

关于修改嘉实丰安6个月定期开放债券型证券投资基金

基金合同及托管协议的公告

一、本次修改的基本情况

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》要求，为推动产品持续良性发展，嘉实基金管理有限公司对嘉实丰安6个月定期开放债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）基金合同、托管协议等法律文件在基金投资限制、申购赎回限制、信息披露条款等方面进行了相应调整。嘉实基金管理有限公司作为本基金的管理人，已与本基金托管人就基金合同、托管协议修改达成一致，并报中国证监会北京监管局备案。本次修改后的基金合同、托管协议将于2018年3月31日起正式施行。

二、基金合同、托管协议修订情况

基于上述调整，本公司将对本基金的基金合同、托管协议中涉及的相关内容进行修订，具体修订内容详见附件《〈嘉实丰安6个月定期开放债券型证券投资基金基金合同〉条款修改对照表》、《〈嘉实丰安6个月定期开放债券型证券投资基金托管协议〉条款修改对照表》。

三、重要提示

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；对投资者持有基金少于7日（不含）收取不低于1.5%的短期赎回费率；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和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、本次修订属于按照有效的法律法规和监管机构的规定执行，本基金管理人已就修订内容履行了规定的程序，符合相关法律法规及基金合同的规定。

3、本公告仅对本基金根据法律法规修订有关事项予以说明。基金管理人将在本公告发布当日，将修改后的基金合同、托管协议登载于本公司网站，并将在更新的基金招募说明书中，对涉及上述修订的内容进行相应更新。

投资者可以通过拨打本公司客服热线（400-600-8800）或登录本公司网站（www.jsfund.cn）获取相关信息。

特此公告

嘉实基金管理有限公司

2018年3月22日

附件：

- 1、《〈嘉实丰安6个月定期开放债券型证券投资基金基金合同〉条款修改对照表》
- 2、《〈嘉实丰安6个月定期开放债券型证券投资基金托管协议〉条款修改对照表》

《嘉实丰安 6 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》条款修改对照表

修改前	修改后
第一部分 前言	
<p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</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》”)……《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>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</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》”)……《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》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)</u>和其他有关法律法规。</p>
第二部分 释义	
无	<p><u>13、《流动性风险管理规定》：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</u></p> <p><u>53、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）、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</u></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>无</p>	<p>五、申购和赎回的数量限制</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，具体规定请参见相关公。</u></p>
六、申购和赎回的价格、费用及其用途	六、申购和赎回的价格、费用及其用途

<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。赎回费中扣除应归基金财产的部分后，其余用于支付登记费和其他必要的手续费，赎回费计入基金财产的比例在本基金招募说明书中列示。</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，<u>其中对持续持有期少于 7 日的投资者收取不少于 1.5% 的赎回费并全额计入基金财产</u>。赎回费中扣除应归基金财产的部分后，其余用于支付登记费和其他必要的手续费，赎回费计入基金财产的比例在本基金招募说明书中列示。</p>
<p>七、拒绝或暂停申购的情形 发生上述第 1、2、3、5、6、7项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受基金投资者的申购申请时.....</p>	<p>七、拒绝或暂停申购的情形 <u>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。</u> <u>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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。</u> 发生上述第 1、2、3、5、6、<u>8、9</u>项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受基金投资者的申购申请时.....</p>
<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 <u>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，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。</u></p>
<p>九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 本基金出现巨额赎回的，基金管理人符合法律法规及基金合同约定的赎回申请应于当日全部予以办理和确认。但对于已接受的赎回申请，如基金管理</p>	<p>九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 本基金出现巨额赎回的，基金管理人符合法律法规及基金合同约定的赎回申请应于当日全部予以办理和确认。但对于已接受的赎回申请，如基金管理</p>

人认为全额支付投资人的赎回款项有困难或认为全额支付投资人的赎回款项可能会对基金的资产净值造成较大波动的，基金管理人可对赎回款项进行延缓支付，但不得超过 20 个工作日。延缓支付的赎回申请以赎回申请当日的基金份额净值为基础计算赎回金额。如基金管理人无法在 20 个工作日内支付上述未支付部分的赎回款项，或基金管理人认为在变现过程中由于存在明显损害其他基金份额持有人利益的情形，经与基金托管人协商一致，基金管理人可以在履行信息披露义务后终止基金合同并报中国证监会备案，而无需召开基金份额持有人大会。

人认为全额支付投资人的赎回款项有困难或认为全额支付投资人的赎回款项可能会对基金的资产净值造成较大波动的，在赎回申请人中不存在当日申请赎回的份额超过前一工作日基金总份额 30%的单个赎回申请人（“大额赎回申请人”）的情形下，基金管理人可对赎回款项进行延缓支付，但不得超过 20 个工作日。延缓支付的赎回申请以赎回申请当日的基金份额净值为基础计算赎回金额。如基金管理人无法在 20 个工作日内支付上述未支付部分的赎回款项，或基金管理人认为在变现过程中由于存在明显损害其他基金份额持有人利益的情形，经与基金托管人协商一致，基金管理人可以在履行信息披露义务后终止基金合同并报中国证监会备案，而无需召开基金份额持有人大会。

