

天弘基金管理有限公司关于天弘永利债券型证券投资基金修订 基金合同部分条款的公告

根据中国证监会颁布的《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“《规定》”）要求，天弘基金管理有限公司（以下简称“本公司”）经与基金托管人协商一致，对旗下天弘永利债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金合同部分条款进行修订，具体内容敬请投资者详见附件。

本次修订主要涉及基金合同中释义、基金的投资、申购与赎回、资产估值、信息披露等部分内容。同时，经与基金托管人协商一致，根据基金合同的修订内容，对本基金托管协议相应做出了调整。

重要提示：

1、本次系根据《规定》要求修订本基金的基金合同及托管协议，并按照相关法律法规的要求履行相应程序。所修订内容可能对本基金投资运作及投资者办理基金申购、赎回业务产生一定影响，包括且不限于：出于流动性风险管理需要增加或调整了基金的部分投资限制规定；对持续持有期少于7日的投资者收取不低于1.5%的赎回费；在规定的特定情形下可能会对投资者的申购/赎回申请数量进行限制、临时拒绝或暂停申购/赎回申请、对部分赎回申请进行延期办理等，由此可能导致投资者的申购/赎回申请无法全部及时处理，从而可能影响投资者的资金安排及投资计划。敬请投资者关注以上变化和影响，并仔细阅读本基金修订后的基金合同等法律文件，审慎进行投资决策。

本基金的招募说明书将根据法定时间要求，进行更新及披露。

2、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。投资者投资于本基金时应认真阅读本基金的《基金合同》等相关法律文件。

3、投资者可登陆我公司官方网站（www.thfund.com.cn）或拨打我公司客户服务热线（95046）进行详细咨询。

特此公告。

天弘基金管理有限公司

二〇一八年三月三十日

附件：《天弘永利债券型证券投资基金基金合同》修订对照表

附件：

《天弘永利债券型证券投资基金基金合同》修订对照表

所在部分	修改前内容	修改后内容
第一部分 前言和释义	<p>前 言</p> <p>为保护基金投资者合法权益，明确基金合同当事人的权利与义务，规范天弘永利债券型证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）运作，依照《中华人民共和国合同法》、《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》）、《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>证券投资基金信息披露内容与格式准则第 6 号《基金合同的内容与格式》</u>及其他有关规定，在平等自愿、诚实信用、充分保护基金投资者及相关当事人的合法权益的原则基础上，特订立《天弘永利债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“本合同”或“《基金合同》”）。</p> <p>……</p>	<p>前 言</p> <p>为保护基金投资者合法权益，明确基金合同当事人的权利与义务，规范天弘永利债券型证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）运作，依照《中华人民共和国合同法》、《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》）、《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“《流动性管理规定》”）、<u>证券投资基金信息披露内容与格式准则第 6 号《基金合同的内容与格式》</u>及其他有关规定，在平等自愿、诚实信用、充分保护基金投资者及相关当事人的合法权益的原则基础上，特订立《天弘永利债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“本合同”或“《基金</p>

	<p>释 义</p> <p>.....</p>	<p>合同》”）。</p> <p>.....</p> <p>释 义</p> <p>.....</p> <p><u>《流动性管理规定》</u>：指《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（新增）</p> <p>.....</p> <p><u>流动性受限资产</u>：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（新增）</p> <p><u>摆动定价机制</u>：指当开放式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，确保投资人的合法权益不受损害并得到公平对待（新增）</p>
第五部分	(五) 申购份额与赎回的数额限制	(五) 申购份额与赎回的数额限制

