基金资产净值的15%；
三、基托管人对基金管理人的业务监督和核查	（三）基托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基托管人托管的全部开放式基金投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基托管人托管的全部开放式基金资产净值的15%； 因证券市场波动、上市公司停牌、基托管人托管的全部开放式基金规模变动等基托管人之外的因素致使基托管人托管的全部开放式基金不符合本条所规定比例限制的，基托管人不得主动新增流动性受限资产的投资。	（三）基托管人根据有关法律法规的规定及基托管人托管的全部开放式基金投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基托管人托管的全部开放式基金资产净值的15%； 因证券市场波动、上市公司停牌、基托管人托管的全部开放式基金规模变动等基托管人之外的因素致使基托管人托管的全部开放式基金不符合本条所规定比例限制的，基托管人不得主动新增流动性受限资产的投资。
三、基托管人对基托管人的业务监督和核查	（四）暂停估值与公告基托管人的情形 （3）占基托管人相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基托管人为保障基托管人托管的全部开放式基托管人托管的全部开放式基托管人托管的全部开放式