

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

基金合同				托管协议			
页码	章节	修改前 中信建投稳溢保本混合型证券投资基金基金合同	修改后 中信建投睿溢混合型证券投资基金基金合同	页码	章节	修改前 中信建投稳溢保本混合型证券投资基金托管协议	修改后 中信建投睿溢混合型证券投资基金托管协议
1	第一部分 前言	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》”)、 <u>《关于保本基金的指导意见》</u> (以下简称“《指导意见》”)、《公开募集开放式证	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》”)、 <u>《公开募集开放式证</u>	4	一、基金 托管协 议的依 据、目 的和原 则	订立本协议的依据是《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、《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》)、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第7号〈托管协议的内容与格式〉》、 <u>《中信建投稳溢保本混合型证券投资基金基金合同》</u> (以下简称《基金合同》)及其他有关规定。	订立本协议的依据是《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、《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》)、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第7号〈托管协议的内容与格式〉》、 <u>《中信建投睿溢混合型证券投资基金基金合同》</u> (以下简称《基金合同》)及其他有关规定。

		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》”）和其他有关法律法规。	理规定》”）和其他有关法律法规。				
1	第一部分前言	投资人购买本基金份额的行为视为同意保证合同的约定。	删除	5	二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	<p>（一）基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权</p> <p>1. 基金托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，对下述基金投资范围、投资对象进行监督。</p> <p><u>A: 保本周期内的投资范围</u></p> <p><u>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行交易的债券、股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许</u></p>	<p>（一）基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权</p> <p>1. 基金托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，对下述基金投资范围、投资对象进行监督。</p> <p><u>删除，后续序号相应调整</u></p>

					<p><u>基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。</u></p> <p><u>本基金的基金资产包括固定收益类资产和权益类资产，固定收益类资产为国内依法发行交易的债券、货币市场工具等，其中债券包括国债、金融债、央行票据、地方政府债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、可转换公司债券(含分离交易的可转换公司债券)、资产支持证券、债券回购等。权益类资产为股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、股指期货等。</u></p> <p><u>B: 转型为“中信建投睿溢混合型证券投资基金”后的投资范围</u></p>		
1	第一部分前言	三、中信建投稳溢保本混合型证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、基金	三、 <u>中信建投睿溢混合型证券投资基金由中信建投稳溢保本混合型证券投资基</u>	5	二、 <b>基金托管人对基金</b>	2. 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投	2. 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投

		<p>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。</p> <p>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。</p>	<p><u>金转型而来。</u>中信建投稳溢保本混合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，其转型后的<u>中信建投睿溢混合型证券投资基金已经中国证监会备案。</u></p> <p>中国证监会对<u>中信建投稳溢保本混合型证券投资基金募集的注册及其转型为本基金的备案</u>，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。</p>		<p><b>管理人的业务监督和核查</b></p>	<p>融资比例进行监督：</p> <p>(1) 按法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金的投资资产配置比例为：</p> <p><u>A: 保本周期内的资产配置比例为：</u></p> <p><u>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；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%。</u></p> <p><u>B: 转型为“中信建投睿溢混合型证券投资基金”后的资产配置比例为：</u></p>	<p>融资比例进行监督：</p> <p>(1) 按法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金的投资资产配置比例为： <u>删除，后续序号相应调整</u></p>
2	第一部分前言	<p><u>基金投资人投资于保本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构，本基金在极端情况下仍然存在本金损失的风险。</u></p>	<p><u>删除</u></p>	6	<p><b>二、基金托管人对基金管理人的业务</b></p>	<p>(2) 根据法律法规的规定及本合同的约定，本基金投资组合遵循以下投资限制：</p> <p><u>A: 保本周期内的投资比</u></p>	<p>(2) 根据法律法规的规定及本合同的约定，本基金投资组合遵循以下投资限制： <u>删除，后续序号相应调整</u></p>

					<p><b>监督和核查</b></p> <p><u>例限制为：</u></p> <p>1) <u>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%，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%；</u></p> <p>2) <u>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；</u></p> <p>3) <u>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%；</u></p> <p>4) <u>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%；</u></p> <p>5) <u>本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；</u></p> <p>6) <u>本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；</u></p>	
--	--	--	--	--	--	--

					<p><u>7)本基金在任何交易日买入权证的总金额,不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%;</u></p> <p><u>8)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%;</u></p> <p><u>9)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%;</u></p> <p><u>10)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%;</u></p> <p><u>11)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%;</u></p> <p><u>12)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</u></p>	
--	--	--	--	--	--	--

					<p>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；</p> <p>13) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；</p> <p>14) 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%；</p> <p>15) 本基金参与股指期货交易应当符合基金合同约定的保本策略和投资目标；本基金每日所持期货合约及有价证券的最大可能损失不得超过基金净资产扣除用于保本部分资产后的余额；</p> <p>16) 本基金总资产不得超过基金净资产的200%；</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</p>	
--	--	--	--	--	---	--

					<p><u>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>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；</u></p> <p><u>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%；</u></p> <p><u>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。</u></p>	
--	--	--	--	--	--	--



