

景順長城基金管理有限公司

關於修改景順長城核心競爭力混合型證券投資基金

基金合同及託管協議的公告

公告送出日期：2018 年 3 月 23 日

本公告載有重要資料，務請閣下垂注。

閣下如對本公告的內容有任何疑問，應向獨立專業及理財人士徵詢意見。

作為景順長城核心競爭力混合型證券投資基金的管理人，景順長城基金管理有限公司就本公告在刊發日期所載資料的準確性負責。

除另有規定外，本函件內所用的詞彙與日期為 2018 年 2 月 3 日之章程所界定者具有相同涵義。

本公告目的乃通知閣下(身為本基金 H 類別基金份額持有人)有關就基金合同作出而於 2018 年 3 月 31 日起生效的若干修改。

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該《規定》的,應當在《規定》施行之日起 6 個月內予以調整。

為符合規定要求,基金管理人就基金合同作出的修改包括但不限於下述的項目:

- 澄清當基金管理人認為接受申購申請對現有基金份額持有人利益構成潛在重大不利影響時,基金管理人可設定若干申購上限、拒絕大額申購、暫停基金申購等;
- 新增基金管理人可經與基金託管人協商確定後暫停接受申購或贖回申請、延緩支付贖回款項、或暫停估值的情形,即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的情形;
- 新增基金管理人可拒絕或暫停申購的情形,即當基金管理人接受某筆或者某些申購申請有可能導致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(該情形原本已適用於 H 類別基金份額持有人);
- 澄清本基金的現金投資並不包括結算備付金、存出保證金和應收申購款等;
- 新增《規定》要求的若干投資限制,包括:
 - 基金管理人管理的全部開放式基金(包括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,不超過該上市公司可流通股票的 15%;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,不超過該上市公司可流通股票流通股票的 30%;
 - 本基金主動投資於流動性受限資產的市值合計不超過基金資產的 15%;因基金管理人控制範圍之外的因素導致基金不符合該投資限制的,基金管理人不得主動新增流動性受限資產的投資;
 - 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投資範圍保持一致;

- 若干估值政策的修改 - 即流通受限的股票須按監管機構或行業協會有關規定確定公允價值；及
- 新增若干有關大額持有本基金的披露要求 - 當 H 類別基金份額名義持有人持有基金份額達到或超過基金總份額 20% 的情形，基金管理人應當在定期報告披露有關該 H 類別基金份額名義持有人的若干資料。

以上修改經與基金託管人中國農業銀行股份有限公司協商一致，毋須按基金合同經份額持有人預先批准。經修改的基金合同已報監管機構備案。託管協議亦進行了修改。有關基金合同和託管協議修改的詳情，請參閱本公告附件。

修改不會對本基金份額持有人的權利或權益造成重大損害，亦不構成本基金投資策略及政策上任何重大變動，亦不會影響本基金管理涉及的開支及收費水平，並不會導致本基金的風險取向產生任何變動。

上述修改所涉及的開及費用將由基金管理人及香港主銷售機構及代表承擔。

章程、香港補充文件及產品資料概要將在適當的時候進行修改。

其他事項

本基金的章程、香港補充文件、產品資料概要、最新及本基金經審核年度報告、未經審核半年度報告及未經審核季度報告及本公告的電子版本可於香港主銷售機構及代表的網站 www.invesco.com.hk¹ 查閱，而其以及經修訂的基金合同的印刷本可於任何香港營業日的正常營業時間內在香港主銷售機構及代表的註冊辦事處免費查閱，地址為香港中環花園道三號冠君大廈 41 樓，且可免費索取副本（惟索取基金合同副本或須繳納合理費用）。

