



天治基金管理有限公司
CHINA NATURE ASSET MANAGEMENT CO., LTD.

天治基金管理有限公司关于天治新消费灵活配置混合型证券投资基金修改基金合同的公告

根据中国证监会 2017 年 10 月 1 日起施行的《公开募集开放式证券投资基金管理流动性风险管理规定》，经与基金托管人上海银行股份有限公司协商一致，天治基金管理有限公司（以下简称“本公司”）对旗下天治新消费灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金合同进行修改。本次部分修改系因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行的修改，且其他修改未对原有基金份额持有人的利益造成任何实质性不利影响，根据基金合同的约定，不需召开持有人大会。本基金的托管协议相应部分一并修改。本基金基金合同、托管协议的修改已向监管机构备案。具体修改内容请见附件。

修改后的基金合同、托管协议将登载于本公司网站，并于 2018 年 3 月 31 日起生效，2018 年 3 月 31 日之前仍按照修改前的基金合同、托管协议的约定运作。

本公司将在更新本基金的招募说明书时，对上述相关内容进行相应修改。

投资者可通过以下途径咨询有关详情：

天治基金管理有限公司网站：www.chinanature.com.cn

客户服务电话：400-098-4800、021-60374800

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。基金的过往业绩并不预示其未来表现。投资者投资于本公司管理的基金时应认真阅读基金合同、招募说明书等法律文件，并注意投资风险。

特此公告。

附件：天治新消费灵活配置混合型证券投资基金基金合同修改对照表

天治基金管理有限公司

2018 年 3 月 30 日

附件：天治新消费灵活配置混合型证券投资基金基金合同修改对照表

章节	修改前	修改后	备注
第一部分 “前言”	<p>原表述：</p> <p>一、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》”)和其他有关法律法规。</p> <p>增加表述</p>	<p>修改为：</p> <p>一、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》”)、《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。</p> <p>增加：</p> <p>六、本基金单一投资者持有基金份额数</p>	<p>新增《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》作为订立基金合同的依据</p> <p>《流动性风险管理规定》第19条要求</p>

		不得达到或超过基金份额总数的 50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过 50%的除外。	
第二部分“释义”	增加表述	<p>增加：</p> <p>12、《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 日起实施的《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>51、流动性受限资产：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</p>	新增与《流动性风险管理规定》相关的释义

		<p>的债券等</p> <p>52、摆动定价机制：指当本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，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待</p> <p>其余序号作相应调整</p>	
第六部分“基金份额的申购与赎回”之“五、申购和赎回的数量限制”	增加表述	<p>增加：</p> <p>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</p>	《流动性风险管理规定》第十九条关于“拒绝或暂停接受投资者申购的情形”

		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。其余序号作相应调整	
第六部分“基金份额的申购与赎回”之“六、申购和赎回的价格、费用及其用途”	<p>原表述：</p> <p>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。赎回费用归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。</p> <p>增加表述</p>	<p>修改为：</p> <p>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。赎回费用归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。其中对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费并全额计入基金财产。</p> <p>增加：</p> <p>7、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循</p>	<p>《流动性风险管理规定》第二十三条关于“短期赎回费规定”</p> <p>《流动性风险管理规定》第二十五条</p>

		<p>相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。</p> <p>其余序号作相应调整</p>	
第六部分“基金份额的申购与赎回”之“七、拒绝或暂停申购的情形”	<p>增加表述</p> <p>原表述： 发生上述第 1、2、3、5、6 项暂停申购</p>	<p>增加：</p> <p>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%集中度的情形时。</p> <p>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，基金管理人应当暂停基金估值，并采取暂停接受基金申购申请的措施。</p> <p>其余序号作相应调整</p> <p>修改为：</p> <p>发生上述第 1、2、3、5、7、8 项暂停申</p>	<p>《流动性风险管理规定》第十九条、第二十四条关于“拒绝或暂停接受投资者申购的情形”</p> <p>根据前文序号调整</p>

	<p>情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人的申购申请时，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>购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人的申购申请时，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全部或部分拒绝的，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>	
第六部分“基金份额的申购与赎回”之“八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形”	增加表述	<p>增加：</p> <p>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基金估值，并采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。</p> <p>其余序号作相应调整</p>	《流动性风险管理规定》第二十四条关于“暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形”的规定

<p>第六部分 “基金份额的申购与赎回”之“九、巨额赎回的情形及处理方式”之“2、巨额赎回的处理方式”</p>	<p>原表述：</p> <p>(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的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，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；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。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请</p>	<p>修改为：</p> <p>(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的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，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；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。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请</p>	<p>《流动性风险管理规定》第二十一条关于“开放式基金巨额赎回的相关规定”</p>
---	--	--	---

	<p>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。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。</p>	<p>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。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。</p> <p>若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额 20%的，基金管理人有权对该单个基金份额持有人超出该比例的赎回申请实施延期办理，对该单个基金份额持有人剩余赎回申请与其他账户赎回申请按前述条款处理。</p>	
第七部分“基金合同当事人及权利义务”之“一、基金管理人”	<p>原表述：</p> <p>(一) 基金管理人简介 名称：天治基金管理有限公司 住所：上海市浦东新区莲振路 298 号 4 号楼 231 室</p>	<p>修改为：</p> <p>(一) 基金管理人简介 名称：天治基金管理有限公司 住所：上海市浦东新区莲振路 298 号 4 号楼 231 室</p>	更新了基金合同中基金管理人的信息