						<u>B: 转型为“中信建投睿溢混合型证券投资基金”的投资比例限制为:</u>	
3	<b>第二部分 释义</b>	<p>1、基金或本基金：指中信建投稳溢保本混合型证券投资基金</p> <p>2、基金管理人：指中信建投基金管理有限公司</p> <p>3、基金托管人：指北京银行股份有限公司</p> <p>4、基金合同或本基金合同：指《中信建投稳溢保本混合型证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充</p> <p>5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《中信建投稳溢保本混合型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充</p> <p>6、招募说明书：指《中信建投稳溢保本混合型证券投资基金招募说明书》及其</p>	<p>1、基金或本基金：指中信建投睿溢混合型证券投资基金</p> <p>2、基金管理人：指中信建投基金管理有限公司</p> <p>3、基金托管人：指北京银行股份有限公司</p> <p>4、基金合同或本基金合同：指《中信建投睿溢混合型证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充</p> <p>5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《中信建投睿溢混合型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充</p> <p>6、招募说明书：指《中信建投睿溢混合型证券投资基金招募说明书》及其定期</p>	14	<b>四、基金财产保管</b>	<p>(一) 基金财产保管的原则</p> <p>.....</p> <p>5、对于因基金<u>认（申）购</u>、基金投资过程中产生的应收财产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金托管人处的，基金托管人应及时通知基金管理人。由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失，基金托管人有义务在合理且必要的范围内配合基金管理人进行追偿，但对此不承担责任。</p> <p>.....</p> <p><u>(二) 募集资金的验证</u> <u>募集期内销售机构按销售与服务协议的约定，将认购资金划入基金管理人在具有托管资格的商业</u> <u>银行开设</u></p>	<p>(一) 基金财产保管的原则</p> <p>.....</p> <p>5、对于因基金<u>申购</u>、基金投资过程中产生的应收财产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金托管人处的，基金托管人应及时通知基金管理人。由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失，基金托管人有义务在合理且必要的范围内配合基金管理人进行追偿，但对此不承担责任。</p> <p>.....</p> <p><u>删除，后续序号相应调整</u></p>

	<p>定期的更新</p> <p><u>7、基金份额发售公告：指《中信建投稳溢保本混合型证券投资基金基金份额发售公告》</u></p> <p>.....</p> <p>15、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或<u>中国银行业监督管理委员会</u></p> <p>.....</p> <p><u>22、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。</u></p> <p>.....</p> <p><u>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<u>认购、申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资</u>等业务而引起基金份额变动及结余情况的账户</u></p> <p><u>28、基金合同生效日：</u></p>	<p>的更新</p> <p><u>删除，后续序号相应调整</u></p> <p>.....</p> <p>14、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或<u>中国银行保险监督管理委员会</u></p> <p>.....</p> <p><u>21、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。</u></p> <p>.....</p> <p><u>26、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<u>申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资</u>等业务而引起基金份额变动及结余情况的账户</u></p> <p><u>27、基金合同生效日：</u></p>		<p><u>的中信建投基金管理有限公司基金认购专户。该账户由基金管理人开立并管理。基金募集期满，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，由基金管理人聘请具有从事证券业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的 2 名以上（含 2 名）中国注册会计师签字有效。验资完成，基金管理人应将募集的属于本基金财产的全部资金划入基金托管人为基金开立的资产托管专户中，基金托管人在收到资金当日出具确认文件。若基金募集期限届满，未能达到《基金合同》生效的条件，由基金管理人按规定办理退款事宜。</u></p>	
--	--	---	--	--	--

	<p><u>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</u></p> <p>.....</p> <p><u>30、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 3 个月</u></p> <p>.....</p> <p><u>38、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</u></p> <p>.....</p> <p><u>51、保证人、担保人：指与基金管理人签订保证合同，为基金管理人对其基金份额持有人的保本基金承担的保本清偿义务提供不可撤销</u></p>	<p><u>指《中信建投睿溢混合型证券投资基金基金合同》生效日，《中信建投稳溢保本混合型证券投资基金基金合同》自同一日失效</u></p> <p>.....</p> <p><u>删除，后续序号相应调整</u></p> <p>.....</p> <p><u>删除，后续序号相应调整</u></p> <p>.....</p> <p><u>删除，后续序号相应调整</u></p>				
--	--	--	--	--	--	--

	<p>的连带责任保证的机构。本基金第一个保本周期由中关村科技融资担保有限公司作为担保人，为本基金第一个保本周期的保本提供不可撤销的连带责任保证</p> <p>52、保本义务人：指与基金管理人签订保证合同，为本基金的某保本周期（第一个保本周期除外）承担保本偿付责任的机构</p> <p>53、保本周期：指基金管理人提供保本的期限，在本《基金合同》中如无特别指明即指当期保本周期。本基金的保本周期每两年为一个周期。本基金第一个保本周期自基金合同生效日起至两年后的对应日止；本基金第一个保本周期后的各保本周期自本基金公告的该保本周期起始之日起至两年后对应日止。如该对应日为非工作日或该公历年不存在该对应日，则顺延至下一个工作</p>					
--	---	--	--	--	--	--

	<p><u>日。基金管理人将在每个保本周期到期前公告到期处理规则，并确定下一个保本周期的起始时间</u></p> <p><u>54、保本周期起始日：第一个保本周期起始日为基金合同生效日，其后保本周期起始日以基金管理人公告为准</u></p> <p><u>55、保本周期到期日或到期日：指保本周期届满的最后一日，第一个保本周期到期日为本基金基金合同生效之日起至两年后的对应日，如该对应日为非工作日或该公历年不存在该对应日，保本周期到期日顺延至下一个工作日，基金合同若无特别所指即为当期保本周期到期日</u></p> <p><u>56、保本金额：第一个保本周期内，指基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的投资金额，即基金份额持有人认购并持有到期的</u></p>					
--	--	--	--	--	--	--

	<p><u>基金份额的净认购金额、认购费用及募集期间的利息收入之和，其后各保本周期的保本金额为过渡期申购并持有到期的基金份额在份额折算日的资产净值及其过渡期申购费用（包括转换补差费）之和以及上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额在份额折算日的资产净值</u></p> <p><u>57、保本：在保本周期到期日，如按基金份额持有人持有到期的基金份额与到期日基金份额净值的乘积加上其持有到期的基金份额在当期保本周期内的累计分红款项之和计算的总金额低于其保本金额，则基金管理人应补足该差额（即保本赔付差额）</u></p> <p><u>58、保本赔付差额：指根据《基金合同》，在保本周期到期日，基金份额持有人持有到期的基金份额与保本</u></p>					
--	--	--	--	--	--	--

