

鑫元基金管理有限公司关于鑫元合享分级债券型 证券投资基金修改基金合同的公告

根据中国证监会发布的自 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“《流动性风险管理规定》”），对已经成立或已获核准但尚未完成募集的开放式基金，原基金合同内容不符合《流动性风险管理规定》的，应当在《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》及鑫元合享分级债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）基金合同的有关规定，经与基金托管人协商一致并报监管机构备案，鑫元基金管理有限公司（以下简称“本公司”）决定对本基金基金合同进行修订，并对赎回费相关规则进行调整。现将相关事宜公告如下：

一、基金合同修订情况

本基金基金合同的具体修订内容详见附件《<鑫元合享分级债券型证券投资基金基金合同>修改前后文对照表》。本次修订属于基金合同约定的基金管理人与基金托管人可以协商一致变更基金合同的事项，并已履行规定程序，符合相关法律法规及基金合同的规定。本次修订自 2018 年 3 月 31 日起生效。

二、基金赎回费相关规则调整

鉴于《流动性风险管理规定》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”，自 2018 年 3 月 31 日本次修订生效之日起，本公司将对持续持有本基金基金份额少于 7 日的投资者收取 1.5% 的赎回费，并全部计入基金财产。届时本基金的赎回费调整为：

1. 本基金在过渡期内的赎回费用

本基金在过渡期内，合享 A 与合享 B 对持续持有期少于 7 日的投资者收取 1.5% 的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产，除此之外不收取赎回费用。

2. 本基金合享 A 份额在其分级运作周期内的赎回开放日的赎回费用

在分级运作周期内，在分级运作周期内，合享 A 对持续持有期少于 7 日的投资者收取 1.5% 的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产，除此之外不收取赎回费。

3. 本基金在转型为“鑫元合享纯债债券型证券投资基金”后的赎回费用本基金在转型后，对 A、C 类份额收取赎回费用。本基金赎回费率按基金份额持有人持有基金份额的时间不同设定赎回费率，具体 A 类份额的赎回费率如下：

■

赎回份额持有时间的计算，以该份额在登记机构的登记日开始计算。0.5 年为 181 天，1 年为 365 天。

具体 C 类份额的赎回费率如下：

■

本基金的赎回费用由赎回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。本基金将对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产；对持续持有期长于 7 日的投资者收取的赎回费，不低于赎回费总额的 25% 应归基金财产，其余用于支付登记费和其他手续费等。

三、其他需要提示的事项

本基金的托管协议也据此相应修订，修订自 2018 年 3 月 31 日起生效。

更新后的《基金合同》及《托管协议》届时可详见基金管理人官网。

本公司将于下次更新招募说明书时同步更新相关内容。

投资者可以通过以下途径了解或咨询相关情况：

鑫元基金管理有限公司

网站：www.xyamc.com

客服电话：400-606-6188

四、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。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现，基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。本公司提醒投资者在投资前应认真阅读基金的基金合同、招募说明书等文件。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

鑫元基金管理有限公司

二〇一八年三月二十三日

附件：《鑫元合享分级债券型证券投资基金基金合同》修改前后文对照表

章节

修改前

修改后

内容

内容

第一部分 前言

一、订立本基金合同的目的、依据和原则

一、订立本基金合同的目的、依据和原则

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。

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。

第二部分 释义

无

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

无

64、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）、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

第五部分 基金过渡期的安排 五、过渡期申购与赎回的费用

五、过渡期申购与赎回的费用

3、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。本基金将对持续持有期少于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；除此

之外的赎回费率以及赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未计入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

六、过渡期申购和赎回的数量限制

六、过渡期申购和赎回的数量限制

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。具体规定请参见招募说明书或相关公告。

七、过渡期拒绝或暂停申购、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形及处理

七、过

渡期拒绝或暂停申购、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形及处理

1、发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人对合享 A、合享 B 的申购申请：

1、发生下列情况

时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人对合享 A、合享 B 的申购申请：

(7) 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形；

(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；

(8) 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。

(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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施；

