

景顺长城基金管理有限公司关于旗下 62 只基金修改基金合同及托管协议的公告

根据中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性新规》”）的要求，景顺长城基金管理有限公司（以下简称“我司”）拟对旗下 62 只公开募集开放式证券投资基金基金合同及托管协议进行修改。上述基金合同及托管协议的修改系因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行的修改，对原有基金份额持有人的利益无实质不利影响，已经我司与相应基金的基金托管人协商一致，并报监管机构进行备案。

本次修改所涉及的基金为 62 只，涉及到 60 组基金合同及托管协议的修改，其中景顺长城系列开放式证券投资基金的基金合同包含 3 只基金，分别为景顺长城货币市场证券投资基金、景顺长城优选混合型证券投资基金和景顺长城动力平衡证券投资基金。所涉及的基金如下列表，具体修改内容请详见附件对照表。

依据《流动性新规》“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，我司将按照法规要求对适用基金持续持有期少于 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该基金的基金财产。修改后的基金合同、托管协议及赎回费相关规则调整等事宜将在 2018 年 3 月 31 日起生效。

编号	基金名称	托管行
1	景顺长城成长之星股票型证券投资基金	中国工商银行
2	景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金	中国工商银行
3	景顺长城中国回报灵活配置混合型证券投资基金	中国工商银行
4	景顺长城沪港深精选股票型证券投资基金	中国工商银行
5	景顺长城量化新动力股票型证券投资基金	中国工商银行
6	景顺长城景盛双息收益债券型证券投资基金	中国工商银行
7	景顺长城新兴成长混合型证券投资基金	中国工商银行
8	景顺长城精选蓝筹混合型证券投资基金	中国工商银行
9	景顺长城公司治理混合型证券投资基金	中国工商银行
10	景顺长城中小盘混合型证券投资基金	中国工商银行
11	景顺长城大中华混合型证券投资基金	中国工商银行
12	景顺长城景兴信用纯债债券型证券投资基金	中国建设银行
13	景顺长城优质成长股票型证券投资基金	中国建设银行
14	景顺长城研究精选股票型证券投资基金	中国建设银行
15	景顺长城量化精选股票型证券投资基金	中国建设银行
16	景顺长城环保优势股票型证券投资基金	中国建设银行
17	景顺长城景盈双利债券型证券投资基金	中国建设银行
18	景顺长城沪港深领先科技股票型证券投资基金	中国建设银行

19	景顺长城策略精选灵活配置混合型证券投资基金	中国银行
20	景顺长城优势企业混合型证券投资基金	中国银行
21	景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	中国银行
22	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	中国银行
23	景顺长城改革机遇灵活配置混合型证券投资基金	中国银行
24	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金	中国银行
25	景顺长城鼎益混合型证券投资基金 (LOF)	中国银行
26	景顺长城景系列开放式证券投资基金 (含景顺长城货币市场证券投资基金, 景顺长城优选混合型证券投资基金、景顺长城动力平衡证券投资基金)	中国银行
27	景顺长城上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金	中国银行
28	上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金	中国银行
29	景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数证券投资基金	中国银行
30	景顺长城稳定收益债券型证券投资基金	中国银行
31	景顺长城优信增利债券型证券投资基金	中国银行
32	景顺长城品质投资混合型证券投资基金	中国农业银行
33	景顺长城四季金利债券型证券投资基金	中国农业银行
34	景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金	中国农业银行
35	景顺长城中小板创业板精选股票型证券投资基金	中国农业银行
36	景顺长城低碳科技主题灵活配置混合型证券投资基金	中国农业银行
37	景顺长城景盈金利债券型证券投资基金	中国农业银行
38	景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金	中国农业银行
39	景顺长城资源垄断混合型证券投资基金 (LOF)	中国农业银行
40	景顺长城内需增长混合型证券投资基金	中国农业银行
41	景顺长城内需增长贰号混合型证券投资基金	中国农业银行
42	景顺长城能源基建混合型证券投资基金	中国农业银行
43	景顺长城景益货币市场基金	中国农业银行
44	景顺长城支柱产业混合型证券投资基金	中国农业银行
45	景顺长城景瑞收益定期开放债券型证券投资基金	兴业银行
46	景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金	兴业银行
47	景顺长城景颐增利债券型证券投资基金	招商银行
48	景顺长城景颐宏利债券型证券投资基金	招商银行
49	景顺长城稳健回报灵活配置混合型证券投资基金	邮储银行
50	景顺长城景泰丰利纯债债券型证券投资基金	邮储银行
51	景顺长城泰安回报灵活配置混合型证券投资基金	邮储银行
52	景顺长城景丰货币市场基金	兴业银行
53	景顺长城领先回报灵活配置混合型证券投资基金	兴业银行

54	景顺长城安享回报灵活配置混合型证券投资基金	兴业银行
55	景顺长城中证500行业中性低波动指数型证券投资基金	浦发银行
56	景顺长城景颐盛利债券型证券投资基金	浦发银行
57	景顺长城泰和回报灵活配置混合型证券投资基金	交通银行
58	景顺长城顺益回报混合型证券投资基金	交通银行
59	景顺长城景颐双利债券型证券投资基金	北京银行
60	景顺长城景颐丰利债券型证券投资基金	北京银行

本公司将在上述基金的招募说明书（更新）中，对上述内容进行相应修改。

特此公告。

风险提示：基金管理人承诺以恪尽职守、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。投资者投资于本基金时应认真阅读本基金的基金合同、招募说明书等文件。敬请投资者留意投资风险。

景顺长城基金管理有限公司

二零一八年三月二十三日

附件：

- 1、 景顺长城成长之星股票型证券投资基金基金合同托管协议修订对照表
- 2、 景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金基金合同托管协议修订对照表
- 3、 景顺长城中国回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同托管协议修订对照表
- 4、 景顺长城沪港深精选股票型证券投资基金基金合同托管协议修订对照表
- 5、 景顺长城量化新动力股票型证券投资基金基金合同托管协议修订对照表
- 6、 景顺长城景盛双息收益债券型证券投资基金基金合同托管协议修订对照表
- 7、 景顺长城新兴成长混合型证券投资基金基金合同托管协议修订对照表
- 8、 景顺长城精选蓝筹混合型证券投资基金基金合同托管协议修订对照表
- 9、 景顺长城公司治理混合型证券投资基金基金合同托管协议修订对照表
- 10、 景顺长城中小盘混合型证券投资基金基金合同托管协议修订对照表
- 11、 景顺长城大中华混合型证券投资基金基金合同托管协议修订对照表
- 12、 景顺长城景兴信用纯债债券型证券投资基金基金合同托管协议修订对照表
- 13、 景顺长城优质成长股票型证券投资基金基金合同托管协议修订对照表

- 14、景顺长城研究精选股票型证券投资基金基金合同托管协议修订对照表
- 15、景顺长城量化精选股票型证券投资基金基金合同托管协议修订对照表
- 16、景顺长城环保优势股票型证券投资基金基金合同托管协议修订对照表
- 17、景顺长城景盈双利债券型证券投资基金基金合同托管协议修订对照表
- 18、景顺长城沪港深领先科技股票型证券投资基金基金合同托管协议修订对照表
- 19、景顺长城策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同托管协议修订对照表
- 20、景顺长城优势企业混合型证券投资基金基金合同托管协议修订对照表
- 21、景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同托管协议修订对照表
- 22、景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同托管协议修订对照表
- 23、景顺长城改革机遇灵活配置混合型证券投资基金基金合同托管协议修订对照表
- 24、景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同托管协议修订对照表
- 25、景顺长城鼎益混合型证券投资基金（LOF）基金合同托管协议修订对照表
- 26、景顺长城景系列开放式证券投资基金基金合同托管协议修订对照表(含景顺长城货币市场证券投资基金，景顺长城优选混合型证券投资基金、景顺长城动力平衡证券投资基金)
- 27、景顺长城上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同托管协议修订对照表
- 28、上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金基金合同托管协议修订对照表
- 29、景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数证券投资基金基金合同托管协议修订对照表
- 30、景顺长城稳定收益债券型证券投资基金基金合同托管协议修订对照表
- 31、景顺长城优信增利债券型证券投资基金基金合同托管协议修订对照表
- 32、景顺长城品质投资混合型证券投资基金基金合同托管协议修订对照表
- 33、景顺长城四季金利债券型证券投资基金基金合同托管协议修订对照表

- 34、景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同托管协议修订对照表
- 35、景顺长城中小板创业板精选股票型证券投资基金基金合同托管协议修订对照表
- 36、景顺长城低碳科技主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同托管协议修订对照表
- 37、景顺长城景盈金利债券型证券投资基金基金合同托管协议修订对照表
- 38、景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金基金合同托管协议修订对照表
- 39、景顺长城资源垄断混合型证券投资基金（LOF）基金合同托管协议修订对照表
- 40、景顺长城内需增长混合型证券投资基金基金合同托管协议修订对照表
- 41、景顺长城内需增长贰号混合型证券投资基金基金合同托管协议修订对照表
- 42、景顺长城能源基建混合型证券投资基金基金合同托管协议修订对照表
- 43、景顺长城景益货币市场基金基金合同托管协议修订对照表
- 44、景顺长城支柱产业混合型证券投资基金基金合同托管协议修订对照表
- 45、景顺长城景瑞收益定期开放债券型证券投资基金基金合同托管协议修订对照表
- 46、景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金基金合同托管协议修订对照表
- 47、景顺长城景颐增利债券型证券投资基金基金合同托管协议修订对照表
- 48、景顺长城景颐宏利债券型证券投资基金基金合同托管协议修订对照表
- 49、景顺长城稳健回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同托管协议修订对照表
- 50、景顺长城景泰丰利纯债债券型证券投资基金基金合同托管协议修订对照表
- 51、景顺长城泰安回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同托管协议修订对照表
- 52、景顺长城景丰货币市场基金基金合同托管协议修订对照表
- 53、景顺长城领先回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同托管协议修订对照表
- 54、景顺长城安享回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同托管协议修订对照表

- 55、 景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金基金合同托管协议修订对照表
- 56、 景顺长城景颐盛利债券型证券投资基金基金合同托管协议修订对照表
- 57、 景顺长城泰和回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同托管协议修订对照表
- 58、 景顺长城顺益回报混合型证券投资基金基金合同托管协议修订对照表
- 59、 景顺长城景颐双利债券型证券投资基金基金合同托管协议修订对照表
- 60、 景顺长城景颐丰利债券型证券投资基金基金合同托管协议修订对照表

关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改 基金合同、托管协议的内容说明

景顺长城成长之星股票型证券投资基金

一、 基金合同修订内容

章节	修订前	修订后
第一部分 前言	<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》”)、《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>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》”)、《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>
第二部分 释义		<p>增加：</p> <p>52、《流动性风险管理规定》：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</p> <p>53、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>54、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>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>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，具体规定请参见招募说明书。</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。</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，具体规定请参见招募说明书。</p> <p>4、基金管理人可在法律法规允许的情况下，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实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案。</p>	<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>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，具体规定请参见招募说明书。</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。</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，具体规定请参见招募说明书。</p> <p>4、基金管理人可在法律法规允许的情况下，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实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案。</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。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。具体请参见相关公告。</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>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。对持续持有期少于7日的投资人收取不低于1.5%的赎回费，对持续持有期少于30日的投资人收取不低于0.75%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产；对持续持有期少于3个月的投资人收取不低于0.5%的赎回费，并将不低于赎回费总额的75%计入基金财产；对持续持有期长于3个月但少于6个月的投资人收取不低于0.5%的赎回费，并将不低于赎回费总额的50%计入基金财产；对持续持有期长于6个月的投资人，应当将不低于赎回费总额的25%计入基金财产，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。对于持续持有期少于7日的投资者，本基金将收取不低于1.5%的赎回费并全额计入基金财产；对持续持有期少于30日的投资人收取不低于0.75%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产；对持续持有期少于3个月的投资人收取不低于0.5%的赎回费，并将不低于赎回费总额的75%计入基金财产；对持续持有期长于3个月但少于6个月的投资人收取不低于0.5%的赎回费，并将不低于赎回费总额的50%计入基金财产；对持续持有期长于6个月的投资人，应当将不低于赎回费总额的25%计入基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。</p>
<p>第六部分 基金份额</p>		<p>增加：</p> <p>8、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人</p>

的申购与赎回		可以采用摆动定价机制,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、自律组织的规定。
第六部分 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:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、因不可抗力导致基金无法正常运作。 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时,基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。 3、证券、期货交易所交易时间非正常停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。 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。 5、基金资产规模过大,使基金管理人无法找到合适的投资品种,或其他可能对基金业绩产生负面影响,从而损害现有基金份额持有人利益的情形。 6、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构的异常情况导致基金销售系统、基金登记系统或基金会计系统无法正常运行。 7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 <p>发生上述第 1、2、3、5、6、7 项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体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>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:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、因不可抗力导致基金无法正常运作。 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时,基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。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,经与基金托管人协商确定后,基金管理人应当暂停接受申购申请。 3、证券、期货交易所交易时间非正常停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。 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。 5、基金资产规模过大,使基金管理人无法找到合适的投资品种,或其他可能对基金业绩产生负面影响,从而损害现有基金份额持有人利益的情形。 6、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构的异常情况导致基金销售系统、基金登记系统或基金会计系统无法正常运行。 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%,或者变相规避 50%集中度的情形时。 8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 <p>发生上述第 1、2、3、5、6、8 项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体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的,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>
第六部分	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

<p>基金份额的申购与赎回</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： 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，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>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，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。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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项。</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 增加： (3) 如果基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额 20%以上的赎回申请的情形下，基金管理人可以对该基金份额持有人超过 20%以上的部分延期办理赎回申请。对于当日非延期的赎回申请，应当按单个账户非延期赎回申请量占非延期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。</p>
<p>第七部分基金合同当事人及权利义务</p>	<p>一、基金管理人 (一) 基金管理人简况 法定代表人：赵如冰</p>	<p>一、基金管理人 (一) 基金管理人简况 法定代表人：杨光裕</p>
<p>第七部分基金合同当事人及权利义务</p>	<p>二、基金托管人 (一) 基金托管人简况 法定代表人：姜建清 联系人：赵会军</p>	<p>二、基金托管人 (一) 基金托管人简况 法定代表人：易会满 联系人：郭明</p>
<p>第十二部分基金的投资</p>	<p>二、投资范围 本基金投资范围包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板</p>	<p>二、投资范围 本基金投资范围包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业</p>

	<p>及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括中小企业私募债券)、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其它品种,本基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。</p> <p>本基金将基金资产的 80%-95% 投资于股票资产,其中,投资于成长性良好的上市公司股票的比例不低于非现金基金资产的 80%,权证投资比例不超过基金资产净值的 3%,将不超过 20% 的基金资产投资于债券等固定收益类品种,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,本基金保留的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%。</p> <p>本基金参与股指期货交易,应符合法律法规规定和基金合同约定的投资限制并遵守相关期货交易所的业务规则。</p>	<p>板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括中小企业私募债券)、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其它品种,本基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。</p> <p>本基金将基金资产的 80%-95% 投资于股票资产,其中,投资于成长性良好的上市公司股票的比例不低于非现金基金资产的 80%,权证投资比例不超过基金资产净值的 3%,将不超过 20% 的基金资产投资于债券等固定收益类品种,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,本基金保留的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%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</p> <p>本基金参与股指期货交易,应符合法律法规规定和基金合同约定的投资限制并遵守相关期货交易所的业务规则。</p>
第十二部分 基金的投资	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</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% 的现金或到期日在一年以内的政府债券;</p>	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</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、存出保证金和应收申购款等;</p>
第十二部分 基金的投资		<p>增加:</p> <p>(12)本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票,不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,不超过该上市公司可流通股票的 30%;</p> <p>(13)本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 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项所规定的比例限制的,基金管理人</p>

		<p>不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>(14)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投资范围保持一致；</p>
第十二部分 基金的投资	<p>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。法律法规另有规定,从其规定。</p>	<p>除上述第(2)、(13)、(14)、(15)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。法律法规另有规定,从其规定。</p>
第十四部分 基金财产的估值	<p>三、估值方法</p> <p>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>(3)首次公开发行有明确锁定期的股票,同一股票在交易所上市后,按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票,按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>	<p>三、估值方法</p> <p>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>(3) 流通受限股票,包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等(不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票),按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>
第十四部分 基金财产的估值	<p>三、估值方法</p>	<p>三、估值方法</p> <p>增加：</p> <p>7、当发生大额申购或赎回情形时,在履行适当程序后,基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。</p>
第十四部分 基金财产的估值	<p>六、暂停估值的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</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值出现重大转变,而基金管理人为保障基金份额持有人的利益,决定延迟估值；</p> <p>4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。</p>	<p>六、暂停估值的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</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值出现重大转变,而基金管理人为保障基金份额持有人的利益,决定延迟估值；</p> <p>4、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时,经与基金托管人协商确认后,应当暂停估值；</p> <p>5、中国证监会和基金合同认定的其它情形。</p>

<p>第十八部分 基金的信息披露</p>	<p>(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</p> <p>基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内, 编制完成基金年度报告, 并将年度报告正文登载于网站上, 将年度报告摘要登载在指定报刊上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。</p> <p>基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内, 编制完成基金半年度报告, 并将半年度报告正文登载在网站上, 将半年度报告摘要登载在指定报刊上。</p> <p>基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内, 编制完成基金季度报告, 并将季度报告登载在指定报刊和网站上。</p> <p>基金合同生效不足 2 个月的, 基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。</p> <p>基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日, 分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。</p>	<p>(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</p> <p>基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内, 编制完成基金年度报告, 并将年度报告正文登载于网站上, 将年度报告摘要登载在指定报刊上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。</p> <p>基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内, 编制完成基金半年度报告, 并将半年度报告正文登载在网站上, 将半年度报告摘要登载在指定报刊上。</p> <p>基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内, 编制完成基金季度报告, 并将季度报告登载在指定报刊和网站上。</p> <p>基金合同生效不足 2 个月的, 基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。</p> <p>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。</p> <p>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例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文件中“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本基金的特定风险, 中国证监会认定的特殊情形除外。</p> <p>基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日, 分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。</p>
<p>第十八部分 基金的信息披露</p>	<p>(七) 临时报告</p>	<p>(七) 临时报告</p> <p>增加:</p> <p>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;</p> <p>27、基金管理人采用摆动定价机制进行估值;</p>
<p>第二十四部分 基金合同内容摘要</p>		<p>摘要部分也做了相应修改, 与合同修订内容保持一致。</p>

二、对基金托管协议的修改内容

章节	修订前	修订后
一、基金托管协议当事人	<p>(一) 基金管理人 法定代表人：赵如冰</p> <p>(二) 基金托管人 法定代表人：姜建清 联系人：赵会军</p>	<p>(一) 基金管理人 法定代表人：杨光裕</p> <p>(二) 基金托管人 法定代表人：易会满 联系人：郭明</p>
二、基金托管协议的依据、目的和原则	<p>订立本协议的依据是《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《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》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第7号〈托管协议的内容与格式〉》、《景顺长城成长之星股票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。</p>	<p>订立本协议的依据是《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《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》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第7号〈托管协议的内容与格式〉》、《景顺长城成长之星股票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。</p>
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	<p>(一) 基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权</p> <p>2、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投融资比例进行监督：</p> <p>(1) 按法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金的投资资产配置比例为：将基金资产的80%-95%投资于股票资产，其中，投资于成长性良好的上市公司股票的比例不低于非现金基金资产的80%，权证投资比例不超过基金资产净值的3%，将不超过20%的基金资产投资于债券等固定收益类品种，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，本基金保留的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%。</p> <p>本基金参与股指期货交易，应符合法律法规规定和基金合同约定的投资限制并遵守相关期货交易所的业务规则。</p>	<p>(一) 基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权</p> <p>2、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投融资比例进行监督：</p> <p>(1) 按法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金的投资资产配置比例为：将基金资产的80%-95%投资于股票资产，其中，投资于成长性良好的上市公司股票的比例不低于非现金基金资产的80%，权证投资比例不超过基金资产净值的3%，将不超过20%的基金资产投资于债券等固定收益类品种，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，本基金保留的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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</p> <p>本基金参与股指期货交易，应符合法律法规规定和基金合同约定的</p>

	<p>如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。</p> <p>基金管理人应定期按照双方约定的形式向基金托管人提供本基金拟投资股票主题库,并有责任确保该股票库符合基金合同的有关规定。基金托管人据此股票库监督本基金投资于该类上市公司股票的比例。</p>	<p>投资限制并遵守相关期货交易所的业务规则。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。</p> <p>基金管理人应定期按照双方约定的形式向基金托管人提供本基金拟投资股票主题库,并有责任确保该股票库符合基金合同的有关规定。基金托管人据此股票库监督本基金投资于该类上市公司股票的比例。</p>
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	<p>(2) 根据法律法规的规定及《基金合同》的约定,本基金投资组合遵循以下投资限制:</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>(2)根据法律法规的规定及《基金合同》的约定,本基金投资组合遵循以下投资限制:</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、存出保证金和应收申购款等;</p>
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查		<p>增加:</p> <p>12) 本基金管理人管理且由本基金托管人托管的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)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%;本基金管理人管理且由本基金托管人托管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>13) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 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项所规定的比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;</p> <p>19) 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投资范围保持一致;</p>
三、基金托管人对基金管理	<p>由于证券、期货市场波动、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</p>	<p>除上述投资限制的第 2)、13)、14) 项外,由于证券、期货市场波动、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</p>

人的业务监督和核查	基金管理人应在 10 个工作日内进行调整, 以达到规定的投资比例限制要求。法律法规另有规定的从其规定。	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 个工作日内进行调整, 以达到规定的投资比例限制要求。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	<p>6、基金托管人对基金投资流通受限证券的监督</p> <p>(1) 基金投资流通受限证券, 应遵守《关于规范基金投资非公开发行证券行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。</p> <p>(2) 流通受限证券, 包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券, 不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>	<p>6、基金托管人对基金投资流通受限证券的监督</p> <p>(1) 基金投资流通受限证券, 应遵守《关于规范基金投资非公开发行证券行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。</p> <p>(2) 流通受限证券与上文流动性受限资产不同, 包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券, 不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>
八、基金资产净值计算和会计核算	<p>(二) 基金资产估值方法</p> <p>(2) 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:</p> <p>③首次公开发行有明确锁定期的股票, 同一股票在交易所上市后, 按交易所上市的同一股票的估值方法估值; 非公开发行有明确锁定期的股票, 按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>	<p>(二) 基金资产估值方法</p> <p>(2) 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:</p> <p>③流通受限的股票, 包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等 (不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票), 按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>
八、基金资产净值计算和会计核算		<p>增加:</p> <p>(8) 当发生大额申购或赎回情形时, 在履行适当程序后, 基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。</p>
十、信息披露	<p>(三) 暂停或延迟信息披露的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;</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资产价值时;</p> <p>3、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变, 而基金管理人为保障基金份额持有人的利益, 已决定延迟估值;</p>	<p>(三) 暂停或延迟信息披露的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;</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资产价值时;</p> <p>3、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变, 而基金管理人为保障基金份额持有人的利益, 已决定延迟估值;</p>

	4、法律法规规定、中国证监会或《基金合同》认定的其他情形。	4、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时,经与基金托管人协商确认后暂停估值; 5、法律法规规定、中国证监会或《基金合同》认定的其他情形。
--	-------------------------------	---

关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改

基金合同、托管协议的内容说明

景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金

一、 基金合同修订内容

章节	修订前	修订后
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》”)、《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。	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》”)、《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>第二部分 释义</p>	<p>42、自由开放期：本基金在每个运作周期结束后设自由开放期，在自由开放期内赎回基金，本基金不收取赎回费，每个自由开放期为 5 至 15 个工作日。</p>	<p>42、自由开放期：本基金在每个运作周期结束后设自由开放期，在自由开放期内赎回基金，除持有期未满 7 日的，本基金不收取赎回费，每个自由开放期为 5 至 15 个工作日。</p>
<p>第二部分 释义</p>		<p>增加：</p> <p>59、《流动性风险管理规定》：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</p> <p>60、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>61、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>第三部分 基金的基 本情况</p>	<p>三、基金的运作方式</p> <p>自由开放期：本基金在相邻两个运作周期之间设置自由开放期，在自由开放期内赎回基金，本基金不收取赎回费。</p>	<p>三、基金的运作方式</p> <p>自由开放期：本基金在相邻两个运作周期之间设置自由开放期，在自由开放期内赎回基金，除持有期未满 7 日的，本基金不收取赎回费。</p>
<p>第六部分 基金份额 的运作周 期、自由 开放期和 受限开放 期</p>	<p>（二）基金的自由开放期</p> <p>本基金在相邻两个运作周期之间设置自由开放期，在自由开放期内赎回基金，本基金不收取赎回费。</p>	<p>（二）基金的自由开放期</p> <p>本基金在相邻两个运作周期之间设置自由开放期，在自由开放期内赎回基金，除持有期未满 7 日的，本基金不收取赎回费。</p>
<p>第九部分 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>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>增加：</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。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。具体请参见相关公告。</p>
<p>第九部分 基金份额 的申购与 赎回</p>	<p>六、申购和赎回的价格、申购费用、受限开放期赎回费用及其用途</p> <p>3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见《招募说明书》。本基金在受限开放期的赎回费率</p>	<p>六、申购和赎回的价格、申购费用、开放期赎回费用及其用途</p> <p>3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见《招募说明书》。本基金在开放期的赎回费率由</p>

<p>由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。受限开放期的赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用，自由开放期的赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入的方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p> <p>4、申购费用由投资人承担，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用，不列入基金财产。</p> <p>5、受限开放期的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人在受限开放期赎回基金份额时收取。不低于赎回费总额的 25% 应归基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。</p> <p>6、本基金的申购费用最高不超过申购金额的 5%，受限开放期赎回费用最高不超过赎回金额的 5%。本基金的申购费率、申购份额具体的计算方法、受限开放期的赎回费率、赎回金额具体的计算方法和收费方式由基金管理人根据基金合同的规定确定，并在招募说明书中列示。基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方</p>	<p>基金管理人决定，并在招募说明书中列示。开放期的赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入的方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p> <p>4、申购费用由投资人承担，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用，不列入基金财产。</p> <p>5、开放期的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人在开放期赎回基金份额时收取。对于持续持有期少于 7 日的投资者，本基金将收取不低于 1.5% 的赎回费并全额计入基金财产，对于持续持有期不少于 7 日的投资者收取的赎回费，不低于赎回费总额的 25% 应归基金财产，未归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>6、本基金的申购费用最高不超过申购金额的 5%，开放期赎回费用最高不超过赎回金额的 5%。本基金的申购费率、申购份额具体的计算方法、开放期的赎回费率、赎回金额具体的计算方法和收费方式由基金管理人根据基金合同的规定确定，并在招募</p>
--	---

	式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。	说明书中列示。基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式,并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。
第九部分 基金份额 的申购与 赎回		增加: 8、当发生大额申购或赎回情形时,在履行适当程序后,基金管理人可以采用摆动定价机制,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、自律组织的规定。
第九部分 基金份额 的申购与 赎回	七、拒绝或暂停申购的情形 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: 1、因不可抗力导致基金无法正常工作。 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时。 3、证券交易所交易时间非正常停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。 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。 5、基金资产规模过大,使基金管理人无法找到合适的投资品种,或其他可能对基金业绩产生负面影响,从而损害现有基金份额持有人利益的情形。	七、拒绝或暂停申购的情形 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: 1、因不可抗力导致基金无法正常工作。 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,经与基金托管人协商确定后,基金管理人应当暂停接受申购申请。 3、证券交易所交易时间非正常停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。 4、基金管理人认为接受某笔或某些

	<p>6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形或者基金合同约定的其他情形。</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申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体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。若自由开放期发生暂停申购情形的，自由开放期间按暂停申购的期间相应延长。</p>	<p>金份额持有人利益时。</p> <p>5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人利益的情形。</p> <p>6、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。</p> <p>7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形或者基金合同约定的其他情形。</p> <p>发生上述第 1、2、3、5、7 项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体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，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。若自由开放期发生暂停申购情形的，自由开放期间按暂停申购的期间相应延长。</p>
<p>第九部分 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>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>1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时。</p> <p>3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</p> <p>4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。</p> <p>5、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形或者基金合同约定的其他情形。</p>	<p>1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。</p> <p>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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项。</p> <p>3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</p> <p>4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。</p> <p>5、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形或者基金合同约定的其他情形。</p>
<p>第九部分 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</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>增加：</p> <p>（3）在自由开放期内，如果基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额 20% 以上的赎回申请的情形下，基金管理人可以对该基金份额持有人超过 20% 以上的部分延期办理赎回申请。对于当日非延期的赎回申请，应当按单个账户非延期赎回申请量占非延期赎</p>

		<p>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。</p>
<p>第十部分 基金合同 当事人及 权利义务</p>	<p>一、基金管理人 (一)基金管理人简况 法定代表人:赵如冰</p>	<p>一、基金管理人 (一)基金管理人简况 法定代表人:杨光裕</p>
<p>第十部分 基金合同 当事人及 权利义务</p>	<p>二、基金托管人 (一)基金托管人简况 法定代表人:姜建清</p>	<p>二、基金托管人 (一)基金托管人简况 法定代表人:易会满</p>
<p>第十五部 分 基金 的投资</p>	<p>二、投资范围 本基金的投资范围包括国内依法发行上市的国债、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、中小企业私募债券、公司债券、中期票据、短期融资券、可分离交易可转债的纯债部分、质押及买断式回购、协议存款、</p>	<p>二、投资范围 本基金的投资范围包括国内依法发行上市的国债、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、中小企业私募债券、公司债券、中期票据、短期融资券、可分离交易可转债的纯债部分、质押及买断式回购、协议存款、</p>

	<p>通知存款、定期存款、资产支持证券等金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类证券品种（但须符合中国证监会的相关规定）。</p> <p>本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场的新股申购或增发新股。可转换债券仅投资二级市场可分离交易可转债的纯债部分。</p> <p>法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。</p> <p>本基金投资组合资产配置比例：债券资产占基金资产的比例不低于 80%，在每个受限开放期的前 10 个工作日和后 10 个工作日、自由开放期的前 2 个月和后 2 个月以及开放期期间不受前述投资组合比例的限制。本基金在封闭期内持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不受限制，但在开放期本基金持有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>通知存款、定期存款、资产支持证券等金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类证券品种(但须符合中国证监会的相关规定)。</p> <p>本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场的新股申购或增发新股。可转换债券仅投资二级市场可分离交易可转债的纯债部分。</p> <p>法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。</p> <p>本基金投资组合资产配置比例：债券资产占基金资产的比例不低于 80%，在每个受限开放期的前 10 个工作日和后 10 个工作日、自由开放期的前 2 个月和后 2 个月以及开放期期间不受前述投资组合比例的限制。本基金在封闭期内持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不受限制，但在开放期本基金持有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、存出保证金和应收申购款等。</p>
第十五部	四、投资限制	四、投资限制

<p>分 基金 的投资</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>（2）本基金在封闭期内持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不受限制，但在开放期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>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>（2）本基金在封闭期内持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不受限制，但在开放期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、存出保证金和应收申购款等；</p>
<p>第十五部 分 基金 的投资</p>		<p>增加：</p> <p>（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超过基金资产的 15%；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本项所规定的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>（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投资范围保持一致；</p>
<p>第十五部 分 基金 的投资</p>	<p>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。法律法规另有规定的，从其规定。</p>	<p>除上述（2）、（8）、（11）、（12）项外，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。法律法规另有规定的，从其规定。</p>

<p>第十七部分 基金资产估值</p>	<p>三、估值方法</p>	<p>三、估值方法 增加： 6、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。</p>
<p>第十七部分 基金资产估值</p>	<p>六、暂停估值的情形</p>	<p>六、暂停估值的情形 增加： 4、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时，经与基金托管人协商确认后，应当暂停估值；</p>
<p>第十七部分 基金资产估值</p>	<p>八、特殊情况的处理 1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 6 项进行估值时，所造成的误差</p>	<p>八、特殊情况的处理 1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 7 项进行估值时，所造成的误差</p>
<p>第二十一部分 基金的信息披露</p>	<p>（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</p>	<p>（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 增加： 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基金份额比例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文件中“影响投资者决策的其他</p>

		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本基金的特有风险,中国证监会认定的特殊情形除外。
第二十一部分 基金的信息披露	(七) 临时报告	(七) 临时报告 增加: 28、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; 29、基金管理人采用摆动定价机制进行估值;
第二十七部分基金合同内容摘要		摘要部分也做了相应修改,与合同修订内容保持一致。

二、对基金托管协议的修改内容

章节	修订前	修订后
一、基金托管协议当事人	(一) 基金管理人 法定代表人: 赵如冰 (二) 基金托管人 法定代表人: 姜建清 联系人: 赵会军	(一) 基金管理人 法定代表人: 杨光裕 (二) 基金托管人 法定代表人: 易会满 联系人: 郭明
二、基金托管协议的依据、目的和原	订立本协议的依据是《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称《运作办法》)、《证券投资	订立本协议的依据是《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称《运作办法》)、《证券

<p>则</p>	<p>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》)、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 7 号〈托管协议的内容与格式〉》、《景顺长城鑫月薪定期支付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。</p>	<p>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》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 7 号〈托管协议的内容与格式〉》、《景顺长城鑫月薪定期支付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。</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) 基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权</p> <p>2、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投融资比例进行监督:</p> <p>(1) 按法律法规的规定及《基金合同》的约定, 本基金投资组合资产配置比例: 投资于债券资产占基金资产的比例不低于 80%, 在每个受限开放期的前 10 个工作日和后 10 个工作日、自由开放期的前 2 个月和后 2 个月以及开放期期间不受前述投资组合比例的限制。本基金在封闭期内持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不受限制, 但在开放期本基金持有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) 基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权</p> <p>2、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投融资比例进行监督:</p> <p>(1) 按法律法规的规定及《基金合同》的约定, 本基金投资组合资产配置比例: 投资于债券资产占基金资产的比例不低于 80%, 在每个受限开放期的前 10 个工作日和后 10 个工作日、自由开放期的前 2 个月和后 2 个月以及开放期期间不受前述投资组合比例的限制。本基金在封闭期内持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不受限制, 但在开放期本基金持有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</p>

	<p>如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。</p>	<p>金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。</p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>	<p>(2) 根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金投资组合遵循以下投资限制：</p> <p>B、本基金在封闭期内持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不受限制，但在开放期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>(2) 根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金投资组合遵循以下投资限制：</p> <p>B、本基金在封闭期内持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不受限制，但在开放期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、存出保证金和应收申购款等；</p> <p>增加：</p> <p>K、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超过基金资产的 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项所规定的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资。</p>
<p>三、基金托管人对基金管理</p>	<p>(3) 法规允许的基金投资比例调整期限</p> <p>由于证券市场波动、证券发行人合并</p>	<p>(3) 法规允许的基金投资比例调整期限</p> <p>除上述第 B、H、K 项外，由于证券</p>

<p>人的业务 监督和核 查</p>	<p>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，以达到规定的投资比例限制要求。法律法规另有规定的从其规定。</p>	<p>市场波动、证券发行人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，以达到规定的投资比例限制要求。法律法规另有规定的从其规定。</p>
<p>八、基金 资产净值 计算和会 计核算</p>	<p>(二) 基金资产估值方法</p>	<p>(二) 基金资产估值方法 增加： (6)当发生大额申购或赎回情形时，履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。</p>
<p>八、基金 资产净值 计算和会 计核算</p>	<p>(三) 估值错误处理 因基金估值错误给投资者造成损失的应先由基金管理人承担，基金管理人对不应由其承担的责任，有权向过错人追偿。 当基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告的，由此造成的投资者或基金的损失，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，由基金管理人与基金托管人按照管理费率 and 托管费率的比例各自承担相应的责任。 由于一方当事人提供的信息错误，另一方当事人在采取了必要合理的措施</p>	<p>(三) 估值错误处理 因基金估值错误给投资者造成损失的应先由基金管理人承担，基金管理人对不应由其承担的责任，有权向过错人追偿。 当基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告的，由此造成的投资者或基金的损失，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，由基金管理人与基金托管人按照管理费率 and 托管费率的比例各自承担相应的责任。 由于一方当事人提供的信息错误，另一方当事人在采取了必要合理的措</p>