	<p><u>周期到期日基金份额净值的乘积加上其持有到期的基金份额在当期保本周期内的累计分红款项之和计算的总金额低于其保本金额的差额</u></p> <p><u>59、持有到期：指基金份额持有人在保本周期内一直持有其所认购、或过渡期申购、或过渡期从上一保本周期转入当期保本周期的基金份额到当期保本周期到期日的行为；第一个保本周期内是指基金份额持有人认购并持有到保本周期到期日</u></p> <p><u>60、保证：就第一个保本周期而言，指保证人为基金管理人履行保本义务提供的不可撤销的连带责任担保，自第二个保本周期起的后续各保本周期而言，由基金管理人与担保人或保本义务人届时签订的保证合同决定，并由基金管理人在当期保本周期开始前公告</u></p> <p><u>61、保证合同：指保证</u></p>					
--	--	--	--	--	--	--

	<p><u>人和基金管理人签订的《中信建投稳溢保本混合型证券投资基金保证合同》</u></p> <p><u>62、到期期间：指本基金保本周期到期后基金份额持有人进行到期操作的时间期间。本基金的到期期间为保本周期到期日及之后 3 个工作日（含第 3 个工作日）</u></p> <p><u>63、过渡期：指基金管理人有权根据其业务需要，将到期期间截止日次个工作日起至下一个保本周期起始日前一工作日的区间设为过渡期，过渡期的具体起止日期由基金管理人确定并届时公告</u></p> <p><u>64、过渡期申购：指投资者在过渡期内的限定期限内申请购买本基金基金份额的行为，在过渡期内，投资者转换转入本基金基金份额，视同为过渡期申购</u></p> <p><u>65、份额折算日：指过渡期最后一个工作日（即下</u></p>					
--	--	--	--	--	--	--



	<p><u>一保本周期开始日前一工作日</u>为基金份额折算日</p> <p><u>66、基金份额折算：在基金份额折算日，基金份额持有人所持有的基金份额（包括投资者过渡期申购的基金份额、保本周期结束后选择或默认选择转入下一个保本周期的基金份额）所代表的资产净值总额保持不变的前提下，变更登记为基金份额净值为 1.000 元的基金份额，基金份额数额按折算比例相应调整</u></p> <p><u>67、保本基金存续条件：指本基金保本周期届满时，符合法律法规有关担保人或保本义务人资质要求、并经基金管理人认可的其他机构为本基金下一保本周期提供保本保障，与基金管理人就本基金下一保本周期签订保证合同，同时本基金满足法律法规和基金合同规定的基金存续要求</u></p>					
--	--	--	--	--	--	--

		<p><u>68、保本周期到期后基金的存续形式：指保本周期届满时，在符合保本基金存续条件下，本基金继续存续并进入下一保本周期；否则，本基金转型为非保本的混合型证券投资基金，基金名称相应变更为“中信建投睿溢混合型证券投资基金”。如果本基金不符合法律法规和基金合同对基金的存续要求，则本基金将根据基金合同的规定终止</u></p>					
7	<p><b>第三部分基金的基本情况</b></p>	<p>一、基金名称 中信建投稳溢保本混合型证券投资基金</p>	<p>一、基金名称 中信建投睿溢混合型证券投资基金</p>	33	<p><b>八、基金收益分配</b></p>	<p>(一) 基金收益分配的原则</p> <p>1. 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 4 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的 5%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；</p> <p>.....</p>	<p>(一) 基金收益分配的原则</p> <p>1. 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 4 次，<u>每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的 5%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；</u></p> <p>.....</p>

					<p>2、<u>本基金收益分配方式</u>：  <u>(1) 保本周期内：仅采取现金分红一种收益分配方式，不进行红利再投资；</u>  <u>(2) 本基金转型为“中信建投睿溢混合型证券投资基金”后：基金收益分配方式分为现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，基金登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式为准；</u></p>	<p>2、<u>本基金收益分配方式</u>分为现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，基金登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式为准；</p>	
7	第三部分 基金的基本情况	<p>四、基金的投资目标  <u>本基金通过稳健资产与风险资产的动态配置和有效的组合管理，在严格控制风险的基础上，力争实现基金资产的长期稳健增值。</u></p>	<p>四、基金的投资目标  <u>本基金主要投资于股票等权益类资产和债券等固定收益类金融工具，通过科学的资产配置与严谨的风险管理，力争超越业绩比较基准、实</u></p>	34	九、信息披露	<p>本基金的信息披露主要包括基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、<u>基金份额发售公告</u>、《基金合同》生效公告、定期报告、临时公告、基金资产净值和</p>	<p>本基金的信息披露主要包括基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、定期报告、临时公告、基金资产净值和基金份额净值等其他必要的公告文件，由基金管理</p>

		<p><u>五、基金的最低募集份额总额</u> 本基金的最低募集份额总额为 2 亿份。</p> <p><u>六、基金份额面值和认购费用</u> 本基金基金份额发售面值为人民币 1.00 元。 本基金具体费率按招募说明书的规定执行。</p> <p><u>七、基金募集规模上限</u> 基金募集期规模上限为 20 亿元人民币（不包括募集期利息）。本基金募集期内规模控制的具体办法详见基金份额发售公告。</p>	<p><u>现基金资产持续稳定增值。</u></p> <p><u>删除，后续序号相应调整</u></p>			<p>基金份额净值等其他必要的公告文件，由基金管理人拟定并负责公布。</p>	<p>人拟定并负责公布。</p>
7	第三部分基金的基本情况		<p><u>删除：</u></p> <p><u>九、基金的保本</u> 本基金第一个保本周期到期日，如按基金份额持有人认购并持有到期的基金份额与到期日基金份额净值的</p>	36	<p><u>十、托管费用</u></p>	<p><u>到期期间（保本周期到期日除外）和过渡期内本基金不计提托管费。</u> <u>若保本周期到期后，本基金不符合保本基金存续条件，基金份额持有人将持有本</u></p>	<p><u>删除</u></p>

