中信保诚基金管理有限公司关于以通讯方式召开信诚稳利债券型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告

中信保诚基金管理有限公司已于2018年9月17日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站(www.citicprufunds.com.cn)发布了《中信保诚基金管理有限公司关于以通讯方式召开信诚稳利债券型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》,并于2018年9月18日发布了第一次提示性公告。为了使本次基金份额持有人大会顺利召开,根据基金合同的相关规定,现发布本次基金份额持有人大会的第二次提示性公告。

一、会议基本情况

中信保诚基金管理有限公司(以下简称"基金管理人")依据中国证监会证监许可 [2016]1565号文注册的信诚稳利债券型证券投资基金(以下简称"本基金")的基金合同于2016年8月4日生效。

综合市场需求分析,为维护基金份额持有人利益,根据《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》和《信诚稳利债券型证券投资基金基金合同》(以下简称"《基金合同》")有关规定,本基金管理人决定召开本基金的基金份额持有人大会,审议《关于信诚稳利债券型证券投资基金变更注册有关事项的议案》。会议的具体安排如下:

1、会议召开方式:通讯方式。

2、会议投票表决起止时间:自2018年9月21日起,至2018年10月16日17:00止(以表决票收件人收到表决票时间为准)。

3、通讯表决票将送达至本基金管理人,具体地址和联系方式如下:

收件人:中信保诚基金管理有限公司客户服务部

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

邮政编码:200120

联系电话:400 6660066

请在信封表面注明:"信诚稳利债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决专用"

二、会议审议事项

本次持有人大会审议的事项为《关于信诚稳利债券型证券投资基金变更注册有关事项的议案》(以下简称"《议案》"),《议案》详见附件一。

三、权益登记日

本次大会的权益登记日为2018年9月20日,即在2018年9月20日交易时间结束后,在本基金登记机构登记在册的本基金全体基金份额持有人均有权参加本次基金份额持有人大会。

四、投票方式

本次持有人大会的表决方式仅限于纸质表决。纸质表决票的填写和寄交方式如下:

1、本次会议表决票见附件三。基金份额持有人可通过剪报、复印或登陆基金管理人网站(http://www.citicprufunds.com.cn/)下载等方式获取表决票。

2、基金份额持有人应当按照表决票的要求填写相关内容,其中:

(1)个人投资者自行投票的,需在表决票上签字,并提供本人身份证件复印件。

(2)机构投资者自行投票的,需在表决票上加盖本单位公章(包括基金管理人认可的业务专用章,下同),并提供加盖公章的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文或登记证书复印件等)。

(3)合格境外机构投资者自行投票的,需在表决票上加盖本机构公章(如有)或由授权代表在表决票上签字(如无公章),并提供该授权代表的有效身份证件、护照或其他身份证明文件的复印件,该合格境外机构投资者所签署的授权委托书或者证明该授权代表有权代表该合格境外机构投资者签署表决票的其他证明文件,以及该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件,以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件。

(4)基金份额持有人可根据本公告"五、授权"的规定授权其他个人或机构代其在本次基金份额持有人大会上投票。

(5)以上各项中的公章、批文、开户证明及登记证书,以基金管理人的认可为准。

3、基金份额持有人或其代理人需将填妥的表决票和所需的相关文件于会议投票表决起止时间内(以本基金管理人收到表决票时间为准)通过专人送交或邮寄的方式送达至本基金管理人的办公地址(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),并请在信封表面注明:"信诚稳利债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决专用"。

五、授权

为便于基金份额持有人有尽可能多的机会参与本次大会,使基金份额持有人在本次大会上充分表达其意志,基金份额持有人除可以直接投票外,还可以授权他人代其在基金份额持有人大会上投票。根据法律法规的规定及《基金合同》的约定,基金份额持有人授权他人在基金份额持有人大会上表决需符合以下规则:

1、委托人

本基金的基金份额持有人自本公告发布之日起可委托他人代理行使本次基金份额持有人大会的表决权。投资者在申购本基金的同时也可以签署授权委托书,待申购申请确认后,授权委托书自动有效。

基金份额持有人(含新申购投资者,下同)授权他人行使表决权的票数按该基金份额持有人在权益登记日所持有的全部基金份额数计算,一份基金份额代表一票表决权。基金份额持有人在权益登记日未持有本基金基金份额的,授权无效。

基金份额持有人在权益登记日是否持有基金份额以及所持有的基金份额的数额以本基金登记机构的登记为准。

2、受托人(代理人)

基金份额持有人可以委托本基金的基金管理人以及其他符合法律规定的机构和个人,代为行使本次基金份额持有人大会上的表决权。

3、授权方式

本基金的基金份额持有人仅可通过纸面授权方式授权代理人代为行使表决权。授权委托书的样本请见本公告附件二。基金份额持有人可通过剪报、复印或登录基金管理人网站下载(http://www.citicprufunds.com.cn/)等方式获取授权委托书样本。

(1)基金份额持有人进行纸面授权所需提供的文件

① 个人基金份额持有人委托他人投票的,应由代理人在表决票上签字或盖章,代理人应提供由委托人填妥并签署的授权委托书原件(授权委托书的格式可参考附件二的样本),并提供基金份额持有人的个人身份证明文件复印件。如代理人为个人,还需提供代理人的身份证明文件复印件;如代理人为机构,还需提供该代理人加盖公章的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等)。

② 机构基金份额持有人委托他人投票的,应由代理人在表决票上签字或盖章,代理人应提供由委托人填妥的授权委托书原件(授权委托书的格式可参考附件二的样本),并在授权委托书上加盖该机构公章,并提供该机构持有人加盖公章的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等)。如代理人为个人,还需提供代理人的身份证明文件复印件;如代理人为机构,还需提供该代理人加盖公章的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等)。

③ 合格境外机构投资者委托他人投票的,应由代理人在表决票上签字或盖章,并提供该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件,以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件,以及填妥的授权委托书原件。如代理人为个人,还需提供代理人的身份证件复印件;如代理人为机构,还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等)。

