

本公告乃重要檔，需要閣下及時垂注。若閣下對本公告之內容有任何疑問，應諮詢閣下的銀行經理、法律顧問、會計師或其他獨立財務顧問。中銀基金管理有限公司就本公告與刊發日期所載資料的準確性承擔全部責任，並在作出一切合理查詢後確認，盡其所知及所信，概無遺漏任何其他事實足以令該等文件的任何聲明產生誤導。

關於中銀收益混合型證券投資基金 修改基金合同、託管協議的公告

根據中國證監會2017年8月31日發佈的《公開募集開放式證券投資基金流動性風險管理規定》（以下簡稱：“《規定》”），對已經存續的開放式基金，原基金合同內容不符合《規定》的，應當在《規定》施行之日起6個月內予以調整。

根據《規定》等法律法規，經與基金託管人中國工商銀行股份有限公司協商一致，並報監管機構備案，中銀基金管理有限公司（以下簡稱：“本公司”）對旗下中銀收益混合型證券投資基金（以下簡稱：“本基金”）的《中銀收益混合型證券投資基金基金合同》（以下簡稱：“《基金合同》”）的相關條款進行修改，《中銀收益混合型證券投資基金託管協定》的相應部分一併修改。具體修改內容請見附件。

本公司將在本基金的更新招募說明書中，對上述內容進行相應調整。

上述修改系因相應的法律法規發生變動而進行的修改，且對基金份額持有人利益無實質性不利影響，並已履行了規定的程式，符合相關法律法規的規定及《基金合同》的約定。上述修改自本公告發佈之日起生效，但為不影響原有基金份額持有人的利益，對A類份額投資者贖回費率的調整將自2018年3月31日起生效，即該日起本基金將對持續持有期少於7日的A類份額投資者收取1.5%的贖回費。

特此公告

附件一：《中銀收益混合型證券投資基金基金合同》修改前後對照表

附件二：《中銀收益混合型證券投資基金託管協定》修改前後對照表

中銀基金管理有限公司

二〇一八年三月二十六日

如閣下對本公告的內容有任何疑問，請聯絡閣下的銀行或財務顧問，或與我們的香港代表「中銀香港資產管理有限公司」聯絡（地址：香港中環德輔道中 2 號 A 中國銀行大廈 5 樓）。

附件一：《中銀收益混合型證券投資基金基金合同》修改前後對照表

章節	修改前	修改後
第一部分 前言和釋義	前 言 為保護基金投資者合法權益，明確基金合同當事人的權利與義務，規範中銀收益混合基金（以下簡稱“本基金”或“基金”）運作，依照《中華人民共和國合同法》、《中華人民共和國證券投資基金法》（以下簡稱《基金法》）、《證券投資基金運作管理辦法》（以下簡稱《運作辦法》）、《證券投資基金銷售管理辦法》（以下簡稱《銷售辦法》）、《證券投資基金資訊披露管理辦法》（以下簡稱《資訊披露辦法》）及其他有關規定，在平等自願、誠實信用、充分保護基金投資者及相關當事人的合法權益的原則基礎上，特訂立《中銀收益混合型證券投資基金基金合同》（以下簡稱“本合同”或“《基金合同》”）。	前 言 為保護基金投資者合法權益，明確基金合同當事人的權利與義務，規範中銀收益混合基金（以下簡稱“本基金”或“基金”）運作，依照《中華人民共和國合同法》、《中華人民共和國證券投資基金法》（以下簡稱《基金法》）、《證券投資基金運作管理辦法》（以下簡稱《運作辦法》）、《證券投資基金銷售管理辦法》（以下簡稱《銷售辦法》）、<u>《證券投資基金資訊披露管理辦法》（以下簡稱《資訊披露辦法》）</u>、<u>《公開募集開放式證券投資基金流動性風險管理規定》（以下簡稱“《流動性風險管理規定》”）</u>及其他有關規定，在平等自願、誠實信用、充分保護基金投資者及相關當事人的合法權益的原則基礎上，特訂立《中銀收益混合型證券投資基金基金合同》（以下簡稱“本合同”或“《基金合同》”）。
第一部分 前言和釋義	前 言	前 言