<p>后仍不能发现该错误，进而导致基金资产净值、基金份额净值计算错误造成投资者或基金的损失，以及由此造成以后交易日基金资产净值、基金份额净值计算顺延错误而引起的投资者或基金的损失，由提供错误信息的当事人一方负责赔偿。</p> <p>基金管理人或基金托管人按估值方法的第（6）项进行估值时，所造成的误差不能作为基金资产估值错误处理。</p> <p>由于证券交易所及其登记结算公司发送的数据错误，或由于不可抗力等其他原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。</p> <p>当基金管理人计算的基金资产净值与基金托管人的计算结果不一致时，相关各方应本着勤勉尽责的态度重新计算核对，如果最后仍无法达成一致，应以基金管理人的计算结果为准对外公布，由此造成的损失以及因该交易日基金资产净值计算顺延错误而引起的损失由基金管理人承担赔偿责任，基金托管人不负赔偿责任。</p>	<p>施后仍不能发现该错误，进而导致基金资产净值、基金份额净值计算错误造成投资者或基金的损失，以及由此造成以后交易日基金资产净值、基金份额净值计算顺延错误而引起的投资者或基金的损失，由提供错误信息的当事人一方负责赔偿。</p> <p>基金管理人或基金托管人按估值方法的第（7）项进行估值时，所造成的误差不能作为基金资产估值错误处理。</p> <p>由于证券交易所及其登记结算公司发送的数据错误，或由于不可抗力等其他原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。</p> <p>当基金管理人计算的基金资产净值与基金托管人的计算结果不一致时，相关各方应本着勤勉尽责的态度重新计算核对，如果最后仍无法达成一致，应以基金管理人的计算结果为准对外公布，由此造成的损失以及因该交易日基金资产净值计算顺延错误而引起的损失由基金管理人承担赔</p>
---	--

		偿责任，基金托管人不负赔偿责任。
十、信息披露	<p>(三) 暂停或延迟信息披露的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</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资产价值时；</p> <p>3、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障基金份额持有人的利益，决定延迟估值；</p> <p>4、法律法规规定、中国证监会或《基金合同》认定的其他情形。</p>	<p>(三) 暂停或延迟信息披露的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</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资产价值时；</p> <p>3、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障基金份额持有人的利益，决定延迟估值；</p> <p>4、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时，经与基金托管人协商确认后暂停估值；</p> <p>5、法律法规规定、中国证监会或《基金合同》认定的其他情形。</p>

关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改基金合同、托管协议的内容说明

景顺长城中国回报灵活配置混合型证券投资基金

一、 基金合同修订内容

章节	修订前	修订后
第一部分 前言	<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>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>
第二部分 释义		<p>增加：</p> <p>52、《流动性风险管理规定》：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</p> <p>53、流动性受限资产：指由于法</p>

		<p>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>54、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>
第六部分 基金份额 的申购与 赎回	<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>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，具体规定请参见招募说明书。</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。</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，具体规定请参见招募说明书。</p> <p>4、基金管理人可在法律法规允许的情况下，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实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。</p>	<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>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，具体规定请参见招募说明书。</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。</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，具体规定请参见招募说明书。</p> <p>4、基金管理人可在法律法规允许的情况下，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实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。</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。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。具体请参见相关公告。</p>
第六部分 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。对持续持有期少于 7 日的投资人收取不低于 1.5% 的赎回费，对持续持有期少于 30 日的</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。对于持续持有期少于 7 日的投资者，本基金将收取不低于 1.5% 的赎回费并全额计</p>

	<p>投资人收取不低于 0.75% 的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产；对持续持有期少于 3 个月的投资人收取不低于 0.5% 的赎回费，并将不低于赎回费总额的 75% 计入基金财产；对持续持有期长于 3 个月但少于 6 个月的投资人收取不低于 0.5% 的赎回费，并将不低于赎回费总额的 50% 计入基金财产；对持续持有期长于 6 个月的投资人，应当将不低于赎回费总额的 25% 计入基金财产，未归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>入基金财产，对持续持有期少于 30 日的投资人收取不低于 0.75% 的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产；对持续持有期少于 3 个月的投资人收取不低于 0.5% 的赎回费，并将不低于赎回费总额的 75% 计入基金财产；对持续持有期长于 3 个月但少于 6 个月的投资人收取不低于 0.5% 的赎回费，并将不低于赎回费总额的 50% 计入基金财产；对持续持有期长于 6 个月的投资人，应当将不低于赎回费总额的 25% 计入基金财产，未归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>
第六部分 基金份额 的申购与 赎回		<p>增加： 8、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，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、自律组织的规定。</p>
第六部分 基金份额 的申购与 赎回	<p>七、拒绝或暂停申购的情形 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： 1、因不可抗力导致基金无法正常运作。 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。 3、证券、期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。 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。 5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或基金管理人认定的其他损害现有基金份额持有人利益的情形。 6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 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>七、拒绝或暂停申购的情形 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： 1、因不可抗力导致基金无法正常运作。 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受申购申请。 3、证券、期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。 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。 5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或基金管理人认定的其他损害现有基金份额持有人利益的情形。 6、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。</p>

		<p>7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述第 1、2、3、5、7 项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全部或部分拒绝的,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>
第六部分 基金份额 的申购与 赎回	<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>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时,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>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>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时,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。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,经与基金托管人协商确定后,基金管理人应当暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项。</p>
第六部分 基金份额 的申购与 赎回	<p>九、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>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</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>增加:</p> <p>(3) 如果基金发生巨额赎回,在单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额 20% 以上的赎回申请的情形下,基金管理人可以对该基金份额持有人超过 20% 以上的部分延期办理赎回申请。对于当日非延期的赎回申请,应当按单个账户非延期赎回申请量占非延期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。</p>

第七部分 基金合同 当事人及 权利义务	<p>一、基金管理人 (一)基金管理人简况 法定代表人: 赵如冰</p> <p>二、基金托管人 (一)基金托管人简况 法定代表人: 姜建清</p>	<p>一、基金管理人 (一)基金管理人简况 法定代表人: 杨光裕</p> <p>二、基金托管人 (一)基金托管人简况 法定代表人: 易会满</p>
第十二部分 基金 的投资	<p>二、投资范围</p> <p>本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票,含普通股和优先股)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、资产支持证券、中小企业私募债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。</p> <p>本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范围为0-95%。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>二、投资范围</p> <p>本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票,含普通股和优先股)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、资产支持证券、中小企业私募债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。</p> <p>本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范围为0-95%。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、存出保证金和应收申购款等。</p>
第十二部分 基金 的投资	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</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>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</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,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、存出保证金和应收申购款等;</p>
第十二部分 基金 的投资		<p>增加:</p> <p>(12)本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票,不超过</p>

		<p>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，不超过该上市公司可流通股票的 30%；</p> <p>(13)本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 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项所规定的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>(14)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投资范围保持一致；</p>
第十二部分 基金的投资	<p>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。法律法规另有规定，从其规定。</p>	<p>除上述第(2)、(13)、(14)、(15)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。法律法规另有规定，从其规定。</p>
第十四部分 基金资产估值	<p>三、估值方法</p> <p>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>(3)首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>	<p>三、估值方法</p> <p>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>(3) 流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等(不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票)，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>
第十四部分 基金资产估值	<p>三、估值方法</p>	<p>三、估值方法</p> <p>增加：</p> <p>7、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。</p>
第十四部分 基金资产估值	<p>六、暂停估值的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</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>六、暂停估值的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</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、中国证监会和基金合同认定的其它情形。</p>	<p>3、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时,经与基金托管人协商确认后,应当暂停估值;</p> <p>4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。</p>
<p>第十四部分 基金资产估值</p>	<p>八、特殊情况的处理</p> <p>1、基金管理人或基金托管人按本基金合同规定的估值方法的第7项进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。</p> <p>2、由于不可抗力原因,或由于证券、期货交易所及登记结算公司发送的数据错误,或国家会计政策变更、市场规则变更等,基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查,但未能发现错误的,由此造成的基金资产估值错误,基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。</p>	<p>八、特殊情况的处理</p> <p>1、基金管理人或基金托管人按本基金合同规定的估值方法的第8项进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。</p> <p>2、由于不可抗力原因,或由于证券、期货交易所及登记结算公司发送的数据错误,或国家会计政策变更、市场规则变更等,基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查,但未能发现错误的,由此造成的基金资产估值错误,基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。</p>
<p>第十八部分 基金的信息披露</p>	<p>(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</p> <p>基金管理人应当在每年结束之日起90日内,编制完成基金年度报告,并将年度报告正文登载于网站上,将年度报告摘要登载在指定媒介上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。</p> <p>基金管理人应当在上半年结束之日起60日内,编制完成基金半年度报告,并将半年度报告正文登载在网站上,将半年度报告摘要登载在指定媒介上。</p> <p>基金管理人应当在每个季度结束之日起15个工作日内,编制完成基金季度报告,并将季度报告登载在指定媒介上。</p> <p>基金合同生效不足2个月的,基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。</p> <p>基金定期报告在公开披露的第2个工作日,分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。</p>	<p>(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</p> <p>基金管理人应当在每年结束之日起90日内,编制完成基金年度报告,并将年度报告正文登载于网站上,将年度报告摘要登载在指定媒介上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。</p> <p>基金管理人应当在上半年结束之日起60日内,编制完成基金半年度报告,并将半年度报告正文登载在网站上,将半年度报告摘要登载在指定媒介上。</p> <p>基金管理人应当在每个季度结束之日起15个工作日内,编制完成基金季度报告,并将季度报告登载在指定媒介上。</p> <p>基金合同生效不足2个月的,基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。</p> <p>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。</p> <p>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额20%的情形,为保障其他投资者</p>

		<p>的权益,基金管理人至少应当在基金定期报告文件中“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本基金的特定风险,中国证监会认定的特殊情形除外。</p> <p>基金定期报告在公开披露的第2个工作日,分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。</p>
第十八部分 基金的信息披露	(七) 临时报告	<p>(七) 临时报告</p> <p>增加:</p> <p>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;</p> <p>27、基金管理人采用摆动定价机制进行估值;</p>
第二十四部分 基金合同内容摘要		<p>摘要部分也做了相应修改,与合同修订内容保持一致。</p>

二、对基金托管协议的修改内容

章节	修订前	修订后
一、基金托管协议当事人	<p>(一) 基金管理人 法定代表人: 赵如冰</p> <p>(二) 基金托管人 法定代表人: 姜建清 联系人: 赵会军</p>	<p>(一) 基金管理人 法定代表人: 杨光裕</p> <p>(二) 基金托管人 法定代表人: 易会满 联系人: 郭明</p>
二、基金托管协议的依据、目的和原则	<p>订立本协议的依据是《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》”)、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第7号〈托管协议的内容与格式〉》、《景顺长城中国回报灵活配置混合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。</p>	<p>订立本协议的依据是《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》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第7号〈托管协议的内容与格式〉》、《景顺长城中国回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)</p>

		及其他有关规定。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	<p>(一) 基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权</p> <p>2、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投融资比例进行监督：</p> <p>(1) 按法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金的投资资产配置比例为：本基金股票投资占基金资产的比例范围为 0-95%。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>如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。本基金投资于该类上市公司股票的比例。</p>	<p>(一)基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权</p> <p>2、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投融资比例进行监督：</p> <p>(1) 按法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金的投资资产配置比例为：本基金股票投资占基金资产的比例范围为 0-95%。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、存出保证金和应收申购款等。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。</p>
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	<p>(2) 根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金投资组合遵循以下投资限制：</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>(2)根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金投资组合遵循以下投资限制：</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、存出保证金和应收申购款等；</p>
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查		<p>增加：</p> <p>12) 本基金管理人管理且由本基金托管人托管的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)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%；本基金管理人管理且由本基金托管人托管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>13) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 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项所规定的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p>
三、基金	(3) 法规允许的基金投资比例调整期限	(3) 法规允许的基金投资比例调整期限

<p>托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>	<p>由于证券、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，以达到规定的投资比例限制要求，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。</p>	<p>除上述第 2)、13)、14) 项外，由于证券、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，以达到规定的投资比例限制要求，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。</p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>	<p>6、基金托管人对基金投资流通受限证券的监督</p> <p>(1) 基金投资流通受限证券，应遵守《关于规范基金投资非公开发行证券行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。</p> <p>(2) 流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>	<p>6、基金托管人对基金投资流通受限证券的监督</p> <p>(1) 基金投资流通受限证券，应遵守《关于规范基金投资非公开发行证券行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。</p> <p>(2) 流通受限证券与上文流动性受限资产不同，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>
<p>八、基金资产净值计算和会计核算</p>	<p>(二) 基金资产估值方法</p> <p>(2) 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>③首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>	<p>(二) 基金资产估值方法</p> <p>(2) 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>③流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等（不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票），按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>
<p>八、基金资产净值计算和会计核算</p>		<p>增加：</p> <p>(7) 当发生大额申购或赎回情形，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。</p>
<p>十、信息披露</p>	<p>(三) 暂停或延迟信息披露的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的证券、期货交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</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资产价值时；</p> <p>3、法律法规规定、中国证监会或</p>	<p>(三) 暂停或延迟信息披露的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的证券、期货交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</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资产价值时；</p> <p>3、前一估值日基金资产净值</p>

	《基金合同》认定的其他情形。	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时,经与基金托管人协商确认后暂停估值; 4、法律法规规定、中国证监会或《基金合同》认定的其他情形。
--	----------------	--

关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改 基金合同、托管协议的内容说明

景顺长城沪港深精选股票型证券投资基金

一、 基金合同修订内容

章节	修订前	修订后
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》”)、《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》”)、《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。
第二部分 释义		增加： 55、《流动性风险管理规定》：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 56、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

		<p>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>57、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>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>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，具体规定请参见招募说明书。</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。</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，具体规定请参见招募说明书。</p> <p>4、基金管理人可在法律法规允许的情况下，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实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。</p>	<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>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，具体规定请参见招募说明书。</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。</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，具体规定请参见招募说明书。</p> <p>4、基金管理人可在法律法规允许的情况下，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实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。</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。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。具体请参见相关公告。</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>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。对持续持有期少于7日的投资人收取不低于1.5%的赎回费，对持续持有期少于30日的投资人收取不低于0.75%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产；对持续持有期少于3个月的投资人收取不低于0.5%的赎回费，并将不低于赎回费总额的75%计入基金财产；对</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。对持续持有期少于7日的投资人收取不低于1.5%的赎回费并全额计入基金财产，对持续持有期少于30日的投资人收取不低于0.75%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产；对持续持有期少于3个月的投资人收取不低于0.5%的赎回费，并将不低于赎回</p>

	持续持有期长于 3 个月但少于 6 个月的投资者收取不低于 0.5% 的赎回费，并将不低于赎回费总额的 50% 计入基金财产；对持续持有期长于 6 个月的投资者，应当将不低于赎回费总额的 25% 计入基金财产，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。	费总额的 75% 计入基金财产；对持续持有期长于 3 个月但少于 6 个月的投资者收取不低于 0.5% 的赎回费，并将不低于赎回费总额的 50% 计入基金财产；对持续持有期长于 6 个月的投资者，应当将不低于赎回费总额的 25% 计入基金财产，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。
第六部分 基金份额 的申购与 赎回		增加： 8、当发生大额申购或赎回情形时，履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，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、自律组织的规定。
第六部分 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者的申购申请：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、因不可抗力导致基金无法正常运作。 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资者的申购申请。 3、证券、期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。 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。 5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或基金管理人认定的其他损害现有基金份额持有人利益的情形。 6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 <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。如果投资者的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资者。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>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者的申购申请：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、因不可抗力导致基金无法正常运作。 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资者的申购申请。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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受申购申请。 3、证券、期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。 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。 5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或基金管理人认定的其他损害现有基金份额持有人利益的情形。 6、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。 7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 <p>发生上述第 1、2、3、5、7 项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</p>

		指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的,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。
第六部分 基金份额 的申购与 赎回	<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>1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时,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>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>1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时,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。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,经与基金托管人协商确定后,基金管理人应当暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项。</p>
第六部分 基金份额 的申购与 赎回		<p>九、巨额赎回的情形及处理方式增加:</p> <p>(3) 如果基金发生巨额赎回,在单个基金份额持有人超过前一开放日基金总份额 20%以上的赎回申请的情形下,基金管理人可以对该基金份额持有人超过 20%以上的部分延期办理赎回申请。对于当日非延期的赎回申请,应当按单个账户非延期赎回申请量占非延期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。</p>
第七部分 基金合同 当事人及	<p>一、基金管理人</p> <p>(一) 基金管理人简况</p> <p>名称: 景顺长城基金管理有限公司</p>	<p>一、基金管理人</p> <p>(一) 基金管理人简况</p> <p>名称: 景顺长城基金管理有限公司</p>

<p>权利义务</p>	<p>住所：深圳市中心四路1号嘉里建设广场第1座21层 法定代表人：赵如冰 设立日期：2003年6月12日 批准设立机关及批准设立文号：中国证券监督管理委员会，中国证监会证监基金字[2003]76号 组织形式：有限责任公司 注册资本：1.3亿元人民币 存续期限：持续经营 联系电话：0755-22381600</p>	<p>住所：深圳市中心四路1号嘉里建设广场第1座21层 法定代表人：杨光裕 设立日期：2003年6月12日 批准设立机关及批准设立文号：中国证券监督管理委员会，中国证监会证监基金字[2003]76号 组织形式：有限责任公司 注册资本：1.3亿元人民币 存续期限：持续经营 联系电话：0755-22381600</p>
<p>第七部分 基金合同 当事人及 权利义务</p>	<p>二、基金托管人 (一) 基金托管人简况 名称：中国工商银行股份有限公司 住所：北京市西城区复兴门内大街55号(100032) 法定代表人：姜建清 成立时间：1984年1月1日 批准设立机关和批准设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》(国发[1983]146号) 组织形式：股份有限公司 注册资本：人民币349,018,545,827元 存续期间：持续经营 基金托管资格批文及文号：中国证监会和中国人民银行证监基金字【1998】3号</p>	<p>二、基金托管人 (一) 基金托管人简况 名称：中国工商银行股份有限公司 住所：北京市西城区复兴门内大街55号(100032) 法定代表人：易会满 成立时间：1984年1月1日 批准设立机关和批准设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》(国发[1983]146号) 组织形式：股份有限公司 注册资本：人民币349,018,545,827元 存续期间：持续经营 基金托管资格批文及文号：中国证监会和中国人民银行证监基金字【1998】3号</p>
<p>第十二部分 基金 的投资</p>	<p>二、投资范围 本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、沪港股票市场交易互联互通机制试点允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、资产支持证券、中小企业私募债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。 如法律法规或监管机构以后允许</p>	<p>二、投资范围 本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、沪港股票市场交易互联互通机制试点允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、资产支持证券、中小企业私募债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。</p>

	<p>基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。</p> <p>本基金将基金资产的 80%-95% 投资于股票资产（其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 0-95%，投资于港股通标的股票的比例占基金资产的 0-95%），权证投资比例不超过基金资产净值的 3%，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，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%。</p>	<p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。</p> <p>本基金将基金资产的 80%-95% 投资于股票资产（其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 0-95%），权证投资比例不超过基金资产净值的 3%，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，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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</p>
第十二部分 基金的投资	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</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>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</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、存出保证金和应收申购款等；</p>
第十二部分 基金的投资	<p>(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；</p>	<p>(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不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，不超过该上市公司可流通股票的 30%；</p>
第十二部分 基金的投资		<p>增加：</p> <p>(16) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 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项所规定的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>(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投资范围保持一致；</p>

第十二部分 基金的投资	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。法律法规另有规定，从其规定。	除上述第(2)、(12)、(16)、(17)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。法律法规另有规定，从其规定。
第十四部分 基金资产估值	三、估值方法 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理： (3)首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。	三、估值方法 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理： (3) 流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等(不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票)，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。
第十四部分 基金资产估值		三、估值方法 增加： 8、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。
第十四部分 基金资产估值	六、暂停估值的情形 1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； 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； 3、中国证监会和基金合同认定的其它情形。	六、暂停估值的情形 1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； 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； 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时，经与基金托管人协商确认后，应当暂停估值； 4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。
第十八部分 基金的信息披露	(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 基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定媒介上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。 基金管理人应当在上半年结束之	(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 基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定媒介上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。 基金管理人应当在上半年结束

	<p>日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定媒介上。</p> <p>基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定媒介上。</p> <p>基金合同生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。</p> <p>基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。</p>	<p>之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定媒介上。</p> <p>基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定媒介上。</p> <p>基金合同生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。</p> <p>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。</p> <p>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例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文件中“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本基金的特定风险，中国证监会认定的特殊情形除外。</p> <p>基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。</p>
第十八部分 基金的信息披露		<p>(七) 临时报告</p> <p>增加：</p> <p>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；</p> <p>27、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；</p>
第二十四部分 基金合同内容摘要		<p>对应基金合同正文内容进行同步修改。</p>

二、 基金托管协议修订内容

章节	修订前	修订后
一、基金托管协议当事人	<p>(一) 基金管理人 名称：景顺长城基金管理有限公司</p>	<p>(一) 基金管理人 名称：景顺长城基金管理有限公司</p>

	<p>住所：深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第 1 座 21 层 法定代表人：赵如冰 成立时间：2003 年 6 月 12 日 批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2003]76 号 注册资本：1.3 亿元人民币 组织形式：有限责任公司 经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会批准的其他业务 存续期间：持续经营</p>	<p>住所：深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第 1 座 21 层 法定代表人：杨光裕 成立时间：2003 年 6 月 12 日 批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2003]76 号 注册资本：1.3 亿元人民币 组织形式：有限责任公司 经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会批准的其他业务 存续期间：持续经营</p>
一、基金托管协议当事人	<p>(二) 基金托管人 名称：中国工商银行股份有限公司 住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号 (100032) 法定代表人：姜建清 电话：(010) 66105799 传真：(010) 66105798 联系人：赵会军 成立时间：1984 年 1 月 1 日 组织形式：股份有限公司 注册资本：人民币 349,018,545,827 元 批准设立机关和设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》(国发[1983]146 号) 存续期间：持续经营</p>	<p>(二) 基金托管人 名称：中国工商银行股份有限公司 住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号 (100032) 法定代表人：易会满 电话：(010) 66105799 传真：(010) 66105798 联系人：郭明 成立时间：1984 年 1 月 1 日 组织形式：股份有限公司 注册资本：人民币 349,018,545,827 元 批准设立机关和设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》(国发[1983]146 号) 存续期间：持续经营</p>
二、基金托管协议的依据、目的和原则	<p>订立本协议的依据是《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》”)、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 7 号〈托管协议的内容与格式〉》、《景顺长城沪港深精选股票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。</p>	<p>订立本协议的依据是《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》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 7 号〈托管协议的内容与格式〉》、《景顺长城沪港深精选股票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。</p>
三、基金托管人对基金管理人业务监督和核	<p>2、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投融资比例进行监督： (1) 按法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金的投资资产配置比例为：本基金将基金资产的 80%</p>	<p>2、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投融资比例进行监督： (1) 按法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金的投资资产配置比例为：本基金将基金资产的</p>

查	-95%投资于股票资产（其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 0-95%，投资于港股通标的股票的比例占基金资产的 0-95%），权证投资比例不超过基金资产净值的 3%，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，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%。	80%-95%投资于股票资产（其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 0-95%，投资于港股通标的股票的比例占基金资产的 0-95%），权证投资比例不超过基金资产净值的 3%，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，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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	<p>(2) 根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金投资组合遵循以下投资限制：</p> <p>1) 本基金股票投资占基金资产的比例范围为 80%-95%；</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>(2) 根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金投资组合遵循以下投资限制：</p> <p>1) 本基金股票投资占基金资产的比例范围为 80%-95%；</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、存出保证金和应收申购款等；</p>
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	<p>4) 本基金管理人管理且由基金托管人托管的全部基金持有一家发行的证券，不超过该证券的 10%；</p>	<p>4) 本基金管理人管理且由基金托管人托管的全部基金持有一家发行的证券，不超过该证券的 10%；本基金管理人管理且由本基金托管人托管的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）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%；本基金管理人管理且由本基金托管人托管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>
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查		<p>增加：</p> <p>12) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 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项所规定的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p>
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	<p>(3) 法规允许的基金投资比例调整期限</p> <p>由于证券、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 个工作日内进行调整，以达</p>	<p>(3) 法规允许的基金投资比例调整期限</p> <p>除上述第 2)、12)、13) 项外，由于证券、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</p>

	到规定的投资比例限制要求，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。	人应在 10 个交易日内进行调整，以达到规定的投资比例限制要求，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	<p>6、基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对基金管理人投资流通受限证券的监督</p> <p>(1) 基金投资流通受限证券，应遵守《关于规范基金投资非公开发行股票行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。</p> <p>(2) 流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>	<p>6、基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对基金管理人投资流通受限证券的监督</p> <p>(1) 基金投资流通受限证券，应遵守《关于规范基金投资非公开发行股票行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。</p> <p>(2) 流通受限证券与上文流动性受限资产不同，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>
八、基金资产净值计算和会计核算	<p>(二) 基金资产估值方法</p> <p>2、估值方法</p> <p>(2) 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>	<p>(二) 基金资产估值方法</p> <p>2、估值方法</p> <p>(2) 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>3) 流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等(不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票)，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>
八、基金资产净值计算和会计核算		<p>增加：</p> <p>(8) 当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。</p>
十、信息披露		<p>(三) 暂停或延迟信息披露的情形</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时，经与基金托管人协商确认后暂停估值；</p>

关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改

基金合同、托管协议的内容说明

景顺长城量化新动力股票型证券投资基金

一、 基金合同修订内容

章节	修订前	修订后
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》”)、《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》”)、《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。
第二部分 释义		<p>增加：</p> <p>52、《流动性风险管理规定》：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</p> <p>53、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>54、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>
第六部分	五、申购和赎回的数量限制	五、申购和赎回的数量限制

<p>基金份额的申购与赎回</p>	<p>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，具体规定请参见招募说明书。</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。</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，具体规定请参见招募说明书。</p> <p>4、基金管理人可在法律法规允许的情况下，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实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。</p>	<p>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，具体规定请参见招募说明书。</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。</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，具体规定请参见招募说明书。</p> <p>4、基金管理人可在法律法规允许的情况下，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实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。</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。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。具体请参见相关公告。</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>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。赎回费用中扣除应根据法律法规规定的比例归入基金财产，未归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>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。赎回费用中扣除应根据法律法规规定的比例归入基金财产，对于持续持有期少于7日的投资者，本基金将收取不低于1.5%的赎回费并全额计入基金财产。未归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>第六部分基金份额的申购与赎回</p>		<p>增加：</p> <p>8、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，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、自律组织的规定。</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>1、因不可抗力导致基金无法正常运作。</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。</p> <p>3、证券、期货交易所交易时间非</p>	<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>1、因不可抗力导致基金无法正常运作。</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产</p>

	<p>正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</p> <p>4、接受某笔或某些申购申请会影响或损害现有基金份额持有人利益时。</p> <p>5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或出现其他损害现有基金份额持有人利益的情形。</p> <p>6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</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>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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受申购申请。</p> <p>3、证券、期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</p> <p>4、接受某笔或某些申购申请会影响或损害现有基金份额持有人利益时。</p> <p>5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或出现其他损害现有基金份额持有人利益的情形。</p> <p>6、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。</p> <p>7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。发生上述第 1、2、3、5、7 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全部或部分拒绝的，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>1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，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>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>1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，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。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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项。</p>
<p>第六部分 基金份额</p>		<p>九、巨额赎回的情形及处理方式增加：</p> <p>(3) 如果基金发生巨额赎回，</p>

<p>的申购与赎回</p>		<p>在单个基金份额持有人超过前一开放日基金总份额 20%以上的赎回申请的情形下,基金管理人可以对该基金份额持有人超过 20%以上的部分延期办理赎回申请。对于当日非延期的赎回申请,应当按单个账户非延期赎回申请量占非延期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。</p>
<p>第七部分 基金合同 当事人及 权利义务</p>	<p>一、基金管理人 (一) 基金管理人简况 名称: 景顺长城基金管理有限公司 住所: 深圳市中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层 法定代表人: 赵如冰 设立日期: 2003 年 6 月 12 日 批准设立机关及批准设立文号: 中国证券监督管理委员会, 中国证监会证监基金字 [2003] 76 号 组织形式: 有限责任公司 注册资本: 1.3 亿元人民币 存续期限: 持续经营 联系电话: 400-8888-606</p>	<p>一、基金管理人 (一) 基金管理人简况 名称: 景顺长城基金管理有限公司 住所: 深圳市中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层 法定代表人: 杨光裕 设立日期: 2003 年 6 月 12 日 批准设立机关及批准设立文号: 中国证券监督管理委员会, 中国证监会证监基金字 [2003] 76 号 组织形式: 有限责任公司 注册资本: 1.3 亿元人民币 存续期限: 持续经营 联系电话: 400-8888-606</p>
<p>第七部分 基金合同 当事人及 权利义务</p>	<p>二、基金托管人 (一) 基金托管人简况 名称: 中国工商银行股份有限公司 住所: 北京市西城区复兴门内大街 55 号 (100032) 法定代表人: 姜建清 成立时间: 1984 年 1 月 1 日 批准设立机关和批准设立文号: 国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》(国发 [1983]146 号) 组织形式: 股份有限公司 注册资本: 人民币 349,018,545,827 元</p>	<p>二、基金托管人 (一) 基金托管人简况 名称: 中国工商银行股份有限公司 住所: 北京市西城区复兴门内大街 55 号 (100032) 法定代表人: 易会满 成立时间: 1984 年 1 月 1 日 批准设立机关和批准设立文号: 国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》(国发 [1983]146 号) 组织形式: 股份有限公司 注册资本: 人民币 349,018,545,827 元</p>

	<p>存续期间：持续经营 基金托管资格批文及文号：中国证监会和中国人民银行证监基金字【1998】3号</p>	<p>存续期间：持续经营 基金托管资格批文及文号：中国证监会和中国人民银行证监基金字【1998】3号</p>
第十二部分 基金的投资	<p>二、投资范围 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（含中小企业私募债）、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p> <p>基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例范围为80%-95%；除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为5%-20%，其中权证资产占基金资产净值的比例范围为0-3%，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，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%。</p>	<p>二、投资范围 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（含中小企业私募债）、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p> <p>基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例范围为80%-95%；除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为5%-20%，其中权证资产占基金资产净值的比例范围为0-3%，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，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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</p>
第十二部分 基金的投资	<p>四、投资限制 1、组合限制 15.6 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>四、投资限制 1、组合限制 15.6 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、存出保证金和应收申购款等；</p>
第十二部分 基金的投资		<p>增加： (18) 本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不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，不超过该上市公司可流通股票的30%； (19) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的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</p>

		<p>理人之外的因素致使基金不符合本项所规定的比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;</p> <p>(20)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投资范围保持一致;</p>
第十二部分 基金的投资	<p>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。法律法规另有规定的,从其规定。</p>	<p>除上述(11)、(19)、(20)项及 15.6 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。法律法规另有规定的,从其规定。</p>
第十四部分 基金资产估值		<p>三、估值方法 增加: 7、当发生大额申购或赎回情形时,在履行适当程序后,基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。 8、流通受限的股票,包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等(不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票),按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>
第十四部分 基金资产估值	<p>六、暂停估值的情形 1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时; 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; 3、中国证监会和基金合同认定的其它情形。</p>	<p>六、暂停估值的情形 1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时; 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; 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时,经与基金托管人协商确认后,应当暂停估值; 4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。</p>
第十四部分 基金资产估值	<p>八、特殊情况的处理 1、基金管理人或基金托管人按本基金合同规定的估值方法的第 7 项进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。</p>	<p>八、特殊情况的处理 1、基金管理人或基金托管人按本基金合同规定的估值方法的第 9 项进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。</p>

<p>第十八部分 基金的信息披露</p>	<p>(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</p> <p>基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内, 编制完成基金年度报告, 并将年度报告正文登载于其网站上, 将年度报告摘要登载在指定媒介上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。</p> <p>基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内, 编制完成基金半年度报告, 并将半年度报告正文登载在其网站上, 将半年度报告摘要登载在指定媒介上。</p> <p>基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内, 编制完成基金季度报告, 并将季度报告登载在指定媒介上。</p> <p>《基金合同》生效不足 2 个月的, 基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。</p> <p>基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日, 分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。</p>	<p>(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</p> <p>基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内, 编制完成基金年度报告, 并将年度报告正文登载于其网站上, 将年度报告摘要登载在指定媒介上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。</p> <p>基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内, 编制完成基金半年度报告, 并将半年度报告正文登载在其网站上, 将半年度报告摘要登载在指定媒介上。</p> <p>基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内, 编制完成基金季度报告, 并将季度报告登载在指定媒介上。</p> <p>《基金合同》生效不足 2 个月的, 基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。</p> <p>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。</p> <p>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例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文件中“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本基金的特定风险, 中国证监会认定的特殊情形除外。</p> <p>基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日, 分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。</p>
<p>第十八部分 基金的信息披露</p>		<p>(七) 临时报告</p> <p>增加:</p> <p>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;</p> <p>27、基金管理人采用摆动定价机制进行估值;</p>
<p>第二十四部分 基金合同内容摘要</p>		<p>对应基金合同正文内容进行同步修改。</p>

二、 基金托管协议修订内容

章节	修订前	修订后
一、基金托管协议当事人	<p>(一) 基金管理人 名称：景顺长城基金管理有限公司 住所：深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第 1 座 21 层 法定代表人：赵如冰 成立时间：2003 年 6 月 12 日 批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2003]76 号 注册资本：1.3 亿元人民币 组织形式：有限责任公司 经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会批准的其他业务 存续期间：持续经营</p>	<p>(一) 基金管理人 名称：景顺长城基金管理有限公司 住所：深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第 1 座 21 层 法定代表人：杨光裕 成立时间：2003 年 6 月 12 日 批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2003]76 号 注册资本：1.3 亿元人民币 组织形式：有限责任公司 经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会批准的其他业务 存续期间：持续经营</p>
一、基金托管协议当事人	<p>(二) 基金托管人 名称：中国工商银行股份有限公司 住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号（100032） 法定代表人：姜建清 电话：（010）66105799 传真：（010）66105798 联系人：赵会军 成立时间：1984 年 1 月 1 日 组织形式：股份有限公司 注册资本：人民币 349,018,545,827 元 批准设立机关和设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》（国发[1983]146 号） 存续期间：持续经营</p>	<p>(二) 基金托管人 名称：中国工商银行股份有限公司 住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号（100032） 法定代表人：易会满 电话：（010）66105799 传真：（010）66105798 联系人：郭明 成立时间：1984 年 1 月 1 日 组织形式：股份有限公司 注册资本：人民币 349,018,545,827 元 批准设立机关和设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》（国发[1983]146 号） 存续期间：持续经营</p>
二、基金托管协议的依据、目的和原则	<p>订立本协议的依据是《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》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 7 号</p>	<p>订立本协议的依据是《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》、《证券投资基金信息</p>

	〈托管协议的内容与格式〉》、《景顺长城量化新动力股票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。	披露内容与格式准则第7号〈托管协议的内容与格式〉》、《景顺长城量化新动力股票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。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	<p>2、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投融资比例进行监督：</p> <p>（1）按法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金的投资资产配置比例为：</p> <p>股票资产占基金资产的比例范围为80%-95%；除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为5%—20%，其中权证资产占基金资产净值的比例范围为0—3%，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，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%。</p>	<p>2、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投融资比例进行监督：</p> <p>（1）按法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金的投资资产配置比例为：</p> <p>股票资产占基金资产的比例范围为80%-95%；除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为5%—20%，其中权证资产占基金资产净值的比例范围为0—3%，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，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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</p>
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查		<p>（2）根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金投资组合遵循以下投资限制：</p> <p>增加：</p> <p>11) 本基金管理人管理且由本基金托管人托管的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)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%；本基金管理人管理且由本基金托管人托管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>12) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的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项所规定的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p>
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	15.6 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；	17.6 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、存出保证金和应收申购款等；
三、基金	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	除上述第12)、13)项及17.6外，因证券、期货市场波动、上市公

<p>托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>	<p>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 个工作日内进行调整，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。</p>	<p>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 个工作日内进行调整，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。</p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>	<p>6、基金托管人对基金投资流通受限证券的监督</p> <p>(1) 基金投资流通受限证券，应遵守《关于规范基金投资非公开发行证券行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。</p> <p>(2) 流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p> <p>(3) 基金管理人应在基金首次投资流通受限证券前，向基金托管人提供经基金管理人董事会批准的有关基金投资流通受限证券的投资决策流程、风险控制制度。基金投资非公开发行股票，基金管理人还应提供基金管理人董事会批准的流动性风险处置预案。上述资料应包括但不限于基金投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制情况。</p>	<p>6、基金托管人对基金投资流通受限证券的监督</p> <p>(1) 基金投资流通受限证券，应遵守《关于规范基金投资非公开发行证券行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。</p> <p>(2) 流通受限证券与上文流动性受限资产不同，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p> <p>(3) 基金管理人应在基金首次投资流通受限证券前，向基金托管人提供经基金管理人董事会批准的有关基金投资流通受限证券的投资决策流程、风险控制制度。基金投资非公开发行股票，基金管理人还应提供基金管理人董事会批准的流动性风险处置预案。上述资料应包括但不限于基金投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制情况。</p>
<p>八、基金资产净值计算和会计核算</p>		<p>(二) 基金资产估值方法</p> <p>2、估值方法</p> <p>增加：</p> <p>(7) 当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。</p> <p>(8) 流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等(不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票)，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>
<p>十、信息</p>		<p>(三) 暂停或延迟信息披露的情形</p>

