

关于修改嘉实优质企业混合型证券投资基金

基金合同及托管协议的公告

一、本次修改的基本情况

根据中国证监会颁布的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》要求，为推动产品持续良性发展，嘉实基金管理有限公司对嘉实优质企业混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）基金合同、托管协议等法律文件在基金投资限制、申购赎回限制、信息披露条款等方面进行了相应调整。嘉实基金管理有限公司作为本基金的管理人，已与本基金托管人就基金合同、托管协议修改达成一致，并报中国证监会北京监管局备案。本次修改后的基金合同、托管协议将于2018年3月31日起正式施行。

二、基金合同、托管协议修订情况

基于上述调整，本公司将对本基金的基金合同、托管协议中涉及的相关内容进行修订，具体修订内容详见附件《〈嘉实优质企业混合型证券投资基金基金合同〉条款修改对照表》、《〈嘉实优质企业混合型证券投资基金托管协议〉条款修改对照表》。

三、重要提示

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；对投资者持有基金少于7日（不含）收取不低于1.5%的短期赎回费率；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和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、本次修订属于按照有效的法律法规和监管机构的规定执行，本基金管理人已就修订内容履行了规定的程序，符合相关法律法规及基金合同的规定。

3、本公告仅对本基金根据法律法规修订有关事项予以说明。基金管理人将在本公告发布当日，将修改后的基金合同、托管协议登载于本公司网站，并将在更新的基金招募说明书中，对涉及上述修订的内容进行相应更新。

投资者可以通过拨打本公司客服热线（400-600-8800）或登录本公司网站（www.jsfund.cn）获取相关信息。

特此公告

嘉实基金管理有限公司

2018年3月22日

附件：

- 1、《〈嘉实优质企业混合型证券投资基金基金合同〉条款修改对照表》
- 2、《〈嘉实优质企业混合型证券投资基金托管协议〉条款修改对照表》

《嘉实优质企业混合型证券投资基金基金合同》条款修改对照表

修改前	修改后
一、前言	
为保护基金投资者合法权益，明确《基金合同》当事人的权利与义务，规范基金运作，依照《基金法》及其他有关法律法规的规定，在平等自愿、诚实信用、充分保护基金投资者合法权益的原则基础上，订立《嘉实优质企业混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）。	为保护基金投资者合法权益，明确《基金合同》当事人的权利与义务，规范基金运作，依照《基金法》、 <u>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</u> （以下简称“ <u>《流动性风险管理规定》</u> ”）及其他有关法律法规的规定，在平等自愿、诚实信用、充分保护基金投资者合法权益的原则基础上，订立《嘉实优质企业混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）。
二、释义	
无	<u>《流动性风险管理规定》</u> ：指《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》； <u>流动性受限资产</u> ：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、 <u>流通受限的新股及非公开发行股票</u> 、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；
五、《基金合同》当事人	
（一）基金管理人 注册地址： 上海市浦东新区富城路 99 号震旦国际大楼 1702 室 法定代表人： 王忠民 总经理：赵学军 组织形式： 中外合资经营企业 注册资本： 1 亿元	（一）基金管理人 注册地址： <u>中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心二期 53 层 09-11 单元</u> 法定代表人： <u>赵学军</u> 组织形式： <u>有限责任公司（中外合资）</u> 注册资本： <u>1.5</u> 亿元

<p>(二) 基金托管人 注册地址: 上海市浦东新区浦东南路 500 号 法定代表人: 吉晓辉 注册资本: 43.5488 亿元人民币</p>	<p>(二) 基金托管人 注册地址: <u>上海市中山东一路 12 号</u> 法定代表人: <u>高国富</u> 注册资本: <u>296.53</u> 亿元人民币</p>
<p>十三、基金份额的申购与赎回</p>	
<p>(五) 申购与赎回的数额限制 无</p>	<p>(五) 申购与赎回的数额限制 <u>2、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,具体规定请参见相关公告。</u></p>
<p>(六) 申购份数与赎回金额的计算方式 5、本基金的申购费率最高不超过 5%, 赎回费率最高不超过 5%。本基金的申购费率和赎回费率由基金管理人确定并在《招募说明书》或更新招募说明书中列示。费率如发生变更, 基金管理人最迟须于新的费率开始实施前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。</p>	<p>(六) 申购份数与赎回金额的计算方式 5、本基金的申购费率最高不超过 5%, 赎回费率最高不超过 5%, <u>其中对持续持有期少于 7 日的投资者收取不少于 1.5% 的赎回费并全额计入基金财产。</u>本基金的申购费率和赎回费率由基金管理人确定并在《招募说明书》或更新招募说明书中列示。费率如发生变更, 基金管理人最迟须于新的费率开始实施前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。</p>
<p>(八) 巨额赎回的认定及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 (2) 部分延期赎回: ……转入下一开放日的赎回申请不享有赎回优先权并将以该下一个开放日的基金份额净值为基准计算赎回金额, 以此类推, 直到全部赎回为止。</p>	<p>(八) 巨额赎回的认定及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 (2) 部分延期赎回: ……转入下一开放日的赎回申请不享有赎回优先权并将以该下一个开放日的基金份额净值为基准计算赎回金额, 以此类推, 直到全部赎回为止。 <u>若基金发生巨额赎回且基金管理人决定部分延期赎回并在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额 10% 的前提下, 如出现单个基金份额持有人超过前一日基金总份额 30% 的赎回申请 (“大额赎回申请人”) 的, 基金管理人应当按照优先确认其他赎回申请人 (“小额赎回申请人”) 赎回申请的原则, 对</u></p>

