

农银汇理基金管理有限公司关于农银汇理中证 500 指数证券投资基金修改基金合同的公告

公告送出日期：2018 年 3 月 23 日

根据中国证券监督管理委员会于 2017 年 8 月 31 日颁布的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（证监会公告[2017]12 号），经与基金托管人交通银行股份有限公司协商一致并报中国证监会上海证监局备案，农银汇理基金管理有限公司（以下简称“本公司”）对农银汇理中证 500 指数证券投资基金（以下简称“本基金”）的《农银汇理中证 500 指数证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）相关条款进行调整，并更新基金管理人、基金托管人信息，现将具体事宜公告如下：

一、《基金合同》的修改内容

本基金《基金合同》修改事项属于因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改，对基金份额持有人的利益无实质性不利影响，且不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化，不属于法律法规规定或《基金合同》约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项。《基金合同》的具体修改内容如下：

章节	原文条款	修改后条款
一、前言	<p>（一）订立《农银汇理中证 500 指数证券投资基金基金合同》（以下简称“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</p> <p>订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》、《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》”）</p>	<p>（一）订立《农银汇理中证 500 指数证券投资基金基金合同》（以下简称“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</p> <p>订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》、《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》”）、<u>《公开募集开放式证券投资基金流动</u></p>

	”)和其他有关法律法规及相关规定。	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及相关规定。
二、释义	无	<p><u>《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；</u></p> <p><u>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；</u></p> <p><u>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；</u></p>
六、基金份额的申购、赎回与转换	（五）申购与赎回的数额限制 无	<p>（五）申购与赎回的数额限制</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，具体请参见相关公告。</u></p>
	<p>（六）申购与赎回的价格、费用及其用途</p> <p>（3）投资人赎回本基金份额需缴纳赎回费用，本基金的赎回费率最高不超过赎回总额（含赎回费用）的5%。本基金实际执行的赎回费率在招募说明书或相关公告中载明。</p>	<p>（六）申购与赎回的价格、费用及其用途</p> <p>（3）投资人赎回本基金份额需缴纳赎回费用，本基金的赎回费率最高不超过赎回总额（含赎回费用）的5%。本基金实际执行的赎回费率在招募说明书或相关公告中载明，<u>其中本基金对持续持有期少于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></p>

		<u>(8) 本基金暂不采用摆动定价机制。</u>
	<p>(九) 巨额赎回的认定及处理方式 (2) 巨额赎回的处理方式 2) 部分延期赎回：……转入下一开放日的申请不享有赎回和转出优先权并将以该下一个开放日的基金份额净值为基准计算，以此类推，直到全部完成赎回和转出申请为止。</p>	<p>(九) 巨额赎回的认定及处理方式 (2) 巨额赎回的处理方式 2) 部分延期赎回：……转入下一开放日的申请不享有赎回和转出优先权并将以该下一个开放日的基金份额净值为基准计算，以此类推，直到全部完成赎回和转出申请为止。 <u>若本基金发生巨额赎回的，在单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额20%以上的赎回申请的情形下，基金管理人有权延期办理赎回申请：对于该基金份额持有人当日超过上一开放日基金总份额20%以上的那部分赎回申请，基金管理人有权全部延期办理；对于该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人有权根据前段“1) 接受全额赎回”或“2) 部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。但是，如该持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。</u></p>
	<p>(十) 拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理 (1) 在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资人的申购申请： 3) 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况；</p>	<p>(十) 拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理 (1) 在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资人的申购申请： 3) 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况<u>或者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；</u> <u>6) 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超过50%，或者变相规避50%集中度的情形时；</u></p>
	<p>(十) 拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理 (2) 在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资人的赎回申请：</p>	<p>(十) 拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理 (2) 在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资人的赎回申请：</p>