披露		<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时，经与基金托管人协商确认后暂停估值；</p>
----	--	---

关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改 基金合同、托管协议的内容说明

景顺长城景盛双息收益债券型证券投资基金

一、 基金合同修订内容

章节	修订前	修订后
第一部分 前言	<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>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>
第二部分 释义		<p>增加：</p> <p>54、《流动性风险管理规定》：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</p>

		<p>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>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>56、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>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>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，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</p> <p>4、基金管理人可在法律法规允许的情况下，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实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。</p>	<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>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，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</p> <p>4、基金管理人可在法律法规允许的情况下，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实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。</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。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。具体请参见相关公告。</p>
<p>第六部分</p>	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p>	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p>

基金份 额的申 购与 赎回	6、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归入基金财产，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。	6、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。对于持续持有期少于7日的投资者，本基金将收取不低于1.5%的赎回费并全额计入基金财产。赎回费用应根据法律法规规定的比例归入基金财产，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。
第六部分 基金份 额的申 购与 赎回		增加： 9、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，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、自律组织的规定。
第六部分 基金份 额的申 购与 赎回	七、拒绝或暂停申购的情形 1、因不可抗力导致基金无法正常运作。 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。 3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。 4、基金管理人接受某笔或某些申购申请会影响或损害现有基金份额持有人利益时。 5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形。 6、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统、基金登记系统或基金会计系统无法正常运行。 7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第1、2、3、5、6、7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。	七、拒绝或暂停申购的情形 1、因不可抗力导致基金无法正常运作。 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受申购申请。 3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。 4、基金管理人接受某笔或某些申购申请会影响或损害现有基金份额持有人利益时。 5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形。 6、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统、基金登记系统或基金会计系统无法正常运行。 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%，或者变相规避50%集中度的情形时。 8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

		<p>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全部或部分拒绝的,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> <ol style="list-style-type: none"> 1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时,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>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> <ol style="list-style-type: none"> 1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时,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。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,经与基金托管人协商确定后,基金管理人应当暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项。
<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增加:</p> <p>(3) 如果基金发生巨额赎回,在单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额 20%以上的赎回申请的情形下,基金管理人可以对该基金份额持有人超过 20%以上的部分延期办理赎回申请。对于当日非延期的赎回申请,应当按单个账户非延期赎回申请量占非延期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。</p>

<p>第七部分 基金合同 当事人及 权利义务</p>	<p>一、基金管理人 (一) 基金管理人简况 名称: 景顺长城基金管理有限公 司 住所: 深圳市中心四路 1 号嘉里 建设广场第 1 座 21 层 法定代表人: 赵如冰 设立日期: 2003 年 6 月 12 日 批准设立机关及批准设立文号: 中国证券监督管理委员会, 中国证 监会证监基金字 [2003] 76 号 组织形式: 有限责任公司 注册资本: 1.3 亿元人民币 存续期限: 持续经营 联系电话: 400-8888-606</p>	<p>一、基金管理人 (一) 基金管理人简况 名称: 景顺长城基金管理有限公 司 住所: 深圳市中心四路 1 号嘉里 建设广场第 1 座 21 层 法定代表人: 杨光裕 设立日期: 2003 年 6 月 12 日 批准设立机关及批准设立文号: 中国证券监督管理委员会, 中国证 监会证监基金字 [2003] 76 号 组织形式: 有限责任公司 注册资本: 1.3 亿元人民币 存续期限: 持续经营 联系电话: 400-8888-606</p>
<p>第七部分 基金合同 当事人及 权利义务</p>	<p>二、基金托管人 (一) 基金托管人简况 名称: 中国工商银行股份有限 公司 (简称: 中国工商银行) 住所: 北京市西城区复兴门内大 街 55 号 法定代表人: 姜建清 成立时间: 1984 年 1 月 1 日 组织形式: 股份有限公司 注册资 本 : 人 民 币 349,018,545,827 元 存续期间: 持续经营 批准设立机关及批准设立文号: 国务院《关于中国人民银行专门行使 中央银行职能的决定》(国发 [1983]146 号) 基金托管业务批准文号: 中国证 监会和中国人民银行证监基字【1998】 3 号 联系人: 赵会军 联系电话: 010-66105799</p>	<p>二、基金托管人 (一) 基金托管人简况 名称: 中国工商银行股份有限公 司 (简称: 中国工商银行) 住所: 北京市西城区复兴门内大 街 55 号 办公地址: 北京市西城区复兴门 内大街 55 号 法定代表人: 易会满 成立时间: 1984 年 1 月 1 日 组织形式: 股份有限公司 注册资 本 : 人 民 币 349,018,545,827 元 存续期间: 持续经营 批准设立机关及批准设立文号: 国务院《关于中国人民银行专门行使 中央银行职能的决定》(国发 [1983]146 号) 基金托管业务批准文号: 中国证 监会和中国人民银行证监基字 【1998】3 号 联系人: 郭明 联系电话: 010-66105799</p>
<p>第十二部 分 基金 的投资</p>	<p>二、投资范围 本基金的投资范围主要为依法发 行的固定收益类品种, 包括国内依法 发行上市的国家债券、金融债券、次 级债券、中央银行票据、企业债券、 中小企业私募债券、公司债券、中期 票据、短期融资券、质押及买断式回 购、协议存款、通知存款、定期存款、 资产支持证券、可转换债券 (含分离 型可转换债券)、银行存款等。本基金 同时投资于股票 (包含中小板、创业 板及其他经中国证监会核准上市的股 票)、权证等权益类品种以及法律、法</p>	<p>二、投资范围 本基金的投资范围主要为依法发 行的固定收益类品种, 包括国内依 法发行上市的国家债券、金融债券、 次级债券、中央银行票据、企业债券、 中小企业私募债券、公司债券、中期 票据、短期融资券、质押及买断式回 购、协议存款、通知存款、定期存款、 资产支持证券、可转换债券 (含分离 型可转换债券)、银行存款等。本基 金同时投资于股票 (包含中小板、创 业板及其他经中国证监会核准上市 的股票)、权证等权益类品种以及法</p>

	<p>规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，其中，本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，其中，本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</p>
第十二部分 基金的投资	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(1) 本基金对债券类资产的投资比例不低于基金资产的 80%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%；</p> <p>(2) 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>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(1) 本基金对债券类资产的投资比例不低于基金资产的 80%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%；</p> <p>(2) 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、存出保证金和应收申购款等；</p>
第十二部分 基金的投资		<p>增加：</p> <p>(11) 本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不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，不超过该上市公司可流通股票的 30%；</p> <p>(12) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 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项所规定的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>(13) 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投资范围保持一致；</p>
第十二部分 基金的投资	<p>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</p>	<p>除上述第(2)、(12)、(13)、(14)项外，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比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应</p>

	会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定，从其规定。	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，从其规定。
第十四部分 基金资产估值		<p>三、估值方法</p> <p>增加：</p> <p>6、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。</p> <p>7、流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等（不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票），按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>
第十四部分 基金资产估值	<p>五、估值错误的处理</p> <p>4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：</p> <p>（2）错误偏差达到基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告。</p>	<p>五、估值错误的处理</p> <p>4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：</p> <p>（2）错误偏差达到基金资产净值的 0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告。</p>
第十四部分 基金资产估值	<p>六、暂停估值的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</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值出现重大转变，而基金管理人为保障基金份额持有人的利益，决定延迟估值；</p> <p>4、出现基金管理人认为属于会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的紧急事故的任何情况；</p> <p>5、中国证监会和基金合同认定的其它情形。</p>	<p>六、暂停估值的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</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值出现重大转变，而基金管理人为保障基金份额持有人的利益，决定延迟估值；</p> <p>4、出现基金管理人认为属于会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的紧急事故的任何情况；</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时，经与基金托管人协商确认后，应当暂停估值；</p> <p>6、中国证监会和基金合同认定的其它情形。</p>
第十四部分 基金资产估值	<p>八、特殊情况的处理</p> <p>1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 6 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。</p>	<p>八、特殊情况的处理</p> <p>1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 8 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。</p>

<p>第十八部分 基金的信息披露</p>	<p>(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</p> <p>基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内, 编制完成基金年度报告, 并将年度报告正文登载于其网站上, 将年度报告摘要登载在指定媒介上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。</p> <p>基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内, 编制完成基金半年度报告, 并将半年度报告正文登载在其网站上, 将半年度报告摘要登载在指定媒介上。</p> <p>基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内, 编制完成基金季度报告, 并将季度报告登载在指定媒介上。</p> <p>《基金合同》生效不足 2 个月的, 基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。</p> <p>基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日, 分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。</p>	<p>(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</p> <p>基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内, 编制完成基金年度报告, 并将年度报告正文登载于其网站上, 将年度报告摘要登载在指定媒介上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。</p> <p>基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内, 编制完成基金半年度报告, 并将半年度报告正文登载在其网站上, 将半年度报告摘要登载在指定媒介上。</p> <p>基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内, 编制完成基金季度报告, 并将季度报告登载在指定媒介上。</p> <p>《基金合同》生效不足 2 个月的, 基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。</p> <p>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。</p> <p>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例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文件中“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本基金的特定风险, 中国证监会认定的特殊情形除外。</p> <p>基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日, 分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。</p>
<p>第十八部分 基金的信息披露</p>		<p>(七) 临时报告</p> <p>增加:</p> <p>27、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> <p>28、基金管理人采用摆动定价机制进行估值;</p>
<p>第二十四部分 基金合同内容摘要</p>		<p>对应基金合同正文内容进行同步修改。</p>

二、 基金托管协议修订内容

章节	修订前	修订后
<p>一、基金托管协议当事人</p>	<p>(一) 基金管理人 名称：景顺长城基金管理有限公司 住所：深圳市中心四路 1 号嘉里建设广场第 1 座 21 层 法定代表人：赵如冰 设立日期：2003 年 6 月 12 日 批准设立机关及批准设立文号：中国证券监督管理委员会，证监基金字 [2003] 76 号 组织形式：有限责任公司 注册资本：1.3 亿元人民币 存续期限：持续经营 联系电话：400-8888-606</p>	<p>(一) 基金管理人 名称：景顺长城基金管理有限公司 住所：深圳市中心四路 1 号嘉里建设广场第 1 座 21 层 法定代表人：杨光裕 设立日期：2003 年 6 月 12 日 批准设立机关及批准设立文号：中国证券监督管理委员会，证监基金字 [2003] 76 号 组织形式：有限责任公司 注册资本：1.3 亿元人民币 存续期限：持续经营 联系电话：400-8888-606</p>
<p>一、基金托管协议当事人</p>	<p>(二) 基金托管人 名称：中国工商银行股份有限公司 住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号 (100032) 法定代表人：姜建清 电话：(010) 66105799 传真：(010) 66105798 联系人：蒋松云 成立时间：1984 年 1 月 1 日 组织形式：股份有限公司 注册资本：人民币 349,321,234,595 元 批准设立机关和设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》(国发[1983]146 号) 存续期间：持续经营</p>	<p>(二) 基金托管人 名称：中国工商银行股份有限公司 住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号 (100032) 法定代表人：易会满 电话：(010) 66105799 传真：(010) 66105798 联系人：郭明 成立时间：1984 年 1 月 1 日 组织形式：股份有限公司 注册资本：人民币 349,321,234,595 元 批准设立机关和设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》(国发[1983]146 号) 存续期间：持续经营</p>
<p>二、基金托管协议的依据、目的和原则</p>	<p>订立本协议的依据是《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》)、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 7 号〈托管协议的内容与格式〉》、《景顺长城景盛</p>	<p>订立本协议的依据是《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》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 7 号〈托管协议的内</p>

	双息收益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。	容与格式)》、《景顺长城景盛双息收益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。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	<p>2、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投融资比例进行监督:</p> <p>(1) 按法律法规的规定及《基金合同》的约定,本基金的投资资产配置比例为:本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%;股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%,其中,本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%;现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>2、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投融资比例进行监督:</p> <p>(1) 按法律法规的规定及《基金合同》的约定,本基金的投资资产配置比例为:本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%;股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%,其中,本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%;现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</p>
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	<p>(2) 根据法律法规的规定及《基金合同》的约定,本基金投资组合遵循以下投资限制:</p> <p>a、本基金对债券类资产的投资比例不低于基金资产的 80%;股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%,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>(2) 根据法律法规的规定及《基金合同》的约定,本基金投资组合遵循以下投资限制:</p> <p>a、本基金对债券类资产的投资比例不低于基金资产的 80%;股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%;</p> <p>b、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、存出保证金和应收申购款等;</p>
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查		<p>增加:</p> <p>k、本基金管理人管理且由本基金托管人托管的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)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%;本基金管理人管理且由本基金托管人托管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>l、基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 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项所规定的比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;</p>
三、基金托管人对	<p>(3) 法规允许的基金投资比例调整期限</p> <p>由于证券市场波动、证券发行人</p>	<p>(3) 法规允许的基金投资比例调整期限</p> <p>除上述第 b、l、m 项外,由于证</p>

<p>基金管理人的业务监督和核查</p>	<p>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，以达到规定的投资比例限制要求，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。</p>	<p>券市场波动、证券发行人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，以达到规定的投资比例限制要求，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。</p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>	<p>6、基金托管人对基金投资流通受限证券的监督</p> <p>(1) 基金投资流通受限证券，应遵守《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。</p> <p>(2) 流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>	<p>6、基金托管人对基金投资流通受限证券的监督</p> <p>(1) 基金投资流通受限证券，应遵守《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。</p> <p>(2) 流通受限证券与上文流动性受限资产不同，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>
<p>八、基金资产净值计算和会计核算</p>		<p>(二) 基金资产估值方法</p> <p>2、估值方法</p> <p>增加：</p> <p>(6) 当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。</p> <p>(7) 流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等(不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票)，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>
<p>十、信息披露</p>		<p>(三) 暂停或延迟信息披露的情形</p> <p>增加：</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时，经与基金托管人协商确认后暂停估值；</p>

关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改 基金合同、托管协议的内容说明

景顺长城新兴成长混合型证券投资基金

一、 基金合同修订内容

章节	修订前	修订后
一、前言 和释义	<p>一、前言</p> <p>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，规范景顺长城新兴成长混合型证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）运作，依照《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》）、《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》）及其他有关规定，在平等自愿、诚实信用、充分保护基金投资者及相关当事人的合法权益的原则基础上，特订立《景顺长城新兴成长混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“本合同”或“《基金合同》”）。</p>	<p>一、前言</p> <p>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，规范景顺长城新兴成长混合型证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）运作，依照《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》）、《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》）及其他有关规定，在平等自愿、诚实信用、充分保护基金投资者及相关当事人的合法权益的原则基础上，特订立《景顺长城新兴成长混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“本合同”或“《基金合同》”）。</p>
一、前言 和释义		<p>增加：</p> <p>流动性风险管理规定指《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</p> <p>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</p>

		<p>务违约无法进行转让或交易的债券等</p> <p>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>
五、基金的申购、赎回及其他注册登记业务	<p>五、申购与赎回的数额限制</p> <p>1、基金管理人可以规定投资者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《招募说明书》;</p> <p>2、基金管理人可以规定投资者每个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》;</p> <p>3、基金管理人可以规定单个投资者累计持有的基金份额上限。具体规定请参见《招募说明书》;</p> <p>4、基金管理人可根据市场情况,在法律法规允许的情况下,调整上述对申购的金额和赎回的份额的数量限制,基金管理人必须在调整生效前 2 个工作日至少在一家中国证监会指定的媒体公告并报中国证监会备案。</p>	<p>五、申购与赎回的数额限制</p> <p>1、基金管理人可以规定投资者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《招募说明书》;</p> <p>2、基金管理人可以规定投资者每个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》;</p> <p>3、基金管理人可以规定单个投资者累计持有的基金份额上限。具体规定请参见《招募说明书》;</p> <p>4、基金管理人可根据市场情况,在法律法规允许的情况下,调整上述对申购的金额和赎回的份额的数量限制,基金管理人必须在调整生效前 2 个工作日至少在一家中国证监会指定的媒体公告并报中国证监会备案;</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。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。具体请参见相关公告。</p>
五、基金的申购、赎回及其他注册登记业务	<p>六、申购费用和赎回费用</p> <p>2、投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。本基金的赎回费用在投资人赎回本基金份额时收取,扣除用于市场推广、注册登记费和其他手续费后的余额归基金财产,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。</p>	<p>六、申购费用和赎回费用</p> <p>2、投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。本基金的赎回费用在投资人赎回本基金份额时收取,扣除用于市场推广、注册登记费和其他手续费后的余额归基金财产,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。对于持续持有期少于 7 日的投资者,本基金将收取不低于 1.5% 的赎回费并全额计入基金财产。</p>
五、基金		<p>增加:</p> <p>6、当发生大额申购或赎回情形</p>

<p>的申购、赎回及其他注册登记业务</p>		<p>时,在履行适当程序后,基金管理人可以采用摆动定价机制,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、自律组织的规定。</p>
<p>五、基金的申购、赎回及其他注册登记业务</p>	<p>九、拒绝或暂停申购的情形及处理方式</p> <p>除非出现如下情形,基金管理人不得拒绝或暂停基金投资者的申购申请:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、不可抗力的原因导致基金无法正常工作; 2、证券交易场所在交易时间非正常停市,导致当日基金资产净值无法计算; 3、基金资产规模过大,使基金管理人无法找到合适的投资品种,或可能对基金业绩产生负面影响,从而损害现有基金份额持有人的利益; 4、法律、法规规定或中国证监会认定的其他可暂停申购的情形; 5、基金管理人认为有必要拒绝或暂停接受的某笔申购申请。 <p>发生上述 1、到 4、项暂停申购情形时,基金管理人应当在至少一家中国证监会指定的媒体刊登暂停申购公告。</p>	<p>九、拒绝或暂停申购的情形及处理方式</p> <p>除非出现如下情形,基金管理人不得拒绝或暂停基金投资者的申购申请:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、不可抗力的原因导致基金无法正常工作; 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时,基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。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,经与基金托管人协商确定后,基金管理人应当暂停接受申购申请; 3、证券交易场所在交易时间非正常停市,导致当日基金资产净值无法计算; 4、基金资产规模过大,使基金管理人无法找到合适的投资品种,或可能对基金业绩产生负面影响,从而损害现有基金份额持有人的利益; 5、法律、法规规定或中国证监会认定的其他可暂停申购的情形; 6、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; 7、基金管理人认为有必要拒绝或暂停接受的某笔申购申请。 <p>发生上述情形之一且基金管理人决定暂停申购的,申购款项将全部或部分相应退还投资者。发生上述 1 到 5 项暂停申购情形时,基金管理人应当在至少一家中国证监会指定的媒体刊登暂停申购公告。</p>
<p>五、基金的申购、赎回及其他注册登记业务</p>	<p>十、暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式</p>	<p>十、暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式</p> <p>增加:</p> <ol style="list-style-type: none"> 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时,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。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,经与基金托管人协商确定后,基金管理人应当暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项;
五、基金的申购、赎回及其他注册登记业务		<p>十一、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>增加:</p> <p>(3) 如果基金发生巨额赎回,在单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额 20%以上的赎回申请的情形下,基金管理人可以对该基金份额持有人超过 20%以上的部分延期办理赎回申请。对于当日非延期的赎回申请,应当按单个账户非延期赎回申请量占非延期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。</p>
六、基金合同当事人及权利义务	<p>一、基金管理人</p> <p>(一) 基金管理人简况</p> <p>名称: 景顺长城基金管理有限公司</p> <p>注册地址: 深圳市中心四路 1 号嘉里建设广场第 1 座 21 层</p> <p>英文名称: INVESCO Great Wall Fund Management Company Limited</p> <p>法定代表人: 赵如冰</p> <p>设立时间: 2003 年 6 月 12 日</p> <p>批准设立机关及批准设立文号: 中国证监会证监基金字【2003】76 号</p> <p>组织形式: 有限责任公司</p> <p>注册资本: 1.3 亿元人民币</p> <p>存续期间: 持续经营</p>	<p>一、基金管理人</p> <p>(一) 基金管理人简况</p> <p>名称: 景顺长城基金管理有限公司</p> <p>注册地址: 深圳市中心四路 1 号嘉里建设广场第 1 座 21 层</p> <p>英文名称: INVESCO Great Wall Fund Management Company Limited</p> <p>法定代表人: 杨光裕</p> <p>设立时间: 2003 年 6 月 12 日</p> <p>批准设立机关及批准设立文号: 中国证监会证监基金字【2003】76 号</p> <p>组织形式: 有限责任公司</p> <p>注册资本: 1.3 亿元人民币</p> <p>存续期间: 持续经营</p>
六、基金合同当事人及权利	<p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况</p> <p>名称: 中国工商银行股份有限公司</p>	<p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况</p> <p>名称: 中国工商银行股份有限公司</p>

<p>义务</p>	<p>司</p> <p>注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号</p> <p>法定代表人：姜建清</p> <p>成立时间：1984 年 1 月 1 日</p> <p>批准设立机关和设立文号：1983 年 9 月 17 日国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》（国发[1983]146 号）</p> <p>注册资本：2480 亿元人民币</p> <p>存续期间：持续经营</p> <p>基金托管资格批文及文号：中国证监会和中国人民银行证监基字【1998】3 号</p>	<p>司</p> <p>注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号</p> <p>法定代表人：易会满</p> <p>成立时间：1984 年 1 月 1 日</p> <p>批准设立机关和设立文号：1983 年 9 月 17 日国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》（国发[1983]146 号）</p> <p>注册资本：2480 亿元人民币</p> <p>存续期间：持续经营</p> <p>基金托管资格批文及文号：中国证监会和中国人民银行证监基字【1998】3 号</p>
<p>十一 基金的投资</p>	<p>四、投资策略</p> <p>2、投资管理的方法和标准</p> <p>(1) 资产配置</p> <p>基金经理依据定期公布的宏观和金融数据以及投资部对于宏观经济、股市政策、市场趋势的综合分析，运用宏观经济模型（MEM）做出对于宏观经济的评价，结合基金合同、投资制度的要求提出资产配置建议，经投资决策委员会审核后形成资产配置方案。</p> <p>本基金是一只高持股的混合型基金，对于股票的投资不少于基金资产净值的 65%，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>四、投资策略</p> <p>2、投资管理的方法和标准</p> <p>(1) 资产配置</p> <p>基金经理依据定期公布的宏观和金融数据以及投资部对于宏观经济、股市政策、市场趋势的综合分析，运用宏观经济模型（MEM）做出对于宏观经济的评价，结合基金合同、投资制度的要求提出资产配置建议，经投资决策委员会审核后形成资产配置方案。</p> <p>本基金是一只高持股的混合型基金，对于股票的投资不少于基金资产净值的 65%，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</p>
<p>十一 基金的投资</p>	<p>六、投资限制</p> <p>(6) 相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制；</p> <p>(7) 法律法规或监管部门取消上述限制，本基金不受上述限制。</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>六、投资限制</p> <p>(6) 相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制；</p> <p>(7) 本基金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、存出保证金和应收申购款等；</p> <p>(8) 本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不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，不超过该上市公司可流通股票的</p>

		<p>30%；</p> <p>(9) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 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项所规定的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>(10) 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投资范围保持一致；</p> <p>(11) 法律法规或监管部门取消上述限制，本基金不受上述限制。</p> <p>除上述第(7)、(9)、(10)项外，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>
第十三部分 基金资产估值	<p>五、估值方法</p> <p>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；</p> <p>(2) 首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；</p> <p>(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价（收盘价）估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>	<p>五、估值方法</p> <p>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；</p> <p>(2) 首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；</p> <p>(3) 流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等（不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票），按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>
第十三部分 基金资产估值	<p>五、估值方法</p>	<p>五、估值方法</p> <p>增加：</p> <p>5、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。</p>
第十三部分	<p>六、基金份额净值的确认和估值</p>	<p>六、基金份额净值的确认和估值</p>

<p>分基金资产估值</p>	<p>错误的处理</p> <p>3、差错处理程序</p> <p>(5)基金管理人及基金托管人基金份额净值计算错误偏差达到基金份额净值的 0.25%时,基金管理人应当报告中国证监会;基金管理人及基金托管人基金份额净值计算错误偏差达到基金份额净值的 0.5%时,基金管理人应当公告并报中国证监会备案。</p>	<p>错误的处理</p> <p>3、差错处理程序</p> <p>(5)基金管理人及基金托管人基金份额净值计算错误偏差达到基金资产净值的 0.25%时,基金管理人应当报告中国证监会;基金管理人及基金托管人基金份额净值计算错误偏差达到基金份额净值的 0.5%时,基金管理人应当公告并报中国证监会备案。</p>
<p>第十三部分 基金资产估值</p>	<p>七、暂停估值的情形</p> <p>1、与本基金投资有关的证券交易场所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;</p> <p>2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人无法准确评估基金资产价值时;</p> <p>3、中国证监会认定的其他情形。</p>	<p>七、暂停估值的情形</p> <p>1、与本基金投资有关的证券交易场所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;</p> <p>2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人无法准确评估基金资产价值时;</p> <p>3、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时,经与基金托管人协商确认后,应当暂停估值;</p> <p>4、中国证监会认定的其他情形。</p>
<p>第十三部分 基金资产估值</p>	<p>八、特殊情形的处理</p> <p>1、基金管理人按估值方法的第 5 项进行估值时,所造成的误差不得作为基金资产估值错误处理;</p>	<p>八、特殊情形的处理</p> <p>1、基金管理人按估值方法的第 6 项进行估值时,所造成的误差不得作为基金资产估值错误处理;</p>
<p>第十八部分 基金的信息披露</p>	<p>(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</p> <p>基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内,编制完成基金年度报告,并将年度报告正文登载于网站上,将年度报告摘要登载在指定报刊上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。</p> <p>基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内,编制完成基金半年度报告,并将半年度报告正文登载在网站上,将半年度报告摘要登载在指定报刊上。</p> <p>基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内,编制完成基金季度报告,并将季度报告登载在指定报刊和网站上。</p>	<p>(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</p> <p>基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内,编制完成基金年度报告,并将年度报告正文登载于网站上,将年度报告摘要登载在指定报刊上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。</p> <p>基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内,编制完成基金半年度报告,并将半年度报告正文登载在网站上,将半年度报告摘要登载在指定报刊上。</p> <p>基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内,编制完成基金季度报告,并将季度报告登载在指定报刊和网站上。</p> <p>基金合同生效不足 2 个月的,本基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。</p>

	<p>基金合同生效不足 2 个月的, 本基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。</p> <p>基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日, 分别报中国证监会和本基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本和书面报告两种方式。</p>	<p>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。</p> <p>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例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文件中“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本基金的特定风险, 中国证监会认定的特殊情形除外。</p> <p>基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日, 分别报中国证监会和本基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本和书面报告两种方式。</p>
第十八部分 基金的信息披露		<p>(七) 临时报告</p> <p>增加:</p> <p>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;</p> <p>27、基金管理人采用摆动定价机制进行估值;</p>
第二十四部分 基金合同内容摘要		<p>摘要部分也做了相应修改, 与合同修订内容保持一致。</p>

二、对基金托管协议的修改内容

章节	修订前	修订后
一、托管协议当事人	<p>一、基金管理人</p> <p>名称: 景顺长城基金管理有限公司</p> <p>住所: 深圳市中心四路 1 号嘉里建设广场第 1 座 21 层</p> <p>法定代表人: 赵如冰</p> <p>成立时间: 2003 年 6 月 12 日</p> <p>批准设立机关及批准设立文号: 中国证监会证监基金字[2003]76 号</p> <p>注册资本: 1.3 亿元人民币</p> <p>组织形式: 有限责任公司</p> <p>经营范围: 基金管理业务、发起设立基金及中国证监会批准的其他业务</p>	<p>一、基金管理人</p> <p>名称: 景顺长城基金管理有限公司</p> <p>住所: 深圳市中心四路 1 号嘉里建设广场第 1 座 21 层</p> <p>法定代表人: 杨光裕</p> <p>成立时间: 2003 年 6 月 12 日</p> <p>批准设立机关及批准设立文号: 中国证监会证监基金字[2003]76 号</p> <p>注册资本: 1.3 亿元人民币</p> <p>组织形式: 有限责任公司</p> <p>经营范围: 基金管理业务、发起设立基金及中国证监会批准的其他业务</p>

	<p>存续期间：持续经营 电话：0755-82370388 传真：0755-25987356 联系人：杨崑阳</p>	<p>存续期间：持续经营 电话：0755-82370388 传真：0755-25987356 联系人：杨崑阳</p>
一、托管协议当事人	<p>二、基金托管人 名称：中国工商银行股份有限公司 住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号（100032） 法定代表人：姜建清 电话：（010）66106912 传真：（010）66106904 联系人：庄为 成立时间：1984 年 1 月 1 日 组织形式：股份有限公司 注册资本：2480 亿元人民币 批准设立机关和设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》（国发[1983]146号） 存续期间：持续经营 经营范围：办理人民币存款、贷款、国内外结算、办理票据承兑、贴现、转贴现、国内会计业务、代理资金清算、提供信用证服务，代理销售业务，代理发行、代理承销、代理承兑债券，代收代付业务，代理证券投资基金清算业务，保险业代理业务，代理外国银行和国际金融机构贷款业务，证券投资基金、企业年金托管业务、企业年金账户管理服务、认购申购业务，咨询调查业务，贷款承诺、企业个人财务顾问服务、组织或参加银行贷款外汇存款，外汇贷款，外币兑换，出口托收及进口代收，外汇票据承兑和贴现，外汇借款、外汇担保、发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外汇有价证券。自营代外汇买卖，外汇金融衍生业务，银行卡业务，电话银行、网上银行，手机银行业务，办理结汇售汇业务，经国务院银行业监督管理机构批准内的其他业务。</p>	<p>二、基金托管人 名称：中国工商银行股份有限公司 住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号（100032） 法定代表人：易会满 电话：（010）66106912 传真：（010）66106904 联系人：郭明 成立时间：1984 年 1 月 1 日 组织形式：股份有限公司 注册资本：2480 亿元人民币 批准设立机关和设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》（国发[1983]146号） 存续期间：持续经营 经营范围：办理人民币存款、贷款、国内外结算、办理票据承兑、贴现、转贴现、国内会计业务、代理资金清算、提供信用证服务，代理销售业务，代理发行、代理承销、代理承兑债券，代收代付业务，代理证券投资基金清算业务，保险业代理业务，代理外国银行和国际金融机构贷款业务，证券投资基金、企业年金托管业务、企业年金账户管理服务、认购申购业务，咨询调查业务，贷款承诺、企业个人财务顾问服务、组织或参加银行贷款外汇存款，外汇贷款，外币兑换，出口托收及进口代收，外汇票据承兑和贴现，外汇借款、外汇担保、发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外汇有价证券。自营代外汇买卖，外汇金融衍生业务，银行卡业务，电话银行、网上银行，手机银行业务，办理结汇售汇业务，经国务院银行业监督管理机构批准内的其他业务。</p>
二、基金托管协议的依据、目的和原则	<p>订立本协议的依据是《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《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》）、《托管协议的内容与格式》、《景顺长城新兴成长混合型证券投资基金</p>	<p>订立本协议的依据是《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《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》、</p>

	基金合同》(以下简称《基金合同》)及其他有关规定。	《托管协议的内容与格式》、《景顺长城新兴成长混合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。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	<p>一、基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权</p> <p>2、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下述基金投融资比例进行监督:</p> <p>(1)按法律法规的规定及基金合同的约定,本基金的投资资产配置比例为:</p> <p>本基金是一只高持股的混合型基金,对于股票的投资不少于基金资产净值的 65%,持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>一、基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权</p> <p>2、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下述基金投融资比例进行监督:</p> <p>(1)按法律法规的规定及基金合同的约定,本基金的投资资产配置比例为:</p> <p>本基金是一只高持股的混合型基金,对于股票的投资不少于基金资产净值的 65%,持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</p>
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	<p>(2)根据法律法规的规定及基金合同的约定,本基金投资组合遵循以下投资限制:</p> <p>(i)持有一家上市公司的股票,其市值不得超过基金资产净值的 10%;</p> <p>(ii)本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券,不得超过该证券的 10%;</p> <p>(iii)本基金投资股权分置改革中产生的权证,在任何交易日买入的总金额,不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%,基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%,本公司管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。其它权证的投资比例,遵从法规或监管部门的相关规定;</p> <p>(iv)现金和到期日不超过 1 年的政府债券不低于 5%;</p> <p>(v)本基金财产参与股票发行申购,所申报的金额不得超过本基金的总资产,所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;</p> <p>(vi)本基金不得违反本基金合同关于投资范围、投资策略和投资比例的约定;</p> <p>(vii)法律法规或监管部门取消上述限制,本基金不受上述限制。</p> <p>(3)法规允许的基金投资比例调整期限</p>	<p>(2)根据法律法规的规定及基金合同的约定,本基金投资组合遵循以下投资限制:</p> <p>(i)持有一家上市公司的股票,其市值不得超过基金资产净值的 10%;</p> <p>(ii)本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券,不得超过该证券的 10%;</p> <p>(iii)本基金投资股权分置改革中产生的权证,在任何交易日买入的总金额,不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%,基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%,本公司管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。其它权证的投资比例,遵从法规或监管部门的相关规定;</p> <p>(iv)本基金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、存出保证金和应收申购款等;</p> <p>(v)本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)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</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，以达到规定的投资比例限制要求。</p>	<p>30%；</p> <p>(vi) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 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项所规定的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>(vii) 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投资范围保持一致；</p> <p>(viii) 本基金财产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；</p> <p>(IX) 本基金不得违反本基金合同关于投资范围、投资策略和投资比例的约定；</p> <p>(X) 法律法规或监管部门取消上述限制，本基金不受上述限制。</p> <p>(3) 法规允许的基金投资比例调整期限</p> <p>除第 (iv)、(vi)、(vii) 项外，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，以达到规定的投资比例限制要求。</p>
<p>八、基金资产净值计算和会计核算</p>	<p>二、基金资产估值方法</p> <p>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；</p> <p>(2) 首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；</p> <p>(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价（收盘价）估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>	<p>二、基金资产估值方法</p> <p>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；</p> <p>(2) 首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；</p> <p>(3) 流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等（不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票），按监管机</p>

		构或行业协会有关规定确定公允价值。
八、基金资产净值计算和会计核算	二、基金资产估值方法	二、基金资产估值方法 增加： 5、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。
十、信息披露	三、暂停或延迟信息披露的情形 1、基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； 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资产价值时； 3、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障基金份额持有人的利益，已决定延迟估值； 4、出现基金管理人认为属于会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的紧急事故的任何情况； 5、法律法规规定、中国证监会或基金合同认定的其他情形。	三、暂停或延迟信息披露的情形 1、基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； 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资产价值时； 3、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障基金份额持有人的利益，已决定延迟估值； 4、出现基金管理人认为属于会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的紧急事故的任何情况； 5、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时，经与基金托管人协商确认后暂停估值； 6、法律法规规定、中国证监会或基金合同认定的其他情形。

关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改 基金合同、托管协议的内容说明

景顺长城精选蓝筹混合型证券投资基金

一、 基金合同修订内容

章节	修订前	修订后
第一部分 前言和释 义	<p>一、前言</p> <p>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，规范景顺长城精选蓝筹混合型证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）运作，依照《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》）、《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》）、证券投资基金信息披露内容与格式准则第6号《基金合同的内容与格式》及其他有关规定，在平等自愿、诚实信用、充分保护基金投资者及相关当事人的合法权益的原则基础上，特订立《景顺长城精选蓝筹混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“本合同”或“《基金合同》”）。</p>	<p>一、前言</p> <p>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，规范景顺长城精选蓝筹混合型证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）运作，依照《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》）、《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》）、证券投资基金信息披露内容与格式准则第6号《基金合同的内容与格式》及其他有关规定，在平等自愿、诚实信用、充分保护基金投资者及相关当事人的合法权益的原则基础上，特订立《景顺长城精选蓝筹混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“本合同”或“《基金合同》”）。</p>
第二部分 前言和释 义	<p>二、释义</p>	<p>二、释义</p> <p>增加：</p> <p>《流动性风险管理规定》：指《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</p> <p>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</p>