			<p><u>乘积加上其认购并持有到期的基金份额累计分红款项之和计算的总金额低于其保本金额，则基金管理人应补足该差额，并在保本周期到期日后二十个工作日内（含第二十个工作日，下同）将该差额支付给基金份额持有人，保证人对此提供不可撤销的连带责任保证。</u></p> <p><u>其后各保本周期到期日，如按基金份额持有人过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额与到期日基金份额净值的乘积加上该部分基金份额在当期保本周期内的累计分红款项之和计算的总金额低于其保本金额，由当期有效的保证合同约定的基金管理人或保本义务人将该保本赔付差额支付给基金份额持有人。</u></p> <p><u>十、保本的保证</u> <u>第一个保本周期内，中</u></p>		<p><u>基金份额转为变更后的“中信建投睿溢混合型证券投资基金”的基金份额，管理费按前一日基金资产净值的1.50%的年费率计提，托管费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。计提方法和支付方式同上。</u></p>	
--	--	--	---	--	---	--

			<p><u>关村科技融资担保有限公司为基金管理人履行保本义务提供不可撤销的连带责任担保，保证范围为基金持有人认购并持有到期的基金份额与保本周期到期日基金份额净值的乘积加上其认购并持有到期的基金份额累计分红款项之和计算的总金额低于其保本金额的差额部分。保证期间为基金保本周期到期日起六个月止。</u></p> <p><u>其后各保本周期的保本事宜，由基金管理人与保证人或保本义务人届时签订的保证合同决定，并由基金管理人在当期保本周期开始前公告。</u></p> <p><u>十一、担保人</u></p> <p><u>本基金第一个保本周期由中关村科技融资担保有限公司作为保证人，为本基金第一个保本周期的保本提供不可撤销的连带责任保证。</u></p> <p><u>其后各保本周期的保本</u></p>				
--	--	--	--	--	--	--	--

			<p><u>保障机制，由基金管理人与担保人或保本义务人届时签订的保证合同决定，并由基金管理人在当期保本周期开始前公告。</u></p> <p><u>十二、基金保本周期</u>  <u>本基金的保本周期每两年为一个周期。本基金第一个保本周期自基金合同生效日起至两年后的对应日止；</u>  <u>本基金第一个保本周期后的各保本周期自本基金届时公告的保本周期起始之日起至两年后对应日止。如该对应日为非工作日或该公历年不存在该对应日，则顺延至下一个工作日。基金管理人将在每个保本周期到期前公告到期处理规则，并确定下一个保本周期的起始时间。</u></p>				
8	<p><b>第四部分 基金的历史沿革</b></p>	<p>第四部分 <u>基金份额的发售</u></p> <p><u>一、基金份额的发售时间、发售方式、发售对象</u></p> <p><u>1、发售时间</u></p>	<p>第四部分 <u>基金的历史沿革</u></p> <p><u>中信建投睿溢混合型证券投资基金根据《中信建投稳溢保本混合型证券投资基金</u></p>	45	<p><b>十六、违约责任</b></p>	<p>1. 基金管理人及基金托管人按照当时有效的法律法规或中国证监会、中国银监会等监管机构的规定作为或不作为而造成的损失等；</p>	<p>1. 基金管理人及基金托管人按照当时有效的法律法规或中国证监会、<u>中国银行保险监督管理委员会</u>等监管机构的规定作为或不作为而造成</p>

	<p><b>革</b></p> <p><u>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。</u></p> <p><b>2、发售方式</b></p> <p><u>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。</u></p> <p><u>销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资者应及时查询。</u></p> <p><b>3、发售对象</b></p> <p><u>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</u></p>	<p><u>金基金合同》的约定由中信建投稳溢保本混合型证券投资基金第一个保本周期届满后转型而来。</u></p> <p><u>中信建投稳溢保本混合型证券投资基金经中国证监会证监许可〔2016〕687 号文注册，自 2016 年 4 月 20 日至 2016 年 5 月 31 日期间公开募集。基金管理人中信建投基金管理有限公司向中国证监会办理完毕基金备案手续后，于 2016 年 5 月 19 日获书面确认，《中信建投稳溢保本混合型证券投资基金基金合同》自该日起生效。</u></p> <p><u>2018 年 5 月 21 日，中信建投稳溢保本混合型证券投资基金第一个保本周期届满。由于不符合避险策略基金存续条件，中信建投稳溢保本混合型证券投资基金按照该基金基金合同的约定转型为非保本的混合型证券投资基金，名称相应变更为“中</u></p>				<p>的损失等；</p>
--	---	---	--	--	--	--------------



	<p>券投资基金的其他投资人。</p> <p><u>4、募集规模上限</u>  <u>本基金募集规模上限为20亿元人民币（不包括募集期利息）。本基金募集期内规模控制的具体办法详见基金份额发售公告。</u></p> <p><u>二、基金份额的认购</u></p> <p><u>1、认购费用</u>  <u>本基金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。</u></p> <p><u>2、募集期利息的处理方式</u>  <u>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。</u></p> <p><u>3、基金认购份额的计算</u>  <u>基金认购份额具体的计算方法在招募说明书中列示。</u></p> <p><u>4、认购份额余额的处理</u></p>	<p><u>信建投睿溢混合型证券投资基金”。</u></p> <p><u>中信建投稳溢保本混合型证券投资基金第一个保本周期到期期间为2018年5月21日（含）至2016年5月24日（含），自2017年5月25日起，“中信建投稳溢保本混合型证券投资基金”转型为“中信建投睿溢混合型证券投资基金”。中信建投睿溢混合型证券投资基金的基金合同即日起生效。</u></p>				
--	---	---	--	--	--	--

	<p><u>方式</u></p> <p><u>认购份额的计算保留到小数点后 2 位，小数点 2 位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。</u></p> <p><u>三、基金份额认购金额的限制</u></p> <p><u>1、投资人认购时，需按销售机构规定的方式全额缴款。</u></p> <p><u>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。</u></p> <p><u>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。</u></p> <p><u>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得撤销。</u></p>					
--	--	--	--	--	--	--

<p>15</p>	<p>第五部分 基金的存 续</p>	<p>第五部分 基金备案</p>	<p>第五部分 基金的存续</p> <p>删除： 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超过 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。</p> <p>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</p>				
-----------	----------------------------	------------------	--	--	--	--	--

