

# 朱雀基金管理有限公司关于修改朱雀安鑫回报债券型发起式证券投资基金基金合同、托管协议的公告

根据中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）于2020年7月10日颁布，自2020年8月1日起施行的《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》（以下简称“《侧袋机制指引（试行）》”）、于2018年6月6日颁布施行的《存托凭证发行与交易管理办法（试行）》及有关法律法规和基金合同的规定，经与朱雀安鑫回报债券型发起式证券投资基金基金托管人兴业银行股份有限公司协商一致，朱雀基金管理有限公司（以下简称“本公司”）对《朱雀安鑫回报债券型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）中前言、释义、基金份额的申购与赎回、基金份额持有人大会、基金的投资、基金资产估值、基金费用与税收、基金的收益与分配、基金的信息披露等章节进行了修订以及对援引的法律法规等进行了更新，并相应调整了《朱雀安鑫回报债券型发起式证券投资基金托管协议》（以下简称“托管协议”）、《朱雀安鑫回报债券型发起式证券投资基金托管协议招募说明书》（以下简称“招募说明书”）、《朱雀安鑫回报债券型发起式证券投资基金托管协议产品资料概要》（以下简称“产品资料概要”）中涉及的内容，同时，根据基金运作情况对招募说明书、产品资料概要进行了信息更新，现将有关事项说明如下：

1、根据《侧袋机制指引（试行）》、《存托凭证发行与交易管理办法（试行）》等法律法规对基金合同、托管协议的修订详见附件。

2、本次修订已经履行了规定的程序，符合有关法律法规和基金合同的约定，对基金份额持有人的利益无实质性不利影响，无需召开基金份额持有人大会。本次修订将自2021年7月9日起正式生效。

3、朱雀安鑫回报债券型发起式证券投资基金修订后的基金合同、托管协议、招募说明书（更新）、产品资料概要（更新）等法律文件于2021年06月30日在基金管理人网站([www.rosefinchfund.com](http://www.rosefinchfund.com))和中国证监会基金电子披露网站(<http://eid.csrc.gov.cn/fund>)披露，供投资者查阅。如有疑问可拨打本公司客服电话（400-921-7211）咨询。

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将来表现。投资有风险，敬请投资者认真阅读基金的相关法律文件，了解基金产品的详细情况，关注基金风险等级变化情况，选择与自己风险识别能力和风险承受能力相匹配的基金。本公告的解释权归本公司所有。

特此公告。

朱雀基金管理有限公司

二〇二一年七月九日

附件：修改朱雀安鑫回报债券型发起式证券投资基金基金合同、托管协议差异对照表

1、《基金合同》差异对照表

序号	涉及章节	原条款	修改后
1	第一部分 前言	<p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</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》”）、<del>《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集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》”）</del>和其他有关法律法规。</p> <p>七、本基金若投资于内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”），将承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带</p>	<p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</p> <p>2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国<b>民法典</b>》（以下简称“<b>《民法典》</b>”）、《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》”）、<b>《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》</b>（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集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》”）、<b>《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》</b>（以下简称“<b>《侧袋机制指引》</b>”）和其他有关法律法规。</p> <p>七、本基金若投资于内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”），将承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能</p>

	<p>来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。具体风险烦请查阅本基金招募说明书的“风险揭示”章节的具体内容。基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。</p> <p><del>本基金合同约定的基金产品资料概要编制、披露与更新要求，自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行。</del></p>	<p>及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。具体风险烦请查阅本基金招募说明书的“风险揭示”章节的具体内容。基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。</p> <p><u>八、本基金的投资范围包括存托凭证。基金资产投资存托凭证，会面临因存托凭证而产生的特殊风险，包括但不限于存托凭证价格大幅波动的风险，存托凭证出现较大亏损的风险，因存托凭证的境外基础证券价格影响导致基金净值波动的风险、因存托凭证的境外基础证券的相关风险而直接或间接导致本基金产生的相关风险，以及与存托凭证发行机制相关的风险等。</u></p> <p><u>九、当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，基金管理人履行相应程序后，可以启用侧袋机制，具体详见基金合同和招募说明书的有关章节。侧袋机制实施期间，基金管理人将对基金简称进行特殊标识，并不办理侧袋账户的申购赎回。请基金份额持有人仔细阅读相关内容并关注本基金启用侧袋机制时的特定风险。</u></p>
2	<p>第二部分 释义</p> <p>11、《销售办法》：<del>指中国证监会 2013 年 3 月 15 日颁布、同年 6 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订</del></p> <p>12、《信息披露办法》：<del>指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布</del></p>	<p>11、《销售办法》：<u>指中国证监会 2020 年 8 月 28 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订</u></p> <p>12、《信息披露办法》：<u>指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9</u></p>