閣下如有任何疑問或對本函內容有任何問題，請致電景順基金熱線：(+852) 3191 8282。

投資者應於買賣基金份額或就基金份額作任何決定前僅慎考慮並徵詢專業及理財人士意見。

¹此網站未經證監會審閱。

附件：

關於根據《公開募集開放式證券投資基金流動性風險管理規定》修改基金合同及託管協議的內容說明

一、基金合同主要修訂內容

章節	修訂前	修訂後
一、前言	2、訂立本基金合同的依據是《中華人民共和國證券投資基金法》（以下簡稱“《基金法》”）、《中華人民共和國合同法》、《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》”）和其他有關法律法規。	2、訂立本基金合同的依據是《中華人民共和國證券投資基金法》（以下簡稱“《基金法》”）、《中華人民共和國合同法》、《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》”）、 <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> 和其他有關法律法規。
二、釋義		增加： <u>67、《流動性風險管理規定》：指中國證監會 2017 年 8 月 31 日頒佈、同年 10 月 1 日實施的《公開募集開放式證券投資基金流動性風險管理規定》及頒佈機關對其不時做出的修訂</u> <u>68、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>
六、基金份額的申購與贖回	(五)申購和贖回的數額限制 1、基金管理人可以規定基金投資者首次申購和每筆申購的最低金額以及每筆贖回的最低份額，具體規定請參見招募說明書。 2、基金管理人可以規定基金投資者每個交易帳戶的最低基金份額餘額，具體規定請參見招募說明書。 3、基金管理人可以規定單個投資者累計持有的基金份額數量或持有的基金份額占基金份額總數的比例上限，具體規定請參見招募說明書。 4、基金管理人可以根據市場情況，在法律法規允許的情況下，調整上述規定的	(五)申購和贖回的數額限制 1、基金管理人可以規定基金投資者首次申購和每筆申購的最低金額以及每筆贖回的最低份額，具體規定請參見招募說明書。 2、基金管理人可以規定基金投資者每個交易帳戶的最低基金份額餘額，具體規定請參見招募說明書。 3、基金管理人可以規定單個投資者累計持有的基金份額數量或持有的基金份額占基金份額總數的比例上限，具體規定請參見招募說明書。 4、基金管理人可以根據市場情況，在法律法規允許的情況下，調整上述規定的

	數量或比例限制。基金管理人必須在調整前依照有關規定在指定媒體上公告。	數量或比例限制。基金管理人必須在調整前依照有關規定在指定媒體上公告。 <u>5. 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。基金管理人基於投資運作與風險控制的需要，可採取上述措施對基金規模予以控制。具體請參見相關公告。</u>
六、基金份額的申購與贖回	(六)申購和贖回的價格、費用及其用途 6、本基金的申購費率最高不超過5%，贖回費率最高不超過基金份額贖回金額的5%。本基金的申購費率、贖回費率和收費方式由基金管理人根據基金合同的規定確定，並在招募說明書中列示。基金管理人可以在履行相關手續後，在基金合同約定的範圍內調整申購、贖回費率或調整收費方式，基金管理人應于新的費率或收費方式實施日前依照《資訊披露辦法》的有關規定在指定媒體上公告。	(六)申購和贖回的價格、費用及其用途 6、本基金的申購費率最高不超過5%，贖回費率最高不超過基金份額贖回金額的5%。<u>對於持續持有期少於7日的A類別基金份額投資者，本基金將收取不低於1.5%的贖回費並全額計入基金財產。</u>本基金的申購費率、贖回費率和收費方式由基金管理人根據基金合同的規定確定，並在招募說明書中列示。基金管理人可以在履行相關手續後，在基金合同約定的範圍內調整申購、贖回費率或調整收費方式，基金管理人應于新的費率或收費方式實施日前依照《資訊披露辦法》的有關規定在指定媒體上公告。
六、基金份額的申購與贖回	(八)拒絕或暫停申購的情形 發生下列情況時，基金管理人可拒絕或暫停接受基金投資者的申購申請： 1、因不可抗力導致基金無法正常運作； 2、證券交易所交易時間臨時停市，導致基金管理人無法計算當日基金資產淨值； 3、發生本基金合同規定的暫停基金資產估值情況； 4、基金管理人、基金託管人、基金銷售機構或註冊登記機構的技術保障不充分或人員傷亡等異常情況導致基金銷售系統或基金註冊登記系統或基金會計系統無法正常運行； 5、基金資產規模過大，使基金管理人無法找到合適的投資品種，或基金管理人認為會損害已有基金份額持有人利益的申購； 6、基金管理人認為會有損于現有基金份額持有人利益的某筆申購； 7、因銷售地區不同導致本基金結算安排無法得到滿足； 8、法律法規規定或中國證監會認定的其他情形。	(八)拒絕或暫停申購的情形 發生下列情況時，基金管理人可拒絕或暫停接受基金投資者的申購申請： 1、因不可抗力導致基金無法正常運作； 2、證券交易所交易時間臨時停市，導致基金管理人無法計算當日基金資產淨值； 3、發生本基金合同規定的暫停基金資產估值情況；<u>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，經與基金託管人協商確定後，基金管理人應當暫停接受申購申請。</u> 4、基金管理人、基金託管人、基金銷售機構或註冊登記機構的技術保障不充分或人員傷亡等異常情況導致基金銷售系統或基金註冊登記系統或基金會計系統無法正常運行； 5、基金資產規模過大，使基金管理人無法找到合適的投資品種，或基金管理人認為會損害已有基金份額持有人利益的申購； 6、基金管理人認為會有損于現有基金份額持有人利益的某筆申購；