	<p>法定代表人：赵玉彪</p> <p>设立日期：2003年5月27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[2003]73号</p> <p>组织形式：有限责任公司</p> <p>注册资本：1.6亿元人民币</p> <p>存续期限：持续经营</p> <p>联系电话：021-60371155</p>	<p>法定代表人：吕文龙</p> <p>设立日期：2003年5月27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[2003]73号</p> <p>组织形式：其他有限责任公司</p> <p>注册资本：1.6亿元人民币</p> <p>存续期限：持续经营</p> <p>联系电话：021-60371155</p>	
第七部分“基金合同当事人及权利义务”之“二、基金托管人”	<p>原表述：</p> <p>(一) 基金托管人简介</p> <p>名称：上海银行股份有限公司</p> <p>住所：中国上海市浦东新区银城中路168号</p> <p>法定代表人：金煜</p> <p>成立时间：1995年12月29日</p> <p>批准设立机关和批准设立文号：中国人民银行 银复[1995]469号《关于上海城市合作银行开业的批复》，中国人民银行</p>	<p>修改为：</p> <p>(一) 基金托管人简介</p> <p>名称：上海银行股份有限公司</p> <p>住所：中国(上海)自由贸易试验区银城中路168号</p> <p>法定代表人：金煜</p> <p>成立时间：1995年12月29日</p> <p>批准设立机关和批准设立文号：中国人民银行 银复[1995]469号《关于上海城</p>	更新了基金合同中基金托管人的信息

	<p>银复[1998]215号《关于上海城市合作银行更改行名的批复》</p> <p>组织形式：股份有限公司</p> <p>注册资本：54.04亿元</p> <p>存续期间：持续经营</p> <p>基金托管资格批文及文号：证监许可[2009]814号 关于核准上海银行证券投资基金托管资格的批复</p>	<p>市合作银行开业的批复》，中国人民银行银复[1998]215号《关于上海城市合作银行更改行名的批复》</p> <p>组织形式：股份有限公司（中外合资、上市）</p> <p>注册资本：78.06亿元</p> <p>存续期间：持续经营</p> <p>基金托管资格批文及文号：证监许可[2009]814号 关于核准上海银行证券投资基金托管资格的批复</p>	
第十二部分“基金的投资”之“二、投资范围”	<p>原表述：</p> <p>本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超</p>	<p>修改为：</p> <p>本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超</p>	《流动性风险管理规定》第十八条关于“开放式基金资金头寸管理的相关规定”

	<p>短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、中小企业私募债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券或票据)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许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。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金股票资产投资比例为基金资产的 0%-95%，其中，投资于受益于新消费主题相关企业的证券不低于非现金基金资产的 80%。本基金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%的现金或者到期日在一</p>	<p>短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、中小企业私募债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券或票据)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许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。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金股票资产投资比例为基金资产的 0%-95%，其中，投资于受益于新消费主题相关企业的证券不低于非现金基金资产的 80%。本基金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%的现金或者到期日在一</p>	
--	---	---	--

	年以内的政府债券。	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。	
第十二部分 “基金的投资”之“四、投资限制”	<p>原表述：</p> <p>1、(2) 本基金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% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券；</p> <p>(4) 本基金管理人管理的全部基金持有家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；</p> <p>除上述第（12）项另有约定外，因证券或期货市场波动、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>修改为：</p> <p>1、(2) 本基金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% 的现金或者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；</p> <p>(4) 本基金管理人管理的全部基金持有家公司发行的证券，不超过该证券的 10%； 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</p>	<p>《流动性风险管理规定》第十八条规定关于“开放式基金资金头寸管理的相关规定”、第十五条规定关于“可流通股票的投资限制”、第十六条规定关于“流动性受限资产的投资限制”以及第十七条规定关于“逆回购交易的质押品的限制”</p>

	<p>增加表述</p> <p>可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%; 除上述第（2）、（12）、（18）、（19）项另有约定外，因证券或期货市场波动、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>增加：</p> <p>1、（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上述比例限制的，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本基金合同约定的投资范围保持一致；</p> <p>其余序号作相应调整</p>	
第十四部分 “基金资产估值”之“三、估值方法”	增加表述	<p>增加：</p> <p>8、当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。</p> <p>其余序号作相应调整</p>	《流动性风险管理规定》第二十五条关于“摆动定价的规定”
第十四部分 “基金资产估值”之“六、暂停估值的情形”	增加表述	<p>增加：</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；</p>	《流动性风险管理规定》第二十四条关于“加强极端市场条件下的估值业务管理”

		其余序号作相应调整	
第十八部分“基金的信息披露”之“五、公开披露的基金信息”之“(四)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”	增加表述	<p>增加：</p> <p>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情形，为保障其他投资者利益，基金管理人至少应当在季度报告、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产品本基金的特有风险。</p> <p>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。</p>	《流动性风险管理规定》第二十六条第(二)项关于“流动性风险分析披露”的规定及第二十七条关于“报告期内单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情形”

第十八部分“基金的信息披露”之“五、公开披露的基金信息”之“(五)临时报告”	增加表述	增加： 25、本基金发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时； 26、基金管理人采用摆动定价机制进行估值； 其余序号作相应调整	《流动性风险管理规定》第二十六条第(二)项关于“流动性风险分析披露”的规定及第二十五条关于“摆动定价的规定”
--	------	---	--