

天弘基金管理有限公司关于天弘丰利债券型证券投资基金(LOF) 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,对旗下天弘丰利债券型证券投资基金(LOF)(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：《天弘丰利债券型证券投资基金（LOF）基金合同》修订对照表

附件：

《天弘丰利债券型证券投资基金（LOF）基金合同》修订对照表

所在部分	修改前内容	修改后内容
标题	天弘丰利分级债券型证券投资基金 基金基金合同	天弘丰利债券型证券投资基金 <u>（LOF）基金合同</u> <u>（由天弘丰利分级债券型证券投资基金转型而来）</u>
第一部分 前言	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，规范天弘丰利分级债券型 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》）、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》、《深 圳证券交易所证券投资基金上 市规则》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	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，规范天弘丰利分级债券型 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》）、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》、《深 圳证券交易所证券投资基金上 市规则》、 <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

	<p>权益的原则基础上，特订立《天弘丰利分级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><u>定》”)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《天弘丰利分级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》”)。</u></p> <p>.....</p> <p><u>根据基金合同的约定，本基金基金合同生效后3年期已届满，天弘丰利分级债券型证券投资基金转换为天弘丰利债券型证券投资基金(LOF)后，故基金合同中的份额分级机制等相关内容均不再适用。(新增)</u></p>
第二部分 释义	<p>.....</p>	<p>.....</p> <p><u>《流动性管理规定》 《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(新增)</u></p> <p>.....</p> <p><u>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</u></p>

		<p><u>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)</u></p> <p><u>摆动定价机制 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，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待 (新增)</u></p>
第七部分 基金份额的 申购与赎回	<p>二、本基金转换为上市开放式基金（LOF）后的申购与赎回</p> <p>.....</p> <p>（六）申购与赎回的数额限制</p> <p>.....</p>	<p>二、本基金转换为上市开放式基金（LOF）后的申购与赎回</p> <p>.....</p> <p>（六）申购与赎回的数额限制</p> <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，</u></p>

	<p>可采取上述措施对基金规模予以控制。具体请参见相关公告。</p> <p>(新增, 以下序号顺延)</p> <p>.....</p> <p>(七) 申购费用和赎回费用</p> <p>.....</p> <p>2、投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取, 扣除用于市场推广、注册登记费和其他手续费后的余额归基金财产, 赎回费归入基金财产的比例</p> <p>3、本基金的赎回费率最高不超过 5%。</p> <p>.....</p>	<p>(七) 申购费用和赎回费用</p> <p>.....</p> <p>2、投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取, <u>对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费并全额计入基金财产, 对持续持有期不少于 7 日的投资者收取的赎回费扣除用于市场推广、注册登记费和其他手续费后的余额归基金财产, 赎回费归入基金财产的比例不得低于赎回费总额的 25%。</u></p> <p>3、本基金的赎回费率最高不超过 5%, <u>其中对持续持有期少于 7 日的投资者将收取不低于 1.5% 的赎回费。</u></p> <p>.....</p> <p>5、<u>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。具体处</u></p>
--	---	--

	<p>(十) 拒绝或暂停申购的情形及 处理方式</p> <p>.....</p> <p>发生上述情形之一且基金管理</p>	<p><u>理原则与操作规范遵循相关法 律法规以及监管部门、自律组织 的规定。(新增, 以下序号顺延)</u></p> <p>.....</p> <p><u>(十) 拒绝或暂停申购的情形及 处理方式</u></p> <p>.....</p> <p><u>(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接 受基金申购申请; (新增)</u></p> <p><u>(5) 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;</u></p> <p><u>(新增, 以下序号顺延)</u></p> <p>.....</p> <p><u>(8) 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)</u></p> <p>发生上述情形之一且基金管理</p>
--	---	---

<p>人决定暂停或拒绝基金投资者的申购申请的，申购款项将全额退还投资者。发生上述 <u>(1) 到 (4)</u> 项暂停申购情形时，基金管理人应当在至少一家指定媒体刊登暂停申购公告。</p> <p>.....</p> <p>(十一)暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式</p> <p>.....</p> <p>(十二)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>人决定暂停或拒绝基金投资者的申购申请的，申购款项将相应退还投资者。发生上述 <u>(1) 到 (4)、(6)</u> 项暂停申购情形时，基金管理人应当在至少一家指定媒体刊登暂停申购公告。</p> <p>.....</p> <p>(十一)暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式</p> <p>.....</p> <p><u>(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接受基金赎回申请或延缓支付赎回款项；(新增，以下序号顺延)</u></p> <p>(十二)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><u>(3) 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%的情形下，基金管理人认为</u></p>
---	---