	發生上述除第 6 項以外的暫停申購情形且基金管理人決定暫停申購時，基金管理人應當根據有關規定在指定媒體上刊登暫停申購公告。如果基金投資者的申購申請被拒絕，被拒絕的申購款項將退還給投資者。在暫停申購的情況消除時，基金管理人應及時恢復申購業務的辦理。	7、因銷售地區不同導致本基金結算安排無法得到滿足； <u>8、基金管理人接受某筆或者某些申購申請有可能導致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> 9、法律法規規定或中國證監會認定的其他情形。 發生上述除第 6、8 項以外的暫停申購情形且基金管理人決定暫停申購時，基金管理人應當根據有關規定在指定媒體上刊登暫停申購公告。如果基金投資者的申購申請被<u>全部或部分拒絕的</u>，被拒絕的申購款項將退還給投資者。在暫停申購的情況消除時，基金管理人應及時恢復申購業務的辦理。
六、基金份額的申購與贖回	(九)暫停贖回或延緩支付贖回款項的情形 發生下列情形時，基金管理人可暫停接受基金投資者的贖回申請或延緩支付贖回款項： 1、因不可抗力導致基金管理人不能支付贖回款項。 2、證券交易所交易時間依法決定臨時停市，導致基金管理人無法計算當日基金資產淨值。 3、連續兩個或兩個以上開放日發生巨額贖回，導致本基金的現金支付出現困難。 4、發生本基金合同規定的暫停基金資產估值情況。 5、法律法規規定或中國證監會認定的其他情形。	(九)暫停贖回或延緩支付贖回款項的情形 發生下列情形時，基金管理人可暫停接受基金投資者的贖回申請或延緩支付贖回款項： 1、因不可抗力導致基金管理人不能支付贖回款項。 2、證券交易所交易時間依法決定臨時停市，導致基金管理人無法計算當日基金資產淨值。 3、連續兩個或兩個以上開放日發生巨額贖回，導致本基金的現金支付出現困難。 4、發生本基金合同規定的暫停基金資產估值情況。<u>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，經與基金託管人協商確定後，基金管理人應當暫停接受贖回申請或延緩支付贖回款項。</u> 5、法律法規規定或中國證監會認定的其他情形。
六、基金份額的申購與贖回	(十)巨額贖回的情形及處理方式 2、巨額贖回的處理方式 (2) 部分順延贖回：當基金管理人認為支付基金投資者的贖回申請有困難或認為支付投資者的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，基金管理人在當日接受贖回比例不低於前一日基金總份額的 10%的前提下，對其餘贖回申請延期辦理。對於當日的贖回申請，應當按基金份額持有人提交的每筆贖回申請量占贖回申請總量的比例，確定該筆贖回申請當日部分確認的贖回份額；	(十)巨額贖回的情形及處理方式 2、巨額贖回的處理方式 (2) 部分順延贖回：當基金管理人認為支付基金投資者的贖回申請有困難或認為支付投資者的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，基金管理人在當日接受贖回比例不低於前一日基金總份額的 10%的前提下，對其餘贖回申請延期辦理。對於當日的贖回申請，應當按基金份額持有人提交的每筆贖回申請量占贖回申請總量的比例，確定該筆贖回申請當日部分確認的贖回份額；