		<p>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>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>第五部分、基金的申购、赎回</p>	<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>1、基金管理人可以规定投资者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《招募说明书》；</p> <p>2、基金管理人可以规定投资者每个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》；</p> <p>3、基金管理人可以规定单个投资者累计持有的基金份额上限。具体规定请参见《招募说明书》；</p> <p>4、基金管理人可根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述对申购的金额和赎回的份额的数量限制，基金管理人必须在调整生效前依照《信息披露办法》的有关规定至少在一家指定媒体及基金管理人网站公告并报中国证监会备案。</p>	<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>1、基金管理人可以规定投资者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《招募说明书》；</p> <p>2、基金管理人可以规定投资者每个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》；</p> <p>3、基金管理人可以规定单个投资者累计持有的基金份额上限。具体规定请参见《招募说明书》；</p> <p>4、基金管理人可根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述对申购的金额和赎回的份额的数量限制，基金管理人必须在调整生效前依照《信息披露办法》的有关规定至少在一家指定媒体及基金管理人网站公告并报中国证监会备案；</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。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。具体请参见相关公告。</p>
<p>第五部分、基金的申购、赎回</p>	<p>六、申购费用和赎回费用 4、本基金的申购费率、赎回费率和收费方式由基金管理人根据《基金合同》的规定确定并在《招募说明书》中列示。基金管理人可以根据《基金合同》的相关约定调整费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前 2 个工作日在至少一家指定报刊及基金管理人网站公告。</p>	<p>六、申购费用和赎回费用 4、本基金的申购费率、赎回费率和收费方式由基金管理人根据《基金合同》的规定确定并在《招募说明书》中列示，对于持续持有期少于 7 日的投资者，本基金将收取不低于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产。基金管理人可以根据《基金合同》的相关约定调整费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前 2 个工作日在至少一家指定报刊及基</p>

		金管理人网站公告。
第五部分、基金的申购、赎回		增加： 6、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，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、自律组织的规定。
第五部分、基金的申购、赎回	<p>九、拒绝或暂停申购的情形及处理方式</p> <p>除非出现如下情形，基金管理人不得暂停或拒绝基金投资者的申购申请：</p> <p>(1) 不可抗力的原因导致基金无法正常工作；</p> <p>(2) 证券交易场所在交易时间非正常停市，导致当日基金资产净值无法计算；</p> <p>(3) 基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益；</p> <p>(4) 法律法规规定或中国证监会认定的其他可暂停申购的情形；</p> <p>(5) 基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔申购。发生上述情形之一的，申购款项将全额退还投资者。</p> <p>发生上述(1)到(4)项暂停申购情形时，基金管理人应当在至少一家指定媒体及基金管理人网站刊登暂停申购公告。</p>	<p>九、拒绝或暂停申购的情形及处理方式</p> <p>除非出现如下情形，基金管理人不得暂停或拒绝基金投资者的申购申请：</p> <p>(1) 不可抗力的原因导致基金无法正常工作；</p> <p>(2) 证券交易场所在交易时间非正常停市，导致当日基金资产净值无法计算；</p> <p>(3) 基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益；</p> <p>(4) 法律法规规定或中国证监会认定的其他可暂停申购的情形；</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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受申购申请；</p> <p>(6) 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；</p> <p>(7) 基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔申购。</p> <p>发生上述情形之一的，申购款项将相应退还投资者。</p> <p>发生上述情形之一且基金管理人决定暂停申购的，申购款项将全部或部分相应退还投资者。发生上述(1)到(5)项暂停申购情形时，基金管理人应当在至少一家指定媒体及基金管理人网站刊登暂停申购公告。</p>
第五部分、基金的申购、赎回	<p>十、暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式</p> <p>除非出现如下情形，基金管理人不得拒绝接受或暂停基金份额持有人</p>	<p>十、暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式</p> <p>除非出现如下情形，基金管理人不得拒绝接受或暂停基金份额持有</p>

<p>赎回</p>	<p>的赎回申请或者延缓支付赎回款项： (1)不可抗力的原因导致基金管理人不能支付赎回款项； (2)证券交易场所依法决定临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；</p> <p>.....</p> <p>同时，在出现上述第(3)款的情形时，对已接受的赎回申请可延期支付赎回款项，最长不超过支付时间 20 个工作日，并在至少一家指定的媒体及基金管理人网站公告。投资者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。</p>	<p>人的赎回申请或者延缓支付赎回款项： (1)不可抗力的原因导致基金管理人不能支付赎回款项； (2) 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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；</p> <p>.....</p> <p>同时，在出现上述第(4)款的情形时，对已接受的赎回申请可延期支付赎回款项，最长不超过支付时间 20 个工作日，并在至少一家指定的媒体及基金管理人网站公告。投资者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。</p>
<p>第五部分、基金的申购、赎回</p>		<p>十一、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>增加： (3) 如果基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额 20%以上的赎回申请的情形下，基金管理人可以对该基金份额持有人超过 20%以上的部分延期办理赎回申请。对于当日非延期的赎回申请，应当按单个账户非延期赎回申请量占非延期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。</p>
<p>第六部分、基金合同当事人及权利义务</p>	<p>一、基金管理人 (一) 基金管理人简况 法定代表人：赵如冰</p>	<p>一、基金管理人 (一) 基金管理人简况 法定代表人：杨光裕</p>
<p>第六部</p>	<p>二、基金托管人</p>	<p>二、基金托管人</p>

分、基金合同当事人及权利义务	(一) 基金托管人简况 法定代表人: 姜建清	(一) 基金托管人简况 法定代表人: 易会满
第十一部分、基金的投资	<p>二、投资范围</p> <p>本基金投资于具有良好流动性的金融工具, 包括国内依法发行和上市交易的公司股票和债券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。</p> <p>本基金投资组合的比例范围为: 股票投资 70%-95%, 现金或者到期日在一年以内的政府债券投资 5%-30%, 权证投资 0-3%。持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>二、投资范围</p> <p>本基金投资于具有良好流动性的金融工具, 包括国内依法发行和上市交易的公司股票和债券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。</p> <p>本基金投资组合的比例范围为: 股票投资 70%-95%, 现金或者到期日在一年以内的政府债券投资 5%-30%, 权证投资 0-3%。持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%, 其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</p>
第十一部分、基金的投资	<p>四、投资策略</p> <p>1、投资管理的决策依据</p> <p>本基金依据以宏观经济分析模型(MEM)为基础的资产配置模型决定基金的资产配置, 运用景顺长城“股票研究数据库(SRD)”等分析系统及 FVMC 等选股模型作为个股选择的依据, 同时依据景顺长城风险管理系统和绩效评估系统进行投资组合的调整。</p> <p>2、投资管理的方法和标准</p> <p>(1) 资产配置</p> <p>基金经理依据定期公布的宏观和金融数据以及投资部对于宏观经济、股市政策、市场趋势的综合分析, 运用宏观经济模型(MEM)做出对于宏观经济的评价, 结合基金合同、投资制度的要求提出资产配置建议, 经投资决策委员会审核后形成资产配置方案。</p> <p>本基金为一只高持股的混合型基金, 对于股票的投资不少于基金资产的 70%, 持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>四、投资策略</p> <p>1、投资管理的决策依据</p> <p>本基金依据以宏观经济分析模型(MEM)为基础的资产配置模型决定基金的资产配置, 运用景顺长城“股票研究数据库(SRD)”等分析系统及 FVMC 等选股模型作为个股选择的依据, 同时依据景顺长城风险管理系统和绩效评估系统进行投资组合的调整。</p> <p>2、投资管理的方法和标准</p> <p>(1) 资产配置</p> <p>基金经理依据定期公布的宏观和金融数据以及投资部对于宏观经济、股市政策、市场趋势的综合分析, 运用宏观经济模型(MEM)做出对于宏观经济的评价, 结合基金合同、投资制度的要求提出资产配置建议, 经投资决策委员会审核后形成资产配置方案。</p> <p>本基金为一只高持股的混合型基金, 对于股票的投资不少于基金资产的 70%, 持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%, 其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</p>
第十一部分、基金的投资 五、投资	(二) 投资组合限制 本基金的投资组合将遵循以下限制: 1、本基金持有一家上市公司的股票, 其市值不得超过基金资产净值的	(二) 投资组合限制 本基金的投资组合将遵循以下限制: 1、本基金持有一家上市公司的股票, 其市值不得超过基金资产净值

<p>限制</p>	<p>10%;</p> <p>2、本基金与由基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；</p> <p>3、本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；</p> <p>4、本基金持有的现金和到期日在一年以内的政府债券为基金资产净值 5%以上；</p> <p>5、本基金不得违反《基金合同》关于投资范围、投资策略和投资比例的约定；即，本基金投资组合的比例范围为：股票投资 70%-95%，现金或者到期日在一年以内的政府债券投资 5%-30%，权证投资 0-3%。</p> <p>6、本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。法律法规或中国证监会另有规定的，遵从其规定；</p> <p>7、基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；</p> <p>8、本基金的建仓期为 6 个月；</p> <p>9、相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。</p> <p>如法律法规或监管部门取消上述限制性规定，履行适当程序后，本基金不受上述规定的限制。</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。法律法规另有规定的从其规定。</p>	<p>的 10%；</p> <p>2、本基金与由基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；</p> <p>3、本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；</p> <p>4、本基金持有的现金和到期日在一年以内的政府债券为基金资产净值 5%以上，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；</p> <p>5、本基金不得违反《基金合同》关于投资范围、投资策略和投资比例的约定；即，本基金投资组合的比例范围为：股票投资 70%-95%，现金或者到期日在一年以内的政府债券投资 5%-30%，权证投资 0-3%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</p> <p>6、本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。法律法规或中国证监会另有规定的，遵从其规定；</p> <p>7、基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；</p> <p>8、本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不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，不超过该上市公司可流通股票的 30%；</p> <p>9、本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 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项所规定的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>10、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</p>
-----------	---	---

		<p>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投资范围保持一致;</p> <p>11、本基金的建仓期为 6 个月;</p> <p>12、相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。</p> <p>如法律法规或监管部门取消上述限制性规定,履行适当程序后,本基金不受上述规定的限制。</p> <p>除上述第 4、9、10 项外,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。法律法规另有规定的从其规定。</p>
第十三部分、基金财产的估值	<p>五、估值方法</p> <p>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:</p> <p>(1)送股、转增股、配股和公开增发的新股,按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价(收盘价)估值;该日无交易的,以最近一日的市价(收盘价)估值;</p> <p>(2)首次公开发行未上市的股票、债券和权证,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值;</p> <p>(3)首次公开发行有明确锁定期的股票,同一股票在交易所上市后,按交易所上市的同一股票的市价(收盘价)估值;非公开发行有明确锁定期的股票,按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>	<p>五、估值方法</p> <p>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:</p> <p>(1)送股、转增股、配股和公开增发的新股,按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价(收盘价)估值;该日无交易的,以最近一日的市价(收盘价)估值;</p> <p>(2)首次公开发行未上市的股票、债券和权证,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值;</p> <p>(3)流通受限的股票,包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等(不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票),按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>
第十三部分、基金财产的估值	<p>五、估值方法</p>	<p>五、估值方法</p> <p>增加:</p> <p>5、当发生大额申购或赎回情形时,在履行适当程序后,基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。</p>
第十三部分、基金财产的估值	<p>七、暂停估值的情形</p> <p>1、与本基金投资有关的证券交易场所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;</p> <p>2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人无法准确评估基金资产价值时;</p> <p>3、中国证监会认定的其他情形。</p>	<p>七、暂停估值的情形</p> <p>1、与本基金投资有关的证券交易场所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;</p> <p>2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人无法准确评估基金资产价值时;</p> <p>3、前一估值日基金资产净值</p>

		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时,经与基金托管人协商确认后,应当暂停估值; 4、中国证监会认定的其它情形。
第十三部分、基金财产的估值	八、特殊情形的处理 1、基金管理人按估值方法的第5项进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理;	八、特殊情形的处理 1、基金管理人按估值方法的第6项进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理;
第十八部分、基金的信息披露	(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 基金管理人应当在每年结束之日起90日内,编制完成基金年度报告,并将年度报告正文登载于网站上,将年度报告摘要登载在指定媒体上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。 基金管理人应当在上半年结束之日起60日内,编制完成基金半年度报告,并将半年度报告正文登载在网站上,将半年度报告摘要登载在指定媒体上。 基金管理人应当在每个季度结束之日起15个工作日内,编制完成基金季度报告,并将季度报告登载在指定媒体和基金管理人网站上。 《基金合同》生效不足2个月的,基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。 基金定期报告在公开披露的第2个工作日,分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本和书面报告两种方式。	(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 基金管理人应当在每年结束之日起90日内,编制完成基金年度报告,并将年度报告正文登载于网站上,将年度报告摘要登载在指定媒体上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。 基金管理人应当在上半年结束之日起60日内,编制完成基金半年度报告,并将半年度报告正文登载在网站上,将半年度报告摘要登载在指定媒体上。 基金管理人应当在每个季度结束之日起15个工作日内,编制完成基金季度报告,并将季度报告登载在指定媒体和基金管理人网站上。 《基金合同》生效不足2个月的,基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。 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基金份额比例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文件中“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本基金的特有风险,中国证监会认定的特殊情形除外。 基金定期报告在公开披露的第2个工作日,分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本和书面报告两种方式。
第十八部分、基金		(七)临时报告 增加:

的信息披露		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； 27、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；
第二十四部分、基金合同内容摘要		摘要部分也做了相应修改，与合同修订内容保持一致。

二、对基金托管协议的修改内容

章节	修订前	修订后
一、基金托管协议当事人	(一) 基金管理人 法定代表人：赵如冰	(一) 基金管理人 法定代表人：杨光裕
一、基金托管协议当事人	(二) 基金托管人 法定代表人：姜建清	(二) 基金托管人 法定代表人：易会满
二、基金托管协议的依据、目的和原则	订立本协议的依据是《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《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》）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第7号〈托管协议的内容与格式〉》、《景顺长城精选蓝筹混合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。	订立本协议的依据是《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《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》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第7号〈托管协议的内容与格式〉》、《景顺长城精选蓝筹混合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。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	(一) 基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权 1、基金托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，对下述基金投资范围、投资对象进行监督。 本基金将投资于以下金融工具： 本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行和上市交易的公司股票和债券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融	(一) 基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权 1、基金托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，对下述基金投资范围、投资对象进行监督。 本基金将投资于以下金融工具： 本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行和上市交易的公司股票和债券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其

	<p>工具。</p> <p>本基金投资组合的比例范围为：股票投资 70%-95%，现金或者到期日在一年以内的政府债券投资 5%-30%，权证投资 0-3%。持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。</p> <p>本基金不得投资于相关法律、法规、部门规章及《基金合同》禁止投资的投资工具。</p> <p>2、基金托管人根据有关法律、法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投融资比例进行监督：</p> <p>(1) 按法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金的投资资产配置比例为：</p> <p>本基金为一只高持股的混合型基金，本基金投资组合的比例范围为：股票投资 70%-95%，现金或者到期日在一年以内的政府债券投资 5%-30%，权证投资 0-3%。</p>	<p>他金融工具。</p> <p>本基金投资组合的比例范围为：股票投资 70%-95%，现金或者到期日在一年以内的政府债券投资 5%-30%，权证投资 0-3%。持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</p> <p>本基金不得投资于相关法律、法规、部门规章及《基金合同》禁止投资的投资工具。</p> <p>2、基金托管人根据有关法律、法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投融资比例进行监督：</p> <p>(1) 按法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金的投资资产配置比例为：</p> <p>本基金为一只高持股的混合型基金，本基金投资组合的比例范围为：股票投资 70%-95%，现金或者到期日在一年以内的政府债券投资 5%-30%，权证投资 0-3%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>	<p>(2) 根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金投资组合遵循以下投资限制：</p> <p>④ 现金和到期日不超过 1 年的政府债券不低于基金资产净值的 5%；</p> <p>⑤ 本基金财产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；</p> <p>⑥ 本基金不得违反《基金合同》关于投资范围、投资策略和投资比例的约定；即，本基金投资组合的比例范围为：股票投资 70%-95%，现金或者到期日在一年以内的政府债券投资 5%-30%，权证投资 0-3%。</p> <p>⑦ 相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。</p> <p>《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消上述限制的，履行适当程序后，基金不受上述限制。</p> <p>(3) 法规允许的基金投资比例调整期限</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</p>	<p>(2) 根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金投资组合遵循以下投资限制：</p> <p>④ 现金和到期日不超过 1 年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、存出保证金和应收申购款等；</p> <p>⑤ 本基金不得违反《基金合同》关于投资范围、投资策略和投资比例的约定；即，本基金投资组合的比例范围为：股票投资 70%-95%，现金或者到期日在一年以内的政府债券投资 5%-30%，权证投资 0-3%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</p> <p>⑥ 本基金财产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；</p> <p>⑦ 本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)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</p>

	<p>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，以达到规定的投资比例限制要求。法律法规另有规定的从其规定。</p>	<p>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>⑧本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 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项所规定的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>⑨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投资范围保持一致；</p> <p>⑩相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。</p> <p>《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消上述限制的，履行适当程序后，基金不受上述限制。</p> <p>(3) 法规允许的基金投资比例调整期限</p> <p>除上述第④、⑧项外，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，以达到规定的投资比例限制要求。法律法规另有规定的从其规定。</p>
<p>八、基金资产净值计算和会计核算</p>	<p>(二) 基金资产估值方法</p> <p>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；</p> <p>(2) 首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；</p> <p>(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价（收盘价）估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>	<p>(二) 基金资产估值方法</p> <p>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；</p> <p>(2) 首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；</p> <p>(3) 流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等（不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票），按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值；</p>

八、基金资产净值计算和会计核算	(二) 基金资产估值方法	(二) 基金资产估值方法 增加： 5、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。
八、基金资产净值计算和会计核算	七、暂停估值的情形 1、与本基金投资有关的证券交易场所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； 2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人无法准确评估基金资产价值时； 3、中国证监会认定的其他情形。	七、暂停估值的情形 1、与本基金投资有关的证券交易场所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； 2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人无法准确评估基金资产价值时； 3、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时，经与基金托管人协商确认后，应当暂停估值； 4、中国证监会认定的其他情形。
八、基金资产净值计算和会计核算	八、特殊情形的处理 1、基金管理人按估值方法的第5项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理；	八、特殊情形的处理 1、基金管理人按估值方法的第6项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理；
十、基金信息披露	(三) 暂停或延迟信息披露的情形 1、基金投资所涉及的证券交易场所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； 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资产价值时； 3、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障基金份额持有人的利益，已决定延迟估值； 4、出现基金管理人认为属于会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的紧急事故的任何情况； 5、法律法规规定、中国证监会或《基金合同》认定的其他情形。	(三) 暂停或延迟信息披露的情形 1、基金投资所涉及的证券交易场所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； 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资产价值时； 3、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障基金份额持有人的利益，已决定延迟估值； 4、出现基金管理人认为属于会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的紧急事故的任何情况； 5、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时，经与基金托管人协商确认后暂停估值； 6、法律法规规定、中国证监会或《基金合同》认定的其他情形。

关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改

基金合同、托管协议的内容说明

景顺长城公司治理混合型证券投资基金

一、 基金合同修订内容

修改章节	修改前	修改后
第一部分 前言和释 义	<p>一、前言</p> <p>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，规范景顺长城公司治理混合型证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）运作，依照《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》）、《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》）、证券投资基金信息披露内容与格式准则第 6 号《基金合同的内容与格式》及其他有关规定，在平等自愿、诚实信用、充分保护基金投资者及相关当事人的合法权益的原则基础上，特订立《景顺长城公司治理混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“本合同”或“《基金合同》”）。</p>	<p>一、前言</p> <p>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，规范景顺长城公司治理混合型证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）运作，依照《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》）、《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》）、证券投资基金信息披露内容与格式准则第 6 号《基金合同的内容与格式》及其他有关规定，在平等自愿、诚实信用、充分保护基金投资者及相关当事人的合法权益的原则基础上，特订立《景顺长城公司治理混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“本合同”或“《基金合同》”）。</p>
第一部分 前言和释 义		<p>… (新增)</p> <p>《流动性风险管理规定》 指《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</p> <p>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</p>

		<p>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>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>
第五部分、基金份额的申购与赎回	<p>五、申购与赎回的数额限制</p> <p>...</p>	<p>五、申购与赎回的数额限制</p> <p>...</p> <p>(新增)</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。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。具体请参见相关公告。</p>
第五部分、基金份额的申购与赎回	<p>六、申购费用和赎回费用</p> <p>...</p> <p>4、本基金的申购费率、赎回费率和收费方式由基金管理人根据《基金合同》的规定确定并在《招募说明书》中列示。基金管理人可以根据《基金合同》的相关约定调整费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前 2 个工作日在至少一家指定报刊及基金管理人网站公告。</p>	<p>六、申购费用和赎回费用</p> <p>...</p> <p>4、本基金的申购费率、赎回费率和收费方式由基金管理人根据《基金合同》的规定确定并在《招募说明书》中列示。对于持续持有期少于 7 日的投资者，本基金将收取不低于 1.5% 的赎回费并全额计入基金财产。基金管理人可以根据《基金合同》的相关约定调整费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前 2 个工作日在至少一家指定报刊及基金管理人网站公告。</p> <p>...</p> <p>(新增)</p> <p>6、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，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、自律组织的规定。</p>
第五部	九、拒绝或暂停申购的情形及处理方式	九、拒绝或暂停申购的情形及处理方式

分、基金份额的申购与赎回	<p>...</p> <p>(2) 发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时,基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。</p> <p>...</p> <p>发生上述情形之一的,申购款项将全额退还投资者。发生上述(1)到(4)项暂停申购情形时,基金管理人应当在至少一家指定媒体及基金管理人网站刊登暂停申购公告。</p>	<p>...</p> <p>(2) 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, 经与基金托管人协商确定后,基金管理人应当暂停接受申购申请;</p> <p>...</p> <p>(新增)</p> <p>(6) 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;</p> <p>...</p> <p>发生上述情形之一的, 申购款项将全部或部分相应退还投资者。发生上述(1)到(6)项暂停申购情形时, 基金管理人应当在至少一家指定媒体及基金管理人网站刊登暂停申购公告。</p>
第五部分、基金份额的申购与赎回	<p>十、暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式</p> <p>...</p> <p>(4) 发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时,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>十、暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式</p> <p>...</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, 经与基金托管人协商确定后,基金管理人应当暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项;</p>
第五部分、基金份额的申购与赎回	<p>十一、巨额赎回的情形及处理方式</p>	<p>十一、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>...</p> <p>(新增)</p> <p>(3) 如果基金发生巨额赎回, 在单个基金份额持有人超过上一日基金总份额 20%以上的赎回申请的情形下, 基金管理人可以对该基金份额持有人超过 20%以上的部分延期办理赎回申请。对于当日非延期的赎回申请, 应当按单个账户非延期赎回申请量占非延期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</p>

		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。
第六部分、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：赵如冰	一、基金管理人 (一) 基金管理人简况 法定代表人：杨光裕
第六部分、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：姜建清	二、基金托管人 (一) 基金托管人简况 法定代表人：易会满
第十一部分、基金的投资	二、投资范围 ... 本基金投资组合的比例范围为：股票投资 65%-95%，债券投资 0%-30%，现金或者到期日在一年以内的政府债券投资 5%-35%，权证投资 0-3%。本基金投资于基金名称显示投资方向的股票不低于基金股票投资的 80%。 本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。	二、投资范围 ... 本基金投资组合的比例范围为：股票投资 65%-95%，债券投资 0%-30%，现金或者到期日在一年以内的政府债券投资 5%-35%，权证投资 0-3%。本基金投资于基金名称显示投资方向的股票不低于基金股票投资的 80%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。 本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。
第十一部分基金的投资	五、投资限制 (二) 投资组合限制 ... 4、本基金持有的现金和到期日在一年以内的政府债券为基金资产净值 5% 以上； 5、本基金不得违反《基金合同》关于投资范围、投资策略和投资比例的约定。本基金投资组合的比例范围为：股票投资 65%-95%，债券投资 0%-30%，现金或者到期日在一年以内的政府债券投资 5%-35%，权证投资 0-3%；	五、投资限制 (二) 投资组合限制 ... 4、本基金持有的现金和到期日在一年以内的政府债券为基金资产净值 5% 以上，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等； 5、本基金不得违反《基金合同》关于投资范围、投资策略和投资比例的约定。本基金投资组合的比例范围为：股票投资 65%-95%，债券投资 0%-30%，现金或者到期日在一年以内的政府债券投资

	<p>...</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。法律法规另有规定的从其规定。</p>	<p>5%-35%，权证投资 0-3%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；</p> <p>...</p> <p>(新增)</p> <p>9、本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不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，不超过该上市公司可流通股票的 30%；</p> <p>10、本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 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项所规定的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>11、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投资范围保持一致； ...</p> <p>除上述第 4、10、11 项外，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。法律法规另有规定的从其规定。</p>
<p>第十三部分、基金资产估值</p>	<p>三、估值方法</p> <p>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>...</p> <p>(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价（收盘价）估</p>	<p>三、估值方法</p> <p>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>...</p> <p>(3) 流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限</p>

	<p>值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>	<p>售期的股票等（不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票），按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p> <p>（新增）</p> <p>6、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。</p>
第十三部分、基金资产估值	<p>七、暂停估值的情形</p> <p>...</p>	<p>七、暂停估值的情形</p> <p>...</p> <p>（新增）</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时，经与基金托管人协商确认后，应当暂停估值；</p>
第十三部分、基金资产估值	<p>八、特殊情形的处理</p> <p>1、基金管理人按估值方法的第 6 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理；</p>	<p>八、特殊情形的处理</p> <p>1、基金管理人按估值方法的第 7 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理；</p>
第十七部分、基金的信息披露	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>...</p> <p>（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</p> <p>...</p>	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>...</p> <p>（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</p> <p>...</p> <p>（新增）</p> <p>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。</p> <p>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例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文件中“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本基金的特定风险，中国证监会认定的特殊情形除外。</p>
第十八部分 基金的信息披露	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>...</p> <p>（七）临时报告</p> <p>...</p>	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>...</p> <p>（七）临时报告</p> <p>...</p> <p>（新增）</p>

		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； 27、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；
第二十四部分 基金合同 内容摘要		根据基金合同正文对应修改

二、托管协议内容修订

修改章节	修改前	修改后
第一部分、基金托管协议当事人	(一) 基金管理人 名称: 景顺长城基金基金管理有限公司 法定代表人: 赵如冰	(一) 基金管理人 名称: 景顺长城基金基金管理有限公司 法定代表人: 杨光裕
第一部分、基金托管协议当事人	(二) 基金托管人 法定代表人: 姜建清	(二) 基金托管人 法定代表人: 易会满
第二部分、基金托管协议的依据、目的和原则	订立本协议的依据是《中华人民共和国证券投资基金法》以下简称《基金法》)、《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》)、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第7号〈托管协议的内容与格式〉》、《景顺长城公司治理混合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。	订立本协议的依据是《中华人民共和国证券投资基金法》以下简称《基金法》)、《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》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第7号〈托管协议的内容与格式〉》、《景顺长城公司治理混合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。

<p>第三部分、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>	<p>(一)基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权</p> <p>...</p> <p>本基金投资组合的比例范围为:股票投资 65%-95%, 债券投资 0%-30%, 现金或者到期日在一年以内的政府债券投资 5%-35%, 权证投资 0-3%。</p> <p>本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>(一) 基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权</p> <p>...</p> <p>本基金投资组合的比例范围为: 股票投资 65%-95%, 债券投资 0%-30%, 现金或者到期日在一年以内的政府债券投资 5%-35%, 权证投资 0-3%。</p> <p>本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%, 其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</p>
<p>第三部分、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>	<p>2、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投融资比例进行监督:</p> <p>(1) 按法律法规的规定及《基金合同》的约定, 本基金的投资资产配置比例为:</p> <p>本基金为一只高持股的混合型基金, 本基金投资组合的比例范围为: 股票投资 65%-95%, 债券投资 0%-30%, 现金或者到期日在一年以内的政府债券投资 5%-35%, 权证投资 0-3%。</p> <p>...</p> <p>本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。</p> <p>...</p>	<p>2、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投融资比例进行监督:</p> <p>(1) 按法律法规的规定及《基金合同》的约定, 本基金的投资资产配置比例为: 本基金为一只高持股的混合型基金, 本基金投资组合的比例范围为: 股票投资 65%-95%, 债券投资 0%-30%, 现金或者到期日在一年以内的政府债券投资 5%-35%, 权证投资 0-3%, 其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</p> <p>...</p> <p>本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</p> <p>...</p>
<p>第三部分、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>	<p>(2) 根据法律法规的规定及《基金合同》的约定, 本基金投资组合遵循以下投资限制:</p> <p>...</p> <p>④现金和到期日不超过 1 年的政府债券不低于 5%;</p>	<p>(2)根据法律法规的规定及《基金合同》的约定, 本基金投资组合遵循以下投资限制:</p> <p>...</p> <p>④现金和到期日不超过 1 年的政府债券不低于 5%, 其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等;</p> <p>...</p> <p>(新增)</p> <p>⑧本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)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</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，以达到规定的投资比例限制要求。法律法规另有规定的从其规定。</p>	<p>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>⑨本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的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项所规定的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>...</p> <p>除上述投资限制第④、⑨项外，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，以达到规定的投资比例限制要求。法律法规另有规定的从其规定。</p>
<p>第三部分、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>	<p>7、基金托管人对基金投资流通受限证券的监督</p> <p>...</p> <p>(2) 流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>	<p>7、基金托管人对基金投资流通受限证券的监督</p> <p>...</p> <p>(2) 流通受限证券与上文流动性受限资产不同，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>
<p>第八部分、基金资产净值计算和会计核算</p>	<p>2. 估值方法</p> <p>...</p> <p>(2) 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>...</p> <p>C、首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价（收盘价）估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定</p>	<p>2. 估值方法</p> <p>...</p> <p>(2) 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>...</p> <p>C、流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等（不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股</p>

	公允价值。	票),按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。 ... (新增) (6)当发生大额申购或赎回情形时,履行适当程序后,基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。
第十部分、信息披露	(三) 暂停或延迟信息披露的情形 ...	(三) 暂停或延迟信息披露的情形 ... (新增) 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时,经与基金托管人协商确认后暂停估值;

关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改 基金合同、托管协议的内容说明

景顺长城中小盘混合型证券投资基金基金合同

一、基金合同修订内容

修改章节	修改前	修改后
第一部分 前言和释义	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,规范景顺长城中小盘混合型证券投资基金(以下简称“本基金”或“基金”)运作,依照《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》)、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称《运作办法》)、《证券投资基金参与股指期货交易指引》、《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》)、证券投资基金信息披露内容与	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,规范景顺长城中小盘混合型证券投资基金(以下简称“本基金”或“基金”)运作,依照《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》)、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称《运作办法》)、《证券投资基金参与股指期货交易指引》、《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

	格式准则第 6 号《基金合同的内容与格式》及其他有关规定,在平等自愿、诚实信用、充分保护基金投资者及相关当事人的合法权益的原则基础上,特订立《景顺长城中小盘混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“本合同”或“《基金合同》”)。	规定》)、证券投资基金信息披露内容与格式准则第 6 号《基金合同的内容与格式》及其他有关规定,在平等自愿、诚实信用、充分保护基金投资者及相关当事人的合法权益的原则基础上,特订立《景顺长城中小盘混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“本合同”或“《基金合同》”)。
第二部分 释义		... (新增) 流动性风险管理规定 指《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》 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 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
第五部分 基金份额的 申购与赎回	五、申购与赎回的数额限制...	五、申购与赎回的数额限制 ... (新增) 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。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。具体请参见相关公告。
第五部分 基金份额的 申购与赎回	<p>六、申购费用和赎回费用</p> <p>...</p> <p>2、投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取，扣除用于市场推广、注册登记费和其他手续费后的余额归基金财产，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。</p>	<p>六、申购费用和赎回费用</p> <p>...</p> <p>2、投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取，扣除用于市场推广、注册登记费和其他手续费后的余额归基金财产，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。对于持续持有期少于 7 日的投资者，本基金将收取不低于 1.5% 的赎回费并全额计入基金财产。</p> <p>...</p> <p>(新增)</p> <p>7、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，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、自律组织的规定。</p>
第五部分 基金份额的 申购与赎回	<p>九、拒绝或暂停申购的情形及处理方式</p> <p>...</p>	<p>九、拒绝或暂停申购的情形及处理方式</p> <p>...</p> <p>(新增)</p> <p>(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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受申购申请；</p> <p>(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%，或者变相规避 50% 集中度的情形时；</p> <p>发生上述情形之一且基金管理人决定暂停申购的，申购款项将全部或部分相应</p>

	<p>发生上述情形之一且基金管理人决定暂停申购的，申购款项将全额退还投资者。发生上述（1）到（6）项暂停申购情形时，基金管理人应当在至少一家指定媒体及基金管理人网站刊登暂停申购公告。</p>	<p>退还投资者。发生上述（1）到（6）、（8）项暂停申购情形时，基金管理人应当在至少一家指定媒体及基金管理人网站刊登暂停申购公告。</p>
<p>第五部分 基金份额的 申购与赎回</p>	<p>十、暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式</p> <p>...</p> <p>同时，在出现上述第（3）款的情形时，对已接受的赎回申请可延期支付赎回款项，最长不超过 20 个工作日，并在至少一家指定报刊及基金管理人网站公告。投资者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。</p>	<p>十、暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式</p> <p>...</p> <p>（新增）</p> <p>（2）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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项。</p> <p>...</p> <p>同时，在出现上述第（4）款的情形时，对已接受的赎回申请可延期支付赎回款项，最长不超过 20 个工作日，并在至少一家指定报刊及基金管理人网站公告。投资者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。</p>
<p>第五部分 基金份额的 申购与赎回</p>	<p>十一、 巨额赎回的情形及处理方式</p>	<p>十一、 巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>（新增）</p> <p>（3）如果基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人超过上一日基金总份额 20%以上的赎回申请的情形下，基金管理人可以对该基金份额持有人超过 20%以上的部分延期办理赎回申请。对于当日非延期的赎回申请，应当按单个账户非</p>

		<p>延期赎回申请量占非延期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。</p>
第六部分 基金合同当事人及权利 义务	<p>一、基金管理人 (一) 基金管理人简况 法定代表人：赵如冰</p>	<p>一、基金管理人 (一) 基金管理人简况 法定代表人：杨光裕</p>
第六部分 基金合同当事人及权利 义务	<p>二、基金托管人 (一) 基金托管人简况 法定代表人：姜建清</p>	<p>二、基金托管人 (一) 基金托管人简况 法定代表人：易会满</p>
第十一部分 基金的投资	<p>二、投资范围 ... 本基金将基金资产的 60%-95% 投资于股票等权益类资产（其中，权证投资比例不超过基金资产净值的 3%），将基金资产的 5%-40% 投资于债券和现金等固定收益类品种（其中，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%。</p>	<p>二、投资范围 ... 本基金将基金资产的 60%-95% 投资于股票等权益类资产（其中，权证投资比例不超过基金资产净值的 3%），将基金资产的 5%-40% 投资于债券和现金等固定收益类品种（其中，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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等）。</p>
第十一部分 基金的投资	<p>六、投资限制 (二) 投资组合限制 ...</p>	<p>六、投资限制 (二) 投资组合限制 ...</p>

	<p>5、现金和到期日不超过 1 年的政府债券不低于 5%；本基金投资股指期货的，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，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>5、现金和到期日不超过 1 年的政府债券不低于 5%；本基金投资股指期货的，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，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、存出保证金和应收申购款等；</p> <p>...</p> <p>（新增）</p> <p>12、本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不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，不超过该上市公司可流通股票的 30%；</p> <p>13、本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 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项所规定的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>14、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投资范围保持一致；</p> <p>...</p> <p>除上述第 5、13、14 项外，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。法律法规另有规</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。法律法规另有规定的从其规定。	定的从其规定。
第十三部分 基金资产估值	<p>五、估值方法</p> <p>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>...</p> <p>(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价（收盘价）估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>	<p>五、估值方法</p> <p>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>...</p> <p>(3) 流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等（不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票），按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p> <p>(新增)</p> <p>6、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。</p>
第十三部分 基金资产估值	七、暂停估值的情形	<p>七、暂停估值的情形</p> <p>(新增)</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时，经与基金托管人协商确认后，应当暂停估值；</p>
第十三部分 基金资产估值	<p>八、特殊情形的处理</p> <p>1、基金管理人按估值方法的第 6 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理；</p>	<p>八、特殊情形的处理</p> <p>1、基金管理人按估值方法的第 7 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理；</p>
第十七部分	五、公开披露的基金信息	五、公开披露的基金信息

<p>基金的信息披露</p>	<p>… (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 …</p>	<p>… (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基金份额比例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文件中“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本基金的特定风险，中国证监会认定的特殊情形除外。</p>
<p>第十八部分 基金的信息披露</p>	<p>五、公开披露的基金信息 … (七) 临时报告 …</p>	<p>五、公开披露的基金信息 … (七) 临时报告 … (新增) 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； 27、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；</p>
<p>第二十四部分 基金合同内容摘要</p>		<p>根据基金合同正文对应修改</p>

