

关于泰信周期回报债券型证券投资基金修改基金合同和托管协议的公告

根据 2017 年 10 月 1 日起施行的《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》）第四十一条之规定，对已经成立的开放式基金，原基金合同内容不符合本规定的，应当在本规定施行之日起 6 个月内，修改基金合同并公告。根据《规定》等法律法规，经与基金托管人中信银行股份有限公司协商一致，泰信基金管理有限公司（以下简称本公司）对旗下泰信周期回报债券型证券投资基金（以下简称本基金）的《泰信周期回报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，具体修改内容见对照表。

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修改，对基金份额持有人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。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《泰信周期回报债券型证券投资基金托管协议》，本公司将于公告当日，将修订后的《基金合同》、《托管协议》登载于公司网站，并将上述基金招募说明书（更新）中对相应内容进行修改。

同时，依据《规定》基金管理人应当强化对投资者短期投资行为的管理，对除货币市场基金与交易型开放式指数基金以外的开放式基金，对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产对本基金赎回费进行调整，调整后的赎回费收取方式如下：

持有时间 赎回费率

7 天以下 1.5%

7 天（含 7 天）-1 年 0.1%

1 年（含 1 年）-2 年 0.05%

2 年以上（含 2 年） 0%

上述基金合同、托管协议的修订及赎回费相关规则调整等事宜自 2018 年 3 月 31 日生效。对于 2018 年 3 月 30 日 15:00 之前的赎回申请，适用调整前的赎回费规则；对于 2018 年 3 月 30 日 15:00 之后的赎回申请，适用调整后的赎回费规则。

投资者可访问泰信基金管理有限公司网站(<http://www.ftfund.com/>)或拨打全国免长途费的客户服务电话（400-888-5988）咨询相关情况。

特此公告。

泰信基金管理有限公司

二〇一八年三月二十四日

泰信周期回报债券型证券投资基金基金合同修改前后文对照表

章节 原文条款 修改后条款

内容 内容

第一部分前言和释义 前言

为保护基金投资者合法权益，明确《基金合同》当事人的权利与义务，规范泰信周期回报债券型证券投资基金（以下简称本基金或基金）运作，依照《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》）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 6 号《基金合同的内容与格式》及其他有关规定，在平等自愿、诚实信用、充分保护基金投资者及相关当事人的合法权益的原则基础上，特订立《泰信周期回报债券型证券投资基金基金合同》（以下简称本合同或《基金合同》）。前言

为保护基金投资者合法权益，明确《基金合同》当事人的权利与义务，规范泰信周期回报债券型证券投资基金（以下简称本基金或基金）运作，依照《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》）、《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》）、证券投资基金信息披露内容与格式准则第6号《基金合同的内容与格式》及其他有关规定，在平等自愿、诚实信用、充分保护基金投资者及相关当事人的合法权益的原则基础上，特订立《泰信周期回报债券型证券投资基金基金合同》（以下简称本合同或《基金合同》）。

释义

无 释义

《流动性风险管理规定》《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》

流动性受限资产由于法律法规、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

第六部分基金份额的申购与赎回 五、申购与赎回的数额限制

无 五、申购与赎回的数额限制

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，具体请参见招募说明书或相关公告。

六、申购费用和赎回费用

2、投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取，扣除用于市场推广、注册登记费和其他手续费后的余额归基金财产，赎回费归入基金财产的比例不得低于法律法规或中国证监会规定的比例下限。 六、申购费用和赎回费用

2、投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取，扣除用于市场推广、注册登记费和其他手续费后的余额归基金财产，赎回费归入基金财产的比例不得低于法律法规或中国证监会规定的比例下限。其中，对持续持有期少于7日的投资者收取不低于1.5%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。

九、拒绝或暂停申购的情形及处理方式

（5）基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔申购；

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停或拒绝基金投资者的申购申请的，申购款项将全额退还投资者。发生上述（1）到（4）、（6）项暂停申购情形时，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。 九、拒绝或暂停申购的情形及处理方式

