

交银施罗德基金管理有限公司关于旗下31只基金根据《公开募集证券投资基金侧袋机制指引(试行)》修改基金合同等法律文件的公告

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》、《公开募集证券投资基金侧袋机制指引(试行)》及各基金基金合同、托管协议、招募说明书及其更新等规定,经与各基金托管人协商一致,并报中国证券监督管理委员会备案,交银施罗德基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)决定对旗下31只公募基金(具体基金清单详见附件)的基金合同、托管协议等法律文件进行修订。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6月30日起正式生效。

现将相关事项公告如下:

一、基金合同修订内容(以交银施罗德增利增强债券型证券投资基金为例)

1、“释义”章节

“释义”章节增加:

“61.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一个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

62.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”

2、“基金份额的申购与赎回”章节

“基金份额的申购与赎回”章节增加:

“十六、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。”

3、“基金份额持有人大会”章节

“基金份额持有人大会”章节增加:

“九、实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定

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:

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%);

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);

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);

4.在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;

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或代理人作为该次基金份额持有人大会的主持人;

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;

7.特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过。

同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。”

4、“基金的投资”章节

“基金的投资”章节增加:

“八、侧袋机制的实施和投资运作安排

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。

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。

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。”

5、“基金资产估值”章节

(1)修订“暂停估值的情形”条款

增加:

“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确认后,基金管理人应当暂停估值;”

并删除:

“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,基金管理人应当暂停估值;”

(2)增加“实施侧袋机制期间的基金资产估值”条款:

“九、实施侧袋机制期间的基金资产估值

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净值信息,暂停披露侧袋账户净值。”

6、“基金费用与税收”章节

“基金费用与税收”章节增加:

“五、实施侧袋机制期间的基金费用

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,详见招募说明书的规定。”

7、“基金的收益与分配”章节

“基金的收益与分配”章节增加:

“七、实施侧袋机制期间的收益分配

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。”

8、“基金的信息披露”章节

“基金的信息披露”章节增加:

“(十)实施侧袋机制期间的信息披露

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。”

二、托管协议修订内容(以交银施罗德增利增强债券型证券投资基金为例)

1、前言

增加:“若本基金实施侧袋机制的,侧袋机制实施期间的相关安排见基金合同和招募说明书的规定。”

2、“基金资产净值计算和会计核算”章节

(1)修订“暂停估值与公告基金份额净值的情形”条款：
增加：
“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确认后，基金管理人应当暂停估值；”
并删除：
“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，基金管理人应当暂停估值；”
(2)增加“实施侧袋机制期间的基金资产估值”条款：
“(五)实施侧袋机制期间的基金资产估值
本基金实施侧袋机制的，应根据基金合同的约定对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的基金净值信息，暂停披露侧袋账户净值。”
3、“基金收益分配”章节
“基金收益分配”章节增加：
“(三)实施侧袋机制期间的收益分配
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。”
4、“基金信息披露”章节
(1)修改“信息披露的内容”条款：
“基金的信息披露内容主要包括基金招募说明书、《基金合同》、托管协议、基金份额发售公告、基金募集情况、《基金合同》生效公告、基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购、赎回价格、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)、临时报告、澄清公告、基金份额持有人大会决议、实施侧袋机制期间的信息披露、中国证监会规定的其他信息。基金年度报告需经具有从事证券相关业务资格的会计师事务所审计后，方可披露。”
(2)增加“实施侧袋机制期间的信息披露”条款：
“(四)实施侧袋机制期间的信息披露
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。”
5、“基金费用”章节
“基金费用”章节增加：
“(九)实施侧袋机制期间的基金费用
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，详见招募说明书的规定。”
重要提示：
1、修改后的基金合同、托管协议自2021年6月30日起生效，基金管理人已履行了规定程序，符合相关法律法规的规定及各基金基金合同、托管协议的约定。修改后的各基金基金合同、托管协议全文将与本公告同日登载于基金管理人网站(www.fund001.com)及中国证监会基金电子披露网站(http://eid.csrc.gov.cn/fund)。本次修订后的招募说明书(更新)和产品资料概要(更新)将在本公司网站发布，供投资者查阅。

2、上述修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响，可不经基金份额持有人大会审议。

3、投资者可登录本基金管理人网站(www.fund001.com)或拨打本基金管理人的客户服务热线400-700-5000(免长途话费)，(021)61055000进行咨询、查询。

风险提示：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。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。

交银施罗德基金管理有限公司
二〇二一年六月三十日

附件：基金清单

序号	基金名称
1	交银施罗德信用添利债券证券投资基金(LOF)
2	交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金
3	交银施罗德稳固收益债券型证券投资基金
4	交银施罗德可转债债券型证券投资基金
5	交银施罗德中高等级信用债券型证券投资基金
6	交银施罗德中债1-3年政策性金融债指数证券投资基金
7	交银施罗德安心收益债券型证券投资基金
8	交银施罗德双轮动债券型证券投资基金
9	交银施罗德强化回报债券型证券投资基金
10	交银施罗德丰盈收益债券型证券投资基金
11	交银施罗德丰润收益债券型证券投资基金
12	交银施罗德丰享收益债券型证券投资基金
13	交银施罗德稳利中短债券型证券投资基金
14	交银施罗德中债1-3年农发行债券指数证券投资基金
15	交银施罗德裕坤纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金
16	交银施罗德增利债券型证券投资基金
17	交银施罗德双利债券型证券投资基金
18	交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金
19	交银施罗德裕利纯债债券型证券投资基金
20	交银施罗德增强收益债券型证券投资基金
21	交银施罗德增利增强债券型证券投资基金
22	交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金
23	交银施罗德裕隆纯债债券型证券投资基金
24	交银施罗德境尚收益债券型证券投资基金
25	交银施罗德丰晟收益债券型证券投资基金
26	交银施罗德稳鑫短债债券型证券投资基金
27	交银施罗德裕通纯债债券型证券投资基金
28	交银施罗德裕盈纯债债券型证券投资基金
29	交银施罗德裕泰两年定期开放债券型证券投资基金
30	交银施罗德裕如纯债债券型证券投资基金
31	交银施罗德裕祥纯债债券型证券投资基金