
方正富邦基金管理有限公司

关于方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金修改基金合同和托管协议的公告

根据《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》”）等法律法规的要求和《方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）、《方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金托管协议》（以下简称“《托管协议》”）的有关规定，本公司经与基金托管人国信证券股份有限公司协商一致并已报监管机构备案，对《基金合同》和《托管协议》的相关条款进行了修订，具体事项公告如下：

一、基金合同、托管协议修订的法律依据

本次修订主要系根据中国证券监督管理委员会于2017年8月31日颁布的《流动性风险管理规定》对已经成立或已获核准但尚未完成募集的开放式基金，原基金合同内容不符合该规定的，应当在该规定施行之日起6个月内，修改基金合同并公告。不涉及基金份额持有人权利义务关系的变化，对原有基金份额持有人的利益无实质性不利影响，无需召开基金份额持有人大会。

二、基金合同、托管协议修订的内容

《基金合同》和《托管协议》的修改详见附件《〈方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金基金合同〉前后文对照表》、《〈方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金托管协议〉前后文对照表》。

三、重要提示

1、修改后的《基金合同》、《托管协议》自本公告发布之日起生效，但为不影响原有基金份额持有人的利益，上述修改中“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，并将上述赎回费全额计入基金财产”的条款将于2018年4月1日起正式实施，即：上述基金将于2018年4月1日起，对持续持有期少于7日的投资者收取1.5%的赎回费。

2、本基金管理人将于公告当日将修改后的《基金合同》和《托管协议》登载于公司网站 (<http://www.founderff.com/>)，并将在下次更新招募说明书及摘要时对相关内容进行相应修改。

3、本公告的解释权归本公司所有。投资者可以拨打本基金管理人客户服务热线400-818-0990或登录网站 (<http://www.founderff.com/>) 咨询相关信息。

风险提示：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。投资者投资于基金时应认真阅读基金合同、招募说明书等资料。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

方正富邦基金管理有限公司

二〇一八年三月二十四日

附件：

《〈方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金基金合同〉前后文对照表》；

《〈方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金托管协议〉前后文对照表》。

附件：

《方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金基金合同》前后文对照表

章节	变更前内容	变更后内容	修改理由
第一部分 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》”）、《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。	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》”）、《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。	补充本基金适用的法律依据。
第二部分 释义	无	13、《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	补充本基金适用的法律依据。
	无	76、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	根据《流动性风险管理规定》第 40 条，补充流动性受限

		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	资产定义。
第七部分 方正富邦 中证 保险的申 购与 赎回	五、申购和赎回的数量限制 无	五、申购和赎回的数量限制 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。具体规定请参见相关公告。	根据《流动性风险规定》第 19 条的规定补充。
	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 …… 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。赎回费归入基金财产的比例依照相关法律法规设定，具体见招募说明书。	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 …… 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。赎回费归入基金财产的比例依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 日的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。	根据《流动性风险规定》第 23 条补充强制赎回费的规定。
	八、拒绝或暂停申购的情形 …… 无	八、拒绝或暂停申购的情形 …… 8、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能	根据《流动性风险规定》第 19、24 条补充应当暂停

<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。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>导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过基金总份额 50% 以上的情形。</p> <p>9、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。</p> <p>10、当新的申购申请被确认成功，使本基金当日净申购比例超过基金管理人规定的当日净申购比例上限时，或使该投资人累计持有的份额超过基金管理人规定的单个投资人累计持有份额上限时，或使该投资人当日申购金额超过基金管理人规定的单个投资人当日申购金额上限时。</p> <p>发生上述第 1、2、3、5、6、7、9、11 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。发生上述第 8 项情形时，基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的申购申请进行限制，基金管理人有权拒绝该等全部或者部分申购申请。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>申购的情形。</p>
<p>九、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p>	<p>九、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p>	<p>根据《流动性风险</p>

<p>无</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>规定》第 24 条的规定补充应当暂停申购的情形。</p>
<p>十、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 无</p>	<p>十、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 (3)若本基金发生巨额赎回且存在单个基金份额持有人当日赎回申请超过前一开放日基金总份额（包括方正富邦中证保险份额、方正富邦中证保险 A 份额、方正富邦中证保险 B 份额）40% 以上情形的，基金管理人有权对该基金份额持有人超过前一开放日基金总份额（包括方正富邦中证保险份额、方正富邦中证保险 A 份额、方正富邦中证保险 B 份额）40% 以上部分的赎回申请进行延期办理；对于该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人有权根据前段“(1) 全额赎回”或“(2) 部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。 4、当出现巨额赎回时，场内赎回申请按照深圳证券交易所和注册登记机构的有关业务规则办理。</p>	<p>根据《流动性风险规定》第 21 条第 2 款的规定修改。</p>

