中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金投资范围新增存托凭证、增加侧袋机制、根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》修改法律文件的公告

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》、《存托凭证发行与交易管理办法(试行)》、《公开募集证券投资基金侧袋机制指引(试行)》、《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号 —— 指数基金指引》(以下简称“新指数指引”)等法律法规及各基金基金合同的规定，经与各基金托管人协商一致，并向中国证监会备案，中信保诚基金管理有限公司(以下简称“本公司”)旗下部分基金就其参与存托凭证投资、增加侧袋机制、明确标的指数事项修订基金合同等法律文件。

本次修订对基金份额持有人利益无实质性不利影响，也不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化，无需召开基金份额持有人大会。

本次修订将自 2021 年 3 月 31 日起正式生效。现将基金合同、托管协议及招募说明书(更新)修订情况公告如下：

一、修订内容

1、增加存托凭证的主要修订

(1)对基金合同“前言”部分进行修订，补充投资存托凭证的风险提示；

(2)对基金合同“基金的投资”部分进行修订，在“投资范围”中增加存托凭证，在“投资策略”中增加存托凭证投资策略，在“投资限制”中增加存托凭证投资限制；

(3)对基金合同“基金资产的估值”(或“基金财产的估值”)部分进行修订，在“估值对象”和“估值方法”中增加存托凭证及其估值方法。

2、增加侧袋机制的主要修订

在基金合同的“前言”、“释义”、“基金份额的申购与赎回”、“基金合同当事人及权利义务”、“基金份额持有人大会”、“基金的投资”、“基金资产估值”(或“基金财产的估值”)、“基金费用与税收”、“基金的收益与分配”、“基金的信息披露”等章节增加侧袋机制相关内容。

3、标的指数事项的主要修订

在基金合同的“前言”、“释义”、“基金的投资”、“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”等章节增加新指数指引相关内容并明确约定标的指数不符合要求、指数编制机构退出等情形时的应急处理安排等内容。

4、托管协议、招募说明书(更新)中涉及上述相关内容的部分将一并修订，并将在基金招募说明书(更新)中揭示相关风险。

涉及上述修改的具体内容详见相关法律文件。

二、本次涉及修订的基金列表

序号	基金全称	本次修改投资范围增加存托凭证	本次修改增加侧袋机制	标的指数事项修订
1	中信保诚中证 500 指数型证券投资基金(LOF)	是	是	是
2	中信保诚沪深 300 指数型证券投资基金(LOF)	是	是	是
3	中信保诚中证 800 金融指数型证券投资基金(LOF)	是	是	是
4	中信保诚中证 TMT 产业主题指数型证券投资基金(LOF)	是	是	是
5	中信保诚中证 800 医药指数型证券投资基金(LOF)	是	是	是
6	中信保诚中证 800 有色指数型证券投资基金(LOF)	是	是	是
7	中信保诚中证智能家居指数型证券投资基金(LOF)	是	是	是
8	中信保诚中证信息安全指数型证券投资基金(LOF)	是	是	是
9	信诚中证基建工程指数型证券投资基金(LOF)	否	是	是
10	中信保诚中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金	否	是	是
11	中信保诚中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金	否	是	是

三、重要提示

本次相关基金基金合同、托管协议、招募说明书修订的内容和程序符合有关法律法规和基金合同的规定。

本次修订更新后的基金合同、托管协议将自 2021 年 3 月 31 日起生效。本公司于公告日在本公司网站上同时公布经修改后的基金合同、托管协议；招募说明书、基金产品资料概要涉及前述内容的，将一并修改，并依照《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定在规定媒介上公告。

投资者可通过以下途径咨询有关详情：

本公司客户服务电话：400-666-0066(免长途费用)

本公司网址：www.citicprufunds.com.cn

本公告的解释权归中信保诚基金管理有限公司所有。

本公告仅对本公司旗下前述 11 只基金修改法律文件的有关事项予以说明。投资者欲了解基金的详细情况，请仔细阅读基金合同、招募说明书及相关法律文件。

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资产，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，基金管理人所管理的其他基金的业绩并不构成对基金业绩表现的保证。投资人应当认真阅读《基金合同》、《招募说明书》、《基金产品资料概要》等基金法律文件，了解基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资人的风险承受能力相适应。

