

关于中信建投稳溢保本混合型证券投资基金修改基金合同及托管协议的公告

根据中国证监会 2017 年 8 月 31 日发布的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》，中信建投基金管理有限公司（以下简称“本公司”）经与基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司协商一致，并报监管机构备案，对《中信建投稳溢保本混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）等相关法律文件进行修订。本次修改后的《基金合同》自 2018 年 3 月 31 日起生效，具体修改内容详见附件《中信建投稳溢保本混合型证券投资基金基金合同和托管协议修改对照表》。

一、重要提示

1. 本基金《基金合同》的修订已经履行了规定的程序，符合相关法律法规及《基金合同》的规定。

2. 本公司将据此在更新上述基金招募说明书时，对上述相关内容进行相应修改。

3. 投资者可访问本公司网站（www.cfund108.com）或拨打本公司客服电话（4009-108-108）咨询相关情况。

二、风险提示：

本公司承诺以诚实信用、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。敬请投资者留意投资风险。

特此公告。

附件：《中信建投稳溢保本混合型证券投资基金基金合同和托管协议修改对照表》

中信建投基金管理有限公司

2018年3月23日

附件：

中信建投稳溢保本混合型稳溢保本混合型证券投资基金
基金合同和托管协议修改对照表

1、《中信建投稳溢保本混合型稳溢保本混合型证券投资基金基金合同》修改对照表

页码	章节	原合同内容	修订后的基金合同内容	修改理由
1	前言	2、订立本基金合同的依据是……《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……《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、 <u>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</u> (以下简称“ <u>《流动性风险管理规定》</u> ”)和其他有关法律法规。	补充本基金的适用法律
4	释义		增加： <u>13、《流动性风险管理规定》：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</u>	补充《流动性风险管理规定》的释义
9	释义		增加： <u>69、流动性受限资产：是指由于法律法规、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</u>	根据《流动性风险管理规定》第 40 条补充

			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	
18	基金份额的 申购与赎回		增加： <u>4、当接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。具体请参见相关公告。</u>	根据《流动性风险管理规定》第 19 条的规定补充
19	基金份额的 申购与赎回	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。赎回费用纳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。赎回费用纳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登记费和其他必要的手续费， <u>其中对持续持有期少于 7 日的投资者将收取不低于 1.5% 的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。</u>	根据《流动性风险管理规定》第 23 条补充强制赎回费的规定
20	基金份额的 申购与赎回	7、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、7 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时……。	增加： <u>7、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资人持有基金份额数的比例达到或者超过基金份额总数的 50%，或者有可能导致投资人变相规避前述 50% 比例要求的情形。</u> <u>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。</u> 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、7、9 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时……。	根据《流动性风险管理规定》第 19 条补充投资者集中度相关条款 根据《流动性风险管理规定》第 24 条补充应当暂停申购的情形

20	基金份额的 申购与赎回		<p>增加： 5、<u>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。</u></p>	根据《流动性风险管理规定》第 24 条的规定补充应当暂停赎回的情形
22	基金份额的 申购与赎回		<p>增加： <u>(3) 如发生单个开放日内单个基金份额持有人申请赎回的基金份额占前一开放日基金总份额的比例超过 30%时，本基金管理人可以对该单个基金份额持有人超过前述约定比例的赎回申请实施延期赎回，具体措施为：</u> <u>对于该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人有权根据前段“（1）全部赎回”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。如下一开放日，该单一基金份额持有人剩余未赎回部分仍旧超出前述比例约定的，继续按前述规则处理，直至该单一基金份额持有人单个开放日内申请赎回的基金份额占前一开放日基金总份额的比例低于前述比例。</u></p>	根据《流动性风险管理规定》第 21 条第 2 款的规定增加
24	基金合同当 事人及权利 义务	<p>一、基金管理人 (一) 基金管理人简况 名称：中信建投基金管理有限公司 住所：北京市怀柔区桥梓镇八龙桥雅苑 3 号楼 1 室 法定代表人：蒋月勤 设立日期：2013 年 9 月 9 日 批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可〔2013〕1108 号 组织形式：有限责任公司</p>	<p>一、基金管理人 (一) 基金管理人简况 名称：中信建投基金管理有限公司 住所：北京市怀柔区桥梓镇八龙桥雅苑 3 号楼 1 室 法定代表人：蒋月勤 设立日期：2013 年 9 月 9 日 批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可〔2013〕1108 号 组织形式：有限责任公司 注册资本：<u>30000</u> 万元</p>	

