

国投瑞银基金管理有限公司关于旗下部分基金

增加侧袋机制、投资范围增加存托凭证

并修改法律文件的公告

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》、《存托凭证发行与交易管理办法（试行）》、《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》等法律法规及相关基金基金合同、招募说明书及其更新等规定，经与各基金托管人协商一致，并向中国证监会备案，国投瑞银基金管理有限公司(以下简称“本公司”)对旗下 17 只基金的基金合同等法律文件进行修订，包括增加侧袋机制、投资范围中增加存托凭证等相关内容。本次修订对基金份额持有人利益无实质性不利影响，修订将自 2021 年 5 月 25 日起正式生效。现将基金合同修订情况公告如下：

一、 本次修订基金列表

序号	基金主代码	基金名称	是否涉及增加侧袋机制	是否涉及增加存托凭证
1	005996	国投瑞银顺昌纯债债券型证券投资基金	是	-
2	008612	国投瑞银顺恒纯债债券型证券投资基金	是	-
3	007342	国投瑞银顺臻纯债债券型证券投资基金	是	-
4	007260	国投瑞银顺祺纯债债券型证券投资基金	是	-
5	005864	国投瑞银顺达纯债债券型证券投资基金	是	-
6	005995	国投瑞银顺泓定期开放债券型证券投资基金	是	-
7	007445	国投瑞银顺悦 3 个月定期开放债券型证券投资基金	是	-
8	005641	国投瑞银顺源 6 个月定期开放债券型证券投资基金	是	-
9	009417	国投瑞银顺荣 39 个月定期开放债券型证券投资基金	是	-
10	006027	国投瑞银顺祥定期开放债券型发起式证券投资基金	是	-
11	002964	国投瑞银顺鑫定期开放债券型发起式证券投资基金	是	-
12	005435	国投瑞银顺银 6 个月定期开放债券型发起式证券投资基金	是	-
13	005725	国投瑞银恒泽中短债债券型证券投资基金	是	-
14	000069	国投瑞银中高等级债券型证券投资基金	是	-
15	121009	国投瑞银稳定增利债券型证券投资基金	是	-
16	161216	国投瑞银双债增利债券型证券投资基金	是	-
17	121012	国投瑞银优化增强债券型证券投资基金	是	是

二、增加侧袋机制相关内容

根据自 2020 年 8 月 1 日起施行的《公开募集证券投资基金侧袋机制指引(试行)》，在上述 17 只基金的基金合同中增加侧袋机制相关内容。增加侧袋机制修订的相关内容主要在基金合同的前言、释义、基金份额的申购与赎回、基金合同当事人及权利义务、基金份额持有人大会、基金的投资、基金资产估值、基金费用与税收、基金的收益与分配和基金的信息披露等章节。

三、明确投资范围中包含存托凭证

明确国投瑞银优化增强债券型证券投资基金投资范围中的股票包含存托凭证，同时相应调整该只基金投资策略、投资比例及限制，补充投资存托凭证的风险揭示以及估值等相关内容。

相关基金的托管协议、招募说明书、基金产品资料概要中涉及的上述修改内容已做同步修改，本公司将依照《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定在规定媒介公告修订后的相关基金基金合同、托管协议、招募说明书(更新)及基金产品资料概要(更新)。投资者可通过本公司网站(www.ubssdic.com)或中国证监会基金电子披露网站(<http://eid.csrc.gov.cn/fund>)查阅相关基金修订后的法律文件。本次修订对基金份额持有人利益无实质性不利影响，并已履行了规定的程序，符合相关法律法规的规定，修订自 2021 年 5 月 25 日起生效。

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。基金的过往业绩并不代表其将来表现。投资有风险，敬请投资人认真阅读基金的相关法律文件，并选择适合自身风险承受能力的投资品种进行投资。

