

关于金鹰添盈纯债债券型证券投资基金

修改基金合同及托管协议的公告

一、本次修改的基本情况

金鹰添盈纯债债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会证监许可[2016]2066号《关于准予金鹰添盈纯债债券型证券投资基金注册的批复》核准募集,基金合同于2016年9月9日正式生效。

2017年8月31日中国证监会发布《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》,为使本基金符合上述法规的要求,经与基金托管人交通银行股份有限公司协商一致,并报监管机构备案,金鹰基金管理有限公司决定于2018年3月31日起修改金鹰添盈纯债债券型证券投资基金基金合同(以下简称《基金合同》)及金鹰添盈纯债债券型证券投资基金托管协议(以下简称《托管协议》),具体修改内容请详见附件1《金鹰添盈纯债债券型证券投资基金基金合同修改对照表》、附件2《金鹰添盈纯债债券型证券投资基金托管协议修改对照表》。

二、重要提示

1. 本次修订属于按照法律法规和监管机构的规定执行,符合《基金合同》的约定。《基金合同》修改后,基金的投资目标、风险收益特征不发生改变,对原有基金份额持有人的利益无实质性影响,无需召开基金份额持有人大会。

2、本公司将于公告当日,将修改后的本基金《基金合同》、《托管协议》登载于公司网站。

3、本公告构成本基金招募说明书的补充,基金管理人将在届时更新招募说明书时一并更新以上内容。

4、投资者可通过本基金管理人的网站: www.gefund.com.cn 或客户服务电话: 400-6135-888 了解详情。

三、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。投资有风险,敬请投资人选择适合自身风险

承受能力的投资品种进行投资。

特此公告。

附件1：《金鹰添盈纯债债券型证券投资基金基金合同修改对照表》

附件2：《金鹰添盈纯债债券型证券投资基金托管协议修改对照表》

金鹰基金管理有限公司

2018年3月24日

附件 1：金鹰添盈纯债债券型证券投资基金基金合同的修订内容

章节	原文内容	修订后内容
第一部分 前言	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	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》

	<p>“《信息披露办法》”)和其他有关法律法规及相关规定。</p>	<p>)和其他有关法律法规及相关规定。</p>
<p>第二部分 释义</p>	<p>无</p>	<p>增加：</p> <p>52、《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>53、流动性受限资产：是指由于法律法规、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> <p>54、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</p>

		公平对待
第六部分 基金份额的申购与赎回	无	<p>五、申购和赎回的数量限制增加：</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>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</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。赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。</p>	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途 修改为：</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。赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。其中对于持续持有期少于7日的投资者收取不低于1.5%的赎回费并全额计入基金财产。</p>
	无	<p>增加：</p> <p>六、8、本基金暂不采用摆动定价机制，基金管理人可结合基金实际运作情况，根据相关法律法规在履行适当程序并提前公告后</p>

	增加摆动定价机制。
	<p>七、拒绝或暂停申购的情形增加：</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。</p> <p>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。</p> <p>9、申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单一投资者单日或单笔申购金额上限的。</p> <p>（最后一段修改为：）</p> <p>发生上述第 1、2、3、5、6、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。如果投资者的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资者。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>增加：</p> <p>八、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，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。</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>增加：</p> <p>（4）当基金发生巨额赎回，在单个持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额 25%的情形下，基金管理人可以延期办理该单个持有人超过上一开放日基金总份额 25%的赎回申请,对于单个持有人未超过上一开放日基金总份额 25%的赎回申请，与当日其它赎回申请一起，按照上述（1）（2）方式处理。当日未获受理的赎回申请将与下一开放日的赎回申请一并处理，直到全部赎回为止。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。</p>
第七部分 基金合同当事人	住所：广东省广州市天河区珠江东路 28 号	<p>修改为：</p> <p>住所：广东省广州市南沙区</p>