		布、同年9月1日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订	<p>月1日实施的，并经2020年3月20日中国证监会《关于修改部分证券期货规章的决定》修正的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订</p> <p>61、侧袋机制：指将基金投资组合中的特定资产从原有账户分离至一个专门账户进行处置清算，目的在于有效隔离并化解风险，确保投资者得到公平对待，属于流动性风险管理工具。侧袋机制实施期间，原有账户称为主袋账户，专门账户称为侧袋账户</p> <p>62、特定资产：包括：（一）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的资产；（二）按摊余成本计量且计提资产减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产；（三）其他资产价值存在重大不确定性的资产</p>
3	第六部分 基金份额 的申购与 赎回		<p>十九、实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回</p> <p>本基金实施侧袋机制的，本基金的申购和赎回安排详见招募说明书或相关公告。</p>
4	第八部分 基金份额		<p>十、实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定</p> <p>若本基金实施侧袋机制，则相关基金份额或表决权的比例指主袋份额</p>

<p>持有人大会</p>		<p>持有人和侧袋份额持有人分别持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例，但若相关基金份额持有人大会召集和审议事项不涉及侧袋账户的，则仅指主袋份额持有人持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例：</p> <p>1、基金份额持有人行使提议权、召集权、提名权所需单独或合计代表相关基金份额 10%以上（含 10%）；</p> <p>2、现场开会的到会者在权益登记日代表的基金份额不少于本基金在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；</p> <p>3、通讯开会的直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；</p> <p>4、在参与基金份额持有人大会投票的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日相关基金份额的二分之一、召集人在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内就原定审议事项重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）相关基金份额的持有人参与或授权他人参与基金份额持有人大会投票；</p>
--------------	--	--

			<p>5、<u>现场开会由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50% 以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人；</u></p> <p>6、<u>一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过；</u></p> <p>7、<u>特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过。</u></p> <p><u>侧袋机制实施期间，基金份额持有人大会审议事项涉及主袋账户和侧袋账户的，应分别由主袋账户、侧袋账户的基金份额持有人进行表决，同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。表决事项未涉及侧袋账户的，侧袋账户份额无表决权。</u></p> <p><u>侧袋机制实施期间，关于基金份额持有人大会的相关规定以本节特殊约定内容为准，本节没有规定的适用本部分的相关规定。</u></p>
5	第十二部分 基金的投资	<p>二、投资范围</p> <p>本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中</p>	<p>二、投资范围</p> <p>本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的</p>

	<p>国证监会核准上市的股票)、港股通标的股票、国债期货、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、分离交易可转债的纯债部分、可交换债券、中期票据、证券公司短期公司债券、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款、通知存款和其他银行存款)、同业存单以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。</p> <p>.....</p>	<p>股票、<u>存托凭证</u>)、港股通标的股票、国债期货、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、分离交易可转债的纯债部分、可交换债券、中期票据、证券公司短期公司债券、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款、通知存款和其他银行存款)、同业存单以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。</p> <p>.....</p> <p><b>三、投资策略</b></p> <p><b>5、存托凭证策略</b></p> <p><u>本基金投资存托凭证的策略依照上述境内上市交易的股票投资策略执行。</u></p> <p>四、投资限制</p> <p><u>(17)本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行，</u></p>
--	--	---

			<p><u>与境内上市交易的股票合并计算；</u></p> <p><u>八、侧袋机制的实施和投资运作安排</u></p> <p><u>当基金持有特定资产且存在或潜在重大赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制，无需召开基金份额持有人大会审议。</u></p> <p><u>侧袋机制实施期间，本部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。</u></p> <p><u>侧袋账户的实施条件、实施程序、运作安排、投资安排、特定资产的处置变现和支付等对投资者权益有重大影响的事项详见招募说明书的规定。</u></p>
6	<p><b>第十四部分 基金资产估值</b></p>	<p>二、估值对象</p> <p>基金所拥有的股票（含港股通标的股票）、债券、银行存款本息、应收款项、国债期货合约、其它投资等资产及负债。</p>	<p>二、估值对象</p> <p>基金所拥有的股票（含港股通标的股票）、<u>存托凭证</u>、债券、银行存款本息、应收款项、国债期货合约、其它投资等资产及负债。</p> <p>四、估值方法</p>