	對於 A 類別基金份額的基金投資者未能贖回部分，投資者在提交贖回申請時可以選擇延期贖回或取消贖回。A 類別基金份額選擇延期贖回的，將自動轉入下一個開放日繼續贖回，直到全部贖回為止；A 類別基金份額選擇取消贖回的，當日未獲贖回的部分申請將被撤銷。延期的贖回申請與下一開放日贖回申請一併處理，無優先權並以該開放日的基金份額淨值為基礎計算贖回金額，並以此類推，直到全部贖回為止。如基金投資者在提交贖回申請時未作明確選擇，投資者未能贖回部分作自動延期贖回處理。對於 H 類別基金份額的未受理部分，預設採用延期贖回方式，並自動轉入下一個 H 類基金份額的開放日繼續贖回，直到全部贖回為止；延期的贖回申請與下一 H 類基金份額開放日的贖回申請一併處理，無優先權並以下一 H 類基金份額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。順延贖回不受 H 類基金份額單筆贖回最低份額的限制。在延期贖回期內，基金管理人有权根據香港銷售機構的申請，取消 H 份額類別的部分或全部延期贖回申請。 當發生巨額贖回並延期辦理時，基金管理人將依據中國證監會與香港證監會的相關要求，進行相關披露。	對於 A 類別基金份額的基金投資者未能贖回部分，投資者在提交贖回申請時可以選擇延期贖回或取消贖回。A 類別基金份額選擇延期贖回的，將自動轉入下一個開放日繼續贖回，直到全部贖回為止；A 類別基金份額選擇取消贖回的，當日未獲贖回的部分申請將被撤銷。延期的贖回申請與下一開放日贖回申請一併處理，無優先權並以該開放日的基金份額淨值為基礎計算贖回金額，並以此類推，直到全部贖回為止。如基金投資者在提交贖回申請時未作明確選擇，投資者未能贖回部分作自動延期贖回處理。對於 H 類別基金份額的未受理部分，預設採用延期贖回方式，並自動轉入下一個 H 類基金份額的開放日繼續贖回，直到全部贖回為止；延期的贖回申請與下一 H 類基金份額開放日的贖回申請一併處理，無優先權並以下一 H 類基金份額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。順延贖回不受 H 類基金份額單筆贖回最低份額的限制。在延期贖回期內，基金管理人有权根據香港銷售機構的申請，取消 H 份額類別的部分或全部延期贖回申請。 <u>若進行上述延期辦理，在單個 A 類別基金份額持有人超過上一工作日基金總份額 20% 以上的贖回申請的情形下，基金管理人可以對該基金份額持有人超過 20% 以上的部分延期辦理贖回申請。對於其餘當日非自動延期辦理的贖回申請，應當按單個帳戶非自動延期辦理的贖回申請量占非自動延期辦理的贖回申請總量的比例，確定當日受理的贖回份額。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。選擇延期贖回的，將自動轉入下一個開放日繼續贖回，直到全部贖回為止；選擇取消贖回的，當日未獲受理的部分贖回申請將被撤銷。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。如投資人在提交贖回申請時未作明確選擇，投資人未能贖回部分作自動延期贖回處理。部分延期贖回不受單筆贖回最低份額的限制。</u> 當發生巨額贖回並延期辦理時，基金管理人將依據中國證監會與香港證監會的相關要求，進行相關披露。
--	--	---