④ 以上各项中的公章、批文、开户证明及登记证书,以基金管理人的认可为准。

(2)对基金管理人的纸面授权文件的送达

基金份额持有人通过纸面方式对基金管理人进行授权的,可通过邮寄授权文件和所需的相关文件或在基金管理人柜台办理授权事宜。

基金份额持有人也可将其填妥的授权委托书和所需的相关文件专人送交基金管理人办公地点。

4、授权效力确定规则

(1) 如果同一基金份额持有人持有的全部基金份额存在多次有效纸面方式授权的,以最后一次纸面授权为准。不能确定最后一次纸面授权的,如最后时间收到的授权委托有多次,以表示具体表决意见的纸面授权为准;

(2)如果委托人签署的授权委托书没有表示具体表决意见的,视为委托人授权代理人按照代理人意志行使表决权;

(3)基金份额以非纸面方式进行授权的,为无效授权;

(4)如委托人在授权委托表示中表达多种表决意见的,视为委托人授权代理人选择其中一种授权表示行使表决权;

(5)如委托人既进行委托授权,又送达了有效表决票,则以有效表决票为准。

5、对基金管理人的授权截止时间

基金管理人接受基金份额持有人授权的截止时间为2018年10月11日16:30时。将纸面授权委托书和所需的相关文件寄送或专人送达给基金管理人的指定地址的,授权时间以收到时间为准。

六、计票

1、本次通讯会议的计票方式为:由本基金管理人授权的两名监督员在基金托管人(中信银行股份有限公司)授权代表的监督下在表决截止日后2个工作日内进行计票,并由公证机关对其计票过程予以公证。

2、基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权。

3、表决票效力的认定如下:

(1)纸面表决票通过专人送交的,表决时间以实际递交时间为准;邮寄送达本公告规定的收件人的,表决时间以收件人收到时间为准。2018年10月16日17:00以后送达基金管理人的,为无效表决。

(2)纸面表决票的效力认定

① 纸面表决票填写完整清晰,所提供文件符合本会议通知规定,且在截止时间之前送达本公告规定的收件人的,为有效表决票;有效表决票按表决意见计入相应的表决结果,其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

② 如纸面表决票上的表决意见未选、表决意见模糊不清或相互矛盾的,但其他各项符合会议通知规定的,视为弃权表决,计入有效表决票;并按"弃权"计入对应的表决结果,其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

③ 如纸面表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的,或未能提供有效证明基金份额持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的,或未能在截止时间之前送达本公告规定的收件人的,均为无效表决票;无效表决票不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

④ 基金份额持有人重复提交纸面表决票的,如各表决票表决意见相同,则视为同一表决票;如各表决票表决意见不相同,则按如下原则处理:

i.送达时间不是同一天的,以最后送达的填写有效的表决票为准,先送达的表决票视为被撤回;

ii.送达时间为同一天的,视为在同一表决票上做出了不同表决意见,计入弃权表决票;

iii.送达时间按如下原则确定:专人送达的以实际递交时间为准,邮寄的以本公告规定的收件人收到的时间为准。

七、决议生效条件

1、本人直接出具书面意见和授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金份额的50%以上(含50%,下同);

2、《关于信诚稳利债券型证券投资基金变更注册有关事项的议案》应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的50%以上(含50%)通过方为有效;

3、本次基金份额持有人大会决议通过的事项,本基金管理人自通过之日起五日内报中国证监会备案,基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

八、本次大会相关机构

1、召集人:中信保诚基金管理有限公司

客服电话:400 6660066

联系人:金芬泉

联系电话:400 666 0066 转9

电子邮件:ds@citicprufunds.com.cn

传真:(021) 5012 0886

网址:http://www.citicprufunds.com.cn

2、公证机构:上海市东方公证处

地址:上海市凤阳路660号

联系电话:(021)62154848,62178903(直线)

联系人:林奇

3、见证律师:上海市通力律师事务所

注册及办公地址:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19楼

联系电话:(021) 31358666

九、二次召集基金份额持有人大会及二次授权

根据《基金法》的规定及《基金合同》的约定,本次持有人大会需要直接出具书面意见和授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额合计占权益登记日基金份额的50%以上(含50%,下同)。如果本次基金份额持有人大会不符合前述要求而不能够成功召开,本基金管理人可在规定时间内就同一议案重新召集基金份额持有人大会。

重新召集基金份额持有人大会时,除非授权文件另有载明,本次基金份额持有人大会授权期间基金份额持有人作出的各类授权依然有效,但如果授权方式发生变化或者基金份额持有人重新作出授权,则以最新方式或最新授权为准,详细说明见届时发布的重新召集基金份额持有人大会的通知。

十、重要提示

1、请基金份额持有人在邮寄表决票时,充分考虑邮寄在途时间,提前寄出表决票。

2、如本次基金份额持有人大会不能成功召开或未能通过本次大会审议的议案,根据《基金法》及《基金合同》的有关规定,本基金可能会再次召开基金份额持有人大会。

3、基金管理人将在发布本公告后2个工作日内连续公布相关提示性公告,就本次会议相关情况做必要说明,请予以留意。

4、上述基金份额持有人大会有关公告可通过中信保诚基金管理有限公司网站查阅,投资者如有任何疑问,可致电400 6660066咨询。

5、本公告的有关内容由中信保诚基金管理有限公司解释。

附件一:《关于信诚稳利债券型证券投资基金变更注册有关事项的议案》

附件二:授权委托书(样本)

附件三:信诚稳利债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决票

附件四:信诚稳利债券型证券投资基金基金合同修改方案说明书

中信保诚基金管理有限公司

2018年9月19日

附件一:

关于信诚稳利债券型证券投资基金变更注册有关事项的议案

信诚稳利债券型证券投资基金基金份额持有人:

