中加基金管理有限公司关于中加纯债定期开放债券型发起式证券投资基金修改基金合同、托管协议的公告

中加纯债定期开放债券型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会2017年6月13日证监许可【2017】909号文注册募集，基金合同于2017年7月20日生效。根据中国证监会2017年8月31日发布的《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》”），对已经成立或已获核准但尚未完成募集的开放式基金，原基金合同内容不符合该《规定》的的，应当在《规定》施行之日起6个月内，修改基金合同并公告。

本次《中加纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》、《中加纯债定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议》的修订内容，符合《规定》和相关法律法规的要求、符合《基金合同》的相关约定，并对基金份额持有人利益无实质性不利影响，不需召开基金份额持有人大会。本基金管理人中加基金管理有限公司（以下简称“本公司”）已就本次修订内容履行了规定的程序，与基金托管人杭州银行股份有限公司协商一致。（《中加纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同修改方案》、《中加纯债定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议修改方案》附后）

同时，依据《规定》“基金管理人应当强化对投资者短期投资行为的管理，对除货币市场基金与交易型开放式指数基金以外的开放式基金，对持续持有期少于7日的投资者收取不低于1.5%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。”的规定，本基金将于2018年3月31日起，对持续持有期少于7日的投资者收取1.5%的赎回费，并全额计入基金资产。

上述基金合同、托管协议的修订及赎回费相关规则调整等事宜自2018年3月31日生效。对于2018年3月30日15:00之前的赎回申请，适用调整前的赎回费规则；对于2018年3月30日15:00之后的赎回申请，适用调整后的赎回费规则。

