

# 关于金鹰元丰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

金鹰元丰保本混合型证券投资基金经中国证券监督管理委员会证监许可[2012]1537号和《关于金鹰元丰保本混合型证券投资基金募集时间安排的确认函》(基金部函[2012]1131号)核准募集,基金合同于2013年1月30日正式生效。金鹰元丰保本混合型证券投资基金第三个保本周期届满后,因未能符合保本基金存续条件,已按照《金鹰元丰保本混合型证券投资基金基金合同》的约定于2017年9月20日正式转型为金鹰元丰债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)。

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,经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致,并报中国证监会备案,金鹰基金管理有限公司决定于2017年11月28日起修改金鹰元丰债券型证券投资基金基金合同(以下简称《基金合同》)及金鹰元丰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《金鹰元丰债券型证券投资基金基金合同修改对照表》、附件2《金鹰元丰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](http://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：《金鹰元丰债券型证券投资基金基金合同修改对照表》

附件2：《金鹰元丰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

2017年11月28日

附件 1：金鹰元丰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
<p>第一部分 前言</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>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>
<p>第二部分 释义</p>	<p>无</p>	<p>增加：</p> <p><b>48、《流动性风险管理规定》：</b>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><b>49、流动性受限资产：</b>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</p>

		<p>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>50、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公平对待。</p>
<p>第六部分 基金份额的申 购与赎回</p>	<p>无</p>	<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</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。不</p>

	<p>有人赎回基金份额时收取。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。</p>	<p>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。其中对于持续持有期少于7日的投资者收取不低于<b>1.5%</b>的赎回费并全额计入基金财产。</p>
	<p>无</p>	<p>增加： 六、7、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增加摆动定价机制。</p>
		<p>七、拒绝或暂停申购的情形增加： 7、当前一估值日基金资产净值<b>50%</b>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。 8、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。 (最后一段修改为：) 发生上述第1、2、3、5、7、9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体上刊</p>

		<p>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： 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申购赎回申请的措施。</p>
		<p>九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 增加： (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%的赎回申请的情形下，基金管理人应当延期办理赎回申请。基金管理人在当日接受该基金份额持有人的全部赎回的比例不低于上一开放日基金总份额 25%的前提下，对该持有人其余赎回申请进行延期办理，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</p>

		日未获受理的部分赎回申请将被撤销。
第十二部分 基金的投资	<p>二、……</p> <p>本基金对固定收益类证券品种的投资比例不低于基金资产的 80%；对股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，其中，权证投资的比例范围占基金资产净值的 0~3%。为维持投资组合的流动性，本基金持有现金和到期日不超过一年的政府债券不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>修改为：</p> <p>二、……</p> <p>本基金对固定收益类证券品种的投资比例不低于基金资产的 80%；对股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，其中，权证投资的比例范围占基金资产净值的 0~3%。为维持投资组合的流动性，本基金持有现金和到期日不超过一年的政府债券不低于基金资产净值的 5%。<b>其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</b></p>
	<p>六、1、（2）保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券；</p>	<p>修改为：</p> <p>六、1、（2）保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，<b>其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</b></p>
	<p>无</p>	<p>六、投资限制 1、组合限制 中增加：</p> <p><b>（5）</b> 本基金管理人管理的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</p>

		<p>上市公司可流通股票的 15%;</p> <p>(6) 本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 30%;</p> <p>(7) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 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>(20) 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、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。</p>	<p>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,除上述第(2)、(7)、(16)、(20)条规定的情形外,基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。</p>



第十四部分  
基金资产估值

三、估值方法

1、(1) 交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

(2) 交易所上市交易或挂牌转让的不含权和含权固定收益品种按估值日第三方估值机构提供的相应品种估值净价估值，如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品

三、估值方法

1 (1) 交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后发生了影响公允价值计量的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

(2) 交易所上市交易或挂牌转让的不含权和含权固定收益品种按估值日第三方估值机构提供的相应品种估值净价估值，如最近交易日后发生了影响公允价值计量的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，采用估值技术确定公允价值；

(3) 交易所上市交易的可转换债券、可交换债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后发生了影响公允价值

	<p>种的现行市价及重大变化因素，采用估值技术确定公允价值；</p> <p>(3) 交易所上市交易的可转换债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；</p>	<p>计量的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；</p>
	<p>2、(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期</p>	<p>2、(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票、非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>

	<p>的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>	
	<p>无</p>	<p>六、暂停估值的情形 增加：  <b>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；</b></p>
<p>第十八部分 基金的信息披露</p>	<p>五（六）……      报告期内出现单一投资者持有基金份额比例超过 <b>20%</b>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“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。</p>	<p>修改为：      五（六）……      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。      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 <b>20%</b>的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在在基金定期报告“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>
	<p>无</p>	<p>五、公开披露的基金信息      （七）临时报告 增加：  <b>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</b></p>

		<p>者赎回等重大事项；</p> <p>六、暂停或延迟信息披露的情形 增加：</p> <p>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基金估值的；</p>
--	--	--

附件 2：金鹰元丰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
二、基金托管协议的依据、目的、原则	<p>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》）、《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》）、《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〉》、《金鹰</p>	<p>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》）、《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》）、《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〉》、《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》”）、《金鹰元丰债券型证券投资基金基金合同》（以下简称</p>

	元丰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。	《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	<p>(一) 2、</p> <p>本基金对固定收益类证券品种的投资比例不低于基金资产的 80%;对股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%,其中,权证投资的比例范围占基金资产净值的 0~3%。为维持投资组合的流动性,本基金持有现金和到期日不超过一年的政府债券不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>(一) 2、</p> <p>本基金对固定收益类证券品种的投资比例不低于基金资产的 80%;对股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%,其中,权证投资的比例范围占基金资产净值的 0~3%。为维持投资组合的流动性,本基金持有现金和到期日不超过一年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、存出保证金及应收申购款等。</p>
	<p>2、(2) b、</p> <p>保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券;</p>	<p>2、(2) b、</p> <p>保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等;</p>
	无	<p>增加:</p> <p>e、本基金管理人管理且由本基金托管人托管的全部开放式基</p>

		<p>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%；</p> <p>f、本基金管理人管理且由本基金托管人托管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%。</p> <p>g、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>由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动、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。</p>	<p>由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动、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 b、g、p 条规定的情形外，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。</p>
<p>八、基金资产净值计算和会计核算</p>	<p>(二) 2、(1)</p> <p>①交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易</p>	<p>(二) 2、(1)</p> <p>①交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后未发生影响公允价值计量</p>

<p>的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。</p> <p>②交易所上市交易或挂牌转让的不含权和含权固定收益品种按估值日第三方估值机构提供的相应品种估值净价估值，如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，采用估值技术确定公允价值；</p> <p>③交易所上市交易的可转换债券按估值日</p>	<p>的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后发生了影响公允价值计量的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。</p> <p>②交易所上市交易或挂牌转让的不含权和含权固定收益品种按估值日第三方估值机构提供的相应品种估值净价估值，如最近交易日后发生了影响公允价值计量的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，采用估值技术确定公允价值；</p> <p>③交易所上市交易的可转换债券、可交换债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后发生了影响公允价值计量的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；</p>
---	--

	<p>收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；</p>	
	<p>③首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>	<p>③首次公开发行有明确锁定期的股票、非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>
<p>十、基金信息</p>	<p>无</p>	<p>增加：</p>



披露		<p>(三) 暂停或延迟信息披露的情形</p> <p>.....</p> <p>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基金估值的；</p>
----	--	--