特此公告。

国投瑞银基金管理有限公司

2021 年 5 月 25 日

附件一：增加侧袋机制基金合同修改对照表

（以国投瑞银顺昌纯债债券型证券投资基金基金合同为例）

章节	原文条款	修改后条款
	内容	内容
第一部分 前言	无	<u>六、当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，基金管理人履行相应程序后，可以启动侧袋机制，具体详见基金合同和招募说明书的有关章节。侧袋机制实施期间，基金管理人将对基金简称进行特殊标识，并不办理侧袋账户的申购赎回。请基金份额持有人仔细阅读相关内容并关注本基金启用侧袋机制时的特定风险。</u>
第二部分 释义	无	<u>55、侧袋机制：指将基金投资组合中的特定资产从原有账户分离至专门账户进行处置清算，目的在于有效隔离并化解风险，确保投资者得到公平对待，属于流动性风险管理工具。侧袋机制实施期间，原有账户称为主袋账户，专门账户称为侧袋账户</u> <u>56、特定资产：包括：（一）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的资产；（二）按摊余成本计量且计提资产减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产；（三）其他资产价值存在重大不确定性的资产</u>
第六部分 基金份额的申购与赎回	八、拒绝或暂停申购的情形 7、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。	八、拒绝或暂停申购的情形 7、当 <u>特定资产占</u> 前一估值日基金资产净值 50%以上的，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。
	九、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 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确认后，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。	九、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 5、当 <u>特定资产占</u> 前一估值日基金资产净值 50%以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。
	无	<u>十七、实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回本基金实施侧袋机制的，本基金的申购和赎回安排详见招募说明书或相关公告。</u>
第七部分 基金合同当事人及	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 …… 住所：上海市虹口区东大名路 638 号 7 层	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 …… 住所：上海市虹口区 <u>杨树浦路 168 号 20 层</u>

<p>权利义 务</p>	<p>三、基金份额持有人 每份基金份额具有同等的合法权益。</p>	<p>三、基金份额持有人 <u>除法律法规另有规定或基金合同另有约定外</u>，每份基金份额具有同等的合法权益。</p>
<p>第八部分 基金 份额持 有人大 会</p>	<p>基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。本基金基金份额持有人大会不设立日常机构。</p>	<p>基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。<u>除法律法规另有规定或基金合同另有约定外</u>，基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。本基金基金份额持有人大会不设立日常机构。</p>
	<p>无</p>	<p><u>九、实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定</u> <u>若本基金实施侧袋机制，则相关基金份额或表决权的比例指主袋份额持有人和侧袋份额持有人分别持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例，但若相关基金份额持有人大会召集和审议事项不涉及侧袋账户的，则仅指主袋份额持有人持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例：</u> <u>1、基金份额持有人行使提议权、召集权、提名权所需单独或合计代表相关基金份额 10%以上（含 10%）；</u> <u>2、现场开会的到会者在权益登记日代表的基金份额不少于本基金在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；</u> <u>3、通讯开会的直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；</u> <u>4、当参与基金份额持有人大会投票的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日相关基金份额的二分之一，召集人在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内就原定审议事项重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）相关基金份额的持有人参与或授权他人参与基金份额持有人大会投票；</u> <u>5、现场开会由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人；</u> <u>6、一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过；</u> <u>7、特别决议应当经参加大会的基金份额持有人</u></p>

		<p>或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过。</p> <p>侧袋机制实施期间，基金份额持有人大会审议事项涉及主袋账户和侧袋账户的，应分别由主袋账户、侧袋账户的基金份额持有人进行表决，同一类别账户内的每份基金份额具有平等的表决权。表决事项未涉及侧袋账户的，侧袋账户份额无表决权。</p> <p>侧袋机制实施期间，关于基金份额持有人大会的相关规定以本节特殊约定内容为准，本节没有规定的适用上文相关约定。</p>
第十二部分 基金的投资	无	<p>八、侧袋机制的实施和投资运作安排</p> <p>当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制，无需召开基金份额持有人大会审议。</p> <p>侧袋机制实施期间，本部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。</p> <p>侧袋账户的实施条件、实施程序、运作安排、投资安排、特定资产的处置变现和支付等对投资者权益有重大影响的事项详见招募说明书的规定。</p>
第十四部分 基金资产估值	<p>六、暂停估值的情形</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，经与基金托管人协商一致后，应当暂停估值；</p>	<p>六、暂停估值的情形</p> <p>3、当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，经与基金托管人协商一致后，应当暂停估值；</p>
	无	<p>九、实施侧袋机制期间的基金资产估值</p> <p>本基金实施侧袋机制的，应根据本部分的约定对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的基金份额净值和基金份额累计净值，暂停披露侧袋账户的基金净值信息。</p>
第十五部分 基金费用与税收	无	<p>四、实施侧袋机制期间的基金费用</p> <p>本基金实施侧袋机制的，与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费，其他费用详见招募说明书的规定或相关公告。</p>
第十六部分 基金的收	无	<p>七、实施侧袋机制期间的收益分配</p> <p>本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配，详见招募说明书的规定。</p>