投资者可以登录本公司网站（www.bobbns.com）查询或者拨打本公司的客户服务电话(400-00-95526)垂询相关事宜。

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。敬请投资人于投资前认真阅读本基金的基金合同。

特此公告。

附件1：《中加纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同修改方案》

附件2：《中加纯债定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议修改方案》

附件1：《中加纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同修改方案》

章节	《基金合同》修改前条款	《基金合同》修改后条款	修改理由
第一部分前言	一、订立本基金合同的目的、依据和原则 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。	一、订立本基金合同的目的、依据和原则 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。	增加《流动性风险管理规定》作为订立合同的依据。
第二部分释义	五、申购和赎回的数量限制 新增： 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。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体规定请参见相关公告。	五、申购和赎回的数量限制 新增： 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。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体规定请参见相关公告。	根据《流动性风险管理规定》第19条补充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的措施。
	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 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。赎回费用应根据法律法规规定的比例引入基金财产，未引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，对持续持有期少于7日的投资者将收取不低于1.5%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。 …… 新增： 7、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 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。赎回费用应根据法律法规规定的比例引入基金财产，未引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，对持续持有期少于7日的投资者将收取不低于1.5%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。 …… 新增： 7、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。	1、根据《流动性风险管理规定》第26条和第27条增加定期报告中应披露的内容。 2、根据《流动性风险管理规定》第18条补充相关投资限制。
第七部分基金份额的申购与赎回	七、拒绝或暂停申购的情形 在开放期内发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请： …… 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时。 …… 发生上述第1、2、3、5、6、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，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。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，且开放期按暂停申购的期间相应顺延。	七、拒绝或暂停申购的情形 在开放期内发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请： …… 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时。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。 …… 新增： 7、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%，或者受相关规避50%集中度的情形时。 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、单个投资人单日或单笔申购金额上限的。 …… 发生上述第1、2、3、5、6、9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，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。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，且开放期按暂停申购的期间相应顺延。	1、根据《流动性风险管理规定》第24条增加极端市场条件下的暂停接受申购申请的情形。
	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 在开放期内发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项： 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时。	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 在开放期内发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项： 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时。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。	根据《流动性风险管理规定》第24条增加极端市场条件下的暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项的情形。
	九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式	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： 在开放期内，如果基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人赎回申请超过前一估值日基金总份额20%的情形下，基金管理人可以延期办理赎回申请。基金管理人认为支付该基金份额持有人的全部赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，在当日接受该基金份额持有人的全部赎回的比例不低于前一估值日基金总份额20%的前提下，其他赎回申请可以延期办理。延期办理期限超过开放期的，开放期相应延长，延长的开放期内不办理申购，亦不接受新的赎回申请，即基金管理人仅为原开放期内因提交赎回申请超过基金总份额20%以上而被延期办理赎回的单个基金份额持有人办理赎回业务。	根据《流动性风险管理规定》第21条规定巨额赎回情形下单个基金份额持有人赎回申请超过一定比例的情形下基金管理人采取的措施。
第八部分基金合同当事人及权利义务	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 …… 法定代表人：闫冰竹 …… 联系电话：010-63620212	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 …… 法定代表人：夏英 …… 联系电话：400-00-95526	更新基金管理人及基金托管人的信息。
	二、投资范围 …… 本基金不投资于股票、权证等权益类资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）和可交换债券。基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%，但在每个开放期开始前十个交易日、开放期及开放期结束后十个交易日的期间内，基金投资不受上述比例限制；在开放期内，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。在封闭期内，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。	二、投资范围 …… 本基金不直接买入股票或权证。但可持有因可转换债券转股所形成的股票或可分离交易可转债分离交易的权证等资产。因上述原因持有的股票和权证等资产，在其可上市交易后不超过10个交易日的时间内卖出。基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%，但在每个开放期的前三个月、开放期及开放期结束后三个月的期间内，基金投资不受上述比例限制；在开放期内，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。在封闭期内，本基金不受上述5%的限制，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。	根据《流动性风险管理规定》第18条补充相关投资限制。
第十部分基金的投资	四、投资限制 1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： （2）在开放期内，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。在封闭期内，本基金不受上述5%的限制，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。 …… 除上述第（10）项外，因证券市场波动、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动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。法律法规另有规定的，从其规定。	四、投资限制 1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： （2）本基金开放期内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、存出保证金及应收申购款等；在封闭期内，本基金不受上述5%的限制； …… 新增： （11）在开放期内，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%，但因证券市场波动、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； （12）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； （13）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30%； 除上述第（2）、（9）、（11）、（12）项外，因证券市场波动、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动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。法律法规另有规定的，从其规定。	1、根据《流动性风险管理规定》第18条补充相关投资限制。 2、根据《流动性风险管理规定》第35条至第38条、第39条、第40条、第41条及第27条补充投资比例。