综合市场需求分析,为更好地满足投资者需求,维护基金份额持有人的利益,根据《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》等法律法规的规定和《信诚稳利债券型证券投资基金基金合同》(以下简称"《基金合同》")有关约定,经基金管理人与基金托管人中信银行股份有限公司(以下简称"中信银行")协商一致,提议将"信诚稳利债券型证券投资基金"变更为"中信保诚稳利债券型证券投资基金",主要内容包括:变更基金名称、投资范围、投资策略、投资限制、估值方法及其他内容,同时基金管理人根据现行有效的法律法规要求及拟变更后的中信保诚稳利债券型证券投资基金的产品特征对基金合同的其他相关内容进行修改。具体内容详见附件四《信诚稳利债券型证券投资基金基金合同修改方案说明书》。

为实施修订《基金合同》的方案,提议授权基金管理人办理本次基金变更注册的有关具体事宜,包括但不限于根据《信诚稳利债券型证券投资基金基金合同修改方案说明书》相关内容对《基金合同》进行修订等。

以上提案,请予审议。

基金管理人:中信保诚基金管理有限公司

二〇一八年九月十七日

附件二:

授权委托书

本人(或本机构)特此授权代表本人(或本机构)参加投票截止日为2018年10月16日的以通讯方式召开的信诚稳利债券型证券投资基金基金份额持有人大会,并代为全权行使所有议案的表决权。表决意见以受托人(代理人)的表决意见为准。本人(或本机构)同意代理人转授权,转授权仅限一次。

上述授权有效期自签署日起至审议上述事项的基金份额持有人大会会议结束之日止。若信诚稳利债券型证券投资基金在法定时间内重新召开审议相同议案的基金份额持有人大会的,本授权继续有效。

委托人(签字/盖章):

委托人证件号码(填写):

受托人(代理人)(签字/盖章):

受托人(代理人)证件号码(填写):

签署日期: 年月日

授权委托书填写注意事项:

1、本授权书仅为样本供基金份额持有人参考使用。基金份额持有人也可以自行制作符合法律规定及《信诚稳利债券型证券投资基金基金合同》要求的授权委托书。

2、基金份额持有人可以委托本基金的基金管理人以及其他符合法律规定的机构和个人,代为行使本次基金份额持有人大会上的表决权。

3、以上授权是基金份额持有人就其持有的本基金全部份额(含截至权益登记日的未付累计收益)向代理人所做授权。

4、本授权委托书(样本)中"委托人证件号码",指基金份额持有人认购或申购本基金时的证件号码或该证件号码的更新。

5、如本次持有人大会权益登记日,投资者未持有本基金的基金份额,则其授权无效。

附件三:

信诚稳利债券型证券投资基金
基金份额持有人大会表决票

基金份额持有人姓名或名称:			
证件号码(身份证件号/营业执照号)			
审议事项	同意	反对	弃权
关于信诚稳利债券型证券投资基金变更注册有关事项的议案			
基金份额持有人(或受托人、代理人)签名或盖章 2018年 月 日			
说明:请以打"√"方式在审议事项后注明表决意见。持有人必须选择一种且只能选择一种表决意见。表决意见代表基金份额持有人所持全部基金份额的表决意见。表决意见未选、表决意见模糊不清或相互矛盾的表决票(但其他各项符合会议通知规定的)均视为投票人放弃表决权利,其所持全部基金份额的表决结果均计为"弃权"。签名或盖章部分填写不完整、不清晰的表决票计为无效表决票。			

附件四:

信诚稳利债券型证券投资基金基金合同修改方案说明书

一、重要提示

1、信诚稳利债券型证券投资基金基金合同于2016年8月4日生效。综合市场需求分析,为更好地满足投资者需求,维护基金份额持有人利益,根据《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》等法律法规和《信诚稳利债券型证券投资基金基金合同》(以下简称"《基金合同》")等有关规定,经基金管理人与基金托管人中信银行股份有限公司(以下简称"中信银行")协商一致,决定召开基金份额持有人大会,审议《关于信诚稳利债券型证券投资基金变更注册有关事项的议案》。

2、《关于信诚稳利债券型证券投资基金变更注册有关事项的议案》需经提交有效表决票的基金份额持有人或其代理人所持表决权的50%以上(含50%)通过,存在无法获得基金份额持有人大会表决通过的可能。

3、基金份额持有人大会表决通过的决议需依法报中国证监会备案,且基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。中国证监会对本次信诚稳利债券型证券投资基金基金份额持有人大会决议的备案,不表明其对变更注册后基金的投资价值、市场前景或投资者的收益做出实质性判断或保证。

二、《基金合同》主要修改内容

(一)基金名称

基金名称由"信诚稳利债券型证券投资基金"变更为"中信保诚稳利债券型证券投资基金"。

(二)变更后基金的投资目标、投资范围、投资策略和投资限制等相关内容

"一、投资目标

在严格控制风险的基础上,本基金主要通过投资于精选的优质债券,力求实现基金资产的长期稳定增值,为投资者实现超越业绩比较基准的收益。

二、投资范围

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具,包括债券(含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、国债期货等法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

本基金不投资于股票、权证等权益类资产,也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。

基金的投资组合比例为:本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%;每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例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、应收申购款等。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

三、投资策略

1、资产配置策略

本基金投资组合中债券、现金各自的长期均衡比重,依照本基金的特征和风险偏好而确定。本基金定位为债券型基金,其资产配置以债券为主,并不因市场的中短期变化而改变。在不同的市场条件下,本基金将综合考虑宏观环境、市场估值水平、风险水平以及市场情绪,在一定的范围内对资产配置调整,以降低系统性风险对基金收益的影响。

2、债券投资策略

(1)类属资产配置策略

在整体资产配置的基础上,本基金将通过考量不同类型固定收益品种的信用风险、市场风险、流动性风险、税收等因素,研究各投资品种的利差及其变化趋势,制定债券类属资产配置策略,以获取债券类属之间利差变化所带来的潜在收益。