特此公告。

中信保诚基金管理有限公司

2021 年 3 月 31 日

附件：基金合同修改对照表

1、中信保诚中证 500 指数型证券投资基金(LOF)基金合同修改对照表

基金合同章节	修改前	修改后
一、前言	(一)订立本基金合同的目的、依据和原则 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》”)、《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》”)、《公开募集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“《流动性风险管理规定》”)和其他有关法律法规。	新增加： (一)订立本基金合同的目的、依据和原则 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》”)、《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》”)、《公开募集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“《流动性风险管理规定》”)、《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》(以下简称“《指数基金指引》”)和其他有关法律法规。
一、前言	(五)本基金合同约定的基金产品资料概要的编制、披露及更新要求，自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行。	删除
一、前言	无	新增加：@(五)本基金为指数基金，投资者投资于本基金面临跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份股停牌等潜在风险，详见本基金招募说明书。 (六)本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他投资于内地市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险。具体风险烦请查阅本基金招募说明书的“风险揭示”章节的具体内容。 (七)当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，基金管理人履行相应程序后，可以启用侧袋机制。侧袋机制实施期间，基金管理人将对基金简称进行特殊标识，并不办理侧袋账户的申购赎回。请基金份额持有人仔细阅读相关内容并关注本基金启用侧袋机制时的特定风险。
二、释义	无	新增加： 67.《指数基金指引》：指中国证监会 2021 年 1 月 22 日颁布、同年 2 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》及颁布机关对其不时做出的修订 68.侧袋机制：指将基金投资组合中的特定资产从原有账户分离至一个专门账户进行处置清算，目的在于有效隔离并化解风险，确保投资者得到公平对待，属于流动性风险管理工具。侧袋机制实施期间，原有账户称为主袋账户，专门账户称为侧袋账户 69.特定资产：包括：(一)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的资产；(二)按摊余成本计量且计提资产减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产；(三)其他资产价值存在重大不确定性的资产
六、基金份额的申购与赎回	(七)拒绝或暂停申购的情形 发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请： 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接受基金申购申请。	(七)拒绝或暂停申购的情形 发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请： 6.当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金申购申请。
六、基金份额的申购与赎回	(八)暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项： 5.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，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金份额持有人的赎回申请。	(八)暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项： 5.当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金份额持有人的赎回申请。
六、基金份额的申购与赎回	无	新增加： (十三)实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回 本基金实施侧袋机制的，本基金的申购和赎回安排详见招募说明书或相关公告。
九、基金合同当事人及其权利义务	(八)基金份额持有人的权利 每份基金份额具有同等的合法权益。	新增加： (八)基金份额持有人的权利 除法律法规另有规定或基金合同另有约定外，每份基金份额具有同等的合法权益。
十、基金份额持有人大会	(一)基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的授权代表在授权范围内有权代表基金份额持有人在基金份额持有人大会中行使权利。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。	新增加： (一)基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的授权代表在授权范围内有权代表基金份额持有人在基金份额持有人大会中行使权利。除法律法规另有规定或基金合同另有约定外，基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。
十、基金份额持有人大会	无	新增加： (十一)实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定 若本基金实施侧袋机制，则相关基金份额或表决权的比例指主袋份额持有人和侧袋份额持有人分别持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例，但若相关基金份额持有人大会召集和审议事项不涉及侧袋账户的，则仅指主袋份额持有人持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例： 1.基金份额持有人行使提议权、召集权、提名权所需单独或合计代表相关基金份额 10%以上(含 10%)； 2.现场开会的到会者在权益登记日代表基金份额不少于本基金在权益登记日相关基金份额的二分之一(含二分之一)； 3. 通讯开会的直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日相关基金份额的二分之一(含二分之一)； 4.在参与基金份额持有人大会投票的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日相关基金份额的二分之一，召集人在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后，6 个月以内就原定审议事项重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上(含三分之一)相关基金份额的持有人参与或授权他人参与基金份额持有人大会投票； 5.现场开会由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50%以上(含 50%)选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人； 6.一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上(含二分之一)通过； 7.特别决议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三分之二以上(含三分之二)通过。 同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。
