

关于修改中融融安二号保本混合型证券投资基金基金合同 等法律文件的公告

中融融安二号保本混合型证券投资基金经中国证券监督管理委员会证监许可（2015）1747号文准予募集，《中融融安二号保本混合型证券投资基金基金合同》于2015年9月25日生效。根据2017年10月1日起施行的《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“《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该《管理规定》的，应当在《管理规定》施行之日起6个月内，修改基金合同并公告。

本次《中融融安二号保本混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）和《中融融安二号保本混合型证券投资基金托管协议》（以下简称“《托管协议》”）的修订内容，符合《管理规定》和相关法律法规的规定及《基金合同》的相关约定。本基金管理人中融基金管理有限公司（以下简称“本公司”）已就本次《基金合同》和《托管协议》修订内容与本基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，并履行了适当的程序。

一、重要提示

1、本基金《基金合同》修改的具体内容详见附件《〈中融融安二号保本混合型证券投资基金基金合同〉修订对照表》，《中融融安二号保本混合型证券投资基金招募说明书》涉及《基金合同》、《托管协议》相关变动处将在定期更新时一并修改并公告。

《基金合同》、《托管协议》的修改内容自2018年3月31日起生效。

2、投资者可以登录本公司网站<http://www.zrfunds.com.cn/>查询或者致电本公司客户服务电话400-160-6000（免长途话费），（010）56517299咨询。

二、风险揭示

1、本次基金管理人系根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修订本基金的《基金合同》和《托管协议》，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；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及相关法律文件，审慎进行投资决策。

2、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。销售机构根据法规要求对投资者类别、风险承受能力和基金的风险等级进行划分，并提出适当性匹配意见。投资者在投资基金前应认真阅读《基金合同》和《招募说明书》等基金法律文件，全面认识基金产品的风险收益特征，在了解产品情况及听取销售机构适当性意见的基础上，根据自身的风险承受能力、投资期限和投资目标，对基金投资作出独立决策，选择合适的基金产品。

特此公告。

附件：《〈中融融安二号保本混合型证券投资基金基金合同〉修订对照表》

中融基金管理有限公司

2018年3月31日

附件：《〈中融融安二号保本混合型证券投资基金基金合同〉修订对照表》

修改章节	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》”）、《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》”）、《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“《流动性风险规定》”）和其他有关法律法规。</p>
第二部分 释义		<p>新增： 13、《流动性规定》：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>
第二部分 释义		<p>新增： 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 新增： 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</p>

		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。
第六部分 基金份额的申购与赎回	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>3. 赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后2位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p>	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>3. 赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见《招募说明书》，赎回金额单位为元。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示，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，并将上述赎回费全额计入基金财产。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后2位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p>
第六部分 基金份额的申购与赎回	<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>4. 基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益或时。</p>	<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>4. 基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益或对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时。</p> <p>新增：</p> <p>8、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数的比例达到或者超过基金份额总数的50%，或者有可能导致投资者变相规避前述50%比例要求的情形。</p> <p>9、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>10、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p>

	<p>发生上述第 1、2、3、5、6、7、8 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。如在过渡期内发生暂停申购，过渡期按暂停申购的期间相应顺延。</p>	<p>发生上述第 1、2、3、5、6、7、8、10 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。如在过渡期内发生暂停申购，过渡期按暂停申购的期间相应顺延。</p>
第六部分 基金份额的申购与赎回	<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p>	<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>新增：</p> <p>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。</p>
第六部分 基金份额的申购与赎回	<p>九、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>2. 巨额赎回的处理方式</p>	<p>九、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>2. 巨额赎回的处理方式</p> <p>新增：</p> <p>（4）若本基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人超过前一开放日基金总份额 20%以上的赎回申请的情形下，基金管理人可以延期办理赎回申请。具体措施如下：</p> <p>对于该单个基金份额持有人超出前一开放日基金总份额 20%的赎回申请，基金管理人可实施延期办理。对于该单个基金份额持有人未超过前一开放日基金总份额 20%（含 20%）的赎回申请与当日其他投资者的赎回申请一起，按上述（1）、（2）方式处理。对于上述因延期办理而未能赎回部分，投资人可在提交赎回申请时选择延期赎回或者取消赎回。选择延期赎回的，延期的赎回申请将自动转入下一开</p>

		放日,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。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。
第七部分 基金合同当事人及权利 义务	一、基金管理人 (一) 基金管理人简况 住所:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室 注册资本:人民币柒亿伍仟万元整 联系电话:010-85003388	一、基金管理人 (一) 基金管理人简况 住所:深圳市福田区莲花街道益田路6009号新世界中心29层 注册资本:人民币壹拾壹亿伍仟万元整 联系电话:010-56517000
第十二部分 基金的投资 (保本周期内的投资)	二、投资范围 基金的投资组合比例为:债券、货币市场工具等稳健资产占基金净资产的比例不低于60%,股票等风险资产的比例按照恒定比例投资组合保险策略进行动态调整,从而达到防御下跌、保值增值的目的。其中,持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。	二、投资范围 基金的投资组合比例为:债券、货币市场工具等稳健资产占基金净资产的比例不低于60%,股票等风险资产的比例按照恒定比例投资组合保险策略进行动态调整,从而达到防御下跌、保值增值的目的。其中,持有现金或者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,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 1. 组合限制 (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;	四、投资限制 1. 组合限制 (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。其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等; 新增: (17)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

	<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>超过该上市公司可流通股票的 30%;</p> <p>(18)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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的,本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;</p> <p>(19)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>(20)法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他投资限制。</p> <p>除上述第(2)、(12)、(18)、(19)项以外,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>第十二部分 基金的投资 (转型后的 投资)</p>	<p>二、投资范围</p> <p>基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例范围为 0-95%。权证投资比例为基金资产净值的 0-3%。本基金在每个交易日日终在扣除股指期货和国债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%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。</p>	<p>二、投资范围</p> <p>基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例范围为 0-95%。权证投资比例为基金资产净值的 0-3%。本基金在每个交易日日终在扣除股指期货和国债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%的现金或者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。</p>
<p>第十二部分 基金的投资</p>	<p>四、投资限制</p> <p>1. 组合限制</p> <p>(2) 本基金每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约</p>	<p>四、投资限制</p> <p>1. 组合限制</p> <p>(2) 本基金每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约</p>

	<p>需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券;</p> <p>因证券/期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动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。</p>	<p>需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者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。</p> <p>新增:</p> <p>(19)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,不超过该上市公司可流通股票的 30%;</p> <p>(20)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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的,本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;</p> <p>(21)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>(22)法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他投资限制。</p> <p>除上述第(2)、(12)、(20)、(21)项以外,因证券/期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动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。</p>
第十四部分	六、暂停估值的情形	六、暂停估值的情形

基金资产的估值		<p>新增： 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确认后，基金管理人应当暂停基金估值；</p>
第十八部分基金的信息披露	(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>(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>新增： 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>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本基金的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。</p>
第十八部分基金的信息披露	(七) 临时报告	<p>(七) 临时报告</p> <p>新增： 27、本基金发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；</p>