但在赎回申请人中存在大额赎回申请人的情形下，基金管理人应当按照以下原则办理：对小额赎回申请人的赎回申请在当日予以全部确认，且在当日按比例支付的赎回份额不低于前一工作日基金总份额的 20%的前提下，在仍可接受赎回申请的范围内对大额赎回申请人的赎回申请按比例（单个大额赎回申请人的赎回申请量/当日大额赎回申请总量）确认。对该等大额赎回申请人当日未予确认的部分，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，当日未获受理的赎回申请将被撤销；选择延期赎回的，当日未获处理的赎回申请将自动转入下一开放日继续赎回，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，直至全部赎回为止。若大额赎回申请人在本开放期最后一个开放日仍有未获受理的赎回申请，则开放期相应延长且延长后不超过 20 个工作日，延长的开放期内不办理申购、亦不接受新的赎回申请，仅为大额赎回申请人办理原开放期内未获受理的赎回申请，并以实际受理日的基金份额净值为基础计算赎回金额。如大额赎回申请人在提交赎回申请时未作明确选择，大额赎回申请人未能赎回部分作自动延期赎回处理。对当日已确认未支

	付的赎回申请，基金管理人可以延缓支付赎回款项，但延缓支付的期限不得超过二十个工作日。基金管理人应当对延期办理事宜在指定媒介上刊登公告。
第七部分 基金合同当事人及权利义务	
<p>一、基金管理人</p> <p>(一) 基金管理人简况</p> <p>法定代表人：邓红国</p> <p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况</p> <p>注册资本：686.04亿元人民币</p>	<p>一、基金管理人</p> <p>(一) 基金管理人简况</p> <p>法定代表人：赵学军</p> <p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况</p> <p>注册资本：810.31亿元人民币</p>
第十二部分 基金的投资	
<p>二、投资范围</p> <p>.....</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的80%（开放期开始前二十个工作日至开放期结束后二十个工作日内不受此比例限制）；开放期内，本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留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%；在封闭期内，本基金不受上述5%的限制，但每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。</p>	<p>二、投资范围</p> <p>.....</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的80%（开放期开始前二十个工作日至开放期结束后二十个工作日内不受此比例限制）；开放期内，本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留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；在封闭期内，本基金不受上述5%的限制，但每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。</p>
<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(2) 开放期内，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，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>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(2) 开放期内，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，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>封闭期内，本基金不受上述 5%的限制，但每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；</p>	<p><u>其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>；封闭期内，本基金不受上述 5%的限制，但每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；</p> <p><u>(14) 开放期内，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、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合本款所规定比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u></p> <p><u>(15) 开放期内，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；</u></p>
<p>因证券、期货市场波动、证券发行人合并、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，除上述第（9）项规定外，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规另有规定的，从其规定。</p>	<p>因证券、期货市场波动、证券发行人合并、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，除上述第 <u>(2)、(9)、(14)、(15)</u> 项外，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规另有规定的，从其规定。</p>
<p>第十四部分 基金资产估值</p>	
<p>六、暂停估值的情形</p> <p>无</p>	<p>六、暂停估值的情形</p> <p><u>3、在本基金开放期内，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；</u></p>
<p>第十八部分 基金的信息披露</p>	
<p>五、公开披露的基金信息</p> <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>五、公开披露的基金信息</p> <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><u>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。</u></p>

	<p><u>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，中国证监会认定的特殊情形除外。</u></p>
<p>(七) 临时报告 无</p>	<p>(七) 临时报告 <u>26、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；</u></p>

注：基金合同内容摘要涉及上述内容的一并修改。

《嘉实丰安 6 个月定期开放债券型证券投资基金托管协议》条款修改对照表

修改前	修改后
一、基金托管协议当事人	
<p>(一) 基金管理人 法定代表人：邓红国</p> <p>(二) 基金托管人 注册资本：686.04亿元人民币</p>	<p>(一) 基金管理人 法定代表人：赵学军</p> <p>(二) 基金托管人 注册资本：810.31亿元人民币</p>
二、基金托管协议的依据、目的和原则	
<p>(一) 订立托管协议的依据 根据《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》)、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 7 号〈托管协议的内容与格式〉》、《嘉实丰安 6 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关规定订立本托管协议。</p>	<p>(一) 订立托管协议的依据 根据《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》)、<u>《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“《流动性风险管理规定》”)</u>、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 7 号〈托管协议的内容与格式〉》、《嘉实丰安 6 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关规定订立本托管协议。</p>
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	
<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金投资范围、投资对象进行监督……</p> <p>基金的投资组合比例为:本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%(开放期开始前二十个工作日至开放期结束后二十个工作日内不受此比例限制);开放期内,本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基</p>	<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金投资范围、投资对象进行监督……</p> <p>基金的投资组合比例为:本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%(开放期开始前二十个工作日至开放期结束后二十个工作日内不受此比例限制);开放期内,本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的</p>

<p>金资产净值的 5%；在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制，但每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。</p>	<p>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；在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制，但每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。</p>
<p>(二)基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资、融券比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： 2. 开放期内，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，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；封闭期内，本基金不受上述 5%的限制，但每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；</p>	<p>(二)基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资、融券比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： 2. 开放期内，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，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；封闭期内，本基金不受上述 5%的限制，但每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金； 14. 开放期内，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、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合本款所规定比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资； 15. 开放期内，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>在符合相关法律法规规定的前提下，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等非本基金管理人的因素致使基金的投资组合不符合上述规定的投资比例的，除上述第 9 项规定外，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规另有规定的，从其规定。</p>	<p>在符合相关法律法规规定的前提下，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等非本基金管理人的因素致使基金的投资组合不符合上述规定的投资比例的，除上述第 2、9、14、15 项外，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规另有规定的，从其规定。</p>
<p>八、基金资产净值计算和会计核算</p>	
<p>(四) 暂停估值与公告基金份额净值的情形 无</p>	<p>(四) 暂停估值与公告基金份额净值的情形 3. 在本基金开放期内，当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无</p>

	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；
--	---