義		新增： <u>本基金單一投資者持有基金份額數不得達到或超過基金份額總數的 50%，但在基金運作過程中因基金份額贖回等情形導致被動達到或超過 50%的除外。</u>
第一部分 前言和釋義	釋 義	釋 義 新增： <u>《流動性風險管理規定》 指《公開募集開放式證券投資基金流動性風險管理規定》</u> <u>擺動定價機制 指當開放式基金遭遇大額申購贖回時，通過調整基金份額淨值的方式，將基金調整投資組合的市場衝擊成本分配給實際申購、贖回的投資者，從而減少對存量基金份額持有人利益的不利影響，確保投資者的合法權益不受損害並得到公平對待</u> <u>流動性受限資產 指由於法律法規、監管、合同或操作障礙等原因無法以合理價格予以變現的資產，包括但不限於</u>

		<u>到期日在 10 個交易日以上的逆回購與銀行定期存款（含協定約定有條件提前支取的銀行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公開發行股票、資產支持證券、因發行人債務違約無法進行轉讓或交易的債券等</u>
第五部分 基金的申購與贖回	三、 申購與贖回的原則	三、 申購與贖回的原則 新增： <u>6、當發生大額申購或贖回情形時，基金管理人可以在履行適當程式後採用擺動定價機制，以確保基金估值的公平性。具體處理原則和操作規範須遵循相關法律法規以及監管部門、自律規則的規定。</u>
第五部分 基金的申購與贖回	五、 申購與贖回的數額限制	五、 申購與贖回的數額限制 新增： <u>4、當接受申購申請對存量基金份額持有人利益構成潛在重大不利影響時，基金管理人應當採取設定單一投資者申購金額上限或基金單日淨申購比例上限、拒絕大額申購、暫停基金申購等措施，切實保護存量基金份額持有人的合法權益。具體請參見相關規定。</u>

第五部分 基金的申 購與贖回	六、 申購費用和贖回費用 3、本基金申購費率最高不超過 5%，贖回費率最高不超過 5%。	六、 申購費用和贖回費用 3、本基金申購費率最高不超過 5%，贖回費率最高不超過 5%，<u>其中對於持續持有期少於 7 日的 A 類份額投資者收取不低於 1.5%的贖回費並全額計入基金財產。</u> 新增： <u>7、當發生大額申購或贖回情形時，基金管理人可以在履行適當程式後採用擺動定價機制，以確保基金估值的公平性。具體處理原則和操作規範須遵循相關法律法規以及監管部門、自律規則的規定。</u>
第五部分 基金的申 購與贖回	九、 拒絕或暫停申購的情形及處理方式 	九、 拒絕或暫停申購的情形及處理方式 新增： <u>（2）當前一估值日基金資產淨值 50%以上的資產出現無可參考的活躍市場價格且採用估值技術仍導致公允價值存在重大不確定性時，經與基金託管人協商確認後，基金管理人應當暫停接受投資人的申購申請；</u> <u>（8）基金管理人接受某筆或者某些申購申請有可能導致</u>

	發生上述情形之一且管理人決定拒絕申購的，申購款項將全額退還投資者。發生上述（1）到（6）項暫停申購情形且管理人決定暫停申購時，基金管理人應當在指定媒體上刊登暫停申購公告。	<u>單一投資者持有基金份額的比例達到或者超過50%，或者變相規避50%集中度的情形時；</u> <u>（9）申請超過基金管理人設定的基金總規模、單日淨申購比例上限、單個投資人單日或單筆申購金額上限的；</u> 發生上述情形之一且管理人決定拒絕申購的，申購款項將相應退還投資者。發生上述（1）到（<u>7</u>）項暫停申購情形且管理人決定暫停申購時，基金管理人應當在指定媒體上刊登暫停申購公告。
第五部分 基金的申購與贖回	十、 暫停贖回或者延緩支付贖回款項的情形及處理方式 除非出現如下情形，基金管理人不得拒絕接受或暫停基金份額持有人的贖回申請或者延緩支付贖回款項： 	十、 暫停贖回或者延緩支付贖回款項的情形及處理方式 除非出現如下情形，基金管理人不得拒絕接受或暫停基金份額持有人的贖回申請或者延緩支付贖回款項： 新增： <u>（2）當前一估值日基金資產淨值 50%以上的資產出現無可參考的活躍市場價格且採用估值技術仍導致公允價值存在重大不確定性時，經與基金託管人協商確認後，基金管理人應當暫停接受投資人的贖回申請或延緩支付贖回</u>

