

关于太平基金管理有限公司旗下太平灵活配置混合型发起式证券投资基金修改基金合同和托管协议的公告

根据中国证监会2017年10月1日起施行的《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《规定》），对已经存续的开放式基金，原基金合同内容不符合该《规定》的，应当在《规定》施行之日起6个月内进行修改。

太平基金管理有限公司（以下简称本公司）经与基金托管人兴业银行股份有限公司协商一致，对旗下托管在兴业银行的太平灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金合同进行了修改。基金合同的具体修改内容见附件，基金托管协议相应部分也一并进行修改，修改后的基金合同和托管协议均已报监管机构备案。本公司将在上述基金的招募说明书（更新）中，对相应部分进行修改。

太平灵活配置混合型发起式证券投资基金合同和托管协议的修订已经履行了规定的程序，符合相关法律法规及基金合同的规定。修改后的基金合同和托管协议将于2018年4月1日起生效，2018年4月1日前仍按照修改前的基金合同和托管协议的约定运作。

投资者可以通过本公司网站（www.taipingfund.com.cn）查阅修改后的基金合同等法律文件。

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，敬请投资人认真阅读基金的相关法律文件，并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：太平灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同和托管协议修改对照表

太平基金管理有限公司

二〇一八年三月三十一日

《太平灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》修改前后文对照表

章节	《基金合同》修改前条款	《基金合同》修改后条款
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>.....</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>.....</p>	<p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</p> <p>.....</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>.....</p>

<p>第二部分 释义</p>		<p>新增：</p> <p>13、《流动性风险规定》：指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日起实施的《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>44、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>.....</p> <p>55、流动性受限资产：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</p>
<p>第六部分 基金份额的 申购与赎回</p>	<p>三、申购与赎回的原则</p>	<p>三、申购与赎回的原则</p> <p>新增：</p> <p>5、本基金暂不采用摆动定价机制。</p> <p>.....</p>

<p>第六部分 基金份额的 申购与赎回</p>	<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>.....</p>	<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>.....</p> <p>新增:</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。具体请参见本基金招募说明书或相关公告。</p>
<p>第六部分 基金份额的 申购与赎回</p>	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>.....</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,具体规定请参见招募说明书或相关公告。赎回费用应根据相关规定按照比例归入基金财产,未计入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。</p> <p>.....</p>	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>.....</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,具体规定请参见招募说明书或相关公告。赎回费用应根据相关规定按照比例归入基金财产,未计入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。其中,本基金对持续持有期少于7日的投资者收取不低于1.50%的赎回费,并将上述赎回费全额计入基金财产。</p> <p>.....</p>
<p>第六部分 基金份额的 申购与赎回</p>	<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>.....</p> <p>4、基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。</p> <p>.....</p>	<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>.....</p> <p>4、基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害存量基金份额持有人利益或对其构成潜在重大不利影响时。</p> <p>新增:</p> <p>6、基金管理人接受某一投资者申购申请后导致其份额超过基金总份额50%以上时。</p> <p>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</p>

	<p>发生上述第 1、2、3、5、6项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介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。</p>	<p>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赎回申请。</p> <p>.....</p> <p>发生上述第 1、2、3、5、7、8项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介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。</p>
<p>第六部分 基金份额的 申购与赎回</p>	<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受基金份额持有人的赎回申请或者延缓支付赎回款项时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第 4 项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。</p>	<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>.....</p> <p>新增：</p> <p>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。</p> <p>.....</p> <p>发生上述第 1、2、3、5、6项情形之一且基金管理人决定暂停接受基金份额持有人的赎回申请或者延缓支付赎回款项时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第 4 项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。</p>

<p>第六部分 基金份额的 申购与赎回</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</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 新增 (4) 单个基金份额持有人的赎回申请如超过上一开放日基金总份额 20%以上的, 基金管理人可对该基金份额持有人实施延期办理赎回申请。基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10%的前提下, 对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请, 应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例, 确定当日受理的赎回份额; 对于未能赎回部分, 投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的, 将自动转入下一个开放日, 并与下一开放日赎回申请一并处理, 无优先权且以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额, 以此类推, 直到全部赎回为止; 选择取消赎回的, 当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。。如基金份额持有人在提交赎回申请时未作明确选择, 基金份额持有人未能赎回部分作自动延期赎回处理。</p>
<p>第十二部分 基金的投资</p>	<p>二、投资范围 基金的投资组合比例为: 本基金股票投资占基金资产的比例为 0% - 95%, 权证投资占基金资产净值的比例为 0% - 3%, 固定收益类资产投资占基金资产的比例为 5%-100%, 扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后, 现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>二、投资范围 基金的投资组合比例为: 本基金股票投资占基金资产的比例为 0% - 95%, 权证投资占基金资产净值的比例为 0% - 3%, 固定收益类资产投资占基金资产的比例为 5%-100%, 扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后, 现金或者到期日在一年以内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、应收申购款等。</p>