(2)普通债券投资策略

对于普通债券,本基金将在严格控制目标久期及保证基金资产流动性的前提下,采用目标久期控制、期限结构配置、信用利差策略、相对价值配置等策略进行主动投资。

1)目标久期控制

本基金首先建立包含消费物价指数、固定资产投资、工业品价格指数、货币供应量等众多宏观经济变量的回归模型。通过回归分析建立宏观经济指标与不同种类债券收益率之间的数量关系,在此基础上结合当前市场状况,预测未来市场利率及不同期限债券收益率走势变化,确定目标久期。当预测未来市场利率将上升时,降低组合久期;当预测未来利率下降时,增加组合久期。

2)期限结构配置

在确定债券组合的久期之后,本基金将采用收益率曲线分析策略,自上而下进行期限结构配置。具体来说,本基金将通过对央行政策、经济增长率、通货膨胀率等众多因素的分析来预测收益率曲线形状的可能变化,从而通过子弹型、哑铃型、梯形等配置方法,确定在短、中、长期债券的投资比例。

3)信用利差策略

一般来说,信用债券的收益率主要由基准收益率与反应信用债券信用水平的信用利差组成。本基金将从宏观经济环境与信用债市场供需状况两个方面对市场信用利差进行分析。首先,对于宏观经济环境,当宏观经济向好时,企业盈利能力好,资金充裕,市场整体信用利差将可能收窄;当宏观经济恶化时,企业盈利能力差,资金紧缺,市场整体信用利差将可能扩大。其次,对于信用债市场供求,本基金将从市场容量、信用债结构及流动性等几方面进行分析。

4)相对价值投资策略

本基金将对市场上同类债券的收益率、久期、信用度、流动性等指标进行比较,寻找其他指标相同而某一指标相对更具有投资价值的债券,并进行投资。

5)回购放大策略

本基金将在控制杠杆风险的前提下,适当地通过回购融资来提高资金利用率,以增强组合收益。

3、资产支持证券的投资策略

本基金将综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成和质量等因素,研究资产支持证券的收益和风险匹配情况。采用数量化的定价模型来跟踪债券的价格走势,在严格控制投资风险的基础上选择合适的投资对象以获得稳定收益。

4、国债期货投资策略

本基金将按照相关法律法规的规定,根据风险管理的原则,在风险可控的前提下,投资国债期货。本基金将充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征,结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析,对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平等指标进行跟踪监控,在最大限度保证基金资产安全的基础上,力求实现委托财产的长期稳定增值。

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)本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%;

(2)每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计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、应收申购款等;

(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%;

(5)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%;

(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%;

(8) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%;

(9)本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间,如果其信用等级下降、不再符合投资标准,应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出;

(10)本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%;债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不得展期;

(11)基金资产总值不得超过基金资产净值的140%;

(12)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、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;

(13)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;

(14)本基金参与国债期货交易,应当遵守下列要求:

1)本基金在任何交易日日终,持有的买入国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;

2)本基金在任何交易日日终,持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的30%;

3)本基金所持有的债券(不含到期日在一年以内的政府债券)市值和买入、卖出国债期货合约价值,合计(轧差计算)应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定;

4)本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的30%;

(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、期货市场波动、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,除以上第(2)、(9)、(12)、(13)条以外,基金管理人应当在10个交易日内进行调整,但法律法规或中国证监会规定的特殊情形除外。

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有关约定。在上述期间内,本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。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。

法律法规或监管部门取消上述限制或调整上述限制的,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制或按调整后的规定执行,但须提前公告,不需要经基金份额持有人大会审议。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:

(1)承销证券;

(2)违反规定向他人贷款或者提供担保;

(3)从事承担无限责任的投资;

(4)向其基金管理人、基金托管人出资;

(5)从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;

(6)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券,或者从事其他重大关联交易的,应当符合基金的投资目标和投资策略,遵循基金份额持有人利益优先原则,防范利益冲突,建立健全内部审批机制和评估机制,按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意,并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议,并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制,如适用于本基金,则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准。

五、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:中证综合债指数收益率

中证综合债指数是中证指数有限公司编制的综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数。该指数的推出旨在更全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势,为债券投资者提供更切合的市场基准。根据本基金的投资范围和投资比例,选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时,本基金管理人可以在与基金托管人协商一致后,履行相关程序后变更业绩比较基准并及时公告。

六、风险收益特征

本基金为债券型基金,预期风险与预期收益低于股票型基金与混合型基金,高于货币市场基金。"

(三)变更后基金的估值方法

"1、证券交易所上市的有价证券的估值

(1)交易所上市的有价证券,以其估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值;估值日无交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化以及证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,以最近交易日的市价(收盘价)估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格。

(2)交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(基金合同另有规定的除外),选取估值日第三方估值机构提供的相应品种对应的估值净价估值。

(3)对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券,采用估值技术确定其公允价值,如基金管理人认为成本能够近似体现公允价值,基金管理人应持续评估上述做法的适当性,并在情况发生改变时做出适当调整。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:

对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券,对存在活跃市场的情况下,以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值;对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下,对市场报价进行调整以确认计量日的公允价值;对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下,则采用估值技术确定其公允价值。

3、全国银行间市场交易品种的估值

(1)全国银行间市场交易的固定收益品种,以第三方估值机构提供的价格数据估值。

(2)对银行间市场未上市,且第三方估值机构未提供估值价格的债券,在发行利率与二级市场利率不存在明显差异、未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下,按成本估值。

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的,按债券所处的市场分别估值。

5、国债期货合约,一般以估值当日结算价进行,估值当日无结算价的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化的,采用最近交易日结算价估值。

6、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。

7、税收

对于按照中国法律法规和基金投资所在地的法律法规规定应交纳的各项税金,本基金将按权责发生制原则进行估值;对于因税收规定调整或其他原因导致基金实际交纳税金与估算的应交税金有差异的,基金将在相关税金调整日或实际支付日进行相应的估值调整。

8、相关法律法规以及监管部门有强制规定的,从其规定。如有新增事项,按国家最新规定估值。

9、当发生大额申购或赎回情形时,基金管理人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。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时,应立即通知对方,共同查明原因,双方协商解决。

根据有关法律法规,基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任,因此,就与本基金有关的会计问题,如经相关各方在平等基础上充分讨论后,仍无法达成一致的意见,按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。"