	同時，在出現上述第（3）款的情形時，對已接受的贖回申請可延期支付贖回款項，最長不超過正常支付時間 20 個工作日，並在在指定媒體上公告。投資者在申請贖回時可事先選擇將當日可能未獲受理部分予以撤銷。	<u>款項；</u> 同時，在出現上述第（4）款的情形時，對已接受的贖回申請可延期支付贖回款項，最長不超過正常支付時間 20 個工作日，並在在指定媒體上公告。投資者在申請贖回時可事先選擇將當日可能未獲受理部分予以撤銷。
第五部分 基金的申購與贖回	十一、 巨額贖回的情形及處理方式 2、巨額贖回的處理方式	十一、 巨額贖回的情形及處理方式 2、巨額贖回的處理方式 新增： <u>（3）當基金出現巨額贖回時，在單個 A 類基金份額持有人贖回申請超過前一開放日基金總份額 10%的情形下，基金管理人認為支付該基金份額持有人的全部贖回申請有困難或者因支付該基金份額持有人的全部贖回申請而進行的財產變現可能會對基金資產淨值造成較大波動時，基金管理人可以對該單個 A 類基金份額持有人超出 10%的贖回申請實施延期辦理。對於未能贖回部分，投資人在提交贖回申請時可以選擇延期贖回或取消贖回，具體參照上述</u>

		<u>(2) 方式處理。延期的贖回申請與下一開放日贖回申請一併處理，無優先權並以下一開放日的基金份額淨值為基礎計算贖回金額，以此類推，直到全部贖回為止。而對該單個 A 類基金份額持有人 10% 以內（含 10%）的贖回申請與其他投資者的贖回申請按上述（1）、（2）方式處理，具體見相關公告。</u>
第六部分 基金合同 當事人及權利義務	一、 基金管理人 （一） 基金管理人簡況 法定代表人：白志中	一、 基金管理人 （一） 基金管理人簡況 法定代表人：章硯
第六部分 基金合同 當事人及權利義務	二、 基金託管人 （一） 基金託管人簡況 法定代表人：薑建清 註冊資本：人民幣 286,509,130,026 元	二、 基金託管人 （一） 基金託管人簡況 法定代表人：易會滿 註冊資本：人民幣 35,640,625.71 萬元
第十一部分 基金的 投資	二、 投資範圍 本基金主要投資於具有穩定和良好分紅能力的國內優質企業的股票，能夠提供固定收益、具有良好流動性的國債、企業債、可轉債等，以及其他固定收益產品。該部分	二、 投資範圍 本基金主要投資於具有穩定和良好分紅能力的國內優質企業的股票，能夠提供固定收益、具有良好流動性的國債、企業債、可轉債等，以及其他固定收益產品。該部分

