

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

附件：

《天弘同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	天弘同利 <u>分级</u> 债券型证券投资 基金 基金合同	天弘同利债券型证券投资基金 <u>（LOF）</u> 基金合同 <u>（由天弘同利分级债券型证券投资 基金转型而来）</u>
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》”）、《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》”）、《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>《流动性管理规定》</u> ”） 和其他有关法律法规。

	<p>四、基金管理人、基金托管人在本基金合同之外披露涉及本基金的信息，其内容涉及界定基金合同当事人之间权利义务关系的，如与基金合同有冲突，以基金合同为准。</p>	<p>四、基金管理人、基金托管人在本基金合同之外披露涉及本基金的信息，其内容涉及界定基金合同当事人之间权利义务关系的，如与基金合同有冲突，以基金合同为准。 <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，天弘同利分级债券型证券投资基金转换为天弘同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。</u> (新增)</p>
<p>第二部分 释义</p>	<p>1、基金或本基金：指天弘同利分级债券型证券投资基金</p> <p>5、基金合同或本基金合同：指《天弘同利<u>分级债券型证券投资基金基金合同</u>》及对本基金合同的任何有效修订和补充</p> <p>6、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《<u>天弘同利分级债券型证券投资基金托管协议</u>》及对该托管协议的任何有效修订和补充</p> <p>7、招募说明书：指《天弘同利<u>分级债券型证券投资基金招募</u></p>	<p>1、基金或本基金：指天弘同利<u>分级债券型证券投资基金，或天弘同利债券型证券投资基金（LOF）</u></p> <p>5、基金合同或本基金合同：指《<u>天弘同利债券型证券投资基金（LOF）基金合同</u>》及对本基金合同的任何有效修订和补充</p> <p>6、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《<u>天弘同利债券型证券投资基金（LOF）托管协议</u>》及对该托管协议的任何有效修订和补充</p> <p>7、招募说明书：指《<u>天弘同利债券型证券投资基金（LOF）招募说</u></p>

	<p>说明书》及其定期的更新</p> <p>.....</p>	<p>说明书》及其定期的更新</p> <p>.....</p> <p>15、<u>《流动性管理规定》</u>：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<u>修订</u>（新增，以下序号顺延）</p> <p>.....</p> <p>71、<u>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（新增）</p> <p>72、<u>摆动定价机制</u>：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，确保投资人的合法权益不受损害并得到公平对待（新增，</p>
--	---------------------------------	---

		以下序号顺延)
第八部分 基金份额 的申购与 赎回	<p>四、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>（四）申购和赎回的数量限制</p> <p>.....</p> <p>（五）申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>.....</p> <p>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。不低于赎回费总额的 25%应归基金财产，其余用于支付登记费和</p>	<p>四、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>（四）申购和赎回的数量限制</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，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。（新增，以下序号顺延）</u></p> <p>.....</p> <p>（五）申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>.....</p> <p><u>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。本基金对持续持有期少于 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</u></p>

	<p>其他必要的手续费。</p> <p>6、本基金赎回费用最高不超过赎回金额的5%，本基金的申购份额具体的计算方法、赎回费率、赎回金额具体的计算方法和收费方式由基金管理人根据基金合同的规定确定，并在招募说明书中列示。基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。</p> <p>(六) 拒绝或暂停申购的情形</p>	<p><u>投资者，不低于赎回费总额的25%应归基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。</u></p> <p>6、本基金赎回费用最高不超过赎回金额的5%，<u>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。</u>本基金的申购份额具体的计算方法、赎回费率、赎回金额具体的计算方法和收费方式由基金管理人根据基金合同的规定确定，并在招募说明书中列示。基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。</p> <p><u>7、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)</u></p> <p>(六) 拒绝或暂停申购的情形</p> <p>.....</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂</p>
--	--	--

	<p>.....</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。</p> <p>.....</p> <p>发生上述第 1、2、3、5、<u>6</u>项暂停申购情形时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。如果投资人的</p>	<p>停接收投资人的申购申请。<u>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。</u></p> <p>.....</p> <p><u>6、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。（新增）</u></p> <p><u>7、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，以下序号顺延）</u></p> <p>.....</p> <p>发生上述第 1、2、3、5、<u>8</u>项暂停申购情形时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体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>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) 暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>.....</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接收投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。</p> <p>.....</p> <p>(八) 巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>.....</p>	<p>(七) 暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>.....</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接收投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。<u>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。</u></p> <p>.....</p> <p>(八) 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</u></p>
--	---	--

		<p>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>
<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 住所:天津市河西区马场道 59 号天津国际经济贸易中心 A 座 16 层 法定代表人:李琦 注册资本:人民币 1.8 亿</p>	<p>一、基金管理人 注册地址:天津自贸区(中心商务区)响螺湾旷世国际大厦 A 座 1704-241 号 办公地址:天津市河西区马场道 59 号天津国际经济贸易中心 A 座 16 层 (新增) 邮政编码:300203 (新增) 法定代表人:井贤栋 注册资本:人民币 5.143 亿元 经营范围:基金募集、基金销售、</p>

	<p>.....</p> <p>二、基金托管人</p> <p>.....</p> <p>法定代表人：<u>姜建清</u></p> <p>.....</p> <p>注册资本：人民币 <u>349,018,545,827 元</u></p>	<p><u>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>.....</p> <p>法定代表人：<u>易会满</u></p> <p>.....</p> <p>注册资本：人民币 <u>35,640,625.71 万元</u></p>
<p>第十六部分 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：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%，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%</p> <p>.....</p> <p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>.....</p> <p>（2）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>.....</p>	<p>二、投资范围</p> <p>.....</p> <p>基金的投资组合比例为：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%，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%，<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>.....</p> <p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>.....</p> <p>（2）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、存出保证金和应收申购款</u></p>

	<p><u>(14) 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；</u></p> <p>.....</p>	<p><u>等；</u></p> <p>.....</p> <p><u>(4) 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%；(新增，以下序号顺延)</u></p> <p>.....</p> <p><u>(16)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本基金合同约定的投资范围保持一致；(新增)</u></p> <p><u>(17)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；(新增，以下序号顺</u></p>
--	--	--

	<p>因证券市场波动、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。</p>	<p>延) <u>除上述 (2)、(13)、(16)、(17) 情形之外</u>，因证券市场波动、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。</p>
<p>第十八部分 基金资产估值</p>	<p>三、估值方法 六、暂停估值的情形</p>	<p>三、估值方法 <u>7、当本基金发生大额申购或赎回情形时</u>，本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。<u>(新增，以下序号顺延)</u> 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</u>，<u>经与基金托管人协商一致的</u>，基金管理人应当暂停估值；<u>(新增，以下序号顺延)</u></p>

	
第二十二 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>(八) 临时报告</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告</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。(新增)</u></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。(新增)</u></p> <p>(八) 临时报告</p> <p>.....</p> <p><u>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)</u></p> <p><u>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)</u></p> <p>.....</p>

	<p>七、暂停或延迟信息披露的情形</p> <p>.....</p>	<p>七、暂停或延迟信息披露的情形</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暂停估值；（新增，以下序号顺延）</u></p>
--	------------------------------------	---