<p>基金份额的申购、赎回</p>	<p>.....</p> <p>(六) 申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>.....</p> <p>2、本基金赎回金额的计算</p> <p>.....</p> <p>A 类基金的赎回费率如下：</p> <table border="0"> <tr> <td>持有时间 (N)</td> <td>赎回费率</td> </tr> <tr> <td>N<30 天</td> <td>0.75%</td> </tr> <tr> <td>30 天≤N<60 天</td> <td>0.30%</td> </tr> <tr> <td>N≥60 天</td> <td>0%；</td> </tr> </table> <p>B 类与 E 类基金的赎回费率如下：</p> <table border="0"> <tr> <td>持有时间 (N)</td> <td>赎回费率</td> </tr> </table>	持有时间 (N)	赎回费率	N<30 天	0.75%	30 天≤N<60 天	0.30%	N≥60 天	0%；	持有时间 (N)	赎回费率	<p>.....</p> <p><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。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告；（新增，以下序号顺延）</u></p> <p>.....</p> <p>(六) 申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>.....</p> <p>2、本基金赎回金额的计算</p> <p>.....</p> <p>A 类基金的赎回费率如下：</p> <table border="0"> <tr> <td>持有时间 (N)</td> <td>赎回费率</td> </tr> <tr> <td><u>N<7 天</u></td> <td><u>1.50%</u></td> </tr> <tr> <td><u>7 天≤N<30 天</u></td> <td>0.75%</td> </tr> <tr> <td>30 天≤N<60 天</td> <td>0.30%</td> </tr> <tr> <td>N≥60 天</td> <td>0%；</td> </tr> </table> <p>B 类与 E 类基金的赎回费率如下：</p> <table border="0"> <tr> <td>持有时间 (N)</td> <td>赎回费率</td> </tr> </table>	持有时间 (N)	赎回费率	<u>N<7 天</u>	<u>1.50%</u>	<u>7 天≤N<30 天</u>	0.75%	30 天≤N<60 天	0.30%	N≥60 天	0%；	持有时间 (N)	赎回费率
持有时间 (N)	赎回费率																							
N<30 天	0.75%																							
30 天≤N<60 天	0.30%																							
N≥60 天	0%；																							
持有时间 (N)	赎回费率																							
持有时间 (N)	赎回费率																							
<u>N<7 天</u>	<u>1.50%</u>																							
<u>7 天≤N<30 天</u>	0.75%																							
30 天≤N<60 天	0.30%																							
N≥60 天	0%；																							
持有时间 (N)	赎回费率																							

	<p>(九) 拒绝或暂停申购、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形及处理</p> <p>1、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>.....</p> <p>(5) 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值的情形；</p> <p>.....</p>	<p><u>及监管部门、自律组织的规定。(新增)</u></p> <p>.....</p> <p>(九) 拒绝或暂停申购、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形及处理</p> <p>1、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>.....</p> <p>(5) 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值的情形；<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，基金管理人应当暂停接受基金申购申请；</u></p> <p><u>(6) 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者持有基金份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形。法律法规或中国证监会另有规定的除外；(新增)</u></p> <p><u>(7) 申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单一投资者单日或单笔申购金额上限的。(新增，以下序号顺延)</u></p> <p>.....</p>
--	--	--

<p>发生上述(1)至(3)项或(5)、(6)项情形时,基金管理人应最迟在两日内刊登拒绝或暂停申购的公告并向中国证监会备案。</p> <p>发生上述(5)项情形时,基金管理人应将申购款项全额退还申购申请人。</p> <p>.....</p> <p>2、暂停接受和办理赎回申请</p> <p>.....</p> <p>(4)发生本基金合同规定的暂停基金资产估值的情形;</p> <p>.....</p> <p>(十)巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>.....</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>.....</p> <p>(3)本基金单个开放日发生巨额赎回且单个持有人的赎回申请超过上一日基金总份额10%的情形下,对此</p>	<p>发生上述(1)至(3)项或(5)、(8)项情形时,基金管理人应最迟在两日内刊登拒绝或暂停申购的公告并向中国证监会备案。</p> <p>发生上述(4)、(6)、(7)项情形时,基金管理人应将申购款项相应退还申购申请人。</p> <p>.....</p> <p>2、暂停接受和办理赎回申请</p> <p>.....</p> <p>(4)发生本基金合同规定的暂停基金资产估值的情形;<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,基金管理人应当暂停接受基金赎回申请或延缓支付赎回款项;</u></p> <p>.....</p> <p>(十)巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>.....</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>.....</p> <p>(3)<u>当基金出现巨额赎回时,在单个基金份额持有人赎回申请超过上一开放日基金总份额10%的情</u></p>
--	--