十四、基金的投资	(二)投资范围 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括中证 500 指数的成份股及其备选成份股、新股(一级市场初次发行或增发)、债券、权证、股指期货以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。其中，中证 500 指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的 90%，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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，权证投资占基金资产净值的比例为 0~3%，其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。	新增加： (二)投资范围 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括中证 500 指数的成份股(含存托凭证)及其备选成份股(含存托凭证)、新股(一级市场初次发行或增发)、存托凭证、债券、权证、股指期货以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。其中，中证 500 指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的 90%，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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，权证投资占基金资产净值的比例为 0~3%，其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。
十四、基金的投资	(三)投资策略 本基金采用数量化指数投资方法，按照成份股在中证 500 指数中的基准权重为基础，以抽样复制的策略构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整，力争保持基金净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。	新增加： (三)投资策略 本基金采用数量化指数投资方法，按照成份股在中证 500 指数中的基准权重为基础，以抽样复制的策略构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整，力争保持基金净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。
十四、基金的投资	无	新增加： (三)投资策略 对于存托凭证投资，本基金将在深入研究的基础上，通过定性分析、定量分析等方式，筛选相应的存托凭证投资标的。
十四、基金的投资	(四)标的指数与业绩比较基准 1.标的指数 如果中证 500 指数被停止编制及发布，或中证 500 指数由其他指数替代(单纯更名除外)，或由于指数编制方法等重大变更导致中证 500 指数不宜继续作为标的指数，或证券市场上有代表性更强、更合适投资的指数推出，本基金管理人可以依据审慎性原则，在充分考虑持有人利益并履行适当程序的前提下，更换本基金的标的指数和投资对象，并依据市场代表性、流动性、与原指数的相关性等诸多因素选择确定新的标的指数。 2.业绩比较基准 本基金业绩比较基准为：95%×中证 500 指数收益率+5%×金融同业存款利率。 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股票指数时，本基金可以在与本基金托管人协商同意后变更业绩比较基准并及时公告。 本基金由于上述原因变更标的指数和业绩比较基准，基金管理人应于变更前在中国证监会指定媒介上公告。	(四)标的指数与业绩比较基准 2.业绩比较基准 本基金业绩比较基准为：95%×沪深 300 指数收益率+5%×金融同业存款利率。 未来若出现标的指数不符合要求(因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求及法律法规、监管机构另有规定的除外)，指数编制机构退出等情形，基金管理人应当按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作。
十四、基金的投资	无	新增加： (六)投资限制 1.组合限制 (19)本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行。
十四、基金的投资	无	新增加： (九)侧袋机制的实施和投资运作安排 当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制。 侧袋机制实施期间，本部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。 侧袋账户的实施条件、实施程序、运作安排、投资安排、特定资产的处置变现和支付等对投资者权益有重大影响的事项详见招募说明书的规定。
十六、基金财产的估值	无	新增加： (二)估值方法 4.本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票执行。
十六、基金财产的估值	(三)估值对象 基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产。	新增加： (三)估值对象 基金所拥有的股票、存托凭证、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产。
十六、基金财产的估值	(七)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估值；	(七)暂停估值的情形 4.当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值；
十六、基金财产的估值	无	新增加： (九)实施侧袋机制期间的基金资产估值 本基金实施侧袋机制的，应根据本部分的约定对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的基金资产净值和份额净值，暂停披露侧袋账户份额净值。
十七、基金费用与税收	无	新增加： (六)实施侧袋机制期间的基金费用 本基金实施侧袋机制的，与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费，详见招募说明书的规定。
十八、基金收益与分配	无	新增加： (七)实施侧袋机制期间的收益分配 本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配，详见招募说明书的规定。
二十、基金的信息披露	无	新增加： (十)实施侧袋机制期间的信息披露 本基金实施侧袋机制的，相关信息披露义务人应当根据法律法规、基金合同和招募说明书的规定进行信息披露，详见招募说明书的规定。
二十一、基金合同的变更、终止与基金财产的清算	(二)本基金合同的终止 有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止： 1.基金份额持有人大会决定终止的； 2.基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在 6 个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务； 3.基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在 6 个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务； 4.中国证监会规定的其他情况。	新增加： (二)本基金合同的终止 有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止： 1.基金份额持有人大会决定终止的； 2.基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在 6 个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务； 3.基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在 6 个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务； 4.出现标的指数不符合要求(因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求及法律法规、监管机构另有规定的除外)，指数编制机构退出等情形，基金管理人召集基金份额持有人大会对解决方案进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的； 5.中国证监会规定的其他情况。