	股票和固定收益產品的投資比例不低於非現金基金資產的 80%。投資組合中股票資產投資比例為 30-90%，債券資產比例為 0-65%，現金或者到期日在一年以內的政府債券類資產比例最低不低於 5%。	股票和固定收益產品的投資比例不低於非現金基金資產的 80%。投資組合中股票資產投資比例為 30-90%，債券資產比例為 0-65%，現金或者到期日在一年以內的政府債券類資產比例最低不低於 5%，<u>其中現金不包括結算備付金、存出保證金、應收申購款等。</u>
第十一部分 基金的投資	六、 投資限制 （二） 投資組合限制	六、 投資限制 （二） 投資組合限制 新增： <u>6、本基金管理人管理的全部開放式基金(包括開放式基金以及處於開放期的定期開放基金)持有一家上市公司發行的可流通股票，不得超過該上市公司可流通股票的15%；</u> <u>本基金管理人管理的全部投資組合持有一家上市公司發行的可流通股票，不得超過該上市公司可流通股票的30%；</u> <u>7、本基金主動投資於流動性受限資產的市值合計不得超過基金資產淨值的15%，因證券市場波動、上市公司股票停牌、基金規模變動等基金管理人之外的因素致使基金不符合前述所規定比例限制的，基金管理人不得主動新增流</u>

	 由於證券市場波動、上市公司合併或基金規模變動等基金管理人之外的原因導致的投資組合不符合上述約定的比例不在限制之內，但基金管理人應在 10 個交易日內進行調整，以達到標準。法律法規另有規定的從其規定。	<u>動性受限資產的投資；</u> <u>8、本基金與私募類證券資管產品及中國證監會認定的其他主體為交易對手開展逆回購交易的，可接受質押品的資質要求應當與基金合同約定的投資範圍保持一致；</u> <u>除第 7、8 項外，由於證券市場波動、上市公司合併或基金規模變動等基金管理人之外的原因導致的投資組合不符合上述約定的比例不在限制之內，但基金管理人應在 10 個交易日內進行調整，以達到標準。法律法規另有規定的從其規定。</u>
第十三部分 基金資產估值	五、估值方法 本基金按以下方式進行估值：	五、估值方法 本基金按以下方式進行估值： 新增： <u>6、當發生大額申購或贖回情形時，可以在履行適當程式後採用擺動定價機制，以確保基金估值的公平性。</u>
第十三部分 基金資產估值	七、暫停估值的情形	七、暫停估值的情形 新增：

		3、當前一估值日基金資產淨值 50%以上的資產出現無可參考的活躍市場價格且採用估值技術仍導致公允價值存在重大不確定性時，經與基金託管人協商一致的，基金管理人應當暫停估值；
第十三部分 基金資產估值	八、特殊情形的處理 1、基金管理人按估值方法的第 6 項進行估值時，所造成的誤差不作為基金資產估值錯誤處理；	八、特殊情形的處理 1、基金管理人按估值方法的第 7 項進行估值時，所造成的誤差不作為基金資產估值錯誤處理；
第十七部分 基金的資訊披露	五、公開披露的基金資訊 （六）基金定期報告，包括基金年度報告、基金半年度報告和基金季度報告	五、公開披露的基金資訊 （六）基金定期報告，包括基金年度報告、基金半年度報告和基金季度報告 新增： <u>報告期內出現單一投資者持有基金份額比例達到或者超過基金總份額20%的情形，為保障其他投資者的權益，基金管理人至少應當在基金定期報告“影響投資者決策的其他重要資訊”項下披露該投資者的類別、報告期末持有份額及占比、報告期內持有份額變化情況及本基金的特有風險。</u>

		<u>本基金持續運作過程中，應當在基金年度報告和半年度報告中披露基金組合資產情況及其流動性風險分析等。</u>
第十七部分 基金的資訊披露	五、公開披露的基金資訊 （七）臨時報告	五、公開披露的基金資訊 （七）臨時報告 新增： <u>26、發生涉及基金申購、贖回事項調整或潛在影響投資者贖回等重大事項時；</u> <u>27、基金管理人採用擺動定價機制進行估值；</u>
第十七部分 基金的資訊披露	八、暫停或延遲資訊披露的情形	新增： <u>八、暫停或延遲資訊披露的情形</u> <u>1、基金投資所涉及的證券交易所遇法定節假日或因其他原因暫停營業時；</u> <u>2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金託管人無法準確評估基金資產價值時；</u> <u>3、占基金相當比例的投資品種的估值出現重大轉變，而基金管理人為保障基金份額持有人的利益，已決定延遲估值；</u>

