

## 兴业基金管理有限公司关于旗下部分基金根据《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》修改基金合同等法律文件的公告

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》和《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》等法律法规的规定和各基金基金合同等法律文件的约定，经与各基金托管人协商一致，并向中国证监会备案，兴业基金管理有限公司（以下简称“本公司”或“基金管理人”）决定自2021年7月14日起，对旗下部分基金的基金合同、托管协议、招募说明书等法律文件进行修订，新增侧袋机制相关内容，并更新部分基金的基金托管人信息。现将有关情况说明如下：

### 一、本次修订的基金范围

本次修订涉及基金管理人旗下36只公募基金，详细名单见下表：

| 序号 | 基金产品名称                  | 基金主代码  |
|----|-------------------------|--------|
| 1  | 兴业福鑫债券型证券投资基金           | 004140 |
| 2  | 兴业裕恒债券型证券投资基金           | 003671 |
| 3  | 兴业福益债券型证券投资基金           | 002524 |
| 4  | 兴业中证银行50金融债指数证券投资基金     | 008042 |
| 5  | 兴业丰利债券型证券投资基金           | 002268 |
| 6  | 兴业丰泰债券型证券投资基金           | 002445 |
| 7  | 兴业天融债券型证券投资基金           | 002638 |
| 8  | 兴业稳固收益两年理财债券型证券投资基金     | 001369 |
| 9  | 兴业优债增利债券型证券投资基金         | 002338 |
| 10 | 兴业安弘3个月定期开放债券型发起式证券投资基金 | 005388 |
| 11 | 中证兴业中高等级信用债指数证券投资基金     | 003429 |
| 12 | 兴业添利债券型证券投资基金           | 001299 |
| 13 | 兴业年年利定期开放债券型证券投资基金      | 001019 |
| 14 | 兴业短债债券型证券投资基金           | 002301 |
| 15 | 兴业嘉瑞6个月定期开放债券型证券投资基金    | 003952 |
| 16 | 兴业6个月定期开放债券型发起式证券投资基金   | 005340 |
| 17 | 兴业纯债6个月定期开放债券型证券投资基金    | 005988 |
| 18 | 兴业嘉荣一年定期开放债券型发起式证券投资基金  | 009105 |
| 19 | 兴业启元一年定期开放债券型证券投资基金     | 003309 |
| 20 | 兴业裕华债券型证券投资基金           | 003672 |
| 21 | 兴业裕丰债券型证券投资基金           | 003640 |
| 22 | 兴业瑞丰6个月定期开放债券型证券投资基金    | 004141 |
| 23 | 兴业3个月定期开放债券型发起式证券投资基金   | 005338 |
| 24 | 兴业鼎泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金  | 008896 |
| 25 | 兴业稳泰66个月定期开放债券型证券投资基金   | 009732 |

|    |                         |        |
|----|-------------------------|--------|
| 26 | 兴业嘉华一年定期开放债券型发起式证券投资基金  | 008517 |
| 27 | 兴业收益增强债券型证券投资基金         | 001257 |
| 28 | 兴业嘉润3个月定期开放债券型发起式证券投资基金 | 005710 |
| 29 | 兴业绿色纯债一年定期开放债券型证券投资基金   | 009237 |
| 30 | 兴业定期开放债券型证券投资基金         | 000546 |
| 31 | 兴业增益五年定期开放债券型证券投资基金     | 002870 |
| 32 | 兴业稳康三年定期开放债券型证券投资基金     | 004242 |
| 33 | 兴业安和6个月定期开放债券型发起式证券投资基金 | 005442 |
| 34 | 兴业中债1-3年政策性金融债指数证券投资基金  | 002659 |
| 35 | 兴业天禧债券型证券投资基金           | 002661 |
| 36 | 兴业机遇债券型证券投资基金           | 005717 |

## 二、基金合同、托管协议、招募说明书的修订情况

1、在基金合同的“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”等章节增加了侧袋机制的相关内容，并对基金合同摘要进行同步修订。在托管协议的前言和“基金信息披露”部分增加了侧袋机制的相关内容。基金合同、托管协议的修订对照表（示例）详见附件。

2、根据基金合同、托管协议的修订情况，在招募说明书中新增“侧袋机制”章节，并对招募说明书的相关内容进行了同步更新。

## 三、重要提示

1、上述修改内容以“兴业天禧债券型证券投资基金”为例，不同基金的描述可能存在差异，具体详见各基金更新的法律文件。本次修订已履行了规定的程序，符合相关法律法规的规定，修订自2021年7月14日起生效。

2、本公告仅对本次法律文件修改的事项予以说明，最终解释权归本公司。投资者欲了解基金信息，请仔细阅读基金的基金合同、更新的招募说明书、基金产品资料概要及相关信息披露文件。本公司将在本公司网站（<http://www.cib-fund.com.cn/>）、中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）上公布经修改后的该等基金基金合同、托管协议、招募说明书。投资者可通过本公司客户服务中心或官方网站咨询有关详情。

