

兴银基金管理有限责任公司
关于修改兴银丰润灵活配置混合型证券投资基金
基金合同等法律文件的公告

一、本次修改的基本情况

为保护投资者利益，兴银丰润灵活配置混合型证券投资基金于 2017 年 9 月 8 日公告暂不募集本基金。

二、基金合同修改情况

基于上述调整，经与本基金托管人兴业银行股份有限公司协商一致，本公司已根据相关法律法规对本基金的基金合同中相关内容进行修订，并报中国证监会备案。

三、重要提示

1、本次修订按照相关法律法规和监管机构的规定执行，基金合同修改后，基金的投资目标、风险收益特征不发生改变。本基金管理人已就修订内容履行了规定的程序，符合相关法律法规及基金合同的规定。

2、本公告仅对本基金根据法律法规修订有关事项予以说明。基金管理人将在本公告发布当日，将修改后的基金合同、托管协议、招募说明书登载于本公司网站。本基金基金合同的修改详见附件《〈兴银丰润灵活配置混合型证券投资基金〉修改前后对照表》，托管协议、招募说明书涉及基金合同相关变动处一并修改。

3、投资者在销售机构办理本基金的投资事务，具体办理规则及程序请遵循销售机构的规定。

投资者可以通过以下途径咨询有关详情：

- 1、兴银基金管理有限责任公司客户服务电话：40000-96326
- 2、兴银基金管理有限责任公司网站：www.hffunds.cn

兴银基金管理有限责任公司

2017 年 9 月 30 日

《兴银丰润灵活配置混合型证券投资基金基金合同》修改前后对照表

章节	原文	修改后
第一部分前言	<p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</p> <p>2、订立本基金合同的依据是《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》”)、《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>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</p> <p>2、订立本基金合同的依据是《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》”)、《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>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</u>(以下简称“<u>《流动性风险规定》</u>”)和其他有关法律法规。</p>
第二部分释义		<p>新增：</p> <p><u>13、《流动性风险规定》</u>：指中国证监局 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《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>
第二部分释义		<p><u>54、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</p> <p><u>55、摆动定价机制</u>：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，</p>

		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
第六部分基金份额的申购与赎回		三、申购与赎回的原则 新增： 5、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可对本基金采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。摆动定价机制的处理原则与操作规范按照中国证券投资基金业协会相关规定执行。
第六部分基金份额的申购与赎回		五、申购和赎回的数量限制 新增： 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。具体请参见相关公告。
第六部分基金份额的申购与赎回	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 1、本基金基金份额净值的计算，均保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入…… 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。赎回费用应根据相关规定按照比例归入基金财产，并在招募说明书中列示，未计入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 1、本基金基金份额净值的计算，均保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入…… 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按照相关法律法规设定，具体见招募说明书。其中对持续持有期少于 7 日的投资者收取 1.5% 的赎回费并全额计入基金财产。
第六部分基金份额的申购与赎回	七、拒绝或暂停申购的情形 4、基金管理人接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。	七、拒绝或暂停申购的情形 4、基金管理人接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时 或对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时。

<p>第六部分基金份额的申购与赎回</p>	<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>发生上述第 1、2、3、5、6、7 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，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。……</p>	<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>新增： <u>7、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超过50%，或者变相规避50%集中度的情形时。</u> <u>8、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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。</u></p> <p>发生上述第 1、2、3、5、6、8、9 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，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。……</p>
<p>第六部分基金份额的申购与赎回</p>		<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>新增： <u>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，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。</u></p>
<p>第六部分基金份额的申购与赎回</p>	<p>九、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>（2）部分延期赎回：当基金管理人认为支付基金份额持有人的赎回申请有困难或认为因支付基金份额持有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</p>	<p>九、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>（2）部分延期赎回：当基金管理人认为支付基金份额持有人的赎回申请有困难或认为因支付基金份额持有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10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。 <u>若基金发生巨额赎回，对于单个基金份额持有人当日赎回申请</u></p>