2、中信保诚沪深 300 指数型证券投资基金(LOF)基金合同修改对照表

基金合同章节	修改前	修改后
一、前言	(一)订立本基金合同的目的、依据和原则 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》”)、《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》”)、《公开募集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“《流动性风险管理规定》”)和其他有关法律法规。	新增加： (一)订立本基金合同的目的、依据和原则 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》”)、《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》”)、《公开募集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“《流动性风险管理规定》”)和其他有关法律法规。
一、前言	(五)本基金合同约定的基金产品资料概要的编制、披露及更新要求，自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行。	删除
一、前言	无	新增加：@(六)本基金为指数基金，投资者投资于本基金面临跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份股停牌等潜在风险，详见本基金招募说明书。 (七)本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他投资于内地市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险。具体风险烦请查阅本基金招募说明书的“风险揭示”章节的具体内容。 (八)当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，基金管理人履行相应程序后，可以启用侧袋机制。侧袋机制实施期间，基金管理人将对基金简称进行特殊标识，并不办理侧袋账户的申购赎回。请基金份额持有人仔细阅读相关内容并关注本基金启用侧袋机制时的特定风险。
二、释义	无	新增加： 66.《指数基金指引》：指中国证监会 2021 年 1 月 22 日颁布、同年 2 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》及颁布机关对其不时做出的修订 67.侧袋机制：指将基金投资组合中的特定资产从原有账户分离至一个专门账户进行处置清算，目的在于有效隔离并化解风险，确保投资者得到公平对待，属于流动性风险管理工具。侧袋机制实施期间，原有账户称为主袋账户，专门账户称为侧袋账户 68.特定资产：包括：(一)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的资产；(二)按摊余成本计量且计提资产减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产；(三)其他资产价值存在重大不确定性的资产
六、基金份额的申购与赎回	(七)拒绝或暂停申购的情形 发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请： 7.当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金份额的申购申请。	(七)拒绝或暂停申购的情形 发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的基金份额申购申请： 7.当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金份额的申购申请。
六、基金份额的申购与赎回	(八)暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的基金份额赎回申请或延缓支付赎回款项： 5.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，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金份额持有人的赎回申请。	(八)暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的基金份额赎回申请或延缓支付赎回款项： 5.当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金份额的赎回申请。
六、基金份额的申购与赎回	无	新增加： (十三)实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回 本基金实施侧袋机制的，本基金的申购和赎回安排详见招募说明书或相关公告。
九、基金合同当事人及其权利义务	(八)基金份额持有人的权利 每份基金份额具有同等的合法权益。	新增加： (八)基金份额持有人的权利 除法律法规另有规定或基金合同另有约定外，每份基金份额具有同等的合法权益。
十、基金份额持有人大会	(一)基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的授权代表在授权范围内有权代表基金份额持有人在基金份额持有人大会中行使权利。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。	新增加： (一)基金份额持有人大会由基金份额持有人或其合法的代理人组成。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。
十、基金份额持有人大会	无	新增加： (十一)实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定 若本基金实施侧袋机制，则相关基金份额或表决权的比例指主袋份额持有人和侧袋份额持有人分别持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例，但若相关基金份额持有人大会召集和审议事项不涉及侧袋账户的，则仅指主袋份额持有人持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例： 1.基金份额持有人行使提议权、召集权、提名权所需单独或合计代表相关基金份额 10%以上(含 10%)； 2.现场开会的到会者在权益登记日代表的基金份额不少于本基金在权益登记日相关基金份额的二分之一(含二分之一)； 3. 通讯开会的直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日相关基金份额的二分之一(含二分之一)； 4.在参与基金份额持有人大会投票的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日相关基金份额的二分之一，召集人在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后，6 个月以内就原定审议事项重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上(含三分之一)相关基金份额的持有人参与或授权他人参与基金份额持有人大会投票； 5.现场开会由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50%以上(含 50%)选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人； 6.一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上(含二分之一)通过； 7.特别决议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三分之二以上(含三分之二)通过。 同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。