		<p>七、暂停估值的情形</p> <p>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估值；—</p>	<p>(5) 本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票执行。</p> <p>七、暂停估值的情形</p> <p>3、当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值；—</p> <p>十、实施侧袋机制期间的基金资产估值</p> <p>本基金实施侧袋机制的，应根据本部分的约定对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的基金净值信息，暂停披露侧袋账户的基金净值信息。</p>
7	第十五部分 基金费用与税收		<p>五、实施侧袋机制期间的基金费用</p> <p>本基金实施侧袋机制的，与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费，详见招募说明书的规定。</p>
8	第十六部		<p>七、实施侧袋机制期间的收益分配</p>

	分基金的收益与分配		本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配，详见招募说明书的规定。
9	第十八部分基金的信息披露		<p><u>(十) 实施侧袋机制期间的信息披露</u></p> <p>本基金实施侧袋机制的，相关信息披露义务人应当根据法律法规、基金合同和招募说明书的规定进行信息披露，详见招募说明书的规定。</p>

## 2、《托管协议》差异对照表

序号	涉及章节	原条款	修改后
1	目录后，一、基金托管协议当事人前		若本基金实施侧袋机制的，侧袋机制实施期间的相关安排见基金合同和招募说明书的规定。
2	二、基金托管协议的依据、目的	<p>(一) 订立托管协议的依据</p> <p>本协议依据《中华人民共和国合同法》、《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》”)、《公</p>	<p>(一) 订立托管协议的依据</p> <p>本协议依据《中华人民共和国民法典》、《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》”)、《公开</p>

	<b>和原则</b>	开募集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》等有关法律法规、基金合同及其他有关规定制订。	募集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》等有关法律法规、基金合同及其他有关规定制订。
3	<b>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</b>	<p>(一)基金托管人根据有关法律法规的规定以及《基金合同》的约定,对基金投资范围、投资比例、投资限制、关联方交易等进行监督。《基金合同》明确约定基金投资证券选择标准的,基金管理人应事先或定期向基金托管人提供投资品种池,以便基金托管人对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督。</p> <p>1. 本基金的投资范围为:</p> <p>本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、港股通标的股票、国债期货、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、分离交易可转债的纯债部分、可交换债券、中期票据、证券公司短期公司债券、短期融资券、超短期融资</p>	<p>(一)基金托管人根据有关法律法规的规定以及《基金合同》的约定,对基金投资范围、投资比例、投资限制、关联方交易等进行监督。《基金合同》明确约定基金投资证券选择标准的,基金管理人应事先或定期向基金托管人提供投资品种池,以便基金托管人对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督。</p> <p>1. 本基金的投资范围为:</p> <p>本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、<u>存托凭证</u>)、港股通标的股票、国债期货、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、分离交易可转债的纯债部分、可交换债券、中期票据、证券公司短期公司债券、短期融资券、超短期融资</p>

		<p>券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款、通知存款和其他银行存款)、同业存单以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。</p> <p>.....</p>	<p>券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款、通知存款和其他银行存款)、同业存单以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。</p> <p>.....</p> <p>2. 基金的投资组合应遵循以下限制:</p> <p>.....</p> <p><u>(17) 本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行, 与境内上市交易的股票合并计算;</u></p> <p>.....</p>
4	八、基金资产净值计算、估值和会计核算		<p><u>(八) 实施侧袋机制期间的基金资产估值</u></p> <p><u>本基金实施侧袋机制的, 应根据本部分的约定对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的基金净值信息, 暂停披露侧袋账户的基金净值信息。</u></p>
5	十、基金信息披露	<p>(二) 信息披露的内容</p> <p>基金的信息披露内容主要包括基金招募说明书、基金产品资料概要、基金合同、托管协议、基金份额发售公告、基金合</p>	<p>(二) 信息披露的内容</p> <p>基金的信息披露内容主要包括基金招募说明书、基金产品资料概要、基金合同、托管协议、基金份额发售公告、基金合</p>

	<p>同生效公告、基金资产净值、各类基金份额净值、各类基金份额累计净值、基金份额申购、赎回价格、基金定期报告（包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告）、临时报告、澄清公告、基金份额持有人大会决议和中国证监会规定的其他信息。基金年度报告需经具有从事证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计后，方可披露。</p>	<p>同生效公告、基金资产净值、各类基金份额净值、各类基金份额累计净值、基金份额申购、赎回价格、基金定期报告（包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告）、临时报告、澄清公告、基金份额持有人大会决议、<b><u>实施侧袋机制期间的信息披露</u></b>和中国证监会规定的其他信息。基金年度报告需经具有从事证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计后，方可披露。</p>
--	---	---