

易方达基金管理有限公司关于易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金（LOF）修订基金合同、托管协议部分条款及调整赎回费相关规则的公告

根据《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《管理规定》）及基金合同和托管协议的有关规定，经与基金托管人协商一致并报监管机构备案，易方达基金管理有限公司决定对易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金（LOF）（以下简称本基金）的基金合同、托管协议进行修订，并对本基金赎回费相关规则进行调整。现将相关事宜公告如下：

一、基金合同和托管协议修订

基金合同、托管协议具体修订内容详见附件《易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金（LOF）基金合同、托管协议修订说明》。本次修订属于基金合同约定的基金管理人与基金托管人可以协商一致变更基金合同的事项，并已履行规定程序，符合相关法律法规及基金合同的规定。

二、赎回费相关规则调整

鉴于《管理规定》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”，基金管理人将本基金（包含场内份额、场外份额）持续持有期少于 7 日（不含）对应的赎回费率调整为 1.5%。上述对投资者收取的赎回费计入基金财产的比例调整为 100%。

三、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 日起生效。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。

基金管理人将在届时更新本基金招募说明书时一并更新相关内容。

四、其他事项

1. 投资者可通过以下途径咨询有关详情

客户服务电话：400-881-8088

网址：www.efunds.com.cn

2. 风险提示：

(1) 本次基金管理人系根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修订本基金的《基金合同》和《托管协议》，所修订内容可能对本基金投资运作及投资者办理基金申购、赎回业务产生一定影响，包括且不限于：出于流动性风险管理需要增加或调整了基金的部分投资限制规定；对投资者持有本基金（包含场内份额、场外份额）少于 7 日（不含）收取 1.5% 的短期赎回费；在规定的特定情形下可能会对投资者的申购/赎回申请数量进行限制、临时拒绝或暂停申购/赎回申请、对部分赎回申请进行延期办理等，由此可能导致投资者的申购/赎回申请无法全部及时处理，从而可能影响投资者的资金安排及投资计划。敬请投资者关注以上变化和影响，并仔细阅读本基金修订后的基金合同及相关法律文件，审慎进行投资决策。

(2) 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。销售机构根据法规要求对投资者类别、风险承受能力和基金的风险等级进行划分，并提出适当性匹配意见。投资者在投资基金前应认真阅读《基金合同》和《招募说明书》等基金法律文件，全面认识基金产品的风险收益特征，在了解产品情况及听取销售机构适当性意见的基础上，根据自身的风险承受能力、投资期限和投资目标，对基金投资作出独立决策，选择合适的基金产品。

特此公告。

附件：《易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金（LOF）基金合同、托管

协议修订说明》

易方达基金管理有限公司

2018年3月22日

附件：易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金（LOF）基金合同、托管协议修订说明

（一）基金合同

序号	章节	原文	修订
1	第一部分 前言	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》”）、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》、《关于实施〈合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法〉有关问题的通知》、《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。	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》”）、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》、《关于实施〈合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法〉有关问题的通知》、《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“《管理规定》”）和其他有关法律法规。
2	第二部分 释义	无	新增释义： “14、《管理规定》：指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《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” 68、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”
3	第七部分 基金份额的 申购与赎回	五、申购和赎回的数量限制 1、基金管理人可以规定投资人首次申购和每次申购的最低金额以及每次赎回的最低份额，具体规定请参见	五、申购和赎回的数量限制 1、基金管理人可以规定投资人首次申购和每次申购的最低金额以及每次赎回的最低份额，具体规定请参见

		<p>招募说明书或相关公告。</p> <p>2、基金管理人可以规定投资人每个基金交易账户的最低基金份额余额，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</p> <p>3、基金管理人可以规定单个投资人累计持有的基金份额上限、当日金额申购上限，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</p> <p>4、基金管理人可在不违反法律法规的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。</p>	<p>招募说明书或相关公告。</p> <p>2、基金管理人可以规定投资人每个基金交易账户的最低基金份额余额，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</p> <p>3、基金管理人可以规定单个投资人累计持有的基金份额上限、单日或单笔申购金额上限，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</p> <p>4、基金管理人有权规定本基金的总规模限额，以及单日申购金额上限和净申购比例上限，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</p> <p>5、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。具体请参见相关公告。</p> <p>6、基金管理人可在不违反法律法规的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制，或者新增基金规模控制措施。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。</p>
4	第七部分 基金份额的 申购与赎回	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</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。所收取的赎回费归入基金财产的比例不得低于法律法规或中国证监会规定的比例下限，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。</p>	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</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。所收取的赎回费归入基金财产的比例不得低于法律法规或中国证监会规定的比例下限，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。基金管理人对持续持有期少于 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。</p>
5	第七部分 基金份额的 申购与赎回	<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>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： 发生上述第 1、2、3、5、6、7、</p>	<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>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： 新增：“8、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一</p>

		<p>8 项情形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。</p>	<p>投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形时。</p> <p>9、当一笔新的申购申请被确认成功，使本基金总规模超过基金管理人规定的本基金总规模上限时；或使本基金单日申购金额或净申购比例超过基金管理人规定的当日申购金额或净申购比例上限时；或该投资人累计持有的份额超过单个投资人累计持有的份额上限时；或该投资人当日申购金额超过单个投资人单日或单笔申购金额上限时。</p> <p>10、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暂停接受基金申购申请的措施。”</p> <p>发生上述第 1、2、3、5、6、7、9、10、11 项情形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。</p>
6	第七部分 基金份额的 申购与赎回	无	<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>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：</p> <p>新增：“8、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>
7	第七部分 基金份额的	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