<p>第十一部分基金合同当事人及权利义务</p>	<p>一、基金管理人 (一) 基金管理人简况 名称：方正富邦基金管理有限公司 住所：北京市西城区太平桥大街 18 号丰融国际大厦 11 层 9、11、12 单元 法定代表人：邹牧（代） 设立日期：2011 年 7 月 8 日 批准设立机关及批准设立文号：中国证监会，证监许可（2011）1038 号 组织形式：有限责任公司 注册资本：贰亿元人民币 存续期限：持续经营 联系电话：010-57303969</p>	<p>一、基金管理人 (一) 基金管理人简况 名称：方正富邦基金管理有限公司 住所：北京市西城区车公庄大街 12 号东侧 8 层 法定代表人：何亚刚 设立日期：2011 年 7 月 8 日 批准设立机关及批准设立文号：中国证监会，证监许可（2011）1038 号 组织形式：有限责任公司 注册资本：肆亿元人民币 存续期限：持续经营 联系电话：010-57303828</p>	<p>更新基金管理人信息。</p>
	<p>二、投资范围 基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于中证方正富邦保险主题指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；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。</p>	<p>二、投资范围 基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于中证方正富邦保险主题指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；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。</p>	<p>根据《流动性风险规定》第 18 条修改。</p>

	<p>六、投资限制</p> <p>(二) 投资组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>4、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%的现金或到期日在一年以内的政府债券；</p>	<p>六、投资限制</p> <p>(二) 投资组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>4、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>根据《流动性风险规定》第 18 条修改。</p>
<p>第十六部分基金的投资</p>	<p>无</p> <p>因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价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。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。</p>	<p>9、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>10、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基金合同约定的投资范围保持一致；</p> <p>除上述第 4、9、10 项外，因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价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。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。</p>	<p>根据《流动性风险规定》第 16、17 条修改。</p>

<p>第十八部分基金资产估值</p>	<p>六、暂停估值的情形 无</p>	<p>六、暂停估值的情形 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；</p>	<p>根据《流动性风险规定》第 24 条补充。</p>
<p>第二十三部分基金的信息披露</p>	<p>五、公开披露的基金信息 （八）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 无</p>	<p>五、公开披露的基金信息 （八）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 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。 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基金定期报告“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，中国证监会认定的特殊情形除外。</p>	<p>根据《流动性风险规定》第 26 条及第 27 条补充定期报告的内容。</p>

	(九) 临时报告 无	(九) 临时报告 31、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；	根据《流动性风险规定》第 26 条补充临时报告的内容。
--	---------------	--	-----------------------------

《方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金托管协议》前后文对照表

章节	变更前内容	变更后内容	修改理由
一、基金托管协议当事人	<p>一、托管协议当事人</p> <p>（一）基金管理人（或简称“管理人”）</p> <p>名称：方正富邦基金管理有限公司</p> <p>住所：北京市西城区太平桥大街丰融国际大厦 11 层 1、9、11、12 单元</p> <p>法定代表人：邹牧（代）</p> <p>成立时间：2011 年 7 月 8 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[2011]1038 号文</p> <p>组织形式：有限责任公司</p> <p>注册资本：2 亿元人民币</p> <p>经营范围：</p> <p>基金管理业务、包括依中国法律从事证券投资基金的设立和管理、基金管理和与此相关的其他业务（涉及行政许可的凭许可证经营）</p> <p>存续期间：持续经营</p> <p>电话：（010）57303969</p> <p>传真：（010）57303718</p>	<p>一、托管协议当事人</p> <p>（一）基金管理人（或简称“管理人”）</p> <p>名称：方正富邦基金管理有限公司</p> <p>住所：北京市西城区车公庄大街 12 号东侧 8 层</p> <p>法定代表人：何亚刚</p> <p>成立时间：2011 年 7 月 8 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[2011]1038 号文</p> <p>组织形式：有限责任公司</p> <p>注册资本：肆亿元人民币</p> <p>经营范围：</p> <p>基金管理业务、包括依中国法律从事证券投资基金的设立和管理、基金管理和与此相关的其他业务（涉及行政许可的凭许可证经营）</p> <p>存续期间：持续经营</p> <p>电话：（010）57303828</p> <p>传真：（010）57303718</p>	更新本基金管理人信息。

<p>二、基金托管协议的依据、目的原则和解释</p>	<p>(一) 依据 本协议依据《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》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)及其他有关法律法规与基金合同订立。</p>	<p>(一) 依据 本协议依据《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》”)及其他有关法律法规与基金合同订立。</p>	<p>补充本基金适用的法律依据。</p>
<p>三、基金托管人对基金管理人</p>	<p>(一)基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定,建立相关的技术系统,对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面: 1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。 基金的投资组合比例为:本基金投资于股票的资产不低于基金资产的 85%,投资于中证方正富邦保险主题指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%,且不低于非现金基金资产的 80%;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。</p>	<p>(一)基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定,建立相关的技术系统,对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面: 1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。 基金的投资组合比例为:本基金投资于股票的资产不低于基金资产的 85%,投资于中证方正富邦保险主题指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%,且不低于非现金基金资产的 80%;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。</p>	<p>根据《流动性风险管理规定》第 18 条修改。</p>

<p>的业务监督和核查</p>	<p>2、对基金投融资比例进行监督。</p> <p>(4) 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%的现金或到期日在一年以内的政府债券；</p>	<p>2、对基金投融资比例进行监督。</p> <p>(4) 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>根据《流动性风险规定》第 18 条修改。</p>
	<p>无</p> <p>因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价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。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。</p>	<p>(9) 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>(10) 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基金合同约定的投资范围保持一致；</p> <p>除上述第 (4)、(9)、(10) 项外，因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价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。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。</p>	<p>根据《流动性风险规定》第 16、17 条修改。</p>