十四、基金的投资	(二)投资范围 本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括沪深 300 指数的成份股、备选成份股、新股(含首次公开发行和增发)、债券、债券回购、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许本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)。本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计(轧差计算)占基金资产的比例为 85%~100%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持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，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。	新增加： (二)投资范围 本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括沪深 300 指数的成份股(含存托凭证)、备选成份股(含存托凭证)、新股(含首次公开发行和增发)、存托凭证、债券、债券回购、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许本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)。本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计(轧差计算)占基金资产的比例为 85%~100%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持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，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。
十四、基金的投资	(三)投资策略 本基金采用完全复制法跟踪指数，即按照沪深 300 指数中成份股组成及在权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整，力争保持基金净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。	新增加： (三)投资策略 本基金采用完全复制法跟踪指数，即按照沪深 300 指数中成份股(含存托凭证)组成及在权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整，力争保持基金净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。
十四、基金的投资	无	新增加： (三)投资策略 对于存托凭证投资，本基金将在深入研究的基础上，通过定性分析、定量分析等方式，筛选相应的存托凭证投资标的。
十四、基金的投资	(四)标的指数与业绩比较基准 1.标的指数 如果沪深 300 指数被停止编制及发布，或沪深 300 指数由其他指数替代(单纯更名除外)，或由于指数编制方法等重大变更导致沪深 300 指数不宜继续作为标的指数，或证券市场上有代表性更强、更合适投资的指数推出，本基金管理人可以依据审慎性原则，在充分考虑持有人利益并履行适当程序的前提下，更换本基金的标的指数和投资对象，并依据市场代表性、流动性、与原指数的相关性等诸多因素选择确定新的标的指数。 2.业绩比较基准 本基金业绩比较基准为：95%×沪深 300 指数收益率+5%×金融同业存款利率。 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股票指数时，本基金可以在与本基金托管人协商同意后变更业绩比较基准并及时公告。 本基金由于上述原因变更标的指数和业绩比较基准，基金管理人应于变更前在中国证监会指定媒介上公告。	(四)标的指数与业绩比较基准 2.业绩比较基准 本基金业绩比较基准为：95%×沪深 300 指数收益率+5%×金融同业存款利率。 未来若出现标的指数不符合要求(因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求及法律法规、监管机构另有规定的除外)，指数编制机构退出等情形，基金管理人应当按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作。
十四、基金的投资	无	新增加： (六)投资限制 1.组合限制 (19)本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行。
十四、基金的投资	无	新增加： (九)侧袋机制的实施和投资运作安排 当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制。 侧袋机制实施期间，本部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。 侧袋账户的实施条件、实施程序、运作安排、投资安排、特定资产的处置变现和支付等对投资者权益有重大影响的事项详见招募说明书的规定。
十六、基金财产的估值	无	新增加： (二)估值方法 4.本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票执行。
十六、基金财产的估值	(三)估值对象 基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产。	新增加： (三)估值对象 基金所拥有的股票、存托凭证、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产。
十六、基金财产的估值	(七)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估值；	(七)暂停估值的情形 4.当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值；
十六、基金财产的估值	无	新增加： (九)实施侧袋机制期间的基金资产估值 本基金实施侧袋机制的，应根据本部分的约定对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的基金资产净值和份额净值，暂停披露侧袋账户份额净值。
十七、基金费用与税收	无	新增加： (六)实施侧袋机制期间的基金费用 本基金实施侧袋机制的，与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费，详见招募说明书的规定。
十八、基金收益与分配	无	新增加： (七)实施侧袋机制期间的收益分配 本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配，详见招募说明书的规定。
二十、基金的信息披露	无	新增加： (十)实施侧袋机制期间的信息披露 本基金实施侧袋机制的，相关信息披露义务人应当根据法律法规、基金合同和招募说明书的规定进行信息披露，详见招募说明书的规定。
二十一、基金合同的变更、终止与基金财产的清算	(二)本基金合同的终止 有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止： 1.基金份额持有人大会决定终止的； 2.基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在 6 个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务； 3.基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在 6 个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务； 4.中国证监会规定的其他情况。	新增加： (二)本基金合同的终止 有下列情形之一的，本基金合同应当终止： 1.基金份额持有人大会决定终止的； 2.基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在 6 个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务； 3.基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在 6 个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务； 4.中国证监会规定的其他情况。

3、中信保诚中证 800 金融指数型证券投资基金(LOF)基金合同修改对照表

基金合同章节	修改前	修改后
一、前言	(一)订立本基金合同的目的、依据和原则 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》”)、《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》”)、《公开募集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“《流动性风险管理规定》”)和其他有关法律法规。	新增加： (一)订立本基金合同的目的、依据和原则 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》”)、《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》”)、《公开募集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