二、托管协议修订内容

修改章节	修改前	修改后
一、基金托管协议当事人	(一) 基金管理人 法定代表人: 赵如冰	(一) 基金管理人 法定代表人: 杨光裕
一、基金托管协议当事人	(二) 基金托管人 法定代表人: 姜建清 联系人: 蒋松云	(二) 基金托管人 法定代表人: 易会满 联系人: 郭明
二、基金托管协议的依据、目的和原则	订立本协议的依据是《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称《运作办法》)、《证券投资基金参与股指期货交易指引》、《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》)、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第7号〈托管协议的内容与格式〉》、《景顺长城中小盘混合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。	订立本协议的依据是《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称《运作办法》)、《证券投资基金参与股指期货交易指引》、《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》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第7号〈托管协议的内容与格式〉》、《景顺长城中小盘混合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。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	... (1) 按法律法规的规定及《基金合同》的约定, 本基金的投资资产配置比例为: 本基金将基金资产的 60%-95% 投资于股票等权益类资产(其中, 权证投资比例不超过基金资产净值的 3%), 将基金资产的 5%-40% 投资于债券和现金等固定收益类品种(其中, 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%)	... (1) 按法律法规的规定及《基金合同》的约定, 本基金的投资资产配置比例为: 本基金将基金资产的 60%-95% 投资于股票等权益类资产(其中, 权证投资比例不超过基金资产净值的 3%), 将基金资产的 5%-40% 投资于债券和现金等固定收益类品种(其中, 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、存出保证金和应收申购款等)。

<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>	<p>(2) 根据法律法规的规定及《基金合同》的约定, 本基金投资组合遵循以下投资限制:</p> <p>...</p> <p>c、现金和到期日不超过 1 年的政府债券不低于 5%; 本基金投资股指期货的, 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>...</p>	<p>(2) 根据法律法规的规定及《基金合同》的约定, 本基金投资组合遵循以下投资限制:</p> <p>...</p> <p>c、现金和到期日不超过 1 年的政府债券不低于 5%; 本基金投资股指期货的, 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、存出保证金和应收申购款等;</p> <p>...</p> <p>(新增)</p> <p>f、本基金管理人管理且由本基金托管人托管的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)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%; 本基金管理人管理且由本基金托管人托管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>g、本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 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项所规定的比例限制的, 基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;</p> <p>...</p> <p>除上述 c、g 项外, 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,</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，以达到规定的投资比例限制要求。法律法规另有规定的从其规定。</p>	<p>但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到规定的投资比例限制要求。法律法规另有规定的从其规定。</p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>	<p>7、基金托管人对基金投资流通受限证券的监督</p> <p>...</p> <p>(2) 流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>	<p>7、基金托管人对基金投资流通受限证券的监督</p> <p>...</p> <p>(2) 流通受限证券与上文流动性受限资产不同，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>
<p>八、基金资产净值计算和会计核算 (二) 基金资产估值方法</p>	<p>2. 估值方法</p> <p>...</p> <p>(2) 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>③首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价（收盘价）估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>	<p>2. 估值方法</p> <p>...</p> <p>(2) 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>③流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等（不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票），按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p> <p>...</p> <p>(新增)</p> <p>(6) 当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公</p>

		平性。
十、信息披露	(三) 暂停或延迟信息披露的情形 ...	(三) 暂停或延迟信息披露的情形 ... (新增) 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时，经与基金托管人协商确认后暂停估值；

**关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改
基金合同、托管协议的内容说明**

景顺长城大中华混合型证券投资基金

一、基金合同修订内容

修改章节	修改前	修改后
1、前言和释义	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，规范景顺长城大中华混合型证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）运作，依照《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》）、《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》）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 6 号〈基金合同的内容与格式〉》、《合格境内机构投资者境外证	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，规范景顺长城大中华混合型证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）运作，依照《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》）、《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》）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 6 号〈基金合同的内容与格式〉》、《合格境内机构投资者境外证

	<p>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》)及其他有关规定,在平等自愿、诚实信用、充分保护基金投资者及相关当事人的合法权益的原则基础上,特订立《景顺长城大中华混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“本合同”或“《基金合同》”。</p>	<p>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》)及其他有关规定,在平等自愿、诚实信用、充分保护基金投资者及相关当事人的合法权益的原则基础上,特订立《景顺长城大中华混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“本合同”或“《基金合同》”。</p>
1、前言和释义		<p>…</p> <p>(新增)</p> <p>流动性风险管理规定 指《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</p> <p>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>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>
5、基金份额的申购和赎回	<p>五、申购与赎回的数额限制</p> <p>…</p>	<p>五、申购与赎回的数额限制</p> <p>…(新增)</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。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要,可采取</p>

		上述措施对基金规模予以控制。具体请参见相关公告。
5、基金份额的申购和赎回	<p>六、申购费用和赎回费用</p> <p>...</p> <p>4、本基金的申购费率、赎回费率和收费方式由基金管理人根据《基金合同》的规定确定并在《招募说明书》中列示。基金管理人可以根据《基金合同》的相关约定调整费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前2个工作日在指定媒体上公告。</p>	<p>六、申购费用和赎回费用</p> <p>...</p> <p>4、本基金的申购费率、赎回费率和收费方式由基金管理人根据《基金合同》的规定确定并在《招募说明书》中列示。对于持续持有期少于7日的投资者，本基金将收取不低于1.5%的赎回费并全额计入基金财产。基金管理人可以根据《基金合同》的相关约定调整费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前2个工作日在指定媒体上公告。</p> <p>...</p> <p>(新增)</p> <p>7、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，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、自律组织的规定。</p>
5、基金份额的申购和赎回	<p>九、拒绝或暂停申购的情形及处理方式...</p> <p>(9) 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况；</p> <p>...</p>	<p>九、拒绝或暂停申购的情形及处理方式...</p> <p>(9) 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况；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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受申购申请；</p> <p>(新增)</p> <p>(10) 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；</p>

	<p>发生上述情形之一的，申购款项将全额退还投资者，由此产生的利息等损失由投资者自行承担。发生上述（1）到（7）项、第（9）项和第（10）项暂停申购情形时，基金管理人应当在指定媒体上刊登暂停申购公告。</p>	<p>发生上述情形之一的，申购款项将全部或部分相应退还投资者，由此产生的利息等损失由投资者自行承担。发生上述（1）到（7）项、第（9）项和第（11）项暂停申购情形时，基金管理人应当在指定媒体上刊登暂停申购公告。</p>
5、基金份额的申购和赎回	<p>十、暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式</p> <p>...</p> <p>（7）发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况</p>	<p>十、暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式</p> <p>...</p> <p>（7）发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况，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。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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；</p>
5、基金份额的申购和赎回	<p>十一、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>...</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>...</p>	<p>十一、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>...</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>...</p> <p>（新增）</p> <p>（3）如果基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额 20%以上的赎回申请的情形下，基金管理人可以对该基金份额持有人超过 20%以上的部分延期办理赎回申请。对于当日非延期的赎回申请，应当按单个账户非延期赎回申请量占非延期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</p>

		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。
6、基金合同当事人及权利义务	一、基金管理人 (一) 基金管理人概况 法定代表人：赵如冰	一、基金管理人 (一) 基金管理人概况 法定代表人：杨光裕
6、基金合同当事人及权利义务	二、基金托管人 (一) 基金托管人概况 法定代表人：姜建清 ... 联系人：赵会军	二、基金托管人 (一) 基金托管人概况 法定代表人：易会满 ... 联系人：郭明
11、基金的投资	二、投资范围 ... 本基金对于股票及其他权益类证券的投资不少于基金资产净值的60%，其中投资于除中国内地以外的大中华地区证券市场以及其他证券市场交易的大中华企业的资产不低于基金股票及其他权益类资产的80%；持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。	二、投资范围 ... 本基金对于股票及其他权益类证券的投资不少于基金资产净值的60%，其中投资于除中国内地以外的大中华地区证券市场以及其他证券市场交易的大中华企业的资产不低于基金股票及其他权益类资产的80%；持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。
13、基金资产	三、估值方法 1、证券交易所上市的有价证券的估	三、估值方法 1、证券交易所上市的有价证券的估值

估值	<p>值</p> <p>...</p> <p>(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的收盘价估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。</p>	<p>...</p> <p>(3) 流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等（不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票），按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p> <p>...</p> <p>(新增)</p> <p>6、当发生大额申购或赎回情形时，履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。</p>
13、基金资产估值	<p>七、暂停估值的情形</p> <p>...</p>	<p>七、暂停估值的情形</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时，经与基金托管人协商确认后，应当暂停估值；</p>
17、基金的信息披露	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>...</p> <p>(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</p> <p>...</p>	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>...</p> <p>(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</p> <p>...</p> <p>(新增)</p> <p>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。</p> <p>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例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文件中“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者</p>

		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本基金的特定风险，中国证监会认定的特殊情形除外。
17、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) 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； 28、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；
24、基金合同摘要		根据基金合同正文对应修改

二、托管协议修订内容

修改章节	修改前	修改后
1. 基金托管协议当事人	1.1 基金管理人 法定代表人：赵如冰	1.1 基金管理人 法定代表人：杨光裕
1. 基金托管协议当事人	1.2 基金托管人 法定代表人：姜建清 联系人：赵会军	1.2 基金托管人 法定代表人：易会满 联系人：郭明
2. 基金托管协议的依据、目的和原则	2.1 订立托管协议的依据 订立本协议的依据是《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称《信息披露办法》)、《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》(以下简称《试行办法》)及《关于实施〈合格境内机构投资者境外证券投	2.1 订立托管协议的依据 订立本协议的依据是《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、《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》、《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》(以下简称《试行办法》)及《关于实施〈合

	资管理试行办法)有关问题的通知》(以下简称《通知》)等相关法律法规和《景顺长城大中华混合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。	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》)等相关法律法规和《景顺长城大中华混合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。
4. 基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	... (1)按法律法规的规定及《基金合同》的约定,本基金的投资资产配置比例为: 本基金对于股票及其他权益类证券的投资不少于基金资产净值的60%,持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。	... (1)按法律法规的规定及《基金合同》的约定,本基金的投资资产配置比例为: 本基金对于股票及其他权益类证券的投资不少于基金资产净值的60%,持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。
9. 基金资产净值计算和会计核算	9.3 暂停估值的情形...	9.3 暂停估值的情形 ... (新增) (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时,经与基金托管人协商确认后,应当暂停估值;
11. 信息披露	11.3 暂停或延迟信息披露的情形	11.3 暂停或延迟信息披露的情形 ... (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时,经与基金托管人协商确认后暂停估值;

**关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改
基金合同、托管协议的内容说明
景顺长城景兴信用纯债债券型证券投资基金**

一、基金合同修改内容

章节	修订前	修订后
<p>前言</p> <p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</p>		<p>增加： 、《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》”）</p>
<p>释义</p>		<p>增加： “54、《流动性风险管理规定》：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 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 56、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，</p>

		确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待”
基金份额的申购与赎回 五、 申购和赎回的数量限制		增加： 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。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。具体请参见相关公告。
基金份额的申购与赎回 六、 申购和赎回的价格、费用及其用途	6、 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。不低于赎回费总额的 25%应归基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。	6、 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。对于持续持有期少于 7 日的投资者，本基金将收取不低于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产。对于持续持有期不少于 7 日的投资者收取的赎回费，不低于赎回费总额的 25%应归基金财产，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。
基金份额的申购与赎回 六、 申购和赎回的价格、费用及其用途		增加： 9、 当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，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、自律组织的规定。
基金份额的申购与赎回 七、 拒绝或暂停申购的情形		增加： 2、 ……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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受申购申请。 6、 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。
基金份额的申	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申购	发生上述情形之一（除第 4、6 项外）且基金管理人决定暂停申购

<p>购与赎回</p> <p>七、拒绝或暂停申购的情形</p>	<p>时,基金管理人应当根据有关规定在指定媒体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>时,基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的,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>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>增加:</p> <p>2、……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,经与基金托管人协商确定后,基金管理人应当暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项。</p>
<p>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</p>		<p>增加:</p> <p>(3) 如果基金发生巨额赎回,在单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额 20%以上的赎回申请的情形下,基金管理人可以对该基金份额持有人超过 20%以上的部分延期办理赎回申请。对于当日非延期的赎回申请,应当按单个账户非延期赎回申请量占非延期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。</p>
<p>基金合同当事人及权利义务</p> <p>一、基金管理人</p>	<p>法定代表人: 赵如冰</p>	<p>法定代表人: 杨光裕</p>

基金合同当事人及权利义务 二、基金托管人	名称:中国建设银行股份有限公司 住所:北京市西城区金融大街25号 法定代表人:王洪章 成立时间:2004年09月17日 基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]12号 组织形式:股份有限公司 注册资本:人民币贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整 存续期间:持续经营	名称:中国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行) 住所:北京市西城区金融大街25号 法定代表人:田国立 成立时间:2004年09月17日 批准设立机关和批准设立文号:中国银监会银监复[2004]143号 组织形式:股份有限公司 注册资本:贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整 存续期间:持续经营 基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]12号
基金的投资 四、投资限制		增加: (2)……,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等 (8)本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的15%;因证券市场波动、债券停牌、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项所规定的比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资; (9)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投资范围保持一致;
基金的投资 四、投资限制	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。法律法规另有规定的,从其规定。	除上述第(2)、(8)、(9)、(10)项外,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。法律法规另有规定的,从其规定。
基金资产估值 三、估值方法	(1)交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值,估值日没有交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投	(1)交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(基金合同另有规定的除外),选取估值日第三方估值机构提供的相应品种对应的估值净价估值,具体估值机构由基金管理人与托管人另行协商约定;

	<p>资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值；</p> <p>(2) 交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值；</p>	<p>(2) 交易所上市交易的可转换债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值；</p>
<p>基金资产估值</p> <p>三、估值方法</p>		<p>增加：</p> <p>6、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。</p>
<p>基金资产估值</p> <p>六、暂停估值的情形</p>		<p>增加：</p> <p>3、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时，经与基金托管人协商确认后，应当暂停估值；</p>
<p>基金资产估值</p> <p>八、特殊情况的处理</p>	<p>1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第6项进行估值时，所造成的误差不得作为基金资产估值错误处理。</p>	<p>1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第7项进行估值时，所造成的误差不得作为基金资产估值错误处理。</p>
<p>基金的信息披露</p> <p>五、公开披露的基金信息</p>		<p>增加：</p> <p>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。</p> <p>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例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文件中“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本基金的特有风险，中国证监会认定的特殊情</p>

		形除外。
基金的信息披露 五、公开披露的基金信息		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； 27、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；
基金合同内容摘要		对应基金合同正文内容进行同步修改。

二、 托管协议修改内容

章节	修订前	修订后
基金托管协议当事人 (一) 基金管理人	法定代表人：赵如冰	法定代表人：杨光裕
基金托管协议当事人 (二) 基金托管人	<p>名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)</p> <p>住所：北京市西城区金融大街25号</p> <p>办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼</p> <p>邮政编码：100033</p> <p>法定代表人：王洪章</p> <p>成立日期：2004年09月17日</p> <p>基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]12号</p> <p>组织形式：股份有限公司</p> <p>注册资本：人民币贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整</p> <p>存续期间：持续经营</p> <p>经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国银行业监督管理委员会等监管部门批准的其他业务。</p>	<p>名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)</p> <p>住所：北京市西城区金融大街25号</p> <p>办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼</p> <p>邮政编码：100033</p> <p>法定代表人：田国立</p> <p>成立日期：2004年09月17日</p> <p>基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]12号</p> <p>组织形式：股份有限公司</p> <p>注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整</p> <p>存续期间：持续经营</p> <p>经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国银行业监督管理委员会等监管部门批准的其他业务。</p>

<p>基金托管协议的依据、目的和原则</p> <p>(一) 订立托管协议的依据</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》”)等有关法律法规、《基金合同》及其他有关规定制订。</p>	<p>本协议依据《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》”)、《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》和其他有关法律法规制订。</p>
<p>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>增加:</p> <p>2. …… ,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等</p> <p>6. 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 15%;因证券市场波动、债券停牌、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项所规定的比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;</p> <p>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投资范围保持一致;</p>
<p>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>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。法律法规另有规定的,从其规定。</p>	<p>除上述第 2、6、7、8 项外,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。法律法规另有规定的,从其规定。</p>
<p>基金资产净值计算和会计核算</p> <p>(二) 基金资产估值方法和特殊情形的处理”的“2. 估值方法</p>	<p>1) 交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值,估值日没有交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调</p>	<p>1) 交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(基金合同另有规定的除外), 选取估值日第三方估值机构提供的相应品种对应的估值净价估值,具体估值机构由基金管理人与托管人另行协商约定;</p> <p>2) 交易所上市交易的可转换债</p>

	<p>整最近交易市价，确定公允价值；</p> <p>2) 交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值；</p>	<p>券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值；</p>
<p>基金资产净值计算和会计核算</p> <p>(二) 基金资产估值方法和特殊情形的处理”的“2. 估值方法</p>		<p>增加：</p> <p>(6) 当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。</p>
<p>基金资产净值计算和会计核算</p> <p>(二) 基金资产估值方法和特殊情形的处理</p>	<p>基金管理人、基金托管人按前述估值方法第(6)进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。</p>	<p>基金管理人、基金托管人按前述估值方法第(7)进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。</p>
<p>基金资产净值计算和会计核算</p> <p>(四) 暂停估值与公告基金份额净值的情形</p>		<p>增加：</p> <p>3. 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时，经与基金托管人协商确认后，应当暂停估值；</p>
<p>基金信息披露</p> <p>(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</p>		<p>增加：</p> <p>(4) 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时，经与基金托管人协商确认后暂停估值；</p>

关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改

基金合同、托管协议的内容说明

景顺长城优质成长股票型证券投资基金

一、基金合同修改内容

章节	修订前	修订后
前言 一、订立本 基金合同 的目的、依 据和原则		增加： 、《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》”）
释义		增加： 52、《流动性风险管理规定》：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 53、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 54、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
基金份额 的申购与 赎回 五、申购和		增加： 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

赎回的数量限制		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。具体请参见相关公告。
基金份额的申购与赎回 六、申购和赎回的价格、费用及其用途		增加： 8、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，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、自律组织的规定。
基金份额的申购与赎回 七、拒绝或暂停申购的情形		增加： 2、……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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受申购申请。 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%，或者变相规避 50%集中度的情形时。
基金份额的申购与赎回 七、拒绝或暂停申购的情形	发生上述第 1、2、3、5、6、7 项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体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。	发生上述情形之一（除第 4、7 项外）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体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，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。
基金份额的申购与赎回 八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形		增加： 2、……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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项。

<p>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</p>		<p>增加：</p> <p>(3) 如果基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额 20%以上的赎回申请的情形下，基金管理人可以对该基金份额持有人超过 20%以上的部分延期办理赎回申请。对于当日非延期的赎回申请，应当按单个账户非延期赎回申请量占非延期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。</p>
<p>基金合同当事人及权利义务</p> <p>一、基金管理人</p>	<p>法定代表人：赵如冰</p>	<p>法定代表人：杨光裕</p>
<p>基金合同当事人及权利义务</p> <p>二、基金托管人</p>	<p>名称：中国建设银行股份有限公司 住所：北京市西城区金融大街 25 号 法定代表人：王洪章 成立时间：2004 年 09 月 17 日 批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复【2004】143 号 基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号 组织形式：股份有限公司 注册资本：人民币贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整 存续期间：持续经营</p>	<p>名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行) 住所：北京市西城区金融大街 25 号 法定代表人：田国立 成立时间：2004 年 09 月 17 日 批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2004]143 号 组织形式：股份有限公司 注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整 存续期间：持续经营 基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号</p>
<p>基金的投资</p> <p>二、投资范</p>		<p>第二款最后增加： ……，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</p>

围		
基金的投 资 四、投资限 制	(2) 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;	(2) 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, 本基金保留的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%, 其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等;
基金的投 资 四、投资限 制		增加: (12) 本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票, 不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, 不超过该上市公司可流通股票的30%; (13) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的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项所规定的比例限制的, 基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资; (14) 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投资范围保持一致;
基金的投 资 四、投资限 制	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。法律法规另有规定, 从其规定。	除上述第(2)、(13)、(14)、(15)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。法律法规另有规定, 从其规定。
基金资产 估值 三、估值方 法	(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票, 同一股票在交易所上市后, 按交易所上市的同一股票的估值方法估值; 非公开发行有明确锁定期的股票, 按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。	(3) 流通受限的股票, 包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等(不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票), 按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。
基金资产 估值 三、估值方		增加: 6、当发生大额申购或赎回情形时, 在履行适当程序后, 基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。

法		
基金资产估值 六、暂停估值的情形		增加： 3、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时，经与基金托管人协商确认后，应当暂停估值；
基金的信息披露 五、公开披露的基金信息		增加： 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基金份额比例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文件中“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本基金的特定风险，中国证监会认定的特殊情形除外。
基金的信息披露 五、公开披露的基金信息		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； 27、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；
基金合同内容摘要		对应基金合同正文内容进行同步修改。

二、托管协议修改内容

章节	修订前	修订后
基金托管协议当事人 (一)基金管理人	法定代表人：赵如冰	法定代表人：杨光裕
基金托管协议当事人 (二)基金托管人	名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行) 住所：北京市西城区金融大街 25 号 办公地址：北京市西城区闹市口大街	名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行) 住所：北京市西城区金融大街 25 号 办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

人	<p>口大街 1 号院 1 号楼 邮政编码：100033 法定代表人：王洪章 成立日期：2004 年 09 月 17 日 基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]12 号 组织形式：股份有限公司 注册资本：人民币贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整 存续期间：持续经营 经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国银行业监督管理委员会等监管部门批准的其他业务。</p>	<p>邮政编码：100033 法定代表人：田国立 成立日期：2004 年 09 月 17 日 基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]12 号 组织形式：股份有限公司 注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整 存续期间：持续经营 经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国银行业监督管理委员会等监管部门批准的其他业务。</p>
<p>基金托管协议的依据、目的和原则 （一）订立托管协议的依据</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》”）等有关法律法规、《基金合同》及其他有关规定制订。</p>	<p>本协议依据《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》”）、《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》和其他有关法律法规制订。</p>
<p>基金托管人对基金管理人的业务监督和核查 （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>第（一）条第三款增加： ……，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等</p>
<p>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</p>	<p>2. 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>2. 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，本基金保留的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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；</p>

<p>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。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督:</p>		
<p>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>增加:</p> <p>9. 本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票,不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,不超过该上市公司可流通股票的 30%;基金托管人的监督义务仅限于其托管的基金管理人管理的开放式基金和投资组合;</p> <p>10. 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 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项所规定的比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;</p> <p>11. 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投资范围保持一致;</p>
<p>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>因证券市场波动、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 个工作日内进行调整。法律法规另有规定的,从其规定。</p>	<p>除上述第 2、10、11、12 项外,因证券市场波动、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 个工作日内进行调整。法律法规另有规定的,从其规定。</p>
<p>基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p> <p>(五)基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》</p>	<p>1. 本基金投资的流通受限证券须为经中国证监会批准的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。本基</p>	<p>1. 本基金投资的流通受限证券与上文流动性受限资产不同,须为经中国证监会批准的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。本基金不投资有锁定期但锁定期不明确的证券。</p>

的约定，对基金管理人投资流通受限证券进行监督。	金不投资有锁定期但锁定期不明确的证券。	
基金资产净值计算和会计核算 (二) 基金资产估值方法和特殊情形的处理	3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。	3) 流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等（不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票），按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。
基金资产净值计算和会计核算 (二) 基金资产估值方法和特殊情形的处理		增加： (6) 当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。
基金资产净值计算和会计核算 (二) 基金资产估值方法和特殊情形的处理	(1) 基金管理人、基金托管人按估值方法的第(6)项进行估值时，所造成的误差不得作为基金份额净值错误处理。	(1) 基金管理人、基金托管人按估值方法的第(7)项进行估值时，所造成的误差不得作为基金份额净值错误处理。
基金资产净值计算和会计核算 (四) 暂停估值与公告基金份额净值的情形		增加： 3. 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时，经与基金托管人协商确认后，应当暂停估值；
基金信息披露 (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		增加： (3) 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时，经与基金托管人协商确认后暂停估值；

关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改
基金合同、托管协议的内容说明

景顺长城研究精选股票型证券投资基金

一、基金合同修改内容

章节	修订前	修订后
<p>前言</p> <p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</p>		<p>增加： 、《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》”）</p>
<p>释义</p>		<p>增加：</p> <p>52、《流动性风险管理规定》：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</p> <p>53、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>54、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>基金份额的申</p>		<p>增加：</p>

<p>购与赎回</p> <p>五、 申购和赎回的数量限制</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。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。具体请参见相关公告。</p>
<p>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>增加:</p> <p>8、当发生大额申购或赎回情形时,在履行适当程序后,基金管理人可以采用摆动定价机制,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、自律组织的规定。</p>
<p>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>增加:</p> <p>2、……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,经与基金托管人协商确定后,基金管理人应当暂停接受申购申请。</p> <p>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%,或者变相规避 50%集中度的情形时。</p>
<p>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>发生上述第 1、2、3、5、6、7 项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体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>发生上述情形之一(除第 4、7 项外)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体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的,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>基金份额的申购与赎回</p> <p>八、 暂停赎回或延缓支付赎回</p>		<p>增加:</p> <p>2、……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,经与基金托管人协商确定后,基金管理</p>

回款项的情形		人应当暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项。
基金份额的申购与赎回 九、巨额赎回的情形及处理方式		增加： （3）如果基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额 20%以上的赎回申请的情形下，基金管理人可以对该基金份额持有人超过 20%以上的部分延期办理赎回申请。对于当日非延期的赎回申请，应当按单个账户非延期赎回申请量占非延期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。
基金合同当事人及权利义务 一、基金管理人	法定代表人：赵如冰	法定代表人：杨光裕
基金合同当事人及权利义务 二、基金托管人	名称：中国建设银行股份有限公司 住所：北京市西城区金融大街 25 号 法定代表人：王洪章 成立时间：2004 年 09 月 17 日 批准设立机关和批准设立文号：中国证监会证监复【1998】12 号 组织形式：股份有限公司 注册资本：人民币贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整 存续期间：持续经营 基金托管资格批文及文号：中国	名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行） 住所：北京市西城区金融大街 25 号 法定代表人：田国立 成立时间：2004 年 09 月 17 日 批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2004]143 号 组织形式：股份有限公司 注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整 存续期间：持续经营 基金托管资格批文及文号：中国

	证监会证监基字【1998】12号	证监会证监基字[1998]12号
基金的投资 二、投资范围		第二款最后增加： ……，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等
基金的投资 四、投资限制		增加： （2）……，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等 增加： （12）本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不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，不超过该上市公司可流通股票的30%； （13）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的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项所规定的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资； （14）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投资范围保持一致；
基金的投资 四、投资限制	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。法律法规另有规定的，从其规定。	除上述第(2)、(13)、(14)、(15)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。法律法规另有规定的，从其规定。
基金资产估值 三、估值方法	（3）首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值	（3）流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交

	方法估值;非公开发行有明确锁定期的股票,按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。	易取得的带限售期的股票等(不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票),按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。
基金资产估值 三、估值方法		增加: 6、当发生大额申购或赎回情形时,在履行适当程序后,基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。
基金资产估值 六、暂停估值的情形		增加: 3、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时,经与基金托管人协商确认后,应当暂停估值;
基金资产估值 八、特殊情况的处理	1、基金管理人或基金托管人按本基金合同规定的估值方法的第6项进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。	1、基金管理人或基金托管人按本基金合同规定的估值方法的第7项进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。
基金的信息披露 五、公开披露的基金信息		增加: 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基金份额比例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文件中“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本基金的特定风险,中国证监会认定的特殊情形除外。
基金的信息披露 五、公开披露的基金信息		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; 27、基金管理人采用摆动定价机制进行估值;
基金合同内容		对应基金合同正文内容进行同步修改。

摘要		
----	--	--

二、托管协议修改内容

章节	修订前	修订后
基金托管协议当事人 (一) 基金管理人	法定代表人：赵如冰	法定代表人：杨光裕
基金托管协议当事人	<p>名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)</p> <p>住所：北京市西城区金融大街25号</p> <p>办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼</p> <p>邮政编码：100033</p> <p>法定代表人：王洪章</p> <p>成立日期：2004年09月17日</p> <p>基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]12号</p> <p>组织形式：股份有限公司</p> <p>注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整</p> <p>存续期间：持续经营</p> <p>经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国银行业监督管理委员会等监管部门批准的其他业务。</p>	<p>名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)</p> <p>住所：北京市西城区金融大街25号</p> <p>办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼</p> <p>邮政编码：100033</p> <p>法定代表人：田国立</p> <p>成立日期：2004年09月17日</p> <p>基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]12号</p> <p>组织形式：股份有限公司</p> <p>注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整</p> <p>存续期间：持续经营</p> <p>经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国银行业监督管理委员会等监管部门批准的其他业务。</p>
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》”)等有关法律法规、《基金合同》及其他有关规定制订。	本协议依据《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》”)、《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》和其他有关法律法规制订。
基金托管人对基金管理人的业务监督和核查 (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。		第(一)条第三款增加: ……,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等
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。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督:		增加: 2. ……,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等 增加: 12. 本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票,不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,不超过该上市公司可流通股票的 30%;基金托管人的监督义务仅限于其托管的基金管理人管理的开放式基金和投资组合; 13. 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 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项所规定的比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资; 14. 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投资范围保持一致;
基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	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	除上述第 2、13、14、15 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

<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>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。法律法规另有规定的,从其规定。</p>	<p>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。法律法规另有规定的,从其规定。</p>
<p>基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p> <p>(五) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定,对基金管理人投资流通受限证券进行监督。</p>	<p>1. 本基金投资的流通受限证券须为经中国证监会批准的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。本基金不投资有锁定期但锁定期不明确的证券。</p>	<p>1. 本基金投资的流通受限证券与上文流动性受限资产不同,须为经中国证监会批准的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。本基金不投资有锁定期但锁定期不明确的证券。</p>
<p>基金资产净值计算和会计核算</p> <p>(二) 基金资产估值方法和特殊情形的处理”的“2. 估值方法</p>	<p>3) 首次公开发行有明确锁定期的股票,同一股票在交易所上市后,按交易所上市的同一股票的估值方法估值;非公开发行有明确锁定期的股票,按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>	<p>3) 流通受限的股票,包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等(不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票),按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>
<p>基金资产净值计算和会计核算</p> <p>(二) 基金资产估值方法和特殊情形的处理</p>		<p>增加:</p> <p>(6) 当发生大额申购或赎回情形时,在履行适当程序后,基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。</p>
<p>基金资产净值计算和会计核算</p> <p>(二) 基金资产估值方法和特殊情形的处理</p>	<p>(1) 基金管理人、基金托管人按估值方法的第(6)项进行估值时,所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。</p>	<p>(1) 基金管理人、基金托管人按估值方法的第(7)项进行估值时,所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。</p>
<p>基金资产净值计算和会计核算</p> <p>(四) 暂停估</p>		<p>增加:</p> <p>3. 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</p>

值与公告基金份额净值的情形		允价值存在重大不确定时,经与基金托管人协商确认后,应当暂停估值;
基金信息披露 (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		增加: (3)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时,经与基金托管人协商确认后暂停估值;

关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改

基金合同、托管协议的内容说明

景顺长城量化精选股票型证券投资基金

一、基金合同修改内容

章节	修订前	修订后
前言 一、订立本基金合同的目的、依据和原则		增加: 、《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》”)
释义		增加: 52、《流动性风险管理规定》: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 53、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

		<p>发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等</p> <p>54、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>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>增加：</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。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。具体请参见相关公告。</p>
<p>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>增加：</p> <p>3、……，对于持续持有期少于7日的投资者，本基金将收取不低于1.5%的赎回费并全额计入基金财产</p> <p>8、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，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、自律组织的规定。</p>
<p>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>增加：</p> <p>2、……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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受申购申请。</p> <p>6、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。</p>
<p>基金份额的申</p>	<p>发生上述第1、2、3、5、6项暂</p>	<p>发生上述暂停申购情形之一(除</p>

<p>购与赎回</p> <p>七、拒绝或暂停申购的情形</p>	<p>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 4、6 项外) 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全部或部分拒绝的,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>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>增加:</p> <p>2、……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,经与基金托管人协商确定后,基金管理人应当暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项。</p>
<p>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</p>		<p>增加:</p> <p>(3) 如果基金发生巨额赎回,在单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额 20%以上的赎回申请的情形下,基金管理人可以对该基金份额持有人超过 20%以上的部分延期办理赎回申请。对于当日非延期的赎回申请,应当按单个账户非延期赎回申请量占非延期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。</p>
<p>基金合同当事人及权利义务</p> <p>一、基金管理</p>	<p>法定代表人: 赵如冰</p>	<p>法定代表人: 杨光裕</p>

人		
基金合同当事人及权利义务 二、基金托管人	<p>名称:中国建设银行股份有限公司 住所:北京市西城区金融大街25号 法定代表人:王洪章 成立时间:2004年09月17日 批准设立机关和批准设立文号:中国银监会银监复【2004】143号 组织形式:股份有限公司 注册资本:人民币贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整 存续期间:持续经营 基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字【1998】12号</p>	<p>名称:中国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行) 住所:北京市西城区金融大街25号 法定代表人:田国立 成立时间:2004年09月17日 批准设立机关和批准设立文号:中国银监会银监复[2004]143号 组织形式:股份有限公司 注册资本:贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整 存续期间:持续经营 基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]12号</p>
基金的投资 二、投资范围		<p>第二款最后增加: ……,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等</p>
基金的投资 四、投资限制		<p>增加: (11)本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票,不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,不超过该上市公司可流通股票的30%; (12)本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的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项所规定的比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资; (13)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投资范围保持一致; 18.6……,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等</p>

基金的投资 四、投资限制	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。法律法规另有规定的,从其规定。	除上述第(12)、(13)、(14)项及18.6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。法律法规另有规定的,从其规定。
基金资产估值 三、估值方法	(3)首次公开发行有明确锁定期的股票,同一股票在交易所上市后,按交易所上市的同一股票的估值方法估值;非公开发行有明确锁定期的股票,按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。	(3)流通受限的股票,包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等(不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票),按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。
基金资产估值 三、估值方法		增加: 6、当发生大额申购或赎回情形时,在履行适当程序后,基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。
基金资产估值 六、暂停估值的情形		增加: 3、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时,经与基金托管人协商确认后,应当暂停估值;
基金资产估值 八、特殊情况的处理	1、基金管理人或基金托管人按本基金合同规定的估值方法的第6项进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。	1、基金管理人或基金托管人按本基金合同规定的估值方法的第7项进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。
基金的信息披露 五、公开披露的基金信息		增加: 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基金份额比例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文件中“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本基金的 特有风险,中国证监会认定的特殊情 形除外。
基金的信息披 露 五、公开披露 的基金信息		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; 27、基金管理人采用摆动定价机 制进行估值;
基金合同内容 摘要		对应基金合同正文内容进行同 步修改。

二、托管协议修改内容

章节	修订前	修订后
基金托管协议 当事人 (一) 基金管 理人	法定代表人: 赵如冰	法定代表人: 杨光裕
基金托管协议 当事人 (二) 基金托 管人	名称: 中国建设银行股份有限公司(简称: 中国建设银行) 住所: 北京市西城区金融大街 25号 办公地址: 北京市西城区闹市口 大街1号院1号楼 邮政编码: 100033 法定代表人: 王洪章 成立日期: 2004年09月17日 基金托管业务批准文号: 中国证 监会证监基字[1998]12号 组织形式: 股份有限公司 注册资本: 贰仟伍佰亿壹仟零玖 拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整 存续期间: 持续经营 经营范围: 吸收公众存款; 发放 短期、中期、长期贷款; 办理国内外 结算; 办理票据承兑与贴现; 发行金 融债券; 代理发行、代理兑付、承销 政府债券; 买卖政府债券、金融债券; 从事同业拆借; 买卖、代理买卖外汇; 从事银行卡业务; 提供信用证服务及 担保; 代理收付款项及代理保险业 务; 提供保管箱服务; 经中国银行业	名称: 中国建设银行股份有限公司(简称: 中国建设银行) 住所: 北京市西城区金融大街 25号 办公地址: 北京市西城区闹市口 大街1号院1号楼 邮政编码: 100033 法定代表人: 田国立 成立日期: 2004年09月17日 基金托管业务批准文号: 中国证 监会证监基字[1998]12号 组织形式: 股份有限公司 注册资本: 贰仟伍佰亿壹仟零玖 拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整 存续期间: 持续经营 经营范围: 吸收公众存款; 发放 短期、中期、长期贷款; 办理国内外 结算; 办理票据承兑与贴现; 发行金 融债券; 代理发行、代理兑付、承销 政府债券; 买卖政府债券、金融债券; 从事同业拆借; 买卖、代理买卖外汇; 从事银行卡业务; 提供信用证服务及 担保; 代理收付款项及代理保险业 务; 提供保管箱服务; 经中国银行业