	<p><u>当日的赎回申请按照以下原则办理：如小额赎回申请人的赎回申请在当日被全部确认，则在仍可接受赎回申请的范围内对大额赎回申请人的赎回申请按比例（单个大额赎回申请人的赎回申请量/当日大额赎回申请总量）确认，对大额赎回申请人未予确认的赎回申请延期办理；如小额赎回申请人的赎回申请在当日不能被全部确认，则按照单个小额赎回申请人的赎回申请量占当日小额赎回申请总量的比例，确认其当日受理的赎回申请量，对当日全部未确认的赎回申请（含小额赎回申请人的其余赎回申请与大额赎回申请人的全部赎回申请）延期办理。延期办理的具体程序，按照本条规定的延期赎回或取消赎回的方式办理；同时，基金管理人应当对延期办理的事宜在指定媒介上刊登公告。</u></p>
<p>（九）拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理</p> <p>1、在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请：</p> <p>2、在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请：</p>	<p>（九）拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理</p> <p>1、在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请：</p> <p><u>（5）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%，或者变相规避 50%集中度的情形时；</u></p> <p><u>（6）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；</u></p> <p>2、在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请：</p> <p><u>（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；</u></p>
<p>十八、基金的投资</p>	

<p>(二)、投资范围</p> <p>.....</p> <p>本基金投资组合的资产配置范围为：股票等权益类资产占基金资产的比例为60~95%；现金、债券资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为5-40%，现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，权证占基金资产净值的比例不超过3%。</p>	<p>(二)、投资范围</p> <p>.....</p> <p>本基金投资组合的资产配置范围为：股票等权益类资产占基金资产的比例为60~95%；现金、债券资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为5-40%，现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，<u>其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>，权证占基金资产净值的比例不超过3%。</p>
<p>(八) 投资组合比例限制</p> <p>无</p>	<p>(八) 投资组合比例限制</p> <p><u>4、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%；</u></p> <p><u>5、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%；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本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；</u></p> <p><u>6、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；</u></p>
<p>由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内，但基金管理人应在10个交易日内进行调整，以达到标准。</p>	<p>由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内，但基金管理人应在10个交易日内进行调整，以达到标准，<u>上述第5、6项除外</u>。</p>
<p>二十一、基金资产估值</p>	
<p>(七) 暂停估值的情形</p> <p>无</p>	<p>(七) 暂停估值的情形</p> <p><u>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</u></p>

	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基金估值;
二十五、基金的信息披露	
(二) 定期报告	(二) 定期报告 <u>6、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。</u> <u>7、报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20%的情形, 为保障其他投资者的权益, 基金管理人至少应当在基金定期报告“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。</u>
(三) 临时公告 无	(三) 临时公告 <u>(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;</u>

《嘉实优质企业混合型证券投资基金托管协议》条款修改对照表

修改前	修改后
一、托管协议当事人	
<p>(一) 基金管理人（或简称“管理人”） 住所：上海市浦东新区富城路99号震旦国际大楼1702室 法定代表人：王忠民 注册资本：1亿元人民币 组织形式：中外合资经营企业</p> <p>(二) 基金托管人（或简称“托管人”） 注册地址：上海市浦东新区浦东南路500号 法定代表人：吉晓辉 注册资本：43.5488亿元人民币</p>	<p>(一) 基金管理人（或简称“管理人”） 住所：<u>中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心二期53层09-11单元</u> 法定代表人：<u>赵学军</u> 注册资本：<u>1.5</u>亿元人民币 组织形式：<u>有限责任公司（中外合资）</u></p> <p>(二) 基金托管人（或简称“托管人”） 注册地址：<u>上海市中山东一路12号</u> 法定代表人：<u>高国富</u> 注册资本：<u>296.53</u>亿元人民币</p>
二、托管协议的依据、目的、原则和解释	
<p>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》）及其他有关法律、法规与《嘉实优质企业混合型证券投资基金合同》制订（以下简称《基金合同》）。</p>	<p>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》）、<u>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</u>（以下简称“<u>《流动性风险管理规定》</u>”）及其他有关法律、法规与《嘉实优质企业混合型证券投资基金合同》制订（以下简称《基金合同》）。</p>
八、基金资产估值、基金资产净值计算和会计核算	
<p>(七) 暂停估值的情形 无</p>	<p>(七) 暂停估值的情形 <u>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确认后，基金管理人应当暂停基金估值；</u></p>
九、投资组合比例监控	

<p>(一) 基金的投资组合将首先遵循以下限制:</p> <p>(1) 投资范围</p> <p>.....</p> <p>本基金投资组合的资产配置范围为: 股票等权益类资产占基金资产的比例为 60~95%; 现金、债券资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5-40%, 现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%, 权证占基金资产净值的比例不超过 3%。若法律法规或中国证监会对基金投资权证的比例有新的规定, 适用新的规定。股票指数期货及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。</p> <p>由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内, 但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整, 以达到标准。</p>	<p>(一) 基金的投资组合将首先遵循以下限制:</p> <p>(1) 投资范围</p> <p>.....</p> <p>本基金投资组合的资产配置范围为: 股票等权益类资产占基金资产的比例为 60~95%; 现金、债券资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5-40%, 现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%, <u>其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>, 权证占基金资产净值的比例不超过 3%。若法律法规或中国证监会对基金投资权证的比例有新的规定, 适用新的规定。股票指数期货及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。</p> <p><u>(5) 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%;</u></p> <p><u>(6) 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%; 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本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;</u></p> <p><u>(7) 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;</u></p> <p>由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内, 但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整, 以达到标准, <u>上述第 (6)、(7) 项除外。</u></p>
---	--