(四)其他相关事项的修改

删除基金合同中关于基金份额发售的部分,并补充基金的历史沿革、基金的存续、投资国债期货的信息披露等内容。

基金管理人按照法律法规的规定及变更注册后的中信保诚稳利债券型证券投资基金的产品特征、根据基金份额持有人大会决议修订基金合同的其他内容。

综上所述,基金管理人拟提请基金份额持有人大会授权基金管理人按照现行有效的法律法规的规定及拟变更后的中信保诚稳利债券型证券投资基金的产品特性相应修订《基金合同》的内容。具体修改内容见本说明之附件《信诚稳利债券型证券投资基金基金合同修订对照表》。

三、《中信保诚稳利债券型证券投资基金基金合同》 基金合同的生效

自本次基金份额持有人大会决议表决通过的下一工作日起,修订后的《中信保诚稳利债券型证券投资基金基金合同》生效,《信诚稳利债券型证券投资基金基金合同》自同日起失效。

四、《基金合同》修改的主要风险及预备措施

在《基金合同》修改之前,基金管理人将提前向基金份额持有人征询意见。如有必要,基金管理人将根据基金份额持有人意见,对《基金合同》修改方案进行适当的修订,并重新公告。基金管理人可在必要情况下,推迟基金份额持有人大会的召开时间。