			<p><u>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。</u></p> <p><u>二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式</u></p> <p><u>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：</u></p> <p><u>1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；</u></p> <p><u>2、在基金募集期限届满后 30 日内退还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息；</u></p> <p><u>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。</u></p> <p><u>三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模</u></p>				
--	--	--	---	--	--	--	--

10	第六部分 基金份额的申购与赎回	<p>三、申购与赎回的原则 .....</p> <p>4、<u>基金份额持有人赎回时，除指定赎回外，基金管理人按“后进先出”的原则，对该持有人账户在该销售机构托管的基金份额进行处理，即登记确认日期在前的基金份额后赎回，登记确认日期在后的基金份额先赎回，以确定被赎回基金份额的持有期限和所适用的赎回费率；</u></p> <p>5、<u>若保本周期到期后，本基金不符合保本基金存续条件，变更为非保本的基金，则变更后对所有基金份额的赎回按照“先进先出”的原则，以确定所适用的赎回费率。对于由本基金转型后基金的基金份额，其持有期将从原份额取得之日起连续计算；</u></p>	<p>三、申购与赎回的原则 .....</p> <p><u>删除，后续序号相应调整</u></p> <p>4、<u>赎回按照“先进先出”的原则，以确定所适用的赎回费率。基金份额持有期将从原份额取得之日起连续计算；</u></p>	47	十八、基金托管协议的效力和文本	<p>(一)本协议经基金管理人、基金托管人双方法定代表人或授权代理人签字(或盖章)并加盖公章(或合同专用章)后成立。本协议以中国证监会注册<u>的</u>文本为正式文本。</p>	<p>(一)本协议经基金管理人、基金托管人双方法定代表人或授权代理人签字(或盖章)并加盖公章(或合同专用章)后成立。本协议以中国证监会<u>备案</u>的文本为正式文本。</p>
14	第六部分 基金份额	<p>9、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述第1、2、3、5、6、8、9项暂停申购情形之一</p>	<p>9、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述第1、2、3、5、6、8、9项暂停申购情形之一</p>				

	<p><b>的申购与赎回</b></p>	<p>且基金管理人决定暂停接受申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。<u>如在过渡期内发生暂停申购，过渡期按暂停申购的期间相应顺延。</u></p> <p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>……<u>如在到期期间内发生暂停赎回，到期期间按暂停赎回的期间相应顺延。</u></p>	<p>且基金管理人决定暂停接受申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。</p> <p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p>				
<p>18</p>	<p><b>第七部分基金合同当事人及权利义务</b></p>	<p>(二) 基金管理人的权利与义务</p> <p>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：</p> <p>(1) 依法募集资金；</p> <p>……</p>	<p>(二) 基金管理人的权利与义务</p> <p>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：</p> <p>(1) 依法募集资金；</p> <p>……</p>				

	<p>(16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金<u>认购、申购、赎回、转换</u>和非交易过户等业务规则；</p> <p>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：</p> <p>(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<u>份额的发售、申购、赎回</u>和登记事宜；</p> <p>.....</p> <p>(8) 采取适当合理的措施使计算基金<u>份额认购、申购、赎回</u>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<u>份额申购、赎回</u>的价格；</p> <p>.....</p> <p><u>(24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案</u></p>	<p>(16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金<u>申购、赎回、转换</u>和非交易过户等业务规则；</p> <p>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：</p> <p>(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<u>份额的申购、赎回</u>和登记事宜；</p> <p>.....</p> <p>(8) 采取适当合理的措施使计算基金<u>份额申购、赎回</u>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<u>份额申购、赎回</u>的价格；</p> <p>.....</p> <p><u>删除，后续序号相应调整</u></p>				
--	---	---	--	--	--	--

		<u>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；</u>					
24	第七部分 基金合同当事人及权利义务	<p>三、基金份额持有人</p> <p>1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：</p> <p>.....</p> <p>(4) <u>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；</u></p>	<p>三、基金份额持有人</p> <p>1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：</p> <p>.....</p> <p>(4) <u>缴纳基金申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；</u></p>				
25	第八部分 基金份额持有人大会	<p>一、召开事由</p> <p>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：</p> <p>.....</p> <p>(5) <u>提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但在保本周期到期后在《基金合同》规定范围内变更为“中信建投睿溢混合型证券投资</u></p>	<p>一、召开事由</p> <p>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：</p> <p>.....</p> <p>(5) <u>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的除外；</u></p>				



	<p><u>基金”，并按《基金合同》约定的“中信建投睿溢混合型证券投资基金”的管理费率和托管费率计提管理费和托管费的以及法律法规要求提高该等报酬标准的除外；</u></p> <p>.....</p> <p><u>(8) 变更基金投资目标、范围或策略，但在保本周期到期后在《基金合同》规定范围内变更为“中信建投睿溢混合型证券投资基金”并按《基金合同》约定的“中信建投睿溢混合型证券投资基金”的投资目标、范围或策略执行的以及法律法规和中国证监会另有规定的除外；</u></p> <p>.....</p> <p><u>(9) 保本周期内，更换保证人或保本义务人或变更保本保障机制，但基金合同或保证合同另有约定的情况除外；</u></p>	<p>.....</p> <p>(8) 变更基金投资目标、范围或策略；</p> <p>.....</p> <p><u>删除，后续序号相应调整</u></p>				
--	---	--	--	--	--	--

<p>32</p>	<p>第八部分 基金份额持有人大会</p>	<p>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： ..... (3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、<u>调低赎回费率</u>或在<u>对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下变更收费方式</u>；  (3) 保本周期内，<u>基金管理人增加新的保证人或保本义务人的；保本周期内，保证人或保本义务人因歇业、停业、被吊销企业法人营业执照、宣告破产或其他足以影响继续履行保证责任能力的情况，或者因保证人或保本义务人发生合并或分立，由合并或分立后的法人或者其他组织承继保证人或保本义务人的权利和义务的情况下，更换保证人或保本</u></p>	<p>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： ..... <u>(2)</u> 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率或在<u>对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下变更收费方式</u>；  <u>删除，后续序号相应调整</u></p>				
-----------	---------------------------	---	--	--	--	--	--