七、基金合同當事人及權利義務	(一)基金管理人 1、基金管理人簡況 法定代表人：趙如冰	(一)基金管理人 1、基金管理人簡況 法定代表人：楊光裕
七、基金合同當事人及權利義務	(二)基金託管人 1、基金託管人簡況 法定代表人：劉士餘	(二)基金託管人 1、基金託管人簡況 法定代表人：周慕冰
十二、基金的投資	(三)投資範圍 本基金投資範圍包括國內依法發行上市的股票（包含中小板、創業板及其他經中國證監會核准上市的股票）、債券、貨幣市場工具、權證、資產支援證券、股指期貨及法律法規或中國證監會允許基金投資的其他金融工具，但須符合中國證監會的相關規定。如法律法規或監管機構以後允許基金投資的其它品種，本基金管理人在履行適當程式後，可以將其納入投資範圍。 本基金將基金資產的 60%-95%投資于股票等權益類資產（其中，權證投資比例不超過基金資產淨值的 3%），將基金資產的 5%-40%投資于債券和現金等固定收益類品種（其中，現金或到期日在一年以內的政府債券不低於基金資產淨值的 5%。 本基金投資於具有核心競爭力的公司股票資產不低於基金股票資產的 80%。 本基金參與股指期貨交易，應符合法律法規規定和基金合同約定的投資限制並遵守相關期貨交易所的業務規則。	(三)投資範圍 本基金投資範圍包括國內依法發行上市的股票（包含中小板、創業板及其他經中國證監會核准上市的股票）、債券、貨幣市場工具、權證、資產支援證券、股指期貨及法律法規或中國證監會允許基金投資的其他金融工具，但須符合中國證監會的相關規定。如法律法規或監管機構以後允許基金投資的其它品種，本基金管理人在履行適當程式後，可以將其納入投資範圍。 本基金將基金資產的 60%-95%投資于股票等權益類資產（其中，權證投資比例不超過基金資產淨值的 3%），將基金資產的 5%-40%投資于債券和現金等固定收益類品種（其中，現金或到期日在一年以內的政府債券不低於基金資產淨值的 5%，<u>其中現金不包括結算備付金、存出保證金和應收申購款等。</u>）。 本基金投資於具有核心競爭力的公司股票資產不低於基金股票資產的 80%。 本基金參與股指期貨交易，應符合法律法規規定和基金合同約定的投資限制並遵守相關期貨交易所的業務規則。
十二、基金的投資	(八) 投資限制 5. 現金或到期日在一年以內的政府債券不低於基金資產淨值的 5%； 本基金投資股指期貨的，每個交易日日終在扣除股指期貨合約需繳納的交易保證金後，應當保持不低於基金資產淨值 5%的現金或到期日在一年以內的政府債券；	(八) 投資限制 5. 現金或到期日在一年以內的政府債券不低於基金資產淨值的 5%； 本基金投資股指期貨的，每個交易日日終在扣除股指期貨合約需繳納的交易保證金後，應當保持不低於基金資產淨值 5%的現金或到期日在一年以內的政府債券，<u>其中現金不包括結算備付金、存出保證金和應收申購款等；</u>
十二、基金的投資		增加： <u>11、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，不超過該上市公司可流通股票的 15%； 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，不超過該上市公司可流通股票的 30</u>