	<p>申购与赎回</p>	<p>.....</p> <p>(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的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，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，可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继续赎回，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。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并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。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的限制。深圳证券交易所、登记结算机构另有规定的，从其规定。</p>	<p>.....</p> <p>(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的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，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，可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继续赎回，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。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并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。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的限制。深圳证券交易所、登记结算机构另有规定的，从其规定。</p> <p>若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额 10%的，基金管理人有权对该单个基金份额持有人超出该比例的赎回申请实施延期办理，对该单个基金份额持有人剩余赎回申请与其他账户赎回申请按前述条款处理。</p>
8	<p>第十三部分 基金的投资</p>	<p>二、投资范围</p> <p>本基金投资于股票的比例不低于基金资产的 80%；本基金投资标的指数成份股、备选成份股、跟踪同一标的指数的期货期权等相关衍生工具的合约市值的资产不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的</p>	<p>二、投资范围</p> <p>本基金投资于股票的比例不低于基金资产的 80%；本基金投资标的指数成份股、备选成份股、跟踪同一标的指数的期货期权等相关衍生工具的合约市值的资产不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的</p>

		5%。若法律法规的相关规定发生变更或监管机构允许，本基金可对上述资产配置比例进行调整。	5%， 现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等 。若法律法规的相关规定发生变更或监管机构允许，本基金可对上述资产配置比例进行调整。
9	第十三部分 基金的投资	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>5、基金管理人应当自《基金合同》生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合《基金合同》的约定。上述期间，基金的投资范围、投资策略应当符合《基金合同》的约定。因证券市场波动、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不符合《基金合同》约定的投资比例规定的，应当在超过比例后三十个工作日内采用合理的商业措施进行调整，以符合投资比例限制要求。法律法规另有规定时，从其规定。</p>	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制： 新增：“（7） 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 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。</p> <p>（8） 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>.....</p> <p>5、基金管理人应当自《基金合同》生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合《基金合同》的约定。上述期间，基金的投资范围、投资策略应当符合《基金合同》的约定。除上述“1、组合限制”（7）、（8）以外，因证券市场波动、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不符合《基金合同》约定的投资比例规定的，应当在超过比例后三十个工作日内采用合理的商业措施进行调整，以符合投资比例限制要求。法律法规另有规定时，从其规定。</p>
10	第十五部分 基金资产估值	<p>六、暂停估值的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的主要证券交易所、市场或外汇市场遇法定节假日或因其他原因暂停交易时；</p> <p>2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；</p> <p>3、占基金相当比例的投资品种的估</p>	<p>六、暂停估值的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的主要证券交易所、市场或外汇市场遇法定节假日或因其他原因暂停交易时；</p> <p>2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；</p> <p>3、占基金相当比例的投资品种的估</p>

		值出现重大转变，延迟估值有利于基金份额持有人利益的保护； 4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。	值出现重大转变，延迟估值有利于基金份额持有人利益的保护； 4、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； 5、中国证监会和基金合同认定的其它情形。
11	第十九部分 基金的信息披露	五、公开披露的基金信息 (七) 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 (七) 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：“报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情形，基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告文件中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。 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。”
12	第十九部分 基金的信息披露	五、公开披露的基金信息 (八) 临时报告	五、公开披露的基金信息 (八) 临时报告 增加：“26、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；”

(二) 托管协议

序号	章节	原文	修订
1	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》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》(以下简称“《试行办法》”)、	(一) 订立托管协议的依据 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》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》(以下简称“《试行办法》”)、

		《关于实施〈合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法〉有关问题的通知》（以下简称“《通知》”）及其他有关法律法规与《易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“《基金合同》”）订立。	《关于实施〈合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法〉有关问题的通知》（以下简称“《通知》”）、《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《管理规定》）及其他有关法律法规与《易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“《基金合同》”）订立。
2	三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	<p>（一）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》中实际可以监控事项的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面：</p> <p>本基金投资于股票的比例不低于基金资产的 80%；基金投资标的指数成份股、备选成份股、跟踪同一标的指数的期货期权等相关衍生工具的合约市值的资产不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。若法律法规的相关规定发生变更或监管机构允许，本基金可对上述资产配置比例进行调整。</p>	<p>（一）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》中实际可以监控事项的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面：</p> <p>本基金投资于股票的比例不低于基金资产的 80%；基金投资标的指数成份股、备选成份股、跟踪同一标的指数的期货期权等相关衍生工具的合约市值的资产不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。若法律法规的相关规定发生变更或监管机构允许，本基金可对上述资产配置比例进行调整。</p>
3	三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	<p>投资组合限制</p> <p>.....</p>	<p>投资组合限制</p> <p>新增：“（7）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 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。</p> <p>（8）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>
4	九、基金资产净值计算和会计核算	<p>（三）暂停估值的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的主要证券交易所、市场或外汇市场遇法定节假日或</p>	<p>（三）暂停估值的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的主要证券交易所、市场或外汇市场遇法定节假日或</p>

		<p>因其他原因暂停交易时；</p> <p>2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金财产价值时；</p> <p>3、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，延迟估值有利于基金份额持有人利益的保护；</p> <p>4、《基金合同》约定或中国证监会认定的其他情形。</p>	<p>因其他原因暂停交易时；</p> <p>2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金财产价值时；</p> <p>3、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，延迟估值有利于基金份额持有人利益的保护；</p> <p>4、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；</p> <p>5、《基金合同》约定或中国证监会认定的其他情形。</p>
--	--	---	--