		注册资本： <u>15000</u> 万元	
27	基金合同当事人及权利义务	<p>(一) 基金托管人简况</p> <p>名称：上海浦东发展银行股份有限公司 住所：上海市中山东一路12号 法定代表人：<u>吉晓辉</u> 成立时间：1992年10月19日 批准设立机关和批准设立文号：中国人民银行银复1992(601)号 组织形式：股份有限公司(上市) 注册资本：人民币<u>196.53</u>亿元 存续期间：永久存续 基金托管资格批文及文号：证监基金字(2003)105号</p>	<p>(一) 基金托管人简况</p> <p>名称：上海浦东发展银行股份有限公司 住所：上海市中山东一路12号 法定代表人：<u>高国富</u> 成立时间：1992年10月19日 批准设立机关和批准设立文号：中国人民银行银复1992(601)号 组织形式：股份有限公司(上市) 注册资本：人民币<u>293.52</u>亿元 存续期间：永久存续 基金托管资格批文及文号：证监基金字(2003)105号</p>
53	基金的投资	本基金的投资组合比例为：债券、货币市场工具等固定收益类资产占基金资产的比例不低于60%，其中基金应保留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；股票、权证、股指期货等权益类资产占基金资产的比例不高于40%。	本基金的投资组合比例为：债券、货币市场工具等固定收益类资产占基金资产的比例不低于60%，其中基金应保留不低于基金资产净值5%的现金(不包括 <u>结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>)或到期日在一年以内的政府债券；股票、权证、股指期货等权益类资产占基金资产的比例不高于40%。
56	基金的投资	(2)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；	(2)保持不低于基金资产净值5%的现金(不包括 <u>结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>)或者到期日在一年以内的政府债券；
57	基金的投资		增加： 根据《流动性风险管理规

		<p>(17) 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。</p> <p>除上述第(11)项以外，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，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。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。</p>	<p>(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；</p> <p>(18) 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；</p> <p>(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%；</p> <p>(20) 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。</p> <p>除上述第(2)、(12)、(17)、(18)项以外，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，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。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。</p>	<p>定》第 15、16、17 条增加</p>
59	基金的投资	<p>本基金的投资组合比例为：债券、货币市场工具等固定收益类资产占基金资产的比例不低于 60%，其中基金应保留不低于基金资产净值 5%</p>	<p>本基金的投资组合比例为：债券、货币市场工具等固定收益类资产占基金资产的比例不低于 60%，其中基金应保留不低于基金资产净值 5%的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券；</p>	

		的现金或到期日在一年以内的政府债券；股票、权证、股指期货等权益类资产占基金资产的比例不高于 40%。	股票、权证、股指期货等权益类资产占基金资产的比例不高于 40%。	
62	基金的投资	(2)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；	(2) 保持不低于基金资产净值 5%的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券；	
63	基金的投资	<p>(17) 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。</p> <p>除上述第(11)项以外，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</p>	<p>增加：</p> <p><u>(18) 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；</u></p> <p><u>(19) 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；</u></p> <p><u>(20) 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%；</u></p> <p><u>(21) 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。</u></p> <p>除上述第(2)、(12)、(18)、(19)项以外，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，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。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。</p>	

		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除外。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。		
71	基金资产估值		增加： <u>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，基金管理人经与基金托管人协商确认后，应当暂停基金估值；</u>	根据《流动性风险管理规定》第 24 条增加
80	基金的信息披露		增加： <u>如报告期内出现单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情形，基金管理人应当在季度报告、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本基金的特有风险。</u> <u>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。</u>	根据《流动性风险管理规定》第 26 条及第 27 条补充定期报告的内容
81	基金的信息披露		增加： <u>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；</u>	根据《流动性风险管理规定》第 26 条补充临时报告的内容

2、《中信建投稳溢保本混合型稳溢保本混合型证券投资基金托管协议》修改对照表

原托管协议页码	章节	原托管协议内容	修订后的托管协议内容	修改理由
5	基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	本基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的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，基金保留的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%，国债期货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。	本基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的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，基金保留的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）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%，国债期货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。	根据《流动性风险管理规定》第 18 条增加
6	基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	本基金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，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；	<p>2、本基金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，保持不低于基金资产净值 5% 的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券；</p> <p>增加：</p> <p>16、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；</p> <p>17、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</p>	<p>根据《流动性风险管理规定》第 18 条增加</p> <p>根据《流动性风险管理规定》第 15、16、17 条增加</p>

		<p><u>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。</u></p> <p>除上述第 <u>11</u> 项以外，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的投资比例的，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除外。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。</p>	<p><u>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；</u></p> <p><u>18、本基金管理人管理的、且由本基金托管人托管的全部开放式基金（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、且由本基金托管人托管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%；</u></p> <p><u>19、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。</u></p> <p>除上述第 <u>2、12、16、17</u> 项以外，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的投资比例的，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除外。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。</p>	
28	基金资产净值计算和会计核算		<p>增加：</p> <p><u>8、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。</u></p>	根据《流动性风险管理规定》第 25 条增加
30	基金资产净值计算和会计核算		<p>（四）暂停估值的情形</p> <p>增加：</p> <p><u>（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</u></p>	根据《流动性风险管理规定》第 24 条增加

			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，基金管理人经与基金托管人协商确认后，应当暂停基金估值；	
--	--	--	---	--

注:托管协议中存在其他笔误修正，不在对照表中列出。