		%; <u>12、本基金主動投資於流動性受限資產的市值合計不超過基金資產的 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本項所規定的比例限制的，基金管理人不得主動新增流動性受限資產的投資；</u> <u>13、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投資範圍保持一致；</u>
十二、基金的投資	基金管理人應當自基金合同生效之日起 6 個月內使基金的投資組合比例符合基金合同的有關約定。因證券或期貨市場波動、上市公司合併、基金規模變動等基金管理人之外的因素致使基金投資比例不符合上述投資比例的，基金管理人應當在 10 個交易日內進行調整。法律法規另有規定時，從其規定。	基金管理人應當自基金合同生效之日起 6 個月內使基金的投資組合比例符合基金合同的有關約定。 <u>除上述第 5、12、13 項外</u> ，因證券或期貨市場波動、上市公司合併、基金規模變動等基金管理人之外的因素致使基金投資比例不符合上述投資比例的，基金管理人應當在 10 個交易日內進行調整。法律法規另有規定時，從其規定。
十四、基金資產的估值	(四) 估值方法 1) 股票估值方法： 2) 未上市股票的估值： 3) 首次公開發行有明確鎖定期期的股票，同一股票在交易所上市後，按交易所上市的同一股票的估值方法估值； 4) 非公開發行有明確鎖定期期的股票，按監管機構或行業協會有關規定確定公允價值。	(四) 估值方法 1) 股票估值方法： 2) 未上市股票的估值： <u>3) 流通受限的股票，包括非公開發行股票、首次公開發行股票時公司股東公開發售股份、通過大宗交易取得的帶限售期的股票等（不包括停牌、新發行未上市、回購交易中的質押券等流通受限股票），按監管機構或行業協會有關規定確定公允價值。</u>
第十四部分 基金資產的估值	(七) 暫停估值的情形	(七) 暫停估值的情形 增加： <u>4、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時，經與基金託管人協商確認後，應當暫停估值；</u>
第十八部分 基金的資訊披露	6、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	6、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 增加： <u>基金管理人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> <u>報告期內出現 A 類別基金份額單一投資者或 H 類別基金份額名義持有人持有基金份額達到或超過基金總份額 20% 的情形，為保障其他投資者利益，基金管理人至少應當在定期報告“影響投資者決策的</u>

		<u>其他重要資訊”項下披露該A類別基金份額投資者或該H類別基金份額名義持有人的類別、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，中國證監會認定的特殊情形除外。</u>
第十八部分 基金的資訊 披露	7、臨時報告	7、臨時報告 增加： <u>(27) 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>
第二十四部分 基金合同 內容摘要		摘要部分也做了相應修改，與合同修訂內容保持一致。

二、對基金託管協議的修改內容

章節	修訂前	修訂後
一、基金託管協議當事人	(一) 基金管理人 法定代表人：趙如冰	(一) 基金管理人 法定代表人：楊光裕
一、基金託管協議當事人	(二) 基金託管人 法定代表人：劉士餘	(二) 基金託管人 法定代表人：周慕冰
三、基金託管人對基金管理人的業務監督和核查	(一) 基金託管人根據有關法律法規的規定及基金合同的約定，對基金投資範圍、投資對象進行監督。基金合同明確約定基金投資風格或證券選擇標準的，基金管理人應按照基金託管人要求的格式提供投資品種池和交易對手庫，以便基金託管人運用相關技術系統，對基金實際投資是否符合基金合同關於證券選擇標準的約定進行監督，對存在疑義的事項進行核查。 本基金的投資範圍主要限於具有良好流動性的金融工具，包括國內依法發行上市的股票（包含中小板、創業板及其他經中國證監會核准上市的股票）、債券、貨幣市場工具、權證、資產支持證券、股指期貨及法律法規或中國證監會允許基金投資的其他金融工具，但須符合中國證監會的相關規定。如法律法規或監管機構以後允許基金投資的其它品種，本基金管理人在	(一) 基金託管人根據有關法律法規的規定及基金合同的約定，對基金投資範圍、投資對象進行監督。基金合同明確約定基金投資風格或證券選擇標準的，基金管理人應按照基金託管人要求的格式提供投資品種池和交易對手庫，以便基金託管人運用相關技術系統，對基金實際投資是否符合基金合同關於證券選擇標準的約定進行監督，對存在疑義的事項進行核查。 本基金的投資範圍主要限於具有良好流動性的金融工具，包括國內依法發行上市的股票（包含中小板、創業板及其他經中國證監會核准上市的股票）、債券、貨幣市場工具、權證、資產支援證券、股指期貨及法律法規或中國證監會允許基金投資的其他金融工具，但須符合中國證監會的相關規定。如法律法規或監管機構

