

## 永赢基金管理有限公司

### 关于永赢瑞益债券型证券投资基金根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改基金合同及托管协议的公告

根据中国证监会于 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“《流动性风险管理规定》”），对已经成立的开放式基金，原基金合同内容不符合《流动性风险管理规定》的，应在《流动性风险管理规定》施行之日起 6 个月内，修改基金合同并公告。

根据《流动性风险管理规定》，经与基金托管人兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”）协商一致，并报监管机构备案，永赢基金管理有限公司（以下简称“本公司”）决定对永赢瑞益债券型证券投资基金基金合同和托管协议进行相应修改，具体修改内容请详见附件《永赢瑞益债券型证券投资基金基金合同修改条款前后文对照表》和《永赢瑞益债券型证券投资基金托管协议修改条款前后文对照表》。

本公司将在更新的《永赢瑞益债券型证券投资基金招募说明书》中对相关内容进行相应修改。

上述修改自【2018】年【3】月【30】日起生效。

重要提示：

1、基金合同和托管协议的修订系因相应的法律法规发生变动而进行的修改。此次修订已经履行了规定的程序，符合相关法律法规及基金合同的规定。

2、本公司于本公告日在网站上同时公布经修改后的永赢瑞益债券型证券投资基金基金合同和托管协议。

3、投资者可通过以下途径咨询有关详情：

本公司客户服务电话：021-51690111

本公司网站：[www.maxwealthfund.com](http://www.maxwealthfund.com)

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。投资者投资于上述基金时应认真阅读该基金的基金合同、招募说明书等文件。敬请投资者留意投资风险。

特此公告。

永赢基金管理有限公司

2018 年 3 月 23 日

## 附件 1:

## 《永赢瑞益债券型证券投资基金基金合同》修改条款前后文对照表

《永赢瑞益债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)按照证监会《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,以下简称“《流动性风险管理规定》”)规定修改拟定,具体新《永赢瑞益债券型证券投资基金基金合同》与原《永赢瑞益债券型证券投资基金基金合同》修改条文的对照说明如下:

页码	《永赢瑞益债券型证券投资基金基金合同》 内容	《永赢瑞益债券型证券投资基金基金合同》修改条款版本 内容	修改理由
1、P1 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》”)、《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>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》”)、《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“《流动性风险管理规定》”)和其他有关法律、法规。</p>	根据《流动性风险管理规定》规定,进行适应性修订
2、P3-6 第二部分 释义		<p>(增加)</p> <p>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</p> <p>52、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</p>	<p>根据相关法律法规的修订情况进行适应性修改</p> <p>根据《流动性</p>

		<p>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>53、摆动定价机制:是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>风险管理规定》第四十条,补充流动性受限资产定义</p> <p>根据《流动性风险管理规定》第四十条,补充摆动定价机制定义</p>
<p>3、P13 第六部分 五、 申购和赎回的 数量限制</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。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要,可采取上述措施对基金规模予以控制。具体规定请参见招募说明书或相关公告。</p>	<p>根据《流动性风险管理规定》第十九条的规定补充</p>
<p>4、P14-15 第六部分 六、 申购和赎回的 价格、费用及 其用途</p>		<p>(增加)</p> <p>6、本基金对持续持有期少于 7 日的投资者,应当收取不低于 1.5%的赎回费,该赎回费全额计入基金财产。</p> <p>9、当本基金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</p>	<p>根据《流动性风险管理规定》第二十三条补充强制赎回费的规定</p> <p>根据《流动性风险管理规定》第</p>