（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，基金管理人应当暂停接受基金申购申请；

（6）基金管理人认为会有损于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的某笔申购；

（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。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停或拒绝基金投资者的申购申请的，申购款项将全额退还投资者。发生上述（1）到（5）、（8）项暂停申购情形时，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。

十、暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式

无 十、暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式

（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；

十一、巨额赎回的情形及处理方式

2、巨额赎回的处理方式

无 十一、巨额赎回的情形及处理方式

2、巨额赎回的处理方式

(3) 当发生巨额赎回且存在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 20%以上的情形时,基金管理人可以对该基金份额持有人超过前述约定比例的赎回申请进行延期办理,对于当日未延期办理的赎回申请,基金管理人根据上述(1)或(2)处理。当日未获受理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基金份额净值为基础计算赎回金额,以此类推;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。部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

第七部分基金合同当事人及权利义务 一、基金管理人

(一) 基金管理人简况

住所:上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 42 层

法定代表人:孟凡利

电话:021-50372168

传真:021-50372197

经营范围:发起设立基金、基金管理及中国证监会批准的其他业务

二、基金托管人

(一) 基金托管人简况

注册地址:北京东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

法定代表人:孔丹

成立时间:1987 年 4 月

注册资本:390.333 亿元人民币 一、基金管理人

(一) 基金管理人简况

住所:中国(上海)自由贸易试验区浦东南路 256 号 37 层

法定代表人:万众

电话:021-20899188

传真:021-20899008

经营范围:基金设立、基金业务管理及中国证监会批准的其他业务

二、基金托管人

(一) 基金托管人简况

注册地址:北京东城区朝阳门北大街 9 号

法定代表人:李庆萍

成立时间:1987 年 4 月 20 日

注册资本:489.35 亿元人民币

第十二部分基金的投资 二、投资范围

基金的投资组合比例为:投资于固定收益类资产的比例为基金资产的 80%95%;因参与一级市场新股申购或公开增发的股票、持有的可转债转股所形成的股票及其股票派发,投资可分离债券而产生的权证等非固定收益类资产(不含现金)不超过基金资产的 20%;在本基金的开放期间,现金或者到期日在一年以内的政府债券、央行票据等流动性良好的金融工具,不低于基金资产净值的 5%。 二、投资范围

基金的投资组合比例为:投资于固定收益类资产的比例为基金资产的 80%95%;因参与一级市场新股申购或公开增发的股票、持有的可转债转股所形成的股票及其股票派发,投资可分离债券而产生的权证等非固定收益类资产(不含现金)不超过基金资产的 20%;在本基金的开放期间,现金或者到期日在一年以内的政府债券、央行票据等流动性良好的金融工具,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。

(二) 投资组合限制

根据法律法规的规定及《基金合同》的约定,本基金投资组合遵循以下投资限制:

1、投资于固定收益类资产的比例为基金资产的 80%95%;,因参与一级市场新股申购或公开增发的股票、持有的可转债转股所形成的股票及其股票派发,投资可分离债券而产生的权证等非固定收益类资产(不含现金)不超过基金资产的 20%;在本基金的开放期间,现金或者到期日在一年以内的政府债券、央行票据等流动性良好的金融工具,不低于基金资产净值的 5%。

由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内，但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。

(二) 投资组合限制

根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金投资组合遵循以下投资限制：

- 1、投资于固定收益类资产的比例为基金资产的 80%95%；因参与一级市场新股申购或公开增发的股票、持有的可转债转股所形成的股票及其股票派发，投资可分离债券而产生的权证等非固定收益类资产（不含现金）不超过基金资产的 20%；
- 2、在本基金的开放期间，现金或者到期日在一年以内的政府债券、央行票据等流动性良好的金融工具，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；
- 7、在本基金的开放期间，本基金与由本基金管理人管理的其他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%；在本基金的开放期间，本基金与由本基金管理人管理的其他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%；封闭期不受此限；
- 8、在本基金的开放期间，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；
- 9、在本基金的开放期间，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；

由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内，但除上述第 2、8、9 项外，基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。

第十四部分基金资产估值 七、暂停估值的情形

- 3、中国证监会认定的其他情形。 七、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，基金管理人应当暂停基金估值；
- 4、法律法规、中国证监会认定的其他情形。