	<p>监督管理机构等监管部门批准的其他业务。</p>	<p>监督管理机构等监管部门批准的其他业务。</p>
<p>基金托管协议的依据、目的和原则 （一）订立托管协议的依据</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》”）等有关法律法规、《基金合同》及其他有关规定制订。</p>	<p>本协议依据《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》和其他有关法律法规制订。</p>
<p>基金托管人对基金管理人的业务监督和核查 （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>第（一）条第三款增加： ……,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等</p>
<p>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。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：</p>		<p>增加： （11）本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票,不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,不超过该上市公司可流通股票的 30%；基金托管人的监督义务仅限于其托管的基金管理人管理的开放式基金和投资组合； （12）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 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项所规定的比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资； （13）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</p>

		<p>受质押品的资质要求应当与投资范围保持一致；</p> <p>增加： 18.6……，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等</p>
<p>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>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。法律法规另有规定的，从其规定。</p>	<p>除上述第(12)、(13)、(14)项及18.6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。法律法规另有规定的，从其规定。</p>
<p>基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p> <p>(五) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金管理人投资流通受限证券进行监督。</p>	<p>1. 本基金投资的流通受限证券须为经中国证监会批准的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。本基金不投资有锁定期但锁定期不明确的证券。</p>	<p>1. 本基金投资的流通受限证券与上文流动性受限资产不同，须为经中国证监会批准的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。本基金不投资有锁定期但锁定期不明确的证券。</p>
<p>基金资产净值计算和会计核算</p> <p>(二) 基金资产估值方法和特殊情形的处理”的“2. 估值方法</p>	<p>3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>	<p>3) 流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等(不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票)，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>
<p>基金资产净值计算和会计核算</p> <p>(二) 基金资产估值方法和特殊情形的处理”的“2. 估值方法</p>		<p>增加： (6) 当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。</p>

基金资产净值计算和会计核算 (二) 基金资产估值方法和特殊情形的处理	(1) 基金管理人或基金托管人按基金合同规定的估值方法的第(6)项进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。	(1) 基金管理人或基金托管人按基金合同规定的估值方法的第(7)项进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。
基金资产净值计算和会计核算 (四) 暂停估值与公告基金份额净值的情形		增加: 3. 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时,经与基金托管人协商确认后,应当暂停估值;
基金信息披露 (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		增加: (4) 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时,经与基金托管人协商确认后暂停估值;

**关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改
 基金合同、托管协议的内容说明**
景顺长城环保优势股票型证券投资基金

一、基金合同修改内容

章节	修订前	修订后
前言 一、订立本基金合同的目的、依据和原则		增加: 、《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》”)
释义		增加: 52、《流动性风险管理规定》: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

		<p>53、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>54、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>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>增加：</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。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。具体请参见相关公告。</p>
<p>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>增加：</p> <p>3、……，对于持续持有期少于 7 日的投资者，本基金将收取不低于 1.5% 的赎回费并全额计入基金财产</p> <p>8、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，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、自律组织的规定。</p>
<p>基金份额的申购与赎回</p> <p>七、拒绝或暂</p>		<p>增加：</p> <p>2、……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，经</p>

<p>停申购的情形</p>		<p>与基金托管人协商确定后,基金管理人应当暂停接受申购申请。</p> <p>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%,或者变相规避50%集中度的情形时。</p>
<p>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>发生上述第1、2、3、5、6、7项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>发生上述情形之一(除第4、7项外)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全部或部分拒绝的,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>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>增加:</p> <p>2、……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,经与基金托管人协商确定后,基金管理人应当暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项。</p>
<p>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”之“2、巨额赎回的处理方式</p>		<p>增加:</p> <p>(3) 如果基金发生巨额赎回,在单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额20%以上的赎回申请的情形下,基金管理人可以对该基金份额持有人超过20%以上的部分延期办理赎回申请。对于当日非延期的赎回申请,应当按单个账户非延期赎回申请量占非延期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。</p>

		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。
基金合同当事人及权利义务 一、基金管理人	法定代表人: 赵如冰	法定代表人: 杨光裕
基金合同当事人及权利义务 二、基金托管人	名称:中国建设银行股份有限公司 住所:北京市西城区金融大街25号 法定代表人:王洪章 成立时间:2004年09月17日 批准设立机关和批准设立文号:中国证监会证监基字[1998]12号 组织形式:股份有限公司 注册资本:人民币贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整 存续期间:持续经营 基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字【1998】12号	名称:中国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行) 住所:北京市西城区金融大街25号 法定代表人:田国立 成立时间:2004年09月17日 批准设立机关和批准设立文号:中国银监会银监复[2004]143号 组织形式:股份有限公司 注册资本:贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整 存续期间:持续经营 基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]12号
基金的投资 二、投资范围		增加: ……,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等
基金的投资 四、投资限制		增加: (2)……,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等 (12)本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票,不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,不超过该上市公司可流通股票的30%; (13)本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的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项所规定的比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投

		<p>资；</p> <p>(14)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投资范围保持一致；</p>
<p>基金的投资</p> <p>四、投资限制”</p> <p>之“1、组合限制”之“基金的投资组合应遵循以下限制：</p>	<p>因证券、期货市场波动、上市公司合并、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。</p>	<p>除上述第(2)、(13)、(14)、(15)项外，因证券、期货市场波动、上市公司合并、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。</p>
<p>基金资产估值</p> <p>四、估值方法</p>	<p>(4) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>	<p>(4) 流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等(不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票)，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>
<p>基金资产估值</p> <p>四、估值方法</p>		<p>增加：</p> <p>7、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。</p>
<p>基金资产估值</p> <p>七、暂停估值的情形</p>		<p>增加：</p> <p>3、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时，经与基金托管人协商确认后，应当暂停估值；</p>
<p>基金的信息披露</p> <p>五、公开披露的基金信息</p>		<p>增加：</p> <p>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。</p> <p>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20%的情形，为保障其他投资者的</p>

		权益,基金管理人至少应当在基金定期报告文件中“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本基金的特定风险,中国证监会认定的特殊情形除外。
基金的信息披露 五、公开披露的基金信息		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; 27、基金管理人采用摆动定价机制进行估值;
基金合同内容摘要		对应基金合同正文内容进行同步修改。

二、托管协议修改内容

章节	修订前	修订后
基金托管协议当事人 (一) 基金管理人	法定代表人: 赵如冰	法定代表人: 杨光裕
基金托管协议当事人 (二) 基金托管人	名称: 中国建设银行股份有限公司(简称: 中国建设银行) 住所: 北京市西城区金融大街25号 办公地址: 北京市西城区闹市口大街1号院1号楼 邮政编码: 100033 法定代表人: 王洪章 成立日期: 2004年09月17日 基金托管业务批准文号: 中国证监会证监基字[1998]12号 组织形式: 股份有限公司 注册资本: 贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整 存续期间: 持续经营 经营范围: 吸收公众存款; 发放短期、中期、长期贷款; 办理国内外结算; 办理票据承兑与贴现; 发行金融债券; 代理发行、代理兑付、承销政府债券; 买卖政府债券、金融债券; 从事同业拆借; 买卖、代理买卖外汇; 从事银行卡业务; 提供信用证服务及	名称: 中国建设银行股份有限公司(简称: 中国建设银行) 住所: 北京市西城区金融大街25号 办公地址: 北京市西城区闹市口大街1号院1号楼 邮政编码: 100033 法定代表人: 田国立 成立日期: 2004年09月17日 基金托管业务批准文号: 中国证监会证监基字[1998]12号 组织形式: 股份有限公司 注册资本: 贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整 存续期间: 持续经营 经营范围: 吸收公众存款; 发放短期、中期、长期贷款; 办理国内外结算; 办理票据承兑与贴现; 发行金融债券; 代理发行、代理兑付、承销政府债券; 买卖政府债券、金融债券; 从事同业拆借; 买卖、代理买卖外汇; 从事银行卡业务; 提供信用证服务及

	担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国银行业监督管理委员会等监管部门批准的其他业务。	担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国银行业监督管理委员会等监管部门批准的其他业务。
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》”)等有关法律法规、《基金合同》及其他有关规定制订。	本协议依据《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》和其他有关法律法规制订。
基金托管人对基金管理人的业务监督和核查 (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。		增加： ……，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等
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。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：		增加： ……，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等 9. 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的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项所规定的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资； 10. 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投资范围保持一致；
基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的。	除上述第2、9、10、11项外，因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外

<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>的。</p>
<p>基金托管人对基金管理人的业务监督和核查 (五) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定,对基金管理人投资流通受限证券进行监督。</p>	<p>1. 本基金投资的流通受限证券须为经中国证监会批准的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。本基金不投资有锁定期但锁定期不明确的证券。</p>	<p>1. 本基金投资的流通受限证券与上文流动性受限资产不同,须为经中国证监会批准的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。本基金不投资有锁定期但锁定期不明确的证券。</p>
<p>基金资产净值计算和会计核算 (二) 基金资产估值方法和特殊情形的处理”的“(2) 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:</p>	<p>④首次公开发行有明确锁定期的股票,同一股票在交易所上市后,按交易所上市的同一股票的估值方法估值;非公开发行有明确锁定期的股票,按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>	<p>④流通受限的股票,包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等(不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票),按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>
<p>基金资产净值计算和会计核算 (二) 基金资产估值方法和特殊情形的处理</p>		<p>增加: (7) 当发生大额申购或赎回情形时,在履行适当程序后,基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。</p>
<p>基金资产净值计算和会计核算 (二) 基金资产估值方法和特殊情形的处理</p>	<p>基金管理人、基金托管人按估值方法的第(7)项进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。</p>	<p>基金管理人、基金托管人按估值方法的第(8)项进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。</p>

基金资产净值计算和会计核算 (四) 暂停估值与公告基金份额净值的情形		增加： 3. 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时，经与基金托管人协商确认后，应当暂停估值；
基金信息披露 (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		增加： (3) 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时，经与基金托管人协商确认后暂停估值；

关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改

基金合同、托管协议的内容说明

景顺长城景盈双利债券型证券投资基金

一、基金合同修改内容

章节	修订前	修订后
前言 一、订立本基金合同的目的、依据和原则		增加： 、《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》”）
释义		增加： 54、《流动性风险管理规定》：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 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，

		<p>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>56、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>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>增加：</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。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。具体请参见相关公告。</p>
<p>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>增加：</p> <p>4、 ……，对于持续持有期少于 7 日的投资者，本基金将收取不低于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产</p> <p>9、 当发生大额申购或赎回情形时,在履行适当程序后,基金管理人可以采用摆动定价机制,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、自律组织的规定。</p>
<p>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>增加：</p> <p>2、 ……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,经与基金托管人协商确定后,基金管理人应当暂停接受申购申请。</p> <p>7、 基金管理人接受某笔或者某</p>

		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。
基金份额的申购与赎回 七、拒绝或暂停申购的情形	发生上述第1、2、3、5、6、7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。	发生上述暂停申购情形之一（除第4、7项外）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全部或部分拒绝的，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。
基金份额的申购与赎回 八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形		增加： 1、……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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项。
基金份额的申购与赎回 九、巨额赎回的情形及处理方式		增加： （3）如果基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额20%以上的赎回申请的情形下，基金管理人可以对该基金份额持有人超过20%以上的部分延期办理赎回申请。对于当日非延期的赎回申请，应当按单个账户非延期赎回申请量占非延期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。

基金合同当事人及权利义务 一、基金管理人	法定代表人：赵如冰	法定代表人：杨光裕
基金合同当事人及权利义务 二、基金托管人	名称：中国建设银行股份有限公司 住所：北京市西城区金融大街25号 办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼 法定代表人：王洪章 成立时间：2004年09月17日 组织形式：股份有限公司 注册资本：人民币贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整 存续期间：持续经营 基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]12号 联系人：田青 联系电话：(010)6759 5096	名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行) 住所：北京市西城区金融大街25号 法定代表人：田国立 成立时间：2004年09月17日 批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2004]143号 组织形式：股份有限公司 注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整 存续期间：持续经营 基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12号
基金的投资 二、投资范围		第二款增加： ……,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等
基金的投资 四、投资限制	(1) 本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的80%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的20%，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%；	(1) 本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的80%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的20%； (2) 现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；
基金的投资 四、投资限制		增加： (12) 本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票,不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,不超过该上市公司可流通股票的

		<p>30%；</p> <p>(13)本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 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该项所规定的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>(14)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投资范围保持一致；</p>
<p>基金的投资</p> <p>四、投资限制</p>	<p>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，从其规定。</p>	<p>除上述第(2)、(13)、(14)、(15)项外，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，从其规定。</p>
<p>基金资产估值</p> <p>三、估值方法</p>	<p>(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>	<p>(3) 流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等(不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票)，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>
<p>基金资产估值</p> <p>三、估值方法</p>		<p>增加：</p> <p>5、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。</p>
<p>基金资产估值</p> <p>六、暂停估值的情形</p>		<p>增加：</p> <p>4、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时，经与基金托管人协商确认后，应当暂停估值；</p>
<p>基金资产估值</p>	<p>1、基金管理人或基金托管人按</p>	<p>1、基金管理人或基金托管人按</p>

八、特殊情况 的处理	估值方法的第 5 项进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。	估值方法的第 6 项进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。
基金的信息披露 五、公开披露 的基金信息		增加: 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基金份额比例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文件中“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本基金的特定风险,中国证监会认定的特殊情形除外。
基金的信息披露 五、公开披露 的基金信息		增加: 27、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; 28、基金管理人采用摆动定价机制进行估值;
基金合同内容 摘要		对应基金合同正文内容进行同步修改。

二、托管协议修改内容

章节	修订前	修订后
基金托管协议 当事人 (一) 基金管理人	法定代表人: 赵如冰	法定代表人: 杨光裕
基金托管协议 当事人 (二) 基金托管人	名称: 中国建设银行股份有限公司(简称: 中国建设银行) 住所: 北京市西城区金融大街 25 号 办公地址: 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼 邮政编码: 100033 法定代表人: 王洪章 成立日期: 2004 年 09 月 17 日 基金托管业务批准文号: 中国证	名称: 中国建设银行股份有限公司(简称: 中国建设银行) 住所: 北京市西城区金融大街 25 号 办公地址: 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼 邮政编码: 100033 法定代表人: 田国立 成立日期: 2004 年 09 月 17 日 基金托管业务批准文号: 中国证

	<p>监会证监基字[1998]12号 组织形式：股份有限公司 注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整 存续期间：持续经营 经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国银行业监督管理委员会等监管部门批准的其他业务。</p>	<p>监会证监基字[1998]12号 组织形式：股份有限公司 注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整 存续期间：持续经营 经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国银行业监督管理委员会等监管部门批准的其他业务。</p>
<p>基金托管协议的依据、目的和原则 （一）订立托管协议的依据</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》”）等有关法律法规、《基金合同》及其他有关规定制订。</p>	<p>本协议依据《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》和其他有关法律法规制订。</p>
<p>基金托管人对基金管理人的业务监督和核查 （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>第二款增加： ……，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等</p>
<p>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</p>	<p>1. 本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，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>1. 本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%； 2. 现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资</p>

<p>同》的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：</p>		<p>产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；</p>
<p>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>增加：</p> <p>12. 本基金管理人管理的且由基金托管人托管的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票,不超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的且由基金托管人托管的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不超过该上市公司可流通股票的 30%；</p> <p>13. 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 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该项所规定的比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>14. 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投资范围保持一致；</p>
<p>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>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,从其规定。</p>	<p>除上述第 2、13、14、15 项外,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,从其规定。</p>
<p>基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p> <p>（五）基金托</p>	<p>1. 本基金投资的流通受限证券须为经中国证监会批准的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消</p>	<p>1. 本基金投资的流通受限证券与上文流动性受限资产不同,须为经中国证监会批准的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易</p>

<p>管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金管理人投资流通受限证券进行监督。</p>	<p>息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。本基金不投资有锁定期但锁定期不明确的证券。</p>	<p>证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。本基金不投资有锁定期但锁定期不明确的证券。</p>
<p>基金资产净值计算和会计核算 （二）基金资产估值方法和特殊情形的处理”的“2. 估值方法</p>	<p>（3）首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>	<p>（3）流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等（不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票），按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>
<p>基金资产净值计算和会计核算 （二）基金资产估值方法和特殊情形的处理”的“2. 估值方法</p>		<p>增加： 5、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。</p>
<p>基金资产净值计算和会计核算 （二）基金资产估值方法和特殊情形的处理</p>	<p>（1）基金管理人、基金托管人按估值方法的第5项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。</p>	<p>（1）基金管理人、基金托管人按估值方法的第6项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。</p>
<p>基金资产净值计算和会计核算 （四）暂停估值与公告基金份额净值的情形</p>		<p>增加： 4. 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时，经与基金托管人协商确认后，应当暂停估值；</p>
<p>基金信息披露 （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</p>		<p>增加： （3）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时，经与基金托管人协商确认后暂停估值；</p>

关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改

基金合同、托管协议的内容说明

景顺长城沪港深领先科技股票型证券投资基金

一、基金合同修改内容

章节	修订前	修订后
<p>前言</p> <p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</p>		<p>增加： 、《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》”）</p>
<p>释义</p>		<p>增加：</p> <p>53、《流动性风险管理规定》：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</p> <p>54、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>55、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>基金份额的申</p>		<p>增加：</p> <p>5、当接受申购申请对存量基金</p>

<p>购与赎回</p> <p>五、 申购和赎回的数量限制</p>		<p>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。具体请参见相关公告。</p>
<p>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>增加:</p> <p>3、……,对于持续持有期少于7日的投资者,本基金将收取不低于1.5%的赎回费并全额计入基金财产</p> <p>8、当发生大额申购或赎回情形时,在履行适当程序后,基金管理人可以采用摆动定价机制,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、自律组织的规定。</p>
<p>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>增加:</p> <p>2、……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,经与基金托管人协商确定后,基金管理人应当暂停接受申购申请。</p> <p>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%,或者变相规避 50%集中度的情形时。</p>
<p>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>发生上述第 1、2、3、5、6、7 项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>发生上述情形之一(除第 4、7 项外)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全部或部分拒绝的,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>基金份额的申购与赎回</p> <p>八、 暂停赎回</p>		<p>增加:</p> <p>2、……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</p>

或延缓支付赎回款项的情形		导致公允价值存在重大不确定性,经与基金托管人协商确定后,基金管理人应当暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项。
基金份额的申购与赎回 九、巨额赎回的情形及处理方式		增加： (3) 如果基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额 20%以上的赎回申请的情形下，基金管理人可以对该基金份额持有人超过 20%以上的部分延期办理赎回申请。对于当日非延期的赎回申请，应当按单个账户非延期赎回申请量占非延期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。
基金合同当事人及权利义务 二、基金托管人	名称：中国建设银行股份有限公司 住所：北京市西城区金融大街 25 号 法定代表人：王洪章 成立时间：2004 年 09 月 17 日 批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复【2004】143 号 组织形式：股份有限公司 注册资本：人民币贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整 存续期间：持续经营 基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字【1998】12 号	名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行) 住所：北京市西城区金融大街 25 号 法定代表人：田国立 成立时间：2004 年 09 月 17 日 批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2004]143 号 组织形式：股份有限公司 注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整 存续期间：持续经营 基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号
基金的投资 二、投资范围		增加： ……，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等

<p>基金的投资</p> <p>四、投资限制</p>		<p>增加：</p> <p>(2) ……，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等</p> <p>(12)本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不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，不超过该上市公司可流通股票的 30%；</p> <p>(13)本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 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项所规定的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>(14)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投资范围保持一致；</p>
<p>基金的投资</p> <p>四、投资限制</p>	<p>因证券、期货市场波动、上市公司合并、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。</p>	<p>除上述第(2)、(13)、(14)、(15)项外，因证券、期货市场波动、上市公司合并、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。</p>
<p>基金资产估值</p> <p>四、估值方法</p>	<p>(4) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>	<p>(4) 流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等(不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票)，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>
<p>基金资产估值</p>		<p>增加：</p>

四、估值方法		7、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。
基金资产估值 七、暂停估值的情形		增加： 3、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时，经与基金托管人协商确认后，应当暂停估值；
基金资产估值 九、特殊情况的处理	1、基金管理人或基金托管人按本基金合同规定的估值方法的第7项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。	1、基金管理人或基金托管人按本基金合同规定的估值方法的第8项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。
基金的信息披露 五、公开披露的基金信息		增加： 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基金份额比例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文件中“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本基金的特定风险，中国证监会认定的特殊情形除外。
基金的信息披露 五、公开披露的基金信息		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； 27、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；
基金合同内容摘要		对应基金合同正文内容进行同步修改。

二、托管协议修改内容

章节	修订前	修订后
基金托管协议	名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)	名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

<p>当事人</p> <p>(二) 基金托管人</p>	<p>住所：北京市西城区金融大街25号</p> <p>办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼</p> <p>邮政编码：100033</p> <p>法定代表人：王洪章</p> <p>成立日期：2004年09月17日</p> <p>基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]12号</p> <p>组织形式：股份有限公司</p> <p>注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整</p> <p>存续期间：持续经营</p> <p>经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国银行业监督管理委员会等监管部门批准的其他业务。</p>	<p>住所：北京市西城区金融大街25号</p> <p>办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼</p> <p>邮政编码：100033</p> <p>法定代表人：田国立</p> <p>成立日期：2004年09月17日</p> <p>基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]12号</p> <p>组织形式：股份有限公司</p> <p>注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整</p> <p>存续期间：持续经营</p> <p>经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国银行业监督管理委员会等监管部门批准的其他业务。</p>
<p>基金托管协议的依据、目的和原则</p> <p>(一) 订立托管协议的依据</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》”)等有关法律法规、《基金合同》及其他有关规定制订。</p>	<p>本协议依据《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》和其他有关法律法规制订。</p>
<p>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>增加：</p> <p>……，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等</p>

<p>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>增加:</p> <p>(2) ……，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等;</p> <p>(12)本基金管理人管理的且由基金托管人托管的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票,不超过该上市公司可流通股票的 15%; 本基金管理人管理的且由基金托管人托管的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不超过该上市公司可流通股票的 30%;</p> <p>(13)本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 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项所规定的比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;</p> <p>(14)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投资范围保持一致;</p>
<p>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>因证券、期货市场波动、上市公司合并、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。</p>	<p>除上述第(2)、(13)、(14)、(15)项外,因证券、期货市场波动、上市公司合并、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。</p>
<p>基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p> <p>(五) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合</p>	<p>1. 本基金投资的流通受限证券须为经中国证监会批准的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。本基金不投资有</p>	<p>1. 本基金投资的流通受限证券与上文流动性受限资产不同,须为经中国证监会批准的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流</p>

同》的约定，对基金管理人投资流通受限证券进行监督。	锁定期但锁定期不明确的证券。	通受限证券。本基金不投资有锁定期但锁定期不明确的证券。
基金资产净值计算和会计核算 (二) 基金资产估值方法和特殊情形的处理	(4) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。	(4) 流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等(不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票)，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。
基金资产净值计算和会计核算 (二) 基金资产估值方法和特殊情形的处理”的“3. 估值方法		增加： 7、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。
基金资产净值计算和会计核算 (二) 基金资产估值方法和特殊情形的处理	(1) 基金管理人、基金托管人按估值方法的第7项进行估值时，所造成的误差不得作为基金资产估值错误处理。	(1) 基金管理人、基金托管人按估值方法的第8项进行估值时，所造成的误差不得作为基金资产估值错误处理。
基金资产净值计算和会计核算 (四) 暂停估值与公告基金份额净值的情形		增加： 3、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时，经与基金托管人协商确认后，应当暂停估值；
基金信息披露 (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		增加： (3) 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时，经与基金托管人协商确认后暂停估值；

关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改 基金合同、托管协议的内容说明

景顺长城策略精选灵活配置混合型证券投资基金

一、基金合同修订内容

章节	修订前	修订后
第一部分 前言 一、订立本基金的 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》”)、《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。	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》”)、《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“《流动性规定》”)和其他有关法律、法规。
第二部分 释义		增加： 52、《流动性规定》：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 53、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

		<p>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>54、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>第六部分 基金份额的申购与赎回 五、申购和赎回的数量限制</p>		<p>增加：</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。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。具体请参见相关公告。</p>
<p>第六部分 基金份额的申购与赎回 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。不低于赎回费总额的 25%应归基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。</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。本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。对于持续持有期不少于 7 日的投资者收取的赎回费，不低于赎回费总额的 25%应归基金财产，未归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>第六部分 基金份额的 申购与 赎回 六、申购 和赎回的 价格、费 用及其用 途</p>		<p>增加： 8、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，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。</p>
<p>第六部分 基金份额的 申购与 赎回 七、拒绝 或暂停申 购的情形</p>	<p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。</p>	<p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。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>第六部分 基金份额的 申购与 赎回 七、拒绝 或暂停申 购的情形</p>		<p>增加： 6、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。</p>
<p>第六部分 基金份额的 申购与 赎回 七、拒绝 或暂停申 购的情形</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申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体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>发生上述第 1、2、3、5、7 项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体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，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</p>	<p>2、发生基金合同规定的暂停基</p>	<p>2、发生基金合同规定的暂停基金资</p>

<p>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>金资产估值情况时，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>产估值情况时，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。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>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</p>		<p>增加：</p> <p>（3）如果基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额 20%以上的赎回申请的情形下，基金管理人可以对该基金份额持有人超过 20%以上的部分延期办理赎回申请。若进行该种超比例延期赎回，对于当日非延期的赎回申请，应当按单个账户非延期赎回申请量占非延期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。</p>

		回处理。
第七部分 基金合同 当事人及 权利义务 一、基金 管理人	法定代表人：赵如冰	法定代表人：杨光裕
第七部分 基金合同 当事人及 权利义务 二、基金 托管人	<p>(一) 基金托管人简况</p> <p>名称：中国银行股份有限公司</p> <p>住所：北京市西城区复兴门内大街1号</p> <p>法定代表人：</p> <p>成立时间：1983年10月31日</p> <p>基金托管资格批文及文号：国务院批转中国人民银行《关于改革中国银行体制的请示报告》（国发[1979]72号）</p> <p>组织形式：股份有限公司</p> <p>注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整</p> <p>存续期间：持续经营</p>	<p>(一) 基金托管人简况</p> <p>名称：中国银行股份有限公司</p> <p>住所：北京市西城区复兴门内大街1号</p> <p>法定代表人：陈四清</p> <p>成立时间：1983年10月31日</p> <p>批准设立机关和批准设立文号：国务院批转中国人民银行《关于改革中国银行体制的请示报告》（国发[1979]72号）</p> <p>组织形式：股份有限公司</p> <p>注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整</p> <p>存续期间：持续经营</p> <p>基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字【1998】24号</p>
第十二部分 基金 的投资 二、投资 范围	本基金将基金资产的0%-95%投资于股票等权益类资产（其中，权证投资比例不超过基金资产净值的3%），将不低于5%的基金资产投资于债券等固定收益类品种（其中，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，本基金保留	本基金将基金资产的0%-95%投资于股票等权益类资产（其中，权证投资比例不超过基金资产净值的3%），将不低于5%的基金资产投资于债券等固定收益类品种（其中，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，本基金保留的现金或到期日在一年

	的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%)。	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)。
第十二部分 基金的投资 四、投资限制	(2) 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；若本基金投资股指期货的，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；	(2) 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；若本基金投资股指期货的，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；
第十二部分 基金的投资 四、投资限制		增加： (12) 本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）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%； (13) 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述所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资； (14) 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本基金合同约定的投资范围保持一致；
第十二部分 基金的投资 四、投资限制	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。法律法规另有规定，从其规定。	除上述（2）、（13）、（14）、（15）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。法律法规另有规定，从其规定。
第十四部分 基金资产的估值 三、估值方法		增加： 5、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。
第十四部分 基金资产的估值 六、暂停估值的情形		增加： 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后，应当暂停估值；
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		增加： 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基金份额比例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

报告、基金半年度报告和基金季度报告		管理人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。
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		增加： 26、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的重大事项时； 27、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；
第二十四部分 基金合同内容摘要		对应基金合同正文内容进行同步修改。

二、托管协议修订内容

章节	修订前	修订后
----	-----	-----

<p>一、 托管协议 当事人</p>	<p>法定代表人：赵如冰</p>	<p>法定代表人：杨光裕</p>
<p>一、 托管协议 当事人</p>	<p>(二) 基金托管人 (或简称“托管人”)</p> <p>名称：中国银行股份有限公司</p> <p>住所：北京市西城区复兴门内大街1号</p> <p>法定代表人：</p> <p>成立时间：1983年10月31日</p> <p>基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号</p> <p>组织形式：股份有限公司</p> <p>注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整</p> <p>经营范围：吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险</p>	<p>(二) 基金托管人 (或简称“托管人”)</p> <p>名称：中国银行股份有限公司</p> <p>住所：北京市西城区复兴门内大街1号</p> <p>法定代表人：陈四清</p> <p>成立时间：1983年10月31日</p> <p>基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号</p> <p>组织形式：股份有限公司</p> <p>注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整</p> <p>经营范围：吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；外汇存款；</p>

	<p>箱服务； 外汇存款； 外汇贷款； 外汇汇款； 外汇兑换； 国际结算； 同业外汇拆借； 外汇票据的承兑和贴现； 外汇借款； 外汇担保； 结汇、 售汇； 发行和代理发行股票以外的外币有价证券； 买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券； 自营外汇买卖； 代客外汇买卖； 外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款； 资信调查、 咨询、 见证业务； 组织或参加银团贷款； 国际贵金属买卖； 海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务； 在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币； 经中国人民银行批准的其他业务。</p> <p>存续期间： 持续经营</p>	<p>外汇贷款； 外汇汇款； 外汇兑换； 国际结算； 同业外汇拆借； 外汇票据的承兑和贴现； 外汇借款； 外汇担保； 结汇、 售汇； 发行和代理发行股票以外的外币有价证券； 买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券； 自营外汇买卖； 代客外汇买卖； 外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款； 资信调查、 咨询、 见证业务； 组织或参加银团贷款； 国际贵金属买卖； 海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务； 在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币； 经中国人民银行批准的其他业务。</p> <p>存续期间： 持续经营</p>
--	---	--

<p>二、 托管协议的 依据、 目的、原 则和解释</p>	<p>(一) 依据</p> <p>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》”)、《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》”)及其他有关法律法规与《景顺长城策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)订立。</p>	<p>(一) 依据</p> <p>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》”)、《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》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其他有关法律法规与《景顺长城策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)订立。</p>
<p>三、 基金托管 人对基金 管理人的 业务监督 和核查</p>	<p>基金将基金资产的 0%-95% 投资于股票等权益类资产(其中,权证投资比例不超过基金资产净值的 3%),将不低于 5% 的基金资产投资于债券等固定收益类品种(其中,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,基金保留的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%)。</p>	<p>基金将基金资产的 0%-95% 投资于股票等权益类资产(其中,权证投资比例不超过基金资产净值的 3%),将不低于 5% 的基金资产投资于债券等固定收益类品种(其中,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,基金保留的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%,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>(2) 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;若基金投资股指期货的,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>(2) 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;若基金投资股指期货的,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>三、 基金托管 人对基金</p>		<p>增加:</p> <p>(12) 本基金管理人管理且由本托</p>

<p>管理人的业务监督和核查</p>		<p>管人托管的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的15%；本基金管理人管理的且有本托管人托管的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的30%；</p> <p>（13）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述所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>（14）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。本基金管理人承诺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与基金合同约定的投资范围保持一致，并承担由于不一致所导致的风险或损失；</p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督</p>	<p>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。法律法规</p>	<p>除上述（2）、（13）、（14）、（15）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</p>

和核查	另有规定，从其规定。	行调整。法律法规另有规定，从其规定。
-----	------------	--------------------

关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改 基金合同、托管协议的内容说明

景顺长城优势企业混合型证券投资基金

一 基金合同修订内容

章节	修订前	修订后
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》”）、《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。	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》”）、《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“《流动性规定》”）和其他有关法律法规。
第二部分 释义		增加： 52、《流动性规定》：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

		<p>53、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>54、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>
第六部分 基金份额的申购与赎回 五、申购和赎回的数量限制		<p>增加：</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。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。具体请参见相关公告。</p>
第六部分 基金份额的申购与赎回 六、申购和赎回的	<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。对持续持有期少于7日的投资人收取不低于</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。对持续持有期少于7日的投资人收取不低于1.5%的赎回费，</p>

<p>价格、费用及其用途</p>	<p>1.5%的赎回费，对持续持有期少于30日的投资人收取不低于0.75%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产；对持续持有期少于3个月的投资人收取不低于0.5%的赎回费，并将不低于赎回费总额的75%计入基金财产；对持续持有期长于3个月但少于6个月的投资人收取不低于0.5%的赎回费，并将不低于赎回费总额的50%计入基金财产；对持续持有期长于6个月的投资人，应当将不低于赎回费总额的25%计入基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。</p>	<p>并将上述赎回费全额计入基金财产；对持续持有期少于30日的投资人收取不低于0.75%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产；对持续持有期少于3个月的投资人收取不低于0.5%的赎回费，并将不低于赎回费总额的75%计入基金财产；对持续持有期长于3个月但少于6个月的投资人收取不低于0.5%的赎回费，并将不低于赎回费总额的50%计入基金财产；对持续持有期长于6个月的投资人，应当将不低于赎回费总额的25%计入基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。</p>
<p>第六部分 基金份额的申购与赎回 六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p>		<p>增加：</p> <p>8、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，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。</p>
<p>第六部分 基金份额的申购与赎回 七、拒绝或暂停申购的情形</p>	<p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。</p>	<p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。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>第六部分</p>		<p>增加：</p>

<p>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>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%，或者变相规避 50%集中度的情形时。</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>发生上述第 1、2、3、5、6、7 项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体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>发生上述第 1、2、3、5、6、8 项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体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，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>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，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>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，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。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赎回申请或延缓支付赎回款项的措施。</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</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p>		<p>增加：</p> <p>（3）如果基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额 20%以上的赎回申请的情形下，基金管理人可以对该基金份额持有人超过 20%以上的部分延期办理赎回申请。若进行该种超比例延期赎回，对于当日非延期的赎回申请，应当按单个账户非延期</p>

		<p>赎回申请量占非延期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。</p>
第七部分 基金合同 当事人及 权利义务 一、基金 管理人	法定代表人：赵如冰	法定代表人：杨光裕
第七部分 基金合同 当事人及 权利义务 二、基金 托管人	<p>(一) 基金托管人简况</p> <p>名称：中国银行股份有限公司 住所：北京市西城区复兴门内大街1号</p> <p>法定代表人：田国立</p> <p>成立时间：1983年10月31日</p> <p>基金托管资格批文及文号：国务院批转中国人民银行《关于改革中国银行体制的请示报告》（国发[1979]72号）</p> <p>组织形式：股份有限公司</p>	<p>(一) 基金托管人简况</p> <p>名称：中国银行股份有限公司 住所：北京市西城区复兴门内大街1号</p> <p>法定代表人：陈四清</p> <p>成立时间：1983年10月31日</p> <p>批准设立机关和批准设立文号：国务院批转中国人民银行《关于改革中国银行体制的请示报告》（国发[1979]72号）</p> <p>组织形式：股份有限公司</p>

	<p>注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整</p> <p>存续期间：持续经营</p>	<p>注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整</p> <p>存续期间：持续经营</p> <p>基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字【1998】24号</p>
第十二部分 基金的投资 二、投资范围	<p>本基金将基金资产的60%-95%投资于股票资产，其中，投资于具备竞争优势的公司股票的资产不低于非现金基金资产的80%，权证投资比例不超过基金资产净值的3%，将基金资产的5%-40%投资于债券等固定收益类品种，其中，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，本基金保留的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%。</p>	<p>本基金将基金资产的60%-95%投资于股票资产，其中，投资于具备竞争优势的公司股票的资产不低于非现金基金资产的80%，权证投资比例不超过基金资产净值的3%，将基金资产的5%-40%投资于债券等固定收益类品种，其中，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，本基金保留的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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</p>
第十二部分 基金的投资 四、投资限制	<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>(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>
第十二部分 基金的投资 四、投资限制		<p>增加：</p> <p>(12) 本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市</p>

		<p>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>（13）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述所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>（14）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本基金合同约定的投资范围保持一致；</p>
第十二部分 基金的投资 四、投资限制	<p>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。法律法规另有规定，从其规定。</p>	<p>除上述（2）、（13）、（14）、（15）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。法律法规另有规定，从其规定。</p>
第十四部分 基金资产的估值 三、估值方法		<p>增加：</p> <p>7、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。</p>
第十四部分 基金		<p>增加：</p>

