

工银瑞信基金管理有限公司

关于深证红利交易型开放式指数证券投资基金修改 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《深证红利交易型开放式指数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农业银行股份有限公司协商一致,对深证红利交易型开放式指数证券投资基金(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《深证红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同、托管协议修改前后文对照表》。

二、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《深证红利交易型开放式指数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：《深证红利交易型开放式指数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
<p>第一部分 前言</p> <p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</p>	<p>2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《中华人民共和国合同法》、《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。</p>	<p>2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《中华人民共和国合同法》、《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》”)、《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。</p>
<p>第二部分 释义</p>		<p>新增：</p> <p>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</p>
<p>第二部分 释义</p>		<p>新增：</p> <p>70、流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操</p>

		<p>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</p>
<p>第七部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>五、申购和赎回的数量限制</p>		<p>新增:</p> <p><u>3、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份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。</u></p>
<p>第七部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>七、暂停申购、赎回的情形</p>		<p>新增:</p> <p><u>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,基金管理人应当采取延缓支付赎回对价或暂停接受基金申购赎回申请的措施;</u></p>

		8、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份额上限的；
第七部分 基金份额的申购与赎回 七、暂停申购、赎回的情形	发生上述情形之一时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，并及时公告。已接受的赎回申请，基金管理人应当足额兑付。在暂停申购、赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购、赎回业务的办理，并予以公告。	发生上述情形之一时（ 除第 8 项外 ），基金管理人应在当日报中国证监会备案，并及时公告。已接受的赎回申请，基金管理人应当足额兑付。在暂停申购、赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购、赎回业务的办理，并予以公告。
第九部分 基金合同当事人及权利义务 一、基金管理人 (一)基金管理人	<p>名称：工银瑞信基金管理有限公司</p> <p>住所：北京市西城区金融大街丙 17 号北京银行大厦</p> <p>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</p> <p>邮政编码：100140</p> <p>法定代表人：杨凯生</p> <p>成立时间：2005 年 6 月 21 日</p> <p>批准设立机关：中国证监会</p> <p>批准设立文号：中国证监会证监基金字[2005]93 号 中国银监会银监复[2005]105 号</p> <p>组织形式：有限责任公司</p> <p>注册资本：人民币 2 亿元</p>	<p>名称：工银瑞信基金管理有限公司</p> <p>住所：北京市西城区金融大街 5 号、甲 5 号 6 层甲 5 号 601、甲 5 号 7 层甲 5 号 701、甲 5 号 8 层甲 5 号 801、甲 5 号 9 层甲 5 号 901</p> <p>法定代表人：郭特华</p> <p>设立日期： 2005 年 6 月 21 日</p> <p>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</p> <p>组织形式：有限责任公司</p> <p>注册资本：贰亿元人民币</p> <p>存续期限：持续经营</p> <p>联系电话：400-811-9999</p>

	存续期间：持续经营	
第九部分 基金合同 当事人及权利义务 (二) 基金托管人	<p>名称：中国农业银行股份有限公司</p> <p>住所：北京市东城区建国门内大街 69 号</p> <p>办公地址：北京市西三环北路 100 号金玉大厦</p> <p>法定代表人：项俊波</p> <p>成立时间：2009 年 1 月 15 日</p> <p>注册资金：2600 亿元人民币</p> <p>存续期间：持续经营</p> <p>组织形式：股份有限公司</p> <p>基金托管资格批准文号：中国证监会证监基字[1998]23 号</p>	<p>名称：中国农业银行股份有限公司</p> <p>注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号</p> <p>法定代表人：周慕冰</p> <p>成立时间：2009 年 1 月 15 日</p> <p>批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13 号</p> <p>组织形式：股份有限公司</p> <p>注册资本：32,479,411.7 万元人民币</p> <p>存续期间：持续经营</p> <p>基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]23 号</p>
第十四部分 基金的投资 (七) 投资限制		<p>新增</p> <p>4、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>5、本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其</p>

	<p>基金管理人应当自基金合同生效之日起 3 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。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比例不符合上述投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。</p>	<p>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>基金管理人应当自基金合同生效之日起 3 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。除上述第 4 和 5 项外，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投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。</p>
<p>第十六部分 基金资产的估值</p> <p>(七) 暂停估值的情形</p>		<p>新增：</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；</u></p>
<p>第二十部分 基金的信息披露</p> <p>五、 公开披露的基金信息</p> <p>8、 基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和</p>		<p>新增：</p> <p><u>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></p> <p><u>基金运作期间，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</u></p>