本公司客户服务电话：40000-95561

### 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，投资

者投资时应认真阅读基金的基金合同、招募说明书、基金产品资料概要等文件。敬请投资者留意投资风险。

特此公告

兴业基金管理有限公司

2021年7月14日

附件：

一、基金合同修改前后对照表（以兴业天禧债券型证券投资基金为例）

| 章节                           | 修改前  | 修改后  |
|------------------------------|--|--|
| 第二部分<br>释义                   |  | 54、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<br><br>55、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 |
| 第六部分<br>基金份额<br>的申购与<br>赎回   |  | 十七、实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回<br>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。  |
| 第七部分<br>基金合同<br>当事人及<br>权利义务 | 二、基金托管人<br><br>（一）基金托管人简况<br><br>……<br><br>法定代表人：李建红 | 二、基金托管人<br><br>（一）基金托管人简况<br><br>……<br><br>法定代表人：缪建民   |

|                                     |   |
|-------------------------------------|---|
| <p>第八部分<br/>基金份额<br/>持有人大<br/>会</p> | <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> <ol style="list-style-type: none"> <li>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%）；</li> <li>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）；</li> <li>3、通讯开会的直接出具书面意见或授权他人代表出具书面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）；</li> <li>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；</li> <li>5、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；</li> <li>6、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；</li> <li>7、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。</li> </ol> <p>同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。</p> |
|-------------------------------------|---|

|               |  |  |
|---------------|--|--|
| 第十二部分 基金的投资   |  | <p>七、侧袋机制的实施和投资运作安排</p> <p>当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> |
| 第十四部分 基金资产估值  | <p>六、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一致的，基金管理人应当暂停估值；</p> | <p>六、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>  |
| 第十四部分 基金资产估值  |  | <p>九、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，暂停披露侧袋账户份额净值。</p>  |
| 第十五部分 基金费用与税收 |  | <p>四、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，但不得收取基金管理费，详见</p>  |

|                |   |   |
|----------------|---|---|
|                |   | 招募说明书的规定。   |
| 第十六部分 基金的收益与分配 |   | 七、实施侧袋机制期间的收益分配<br>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。   |
| 第十八部分 基金的信息披露  | 五、公开披露的基金信息<br>.....<br>八、暂停或延迟信息披露的情形<br>.....<br>3、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基金管理人暂停估值时； | 五、公开披露的基金信息<br>.....<br>(十三) 实施侧袋机制期间的信息披露<br>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。<br>八、暂停或延迟信息披露的情形<br>.....<br>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，基金管理人暂停估值时； |

二、托管协议修改前后对照表（以兴业天禧债券型证券投资基金为例）

| 章节          | 修改前                              | 修改后                                      |
|-------------|----------------------------------|--|
|             |                                  | 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。 |
| 一、基金托管协议当事人 | (二) 基金托管人（也可称资产托管人）<br>法定代表人：李建红 | (二) 基金托管人（也可称资产托管人）<br>法定代表人：缪建民         |
| 十、基         | (三) 基金托管人和基金管理人在信息披露中            | (三) 基金托管人和基金管理人在信                        |

|              |   |  |
|--------------|---|--|
| <b>金信息披露</b> | 的职责和信息披露程序<br>1.职责<br>.....<br>(3)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基金管理人暂停估值时； | 息披露中的职责和信息披露程序<br>1.职责<br>.....<br>(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，基金管理人暂停估值时； |
|--------------|---|--|

### 三、招募说明书修订的主要内容（以兴业天禧债券型证券投资基金为例）

#### （一）在“重要提示”增加侧袋机制特定风险提示

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本招募说明书的相关章节。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。

#### （二）新增“侧袋机制”章节如下：

##### 十七、侧袋机制

##### （一）侧袋机制的实施条件和程序

当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，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。

基金管理人应当在启用侧袋机制后及时发布临时公告，并在五个工作日内聘请侧袋机制启用日发表意见且符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所进行审计并披露专项审计意见。基金管理人应当在启用侧袋机制当日报中国证监会及公司所在地中国证监会派出机构备案，并按照法律法规规定提交材料。

##### （二）实施侧袋机制期间基金份额的申购与赎回

1、启用侧袋机制当日，基金登记机构以基金份额持有人的原有账户份额为基础，确认相应侧袋账户基金份额持有人名册和份额；当日收到的申购申请，按照启用侧袋机制后的主袋账户份额办理；当日收到的赎回申请，仅办理主袋账户的赎回申请并支付赎回款项。

2、实施侧袋机制期间，基金管理人不得办理侧袋账户份额的申购、赎回和转换；同时，基金管理人按照基金合同和招募说明书的约定办理主袋账户份额的赎回，并根据主袋账户运作情况确定是否暂停申购。