		平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。	二十五条补充摆动定价机制的适用情形
<p>5、P15-16 第六部分 七、 拒绝或暂停申购的情形</p>	<p>4、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时。 发生上述第 1、2、3、5、6、9 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停投资者的申购申请时，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，被拒绝部分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。</p>	<p>4、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。 (增加) 5、基金管理人基于投资运作与风险控制的需要认为应当拒绝大额申购或暂停申购时。 6、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投资人的申购申请。 7、基金管理人使用固有资金、公司高级管理人员及基金经理等人员出资认购的基金份额超过基金总份额 50%的情形除外，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的持有基金份额占本基金总份额的比例达到或者超过 50%，或者通过一致行动人等方式变相使单一投资者持有本基金份额占本基金总份额的比例达到或超过 50%的情形时。 发生上述第 1、2、3、5、6、8、9、10 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停投资者的申购申请时，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</p>	<p>根据《流动性风险管理规定》第十九条规定，完善表述</p> <p>根据《流动性风险管理规定》第二十四条补充应当暂停申购的情形</p> <p>根据《流动性风险管理规定》第四十条第（四）项完善表述</p>

		部或部分拒绝，被拒绝部分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。	
6、P16 第六部分 八、 暂停赎回或延 缓支付赎回款 项的情形		<b>(增加)</b> 6、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投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。	根据《流动性风险管理规定》第二十四条的规定补充应当暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形
7、P17 第六部分 九、 巨额赎回的情 形及处理方式	2、巨额赎回的处理方式 (2) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，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。延期的赎回申请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该类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。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	2、巨额赎回的处理方式 (2) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。 <b>若进行上述延期办理，对于单个基金份额持有人当日赎回申请超过上一开放日基金总份额 10%以上的部分，将自动进行延期办理。对于其余当日非自动延期办理的赎回申请，应当按单个账户非自动延期办理的赎回申请量占非自动延期办理的赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分</b> 赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日	根据《流动性风险管理规定》第二十一条第（二）项的规定修改

	分作自动延期赎回处理。	赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的该类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。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。	
8、P41 第十二部分 二、投资范围	基金的投资组合比例为：本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%；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，应持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%。	基金的投资组合比例为：本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%；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，应持现金（不含结算备付金、存出保证金、应收申购款等）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%。	根据《流动性风险管理规定》第十八条修改
9、P43-45 第十二部分 四、投资限制	<p>1、组合限制</p> <p>(2) 本基金在任何交易日日终，扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应持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>除上述第(9)项外，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，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>(2) 本基金在任何交易日日终，扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应持现金（不含结算备付金、存出保证金、应收申购款等）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><b>(增加)</b></p> <p><b>(13) 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款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</b></p>	<p>根据《流动性风险管理规定》第十八条修改</p> <p>根据《流动性风险管理规定》第十六、十七条修改</p>

		<p>(14) 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>除上述第(2)、(9)、(13)、(14)项外，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，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>	
10、 P49 第十四部分 三、估值方法		<p>(增加)</p> <p>7、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。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。</p>	根据《流动性风险管理规定》第二十五条补充完善估值方法
11、 P52 第十四部分 五、估值错误的处理	<p>5、特殊情况的处理</p> <p>(1) 基金管理人或基金托管人按基金合同约定的估值方法第7项进行估值时，所造成的误差不得作为基金资产估值错误处理；</p>	<p>5、特殊情况的处理</p> <p>(1) 基金管理人或基金托管人按基金合同约定的估值方法第8项进行估值时，所造成的误差不得作为基金资产估值错误处理；</p>	根据估值方法调整序号
12、 P52 第十四部分 六、暂停估值的情形		<p>(增加)</p> <p>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>	根据《流动性风险管理规定》第二十四条补充
13、 P60-6 2 第十八部分	<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>基金管理人应当在每年结束之日起90日内，编制完</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>基金管理人应当在每年结束之日起90日内，编</p>	

<p><b>五、公开披露的基金信息</b></p>	<p>成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定媒介上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。</p> <p>基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定媒介上。</p> <p>基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定媒介上。</p> <p>基金合同生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。</p> <p>基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。</p> <p>报告期内出现单一投资者持有基金份额占本基金总份额的比例达到或者超过 20% 的情形，基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告文件中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。</p> <p>法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。</p> <p>(七) 临时报告</p>	<p>制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定媒介上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。</p> <p>基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定媒介上。</p> <p>基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定媒介上。</p> <p>基金合同生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。</p> <p>基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。</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产品的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。</p> <p>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。</p> <p>法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定</p> <p>(七) 临时报告</p>	<p>根据《流动性风险管理规定》第二十六条及第二十七条补充定期报告的内容</p>
---------------------------	--	--	--