基金季度报告		未持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及产品的 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 五、公开披露的基金信息 9、临时报告		新增： <u>(28) 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；</u>

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	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 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： 100140 法定代表人： 杨凯生 成立日期： 2005 年 06 月 21 日 批准设立机关： 中国证监会 批准设立文号： 中国证监会证监基金字【2005】93 号	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 5 号、甲 5 号 6 层甲 5 号 601、甲 5 号 7 层甲 5 号 701、甲 5 号 8 层甲 5 号 801、甲 5 号 9 层甲 5 号 901 法定代表人：郭特华 设立日期：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】93 号 组织形式：有限责任公司

	<p style="text-align: center;">—————中国银监会银监复[2005]105号</p> <p>组织形式：有限责任公司</p> <p>注册资本：2亿元人民币</p> <p>存续期间：持续经营</p> <p>经营范围：基金募集；基金销售；资产管理以及中国证监会许可的其它业务</p>	<p>注册资本：贰亿元人民币</p> <p>存续期限：持续经营</p> <p>联系电话：400-811-9999</p>
<p>二、基金托管协议当事人</p> <p>(一) 基金托管人</p>	<p>名称：中国农业银行股份有限公司</p> <p>注册地址：北京市东城区建国门内大街 69号</p> <p>办公地址：北京市西三环北路 100号金玉大厦</p> <p>邮政编码：100048</p> <p>法定代表人：项俊波</p> <p>成立时间：2009年 1月 15日</p> <p>基金托管资格批准文号：中国证监会证监基字[1998]23号</p> <p>组织形式：股份有限公司</p> <p>注册资本：2600亿元人民币</p> <p>存续期间：持续经营</p> <p>经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金</p>	<p>名称：中国农业银行股份有限公司</p> <p>注册地址：北京市东城区建国门内大街 69号</p> <p>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九层</p> <p>邮政编码：100031</p> <p>法定代表人：周慕冰</p> <p>成立时间：2009年 1月 15日</p> <p>基金托管资格批准文号：中国证监会证监基字[1998]23号</p> <p>注册资本：32,479,411.7万元人民币</p> <p>存续期间：持续经营</p> <p>经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结 算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金</p>

	<p>融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；结汇、售汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项；提供保管箱服务；代理资金清算；各类汇兑业务；代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务；贷款承诺；组织或参加银团贷款；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇借款；发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券；外币票据承兑和贴现；自营、代客外汇买卖；外币兑换；外汇担保；资信调查、咨询、见证业务；企业、个人财务顾问服务；证券公司客户交易结算资金存管业务；证券投资基金托管业务；企业年金托管业务；产业投资基金托管业务；合格境外机构投资者境内证券投资托管业务；代理开放式基金业务；电话银行、手机银行、网上银行业务；金融衍生产品交易业务；经国务院银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务；保险兼业代理业务。</p>	<p>融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；结汇、售汇；从事银行卡业务；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；代理资金清算；各类汇兑业务；代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务；贷款承诺；组织或参加银团贷款；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇借款；发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券；外币票据承兑和贴现；自营、代客外汇买卖；外币兑换；外汇担保；资信调查、咨询、见证业务；企业、个人财务顾问服务；证券公司客户交易结算资金存管业务；证券投资基金托管业务；企业年金托管业务；产业投资基金托管业务；合格境外机构投资者境内证券投资托管业务；代理开放式基金业务；电话银行、手机银行、网上银行业务；金融衍生产品交易业务；经国务院银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务。</p>
<p>二、基金托管协议的依据、目的和原则 (一) 订立托管协议的依据</p>	<p>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》”)等有关法律、法规(以下简称“法律法规”)、基金合同及其他有关规定制订。</p>	<p>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》”)、《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》”)等有关法律、法规(以下简称“法律法规”)、基金合同及其他有</p>

		关规定制订。
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p> <p>(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、融券比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：</p>	<p>因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成分股调整、基金申购或赎回带来现金等非本基金管理人的因素致使基金投资组合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。</p>	<p>新增</p> <p>3、 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>4、 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>.....</p> <p>除上述第 3 和 4 项外， 因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成分股调整、基金申购或赎回带来现金等非本基金管理人的因素致使基金投资组合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。</p>
<p>八、基金资产净值计算和会计核算</p> <p>(四) 暂停估值与公</p>		<p>新增：</p> <p>(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</p>

告基金份额净值的情形		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；
------------	--	---------------------------------------