	五、申购和赎回的数量限制 新增： 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。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体规定请参见相关公告。	五、申购和赎回的数量限制 新增： 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。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体规定请参见相关公告。	根据《流动性风险管理规定》第19条补充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的措施。
	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 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。赎回费用应根据法律法规规定的比例引入基金财产，未引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，对持续持有期少于7日的投资者将收取不低于1.5%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。 …… 新增： 7、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 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。赎回费用应根据法律法规规定的比例引入基金财产，未引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，对持续持有期少于7日的投资者将收取不低于1.5%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。 …… 新增： 7、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。	1、根据《流动性风险管理规定》第26条和第27条增加定期报告中应披露的内容。 2、根据《流动性风险管理规定》第18条补充相关投资限制。
	七、拒绝或暂停申购的情形 在开放期内发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请： …… 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时。 …… 发生上述第1、2、3、5、6、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，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。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，且开放期按暂停申购的期间相应顺延。	七、拒绝或暂停申购的情形 在开放期内发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请： …… 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时。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。 …… 新增： 7、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%，或者受相规避50%集中度的情形时。 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、单个投资人单日或单笔申购金额上限的。 …… 发生上述第1、2、3、5、6、9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，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。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，且开放期按暂停申购的期间相应顺延。	1、根据《流动性风险管理规定》第24条增加极端市场条件下的暂停接受申购申请的情形。
	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 在开放期内发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项： 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时。	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 在开放期内发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项： 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时。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。	根据《流动性风险管理规定》第24条增加极端市场条件下的暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项的情形。
	九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式	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： 在开放期内，如果基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人赎回申请超过前一估值日基金总份额20%的情形下，基金管理人可以延期办理赎回申请。基金管理人认为支付该基金份额持有人的全部赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，在当日接受该基金份额持有人的全部赎回的比例不低于前一估值日基金总份额20%的前提下，其他赎回申请可以延期办理。延期办理期限超过开放期的，开放期相应延长，延长的开放期内不办理申购，亦不接受新的赎回申请，即基金管理人仅为原开放期内因提交赎回申请超过基金总份额20%以上而被延期办理赎回的单个基金份额持有人办理赎回业务。	根据《流动性风险管理规定》第21条规定巨额赎回情形下单个基金份额持有人赎回申请超过一定比例的情形下基金管理人采取的措施。
第八部分基金合同当事人及权利义务	二、基金托管人 （一）基金托管人简况 …… 法定代表人：夏英 …… 联系电话：010-63636222	二、基金托管人 （一）基金托管人简况 …… 法定代表人：闫冰竹 …… 联系电话：400-00-95526	更新基金管理人的相关信息。
	三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查 …… （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、融资比例进行监督。 …… （2）在开放期内，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。 …… 除上述第（10）项外，因证券市场波动、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动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。法律法规另有规定的，从其规定。	三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查 …… （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： 基金的投资组合比例为：债券资产占基金资产的比例不低于80%，但在每次开放期前三个月、开放期及开放期结束后三个月的期间内，基金投资不受上述比例限制；开放期内现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。在封闭期内，本基金不受上述5%的限制。 …… 除上述第（2）、（9）、（11）、（12）项外，因证券市场波动、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动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。法律法规另有规定的，从其规定。	1、根据《流动性风险管理规定》第18条补充相关投资限制。 2、根据《流动性风险管理规定》第25条至第26条增加临时报告应披露的内容。
第十三部分基金的投资	四、投资限制 1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： （2）在开放期内，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。在封闭期内，本基金不受上述5%的限制，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。 …… 除上述第（10）项外，因证券市场波动、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动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。法律法规另有规定的，从其规定。	四、投资限制 1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： （2）在开放期内，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。在封闭期内，本基金不受上述5%的限制，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。 …… 新增： （16）在开放期内，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%，但因证券市场波动、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）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； （18）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%； …… 除上述第（2）、（10）、（16）、（17）项外，因证券市场波动、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动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。法律法规另有规定的，从其规定。	1、根据《流动性风险管理规定》第18条补充相关投资限制。 2、根据《流动性风险管理规定》第35条至第36条以及第37条补充相关投资限制。
