

## 泰达宏利基金管理有限公司

### 关于旗下 51 只证券投资基金修改基金合同和托管协议的公告

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《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》”）等法律法规以及相关基金合同和托管协议的有关规定，经与各基金托管人协商一致，并履行了必要程序，泰达宏利基金管理有限公司（以下简称“本公司”）决定对下表中51只已经成立正在运作的证券投资基金的基金合同和托管协议进行修改。

#### 一、基金合同及托管协议修改

本次修改涉及的51只证券投资基金如下：

序号	基金名称	基金托管人
1	泰达宏利转型机遇股票型证券投资基金	中国银行股份有限公司
2	泰达宏利中证500指数分级证券投资基金	中国银行股份有限公司
3	泰达宏利养老收益混合型证券投资基金	中国银行股份有限公司
4	泰达宏利瑞利分级债券型证券投资基金	中国银行股份有限公司
5	泰达宏利量化增强股票型证券投资基金	中国银行股份有限公司
6	泰达宏利聚利债券型证券投资基金(LOF)	中国银行股份有限公司
7	泰达宏利集利债券型证券投资基金	中国银行股份有限公司
8	泰达宏利行业精选混合型证券投资基金	中国银行股份有限公司
9	泰达宏利复兴伟业灵活配置混合型证券投资基金	中国银行股份有限公司
10	泰达宏利亚洲债券型证券投资基金	中国银行股份有限公司
11	泰达宏利信用合利定期开放债券型证券投资基金	中国银行股份有限公司
12	泰达宏利新思路灵活配置混合型证券投资基金	中国银行股份有限公司
13	泰达宏利新起点灵活配置混合型证券投资基金	中国银行股份有限公司
14	泰达宏利同顺大数据量化优选灵活配置混合型证券投资基金	中国银行股份有限公司
15	泰达宏利淘利债券型证券投资基金	中国银行股份有限公司
16	泰达宏利绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金	中国银行股份有限公司

17	泰达宏利活期友货币市场基金	中国银行股份有限公司
18	泰达宏利港股通优选股票型证券投资基金	中国银行股份有限公司
19	泰达宏利改革动力量化策略灵活配置混合型证券投资基金	中国银行股份有限公司
20	泰达宏利定宏混合型证券投资基金	中国银行股份有限公司
21	泰达宏利睿智稳健灵活配置混合型证券投资基金	中国工商银行股份有限公司
22	泰达宏利首选企业股票型证券投资基金	中国农业银行股份有限公司
23	泰达宏利领先中小盘混合型证券投资基金	中国农业银行股份有限公司
24	泰达宏利货币市场基金	中国农业银行股份有限公司
25	泰达宏利效率优选混合型证券投资基金(LOF)	中国建设银行股份有限公司
26	泰达宏利市值优选混合型证券投资基金	中国建设银行股份有限公司
27	泰达宏利逆向策略混合型证券投资基金	中国建设银行股份有限公司
28	泰达宏利蓝筹价值混合型证券投资基金	中国建设银行股份有限公司
29	泰达宏利红利先锋混合型证券投资基金	中国建设银行股份有限公司
30	泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金	中国建设银行股份有限公司
31	泰达宏利价值优化型成长类行业混合型证券投资基金	交通银行股份有限公司
32	泰达宏利价值优化型稳定类行业混合型证券投资基金	交通银行股份有限公司
33	泰达宏利价值优化型周期类行业混合型证券投资基金	交通银行股份有限公司
34	泰达宏利风险预算混合型证券投资基金	交通银行股份有限公司
35	泰达宏利创金灵活配置混合型证券投资基金	交通银行股份有限公司
36	泰达宏利业绩驱动量化股票型证券投资基金	招商银行股份有限公司
37	泰达宏利睿选稳健灵活配置混合型证券投资基金	招商银行股份有限公司
38	泰达宏利汇利债券型证券投资基金	包商银行股份有限公司
39	泰达宏利启智灵活配置混合型证券投资基金	江苏银行股份有限公司
40	泰达宏利创盈灵活配置混合型证券投资基金	华夏银行股份有限公司
41	泰达宏利创益灵活配置混合型证券投资基金	华夏银行股份有限公司
42	泰达宏利溢利债券型证券投资基金	北京银行股份有限公司
43	泰达宏利启泽灵活配置混合型证券投资基金	北京银行股份有限公司

44	泰达宏利启明灵活配置混合型证券投资基金	北京银行股份有限公司
45	泰达宏利启惠灵活配置混合型证券投资基金	北京银行股份有限公司
46	泰达宏利启富灵活配置混合型证券投资基金	北京银行股份有限公司
47	泰达宏利启迪灵活配置混合型证券投资基金	北京银行股份有限公司
48	泰达宏利京元宝货币市场基金	北京银行股份有限公司
49	泰达宏利京天宝货币市场基金	北京银行股份有限公司
50	泰达宏利恒利债券型证券投资基金	北京银行股份有限公司
51	泰达宏利纯利债券型证券投资基金	北京银行股份有限公司

## 二、基金合同修订情况

由于基金类别、运作方式、投资方向等不同，各基金基金合同修订内容、具体表述等可能存在差异。本公告正文列示的合同修订内容并不特别区分基金类别，仅对货币基金的特别规定进行单独说明。如《流动性风险管理规定》某项规定不适用某类基金或对不同类别基金有所区别，遵循其规定。法律法规或监管机构另有规定或中国证监会认定的特殊情况的从其规定。