		<p><u>义务人；</u></p> <p><u>(4) 某一保本周期到期后，变更下一个保本周期的保本保障机制，变更下一保本周期的保证人或保本义务人；</u></p> <p><u>(5) 保本周期到期后在《基金合同》规定范围内本基金转型为非保本基金“中信建投睿溢混合型证券投资基金”，并按基金合同的约定变更基金的投资目标、投资范围、投资策略；</u></p>					
39	第十二部分 保本和保本保障机制(原)	第十二部分 保本和保本保障机制	<u>删除该部分全部内容</u>				
39	第十三部分 基金基金	第十三部分 基金保本的保证	<u>删除该部分全部内容</u>				

	保本的保证(原)						
39	第十二部分 基金的投资	<p>第十四部分 基金的投资</p> <p>一、保本周期内的投资</p> <p>(一) 投资目标</p> <p>本基金通过固定收益类资产与权益类资产的动态配置和有效的组合管理,在严格控制风险的基础上,力争实现基金资产的长期稳健增值。</p> <p>(二) 投资范围</p> <p>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行交易的债券、股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,</p>	<p>第十二部分 基金的投资</p> <p><u>删除, 后续序号相应调整</u></p>				

	<p>但需符合中国证监会的相关规定。</p> <p>本基金的基金资产包括固定收益类资产和权益类资产，固定收益类资产为国内依法发行交易的债券、货币市场工具等，其中债券包括国债、金融债、央行票据、地方政府债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、可转换公司债券（含分离交易的可转换公司债券）、资产支持证券、债券回购等。权益类资产为股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、股指期货等。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</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</p>					
--	---	--	--	--	--	--

	<p>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；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%。</p> <p>（三）投资策略</p> <p>本基金运用恒定比例组合保险策略（Constant Proportion Portfolio Insurance，以下简称 CPPI 策略），动态调整固定收益类资产与权益类资产在基金组合中的投资比例，以确保本基金在保本周期到期时的本金安全，并实现基金资产在保本基础上的保值增值目的。具体而言，本基金的投资策略包括大类资产配置策略、固定收益类资产投资策略和权益类资产投资策略。</p> <p>1、大类资产配置策略</p> <p>本基金在大类资产配置</p>					
--	--	--	--	--	--	--

	<p>上采取 CPPI 策略对固定收益类资产和权益类资产进行配置，动态调整固定收益类资产与权益类资产投资的比例，来实现保本和增值的目标。具体来说，该策略通过对固定收益类资产的投资实现保本周期到期时投资本金的安全，通过对权益类资产的投资寻求保本周期内资产的稳定增值。</p> <p>结合 CPPI 策略，本基金对固定收益类资产和权益类资产的资产配置可分为以下四步：</p> <p>第一步，确定价值底线（Floor）。根据本基金保本周期到期时投资组合的最低目标价值（本基金的最低保本值为投资本金的 100%）和合理的贴现率，确定当前应持有的固定收益类资产数额，亦即价值底线（Floor）。</p> <p>第二步，计算安全垫（Cushion）。通过计算基金</p>					
--	---	--	--	--	--	--

	<p>投资组合现时净值超越价值底线的数额，得到安全垫（Cushion）。</p> <p>第三步，确定风险乘数（Multiplier）。本基金通过对宏观经济和证券市场运行状况和趋势的判断，并结合风险收益情况，确定投资过程中安全垫的放大倍数，也就是风险乘数，并在安全垫和风险乘数确定的基础上，得到当期权益类资产的最高配置比例。</p> <p>第四步，动态调整固定收益类资产和权益类资产的配置比例，并结合市场实际运行态势制定权益类资产投资策略，进行投资组合管理，实现基金资产在保本基础上的保值增值。</p> <p>2、固定收益类资产投资策略</p> <p>本基金通过综合分析宏观经济运行趋势、财政政策、货币政策等，对市场的收益</p>					
--	--	--	--	--	--	--



	<p>率走势及信用环境变化作出判断，并综合考虑不同债券品种收益率变化的阶段特征、具体、收益率水平、信用风险的大小、流动性的好坏等多种因素，在确保基金资产收益安全性和稳定性的基础上，构造债券组合。</p> <p>(1) 免疫策略</p> <p>本基金采用剩余期限与保本周期期限动态匹配的投资策略，参照保本周期的剩余期限，动态调整固定收益类资产债券组合久期，以有效控制利率变动风险，维护债券组合收益的稳定性。</p> <p>(2) 收益率曲线策略</p> <p>本基金将结合对市场收益率曲线变化的研究，适时采用子弹、杠铃或梯形策略构造投资组合，并进行动态调整，从短、中、长期债券的相对价格变化中获取收益。</p> <p>(3) 相对价值策略</p>					
--	--	--	--	--	--	--

	<p>本基金通过对不同债券市场、债券品种及信用等级的债券间利差的分析判断，获取阶段性市场定价偏差所带来的投资机会。</p> <p>(4) 骑乘策略</p> <p>本基金通过分析收益率曲线各期限利差情况，买入收益率曲线最陡峭处所对应的期限债券，持有一定时间后，随着债券剩余期限的缩短，到期收益率将迅速下降，从而获得较高的期限利差带来的资本利得收入。</p> <p>(5) 回购策略</p> <p>本基金将适时运用回购交易套利策略，在确保基金资产安全的前提下增强债券组合的收益率。</p> <p>(6) 信用债投资策略</p> <p>本基金将采用内部信用评级和外部信用评级相结合的方法，通过对信用产品基本面的研究，形成对该信用产品信用级别综合评定，并</p>					
--	---	--	--	--	--	--

	<p>通过调整组合内信用产品在信用等级和剩余期限方面的分布，获取超额收益。</p> <p>3、权益类资产投资策略</p> <p>(1) 股票投资策略</p> <p>本基金将严谨、规范化的选股方法与积极主动的投资风格相结合，从行业 and 个股两方面进行分析研究，精选具有清晰、可持续的业绩增长潜力且被市场相对低估或价格处于合理区间的股票，构建股票组合。</p> <p>1) 行业配置策略</p> <p>本基金将密切关注国内外经济运行情况和国内各项政策，深入分析各行业的发展现状、景气走势及政策影响，对具有良好发展前景的行业，景气程度走高或处于拐点的行业，以及政策上充分获得现实支持的行业进行重点配置。</p> <p>2) 个股选择策略</p> <p>本基金将坚持价值投资</p>					
--	---	--	--	--	--	--