---

---

		<p>(增加)</p> <p>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> <p>28、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；</p>	<p>根据《流动性风险管理规定》第二十五、二十六条补充临时报告的内容</p>
--	--	--	--

附件 2: 《永赢瑞益债券型证券投资基金托管协议》修改条款前后文对照表

《永赢瑞益债券型证券投资基金托管协议》(以下简称“《托管协议》”)按照证监会《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,以下简称“《流动性风险管理规定》”)规定修改拟定,具体新《永赢瑞益债券型证券投资基金托管协议》与原《永赢瑞益债券型证券投资基金托管协议》修改条文的对照说明如下:

页码	《永赢瑞益债券型证券投资基金托管协议》	《永赢瑞益债券型证券投资基金托管协议》修改条款版本	修改理由
	内容	内容	
1、P5 二、基金托管协议的依据、目的、原则 (一)订立托管协议的目的	本协议依据《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》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)等有关法律法规、《永赢瑞益债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关规定制订。	本协议依据《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“《流动性风险管理规定》”)等有关法律法规、《永赢瑞益债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关规定制订。	根据《流动性风险管理规定》进行适应性修订
2、P5 三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查 (一)基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权	基金的投资组合比例为:本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%;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,应保持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%。	基金的投资组合比例为:本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%;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,应保持现金(不含结算备付金、存出保证金、应收申购款等)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%。	根据《流动性风险管理规定》第十八条修改

<p>3、P6-8 三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查 (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、融资比例进行监督。</p>	<p>基金托管人按下述比例和调整期限进行监督: (2) 本基金在任何交易日日终,扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应保持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%; 除上述第(9)项外,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,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>基金托管人按下述比例和调整期限进行监督: (2) 本基金在任何交易日日终,扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应保持现金(不含<b>结算备付金、存出保证金、应收申购款等</b>)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%; <b>(增加)</b> (13) 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款所规定比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资; (14) 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; 除上述第(2)、(9)、(13)、(14)项外,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,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>根据《流动性风险管理规定》第十八条修改  根据《流动性风险管理规定》第十六、十七条修改</p>
<p>4、P28-29 八、基金资产</p>	<p>3、特殊情形的处理 基金管理人、基金托管人按估值方法的第(7)</p>	<p>2. 估值方法 <b>(增加)</b></p>	<p>根据《流动性风险管理规定》第</p>

<p>净值计算和会计核算</p> <p>(二) 基金资产估值方法和特殊情形的处理</p>	<p>项进行估值时，所造成的误差不作为基金估值错误处理。</p>	<p>(7) 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。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。</p> <p>3、特殊情形的处理</p> <p>基金管理人、基金托管人按估值方法的第(8)项进行估值时，所造成的误差不作为基金估值错误处理。</p>	<p>二十五条补充完善估值方法</p> <p>根据估值方法调整序号</p>
<p>5、P30</p> <p>八、基金资产净值计算和会计核算</p> <p>(四) 暂停估值的情形</p>		<p>(增加)</p> <p>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>	<p>根据《流动性风险管理规定》第二十四条补充</p>
<p>6、P36</p> <p>十、基金信息披露</p> <p>(三) 基金托管人和基金管理人在信息披露中的职责和信息披露程序</p>	<p>报告期内出现单一投资者的持有基金份额占本基金总份额的比例达到或超过 20%的情形，基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告文件中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。</p>	<p>(增加)</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产品的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。</p> <p>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。</p>	<p>根据《流动性风险管理规定》第二十六条及第二十七条补充定期报告的内容</p>