3、除基金管理人应按照主袋账户的份额净值办理主袋账户份额的申购和赎回外，本招募说明书“基金份额的申购与赎回”部分的申购、赎回规定适用于主袋账户份额。巨额赎回按照单个开放日内主袋账户份额净赎回申请超过上一开放日主袋账户总份额的10%认定。

#### （三）实施侧袋机制期间的基金投资

侧袋机制实施期间，招募说明书“基金的投资”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。基金管理人计算各项投资运作指标和基金业绩指标时仅需考虑主袋账户资产。

基金管理人原则上应当在侧袋机制启用后20个交易日内完成对主袋账户投资组合的调整，因资产流动性受限等中国证监会规定的情形除外。

基金管理人不得在侧袋账户中进行除特定资产处置变现以外的其他投资操作。

#### （四）实施侧袋机制期间的基金估值

本基金实施侧袋机制的，基金管理人和基金托管人应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，暂停披露侧袋账户份额净值。侧袋账户的会计核算应符合《企业会计准则》的相关要求。

#### （五）实施侧袋账户期间的基金费用

1、本基金实施侧袋机制的，管理费和托管费等按主袋账户基金资产净值作为基数计提。

2、与侧袋账户有关的费用可从侧袋账户中列支，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，但不得收取基金管理费。

#### （六）侧袋账户中特定资产的处置变现和支付

特定资产以可出售、可转让、恢复交易等方式恢复流动性后，基金管理人应当按照基金份额持有人利益最大化原则，采取将特定资产予以处置变现等方式，及时向侧袋账户份额持有人支付对应变现款项。

侧袋机制实施期间，无论侧袋账户资产是否全部完成变现，基金管理人都应当及时向侧袋账户全部份额持有人支付已变现部分对应的款项。若侧袋账户资产无法一次性完成处置变现，基金管理人在每次处置变现后均应按照相关法律法规要求及时发布临时公告。

侧袋账户资产全部完成变现并终止侧袋机制后，基金管理人应及时聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所进行审计并披露专项审计意见。

#### （七）侧袋机制的信息披露

##### 1、临时公告

在启用侧袋机制、处置特定资产、终止侧袋机制以及发生其他可能对投资者利益产生重大影响的事项后基金管理人应及时发布临时公告。

##### 2、基金净值信息



基金管理人应按照招募说明书“基金的信息披露”部分规定的基金净值信息披露方式和频率披露主袋账户份额的基金净值信息。实施侧袋机制期间本基金暂停披露侧袋账户基金净值信息。

### 3、定期报告

侧袋机制实施期间，基金管理人应当在基金定期报告中披露报告期内特定资产处置进展情况，披露报告期末特定资产可变现净值或净值区间的，应同时注明不作为特定资产最终变现价格的承诺。

基金定期报告中的基金会计报表仅需针对主袋账户进行编制。会计师事务所对基金年度报告进行审计时，应对报告期内基金侧袋机制运行相关的会计核算和年度报告披露等发表审计意见。

(八) 本部分关于侧袋机制的相关规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，或将来法律法规或监管规则针对侧袋机制的内容有进一步规定的，基金管理人经与基金托管人协商一致并履行适当程序后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

#### (三) 在“风险揭示”中新增实施侧袋机制有关风险提示如下：

##### (4) 实施侧袋机制对投资者的影响

侧袋机制是一种流动性风险管理工具，是将特定资产分离至专门的侧袋账户进行处置清算，并以处置变现后的款项向基金份额持有人进行支付，目的在于有效隔离并化解风险。但基金启用侧袋机制后，侧袋账户份额将停止披露基金份额净值，并不得办理申购、赎回和转换，仅主袋账户份额正常开放赎回，因此启用侧袋机制时持有基金份额的持有人将在启用侧袋机制后同时持有主袋账户份额和侧袋账户份额，侧袋账户份额不能赎回，其对应特定资产的变现时间具有不确定性，最终变现价格也具有不确定性并且有可能大幅低于启用侧袋机制时的特定资产的估值，基金份额持有人可能因此面临损失。

实施侧袋机制期间，因本基金不披露侧袋账户份额的净值，即便基金管理人在基金定期报告中披露报告期末特定资产可变现净值或净值区间的，也不作为特定资产最终变现价格的承诺，因此对于特定资产的公允价值和最终变现价格，基金管理人不承担任何保证和承诺的责任。

基金管理人将根据主袋账户运作情况合理确定申购政策，因此实施侧袋机制后主袋账户份额存在暂停申购的可能。

启用侧袋机制后，基金管理人计算各项投资运作指标和基金业绩指标时仅需考虑主袋账户资产，并根据相关规定对分割侧袋账户资产导致的基金净资产减少进行按投资损失处理，因此本基金披露的业绩指标不能反映特定资产的真实价值及变化情况。

(四) 根据基金合同、托管协议的修订，更新招书说明书中相应部分的内容  
四、因上述修订调整导致的序号变化调整。