	履行適當程式後，可以將其納入投資範圍。 本基金的配置比例為： 本基金將基金資產的 60%-95%投資于股票等權益類資產（其中，權證投資比例不超過基金資產淨值的 3%），將基金資產的 5%-40%投資于債券和現金等固定收益類品種（其中，現金或到期日在一年以內的政府債券不低於基金資產淨值的 5%。 本基金參與股指期貨交易，應符合法律法規規定和基金合同約定的投資限制並遵守相關期貨交易所的業務規則。	以後允許基金投資的其它品種，本基金管理人在履行適當程式後，可以將其納入投資範圍。 本基金的配置比例為： 本基金將基金資產的 60%-95%投資于股票等權益類資產（其中，權證投資比例不超過基金資產淨值的 3%），將基金資產的 5%-40%投資于債券和現金等固定收益類品種（其中，現金或到期日在一年以內的政府債券不低於基金資產淨值的 5%，<u>其中現金不包括結算備付金、存出保證金和應收申購款等</u>）。 本基金參與股指期貨交易，應符合法律法規規定和基金合同約定的投資限制並遵守相關期貨交易所的業務規則。
三、基金託管人對基金管理人的業務監督和核查	（二）基金託管人根據有關法律法規的規定及基金合同的約定，對基金投資、融資、融券比例進行監督。基金託管人按下述比例和調整期限進行監督： 3、現金或到期日在一年以內的政府債券不低於基金資產淨值的 5%；本基金投資股指期貨的，每個交易日日終在扣除股指期貨合約需繳納的交易保證金後，應當保持不低於基金資產淨值 5%的現金或到期日在一年以內的政府債券；	（二）基金託管人根據有關法律法規的規定及基金合同的約定，對基金投資、融資、融券比例進行監督。基金託管人按下述比例和調整期限進行監督： 3、現金或到期日在一年以內的政府債券不低於基金資產淨值的 5%；本基金投資股指期貨的，每個交易日日終在扣除股指期貨合約需繳納的交易保證金後，應當保持不低於基金資產淨值 5%的現金或到期日在一年以內的政府債券，<u>其中現金不包括結算備付金、存出保證金和應收申購款等</u>； 增加： <u>9、本基金管理人管理且由基金託管人託管的全部開放式基金（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，不超過該上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理且由基金託管人託管的全部投資組合持有一家上市公司發行的可流通股票，不超過該上市公司可流通股票的 30%；</u> <u>10、本基金主動投資於流動性受限資產的市值合計不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本項所規定的比例限制的，基金管理人不得主動新增流動性受限資產的投資；</u> <u>11、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本基金合同約定的投資範圍保持一致；</u>