		<u>4、出現基金管理人認為屬於會導致基金管理人不能出售或評估基金資產的緊急事故的任何情況；</u> <u>5、當前一估值日基金資產淨值50%以上的資產出現無可參考的活躍市場價格且採用估值技術仍導致公允價值存在重大不確定性時，經與基金託管人協商一致暫停估值的；</u> <u>6、法律法規規定、中國證監會或基金合同認定的其他情形。</u>
--	--	--

附件二：《中銀收益混合型證券投資基金託管協定》修改前後對照表

章節	修改前	修改後
一、託管協議當事人	（一）基金管理人 法定代表人：白志中 經營範圍：一、基金管理業務；二、發起和設立基金；三、在證監會批准（如果需要獲得該等批准）前提下，從事其他中國法律許可及股東在股東會上同意的業務。 連絡人：範麗萍	（一）基金管理人 法定代表人：<u>章硯</u> 經營範圍：<u>基金募集、基金銷售、資產管理、中國證監會許可的其他業務。【依法須經批准的項目，經相關部門批准後方可開展經營活動】</u> 連絡人：<u>高爽秋</u>
一、基金託管協議當事人	（一）基金託管人 法定代表人：董建清 註冊資本：人民幣 286,509,130,026 元	（一）基金託管人 法定代表人：<u>易會滿</u> 註冊資本：<u>人民幣 35,640,625.71 萬元</u>
二、訂立託管協定的依據、目的和原則	訂立本協定的依據是《中華人民共和國證券投資基金法》（以下簡稱《基金法》）、《證券投資基金運作管理辦法》（以下簡稱《運作辦法》）、《證券投資基金銷售管理辦法》（以下簡稱《銷售辦法》）、《證券投資基金資訊披露	訂立本協定的依據是《中華人民共和國證券投資基金法》（以下簡稱《基金法》）、《證券投資基金運作管理辦法》（以下簡稱《運作辦法》）、《證券投資基金銷售管理辦法》（以下簡稱《銷售辦法》）、《證券投資基金資訊披露

	管理辦法》（以下簡稱《資訊披露辦法》）、《證券投資基金資訊披露內容與格式準則第 7 號〈託管協定的內容與格式〉》、《中銀收益混合型證券投資基金基金合同》（以下簡稱《基金合同》）及其他有關規定。	管理辦法》（以下簡稱《資訊披露辦法》）、《證券投資基金資訊披露內容與格式準則第 7 號〈託管協定的內容與格式〉》、<u>《公開募集開放式證券投資基金流動性風險管理規定》</u>、《中銀收益混合型證券投資基金基金合同》（以下簡稱《基金合同》）及其他有關規定。
三、基金託管人對基金管理人的業務監督和核查	（一）基金託管人對基金管理人的投資行為行使監督權 2、基金託管人根據有關法律法規的規定及基金合同的約定對下述基金投融資比例進行監督： （1）按法律法規的規定及基金合同的約定，本基金的投資資產配置比例為； 股票資產投資比例為 30-90%，債券資產比例為 0-65%，現金或者到期日在一年以內的政府債券類資產比例最低不低於 5%。 …… （2）根據法律法規的規定及基金合同的約定，本基金投資組合遵循以下投資限制；	（一）基金託管人對基金管理人的投資行為行使監督權 2、基金託管人根據有關法律法規的規定及基金合同的約定對下述基金投融資比例進行監督： （1）按法律法規的規定及基金合同的約定，本基金的投資資產配置比例為； 股票資產投資比例為 30-90%，債券資產比例為 0-65%，現金或者到期日在一年以內的政府債券類資產比例最低不低於 5%，<u>其中現金不包括結算備付金、存出保證金、應收申購款等。</u> …… （2）根據法律法規的規定及基金合同的約定，本基金投資組合遵循以下投資限制；