<p>第十二部分 基金的投资</p>	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合将遵循以下限制：</p> <p>(2) 本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当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>除上述第 (12) 项另有约定外，因证券期货市场波动、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，但中国证监会规定的特殊情形除外。</p>	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合将遵循以下限制：</p> <p>(2) 本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当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、应收申购款等； 新增： (22) 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%；本基金管理人管理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%； (23) 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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前款所规定比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资； (24) 本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>除上述第 (2)、(12)、(23)、(24) 项外，因证券期货市场波动、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，但中国证监会规定的特殊情形除外。</p>
------------------------	-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

第十四部分 基金资产估 值	六、暂停估值的情形	六、暂停估值的情形 新增： 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；
第十八部分 基金的信息 披露	一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他有关规定。	一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、 《流动性风险规定》 、《基金合同》及其他有关规定。
第十八部分 基金的信息 披露	五、公开披露的基金信息 (六) 基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告	五、公开披露的基金信息 (六) 基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告 新增： 基金持续运作过程中，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等。 报告期内出现单一投资者持有本基金基金份额比例超过基金总份额 20%的情形时，基金管理人至少应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告“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产品的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。
第十八部分 基金的信息 披露	五、公开披露的基金信息 (七) 临时报告	五、公开披露的基金信息 (七) 临时报告 新增：

		<p>27、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时；</p>
--	--	-----------------------------------------------

《太平灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议》修改前后文对照表

章节	《托管协议》修改前条款	《托管协议》修改后条款
二、基金托管协议的依据、目的和原则	<p>(一) 订立托管协议的依据</p> <p>本托管协议依据《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》(以下称“《运作办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下称“《信息披露办法》”)等有关法律法规、基金合同及其他有关规定制订。</p>	<p>(一) 订立托管协议的依据</p> <p>本托管协议依据《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》(以下称“《运作办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下称“《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》”)等有关法律法规、基金合同及其他有关规定制订。</p> <p style="text-align: center;">.....</p>

<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>	<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定, 对基金投资范围、投资对象进行监督。</p> <p>本基金股票投资占基金资产的比例为 0%-95%, 权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%, 固定收益类资产投资占基金资产的比例为 5%-100%, 扣股指期货合约需缴纳的交易保证金后现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定, 对基金投资范围、投资对象进行监督。</p> <p>本基金股票投资占基金资产的比例为 0% - 95%, 权证投资占基金资产净值的比例为 0% - 3%, 固定收益类资产投资占基金资产的比例为 5%-100%, 扣股指期货合约需缴纳的交易保证金后现金或者到期日在一年以内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、应收申购款等。</p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>	<p>(二) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定, 对基金投资、融资、融券比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督:</p> <p>(2) 本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后, 应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券;</p>	<p>(二) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定, 对基金投资、融资、融券比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督:</p> <p>(2) 本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后, 应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或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、应收申购款等;</p> <p>新增:</p> <p>(22) 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%; 本基金管理人管理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>(23) 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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前款所规定比例限制的, 本基</p>

	<p>除上述第(12)项另有约定外,因证券期货市场波动、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,但中国证监会规定的特殊情形除外。</p>	<p>金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;</p> <p>(24) 本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>除上述第 (2)、(12)、(23)、(24) 项外,因证券期货市场波动、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,但中国证监会规定的特殊情形除外。</p>
八、基金资产净值计算和会计核算	(四) 暂停估值的情形	<p>(四) 暂停估值的情形</p> <p>增加</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>
十、基金信息披露	<p>(一) 保密义务</p> <p>基金托管人和基金管理人应按法律法规、基金合同的有关规定进行信息披露,拟公开披露的信息在公开披露之前应予保密。除按《基金法》、基金合同、《信息披露办法》及其他有关规定进行信息披露外,基金管理人和基金托管人对基金运作中产生的信息以及从对方获得的业务信息应予保密。但是,如下情况不应视为基金管理人或基金托管人违反保密义务:</p>	<p>(一) 保密义务</p> <p>基金托管人和基金管理人应按法律法规、基金合同的有关规定进行信息披露,拟公开披露的信息在公开披露之前应予保密。除按《基金法》、基金合同、《流动性风险规定》、《信息披露办法》及其他有关规定进行信息披露外,基金管理人和基金托管人对基金运作中产生的信息以及从对方获得的业务信息应予保密。但是,如下情况不应视为基金管理人或基金托管人违反保密义务:</p>