<p>资产的估值 六、暂停估值的情形</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一致后，应当暂停估值；</p>
<p>第十四部分 基金资产的估值</p>	<p>八、特殊情况的处理 1、基金管理人或基金托管人按本基金合同规定的估值方法的第 7 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。</p>	<p>八、特殊情况的处理 1、基金管理人或基金托管人按本基金合同规定的估值方法的第 8 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。</p>
<p>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</p>		<p>增加： 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基金份额比例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。</p>
<p>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</p>		<p>增加： 26、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的重大事项的； 27、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；</p>

第二十四 部分 基 金合同内 容摘要		对应基金合同正文内容进行同步修 改。
-----------------------------	--	-----------------------

二 托管协议修订内容

章节	修订前	修订后
----	-----	-----

<p>一、 托管协议 当事人</p>	<p>(一) 基金管理人 (或简称“管理人”)</p> <p>法定代表人: 赵如冰</p>	<p>(一) 基金管理人 (或简称“管理人”)</p> <p>法定代表人: 杨光裕</p>
<p>一、 托管协议 当事人</p>	<p>(二) 基金托管人 (或简称“托管人”)</p> <p>名称: 中国银行股份有限公司</p> <p>住所: 北京市西城区复兴门内大街 1 号</p> <p>法定代表人: 田国立</p> <p>成立时间: 1983 年 10 月 31 日</p> <p>基金托管业务批准文号: 中国证监会证监基字【1998】24 号</p> <p>组织形式: 股份有限公司</p> <p>注册资本: 人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整</p> <p>经营范围: 吸收人民币存款; 发放短期、中期和长期贷款; 办理结算; 办理票据贴现; 发行金融债券; 代理发行、代理兑付、承销政府债券; 买卖政府债券; 从事同业拆借; 提供信用证服务及担保; 代理收付款项及代理保</p>	<p>(二) 基金托管人 (或简称“托管人”)</p> <p>名称: 中国银行股份有限公司</p> <p>住所: 北京市西城区复兴门内大街 1 号</p> <p>法定代表人: 陈四清</p> <p>成立时间: 1983 年 10 月 31 日</p> <p>基金托管业务批准文号: 中国证监会证监基字【1998】24 号</p> <p>组织形式: 股份有限公司</p> <p>注册资本: 人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整</p> <p>经营范围: 吸收人民币存款; 发放短期、中期和长期贷款; 办理结算; 办理票据贴现; 发行金融债券; 代理发行、代理兑付、承销政府债券; 买卖政府债券; 从事同业拆借; 提供信用证服务及担保; 代理收付款项及代理保险业务; 提供保险</p>

	<p>险业务；提供保险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；经中国人民银行批准的其他业务。</p> <p>存续期间：持续经营</p>	<p>箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；经中国人民银行批准的其他业务。</p> <p>存续期间：持续经营</p>
--	--	--

<p>二、 托管协议的 依据、 目的、原 则和解释</p>	<p>(一) 依据</p> <p>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》”)、《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》”)及其他有关法律法规与《景顺长城优势企业混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)订立。</p>	<p>(一) 依据</p> <p>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》”)、《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》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其他有关法律法规与《景顺长城优势企业混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)订立。</p>
<p>三、 基金托管 人对基金 管理人的 业务监督 和核查</p>	<p>基金将基金资产的 60%-95% 投资于股票资产, 其中, 投资于具备竞争优势的公司股票的资产不低于非现金基金资产的 80%, 权证投资比例不超过基金资产净值的 3%; 将基金资产的 5%-40% 投资于债券等固定收益类品种, 其中, 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, 本基金保留的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%。</p>	<p>基金将基金资产的 60%-95% 投资于股票资产, 其中, 投资于具备竞争优势的公司股票的资产不低于非现金基金资产的 80%, 权证投资比例不超过基金资产净值的 3%; 将基金资产的 5%-40% 投资于债券等固定收益类品种, 其中, 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, 本基金保留的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%, 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>2、对基金投融资比例进行监督;</p> <p>(2) 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; 若基金投资股指期货的, 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>2、对基金投融资比例进行监督;</p> <p>(2) 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; 若基金投资股指期货的, 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>三、 基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>		<p>增加：</p> <p>（12）本基金管理人管理且由本托管人托管的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）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且由本托管人托管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>（13）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述所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>（14）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。本基金管理人承诺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与基金合同约定的投资范围保持一致，并承担由于不一致所导致的风险或损失；</p>
<p>三、 基金托管人对基金</p>	<p>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</p>	<p>除上述（2）、（13）、（14）、（15）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</p>

管理人的业务监督和核查	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。法律法规另有规定，从其规定。	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。法律法规另有规定，从其规定。
--------------------	---	--

关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改

基金合同、托管协议的内容说明

景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

一 基金合同修改内容

章节	修订前	修订后
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。	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“《流动性规定》”）和其他有关法律法规。
第二部分 释义		增加： 55、《流动性规定》：指中国证监会2017年8月31日颁布、同年10月1日

		<p>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>56、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>57、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>第六部分 基金份额的申购与赎回 五、申购和赎回的数量限制</p>		<p>增加：</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。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。具体请参见相关公告。</p>

<p>第六部分 基金份额的 申购与赎回 六、申购 和赎回的 价格、费 用及其用 途</p>	<p>3、赎回金额的计算及处理方式： 本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后2位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p>	<p>3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。本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。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后2位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p>
<p>第六部分 基金份额的 申购与赎回 六、申购 和赎回的 价格、费 用及其用 途</p>		<p>增加： 8、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，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。</p>
<p>第六部分 基金份额的 申购与赎回 七、拒绝 或暂停申 购的情形</p>	<p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。</p>	<p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。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>第六部分 基金份额的 申购与</p>	<p>发生上述第1、2、3、5、6、7、8、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</p>	<p>发生上述第1、2、3、5、6、7、8、9项暂停申购情形之一且基金管理人决</p>

<p>赎回七、拒绝或暂停申购的情形</p>	<p>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>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全部或部分拒绝的，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八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p>	<p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，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>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，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。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赎回申请或延缓支付赎回款项的措施。</p>
<p>第六部分基金份额的申购与赎回九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式</p>		<p>增加：</p> <p>（3）如果基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额 20%以上的赎回申请的情形下，基金管理人可以对该基金份额持有人超过 20%以上的部分延期办理赎回申请。若进行该种超比例延期赎回，对于当日非延期的赎回申请，应当按单个账户非延期赎回申请量占非延期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</p>

		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。
第七部分 基金合同 当事人及 权利义务 一、基金 管理人	法定代表人：赵如冰	法定代表人：杨光裕
第七部分 基金合同 当事人及 权利义务 二、基金 托管人	<p>(一) 基金托管人简况</p> <p>名称：中国银行股份有限公司 住所：北京市复兴门内大街 1 号 法定代表人：田国立 成立时间：1983 年 10 月 31 日 批准设立机关和批准设立文号：国务院批转中国人民银行《关于改革中国银行体制的请示报告》（国发[1979]72 号）。</p> <p>组织形式：股份有限公司 注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整</p> <p>存续期间：持续经营 基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字【1998】24 号</p>	<p>(一) 基金托管人简况</p> <p>名称：中国银行股份有限公司 住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号 法定代表人：陈四清 成立时间：1983 年 10 月 31 日 批准设立机关和批准设立文号：国务院批转中国人民银行《关于改革中国银行体制的请示报告》（国发[1979]72 号）</p> <p>组织形式：股份有限公司 注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整</p> <p>存续期间：持续经营 基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字【1998】24 号</p>

第十二部分 基金的投资 二、投资范围	<p>基金的投资组合比例为：本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%，同时不低于非现金基金资产的 80%，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，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>基金的投资组合比例为：本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%，同时不低于非现金基金资产的 80%，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，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>
第十二部分 基金的投资 三、投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金主要通过投资于目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股来进行被动式指数化投资，达到跟踪标的指数的目标。因此，本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%，同时不低于非现金基金资产的 80%，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，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>1、资产配置策略</p> <p>本基金主要通过投资于目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股来进行被动式指数化投资，达到跟踪标的指数的目标。因此，本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%，同时不低于非现金基金资产的 80%，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，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>
第十二部分 基金的投资 四、投资限制	<p>(1) 本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%，同时不低于非现金基金资产的 80%，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，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>(1) 本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%，同时不低于非现金基金资产的 80%；</p> <p>(2) 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，保持不</p>

		<p>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>
第十二部分 基金的投资 四、投资限制		<p>增加：</p> <p>（10）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述所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>（11）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本基金合同约定的投资范围保持一致；</p>
第十二部分 基金的投资	<p>因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制、目标 ETF 暂停申购、赎回或二级市场交易停牌、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。法律法规另有规</p>	<p>除上述（2）、（10）、（11）、（12）项外，因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制、目标 ETF 暂停申购、赎回或二级市场交易停牌、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。法律法规</p>

	定的，从其规定。	另有规定的，从其规定。
第十四部分 基金资产的估值 三、估值方法		增加： 8、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。
第十四部分 基金资产的估值 六、暂停估值的情形		增加： 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后，应当暂停估值；
第十四部分 基金资产的估值	八、特殊情况的处理 1、基金管理人或基金托管人按本基金合同规定的估值方法的第 8 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。	八、特殊情况的处理 1、基金管理人或基金托管人按本基金合同规定的估值方法的第 9 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。
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		增加： 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基金份额比例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。
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		增加： 26、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的重大事项； 27、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；
第二十四部分 基金合同内容摘要		根据基金合同正文修改

二 托管协议修改内容

章节	修订前	修订后
----	-----	-----

<p>一、 托管协议 当事人</p>	<p>(一)基金管理人(或简称“管 理人”) 法定代表人: 赵如冰</p>	<p>(一)基金管理人(或简称“管理 人”) 法定代表人: 杨光裕</p>
<p>一、 托管协议 当事人</p>	<p>(二)基金托管人(或简称“托 管人”) 名称: 中国银行股份有限公司 住所: 北京市西城区复 兴门内大街1号 法定代表人: 田国立 成立时间: 1983年10月31 日 基金托管业务批准文号: 中国证 监会证监基字【1998】24号 组织形式: 股份有限公司 注册资本: 人民币贰仟柒佰 玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹 佰玖拾伍元整 经营范围: 吸收人民币存款; 发放短期、中期和 长期贷款; 办理结 算; 办理票据贴 现; 发行金融债 券; 代理发行、代 理兑付、承销政府 债券; 买卖政府债 券; 从事同业拆 借; 提供信用证服</p>	<p>(二)基金托管人(或简称“托管 人”) 名称: 中国银行股份有限公 司 住所: 北京市西城区复兴门 内大街1号 法定代表人: 陈四清 成立时间: 1983年10月31日 基金托管业务批准文号: 中国证 监会证监基字【1998】24号 组织形式: 股份有限公司 注册资本: 人民币贰仟柒佰玖拾 壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍 元整 经营范围: 吸收人民币存款; 发 放短期、中期和长期 贷款; 办理结算; 办 理票据贴现; 发行金 融债券; 代理发行、 代理兑付、承销政府 债券; 买卖政府债券; 从事同业拆借; 提供 信用证服务及担保; 代理收付款项及代理 保险业务; 提供保险</p>

	<p>务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务； 外汇存款； 外汇贷款； 外汇汇款； 外汇兑换； 国际结算； 同业外汇拆借； 外汇票据的承兑和贴现； 外汇借款； 外汇担保； 结汇、售汇； 发行和代理发行股票以外的外币有价证券； 买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券； 自营外汇买卖； 代客外汇买卖； 外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款； 资信调查、咨询、见证业务； 组织或参加银团贷款； 国际贵金属买卖； 海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务； 在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币； 经中国人民银行批准的其</p>	<p>箱服务； 外汇存款； 外汇贷款； 外汇汇款； 外汇兑换； 国际结算； 同业外汇拆借； 外汇票据的承兑和贴现； 外汇借款； 外汇担保； 结汇、售汇； 发行和代理发行股票以外的外币有价证券； 买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券； 自营外汇买卖； 代客外汇买卖； 外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款； 资信调查、咨询、见证业务； 组织或参加银团贷款； 国际贵金属买卖； 海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务； 在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币； 经中国人民银行批准的其他业务。</p> <p>存续期间： 持续经营</p>
--	---	--

	他业务。	
	存续期间： 持续经营	

<p>二、 托管协议的 依据、 目的、原 则和解释</p>	<p>(一) 依据</p> <p>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》”)及其他有关法律、法规与《景顺长城中证 TMT 150 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)订立。</p>	<p>(一) 依据</p> <p>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》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其他有关法律、法规与《景顺长城中证 TMT 150 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)订立。</p>
<p>三、 基金托管 人对基金 管理人的 业务监督 和核查</p>	<p>(1) 本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%，同时不低于非现金基金资产的 80%，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，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>(1) 本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%，同时不低于非现金基金资产的 80%；</p> <p>(2) 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，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>三、 基金托管 人对基金 管理人的 业务监督 和核查</p>		<p>增加：</p> <p>(10) 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述所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>(11) 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</p>

		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。本基金管理人承诺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与基金合同约定的投资范围保持一致，并承担由于不一致所导致的风险或损失；
三、 基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制、目标 ETF 暂停申购、赎回或二级市场交易停牌、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。法律法规另有规定的，从其规定。	除上述（2）、（10）、（11）、（12）项外，因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制、目标 ETF 暂停申购、赎回或二级市场交易停牌、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。法律法规另有规定的，从其规定。

关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改 基金合同、托管协议的内容说明

景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

一 基金合同修改内容

章节	修订前	修订后
第一部分 前言 一、订立本基金合	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	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

<p>同 的 目 的、 依 据 和 原 则</p>	<p>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>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“《流动性规定》”)和其他有关法律法规。</p>
<p>第 二 部 分 释 义</p>		<p>增加：</p> <p>55、《流动性规定》：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</p> <p>56、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>57、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</p>

		法权益不受损害并得到公平对待
第六部分 基金份额的 申购与赎回 五、申购 和赎回的 数量限制		增加： 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。具体请参见相关公告。
第六部分 基金份额的 申购与赎回 六、申购 和赎回的 价格、费用 及其用途	3、赎回金额的计算及处理方式： 本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后2位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。	3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。本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。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后2位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。
第六部分 基金份额的 申购与赎回 六、申购 和赎回的 价格、费用 及其用途		增加： 8、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，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。

<p>第六部分 基金份额的 申购与 赎回 七、拒绝 或暂停申 购的情形</p>	<p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。</p>	<p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。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>第六部分 基金份额的 申购与 赎回 七、拒绝 或暂停申 购的情形</p>	<p>发生上述第 1、2、3、5、6、7、8、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>发生上述第 1、2、3、5、6、7、8、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全部或部分拒绝的，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 八、暂停 赎回或延 缓支付赎 回款项的 情形</p>	<p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，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>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，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。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赎回申请或延缓支付赎回款项的措施。</p>
<p>第六部分 基金份额的 申购与 赎回 九、巨额 赎回的情 形及处理</p>		<p>增加： (3) 如果基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额 20%以上的赎回申请的情形下，基</p>

<p>方式 2、巨额赎回的处理方式</p>		<p>金管理人可以对该基金份额持有人超过20%以上的部分延期办理赎回申请。对于当日非延期的赎回申请，应当按单个账户非延期赎回申请量占非延期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。</p>
<p>第七部分 基金合同当事人及权利义务 一、基金管理人</p>	<p>法定代表人：赵如冰</p>	<p>法定代表人：杨光裕</p>
<p>第七部分 基金合同当事人及权利义务 二、基金托管人</p>	<p>(一) 基金托管人简况 名称：中国银行股份有限公司 住所：北京市复兴门内大街1号 法定代表人：田国立 成立时间：1983年10月31日 批准设立机关和批准设立文号： 国务院批转中国人民银行《关于改革中国银行体制的请示报告》（国发</p>	<p>(一) 基金托管人简况 名称：中国银行股份有限公司 住所：北京市西城区复兴门内大街1号 法定代表人：陈四清 成立时间：1983年10月31日 批准设立机关和批准设立文号：国务院批转中国人民银行《关于改革</p>

	<p>[1979]72号)。</p> <p>组织形式：股份有限公司</p> <p>注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整</p> <p>存续期间：持续经营</p> <p>基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字【1998】24号</p>	<p>中国银行体制的请示报告》(国发[1979]72号)</p> <p>组织形式：股份有限公司</p> <p>注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整</p> <p>存续期间：持续经营</p> <p>基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字【1998】24号</p>
第十二部分 基金的投资 二、投资范围	<p>基金的投资组合比例为：本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%，同时不低于非现金基金资产的80%，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，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>基金的投资组合比例为：本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%，同时不低于非现金基金资产的80%，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，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>
第十二部分 基金的投资 三、投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金主要通过投资于目标ETF、标的指数成份股和备选成份股来进行被动式指数化投资，达到跟踪标的指数的目标。因此，本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%，同时不低于非现金基金资产的80%，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，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</p>	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金主要通过投资于目标ETF、标的指数成份股和备选成份股来进行被动式指数化投资，达到跟踪标的指数的目标。因此，本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%，同时不低于非现金基金资产的80%，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，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</p>

	券。	金、应收申购款等。
第十二部分 基金的投资 四、投资限制	<p>(1) 本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%，同时不低于非现金基金资产的 80%，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，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>(1) 本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%，同时不低于非现金基金资产的 80%；</p> <p>(2) 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，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>
第十二部分 基金的投资 四、投资限制		<p>增加：</p> <p>(10) 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述所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>(11) 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本基金合同约定的投资范围保持一致；</p>
第十二部分 基金的投资 四、投资限制	<p>因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制、目标 ETF 暂停申购、赎回或二级市场交易停牌、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致</p>	<p>除上述 (2)、(10)、(11)、(12) 项外，因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制、目标 ETF 暂停申购、赎回或二级市场交易停牌、股权分置改革中支付对价等基金</p>

	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。	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。
第十四部分 基金资产的估值 三、估值方法		增加： 8、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。
第十四部分 基金资产的估值 六、暂停估值的情形		增加： 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后，应当暂停估值；
第十四部分 基金资产的估值	八、特殊情况的处理 1、基金管理人或基金托管人按本基金合同规定的估值方法的第 8 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。	八、特殊情况的处理 1、基金管理人或基金托管人按本基金合同规定的估值方法的第 9 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。
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		增加： 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基金份额比例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，基金管理人应当在基金定期报告“影响投资

报告和基金季度报告		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		增加： 26、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的重大事项； 27、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；
第二十四部分 基金合同内容摘要		根据基金合同正文修改。

二 托管协议修改内容

章节	修订前	修订后
----	-----	-----

一、 托管协议 当事人	法定代表人：赵如冰	法定代表人：杨光裕
一、 托管协议 当事人	<p>名称： 中国银行股份有限公司</p> <p>住所： 北京市西城区复兴门内大街1号</p> <p>法定代表人：田国立</p> <p>成立时间： 1983年10月31日</p> <p>基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号</p> <p>组织形式：股份有限公司</p> <p>注册资本： 人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整</p> <p>经营范围： 吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险</p>	<p>名称： 中国银行股份有限公司</p> <p>住所： 北京市西城区复兴门内大街1号</p> <p>法定代表人：陈四清</p> <p>成立时间： 1983年10月31日</p> <p>基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号</p> <p>组织形式： 股份有限公司</p> <p>注册资本： 人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整</p> <p>经营范围： 吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇兑换；国际结算；</p>

	<p>箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；经中国人民银行批准的其他业务。</p> <p>存续期间： 持续经营</p>	<p>同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；经中国人民银行批准的其他业务。</p> <p>存续期间： 持续经营</p>
--	---	--

<p>二、 托管协议的依据、目的、原则和解释</p>	<p>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》”）及其他有关法律法规与《景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）订立。</p>	<p>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》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其他有关法律法规与《景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）订立。</p>
<p>三、 基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>	<p>2、对基金投融资比例进行监督：</p> <p>（1）本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%，同时不低于非现金基金资产的 80%，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，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>2、对基金投融资比例进行监督：</p> <p>（1）本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%，同时不低于非现金基金资产的 80%；</p> <p>（2）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，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>三、 基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>		<p>增加：</p> <p>（10）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述所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p>

		<p>(11) 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。本基金管理人承诺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与本基金基金合同约定的投资范围保持一致，并承担由于不一致所导致的风险或损失；</p>
<p>三、 基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>	<p>因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制、目标 ETF 暂停申购、赎回或二级市场交易停牌、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。法律法规另有规定的，从其规定。</p>	<p>除上述 (2)、(10)、(11)、(12) 项外，因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制、目标 ETF 暂停申购、赎回或二级市场交易停牌、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。法律法规另有规定的，从其规定。</p>

关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改

基金合同、托管协议的内容说明

景顺长城改革机遇灵活配置混合型证券投资基金

一、基金合同修改内容

章节	原基金合同	修改内容
第一部分	2、订立本基金合同的依据是	2、订立本基金合同的依据是《中华

<p>前言</p> <p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</p>	<p>《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>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“《流动性规定》”）和其他有关法律法规。</p>
<p>第二部分 释义</p>		<p>增加：</p> <p>52、《流动性规定》：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</p> <p>53、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>54、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</p>

		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
第六部分 基金份额的申购与赎回 五、申购和赎回的数量限制		增加： 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。具体请参见相关公告。
第六部分 基金份额的申购与赎回 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。赎回费用中应根据招募说明书规定的比例归入基金财产，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。	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。本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。赎回费用中应根据招募说明书规定的比例归入基金财产，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。
第六部分 基金份额的申购与赎回 六、申购和赎回的价格、费用及其用途		增加： 8、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，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。
第六部分 基金份额的申购与	2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人	2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投

赎回 七、拒绝或 暂停申购 的情形	可暂停接受投资人的申购申请。	投资人的申购申请。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。
第六部分 基金份额的 申购与 赎回 七、拒绝或 暂停申购 的情形		增加： 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%，或者变相规避 50%集中度的情形时。
第六部分 基金份额的 申购与 赎回 七、拒绝或 暂停申购 的情形	发生上述第 1、2、3、5、6、7 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。	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全部或部分拒绝的，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。
第六部分 基金份额的 申购与 赎回 八、暂停赎 回或延缓 支付赎回 款项的情 形	2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，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，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。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赎回申请或延缓支付赎回款项的措施。
第六部分 基金份额的 申购与		增加： (3) 如果基金发生巨额赎回，在单

<p>赎回 九、巨额赎回的情形及处理方式</p>		<p>个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额 20%以上的赎回申请的情形下，基金管理人可以对该基金份额持有人超过 20%以上的部分延期办理赎回申请。若进行该种超比例延期赎回，对于当日非延期的赎回申请，应当按单个账户非延期赎回申请量占非延期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。</p>
<p>第七部分 基金合同当事人及权利义务 一、基金管理人</p>	<p>法定代表人：赵如冰</p>	<p>法定代表人：杨光裕</p>
<p>第七部分 基金合同当事人及权利义务 二、基金托管人</p>	<p>（一） 基金托管人简况 名称：中国银行股份有限公司 住所：北京市复兴门内大街 1 号 法定代表人：田国立 成立时间：1983 年 10 月 31 日</p>	<p>（一） 基金托管人简况 名称：中国银行股份有限公司 住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号 法定代表人：陈四清 成立时间：1983 年 10 月 31 日</p>

	<p>批准设立机关和批准设立文号：国务院批转中国人民银行《关于改革中国银行体制的请示报告》（国发[1979]72号）。</p> <p>组织形式：股份有限公司</p> <p>注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整</p> <p>存续期间：持续经营</p> <p>基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字【1998】24号</p>	<p>批准设立机关和批准设立文号：国务院批转中国人民银行《关于改革中国银行体制的请示报告》（国发[1979]72号）</p> <p>组织形式：股份有限公司</p> <p>注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整</p> <p>存续期间：持续经营</p> <p>基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字【1998】24号</p>
第十二部分 基金的投资 二、投资范围	<p>本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范围为 0-95%。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>本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范围为 0-95%。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。</p>
第十二部分 基金的投资 四、投资限制	<p>（1）本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范围为 0-95%。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，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>（1）本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范围为 0-95%；</p> <p>（2）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，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>
第十二部分 基金的投资		增加：

<p>投资 四、投资限制</p>		<p>(12) 本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）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>(13) 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述所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>(14) 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本基金合同约定的投资范围保持一致；</p>
<p>第十二部分 基金的投资 四、投资限制</p>	<p>因证券、期货市场波动、上市公司合并、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，从其规定。</p>	<p>除上述（2）、（13）、（14）、（15）项外，因证券、期货市场波动、上市公司合并、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，从其规定。</p>

<p>第十四部分 基金资产的估值</p> <p>三、估值方法</p>		<p>增加：</p> <p>7、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。</p>
<p>第十四部分 基金资产的估值</p> <p>六、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一致后，应当暂停估值；</p>
<p>第十四部分 基金资产的估值</p>	<p>八、特殊情况的处理</p> <p>1、基金管理人或基金托管人按本基金合同规定的估值方法的第 7 项进行估值时，所造成的误差</p> <p>不作为基金资产估值错误处理。</p>	<p>八、特殊情况的处理</p> <p>1、基金管理人或基金托管人按本基金合同规定的估值方法的第 8 项进行估值时，所造成的误差</p> <p>不作为基金资产估值错误处理。</p>
<p>第十八部分 基金的信息披露</p> <p>五、公开披露的基金信息</p> <p>(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</p>		<p>增加：</p> <p>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。</p> <p>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例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。</p>

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		增加： 26、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的重大事项时； 27、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；
第二十四部分 基金合同内容摘要		根据基金合同正文修改

二、 托管协议修改内容

章节	原托管协议	修改内容
----	-------	------

<p>一、 托管协议 当事人</p>	<p>法定代表人：赵如冰</p>	<p>法定代表人：杨光裕</p>
<p>一、 托管协议 当事人</p>	<p>(二) 基金托管人 (或简称“托管人”)</p> <p>名称： 中国银行股份有限公司</p> <p>住所： 北京市西城区复兴门内大街 1 号</p> <p>法定代表人： 田国立</p> <p>成立时间： 1983 年 10 月 31 日</p> <p>基金托管业务批准文号： 中国证监会证监基字【1998】24 号</p> <p>组织形式： 股份有限公司</p> <p>注册资本： 人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整</p> <p>经营范围： 吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险</p>	<p>(二) 基金托管人 (或简称“托管人”)</p> <p>名称： 中国银行股份有限公司</p> <p>住所： 北京市西城区复兴门内大街 1 号</p> <p>法定代表人： 陈四清</p> <p>成立时间： 1983 年 10 月 31 日</p> <p>基金托管业务批准文号： 中国证监会证监基字【1998】24 号</p> <p>组织形式： 股份有限公司</p> <p>注册资本： 人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整</p> <p>经营范围： 吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；外汇存款；</p>

	<p>箱服务； 外汇存款； 外汇贷款； 外汇汇款； 外汇兑换； 国际结算； 同业外汇拆借； 外汇票据的承兑和贴现； 外汇借款； 外汇担保； 结汇、 售汇； 发行和代理发行股票以外的外币有价证券； 买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券； 自营外汇买卖； 代客外汇买卖； 外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款； 资信调查、 咨询、 见证业务； 组织或参加银团贷款； 国际贵金属买卖； 海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务； 在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币； 经中国人民银行批准的其他业务。</p> <p>存续期间： 持续经营</p>	<p>外汇贷款； 外汇汇款； 外汇兑换； 国际结算； 同业外汇拆借； 外汇票据的承兑和贴现； 外汇借款； 外汇担保； 结汇、 售汇； 发行和代理发行股票以外的外币有价证券； 买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券； 自营外汇买卖； 代客外汇买卖； 外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款； 资信调查、 咨询、 见证业务； 组织或参加银团贷款； 国际贵金属买卖； 海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务； 在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币； 经中国人民银行批准的其他业务。</p> <p>存续期间： 持续经营</p>
--	---	--

<p>二、 托管协议的 依据、 目的、原 则和解释</p>	<p>(一) 依据</p> <p>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》”)及其他有关法律、法规与《景顺长城改革机遇灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)订立。</p>	<p>(一) 依据</p> <p>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》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其他有关法律、法规与《景顺长城改革机遇灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)订立。</p>
<p>三、 基金托管 人对基金 管理人的 业务监督 和核查</p>	<p>(1) 本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范围为 0-95%。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，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>(1) 本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范围为 0-95%；</p> <p>(2) 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，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>三、 基金托管 人对基金 管理人的 业务监督 和核查</p>		<p>增加：</p> <p>(12) 本基金管理人管理的且由本托管人托管的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）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且由本托管人托管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</p>

		<p>公司可流通股票的 30%；</p> <p>(13) 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述所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>(14) 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本基金基金合同约定的投资范围保持一致。本基金管理人承诺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与本基金基金合同约定的投资范围保持一致，并承担由于不一致所导致的风险或损失；</p>
<p>三、 基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>	<p>因证券、期货市场波动、上市公司合并、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，从其规定。</p>	<p>除上述 (2)、(13)、(14)、(15) 项外，因证券、期货市场波动、上市公司合并、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，从其规定。</p>

关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改 基金合同、托管协议的内容说明

景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

一 基金合同修改内容

章节	修订前	修订后
<p>第一部分 前言 一、订立本基金合同的、依据和原则</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》”）、《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>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》”）、《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“《流动性规定》”）和其他有关法律法规。</p>
<p>第二部分 释义</p>		<p>增加：</p> <p>72、《流动性规定》：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</p> <p>73、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</p>

		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
第八部分 基金份额的申购、赎回与非交易过户 五、申购与赎回的数额限制		<p>增加：</p> <p>2、基金管理人可以规定单个投资者累计持有的基金份额上限，具体规定参见招募说明书或其他公告。</p> <p>3、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份额上限、基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购或限制基金当日最大申购份额等措施，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。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。具体请参见相关公告。</p>
第八部分 基金份额的申购、赎回与非交易过户 七、拒绝或暂停申购、赎回的情形及处理方式	(3) 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况；	(3) 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况的，基金管理人可以暂停接受投资者的申购、赎回申请。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对价或暂停接受基金申购、赎回申请的措施；
第八部分 基金份额	发生上述情形之一（第（6）项	发生上述情形之一（第（6）项除外）

<p>的申购、赎回与非交易过户七、拒绝或暂停申购、赎回的情形及处理方式</p>	<p>除外)且基金管理人决定拒绝或暂停基金份额持有人的申购、赎回申请时,基金管理人应当及时公告并向中国证监会备案。已接受的赎回申请,基金管理人应当足额支付。在拒绝或暂停申购、赎回的情形消除时,基金管理人应及时恢复申购、赎回业务的办理并依照《信息披露办法》有关规定在指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告,并公告最近 1 个开放日的基金份额净值。</p>	<p>且基金管理人决定拒绝或暂停基金份额持有人的申购、赎回申请或延缓支付赎回对价时,基金管理人应当及时公告并向中国证监会备案。已接受的赎回申请,基金管理人应当足额支付。在拒绝或暂停申购、赎回的情形消除时,基金管理人应及时恢复申购、赎回业务的办理并依照《信息披露办法》有关规定在指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告,并公告最近 1 个开放日的基金份额净值。</p>
<p>第九部分基金合同当事人及权利义务一、基金管理人</p>	<p>法定代表人: 赵如冰</p>	<p>法定代表人: 杨光裕</p>
<p>第九部分基金合同当事人及权利义务二、基金托管人</p>	<p>(一) 基金托管人简况 名称: 中国银行股份有限公司 住所: 北京市复兴门内大街 1 号 法定代表人: 田国立 成立时间: 1983 年 10 月 31 日 批准设立机关和批准设立文号: 国务院批转中国人民银行《关于改革中国银行体制的请示报告》(国发[1979]72 号)。 组织形式: 股份有限公司 注册资本: 人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整 存续期间: 持续经营 基金托管资格批文及文号: 中国</p>	<p>(一) 基金托管人简况 名称: 中国银行股份有限公司 住所: 北京市西城区复兴门内大街 1 号 法定代表人: 陈四清 成立时间: 1983 年 10 月 31 日 批准设立机关和批准设立文号: 国务院批转中国人民银行《关于改革中国银行体制的请示报告》(国发[1979]72 号) 组织形式: 股份有限公司 注册资本: 人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整</p>

	证监会证监基字【1998】24号	<p>存续期间：持续经营</p> <p>基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字【1998】24号</p>
第十四部分 基金的投资七、投资限制	12.6 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，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；	12.6 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，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；
第十四部分 基金的投资七、投资限制		<p>增加：</p> <p>（14）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述所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>（15）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>
第十四部分 基金的投资七、投资限制	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。法律法规另有规定的，从其规定。	除上述（9）、（14）、（15）项及 12.6 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。法律法规另有规定的，从其规定。

第十六部分 基金资产的估值 六、暂停估值的情形		<p>增加：</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后，应当暂停估值；</p>
第二十部分 基金的信息披露 五、公开披露的基金信息 (八) 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		<p>增加：</p> <p>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。</p> <p>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例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。</p>
第二十部分 基金的信息披露 五、公开披露的基金信息 (九) 临时报告		<p>增加：</p> <p>29、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；</p>
第二十七部分 基金合同内容摘要		<p>根据基金合同正文对应修改</p>

二 托管协议修改内容

章节	修订前	修订后
----	-----	-----

<p>一、托管协议当事人</p>	<p>(一) 基金管理人 (或简称“管理人”)</p> <p>法定代表人: 赵如冰</p>	<p>(一) 基金管理人 (或简称“管理人”)</p> <p>法定代表人: 杨光裕</p>
<p>一、托管协议当事人</p>	<p>(二) 基金托管人 (或简称“托管人”)</p> <p>名称: 中国银行股份有限公司</p> <p>住所: 北京市西城区复兴门内大街 1 号</p> <p>法定代表人: 田国立</p> <p>成立时间: 1983 年 10 月 31 日</p> <p>批准设立机关和批准设立文号: 国务院批转中国人民银行《关于改革中国银行体制的请示报告》(国发[1979]72 号)。</p> <p>基金托管业务批准文号: 中国证监会证监基字【1998】24 号</p> <p>组织形式: 股份有限公司</p> <p>注册资本: 人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整</p> <p>经营范围: 吸收人民币存款; 发放短期、中期和长期贷款; 办理结算; 办理票据贴现; 发行金</p>	<p>(二) 基金托管人 (或简称“托管人”)</p> <p>名称: 中国银行股份有限公司</p> <p>住所: 北京市西城区复兴门内大街 1 号</p> <p>法定代表人: 陈四清</p> <p>成立时间: 1983 年 10 月 31 日</p> <p>基金托管业务批准文号: 中国证监会证监基字【1998】24 号</p> <p>组织形式: 股份有限公司</p> <p>注册资本: 人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整</p> <p>经营范围: 吸收人民币存款; 发放短期、中期和长期贷款; 办理结算; 办理票据贴现; 发行金融债券; 代理发行、代理兑付、承销政府债券; 买卖政府债券; 从事同业拆借; 提供信用证服务及担保; 代理收付款项</p>

	<p>融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；经中国人民银行批准的其</p>	<p>及代理保险业务；提供保险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；经中国人民银行批准的其他业务。</p> <p>存续期间： 持续经营</p>
--	---	---

	他业务。 存续期间： 持续经营	
--	--------------------	--

<p>二、托管协议的依据、目的、原则和解释</p>	<p>(一) 依据</p> <p>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》”)、《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》”)及其他有关法律法规与《景顺长城中证500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)订立。</p>	<p>(一) 依据</p> <p>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》”)、《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》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其他有关法律法规与《景顺长城中证500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)订立。</p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>	<p>12.6 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,应当保持不低于交易保证金一倍的现金;</p>	<p>12.6 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,应当保持不低于交易保证金一倍的现金,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等;</p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>		<p>增加:</p> <p>(14) 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述所规定比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;</p> <p>(15) 本基金与私募类证券资产产</p>

		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。本基金管理人承诺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与基金合同约定的投资范围保持一致，并承担由于不一致所导致的风险或损失；
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	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。法律法规另有规定的，从其规定。	除上述（9）、（14）、（15）及 12.6 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。法律法规另有规定的，从其规定。

关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改

基金合同、托管协议的内容说明

景顺长城鼎益混合型证券投资基金（LOF）基金合同

一、基金合同对照表

章节	原基金合同	修改内容
一、前言 (一) 订立《景顺长城鼎益混合型证券	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法通则》、《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国信托法》、2003 年 10 月 28 日第十届全国人民代表大会常务委	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法通则》、《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国信托法》、2003 年 10 月 28 日第十届全国人民代表大会常务委

