

东吴基金管理有限公司关于修改东吴增利债券型证券投资基金基金合同、托管协议的公告

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《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》”）等法律法规和《东吴增利债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”或“《基金合同》”）的有关规定，为保护投资者利益，东吴基金管理有限公司（以下简称“本公司”）经与基金托管人中信银行股份有限公司协商一致并报中国证券监督管理委员会上海监管局备案，对东吴增利债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金合同、托管协议相关内容进行修订。

现将具体事项公告如下：

一、基金合同的修订内容

根据 2017 年 10 月 1 日起实施的《流动性风险管理规定》，本公司对本基金基金合同和托管协议的相关内容进行了修订，具体修改内容请见附件修改前后条款对照表。本次修订是因相应的法律法规发生变动而进行的，不需召开基金份额持有人大会。本公司已就修订内容与基金托管人中信银行股份有限公司协商一致，并报中国证券监督管理委员会上海监管局备案。基金合同和托管协议的具体修订内容详见附件。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、重要提示

- 1、本次修改遵照法律法规、中国证监会的相关规定和基金合同的约定执行，可不经基金份额持有人大会表决。
- 2、本基金管理人将在指定媒介上公布经修改后的基金合同和托管协议。本基金管理人将在更新基金招募说明书时，对上述相关内容进行相应修订。
- 3、根据《流动性风险管理规定》的规定及基金合同的约定，本基金管理人将对本基金的赎回费率进行调整，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；对持续持有期不少于 7 日的投资者，仍按照原定的赎回费率标准收取。上述基金赎回费率的调整亦将于 2018 年 3 月 31 日起生效。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。
- 4、投资者可登录本基金管理人网站（www.scfund.com.cn）或拨打本基金管理人的客户服务电话

(400-821-0588、021-50509666) 进行咨询、查询。

风险提示：本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈

利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，敬请投资人认真阅读基金的相

关法律文件，并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。

东吴基金管理有限公司

二〇一八年三月二十六日

附件 1:《东吴增利债券型证券投资基金基金合同》修改前后条款对照表

附件 2:《东吴增利债券型证券投资基金托管协议》修改前后条款对照表

附件 1:《东吴增利债券型证券投资基金基金合同》修改前后条款对照表

章节 原表述 修改后表述

第一部分：前

言和释义

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，规范东吴增利债券型证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）运作，依照…《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，…

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，规范东吴增利债券型证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）运作，依照…《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》、《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》”）及其他有关规定，…

第一部分：前

言和释义

增加《流动性风险管理规定》的释义：

《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》

第一部分：前

言和释义

增加流动性受限资产的释义：

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

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

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告；

第六部分：基

金份额的申

购与赎回

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%的赎回费并全额计入基金财产。

第六部分：基

金份额的申

购与赎回

九、拒绝或暂停申购的情形及处理方式

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

.....

（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，基金管理人应当暂停接受基金申购申请；

（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数的比例达到或者超过基金份额总数的50%，或者有可能导致投资者变相规避前述50%比例要求的情形；

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。

第六部分：基金份额的申购与赎回

十、暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式

(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，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请；

第六部分：基金份额的申购与赎回

十一、巨额赎回的情形及处理方式增加以下条款：

(3) 如发生单个开放日内单个基金份额持有人申请赎回的基金份额占前一开放日基金总份额的比例超过 20%时，本基金管理人可以对该单个基金份额持有人超过前述约定比例的赎回申请实施延期赎回。

对该单个基金份额持有人不超过前述比例的赎回申请，与当日其他赎回申请一起，按上述“(1) 全额赎回”或“(2) 部分延期赎回”方式处理。如下一开放日，该单一基金份额持有人剩余未赎回部分仍旧超出前述比例约定的，继续按前述规则处理，直至该单一基金份额持有人单个开放日内申请赎回的基金份额占前一开放日基金总份额的比例低于前述比例。

在不违反法律法规的前提下，基金管理人在履行适当程序后，有权根据当时市场环境调整前述比例及处理规则，并在指定媒介上进行公告。

第七部分 基金合同当事人及权利义务

一、基金管理人

法定代表人：徐建平

一、基金管理人

法定代表人：王炯

第十二部分：

基金的投资

二、投资范围

本基金为债券型基金，投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%，其中，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%。

二、投资范围

本基金为债券型基金，投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%，其中，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。

第十二部分：

基金的投资

五、投资限制

4、本基金投资于债券类资产（包括含权债券）的比例不低于基金资产净值的 80%，投资于股票等权益类证券的比例不超过基金资产净值的 20%，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%；

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价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。

五、投资限制

4、本基金投资于债券类资产（包括含权债券）的比例不低于基金资产净值的 80%，投资于股票等权益类证券的比例不超过基金资产净值的 20%，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；

13、 本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）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%；本基金管理人管理的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%；

14、 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；

15、 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 4 项中“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%”及第 9、14、15 项外，因证券市场波动、、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价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。

第十四 部分：

基金资产估

值

七、暂停估值的情形增加以下条款：

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后，基金管理人应当暂停基金估值；

第十八部分：

基金的信息

披露

五、公开披露的基金信息

（七）临时报告

26、中国证监会规定的其他事项。

五、公开披露的基金信息

（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……

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，为保障其他投资者利益，基金管理人至少应当在定期报告“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有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

本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告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

（七）临时报告

26、发生涉及本基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；

27、中国证监会规定和基金合同约定的其他事项。

附件 2：《东吴增利债券型证券投资基金托管协议》修改前后条款对照表
章节 原文条款 修改后条款

一、基金托管协议

当事人

（一）基金管

理人

法定代表人：徐建平 法定代表人:王炯

二、基金托管协议

的依据、目的和原

则

（一）订立托

管协议的依据

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〉》、……

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〉》、……

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不低于基金资产的 80%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金不直接从二级市场买入股票或权证等权益类资产。本基金投资于非固定收益类资产的比例不高于基金资产的 20%。

.....

(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：

.....

4) 本基金投资于债券类资产（包括含权债券）的比例不低于基金资产净值的 80%，投资于股票等权益类证券的比例不超过基金资产净值的 20%，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%；

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价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。

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不低于基金资产的 80%，其中，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。本基金不直接从二级市场买入股票或权证等权益类资产。本基金投资于非固定收益类资产的比例不高于基金资产的 20%。

.....

(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：

.....

4) 本基金投资于债券类资产（包括含权债券）的比例不低于基金资产净值的 80%，投资于股票等权益类证券的比例不超过基金资产净值的 20%，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；

13) 本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 30%；

14) 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；

15) 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 4) 中“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%”及 9)、14)、15) 项外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价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。