三、基金託管人對基金管理人的業務監督和核查	因證券或期貨市場波動、上市公司合併、基金規模變動等基金管理人之外的因素致使基金投資比例不符合 <u>上述 1-5 項以及 7-10 項</u> 規定的投資比例的，基金管理人應當在 10 個交易日內進行調整。	<u>除上述 3、6、10、11 項外</u> ，因證券或期貨市場波動、上市公司合併、基金規模變動等基金管理人之外的因素致使基金投資比例不符合上述規定的投資比例的，基金管理人應當在 10 個交易日內進行調整。
三、基金託管人對基金管理人的業務監督和核查	(七) 基金託管人根據有關法律法規的規定及基金合同的約定，對基金投資流通受限證券進行監督。 2、流通受限證券，包括由《上市公司證券發行管理辦法》規範的非公開發行股票、公開發行股票網下配售部分等在發行時明確一定期限鎖定期的可交易證券，不包括由於發佈重大消息或其他原因而臨時停牌的證券、已發行未上市證券、回購交易中的質押券等流通受限證券。	(七) 基金託管人根據有關法律法規的規定及基金合同的約定，對基金投資流通受限證券進行監督。 2、流通受限證券<u>與上文流動性受限資產並不完全一致</u>，包括由《上市公司證券發行管理辦法》規範的非公開發行股票、公開發行股票網下配售部分等在發行時明確一定期限鎖定期的可交易證券，不包括由於發佈重大消息或其他原因而臨時停牌的證券、已發行未上市證券、回購交易中的質押券等流通受限證券。
八、基金資產淨值計算和會計核算	(二) 基金資產估值方法和特殊情形的處理 2、估值方法 2) 未上市股票的估值。 3) 首次公開發行有明確鎖定期的股票，同一股票在交易所上市後，按估值日在證券交易所上市的同一股票的市價進行估值； 4) 非公開發行的且在發行時明確一定期限鎖定期的股票，按監管機構或行業協會有關規定確定公允價值。	(二) 基金資產估值方法和特殊情形的處理 2、估值方法 2) 未上市股票的估值。 <u>3) 流通受限的股票，包括非公開發行股票、首次公開發行股票時公司股東公開發售股份、通過大宗交易取得的帶限售期的股票等（不包括停牌、新發行未上市、回購交易中的質押券等流通受限股票），按監管機構或行業協會有關規定確定公允價值。</u>
八、基金資產淨值計算和會計核算	(四) 暫停估值與公告基金份額淨值的情形	(四) 暫停估值與公告基金份額淨值的情形 增加： <u>(4) 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時，經與基金託管人協商確認後，應當暫停估值；</u>
十、基金資訊披露	(三) 基金託管人和基金管理人在資訊披露中的職責和資訊披露程式 1.職責 基金託管人和基金管理人在資訊披露過程中應以保護基金份額持有人利益為宗旨，誠實信用，嚴守秘密。基金管理人負責辦理與基金有關的資訊披露事宜，對於本章第（二）條規定的應由基金託管人覆核的事項，應經基金託管人覆核無誤後，由基金管理人予以公佈。 基金管理人應當在中國證監會規定的時間內，將應予披露的基金資訊通過中國證監會指定的全國性報刊（以下簡稱“指	(三) 基金託管人和基金管理人在資訊披露中的職責和資訊披露程式 1.職責 基金託管人和基金管理人在資訊披露過程中應以保護基金份額持有人利益為宗旨，誠實信用，嚴守秘密。基金管理人負責辦理與基金有關的資訊披露事宜，對於本章第（二）條規定的應由基金託管人覆核的事項，應經基金託管人覆核無誤後，由基金管理人予以公佈。 基金管理人應當在中國證監會規定的時間內，將應予披露的基金資訊通過中國證監會指定的全國性報刊（以下簡稱

	定報刊”）和基金管理人的互聯網網站等媒介披露。根據法律法規應由基金託管人公開披露的資訊，基金託管人將通過指定報刊和基金託管人的互聯網網站公開披露。 當出現下述情況時，基金管理人和基金託管人可暫停或延遲披露基金資訊： (1) 不可抗力； (2) 法律法規、基金合同或中國證監會規定的情況。	“指定報刊”）和基金管理人的互聯網網站等媒介披露。根據法律法規應由基金託管人公開披露的資訊，基金託管人將通過指定報刊和基金託管人的互聯網網站公開披露。 當出現下述情況時，基金管理人和基金託管人可暫停或延遲披露基金資訊： (1) 不可抗力； <u>(2) 發生基金合同約定的暫停估值的情形；</u> (3) 法律法規、基金合同或中國證監會規定的情況。
--	---	---