### （一）对原基金合同中前言、释义章节的修订

1、在“前言”有关订立基金合同的依据中增加“《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》”。

2、在“释义”中新增“《流动性风险管理规定》”、“流动性受限资产”、“摆动定价机制”的释义。

### （二）对原基金合同中基金份额申购与赎回章节的修订

1、在有关申购与赎回数额限制的节段中增加如下内容：

“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。”

2、对有关申购赎回费用节段的修订

（1）增加有关短期赎回费的约定如下：

“本基金对持续持有期少于 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。”

(2) 增加“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”相关描述。

3、在有关拒绝或暂停申购情形的节段中增加如下约定：

(1) “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。”

(2) “当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”，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请。

4、在有关暂停赎回或延缓支付赎回款项情形的节段中增加如下约定：

“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。”

5、在有关巨额赎回处理方式的节段中新增约定在单个基金份额持有人超过基金总份额一定比例以上的大额赎回申请情形下，可延期办理赎回申请，并约定了相关处理措施。

(三) 对原基金合同中基金投资章节的修订

1、明确“不低于基金资产净值 5%的现金”中“现金”的范围不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

2、新增有关投资可流通股票的限制如下：

“本基金管理人管理的全部开放式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%。”

3、新增主动投资流动性受限资产的限制如下：

“本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 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前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资。”

4、新增对逆回购交易质押品资质的限制如下：

“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。”

（四）对原基金合同中基金资产估值章节的修订

1、在有关估值方法的节段中增加如下约定：

“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。”

2、在有关暂停估值情形的节段中增加如下约定：

“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。”

（五）对原基金合同中基金信息披露章节的修订

1、在定期报告披露中新增约定如下：

“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产品的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。”

2、在临时公告披露中增加约定“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”及“基金管理人采用摆动定价机制进行估值”为应披露的重大事件。

（六）对货币基金基金合同的特别修订

1、对基金份额申购与赎回章节的修订

新增收取强制赎回费用的情形，在该情形下，为确保基金平稳运作，避免诱发系统性风险，基金管理人可以与基金托管人协商后，对当日单个基金份额持有人申请赎回基金份额超过基金总份额 1%以上的赎回申请征收 1%的强制赎回费

用，并将上述赎回费用全额计入基金财产，但基金管理人与基金托管人协商确认上述做法无益于基金利益最大化的情形除外。新增情形具体如下：

“当基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额 50%，且投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计低于 10%且偏离度为负时。”

## 2、对基金投资章节的修订

(1) 根据货币基金份额持有人集中度情况新增如下限制：

“当基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 50%时，基金投资组合的平均剩余期限不得超过 60 天，平均剩余存续期不得超过 120 天。当基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 20%时，基金投资组合的平均剩余期限不得超过 90 天，平均剩余存续期不得超过 180 天。”

“当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 50%时，现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及五个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 30%；当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 20%时，现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及五个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 20%。”

(2) 新增主动投资流动性受限资产的限制如下：

“本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值 10%。因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资。”

(3) 新增对次高等级信用类金融工具（含存款及同业存单）的投资限制如下：

①“本基金投资于主体信用评级低于 AAA 的机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 10%，其中单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例不得超过 2%。前述金融工具包括债券、非金融企业债务融资工具、银行存款、同业存单、相关机构作为原始权益人的资产支持证券及中国证监会认定的其他品种。”

②“本基金拟投资于主体信用评级低于 AA+ 的商业银行的银行存款与同业存单的，应当经基金管理人董事会审议批准，相关交易应当事先征得基金托管人的同意，并作为重大事项履行信息披露程序。”

(4) 新增投资同一商业银行存款及同业存单与债券的限制如下：

“本基金管理人管理的全部货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券，不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的 10%。”

### 3、对基金信息披露章节的修订

(1) 在定期报告披露中新增约定“基金管理人应当在基金年度报告和半年度报告中披露报告期末基金前 10 名份额持有人的类别、持有份额及占总份额的比例等信息。”

(2) 在临时公告披露中增加“本基金投资于主体信用评级低于 AA+ 的商业银行的银行存款与同业存单”为应披露的重大事件。

### 重要提示：

1、根据《流动性风险规定》第二十三条的相关规定，“基金管理人应当强化对投资者短期投资行为的管理，对除货币市场基金与交易型开放式指数基金以外的开放式基金，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”。受此影响，除货币市场基金外，本管理人旗下的部分基金的赎回费率及赎回费计入基金财产比例将进行相应调整。自 2018 年 3 月 31 日起，本管理人将对持续持有期少于 7 日的上表中除货币市场基金外的基金赎回申请，收取不低于 1.5% 的赎回费并全额计入基金财产。即 2018 年 3 月 30 日 15:00 之前的赎回申请，适用调整前的赎回费规则，2018 年 3 月 30 日 15:00 之后的赎回申请，适用调整后的赎回费规则。转换业务涉及的转出基金赎回费率等事项按上述规则进行调整。

2、本公司将于公告当日，将修改后的 51 只证券投资基金的《基金合同》、《托管协议》登载于公司网站，更新后的《基金合同》和《托管协议》自公告之日起生效。

3、本公司将在上表 51 只基金的招募说明书（更新）中，对相应部分进行修改。

4、投资者可通过本基金管理人的网站：[www.mfcteda.com](http://www.mfcteda.com) 或客户服务电话：400-698-8888、（010）66555662 了解详情。

5、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。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。基金管理人提醒投资者，投资者投资于基金前应认真阅读基金合同、招募说明书等文件。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

泰达宏利基金管理有限公司

2018年3月24日