第十八部分基金的信息披露 五、公开披露的基金信息公开披露的基金信息包括：

- (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

五、公开披露的基金信息公开披露的基金信息包括：

- (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

本基金持续运作过程中，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。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。

(七) 临时报告

无 (七) 临时报告

- 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重大事项时；

章节 原文条款 修改后条款

内容 内容

一、基金托管协议当事人 (一) 基金管理人

住所：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 42 层

法定代表人：孟凡利

经营范围：发起设立基金、基金管理及中国证监会批准的其他业务

电话：021-50372168 传真：021-50372197

(二) 基金托管人

住所：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

法定代表人：孔丹

成立时间：1987 年 4 月 7 日

注册资本：叁佰玖拾亿叁仟叁佰叁拾万元人民币 (一) 基金管理人

住所：中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号 37 层

法定代表人：万众

经营范围：基金设立、基金业务管理及中国证监会批准的其他业务

电话：021-20899188

传真：021-20899008

(二) 基金托管人

住所：北京市东城区朝阳门北大街 9 号

法定代表人：李庆萍

成立时间：1987 年 4 月 20 日

注册资本：489.35 亿元人民币

二、基金托管协议的依据、目的和原则 订立本协议的依据是《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》）、《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〉》、《泰信周期回报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。 订立本协议的依据是《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》、《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〉》、《泰信周期回报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。

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

2、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投融资比例进行监督：

(1) 按法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金的投资资产配置比例为：

投资于固定收益类资产的比例为基金资产的 80%95%；因参与一级市场新股申购或公开增发的股票、持有的可转债转股所形成的股票及其股票派发，投资可分离债券而产生的权证等非固定收益类资产（不含现金）不超过基金资产的 20%；在本基金的开放期间，现金或者到期日在一年以内的政府债券、央行票据等流动性良好的金融工具，不低于基金资产净值的 5%。 (一) 基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

2、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投融资比例进行监督：

(1) 按法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金的投资资产配置比例为：

投资于固定收益类资产的比例为基金资产的 80%95%；因参与一级市场新股申购或公开增发的股票、持有的可转债转股所形成的股票及其股票派发，投资可分离债券而产生的权证等非固定收益类资产（不含现金）不超过基金资产的 20%；在本基金的开放期间，现金或者到期日在一年以内的政府债券、央行票据等流动性良好的金融工具，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。

(2) 根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金投资组合遵循以下投资限制：

1、投资于固定收益类资产的比例为基金资产的 80%95%；，因参与一级市场新股申购或公开增发的股票、持有的可转债转股所形成的股票及其股票派发，投资可分离债券而产生的权证等非固定收益类资产（不含现金）不超过基金资产的 20%；在本基金的开放期间，现金或者到期日在一年以内的政府债券、央行票据等流动性良好的金融工具，不低于基金资产净值的 5%。

(2) 根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金投资组合遵循以下投资限制：

1、投资于固定收益类资产的比例为基金资产的 80%95%；因参与一级市场新股申购或公开增发的股票、持有的可转债转股所形成的股票及其股票派发，投资可分离债券而产生的权证等非固定收益类资产（不含现金）不超过基金资产的 20%；

2、在本基金的开放期间，现金或者到期日在一年以内的政府债券、央行票据等流动性良好的金融工具，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；

7、在本基金的开放期间，本基金与由本基金管理人管理的其他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%；在本基金的开放期间，本基金与由本基金管理人管理的其他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%；

8、在本基金的开放期间，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；

9、在本基金的开放期间，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；

（3）法规允许的基金投资比例调整期限

由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例，不在限制之内，但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到规定的投资比例限制要求。法律法规另有规定的从其规定。（3）法规允许的基金投资比例调整期限

由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例，不在限制之内，但除上述（2）中第 2、8、9 项外，基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到规定的投资比例限制要求。法律法规另有规定的从其规定。

十、信息披露 （三）暂停或延迟信息披露的情形

无 （三）暂停或延迟信息披露的情形

3、《基金合同》约定的暂停估值的情形；