	4) 发生本基金合同规定的暂停基金财产估值情况;	4) 发生本基金合同规定的暂停基金财产估值情况 <u>或者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赎回申请;</u>
七、基金合同当事人及其权利义务	(一) 基金管理人 (1) 基金管理人基本情况 住所: 上海市浦东新区世纪大道1600号浦项商务广场7层 法定代表人: 杨琨	(一) 基金管理人 (1) 基金管理人基本情况 住所: <u>中国(上海)自由贸易试验区银城路9号50层</u> 法定代表人: <u>于进</u>
	(二) 基金托管人 (1) 基金托管人基本情况 法定代表人: 胡怀邦 注册资本: 562.59 亿元人民币	(二) 基金托管人 (1) 基金托管人基本情况 法定代表人: <u>牛锡明</u> 注册资本: <u>742.62</u> 亿元人民币
十二、基金的投资	(二) 投资范围 本基金投资于标的指数成分股和备选股的比例不低于基金资产的90%; 除股票以外的其他资产投资比例范围为基金资产的5%—10%, 其中现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%。	(二) 投资范围 本基金投资于标的指数成分股和备选股的比例不低于基金资产的90%; 除股票以外的其他资产投资比例范围为基金资产的5%—10%, 其中现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%, <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>
	(八) 投资禁止行为与限制 (2) 基金投资组合比例限制 1) 本基金投资于标的指数成分股和备选股的比例不低于基金资产的90%; 除股票以外的其他资产投资比例范围为基金资产的5%—10%, 其中现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%; 5) 基金的投资组合中保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%; 7) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例, 不得超过该资产支持证券规模的10%; 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例, 不得超过基金资产净值的10%; 本公司管理	(八) 投资禁止行为与限制 (2) 基金投资组合比例限制 1) 本基金投资于标的指数成分股和备选股的比例不低于基金资产的90%; 除股票以外的其他资产投资比例范围为基金资产的5%—10%, 其中现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%, <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> 5) 基金的投资组合中保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%, <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> 7) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例, 不得超过该资产支持证券规模的10%; 本基金投资于同一原始权益人的各类资产

	<p>的全部证券投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%，中国证监会规定的特殊品种除外。本基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，将在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出。</p>	<p>支持证券的比例，不得超过基金资产净值的10%；本公司管理的全部证券投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%，中国证监会规定的特殊品种除外；</p> <p>8) 本基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，将在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；</p> <p>10) <u>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；</u></p> <p>11) <u>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>(九) 投资组合比例调整 基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。因证券市场波动、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不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在10个工作日内进行调整，法律法规证监会另有规定的，从其规定。</p>	<p>(九) 投资组合比例调整 基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。<u>除上述(八)的(2)中第5)、8)、10)、11)项之外，</u>因证券市场波动、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不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在10个工作日内进行调整，法律法规证监会另有规定的，从其规定。</p>
<p>十四、基金资产的估值</p>	<p>(六) 暂停估值的情形 无</p>	<p>(六) 暂停估值的情形 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的；</p>
<p>十八、基金的信</p>	<p>(三) 定期报告 无</p>	<p>(三) 定期报告 (6) 基金持续运作过程中，基金管理人应当在基金年度报告和半年度报</p>

息披露		<p><u>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>(7) 基金运作期间，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产品的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。</u></p>
	(五) 临时报告与公告 无	<p>(五) 临时报告与公告</p> <p><u>(26) 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的重大事项；</u></p>

*基金合同内容摘要部分、托管协议涉及上述内容的一并修改；

二、重要提示

1、本次修订后的《基金合同》自本公告发布之日起生效，但为不影响原有基金份额持有人的利益，《基金合同》中“本基金对持续持有期少于 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。”的条款将于 2018 年 3 月 31 日起正式实施。本基金将于 2018 年 3 月 31 日起，对持续持有期少于 7 日的投资者收取 1.5% 的赎回费并全额计入基金财产。

2、本公司于本公告日在网站上同时公布经修改后的本基金基金合同及托管协议；招募说明书及摘要将随后在定期更新时进行相应修改。

3、投资者可拨打本公司客户服务电话（4006895599、021-61095599）或登陆本公司网站（www.abc-ca.com）咨询相关事宜。

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。投资人投资于本基金时应认真阅读本基金的基金合同、招募说明书等文件。敬请投资人留意投资风险。

特此公告。

农银汇理基金管理有限公司
2018年3月23日