	<p><u>单个持有人在比例以内的赎回申请与其他持有人的赎回申请仍按照前述条款处理。但对此单个持有人超过该比例的赎回申请，基金管理人有权延期办理赎回，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，并应当在指定媒体上刊登公告。</u></p> <p>.....</p>	<p><u>形下，基金管理人认为支付该基金份额持有人的全部赎回申请有困难或者因支付该基金份额持有人的全部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，基金管理人可以对该单个基金份额持有人超出10%的赎回申请实施延期办理。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，具体参照上述（2）方式处理。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。而对该单个基金份额持有人10%以内（含10%）的赎回申请与其他投资者的赎回申请按上述（1）、（2）方式处理，具体见相关公告。（新增，以下序号顺延）</u></p>
<p>第六部分 基金合同 当事人及 权利义务</p>	<p>一、基金管理人</p> <p>.....</p> <p><u>住所：天津市河马区马场道 59 号天津国际经济贸易中心 A 座 16 层</u></p> <p>.....</p>	<p>一、基金管理人</p> <p>.....</p> <p><u>注册地址：天津自贸区（中心商务区）响螺湾旷世国际大厦 A 座 1704-241 号</u></p> <p><u>办公地址：天津市河西区马场道 59 号天津国际经济贸易中心 A 座</u></p>

	<p>存续期限：<u>长期</u></p> <p>.....</p> <p>(二) 基金托管人</p> <p>.....</p> <p>注册资本：<u>50</u> 亿元人民币</p>	<p><u>16 层</u> (新增)</p> <p><u>邮政编码：300203</u> (新增)</p> <p>.....</p> <p><u>存续期间：持续经营</u></p> <p>.....</p> <p><u>联系电话：(022) 83310208</u> (新增)</p> <p>.....</p> <p>(二) 基金托管人</p> <p>.....</p> <p>注册资本：<u>207.74</u> 亿元人民币</p>
<p>第十一部分 基金投资</p>	<p>(二) 投资范围</p> <p>.....</p> <p>本基金对债券类资产及中国证监会批准的允许基金投资的其他固定收益类金融工具的投资比例不低于基金资产的 80%，对股票等权益类证券的投资比例不超过基金资产的 20%，对现金和到期日不超过一年的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p> <p>.....</p> <p>(六) 投资限制</p> <p>.....</p> <p>2、 投资组合限制</p> <p>.....</p>	<p>(二) 投资范围</p> <p>.....</p> <p>本基金对债券类资产及中国证监会批准的允许基金投资的其他固定收益类金融工具的投资比例不低于基金资产的 80%，对股票等权益类证券的投资比例不超过基金资产的 20%，对现金和到期日不超过一年的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，<u>其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。</u></p> <p>.....</p> <p>(六) 投资限制</p> <p>.....</p> <p>2、 投资组合限制</p> <p>.....</p>

	<p>(14) 保持不低于基金资产净值百分之五的现金或者到期日在一年以内的政府债券；</p> <p>.....</p>	<p>(2) <u>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%; (新增, 以下序号顺延)</u></p> <p>.....</p> <p>(14) 保持不低于基金资产净值百分之五的现金或者到期日在一年以内的政府债券, <u>其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等;</u></p> <p>.....</p> <p>(16) <u>本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 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该比例限制的, 基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资; (新增)</u></p> <p>(17) <u>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</u></p>
--	---	--

	<p>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(1)—(10)项规定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内调整完毕。</p>	<p><u>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本基金合同约定的投资范围保持一致；</u>（新增，以下序号顺延）</p> <p>.....</p> <p>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(1)—(13)项规定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内调整完毕。</p>
<p>第十三部分 基金资产的估值</p>	<p>(三) 估值方法</p> <p>.....</p> <p>(七) 暂停估值的情形</p> <p>.....</p>	<p>(三) 估值方法</p> <p>.....</p> <p><u>6、当本基金发生大额申购或赎回情形时，本基金管理人在履行适当程序后，可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。</u>（新增）</p> <p>.....</p> <p>(七) 暂停估值的情形</p> <p>.....</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估值；</u>（新增，以下序号顺延）</p>

<p>第十七部分 基金的信息披露</p>	<p>(五) 公开披露的基金信息</p> <p>.....</p> <p>6、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</p> <p>.....</p> <p>7、临时报告</p> <p>.....</p>	<p>(五) 公开披露的基金信息</p> <p>.....</p> <p>6、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</p> <p>.....</p> <p><u>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20%的情形，为保障其他投资者利益，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“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定风险。(新增)</u></p> <p><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。(新增)</u></p> <p>7、临时报告</p> <p>.....</p> <p><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时；(新增)</u></p> <p><u>(27) 基金管理人采用摆动定价机制进行估值；(新增，以下序号顺</u></p>
----------------------	---	---

		延)
--	--	----