关于金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）

修改基金合同及托管协议的公告

一、本次修改的基本情况

金鹰元盛分级债券型发起式证券投资基金经中国证券监督管理委员会证监许可[2013]13号核准募集，基金合同于2013年5月2日正式生效。根据《基金合同》的有关规定，金鹰元盛分级债券型发起式证券投资基金在基金合同生效2年期届满，转换为上市开放式基金（LOF）,更名为金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）（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建设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日起修改金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）基金合同（以下简称《基金合同》）及金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）托管协议（以下简称《托管协议》），具体修改内容请详见附件1《金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）基金合同修改对照表》、附件2《金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）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：《金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）基金合同修改对照表》

附件2：《金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）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：金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）基金合同的修订内容

章节	原文内容	修订后内容
一、 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》”)、《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》”)、《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。
二、 释义	无	增加： **80、《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** **81、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 **82、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。**
八、 基金份额的申购与赎回	无	（一）5.申购和赎回的金额 增加： **（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。**
	6、元盛 A 申购和赎回的价格、费用及其用途 （4）元盛A不收取申购费用~~、赎回费用~~。	6.元盛 A 申购和赎回的价格、费用及其用途 修改为： （4）元盛 A 不收取申购费用。**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。
	无	增加： **6.（5）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。**
		8.拒绝或暂停申购的情形 增加： **（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）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。** **（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（1）、（2）、（3）、（5）、（7）、（9）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。
		增加： **9. （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。**
		10.巨额赎回的认定　增加： **（3）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。对于该单个持有人未超过上一开放日基金总份额 25%的赎回申请，与当日其他赎回申请一起，按照上述（1）、（2）方式处理。当日未获受理的赎回申请将于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。**
	无	（二）转型为上市开放式基金

		（LOF）后的申购与赎回 5.申购和赎回的数额限制　增加： **（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。**
	6.　（3）上市开放式基金（LOF）的申购、赎回费用 修改为： 上市开放式基金（LOF）C 类基金份额不收取申购费用，E 类基金份额收取申购费用。两类份额赎回费用由基金赎回人承担。基金的赎回费率最高不超过 5%。	6.　（3）上市开放式基金（LOF）的申购、赎回费用 修改为： 上市开放式基金（LOF）C 类基金份额不收取申购费用，E 类基金份额收取申购费用。两类份额赎回费用由基金赎回人承担。基金的赎回费率最高不超过 5%。**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。** 增加： **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。**
		8.拒绝或暂停申购的情形及处理方式 增加： **（5）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。 **（6）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。** **（7）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：） 发生上述情形之一的，申购款项将全额退还投资者。发生上述**（1）（2）、（3）、（4）、（6）、（8）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和基金管理人网站上刊登暂停申购公告。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，并依照有关规定在至少一家指定媒体及基金管理人网站上公告。
		增加： **9. （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。
		10.巨额赎回的处理方式　增加： **3）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。对于该单个持有人未超过上一开放日基金总份额25%的赎回申请，与当日其他赎回申请一起，按照上述1）、2）方式处理。当日未获受理的赎回申请将于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。**
十一、基金合同当事人及权利义务	（一）基金管理人 住所：~~广东省广州市天河区体育西路189号城建大厦22、23楼~~ 法定代表人：~~凌富华~~ 注册资本：~~2.5~~亿元	(一)基金管理人 住所：**广东省广州市南沙区海滨路171号11楼自编1101之一J79** 法定代表人：**刘岩** 注册资本：5.1020亿元
	(二)基金托管人	(二)基金托管人