	 (3) 法規允許的基金投資比例調整期限 由於證券市場波動、上市公司合併或基金規模變動等基金	新增： <u>⑦本基金管理人管理的全部開放式基金(包括開放式基金以及處於開放期的定期開放基金)持有一家上市公司發行的可流通股票，不得超過該上市公司可流通股票的 15%；</u> <u>本基金管理人管理的全部投資組合持有一家上市公司發行的可流通股票，不得超過該上市公司可流通股票的 30%；</u> <u>⑧本基金主動投資於流動性受限資產的市值合計不得超過基金資產淨值的 15%，因證券市場波動、上市公司股票停牌、基金規模變動等基金管理人之外的因素致使基金不符合前述所規定比例限制的，基金管理人不得主動新增流動性受限資產的投資；</u> <u>⑨本基金與私募類證券資管產品及中國證監會認定的其他主體為交易對手開展逆回購交易的，可接受質押品的資質要求應當與基金合同約定的投資範圍保持一致；</u> (3) 法規允許的基金投資比例調整期限 <u>除上述⑧、⑨外</u>，由於證券市場波動、上市公司合併或基
--	--	---

	管理人之外的原因導致的投資組合不符合上述約定的比例，不在限制之內，但基金管理人應在 10 個交易日內進行調整，以達到規定的投資比例限制要求。法律法規另有規定的從其規定。	金規模變動等基金管理人之外的原因導致的投資組合不符合上述約定的比例，不在限制之內，但基金管理人應在 10 個交易日內進行調整，以達到規定的投資比例限制要求。法律法規另有規定的從其規定。
八、資產淨值計算和會計核算	（二）基金資產估值方法 2、估值方法 本基金的估值方法為： （8）在任何情況下，基金管理人如採用本項第(1) — (6)項規定的方法對基金資產進行估值，均應被認為採用了適當的估值方法。但是，如有確鑿證據表明按上述方法進行估值不能客觀反映其公允價值的，基金管理人可根據具體情況與基金託管人商定後，按均能反映公允價值的價格估值。如：銀行間債券估值如遇特殊情況，由基金管理人和基金託管人綜合考慮成本價、收益率曲線等因素確定的反	（二）基金資產估值方法 2、估值方法 本基金的估值方法為： 新增： <u>（7）當發生大額申購或贖回情形時，可以在履行適當程式後採用擺動定價機制，以確保基金估值的公平性。</u> （8）在任何情況下，基金管理人如採用本項第(1) — (7)項規定的方法對基金資產進行估值，均應被認為採用了適當的估值方法。但是，如有確鑿證據表明按上述方法進行估值不能客觀反映其公允價值的，基金管理人可根據具體情況與基金託管人商定後，按均能反映公允價值的價格估值。如：銀行間債券估值如遇特殊情況，由基金管理人和基金託管人綜合考慮成本價、收益率曲線等因素確定的反

	映公允價值的價格估值。	映公允價值的價格估值。
十、資訊披露	(二) 基金管理人和基金託管人在資訊披露中的職責和資訊披露程式	(二) 基金管理人和基金託管人在資訊披露中的職責和資訊披露程式 新增： <u>報告期內出現單一投資者持有基金份額比例達到或者超過基金總份額20%的情形，為保障其他投資者的權益，基金管理人至少應當在基金定期報告“影響投資者決策的其他重要資訊”項下披露該投資者的類別、報告期末持有份額及占比、報告期內持有份額變化情況及本基金的特有風險。</u> <u>本基金持續運作過程中，應當在基金年度報告和半年度報告中披露基金組合資產情況及其流動性風險分析等。</u>
十、資訊披露	(三) 暫停或延遲資訊披露的情形	(三) 暫停或延遲資訊披露的情形 新增： <u>5、當前一估值日基金資產淨值 50%以上的資產出現無可參考的活躍市場價格且採用估值技術仍導致公允價值存在重大不確定性時，經與基金託管人協商一致暫停估值</u>

		<u>的</u> ；
--	--	------------