如果《议案》未获得持有人大会的批准,基金管理人将按照有关规定重新向持有人大会提交本基金合同修改方案议案,具体请见基金管理人届时发布的公告。

五、基金管理人联系方式

基金份额持有人若对本方案的内容有任何意见和建议,请通过以下方式联系

基金管理人:中信保诚基金管理有限公司

客服电话:400-666-0066

公司网站:www.citicprufunds.com.cn

中信保诚基金管理有限公司

2018年9月17日

附件:《信诚稳利债券型证券投资基金基金合同修订对照表》

章节	原文条款 内容	修订后条款 内容
基金名称	信诚稳利债券型证券投资基金	中信保诚稳利债券型证券投资基金
第一部分 前言	三、信诚稳利债券型证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集,并经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")注册。 中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。	三、中信保诚稳利债券型证券投资基金由信诚稳利债券型证券投资基金变更而来,信诚稳利债券型证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、《信诚稳利债券型证券投资基金基金合同》及其他有关规定募集,并经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")注册。 中国证监会对信诚稳利债券型证券投资基金变更为本基金的注册,并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对本基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。
第二部分 释义	1、基金或本基金:指信诚稳利债券型证券投资基金	1、基金或本基金:指中信保诚稳利债券型证券投资基金,本基金由信诚稳利债券型证券投资基金变更而来
	7、基金份额发售公告:指《信诚稳利债券型证券投资基金基金份额发售公告》	无
	16、银行业监督管理机构:指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会	15、银行业监督管理机构:指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会
	23、基金销售业务:指基金管理人或销售机构宣传推介基金,发售基金份额,办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务	22、基金销售业务:指基金管理人或销售机构宣传推介基金,办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务
	28、基金交易账户:指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务而引起基金的基金份额变动及结余情况的账户	27、基金交易账户:指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务而引起基金的基金份额变动及结余情况的账户
	29、基金合同生效日:指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件,基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕,并获得中国证监会书面确认的日期	28、基金合同生效日:指《中信保诚稳利债券型证券投资基金基金合同》生效日,《信诚稳利债券型证券投资基金基金合同》自同一日失效
	31、基金募集期:指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间,最长不得超过三个月 39、认购:指在基金募集期内,投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为	无
	54、基金份额类别:指根据认购费、申购费、销售服务费、赎回费收取方式的不同将基金份额分为不同的类别,各基金份额类别分别设置代码,分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值 55、A类基金份额:指在投资者认购、申购时收取认购费、申购费,在投资者赎回时根据持有期限收取赎回费的基金份额,或简称"A类份额" 56、C类基金份额:指不收取认购/申购费用,但对持有期限少于30日的本类别基金份额的赎回收取赎回费,且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,或简称"C类份额"	51、基金份额类别:指根据申购费、销售服务费、赎回费收取方式的不同将基金份额分为不同的类别,各基金份额类别分别设置代码,分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值 52、A类基金份额:指在投资者申购时收取申购费,在投资者赎回时根据持有期限收取赎回费的基金份额,或简称"A类份额" 53、C类基金份额:指不收取申购费用,但对持有期限少于30日的本类别基金份额的赎回收取赎回费,且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,或简称"C类份额"
	无	55、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
第三部分 基金的基本情况	五、基金的最低募集份额总额 本基金的最低募集份额总额为2亿份,最低募集金额为2亿元。 六、基金份额发售面值和认购费用 本基金基金份额发售面值为人民币1.00元。 本基金A类基金份额收取认购费用,C类基金份额不收取认购费。本基金A类基金份额的认购费率情况由基金管理人决定,并在招募说明书中列示。	无
	八、基金份额的类别 本基金根据认购/申购费用、赎回费用收取方式的不同,将基金份额分为A、C两类。在投资者认购、申购时收取认购费、申购费,在投资者赎回时根据持有期限收取赎回费的基金份额,称为A类基金份额;不收取认购/申购费用,但对持有期限少于30日的本类别基金份额的赎回收取赎回费,且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为C类基金份额。	六、基金份额的类别 本基金根据申购费用、赎回费用收取方式的不同,将基金份额分为A、C两类。在投资者申购时收取申购费,在投资者赎回时根据持有期限收取赎回费的基金份额,称为A类基金份额;不收取申购费用,但对持有期限少于30日的本类别基金份额的赎回收取赎回费,且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为C类基金份额。
第四部分 基金的历史沿革	第四部分基金份额的发售 一、基金份额的发售时间、发售方式、发售对象 1、发售时间 自基金份额发售之日起最长不得超过3个月,具体发售时间见基金份额发售公告。 2、发售方式 通过各销售机构的基金销售网点公开发售,各销售机构的具体名单见基金份额发售公告以及基金管理人届时发布的调整销售机构的相关公告。 3、发售对象 符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。 二、基金份额的认购 1、认购费用 本基金A类基金份额收取认购费,本基金C类基金份额不收取认购费。本基金A类基金份额的认购费率由基金管理人决定,并在招募说明书中列示。基金认购费用不列入基金财产。 2、募集期利息的处理方式 有效认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有,其中利息转份额以登记机构的记录为准。 3、基金认购份额的计算 基金认购份额具体的计算方法在招募说明书中列示。 4、认购份额余额的处理方式 认购份额的计算保留到小数点后2位,小数点后第3位四舍五入,由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。 三、基金份额认购金额的限制 1、投资人认购时,需按销售机构规定的方式全额缴款。 2、基金管理人可以对每个基金交易账户的单笔最低认购金额进行限制,具体限制请参看招募说明书或相关公告。 3、基金管理人可以对募集期间的单个投资人的累计认购金额进行限制,具体限制和处理方法请参看招募说明书或相关公告。 4、投资人在募集期内可以多次认购基金份额,但已受理的认购申请不允许撤销。	第四部分基金的历史沿革 中信保诚稳利债券型证券投资基金由信诚稳利债券型证券投资基金变更而成。 信诚稳利债券型证券投资基金由中国证监会证监许可[2016]1565号文准予注册,于2016年8月1日至2016年8月1日期间公开发售。经中国证监会书面确认,《信诚稳利债券型证券投资基金基金合同》于2016年8月4日生效。基金管理人为中信保诚基金管理有限公司,基金托管人为中信银行股份有限公司。 2018年X月X日,信诚稳利债券型证券投资基金基金份额持有人大会以通讯方式召开,大会讨论通过了信诚稳利债券型证券投资基金调整基金合同修改的议案,内容包括信诚稳利债券型证券投资基金调整投资范围、投资策略、信息披露、基金估值以及修订基金合同等,并同意将"信诚稳利债券型证券投资基金"更名为"中信保诚稳利债券型证券投资基金",上述基金份额持有人大会决议生效。自2018年X月X日起,《中信保诚稳利债券型证券投资基金基金合同》生效,《信诚稳利债券型证券投资基金基金合同》同日起失效。
第五部分 基金的存续	第五部分基金备案 一、基金备案的条件 本基金自基金份额发售之日起3个月内,在基金募集份额总额不少于2亿份,基金募集金额不少于2亿元人民币且基金认购人数不少于200人的条件下,基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售,并在10日内聘请法定验资机构验资,自收到验资报告之日起10日内,向中国证监会办理基金备案手续。 基金募集达到基金备案条件的,自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起,《基金合同》生效;否则《基金合同》不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对《基金合同》生效事宜予以公告。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户,在基金募集行为结束前,任何人不得动用。 二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式 如果募集期限届满,未满足基金备案条件,基金管理人应当承担下列责任: 1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用; 2、在基金募集期限届满后30日内返还投资者已缴纳的款项,并加计银行同期活期存款利息; 3、如基金募集失败,基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。 三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模 ……	第五部分基金的存续 自2018年X月X日起,《中信保诚稳利债券型证券投资基金基金合同》生效,《信诚稳利债券型证券投资基金基金合同》同日起失效。中信保诚稳利债券型证券投资基金由信诚稳利债券型证券投资基金变更而来。 基金合同生效后,本基金登记机构将进行本基金必要信息的变更。 ……
第六部分 基金份额的申购与赎回	四、申购与赎回的程序 2、申购和赎回的款项支付 ……如遇证券交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行交换系统故障或其他非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响了业务流程,则赎回款项划付时间相应顺延。 3、申购和赎回申请的确认 ……销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到申购、赎回申请。申购、赎回申请的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况,投资者应及时查询。若申购不成功,则申购款项退还给投资人。	四、申购与赎回的程序 2、申购和赎回的款项支付 ……如遇证券、期货交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行交换系统故障或其他非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响了业务流程,则赎回款项划付时间相应顺延。 3、申购和赎回申请的确认 ……销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到申购、赎回申请。申购、赎回申请的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况,投资者应及时查询。若申购不成功,则申购款项退还给投资人。
	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 无	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 7、当发生大额申购或赎回情形时,基金管理人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。
	七、拒绝或暂停申购的情形 3、证券交易所交易时间非正常停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。	七、拒绝或暂停申购的情形 3、证券、期货交易所交易时间非正常停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 3、证券交易所交易时间非正常停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 3、证券、期货交易所交易时间非正常停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
	九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 (2)部分延期赎回:当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时,基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的10%的前提下,可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请,应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例,确定当日受理的赎回份额;对于未能赎回部分,投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的,将自动转入下一个开放日继续赎回,直到全部赎回为止;选择取消赎回的,当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。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。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择,投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。 本基金发生巨额赎回时,在单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额10%以上的赎回申请的情形下,基金管理人可以延期办理赎回申请:对于该基金份额持有人当日赎回申请超过上一开放日基金总份额10%以上的那部分赎回申请,基金管理人可以进行延期办理;对于该基金份额持有人未超过上述比例的部分,基金管理人根据前段"(1)全额赎回"或"(2)部分延期赎回"的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。但是,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。	九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 (2)部分延期赎回:当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时,基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的10%的前提下,可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请,应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例,确定当日受理的赎回份额;对于未能赎回部分,投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的,将自动转入下一个开放日继续赎回,直到全部赎回为止;选择取消赎回的,当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。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。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择,投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。 本基金发生巨额赎回时,在单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额10%以上的赎回申请的情形下,基金管理人可以延期办理赎回申请:对于该基金份额持有人当日赎回申请超过上一开放日基金总份额10%以上的那部分赎回申请,基金管理人可以进行延期办理;对于该基金份额持有人未超过上述比例的部分,基金管理人根据前段"(1)全额赎回"或"(2)部分延期赎回"的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。所有延期的赎回申请与下一开放日的赎回申请一并处理,无优先权并以下一开放日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。但是,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。
第七部分 基金合同当事人及权利义务	一、基金管理人 (二)基金管理人的权利与义务 1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人的权利包括但不限于: (16)在符合有关法律、法规的前提下,制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户等业务规则; 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人的义务包括但不限于: (1)依法募集资金,办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜; (8)采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定,按有关规定计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回的价格; (24)基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件,《基金合同》不能生效,基金管理人承担全部募集费用,将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人;	一、基金管理人 (二)基金管理人的权利与义务 1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人的权利包括但不限于: (16)在符合有关法律、法规的前提下,制订和调整有关基金申购、赎回、转换和非交易过户等业务规则,在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调整托管费率、管理费率及调高赎回费率、销售服务费率之外的相关费率结构和收费方式; 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人的义务包括但不限于: (1)依法募集资金,办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的申购、赎回和登记事宜; (8)采取适当合理的措施使计算基金份额申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定,按有关规定计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回的价格;
