

# 关于鹏华丰信分级债券型证券投资基金

## 修改基金合同的公告

根据中国证监会 2017 年 8 月 31 日发布的《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》”），对已经存续的开放式基金，原基金合同内容不符合该《规定》的，应当在《规定》施行之日起 6 个月内予以调整。根据《规定》等法律法规，经与基金托管人上海银行股份有限公司协商一致，鹏华基金管理有限公司（以下简称“本公司”）对旗下鹏华丰信分级债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）的《鹏华丰信分级债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）相关条款进行修订。本次《基金合同》的修改内容包括释义、申购和赎回的数量限制、申购和赎回的价格、费用及其用途、拒绝或暂停申购的情形、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形、巨额赎回的处理方式、投资范围、投资限制、估值方法、暂停估值的情形、基金的信息披露等。具体修改内容见附件。

本次《基金合同》修订的内容系因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行的修改，且对原有基金份额持有人的利益无实质性影响，根据《基金合同》的约定，不需召开基金份额持有人大会。本次《基金合同》修订已经本基金管理人与基金托管人协商一致并已报监管机构备案。修订后的《基金合同》自本公告发布之日起生效。本基金管理人经与基金托管人协商一致，已相应修改本基金的《鹏华丰信分级债券型证券投资基金托管协议》，并将在更新的《鹏华丰信分级债券型证券投资基金招募说明书》中作相应调整。

投资者可访问鹏华基金管理有限公司网站([www.phfund.com](http://www.phfund.com))或拨打全国免长途费的客户服务电话（400—6788—999）咨询相关情况。

特此公告。

鹏华基金管理有限公司

二〇一八年三月七日

附件：《基金合同》修订对照表

基金合同条款	修改前内容	修改后内容
第一部分 “前言”	<p>原表述：</p> <p>（一）、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。</p>	<p>修改为：</p> <p>（一）、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》”）、《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“《流动性规定》”）和其他有关法律、法规。</p>
第二部分 “释义”	<p>增加表述</p>	<p>增加：</p> <p>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> <p>54、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</p>

		<p>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> <p>55、摆动定价机制：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，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待</p> <p>其余序号相应作调整</p>
<p>第七部分 “基金份额的申购与赎回”之“（一）丰信 A、丰信 B 的申购与赎回”之“5、申购与赎回的数额限制”</p>	<p>增加表述</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，具体请参见相关公告；</p>
<p>第七部分 “基金份</p>	<p>增加表述</p>	<p>增加：</p>

<p>额的申购与赎回” 之“（一）丰信 A、丰信 B 的申购 与赎回”之“8、 拒绝或暂停申购的 情形及处理方式”</p>	<p>原表述： 发生上述情形之一的，申购款项 将全额退还投资人。发生上述 1 到 5、8 项暂停申购情形且基金 管理人决定暂停申购时，基金管 理人应当在至少一家指定媒体及 基金管理人网站刊登暂停申购公 告。</p>	<p>（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；  （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。  修改为： 发生上述情形之一的，申购款项 将相应退还投资人。发生上述 1 到 5 项暂停申购情形且基金管 理人决定暂停申购时，基金管理 人应当在至少一家指定媒体及基 金管理人网站刊登暂停申购公告。</p>
<p>第七部分“基金份 额的申购与赎回” 之“（一）丰信 A、丰信 B 的申购 与赎回”之“9、 暂停赎回或者延缓 支付赎回款项的情 形及处理方式”</p>	<p>增加表述</p>	<p>增加： 4) 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>
<p>第七部分“基金份</p>	<p>增加表述</p>	<p>增加：</p>

<p>额的申购与赎回” 之“（一）丰信 A、丰信 B 的申购 与赎回”之“10、 巨额赎回的情形及 处理形式”</p>		<p>（3）若基金发生巨额赎回，在当日存在单个基金份额持有人超过上一日基金总份额 10%以上的赎回申请（“大额赎回申请人”）的情形下，基金管理人可以延期办理赎回申请。对其他赎回申请人（“小额赎回申请人”）和大额赎回申请人 10%以内的赎回申请在当日根据前述“（1）支付全部赎回款项”或“（2）延期支付部分赎回款项”的约定方式办理，在仍可接受赎回申请的范围内对大额赎回申请人超过 10%的赎回申请按比例确认。对当日未予确认的赎回申请进行延期办理。对于未能赎回部分，基金份额持有人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销；选择延期赎回的，当日未获受理的赎回申请将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。如基金份额持有人在提交赎回申请时未作明确选择，基金份额持有人未能赎回部分作自动延期赎回处理。</p>
<p>第十三部分 “基</p>	<p>原表述：</p>	<p>修改为：</p>

<p>金的投资”之</p> <p>“（二）投资范围”</p>	<p>基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%；股票等权益类品种的投资比例不超过基金资产的 20%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%；股票等权益类品种的投资比例不超过基金资产的 20%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例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。</p>
<p>第十三部分 “基金的投资”之</p> <p>“（四）投资限制”</p>	<p>原表述：</p> <p>1、（3）本基金持有的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%；</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>增加表述</p>	<p>修改为：</p> <p>1、（3）本基金持有的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；</p> <p>除上述第（3）、（11）、（12）条外，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>增加：</p> <p>（11）在开放日，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</p>

		<p>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前述所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>（12）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>（13）本基金管理人管理的全部开放式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%；</p> <p>（14）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%；</p> <p>序号做相应调整。</p>
<p>第十四部分 “基金资产估值”之 “（三）估值方法”</p>	<p>增加表述</p>	<p>增加： 6、当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。 序号做相应调整</p>
<p>第十四部分 “基金资产估值”之 “（六）暂停估值的情形”</p>	<p>增加表述</p>	<p>增加： 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</p>

		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； 序号做相应调整
第十四部分 “基金资产估值”之 “（八）特殊情况的处理”	原表述： 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。	修改为： 1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第7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。
第十九部分 “基金的信息披露”之 “（五）公开披露的基金信息”之 “7、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”	增加表述	增加： 基金管理人应当在半年度报告和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。 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产品的特有风险。
第十九部分 “基金的信息披露”之 “（五）公开披露的基金信息”之 “8、临时报告”	增加表述	增加： （28）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； （29）基金管理人采用摆动定价机制进行估值； 序号做相应调整