发生上述情况之一且基金管理人决定暂停申购的，申购款项将全额退还投资者。发生上述 (1) 到 (7) 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，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。

) 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形；

(10) 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。

发生上述情况之一且基金管

理人决定暂停申购的，申购款项将全额退还投资者。发生上述 (1) - (6)、(8)、

(9) 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，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。

2、暂停赎回或延缓支付合享 A、合享 B 赎回款项的情形

2、暂停赎回或延缓支付合享 A、合享 B 赎回款项的情形

(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，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施；

八、过渡期合享 A、合享 B 巨额赎回的情形及处理方式

八、过渡期合享 A、合享 B 巨额赎回的情形及处理方式

2、合享 A、合享 B 巨额赎回的处理方式

2、合享 A、合享 B 巨额赎回的处理方式

(3) 在过渡期内基金发生巨

额赎回，且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一工作日基金总份额的 20%，基金管理人有权先行对该单个基金份额持有人超出 20%以上的部分赎回申请实施延期办理。对于延期办理的部分，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；选择延期赎回的，将自动转入下一个赎回开放日继续赎回，无优先权并

以下一赎回开放日的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。

如延期办理期限超过赎回开放日，则赎回开放日相应延长、申购开放日相应延后，即过渡期相应延长。延长的赎回开放日内不接受新的赎回申请，即基金管理人仅为原赎回开放日内因提交赎回申请超过基金总份额 20%以上而被延期办理赎回的单个基金份额持有人办理赎回业务。

第九部分 基金份额的申购与赎回 一、分级运作周期内合享 A 的申购与赎回

一、分级运作周期内合享 A 的申购与赎回

(五) 申购和赎回的数量限制

(五) 申购和赎回的数量限制

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。具体规定请参见招募说明书或相关公告。

（六）申购和赎回的价格、费用及其用途

（六）申购和赎回的价格、费用及其用途

4、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。本基金将对持续持有期少于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；除此之外的赎回费率以及赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未计入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

（七）拒绝或暂停申购合享 A 的情形

（七）拒绝或暂停申购合享 A 的情形

7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形；

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。

8、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。

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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。

发生上述情况之一且基金管理人决定暂停申购的，申购款项将全额退还投资者。发生上述 1 到 7 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，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拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在上述情况消除时，基金管理人应及时恢复申购。

9、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形；

10、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。

发生上述情况之一且基金管理人决定暂停申购的，申购款项将全额退还投资者。发生上述 1-6、8、9 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，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拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在上述情况消除时，基金管理人应及时恢复申购。

（八）暂停赎回合享 A 或延缓支付合享 A 赎回款项的情形

（八）暂停赎回合享 A 或延缓支付合享 A 赎回款项的情形

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，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。

（九）巨额赎回的情形及处理方式

（九）巨额赎回的情形及处理方式

2、巨额赎回的处理方式

2、巨额赎回的处理方式

（3）在开放日内（指合享

A 的赎回开放日），若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一工作日基金总份额的 20%，基金管理人有权先行对该单个基金份额持有人超出 20% 以上的部分赎回申请实施延期办理。对于延期办理的部分，基金管理人在开放日（指合享 A 的赎回开放日）外按办理日当日净值为该该单个份额持有人继续办理延期的赎回申请，直至全部赎回为止。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）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。

第九部分 基金份额的申购与赎回 三、本基金转型为“鑫元合享纯债债券型证券投资基金”后的申购和赎回

三、本基金转型为“鑫元合享纯债债券型证券投资基金”后的申购和赎回

(五) 申购和赎回的数量限制

(五) 申购和赎回的数量限制

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。具体规定请参见招募说明书或相关公告。

(六) 申购和赎回的价格、费用及其用途

(六) 申购和赎回的价格、费用及其用途

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的收取。不低于赎回费总额的 25%应归基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。