	法定代表人：~~王洪章~~	法定代表人：**田国立**
十六、基金的投资	（二）…… 本基金对固定收益类金融工具的投资比例不低于基金资产的80%，其中中小企业私募债券的投资比例不超过基金资产的20%。为维持投资组合的流动性，元盛A的开放日或基金合同生效后2年期届满日之前的4个工作日起至元盛A的开放日（含）或基金合同生效后2年期届满日（含）止，以及本基金转型为金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）并开放申购赎回之后，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%；在其他时段，本基金持有现金和到期日不超过一年的政府债券可低于基金资产净值的5%。	修改为： （二）…… 本基金对固定收益类金融工具的投资比例不低于基金资产的80%，其中中小企业私募债券的投资比例不超过基金资产的20%。为维持投资组合的流动性，元盛A的开放日或基金合同生效后2年期届满日之前的4个工作日起至元盛A的开放日（含）或基金合同生效后2年期届满日（含）止，以及本基金转型为金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）并开放申购赎回之后，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%；在其他时段，本基金持有现金和到期日不超过一年的政府债券可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**。
	（六）、1、(6)本基金投资固定收益类金融工具的比例不低于基金资产的80%，其中对中小	修改为： （六）、1、(6)本基金投资固定收益类金融工具的比例不低于基金资产的80%，其中对中小企业私

	企业私募债券的投资比例不超过基金资产的20%；对股票、权证等权益类金融工具的投资比例不超过基金资产的20%；为维持投资组合的流动性，至少于元盛A的开放日或基金合同生效后2年期届满日前4个工作日起至元盛A的开放日（含）或基金合同生效后2年期届满日(含)止，以及本基金转型为金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）并开放申购赎回之后，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%；本基金转型前，在其他时段，本基金持有现金和到期日不超过一年的政府债券可低于基金资产净值的5%。	募债券的投资比例不超过基金资产的20%；对股票、权证等权益类金融工具的投资比例不超过基金资产的20%；为维持投资组合的流动性，至少于元盛A的开放日或基金合同生效后2年期届满日前4个工作日起至元盛A的开放日（含）或基金合同生效后 2 年期届满日（含）止，以及本基金转型为金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）并开放申购赎回之后，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%；本基金转型前，在其他时段，本基金持有现金和到期日不超过一年的政府债券可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**；
	无	（六）、1、增加 ： **（15）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，不得超过该上市公司可流通股票的15%；** **（16）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%； **（17）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%；** **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。** **（18）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；** （最后一段修改为：） 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（6）、（11）、（17）、（18）项规定的情况外**，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。
十八　基金资产估值	无	（六） 增加： **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；
二十二 基金的信息披露	无	（八） 增加： 7. 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。 8. 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有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。
	无	(九) 增加： 31. 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；

二、金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）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	（一）基金管理人	（一）基金管理人

协议当事人	注册地址：~~广东省珠海市吉大九洲大道东段商业银行大厦7楼16单元~~ 法定代表人：~~凌富华~~ 注册资本：~~2.5~~亿元	注册地址：**广东省广州市南沙区海滨路171号11楼自编1101之一J79** 法定代表人：**刘岩** 注册资本：**5.1020**亿元
	（二）基金托管人 法定代表人~~：王洪章~~	（二）基金托管人 法定代表人：**田国立**
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 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》”）等有关法律法规、基金合同及其他有关规定制订。	（一）订立托管协议的依据 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》”）**、《 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》”）**等有关法律法规、基金合同及其他有关规定制订。
	（二）（11）至少于元盛 A 的开放日或基金合同生效后 2 年期届满日前 4 个工作日起至元盛A的开放日（含）或基金合同生效后 2 年期届满日（含）止，以及本基金转型为金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）并开放申购赎回之后，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	（二）（11）至少于元盛 A 的开放日或基金合同生效后2年期届满日前4个工作日起至元盛A的开放日（含）或基金合同生效后2年期届满日（含）止，以及本基金转型为金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）并开放申购赎回之后，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%；在其他时段，本基金持有现金和到期日不超过一年的政府债券可低于基金资产净值的5%**，其中，现金不包括结算备付金、存出**

	5%；在其他时段，本基金持有现金和到期日不超过一年的政府债券可低于基金资产净值的5%。 (12)本基金持有的所有流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的~~30%~~；本基金持有的同一流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的10%；	**保证金、应收申购款等**。 (12)本基金持有的所有流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的**15%**；本基金持有的同一流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的10%；
	无	增加： **（14）本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的15%；** **（15）本基金管理人管理的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的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%；** **（16）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%；** **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。 **（17）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；** （最后一段修改为：） 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（8）、（11）、（16）、（17）项规定的情况外**，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。
八、基金资产净值计算和会计核算	无	增加： （四）（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；**
十、基金信息披露	无	增加： （三）1.（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；