	<p>理念，立足于公司的财务状况和发展潜力，通过估值手段，对公司的价值进行合理判断，并结合股票的价格对其投资价值进行科学判断；同时，本基金将充分结合中国证券市场的自身特点和运行规律，发掘出投资价值被市场低估的投资品种，以获取优厚的投资回报。</p> <p>（2）权证投资策略</p> <p>本基金的权证投资以权证的市值分析为基础，配以权证定价模型寻求其合理估值水平，以主动式的科学投资管理为手段，充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，追求基金资产稳定的当期收益。</p> <p>（3）股指期货投资策略</p> <p>本基金参与股指期货的投资以符合基金合同规定的保本策略和投资目标为前提</p>					
--	---	--	--	--	--	--

	<p>进行。本基金以套期保值为目的，根据风险管理的原则，在风险可控的前提下，投资于流动性好、交易活跃的股指期货合约，有效管理投资组合的系统性风险，积极改善组合的风险收益特征。</p> <p>（四）投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>（1）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%，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%；</p> <p>（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；</p> <p>（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%；</p>					
--	--	--	--	--	--	--

	<p>(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%；</p> <p>(5)本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；</p> <p>(6)本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的10%；</p> <p>(7)本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%；</p> <p>(8)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%；</p> <p>(9)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%；</p> <p>(10) 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</p>					
--	--	--	--	--	--	--

	<p>资产支持证券规模的 10%；</p> <p>（11）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%；</p> <p>（12）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；</p> <p>（13）基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；</p> <p>（14）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%；</p> <p>（15）本基金参与股指</p>					
--	---	--	--	--	--	--

	<p>期货交易应当符合基金合同约定的保本策略和投资目标；本基金每日所持期货合约及有价证券的最大可能损失不得超过基金净资产扣除用于保本部分资产后的余额；</p> <p>（16）本基金总资产不得超过基金净资产的 200%；</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</p>					
--	---	--	--	--	--	--



	<p>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、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。</p>					
--	---	--	--	--	--	--

	<p>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本基金合同生效之日起开始。</p> <p>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，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以变更后的规定为准。</p> <p>2、禁止行为</p> <p>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：</p> <p>(1) 承销证券；</p> <p>(2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；</p> <p>(3) 从事承担无限责任的投资；</p> <p>(4) 买卖其他基金份</p>					
--	---	--	--	--	--	--

	<p>额，但是中国证监会另有规定的除外；</p> <p>（5）向其基金管理人、基金托管人出资；</p> <p>（6）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；</p> <p>（7）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。</p> <p>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</p>					
--	---	--	--	--	--	--

	<p>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。</p> <p>法律、行政法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制或按照调整后的标准执行。</p> <p>(五) 业绩比较基准</p> <p>本基金业绩比较基准： 两年期银行定期存款税后收益率。</p> <p>两年期银行定期存款税后收益率指按照基金合同生效日或新的保本周期开始日中国人民银行公布并执行的同期金融机构人民币存款基准利率（按照四舍五入的方法保留到小数点后第 2 位，单位为百分数）计算的与当期保本周期同期限的税后收益率。</p>					
--	--	--	--	--	--	--

	<p>本基金是保本型基金，保本周期为两年，保本但不保证收益率。以两年期银行定期存款税后收益率作为本基金的业绩比较基准，能够使本基金投资者理性判断本基金的预期风险收益特征，合理地衡量比较本基金保本保证的有效性。</p> <p>如果今后法律法规发生变化，或者市场变化导致本业绩比较基准不再适用，又或者市场出现更具权威、且更能够表征本基金风险收益特征的业绩比较基准，则本基金管理人将视情况经与本基金托管人协商同意后调整本基金的业绩比较基准并报中国证监会备案，并及时公告，但不需要召开基金份额持有人大会。</p> <p>（六）风险收益特征</p> <p>本基金为保本混合型基金产品，属证券投资基金中的低风险品种，其预期风险</p>					
--	---	--	--	--	--	--

		与预期收益率低于股票型基金、非保本的混合型基金，高于货币市场基金和债券型基金。  二、转型为“中信建投睿溢混合型证券投资基金”后的投资				
43	第十二部分 基金的投资	基金管理人应当自 <u>本基金</u> 转型为“ <u>中信建投睿溢混合型证券投资基金</u> ”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。	基金管理人应当自 <u>《基金合同》</u> 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。			
53	第十五部分 基金费用与税收	二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式 1、基金管理人的管理费 本基金的管理费按前一日基金资产净值的 <u>1.20%</u> 年费率计提。管理费的计算方法如下： $H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$ H 为每日应计提的基金管理费 E 为前一日的基金资产	二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式 1、基金管理人的管理费 本基金的管理费按前一日基金资产净值的 <u>1.50%</u> 年费率计提。管理费的计算方法如下： $H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$ H 为每日应计提的基金管理费 E 为前一日的基金资产			

	<p>净值</p> <p>基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假，支付日期顺延至下一个工作日。<u>到期期间和过渡期内本基金不计提管理费。</u></p> <p>2、基金托管人的托管费</p> <p>本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：</p> $H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$ <p>H 为每日应计提的基金托管费</p> <p>E 为前一日的基金资产净值</p> <p>基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金</p>	<p>净值</p> <p>基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假，支付日期顺延至下一个工作日。</p> <p>2、基金托管人的托管费</p> <p>本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：</p> $H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$ <p>H 为每日应计提的基金托管费</p> <p>E 为前一日的基金资产净值</p> <p>基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金</p>				
--	--	--	--	--	--	--