益与分配		
第十八部分 基金的信息披露	五、公开披露的基金信息 无	五、公开披露的基金信息 <u>(十三) 实施侧袋机制期间的信息披露</u> <u>本基金实施侧袋机制的，相关信息披露义务人应当根据法律法规、基金合同和招募说明书的规定进行信息披露，详见招募说明书的规定。</u>

注：以上更新修订内容仅为示例，不同基金的基金合同及招募说明书中相应条款表述及修订位置存在差异，具体请以相关基金披露的修订后法律文件内容为准。

附件二：增加存托凭证基金合同修改对照表

国投瑞银优化增强债券型证券投资基金基金合同修改对照表

章节	原文条款	修改后条款
	内容	内容
第一部分 前言	无	<u>(六)本基金的投资范围包括存托凭证，可能面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险。</u>
第七部分 基金合同当事人及权利义务	(五)基金管理人的义务 26. 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使 股东 权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利，不谋求对上市公司的控股和直接管理；	(五)基金管理人的义务 26. 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使 相关 权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利，不谋求对上市公司的控股和直接管理；
第十二部分 基金的投资	(二) 投资范围 本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券、股票、权证及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。 本基金主要投资于国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益证券品种。本基金既可以参与一级市场新股申购或增发新股，也可以在二级市场买入股票、权证等权益类资产。本基金对债券类资产的投资比例不低于基金资产的 80%；股票、权证等权益类资产的比例不超过基金资产的 20%，其中权证投资的比例不超过基金资产净值的 3%；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%，其中，上述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。	(二) 投资范围 本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券、股票 <u>（含存托凭证）</u> 、权证及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。 本基金主要投资于国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益证券品种。本基金既可以参与一级市场新股 <u>（含存托凭证）</u> 申购或增发新股 <u>（含存托凭证）</u> ，也可以在二级市场买入股票 <u>（含存托凭证）</u> 、权证等权益类资产。本基金对债券类资产的投资比例不低于基金资产的 80%；股票、权证等权益类资产的比例不超过基金资产的 20%，其中权证投资的比例不超过基金资产净值的 3%；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%，其中，上述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。
	(四) 投资策略 3. 股票投资策略 无	(四) 投资策略 3. 股票投资策略 <u>(3) 存托凭证投资策略</u> <u>本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。</u>
	(七) 投资限制 1. 组合限制 无	(七) 投资限制 1. 组合限制 <u>(17) 本基金投资存托凭证的比例限制依照境内</u>

		<u>上市交易的股票执行，与境内上市交易的股票合并计算；</u>
	<p>(八) 基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法</p> <p>1. 基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利、债权人权利，保护基金份额持有人的利益；</p>	<p>(八) 基金管理人代表基金行使相关权利的处理原则及方法</p> <p>1. 基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使相关权利、债权人权利，保护基金份额持有人的利益；</p>
第十四部分 基金资产估值	<p>(二) 估值方法</p> <p>无</p>	<p>(二) 估值方法</p> <p><u>5、本基金投资存托凭证的估值核算依照境内上市交易的股票执行。</u></p>
	<p>(三) 估值对象</p> <p>基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产和负债。</p>	<p>(三) 估值对象</p> <p>基金所拥有的股票<u>(含存托凭证)</u>、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产和负债。</p>
	<p>(八) 特殊情况的处理</p> <p>1. 基金管理人或基金托管人按估值方法的第5-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。</p>	<p>(八) 特殊情况的处理</p> <p>1. 基金管理人或基金托管人按估值方法的第6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。</p>