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。本基金将对持续持有期少于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；对持续持有期长于7日的投资者收取的赎回费，不低于赎回费总额的25%应归基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。

(七) 拒绝或暂停申购的情形

(七) 拒绝或暂停申购的情形

6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形；

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达到或者超过50%，或者变相规避50%集中度的情形时。

7、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。

7、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暂停接受基金申购申请的措施。

发生上述情况之一且基金管理人决定暂停申购的，申购款项将全额退还投资者。发生上述 1 到 6 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，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。

8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形；

9、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。

发生上述情况之一且基金管理人决定暂停申购的，申购款项将全额退还投资者。发生上述 1-5、7、8 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，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。

(八) 暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

(八) 暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

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。

（九）巨额赎回的情形及处理方式

（九）巨额赎回的情形及处理方式

2、巨额赎回的处理方式

2、巨额赎回的处理方式

（3）若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 20%，基金管理人有权先行对该单个基金份额持有人超出 20%以上的部分赎回申请实施延期办理。对于延期办理的部分，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；选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，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，直到全部赎回为止。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）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。

第十部分 基金合同当事人及权利义务 一、基金管理人

一、基金管理人

(一) 基金管理人简况

(一) 基金管理人简况

名称：鑫元基金管理有限公司

名称：鑫元基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区富城路 99 号震旦大厦 31 楼

住所：中国（上海）自由贸易试验区浦东大道

1200 号 2 层 217 室

法定代表人：束行农

法定代表人：肖炎

.....

.....

注册资本：人民币 2 亿元

注册资本：人民币 17 亿元

.....

.....

二、基金托管人

二、基金托管人

(一) 基金托管人简况

(一) 基金托管人简况

名称：中国光大银行股份有限公司

名称：中国光大银行股份有限公司

住所：北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心

住所：北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中

国光大中心

法定代表人：唐双宁

法定代表人：唐双宁

成立时间：1992 年 8 月 18 日

成立时间：1992 年 6 月 18 日

批准设立机关和批准设立文号：国务院、国函[1992]7 号

批准设立机关和批准设立文号：国务院、国函

[1992]7 号

组织形式：股份有限公司

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 404.3479 亿元

注册资本：人民币 466.79095 亿元

存续期间：持续经营

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：证监会基金字[2002]75 号

基金托管资格批文及文号：证监会基金字[2002]75 号

第十五部分

二、投资范围

二、投资范围

基金的投

资

.....

.....

基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%（在分级运作存续期内，在本基金分级运作周期内任一开放日、任一开放日前十个工作日和后十个工作日以及过渡期开始前十个工作日和结束后十个工作日，本基金可不受上述限制）；在每个分级运作周期内的每个开放日，现金或者到期日在一年内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。

基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%（在分级运作存续期内，在本基金分级运作周期内任一开放日、任一开放日前十个工作日和后十个工作日以及过渡期开始前十个工作日和结束后十个工作日，本基金可不受上述限制）；在每个分级运作周期内的每个开放日，现金或者到期日在一年内的政府债券的投资比例合计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。

四、投资限制

四、投资限制

1、组合限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

基金的投资组合应遵循以下限制：

(2) 在任一分级运作周期内的每个开放日，现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资合计不低于基金资产净值的 5%；

(2)

在任一分级运作周期内的每个开放日，现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资合计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；

.....

.....

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 10 个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

(5) 在开放期或过渡期内，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%；封闭期内不受此限；因证券市场波动、证券停牌、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，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

.....

(13) 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；

.....

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，除上述第(2)、(5)、(10)、(13)项外，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

第十七部分基金资产估值

六、暂停估值的情形

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，应当暂停基金估值；

第二十一部分

五、公开披露的基金信息

五、公开披露的基金信息

基金的信息披露

(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

(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

.....

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。

报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 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。

(七) 临时报告

(七) 临时报告

32、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；