	二、基金托管人 (二)基金托管人的权利与义务 1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金托管人的权利包括但不限于: (4)根据相关市场规则,为基金开设证券账户及投资所需其他账户,为基金办理证券交易资金清算; 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金托管人的义务包括但不限于: (6)按规定开设基金财产的资金账户、证券账户及投资所需其他账户,按照《基金合同》的约定,根据基金管理人的投资指令,及时办理清算、交割事宜;	二、基金托管人 (二)基金托管人的权利与义务 1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金托管人的权利包括但不限于: (4)根据相关市场规则,为基金开设资金账户、证券账户、期货账户及投资所需其他账户,为基金办理证券交易资金清算; 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金托管人的义务包括但不限于: (6)按规定开设基金财产的资金账户、证券账户、期货账户及投资所需其他账户,按照《基金合同》的约定,根据基金管理人的投资指令,及时办理清算、交割事宜;
	三、基金份额持有人 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金份额持有人的义务包括但不限于: (4)缴纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用;	三、基金份额持有人 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金份额持有人的义务包括但不限于: (4)缴纳基金申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用;
第八部分 基金份额持有人大会	一、召开事由 1、当出现或需要决定下列事由之一的,应当召开基金份额持有人大会: (5)调整基金管理人、基金托管人的报酬标准,但法律法规要求提高该等报酬标准或销售服务费率的除外; (12)对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项; 2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改,不需召开基金份额持有人大会: …… (6)按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。	一、召开事由 1、当出现或需要决定下列事由之一的,应当召开基金份额持有人大会: (5)调整基金管理人、基金托管人的报酬标准或提高销售服务费率,但法律法规要求调整该等报酬标准或提高销售服务费率的除外; (12)对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项; 2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改,不需召开基金份额持有人大会: …… (6)在法律法规的规定和基金合同的约定范围内以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下,基金管理人、登记机构、基金销售机构可调整有关申购、赎回、非交易过户、转托管等业务规则; (7)在法律法规的规定和基金合同的约定范围内以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下,基金可推出新业务或服务; (8)按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。
	三、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式 2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下,由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。	三、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式 2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下,由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。
第十二部分 基金的投资	二、投资范围 本基金的投资范围主要为具有良好流动性的固定收益类品种,包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、银行存款、同业存单等法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。 …… 基金的投资组合比例为:本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%;本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例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、应收申购款等。	二、投资范围 本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具,包括债券(含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、国债期货等法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。 …… 基金的投资组合比例为:本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%;每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例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、应收申购款等。
	三、投资策略 …… 2、固定收益类资产的投资策略 ……	三、投资策略 …… 2、债券投资策略 …… 4、国债期货投资策略 本基金将按照相关法律法规的规定,根据风险管理的原则,在风险可控的前提下,投资国债期货。本基金将充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征,结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析,对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平等指标进行跟踪监控,在最大限度保证基金资产安全的基础上,力求实现委托财产的长期稳定增值。
	四、投资限制 1、组合限制 (2)本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计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、应收申购款等; …… 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,除以上第(2)、(9)、(12)、(13)条以外,基金管理人应当在10个交易日内进行调整,但法律法规或中国证监会规定的特殊情形除外。	四、投资限制 1、组合限制 (2)每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计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、应收申购款等; (14)本基金参与国债期货交易,应当遵守下列要求: 1)本基金在任何交易日日终,持有的买入国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%; 2)本基金在任何交易日日终,持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的30%; 3)本基金所持有的债券(不含到期日在一年以内的政府债券)市值和买入、卖出国债期货合约价值,合计(轧差计算)应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定; 4)本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的30%; …… 因证券、期货市场波动、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,除以上第(2)、(9)、(12)、(13)条以外,基金管理人应当在10个交易日内进行调整,但法律法规或中国证监会规定的特殊情形除外。
	五、业绩比较基准 本基金的业绩比较基准为:中证综合债指数收益率 如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时,本基金管理人可以在与基金托管人协商一致后变更业绩比较基准并及时公告,但不需要召集基金份额持有人大会。	五、业绩比较基准 本基金的业绩比较基准为:中证综合债指数收益率 中证综合债指数是中证指数有限公司编制的综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数。该指数的推出旨在更全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势,为债券投资者提供更切合的市场基准。根据本基金的投资范围和投资比例,选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。 如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时,本基金管理人可以在与基金托管人协商一致后,履行相关程序后变更业绩比较基准并及时公告。
	六、风险收益特征 本基金为债券型基金,预期风险与预期收益低于股票型基金与混合型基金,高于货币市场基金,属于证券投资基金中的中等偏低风险收益品种。	六、风险收益特征 本基金为债券型基金,预期风险与预期收益低于股票型基金与混合型基金,高于货币市场基金。
第十三部分 基金的财产	三、基金财产的账户 基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户以及投资所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。	三、基金财产的账户 基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户、期货账户以及投资所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。
第十四部分 基金资产估值	二、估值对象 基金所拥有的债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。	二、估值对象 基金所拥有的债券、国债期货合约和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。
	三、估值方法 1、证券交易所上市的有价证券的估值 (1)交易所上市的有价证券(包括股票、权证等),以其估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值;估值日无交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,以最近交易日的市价(收盘价)估值……	三、估值方法 1、证券交易所上市的有价证券的估值 (1)交易所上市的有价证券,以其估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值;估值日无交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化以及证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,以最近交易日的市价(收盘价)估值…… 4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的,按债券所处的市场分别估值。 5、国债期货合约,一般以估值当日结算价进行估值,估值当日无结算价的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化的,采用最近交易日结算价估值。 9、当发生大额申购或赎回情形时,基金管理人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。
	六、暂停估值的情形 1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;	六、暂停估值的情形 1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;
	八、特殊情况的处理 1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第4项进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。 2、由于证券交易场所及其登记结算公司发送的数据错误原因或由于其他不可抗力原因……	八、特殊情况的处理 1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第6项进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。 2、由于证券、期货交易场所及其登记结算公司发送的数据错误原因或由于其他不可抗力原因……
第十五部分 基金费用与税收	一、基金费用的种类 7、基金的证券交易或结算费用;	一、基金费用的种类 7、基金的证券、期货交易或结算费用;
	三、不列入基金费用的项目 3、《基金合同》生效前的相关费用;	三、不列入基金费用的项目 3、《基金合同》生效前的相关费用按照《信诚稳利债券型证券投资基金基金合同》相关标准执行;
第十七部分 基金的会计与审计	一、基金会计政策 2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日;基金首次募集的会计年度按如下原则:如果《基金合同》生效少于2个月,可以并入下一个会计年度披露;	一、基金会计政策 2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日;
第十八部分 基金的信息披露	五、公开披露的基金信息 (一)基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议 2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项,说明基金认购、申购和赎回安排…… 3、…… 基金募集申请经中国证监会注册后,基金管理人在基金份额发售的3日前,将基金招募说明书、《基金合同》摘要登载在指定媒介上;基金管理人、基金托管人应当将《基金合同》、基金托管协议登载在网站上。	五、公开披露的基金信息 (一)基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议 2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项,说明基金申购和赎回安排…… 3、…… 基金变更申请经中国证监会准予后,基金管理人按照相关规定,将基金招募说明书、《基金合同》摘要登载在指定媒介上;基金管理人、基金托管人应当将《基金合同》、基金托管协议登载在网站上。
	(二)基金份额发售公告 基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告,并在披露招募说明书的当日登载于指定媒介上。 (三)《基金合同》生效公告 基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在指定媒介上登载《基金合同》生效公告。	无
	(四)基金资产净值、各类基金份额的基金份额净值 在开始办理基金份额申购或者赎回后,基金管理人应当在每个开放日的次日,通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介,披露开放日的各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。	(二)基金资产净值、各类基金份额的基金份额净值 在开始办理基金份额申购或者赎回后,基金管理人应当在每个开放日的次日,通过网站、基金份额销售网点以及其他媒介,披露开放日的各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。
	(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 …… 《基金合同》生效不足2个月的,基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。	(四)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 ……
	(七)临时报告 7、基金募集期延长;	(五)临时报告 26、基金管理人采用摆动定价机制进行估值;
	(十)投资资产支持证券的信息	(八)投资资产支持证券的信息披露
	无	(九)投资国债期货的信息披露 基金在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露国债期货交易情况,包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等,并充分揭示国债期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标。
	八、暂停或延迟信息披露的情形 2、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;	八、暂停或延迟信息披露的情形 2、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;
第二十二部分 基金合同的效力	1、《基金合同》经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字并在募集结束后经基金管理人向中国证监会办理基金备案手续,并经中国证监会书面确认后生效。	1、《信诚稳利债券型证券投资基金基金合同》经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字,并在募集结束后经基金管理人向中国证监会办理基金备案手续,并经中国证监会书面确认后生效。 经信诚稳利债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决通过,自2018年**月**日起,《中信保诚稳利债券型证券投资基金基金合同》生效,《信诚稳利债券型证券投资基金基金合同》失效。