		<p>托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日，支付日期顺延至下一个工作日。<u>到期期间和过渡期内本基金不计提托管费。</u></p>	<p>托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日，支付日期顺延至下一个工作日。</p>				
54	第十五部分 基金费用与税收	<p><u>若保本周期到期后，本基金不符合保本基金存续条件，基金份额持有人将所持持有本基金份额转为变更后的“中信建投睿溢混合型证券投资基金”的基金份额，管理费按前一日基金资产净值的 1.50%的年费率计提，托管费按前一日基金资产净值的 0.20%的年费率计提。计提方法和支付方式同上。</u></p>	<p><del>删除</del></p>				
55	第十六部分 基金的收益与	<p><u>第十八部分 基金的收益与分配</u>                      三、基金收益分配原则                      .....                      2、本基金收益分配方式：</p>	<p><u>第十六部分 基金的收益与分配</u>                      三、基金收益分配原则                      .....                      2、本基金收益分配方式分为现金分红与红利再投</p>				



	<p><b>分配</b></p>	<p><u>(1) 保本周期内：仅采取现金分红一种收益分配方式，不进行红利再投资；</u> <u>(2) 本基金转型为“中信建投睿溢混合型证券投资基金”后：基金收益分配方式分为现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，基金登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式为准；</u></p>	<p>资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，基金登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式为准；</p>				
<p>55</p>	<p><b>第十六部分 基金的收益与分配</b></p>	<p>六、基金收益分配中发生的费用 <u>本基金在保本期内，收益分配时所发生的银行转账等手续费用由投资者自行承担。如果基金份额持有人所获现金红利不足支付前述银行转账等手续费用，则前述</u></p>	<p>六、基金收益分配中发生的费用 基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足于支付银行转账或其他手续费用时，基金登记</p>				

		<p><u>银行转账等手续费用由相应销售机构（基金管理人或其指定的其他销售机构）承担。</u></p> <p><u>基金转型为“中信建投睿溢混合型证券投资基金”的，</u>基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足于支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。</p>	<p>机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。</p>				
57	第十七部分 基金的会计与审计	<p><u>第十九部分 基金的会计与审计</u></p> <p>一、基金会计政策</p> <p>1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；</p> <p>2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；<u>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</u></p>	<p><u>第十七部分 基金的会计与审计</u></p> <p>一、基金会计政策</p> <p>1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；</p> <p>2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；</p>				

		<u>以并入下一个会计年度披露；</u>				
58	<b>第十八部分 基金的信息披露</b>	<p><u>第二十部分 基金的信息披露</u></p> <p>五、公开披露的基金信息</p> <p>.....</p> <p>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<u>认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务</u>等内容。</p> <p>.....</p> <p><u>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。</u></p> <p><u>(二) 基金份额发售公</u></p>	<p><u>第十八部分 基金的信息披露</u></p> <p>五、公开披露的基金信息</p> <p>.....</p> <p>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<u>申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务</u>等内容。</p> <p>.....</p> <p><u>删除，后续序号相应修改</u></p>			

		<p>告</p> <p><u>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。</u></p> <p><u>(三)《基金合同》生效公告</u></p> <p><u>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。</u></p>				
59	第十八部分 基金的信息披露	<p><u>(四) 基金资产净值、基金份额净值</u></p> <p>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，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。</p> <p><u>(五) 基金份额申购、赎回价格</u></p>	<p><u>(二) 基金资产净值、基金份额净值</u></p> <p>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，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。</p> <p><u>(三) 基金份额申购、赎回价格</u></p>			

		<p>基金管理人应当在《基金合同》、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金份额<u>发售</u>网点查阅或者复制前述信息资料。</p> <p>.....</p>	<p>基金管理人应当在《基金合同》、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金份额<u>销售</u>网点查阅或者复制前述信息资料。</p>				
60	第十八部分 基金的信息披露	<p><u>(七) 临时报告</u></p> <p>.....</p> <p>1、基金份额持有人大会的召开；</p> <p>.....</p> <p>4、<u>更换基金管理人、基金托管人、保证人、担保义务人或保本保障机制；</u></p> <p>.....</p> <p>7、<u>基金募集期延长；</u></p> <p>.....</p> <p>27、<u>与保本周期到期相关的事项；</u></p> <p>.....</p> <p><u>(十二) 保证合同</u></p>	<p><u>(五) 临时报告</u></p> <p>.....</p> <p>1、基金份额持有人大会的召开；</p> <p>.....</p> <p><u>删除，后续序号相应调整</u></p> <p>.....</p> <p><u>删除，后续序号相应调整</u></p> <p>.....</p> <p><u>删除，后续序号相应调整</u></p> <p>.....</p> <p><u>删除，后续序号相应调整</u></p>				

		<u>保证合同作为保本基金的基金合同、招募说明书的附件，随基金合同、招募说明书一同公告。</u>	<u>整</u>				
64	第二十一部分 保本周期到期(原)	第二十一部分 保本周期到期	<u>删除该部分全部内容</u>				
65	第二十分 违约责任	2、基金管理人和/或基金托管人按照当时有效的法律法规或中国证监会、 <u>中国银保监会</u> 等监管机构的规定作为或不作为而造成的损失等；	2、基金管理人和/或基金托管人按照当时有效的法律法规或中国证监会、 <u>中国银行保险监督管理委员会</u> 等监管机构的规定作为或不作为而造成的损失等；				
64	第二十二部分 基金合同的效力	<u>第二十五部分</u> 基金合同的效力 《基金合同》是约定基金合同当事人之间权利义务关系的法律文件。 1、《基金合同》经基金管理人、基金托管人双方盖	<u>第二十二部分</u> 基金合同的效力 《基金合同》是约定基金合同当事人之间权利义务关系的法律文件。 1、 <u>本基金由中信建投稳溢保本混合型证券投资基金</u>				

	<p>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。</p>	<p>转型而来。《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，并自中信建投稳溢保本混合型证券投资基金第一个保本周期到期期间截止日的次日起生效。</p>				
--	---	---	--	--	--	--

注:基金合同和托管协议中存在其他笔误修正，不在对照表中列出。