		<p>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）</p>
第十部分 基金合同当事人及权利义务	<p>一、基金管理人</p> <p>.....</p> <p><u>住所：</u>天津市河马区马场道 59 号天津国际经济贸易中心 A 座</p> <p><u>16 层</u></p> <p>.....</p>	<p>一、基金管理人</p> <p>.....</p> <p><u>注册地址：</u>天津自贸区（中心商务区）响螺湾旷世国际大厦 A 座</p> <p><u>1704-241 号</u></p> <p><u>办公地址：</u>天津市河西区马场道</p>

	<p>法定代表人: <u>井贤栋</u> (拟任)</p> <p>.....</p> <p>存续期限: <u>长期</u></p> <p>.....</p> <p>二、基金托管人</p> <p>名称: <u>中国邮政储蓄银行有限责任公司</u></p> <p>.....</p> <p>法定代表人: <u>刘安东</u></p> <p>.....</p> <p>注册资本: <u>470</u> 亿元人民币</p>	<p><u>59 号天津国际经济贸易中心 A 座 16 层 (新增)</u></p> <p><u>邮政编码: 300203 (新增)</u></p> <p>法定代表人: <u>井贤栋</u></p> <p>.....</p> <p>存续期间: <u>持续经营</u></p> <p><u>经营范围: 基金募集、基金销售、资产管理、从事特定客户资产管理业务、中国证监会许可的其他业务。</u> (新增)</p> <p>.....</p> <p>二、基金托管人</p> <p>名称: <u>中国邮政储蓄银行股份有限公司</u></p> <p>.....</p> <p>法定代表人: <u>李国华</u></p> <p>.....</p> <p>注册资本: <u>810.31</u> 亿元人民币</p>
第十五部分 基金的投资	<p>二、投资范围</p> <p>.....</p> <p>本基金对债券等固定收益类证券的投资比例不低于基金资产的 80%，其中，投资于信用债券的资产占基金固定收益类资产的比例不低于 40%，持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，本</p>	<p>二、投资范围</p> <p>.....</p> <p>本基金对债券等固定收益类证券的投资比例不低于基金资产的 80%，其中，投资于信用债券的资产占基金固定收益类资产的比例不低于 40%，持有现金或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</p>

	<p>基金对股票等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%。</p> <p>五、投资限制</p> <p>(二) 投资组合限制</p> <p>.....</p> <p>5、现金或到期日不超过 1 年的政府债券不低于基金资产净值的 5%;</p>	<p><u>中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</u>本基金对股票等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%。</p> <p>五、投资限制</p> <p>(二) 投资组合限制</p> <p><u>2、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%；</u>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 <u>30%；</u>（新增，以下序号顺延）</p> <p>6、现金或到期日不超过 1 年的政府债券不低于基金资产净值的 5%，<u>其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；</u></p> <p>11、本基金与私募类证券资管产</p>
--	---	--

	<p>10、本基金持有一家公司发行的流通受限证券，其市值不得超过基金资产净值的百分之二；本基金持有的所有流通受限证券，其市值不得超过基金资产净值的百分之十；经基金管理人和基金托管人协商，可对以上比例进行调整；</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本基金投资比例不符合上述各项规定的投资比例，基金管理人应当在 10 个交易日内调整完毕。</p>	<p>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；（新增）</p> <p>12、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；</p> <p>.....</p> <p>除上述 6、11、12 情形之外，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本基金投资比例不符合上述各项规定的投资比例，基金管理人应当在 10 个交易日内调整完毕。</p>
第十七部分 基金资产估值	<p>五、估值方法</p> <p>.....</p>	<p>五、估值方法</p> <p>.....</p> <p>5、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</p>

	<p>八、暂停估值与公告基金份额净值的情形</p> <p>.....</p>	<p>性。(新增)</p> <p>.....</p> <p>八、暂停估值与公告基金份额净值的情形</p> <p>.....</p> <p><u>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一致的，基金管理人应当暂停估值；(新增，以下序号顺延)</u></p>
第二十部分 基金的信息披露	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>.....</p> <p>(七)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>五、公开披露的基金信息</p> <p>.....</p> <p>(七)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</p> <p>.....</p> <p><u>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有风险。(新</u></p>

		<p>增)</p> <p><u>本基金持续运作过程中，基金管理人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>(新增)</p> <p>(八) 临时报告</p> <p>.....</p>
		<p>30、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，以下序号顺延)</p> <p>31、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；(新增，以下序号顺延)</p>