

新华基金管理股份有限公司关于新华恒益量化灵活配置混合型 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》（以下简称“《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《流动性风险管理规定》的，应当在《流动性风险管理规定》施行之日起6个月内予以调整。

新华基金管理股份有限公司（以下简称“本公司”）根据《流动性风险管理规定》等法律法规，经与基金托管人中国农业银行股份有限公司协商一致，并报监管机构备案，修订《新华恒益量化灵活配置混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）等相关法律文件。

本次基金合同的修改详见附件《新华恒益量化灵活配置混合型证券投资基金基金合同修改对照表》，托管协议涉及基金合同相关变动处一并修改。上述修订自2018年3月31日起生效。

重要提示：

1、本次对基金合同修订的内容系因相应的法律法规发生变动而进行的修订，本基金管理人已就修改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、基金管理人将在本公告发布当日，将修改后的基金合同、托管协议等法律文件登载于本公司网站。并在下期更新的《新华恒益量化灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》中，对上述相关内容进行相应修改。

3、本公告的最终解释权归本公司所有。投资人欲了解更多详细情况，可拨打本公司的客户服务电话400-819-8866了解详情。

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。本公司充分重视投资者教育工作，以保障投资者利益为己任，特此提醒广大投资者正确认识投资基金所存在的风险，

慎重考虑、谨慎决策，选择与自身风险承受能力相匹配的产品，做理性的基金投资者。

特此公告。

新华基金管理股份有限公司

二〇一八年三月二十七日

附件:新华恒益量化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 |
|--------------------|---|---|
| 第一部分 前言 | <p>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>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》”)、《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》”)、《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> |
| 第二部分 释义 | | <p>增加:</p> <p>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</p> <p>45、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的债券等</p> |
| 第六部分 基金份额的申购与赎回 | <p>五、申购和赎回的数量限制</p> | <p>五、申购和赎回的数量限制</p> <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。具体规定请参见相关公告。</p> |

| | | |
|-----------------------|--|--|
| <p>第六部分基金份额的申购与赎回</p> | <p>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。赎回费用归入基金财产的具体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>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，其中对持续持有期少于7日的投资者收取不少于1.5%的赎回费并全额计入基金财产。赎回费用归入基金财产的具体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>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 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达到或者超过50%，或者变相规避50%集中度的情形时。</p> <p>发生上述第1、2、3、5、6、8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>七、拒绝或暂停申购的情形 7、接受某一投资者申购申请后导致其份额达到或超过基金总份额50%以上的。 增加： 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，基金管理人应当暂停接受基金申购申请。</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。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> |
| <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 发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：</p> | <p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项： 增加： 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> |

| | | |
|--------------------|---|---|
| 第六部分 基金份额的申购与赎回 | 九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 | 九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 增加： (3) 在出现巨额赎回时，对于单个基金份额持有人当日超过上一日基金总份额10%以上的赎回申请，基金管理人有权先行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，之后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。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。延期部分如选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。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。 |
| 第十二部分 基金的投资 | 二、投资范围 基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为0-95%，权证投资占基金资产净值的比例为0-3%，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。 | 二、投资范围 基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为0-95%，权证投资占基金资产净值的比例为0-3%，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。 |
| 第十二部分 基金的投资 | 四、投资限制 (2) 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； | 四、投资限制 (2) 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； 增加： (18) 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 |

| | | |
|-------------------------|--|--|
| | <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。法律法规另有规定的，从其规定。</p> | <p>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%；</p> <p>(19) 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本款项所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>(20) 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 (2)、(12)、(19)、(20) 项之外，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。法律法规另有规定的，从其规定。</p> |
| <p>第十四部分 基金资产估值</p> | <p>六、暂停估值的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</p> <p>2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；</p> <p>3、中国证监会和基金合同认定的其它情形。</p> | <p>六、暂停估值的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</p> <p>2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；</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，基金管理人经与基金托管人协商一致的；</p> <p>4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。</p> |

| | | |
|---|--|--|
| <p>第十 八部 分 基金 的信 息披 露</p> | <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>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例超过 20% 的情形，基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告文件中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。</p> <p>(七) 临时报告</p> | <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>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有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。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> <p>(七) 临时报告</p> <p>增加：</p> <p>27、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；</p> |
|---|--|--|