	<p>且受理的赎回份额；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。如基金份额持有人在提交赎回申请时未作明确选择，基金份额持有人未能赎回部分作自动延期赎回处理。</p>	<p><u>超过上一开放日基金总份额20%以上的部分，将自动进行延期办理。对于其余当日非自动延期办理的赎回申请，应当按单个账户非自动延期办理的赎回申请量占非自动延期办理的赎回申请量的比例，确定当日受理的赎回份额。</u>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。如基金份额持有人在提交赎回申请时未作明确选择，基金份额持有人未能赎回部分作自动延期赎回处理。</p>
<p>第八部分基金份额持有人大会</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，法律法规、基金合同和中国证监会另有规定无需召开基金份额持有人大会的除外：</p> <p>（5）<u>提高</u>基金管理人和基金托管人的报酬标准（根据法律法规的要求提高的除外）；</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：</p> <p>—（1）<u>调低</u>基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；—</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，法律法规、基金合同和中国证监会另有规定无需召开基金份额持有人大会的除外：</p> <p>（5）<u>调整</u>基金管理人和基金托管人的报酬标准（根据法律法规的要求调整的除外）；</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：</p> <p>删除。</p>
<p>第十二部分基金的投资</p>	<p>二、投资范围</p> <p>……</p> <p>基金的投资组合比例为：股票、权证占基金资产的 0%-95%；债券、资产支持证券、债券逆回购、银行存款占基金资产的比例不</p>	<p>二、投资范围</p> <p>……</p> <p>基金的投资组合比例为：股票、权证占基金资产的 0%-95%；债券、资产支持证券、债券逆回购、银行存款占基金资产的比例不</p>

	<p>低于 5%。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>低于 5%。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，<u>其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</u></p>
<p>第十二部分基金的投资</p>	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>（2）每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金以后，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>因证券/期货市场波动、证券发行人合并、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。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。</p>	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>（2）每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金以后，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，<u>其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</u></p> <p>新增：</p> <p><u>（5）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>（6）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%；</u></p> <p><u>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；</u></p> <p>……</p> <p>（20）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>

		<u>除上述第(2)项、第(6)项、第(14)项、第(20)项外</u> ,因证券/期货市场波动、证券发行人合并、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。法律法规或监管机构另有规定的,从其规定。
第十四部分基金资产估值	三、估值方法	三、估值方法 <u>10、当发生大额申购或赎回情形时,基金管理人可以采用摆动定价机制,以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。</u>
第十四部分基金资产估值	四、估值程序 1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后,基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算,精确到 <u>0.001</u> 元,小数点后第4位四舍五入。…… 五、估值错误的处理 ……当基金份额净值小数点后 <u>3</u> 位以内(包括第 <u>3</u> 位)发生差错时,视为基金份额净值错误。	四、估值程序 1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后,基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算,精确到 <u>0.0001</u> 元,小数点后第5位四舍五入。…… 五、估值错误的处理 ……当基金份额净值小数点后 <u>4</u> 位以内(包括第 <u>4</u> 位)发生差错时,视为基金份额净值错误。
第十四部分基金资产估值		六、暂停估值的情形 <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;</u>
第十四部分基金资产估值	八、特殊情形的处理 1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 <u>10</u> 项进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理;	八、特殊情形的处理 1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 <u>11</u> 项进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理;
第十五部分基金费用与税收	四、费用调整 调高 基金管理费率、基金托管费率等费率,须召开基金份额持有人大会审议; 调低 基金管理费	四、费用调整 <u>调整</u> 基金管理费率、基金托管费率等费率,须召开基金份额持有人大会审议。

	率、基金托管费率等费率，无须召开基金份额持有人大会。	
第十八部分基金的信息披露	一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的规定发生变化时，本基金从其最新规定。	一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、 <u>《流动性风险规定》</u> 、《基金合同》及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的规定发生变化时，本基金从其最新规定。
第十八部分基金的信息披露		<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>（六）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>新增： <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，为保障其他投资者利益，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定风险。</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。</u></p> <p>（七）临时报告</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；</u></p> <p><u>27、基金管理人采用摆动定价机制进行估值时；</u></p>
第二十四部分基金合同内容摘要	基金合同内容摘要作相应调整。	