	五、估值依据及原则 1、估值依据 估值应符合本基金合同、《证券投资基金会计核算业务指引》、证监会计字[2007]121号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、中国证监会[2008]38号公告《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、中基协发[2014]24号《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》及其他法律、法规、行业协会自律规则的规定，如法律法规未做明确规定的，参照证券投资基金的行业通行做法处理。基金管理人、基金托管人的估值数据应依据合法的数据来源独立取得。 2、估值原则 （1）对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，应采用市价确定公允价值。估值日无市价，但最近交易日后经济环境未发生影响证券价格的重大事件的，应采用最近交易日的市价进行调整，确定公允价值。 （2）对不存在活跃市场的投资品种，应采用在市前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术得出的结果，应反映估值日在公平条件下进行正常商业交易所采用的交易价格。采用估值技术确定公允价值时，应尽可能使用市场参数，并应通过定期检验，确保估值技术的有效性。 （3）有充足理由表明按以上估值原则仍不能客观反映相关投资品种的公允价值的，基金管理人应根据具体情况与基金托管人进行商议，按最能恰当反映公允价值的价格估值。	五、估值依据及原则 1、估值依据 估值应符合本基金合同、《证券投资基金会计核算业务指引》、证监会计字[2007]121号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、中国证监会[2008]38号公告《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、中基协发[2014]24号《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》及其他法律、法规、行业协会自律规则的规定，如法律法规未做明确规定的，参照证券投资基金的行业通行做法处理。基金管理人、基金托管人的估值数据应依据合法的数据来源独立取得。 2、估值原则 （1）对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，应采用市价确定公允价值。估值日无市价，但最近交易日后经济环境未发生影响证券价格的重大事件的，应采用最近交易日的市价进行调整，确定公允价值。 （2）对不存在活跃市场的投资品种，应采用在市前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术得出的结果，应反映估值日在公平条件下进行正常商业交易所采用的交易价格。采用估值技术确定公允价值时，应尽可能使用市场参数，并应通过定期检验，确保估值技术的有效性。 （3）如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。	1、增加新的估值业务指导意见作为估值依据。 2、根据新估值依据修改估值原则。
第十五部分基金资产估值	六、暂停估值的情形 …… （三）基金托管人和基金管理人在信息披露中的职责和信息披露程序 …… 当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金相关信息： …… 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，应当暂停基金估值的； …… （四）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，应当暂停基金估值的情形。	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，应当暂停基金估值的情形。 …… （三）基金托管人和基金管理人在信息披露中的职责和信息披露程序 …… 当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金相关信息： …… 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，应当暂停基金估值的； …… （四）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，应当暂停基金估值的情形。	根据《流动性风险管理规定》第25条和第26条增加应披露的内容。
第十六部分基金份额的申购与赎回	七、暂停估值的情形	七、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，应当暂停基金估值的； …… （四）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，应当暂停基金估值的情形。	根据《流动性风险管理规定》第24条增加极端市场条件下的暂停估值的情形。
第十七部分基金份额的赎回	七、拒绝或暂停申购的情形 在开放期内发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请： …… 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时。 …… 发生上述第1、2、3、5、6、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，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。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，且开放期按暂停申购的期间相应顺延。	七、拒绝或暂停申购的情形 在开放期内发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请： …… 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时。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投资人的申购申请。 …… 新增： 7、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%，或者受相规避50%集中度的情形时。 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、单个投资人单日或单笔申购金额上限的。 …… 发生上述第1、2、3、5、6、9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，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。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，且开放期按暂停申购的期间相应顺延。	1、根据《流动性风险管理规定》第24条增加极端市场条件下的暂停接受申购申请的情形。 2、根据《流动性风险管理规定》第19条补充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的情形。
	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 在开放期内发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项： 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时。	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 在开放期内发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项： 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时。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，应当暂停接受基金赎回申请或延缓支付赎回款项。	根据《流动性风险管理规定》第24条增加极端市场条件下的暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项的情形。
	九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式	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： 在开放期内，如果基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人赎回申请超过前一估值日基金总份额20%的情形下，基金管理人可以延期办理赎回申请。基金管理人认为支付该基金份额持有人的全部赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，在当日接受该基金份额持有人的全部赎回的比例不低于前一估值日基金总份额20%的前提下，其他赎回申请可以延期办理。延期办理期限超过开放期的，开放期相应延长，延长的开放期内不办理申购，亦不接受新的赎回申请，即基金管理人仅为原开放期内因提交赎回申请超过基金总份额20%以上而被延期办理赎回的单个基金份额持有人办理赎回业务。	根据《流动性风险管理规定》第21条规定巨额赎回情形下单个基金份额持有人赎回申请超过一定比例的情形下基金管理人采取的措施。
第十八部分基金的信息披露	（七）临时报告 …… 新增： 26、本基金发生涉及申购、赎回事项调整，或潜在影响投资人赎回等重大事项； 27、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；	（七）临时报告 …… 新增： 26、本基金发生涉及申购、赎回事项调整，或潜在影响投资人赎回等重大事项； 27、基金管理人采用摆动定价机制进行估值； 28、基金管理人采用摆动定价机制进行估值。	根据《流动性风险管理规定》第25条和第26条增加临时报告应披露的内容。
	八、暂停或延迟披露基金相关信息的情形 当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金相关信息： …… 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，应当暂停基金估值的； …… （四）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，应当暂停基金估值的情形。	八、暂停或延迟披露基金相关信息的情形 当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金相关信息： …… 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，应当暂停基金估值的； …… （四）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，应当暂停基金估值的情形。	根据《流动性风险管理规定》第24条增加极端市场条件下的暂停估值的情形。

附件2：《中加纯债定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议修改方案》

章节	《托管协议》修改前条款	《托管协议》修改后条款	修改理由
一、基金托管协议当事人	（一）基金管理人 …… 法定代表人：闫冰竹	（一）基金管理人 …… 法定代表人：夏英	更新基金管理人的相关信息。
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》”）、《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》”）等有关法律法规，《中加纯债定期开放债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《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》”）、《证券投资基金信息披露管理