信诚中证信息安全指数分级证券投资基金之信息安B交易价格波动提示公告

近期,中信保诚基金管理有限公司(以下简称"本基金管理人")旗下信诚中证信息安全指数分级证券投资基金B 份额(场内简称:信息安B,代码:150310)二级市场交易价格连续大幅波动,2018年9月17日,信息安B二级市场收盘价为0.380元,相对于当日0.273元的基金份额净值,溢价幅度达到39.2%。截止2018年9月18日,信息安B二级市场收盘价为0.405元,明显高于基金份额参考净值,投资者如果盲目投资,可能遭受重大损失

为此,本基金管理人提示如下:

1、信息安B具有预期风险、预期收益较高的特征。由于信息安B内含杠杆机制的设计,信息安B基金份额参考净值的变动幅度将大于信诚信息安全份额(场内简称:信息安全,基础份额,代码:165523)净值和信诚信息安全A份额(场内简称:信息安A,代码:150309)参考净值的变动幅度,即信息安B的波动性要高于其他两类份额,其承担的风险也较高。信息安B的持有人会因杠杆倍数的变化而承担不同程度的投资风险。

2、信息安B的交易价格,除了有份额参考净值变化的风险外,还会受到市场的系统性风险、流动性风险等其他风险影响,可能使投资人面临损失。

3、截至2018年9月18日,信息安B的基金份额参考净值接近基金合同约定的不定期份额折算阈值。不定期份额折算后,信息安B的溢价率可能发生较大变化。

特提请参与二级市场交易的投资者注意高溢价所带来的风险。

4、截至本公告披露日,信诚中证信息安全指数分级证券投资基金运作正常。本基金管理人仍将严格按照法律法规及基金合同进行投资运作。

5、截至本公告披露日,信诚中证信息安全指数分级证券投资基金无其他应披露而未披露的重大信息。本基金管理人仍将严格按照有关规定和要求,及时做好信息披露工作。

6、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资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的基金合同和招募说明书等相关法律文件。

敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

中信保诚基金管理有限公司

2018年9月19日