及权利义务	<p>越秀金融大厦 30 层</p> <p>法定代表人：凌富华</p> <p>注册资本：2.5 亿元人民币</p>	<p>海滨路 171 号 11 楼自编 1101 之一 J79</p> <p>法定代表人：刘岩</p> <p>注册资本：5.102 亿元人民币</p>
	<p>住所：上海市浦东新区银城中路 188 号</p> <p>法定代表人：牛锡明</p>	<p>修改为：</p> <p>住所：上海市浦东新区银城中路 188 号（邮政编码：200120）</p> <p>法定代表人：彭纯</p> <p>批准设立机关和批准设立文号：国务院国发(1986)字第 81 号文和中国人民银行银发 [1987] 40 号文</p>
第十二部分 基金的投资	<p>二、……</p> <p>本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%；持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不得低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>修改为：</p> <p>二、……</p> <p>本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%；持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不得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>四、1、（2）本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不得低于基金资产净值的 5%；</p>	<p>修改为：</p> <p>四、1、（2）本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不得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</p>

		<p>购款等；</p>
<p>无</p>	<p>四、投资限制 1、组合限制中增加：</p> <p>(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%。</p> <p>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。</p> <p>(14) 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>四、投资限制 1、组合限制中增加：</p> <p>(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%。</p> <p>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。</p> <p>(14) 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>因证券市场波动、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，基金管理人应当在相关证券可上市交易之日起的 10 个交易日内进行调整（除（9）外）。法律法规另有规定的，从其规定。</p>	<p>因证券市场波动、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，基金管理人应当在相关证券可上市交易之日起的 10 个交易日内进行调整（除（2）、（9）、（13）、（14）外）。法律法规另有规定的，从其规定。</p>

第十四部分 基金资产估值	无	<p>六、暂停估值的情形增加：</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>
第十八部分 基金的信息披露	无	<p>修改为：</p> <p>五（六）……</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。</p> <p>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定风险，中国证监会认定的特殊情形除外。</p>
	无	<p>（五）临时报告与公告 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；</p>

		<p>八、当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金相关信息 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的；</p>
--	--	--

二、金鹰添盈纯债债券型证券投资基金托管协议的修订内容

章节	原文内容	修订后内容
一、基金托管协议当事人	<p>法定代表人：凌富华</p> <p>注册资本：人民币 2.5 亿元</p>	<p>法定代表人：刘岩</p> <p>注册资本：人民币 5.102 亿元</p>
	<p>办公地址：上海市长宁区仙霞路 18 号（邮政编码：200336）</p> <p>法定代表人：牛锡明</p> <p>经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买</p>	<p>法定代表人：彭纯</p>

	<p>卖政府债券、金融债券； 从事同业拆借； 买卖、 代理买卖外汇； 从事银 行卡业务； 提供信用证 服务及担保； 代理收付 款项业务； 提供保管箱 服务； 经国务院银行业 监督管理机构批准的其他 业务； 经营结汇、售 汇业务。</p>	
<p>二、基金托管 协议的依据、 目的、原则</p>	<p>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》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《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》）、《金鹰添盈纯债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。</p>	<p>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》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《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》”）、《金鹰添盈纯债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。</p>
<p>三、基金托管</p>	<p>（一）（1）</p>	<p>（一）（1）</p>

人对基金管理人的业务监督和核查	<p>本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%；持有现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不得低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%；持有现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不得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>(2) 2)</p> <p>本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不得低于基金资产净值的 5%；</p>	<p>(2) 2)</p> <p>本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不得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>无</p>	<p>增加：</p> <p>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%。</p> <p>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。</p> <p>14) 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</p>

	<p>因证券市场波动、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，基金管理人应当在相关证券可上市交易之日起的 10 个交易日内进行调整（除 9）外）。法律法规另有规定的，从其规定。</p>	<p>致；</p> <p>因证券市场波动、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，基金管理人应当在相关证券可上市交易之日起的 10 个交易日内进行调整（除 2）、9）、13）、14）外）。法律法规另有规定的，从其规定。</p>
<p>十、基金信息披露</p>	<p>无</p>	<p>增加：</p> <p>（三）暂停或延迟信息披露的情形</p> <p>.....</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的；</p>