<p>投资基金（LOF）基金合同》的目的、依据和原则</p>	<p>五次会议通过并于 2004 年 6 月 1 日起施行的《中华人民共和国证券投资基金法》以下简称《基金法》）、2004 年 6 月 29 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）发布并于 2004 年 7 月 1 日起施行的《证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）和《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、2004 年 6 月 11 日中国证监会发布并于 2004 年 7 月 1 日起施行的《证券投资基金信息披露管理办法》以下简称《信息披露办法》）以及 2004 年 8 月 17 日深圳证券交易所发布并于 2004 年 8 月 17 日施行的《深圳证券交易所上市开放式基金业务规则》（以下简称《业务规则》）及其他有关规定。</p>	<p>月 1 日起施行的《中华人民共和国证券投资基金法》以下简称《基金法》）、2004 年 6 月 29 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）发布并于 2004 年 7 月 1 日起施行的《证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）和《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、2004 年 6 月 11 日中国证监会发布并于 2004 年 7 月 1 日起施行的《证券投资基金信息披露管理办法》以下简称《信息披露办法》）以及 2004 年 8 月 17 日深圳证券交易所发布并于 2004 年 8 月 17 日施行的《深圳证券交易所上市开放式基金业务规则》（以下简称《业务规则》）、《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《流动性规定》）及其他有关规定。</p>
<p>二、释义</p>		<p>增加：</p> <p>《流动性规定》 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；</p> <p>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>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</p>

		<p>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>八、基金的申购和赎回 （五）申购、赎回的数额约定</p>		<p>增加：</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。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。具体请参见相关公告。</p>
<p>八、基金的申购和赎回 （六）申购、赎回的价格、费用及其用途</p>	<p>3、本基金的申购费由申购人承担，归销售机构所有。本基金的赎回费由赎回人承担，所收取的赎回费中不低于 25%的部分归入基金财产。申购费和赎回费用的用途为市场推广、基金份额销售及注册登记等。</p>	<p>3、本基金的申购费由申购人承担，归销售机构所有。本基金的赎回费由赎回人承担，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。对持续持有期不少于 7 日的投资者所收取的赎回费中不低于 25%的部分归入基金财产。申购费和赎回费用的用途为市场推广、基金份额销售及注册登记等。</p>
<p>八、基金的申购和赎回 （六）申购、赎回的价格、费用及其用途</p>		<p>增加：</p> <p>6、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，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。</p>
<p>八、基金的申购和赎回</p>		<p>增加：</p>

<p>回 (九)拒绝或暂停申购的情形及处理</p>		<p>(2) 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;</p>
<p>八、基金的申购和赎回 (九)拒绝或暂停申购的情形及处理</p>		<p>增加: (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>八、基金的申购和赎回 (九)拒绝或暂停申购的情形及处理</p>	<p>发生暂停申购情形时, 基金管理人应当立即在指定媒体上刊登暂停申购公告。</p>	<p>发生除上述(5)和(8)项情形之外的暂停申购情形时, 基金管理人应当立即在指定媒体上刊登暂停申购公告。</p>
<p>八、基金的申购和赎回 (九)拒绝或暂停申购的情形及处理</p>		<p>增加: (2) 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>八、基金的申购和赎回 (十)巨额赎回的情形及处理方式</p>		<p>增加: (3) 如果基金发生巨额赎回, 在单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额 20%以上的赎回申请的情形下, 基金管理人可以对该基金份额持有人超过 20%以上的部分延期办理赎回申请。若进行该种超比例延期赎回, 对于当日非延</p>

		<p>期的赎回申请,应当按单个账户非延期赎回申请量占非延期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。</p> <p>(4) 巨额赎回业务的场内处理,按照深圳证券交易所及登记结算机构的有关《业务规则》办理。</p>
九、基金合同当事人及权利义务 (一)基金合同当事人	法定代表人:赵如冰	法定代表人:杨光裕
九、基金合同当事人及权利义务 (一)基金合同当事人	<p>2、基金托管人</p> <p>名称: 中国银行股份有限公司</p> <p>住所: 北京市西城区复兴门内大街 1 号</p> <p>办公地址: 北京市西城区复兴门内大街 1 号</p> <p>法定代表人: 田国立</p> <p>组织形式: 股份有限公司</p>	<p>2、基金托管人</p> <p>名称: 中国银行股份有限公司</p> <p>住所: 北京市西城区复兴门内大街 1 号</p> <p>法定代表人: 陈四清</p> <p>成立时间: 1983 年 10 月 31 日</p> <p>批准设立机关和批准设立文号: 国务院批转中国人民银行《关于改革中国银行</p>

	<p>注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整</p> <p>存续期间：持续经营</p> <p>成立日期：1912年2月5日</p> <p>基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号</p> <p>托管部门总经理：肖伟</p>	<p>体制的请示报告》</p> <p>（国发[1979]72号）</p> <p>组织形式：股份有限公司</p> <p>注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整</p> <p>存续期间：持续经营</p> <p>基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字【1998】24号</p>
十七、基金的投资 （四）投资策略 2、投资管理的方法和标准	<p>（1）资产配置</p> <p>本基金是一只较高持股的混合型基金，对于股票的投资不少于基金财产的60%，持有现金和到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。</p>	<p>（1）资产配置</p> <p>本基金是一只较高持股的混合型基金，对于股票的投资不少于基金财产的60%，持有现金和到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</p>
十七、基金的投资 （五）业绩比较基准	<p>（1）公允性。本基金定位于高持股的混合型基金，同时始终持有不少于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。以上述基准对本基金的投资业绩进行评估，能够比较客观的反映资产的市场平均收益水平，也可以比较公允的反映基金管理人的投资管理能力。</p>	<p>（1）公允性。本基金定位于高持股的混合型基金，同时始终持有不少于基金资产净值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、存出保证金和应收申购款等。以上述基准对本基金的投资业绩进行评估，能够比较客观的反映资产的市场平均收益水平，也可以比较公允的反映基金管理人的投资管理能力。</p>
十七、基金的投资 （七）投资限制		<p>增加：</p> <p>（2）持有现金和到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存</p>

		<p>出保证金和应收申购款等；</p> <p>(6) 本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)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>(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述所规定比例限制的,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>二十、基金财产的估值 (五)估值方法</p>		<p>增加:</p> <p>5、当本基金发生大额申购或赎回情形时,在履行适当程序后,基金管理人可以采用摆动定价机制,以确保基金估值的公平性。</p>
<p>二十、基金财产的估值 (七)暂停估值的情</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</p>

形		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后, 应当暂停估值;
二十、基金财产的估值	(八) 特殊情形的处理 1、基金管理人按估值方法的第5项进行估值时, 所造成的误差不能作为基金资产估值错误处理;	(八) 特殊情形的处理 1、基金管理人按估值方法的第6项进行估值时, 所造成的误差不作为基金资产估值错误处理;
二十四、基金的信息披露 (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		增加: 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基金份额比例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文件中“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本基金的特有风险, 中国证监会认定的特殊情形除外。
二十四、基金的信息披露 (八) 临时报告		增加: 26、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的重大事项时; 27、基金管理人采用摆动定价机制进行估值;

二、托管协议修改内容

章节	原托管协议	修改内容
----	-------	------

封面	景顺长城鼎益混合型证券投资基金 托管协议	景顺长城鼎益混合型证券投资基金 (LOF) 托管协议
全文	景顺长城鼎益混合型证券投资基金	景顺长城鼎益混合型证券投资基金 (LOF)
一、托管协议当事人	法定代表人：赵如冰	法定代表人：杨光裕
一、托管协议当事人	<p>法定代表人：田国立</p> <p>经营范围：</p> <p>吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地</p>	<p>法定代表人：陈四清</p> <p>组织形式： 股票有限公司</p> <p>注册资本： 人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整</p> <p>存续期间： 持续经营</p> <p>经营范围：吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；</p> <p>发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；从事同业拆借；</p> <p>提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；外汇存款；</p> <p>外汇贷款；外汇汇款；外汇兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；</p> <p>外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；</p>

	<p>货币；经中国人民银行批准的其他业务。</p> <p>企业类型：股份有限公司</p> <p>注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整</p> <p>存续期间：持续经营</p>	<p>组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；经中国人民银行批准的其他业务。</p>
二、托管协议的依据、目的、原则和解释	<p>(一) 依据</p> <p>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》（以下称“《基金法》”）、《证券投资基金运作管理办法》（以下称“《管理办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律、法规与《景顺长城鼎益混合型证券投资基金基金合同》（以下称“《基金合同》”）制订。</p>	<p>(一) 依据</p> <p>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》（以下称“《基金法》”）、《证券投资基金运作管理办法》（以下称“《管理办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其他有关法律、法规与《景顺长城鼎益混合型证券投资基金(LOF)基金合同》（以下称“《基金合同》”）制订。</p>
二、托管协议的依据、目的、原则和解释	<p>(二) 目的</p> <p>本协议的目的是明确景顺长城鼎益混合型证券投资基金基金托管人和景顺长城鼎益混合型证券投资基金基金管理人之间在基金份额持有人名册的登记、基金财产的保管、基金财产的管理和运作、基金的申购、赎回及相互监督等有关事宜中的权利、义务及职责，以确保基金财产</p>	<p>(二) 目的</p> <p>本协议的目的是明确景顺长城鼎益混合型证券投资基金(LOF)基金托管人和景顺长城鼎益混合型证券投资基金(LOF)基金管理人之间在基金份额持有人名册的登记、基金财产的保管、基金财产的管理和运作、基金的申购、赎回及相互监督等有关事宜中的权利、义务及职责，以确保基金财产的安全，保护基金份额持有人</p>

	的安全，保护基金份额持有人的合法权益。	的合法权益。
--	---------------------	--------

关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改 基金合同、托管协议的内容说明

景顺长城景系列开放式证券投资基金

一、基金合同修改内容

章节	修订前	修订后
一、前言	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法通则》、《中华人民共和国信托法》、《中华人民共和国合同法》、1997年11月14日经国务院批准发布的《证券投资基金管理暂行办法》（以下简称《暂行办法》）、2000年10月8日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）发布的《开放式证券投资基金试点办法》（以下简称《试点办法》）及其他有关规定。	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法通则》、《中华人民共和国信托法》、《中华人民共和国合同法》、1997年11月14日经国务院批准发布的《证券投资基金管理暂行办法》（以下简称《暂行办法》）、2000年10月8日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）发布的《开放式证券投资基金试点办法》（以下简称《试点办法》）、《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》”）及其他有关规定。
二、释义		增加： 《流动性风险管理规定》：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 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

		<p>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>摆动定价机制：指当优选混合基金、动力平衡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>
三、基金合同当事人 (一) 基金发起人	法定代表人：赵如冰	法定代表人：杨光裕
三、基金合同当事人 (三) 基金托管人	<p>名称：中国银行股份有限公司 法定代表人：田国立 成立时间：1912年2月5日 住所：北京市西城区复兴门内大街1号 注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整 存续期间：持续经营 组织形式：股份有限公司 基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]24号</p>	<p>名称：中国银行股份有限公司 住所：北京市西城区复兴门内大街1号 法定代表人：陈四清 成立时间：1983年10月31日 批准设立机关和批准设立文号：国务院批转中国人民银行《关于改革中国银行体制的请示报告》（国发[1979]72号） 组织形式：股份有限公司 注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整 存续期间：持续经营 基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字【1998】24号</p>

<p>十三、基金的申购、赎回</p> <p>(五) 申购、赎回的数额限制</p>		<p>增加:</p> <p>3、当接受申购申请对优选混合基金或动力平衡基金存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时,基金管理人应当对该只基金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,可采取上述措施对优选混合基金或动力平衡基金的基金规模予以控制。具体请参见相关公告。</p>
<p>十三、基金的申购、赎回</p> <p>(六) 申购、赎回的费用</p>	<p>1、本系列基金的申购费率最高不超过 3%, 赎回费率最高不超过 1.0%。</p> <p>2、本系列基金的申购费由申购人承担, 归销售机构所有。</p> <p>3、本系列基金赎回费的 25%归入基金财产, 其余作为注册登记费及其他基本手续费。</p> <p>4、本系列基金的申购费率、赎回费率由基金管理人确定并在招募说明书或公开说明书中列示。</p>	<p>1、本系列基金的申购费率最高不超过 3%。</p> <p>2、本系列基金的申购费由申购人承担, 归销售机构所有。</p> <p>3、本系列基金中优选混合基金、动力平衡基金对于持续持有期少于7日的投资者, 将收取不低于1.5%的赎回费并全额计入对应基金的基金财产, 对于持续持有期不少于7日的投资者, 赎回费的 25%归入基金财产, 其余作为注册登记费及其他基本手续费。</p> <p>4、货币基金在一般情况下不收取申购费用和赎回费用, 但是当货币基金前10名基金份额持有人的持有份额合计超过基金总份额50%, 且货币基金投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计低于10%且偏离度为负时, 为确保货币基金平稳运作, 避免诱发系统性风险, 对</p>

		<p>当日单个基金份额持有人申请赎回（含转换出）基金份额超过基金总份额的1%以上的赎回（含转换出）申请（超过基金总份额1%以上的部分）征收1%的强制赎回费用，并将上述赎回费用全额计入货币基金的基金资产。基金管理人与基金托管人协商确认上述做法无益于基金利益最大化的情形除外。</p> <p>5、本系列基金的申购费率、赎回费率由基金管理人确定并在招募说明书或公开说明书中列示。</p> <p>6、当优选混合基金、动力平衡基金发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，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、自律组织的规定。</p>
<p>十三、基金的申购、赎回</p> <p>（九）巨额赎回的情形及处理</p>		<p>增加：</p> <p>（3）如果本系列基金中任一基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额20%（货币市场基金为10%）以上的赎回申请的情形下，基金管理人可以对该基金份额持有人超过20%（货币市场基金为10%）以上的部分延期办理赎回申请。若进行该种超比例延期赎回，对于当日非延期的赎回申请，应当按单个账户非延期赎回申请量占非延期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</p>

		<p>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该基金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。</p>
<p>十三、基金的申购、赎回</p> <p>(十) 拒绝或暂停申购、赎回的情形与处理</p>	<p>1、本系列基金任一基金出现以下情况之一时，基金管理人可拒绝或暂停接受基金投资者的申购申请：</p> <p>(1) 不可抗力；</p> <p>(2) 证券交易所交易时间非正常停市或其他情形，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；</p> <p>(3) 基金管理人认为市场缺乏合适的投资机会，继续接受申购可能对已有基金份额持有人利益产生损害；</p> <p>(4) 基金管理人认为会严重损害已有基金份额持有人利益的申购；</p> <p>(5) 基金管理人、基金托管人、销售代理人或注册登记人的技术保障或人员支持等不充分；</p> <p>(6) 法律、法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p>	<p>1、本系列基金任一基金出现以下情况之一时，基金管理人可全部或部分拒绝或暂停接受基金投资者的申购申请：</p> <p>(1) 不可抗力；</p> <p>(2) 证券交易所交易时间非正常停市或其他情形，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；</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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受申购申请；</p> <p>(4) 基金管理人认为市场缺乏合适的投资机会，继续接受申购可能对已有基金份额持有人利益产生损害；</p> <p>(5) 基金管理人认为会严重损害已有基金份额持有人利益的申购；</p> <p>(6) 基金管理人、基金托管人、销售代理人或注册登记人的技术保障或人员支持等不充分；</p> <p>(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</p>

		50%，或者变相规避50%集中度的情形时； (8) 法律、法规规定或中国证监会认定的其他情形。
十三、基金的申购、赎回 (十) 拒绝或暂停申购、赎回的情形与处理		2、拒绝或暂停赎回的情形和处理增加： (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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；
十三、基金的申购、赎回 (十四) 货币市场基金申购、赎回的数额约定		增加： 5、当接受货币市场基金的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，可采取上述措施对货币市场基金规模予以控制。具体请参见相关公告。
十三、基金的申购、赎回 (十五) 货币市场基金申购份额、赎回金额的计算方式	2、基金赎回金额的计算 赎回金额=赎回份额×1.00元 基金赎回金额保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，舍去部分所代表的资产归基金所有。	2、基金赎回金额的计算 按照本合同约定不收取赎回费时赎回金额=赎回份额×1.00元 按照本合同约定收取赎回费时，赎回金额=(赎回份额×1.00元)-赎回费用 基金赎回金额保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，舍去部分所代表的资产归基金所有。 货币基金在一般情况下不收

		取申购费用和赎回费用，但是当货币基金前10名基金份额持有人的持有份额合计超过基金总份额50%，且货币基金投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计低于10%且偏离度为负时，为确保货币基金平稳运作，避免诱发系统性风险，对当日单个基金份额持有人申请赎回（含转换出）基金份额超过基金总份额的1%以上的赎回（含转换出）申请（超过基金总份额1%以上的部分）征收1%的强制赎回费用，并将上述赎回费用全额计入货币基金的基金资产。基金管理人与基金托管人协商确认上述做法无益于基金利益最大化的情形除外。
十四、基金的转换 （五）转换的费用	2、本系列基金转换费在扣除注册登记费用及其他基本手续费后，剩余部分归基金财产。	2、本系列基金转换费在扣除注册登记费用及其他基本手续费后，剩余部分归基金财产。对于基金份额持有人转出持有期不足7日的优选混合型基金或动力平衡基金，其收取不低于1.5%的赎回费，并将前述赎回费全额归入对应基金的基金财产。
十四、基金的转换 （八）拒绝或暂停转换的情形与处理		增加： （4）发生基金合同约定的暂停申购或赎回的情形；
十四、基金的转换 （十三）货币市场	基金的转入金额包括转换费用和净转入金额，其中： 货币市场基金转出金额=货币基金转出份额×1.0000	基金的转入金额包括转换费用和净转入金额，其中： 当按照本合同约定不收取赎回费时，货币市场基金转出金额=货币基

<p>基金向优选混合型基金或动力平衡基金转换的转换费用及转换份额计算公式如下：</p>		<p>金转出份额\times1.0000</p> <p>当按照本合同约定收取赎回费时，货币市场基金转出金额=（转出份额\times1.00元）-赎回费用</p> <p>货币基金在一般情况下不收取申购费用和赎回费用，但是当货币基金前10名基金份额持有人的持有份额合计超过基金总份额50%，且货币基金投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计低于10%且偏离度为负时，为确保货币基金平稳运作，避免诱发系统性风险，对当日单个基金份额持有人申请赎回（含转换出）基金份额超过基金总份额的1%以上的赎回（含转换出）申请（超过基金总份额1%以上的部分）征收1%的强制赎回费用，并将上述赎回费用全额计入货币基金的基金资产。基金管理人与基金托管人协商确认上述做法无益于基金利益最大化的情形除外。</p>
<p>十九、基金的投资 （五）投资组合比例限制</p>	<p>（1）本系列基金投资于股票、债券的比例不低于基金资产总值的 80%； （2）本系列基金投资于国家债券的比例不低于基金资产净值的 20%； （3）本系列基金持有一家上市公司的股票，不超过基金资产净值的 10%； （4）本系列基金与由本系列基金管理人管理的其他基金持有一家上市公司发行的证券总和，不得超过该证券的 10%； （5）本系列基金股票资产中至少有 80%属于本系列基金名称所显示的投资内容； （6）中国证监会规定的其他比例限</p>	<p>（1）本系列基金投资于股票、债券的比例不低于基金资产总值的 80%； （2）本系列基金投资于国家债券的比例不低于基金资产净值的 20%； （3）本系列基金持有一家上市公司的股票，不超过基金资产净值的 10%； （4）本系列基金与由本系列基金管理人管理的其他基金持有一家上市公司发行的证券总和，不得超过该证券的 10%； （5）本基金管理人管理的全部开放</p>

	<p>制；</p> <p>(7) 法律法规和监管机关对上述比例限制另有规定的，从其规定。</p>	<p>式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不超过该上市公司可流通股票的15%；</p> <p>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，不超过该上市公司可流通股票的30%；</p> <p>(6) 本系列基金股票资产中至少有80%属于本系列基金名称所显示的投资内容；</p> <p>(7) 优选混合型基金或动力平衡基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的15%；因证券市场波动、证券停牌、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项所规定的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>(8) 本系列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投资范围保持一致；</p> <p>(9) 中国证监会规定的其他比例限制；</p> <p>(10) 法律法规和监管机关对上述比例限制另有规定的，从其规定。</p>
<p>十九、基金的投资</p> <p>(八) 货币市场基金投资的特别限制</p>	<p>2、货币市场基金遵守以下投资组合比例限制：</p> <p>(1) 投资于同一公司发行的短期企业债券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；</p> <p>(2) 存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款，不得超过基金资产净值的 30%；存放在不具有基金托管资格的同一商业银行的存款，不得</p>	<p>2、货币市场基金遵守以下投资组合比例限制：</p> <p>(1) 投资于同一公司发行的短期企业债券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；</p> <p>(2) 存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款，不得超过基金资产净值的 30%；存放在不具有基</p>

	<p>超过基金资产净值的 5%;</p> <p>(3) 投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 180 天;</p> <p>(4) 不得与基金管理人的股东进行交易, 不得通过交易上的安排认为降低投资组合的平均剩余期限的真实天数;</p> <p>(5) 除发生巨额赎回的情况外, 基金投资组合中债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%; 因发生巨额赎回致使基金债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的, 应当在 5 个交易日内进行调整;</p> <p>(6) 基金持有的剩余期限不超过 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本总计不得超过当日基金资产净值的 20%; 基金不得投资于以定期存款利率为基准利率的浮动利率债券;</p> <p>(7) 买断式回购融入基础债券的剩余期限不得超过 397 天;</p> <p>(8) 中国证监会、中国人民银行规定的其他比例限制。</p>	<p>金托管资格的同一商业银行的存款, 不得超过基金资产净值的 5%;</p> <p>(3) 当货币市场基金前10名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的50%时, 货币市场基金投资组合的平均剩余期限不得超过60天, 平均剩余存续期不得超过120天; 投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于30%; 当货币市场基金前10名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的20%时, 货币市场基金投资组合的平均剩余期限不得超过90天, 平均剩余存续期不得超过180天; 投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于20%;</p> <p>(4) 投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 180 天, 但上述第 (3) 项另有约定的除外;</p> <p>(5) 不得与基金管理人的股东进行交易, 不得通过交易上的安排认为降低投资组合的平均剩余期限的真实天数;</p> <p>(6) 除发生巨额赎回的情况外, 基金投资组合中债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%; 因发生巨额赎回致使基金债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的, 应当在 5 个交易日内进行调整;</p> <p>(7) 基金持有的剩余期限不超过 397 天但剩余存续期超过 397 天</p>
--	---	---

		<p>的浮动利率债券的摊余成本总计不得超过当日基金资产净值的 20%；基金不得投资于以定期存款利率为基准利率的浮动利率债券；</p> <p>(8) 买断式回购融入基础债券的剩余期限不得超过 397 天；</p> <p>(9) 本基金管理人管理的全部货币市场基金投资于同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券，不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的10%；</p> <p>(10) 货币市场基金投资于主体信用评级低于AAA 的机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过10%，其中单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过2%；前述金融工具包括债券、非金融企业债务融资工具、银行存款、同业存单、相关机构作为原始权益人的资产支持证券及中国证监会认定的其他品种；</p> <p>货币市场基金拟投资于主体信用评级低于AA+的商业银行的银行存款与同业存单的，应当经基金管理人董事会审议批准，相关交易应当事先征得基金托管人的同意，并作为重大事项履行信息披露程序；</p> <p>(11) 货币市场基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的10%；因证券市场波动、证券停牌、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项所规定的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>(12) 本基金与私募类证券资管产</p>
--	--	---

		<p>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本基金合同约定的投资范围保持一致；</p> <p>(13) 中国证监会、中国人民银行规定的其他比例限制。</p>
二十三、基金财产的估值 (四)、估值方法		<p>增加：</p> <p>6、对于优选混合型基金和动力平衡基金，当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。</p>
二十三、基金财产的估值 (七)、暂停估值的情形		<p>增加：</p> <p>3、前一估值日本系列基金中任一基金的基金资产净值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时，经与基金托管人协商确认后，应当暂停该基金的估值；</p>
二十七、基金的信息披露 (四) 定期报告		<p>增加：</p> <p>5、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系列基金任一基金的基金份额比例达到或超过该基金基金总份额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该基金基金定期报告文件中“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本基金的特定风险，中国证监会认定的特殊情形除外。</p> <p>6、本系列基金持续运作过程中，基金管理人应在该基金的半年度报</p>

		<p>告、年度报告等文件中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。</p> <p>7、货币市场基金应当在年度报告、半年度报告中至少披露报告期末基金前10名基金份额持有人的类别、持有份额及占总份额的比例等信息。</p>
二十七、基金的信息披露 (五)、临时报告与公告		<p>增加：</p> <p>18、货币市场基金拟投资于主体信用评级低于AA+商业银行的银行存款与同业存单的；</p> <p>19、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> <p>20、基金管理人采用摆动定价机制对优选混合基金或动力平衡基金进行估值；</p>

三、托管协议

一、托管协议当事人 (一) 基金管理人	法定代表人：赵如冰	法定代表人：杨光裕
一、托管协议当事人 (二) 基金托管人	<p>名称：中国银行股份有限公司</p> <p>住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号</p> <p>法定代表人：田国立</p> <p>注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整</p> <p>经营范围：人民币存款、贷款、结算业务；居民储蓄业务；信托贷款、投资业务；金融</p>	<p>名称：中国银行股份有限公司</p> <p>住所：北京市西城区复兴门内大街1号</p> <p>法定代表人：陈四清</p> <p>成立时间：1983年10月31日</p> <p>基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号</p>

	<p>租赁业务；外汇存款；外汇汇款；外汇投资；在境内、外发行或代理发行外 币有价证券；贸易、非贸易结算；外币票据贴现；外汇放款；买卖或代理 买卖外汇及外币有价证券；境内、外外 汇借款；外汇及外币票据兑换；外汇担 保；保管箱业务；征信调查、咨询服务；基金托管业务。</p> <p>组织形式：股份有限公司 存续期间：持续经营</p>	<p>组织形式： 股份有限公司 注册资本： 人民币贰仟柒佰玖 拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹 佰玖拾伍元整</p> <p>经营范围： 吸收人民币存款；发 放短期、中期和长期贷款；办理结 算；办理票据贴现；发行金融债券； 代理发行、代理兑付、承销政府债 券；买卖政府债券；从事同业拆借； 提供信用证服务及担保；代理收付 款项及代理保险业务；提供保险箱 服务；外汇存款；外汇贷款；外汇 汇款；外汇兑换；国际结算；同业 外汇拆借；外汇票据的承兑和贴 现；外汇借款；外汇担保；结汇、 售汇；发行和代理发行股票以外的 外币有价证券；买卖和代理买卖股 票以外的外币有价证券；自营外汇 买卖；代客外汇买卖；外汇信用卡 的发行和代理国外信用卡的发行 及付款；资信调查、咨询、见证业 务；组织或参加银团贷款；国际贵 金属买卖；海外分支机构经营与当 地法律许可的一切银行业务；在港 澳地区的分行依据当地法令可发 行或参与代理发行当地货币；经中 国人民银行批准的其他业务。</p> <p>存续期间： 持续经营</p>
<p>二、订立托 管协议 的依 据、目 的和原 则</p>	<p>(一) 依据 本协议依据《中华人民共和国民法通 则》、《中华人民共和国信托法》(以 下简称“信托法”)、《中华人民共和 国合同法》、《证券投资基金管理暂行 办法》(以下简称《暂行办法》)及其 实施准则、《开放式证券投资基金试 点办法》(以下简称《试点办法》)、 及其他有关法律、法规与《景顺长城</p>	<p>(一) 依据 本协议依据《中华人民共和国民法 通则》、《中华人民共和国信托法》 (以下简称“信托法”)、 《中华人民共和国合同法》、《证券 投资基金管理暂行办法》(以下简 称《暂行办法》)及其实施准则、《开 放式证券投资基金试点办法》(以</p>

	景系列开放式证券投资基金基金契约》(以下简称《基金契约》)制订。	下简称《试点办法》) 《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》、及其他有关法律、法规与《景顺长城景系列开放式证券投资基金基金合同》(以下简称《基金合同》)制订。
三、基金托管人和基金管理人之间的业务监督、核查	(一)基金托管人对基金管理人的业务监督、核查 根据《暂行办法》、《试点办法》、《基金契约》和有关证券法规的规定,基金托管人应对基金管理人就本系列基金的各基金资产的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金的申购与赎回、基金收益分配等行为的合法性、合规性分别进行监督和核查。	(一)基金托管人对基金管理人的业务监督、核查 根据《暂行办法》、《试点办法》、《基金合同》和有关证券法规的规定,基金托管人应对基金管理人就本系列基金的各基金资产的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金的申购与赎回、基金收益分配等行为的合法性、合规性分别进行监督和核查。
三、基金托管人和基金管理人之间的业务监督、核查		增加: 1、 根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》,基金托管人对基金管理人的业务监督、核查增加了以下监督事项:适用于优选混合型基金、动力平衡基金和货币市场基金的: (1) 本基金管理人管理且由本托管人托管的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票,不超过该上市公司可流通股票的15%;本基金管理人管理且由本托管人托管的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不超过该上

		<p>上市公司可流通股票的30%；</p> <p>(2) 优选混合型基金或动力平衡基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的15%；因证券市场波动、证券停牌、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项所规定的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>(3) 本系列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投资范围保持一致；本基金管理人承诺本系列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与基金合同约定的投资范围保持一致，并承担由于不一致所导致的风险或损失。</p> <p>仅适用于货币市场基金的：</p> <p>(1) 当货币市场基金前10名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的50%时，货币市场基金投资组合的平均剩余期限不得超过60天，平均剩余存续期不得超过120天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于30%；当货币市场基金前10名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的20%时，货币市场基金投资组合的平均剩余期限不</p>
--	--	---

		<p>得超过90天，平均剩余存续期不得超过180天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于20%；</p> <p>(2) 投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过180天，但上述第(1)项另有约定的除外；</p> <p>(3) 本基金管理人管理且由本托管人托管的全部货币市场基金投资于同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券，不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的10%；</p> <p>(4) 货币市场基金投资于主体信用评级低于AAA的机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过10%，其中单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过2%；前述金融工具包括债券、非金融企业债务融资工具、银行存款、同业存单、相关机构作为原始权益人的资产支持证券及中国证监会认定的其他品种；</p> <p>(5) 货币市场基金拟投资于主体信用评级低于AA+的商业银行的银行存款与同业存单的，应当经基金管理人董事会审议批准，相关交易应当事先征得基金托管人的同意，并作为重大事项履行信息披露程序；</p> <p>(6) 货币市场基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不</p>
--	--	---

		<p>超过基金资产的10%；因证券市场波动、证券停牌、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项所规定的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>（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；本基金管理人承诺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与基金合同约定的投资范围保持一致，并承担由于不一致所导致的风险或损失。</p>
	同步将托管协议中涉及“《基金契约》”表述对应修改为“《基金合同》”。	

关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改 基金合同、托管协议的内容说明

景顺长城上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金

一、 基金合同修改内容

章节	原基金合同	修改内容
一、 前言	<p>2、 订立本基金合同的依据</p> <p>订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法通则》、《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》）、《证券投资基金运作管理</p>	<p>2、 订立本基金合同的依据</p> <p>订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法通则》、《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》）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、</p>

	<p>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》)和《证券投资基金销售管理办法》(以下简称《销售办法》)及其他法律法规的有关规定。</p>	<p>《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《流动性规定》)和《证券投资基金销售管理办法》(以下简称《销售办法》)及其他法律法规的有关规定。</p>
<p>二、 释义</p>		<p>增加：</p> <p>《流动性规定》：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；</p> <p>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>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>六、基金份额的申购、赎回与转换</p> <p>(五) 申购与赎回的数额限制</p>		<p>增加:</p> <p>3、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。具体请参见相关公告。</p>
<p>六、基金份额的申购、赎回与转换</p> <p>(七) 申购和赎回的费用及其用途</p>	<p>4、本基金的申购费用由申购人承担,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用,不列入基金财产。</p> <p>本基金的赎回费用由基金份额持有人承担,其中不低于 25%的部分归入基金财产(具体比例见招募说明书),其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。</p>	<p>4、本基金的申购费用由申购人承担,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用,不列入基金财产。</p> <p>本基金的赎回费用由基金份额持有人承担,其中本基金对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5%的赎回费,并将上述赎回费全额计入基金财产。对持续持有期不少于 7 日的投资者收取的赎回费,不低于 25%的部分归入基金财产(具体比例见招募说明书),未归入基金财产部分用于支付注册登记费等相关手续费。</p>
<p>六、基金份额的申购、赎回与转换</p> <p>(七) 申购和赎回的费用及其用途</p>		<p>增加:</p> <p>7、当发生大额申购或赎回情形时,在履行适当程序后,基金管理人可以采用摆动定价机制,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。</p>
<p>六、基金份额的申购、赎回与转换</p>		<p>增加:</p> <p>(3) 如果基金发生巨额赎回,在单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额 20%以上的赎回申请的情形下,基</p>

<p>(九)巨额赎回的认定及处理方式</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p>		<p>金管理人可以对该基金份额持有人超过20%以上的部分延期办理赎回申请。对于当日非延期的赎回申请，应当按单个账户非延期赎回申请量占非延期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。</p>
---	--	--

<p>六、基金份额的申购、赎回与转换</p> <p>(十)拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理</p>	<p>(5) 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况；</p>	<p>(5) 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况；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；</p>
<p>六、基金份额的申购、赎回与转换</p> <p>(十)拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理</p>	<p>2、在以下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请：</p>	<p>2、在以下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请或延缓支付款项：</p>
<p>六、基金份额的申购、赎回与转换</p> <p>(十)拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理</p>	<p>(4) 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值的情况；</p>	<p>(4) 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值的情况；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>八、基金合同当事人及权利义务</p> <p>(一)基金管理人</p>	<p>法定代表人：赵如冰</p>	<p>法定代表人：杨光裕</p>
<p>八、基金合同当事人</p>	<p>1、基金托管人基本情况</p>	<p>1、基金托管人基本情况</p>

<p>及权利义 务</p> <p>(二)基金 托管人</p>	<p>名称：中国银行股份有限公司</p> <p>住所：北京市复兴门内大街 1 号</p> <p>法定代表人：肖钢</p> <p>成立日期：1983 年 10 月 31 日</p> <p>基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号</p> <p>组织形式：股份有限公司</p> <p>注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整</p> <p>存续期间：持续经营</p> <p>经营范围：吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外币兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股</p>	<p>名称：中国银行股份有限公司</p> <p>住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号</p> <p>法定代表人：陈四清</p> <p>成立时间：1983 年 10 月 31 日</p> <p>批准设立机关和批准设立文号：国务院批转中国人民银行《关于改革中国银行体制的请示报告》（国发[1979]72 号）</p> <p>组织形式：股份有限公司</p> <p>注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整</p> <p>存续期间：持续经营</p> <p>基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字【1998】24 号</p>
---	---	---

	票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代营外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；经中国人民银行批准的其他业务。	
十四、基金的投资	<p>(二) 投资范围</p> <p>本基金以目标 ETF、标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象，其中投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%；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%；同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于新股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、权证及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定，该部分资产比例不高于基金资产净值的 5%。</p>	<p>(二) 投资范围</p> <p>本基金以目标 ETF、标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象，其中投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%；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、存出保证金和应收申购款等；同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于新股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、权证及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定，该部分资产比例不高于基金资产净值的 5%。</p>
十四、基金的投资 (四) 投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金主要通过投资目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股来进行被动式指数化投资，达到</p>	<p>2、资产配置策略</p> <p>本基金主要通过投资目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股来进行被动式指数化投资，达到跟踪指数的目标。因此，</p>

	<p>跟踪指数的目标。因此，本基金投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%；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%；中国证监会允许的其他金融工具的投资比例不高于基金资产净值的 5%。</p>	<p>本基金投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%；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、存出保证金和应收申购款等；中国证监会允许的其他金融工具的投资比例不高于基金资产净值的 5%。</p>
<p>十四、基金的投资 (七)投资禁止行为与限制</p>	<p>(1) 基金资产中投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；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%；中国证监会允许的其他金融工具的投资比例不高于基金资产净值的 5%；</p>	<p>(1) 基金资产中投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；</p> <p>(2) 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、存出保证金和应收申购款等；中国证监会允许的其他金融工具的投资比例不高于基金资产净值的 5%；</p>
<p>十四、基金的投资</p>		<p>增加：</p> <p>(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述所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>(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本基金合同约定的投资范围保持一致；</p>

<p>十四、 基金的投资</p>	<p>(八) 投资组合比例调整</p> <p>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。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、目标 ETF 估值依法调整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，基金管理人应当在十个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。</p>	<p>(八) 投资组合比例调整</p> <p>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。除基金投资组合比例限制中第(2)、(5)、(6)项外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、目标 ETF 估值依法调整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，基金管理人应当在十个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。</p>
------------------	---	--

<p>十七、基金资产的估值</p> <p>(四)估值方法</p>		<p>增加：</p> <p>6、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。</p>
<p>十七、基金资产的估值</p> <p>(六)暂停估值的情形</p>		<p>增加：</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后，应当暂停估值；</p>
<p>十七、基金资产的估值</p>	<p>(九) 特殊情形的处理</p> <p>1、基金管理人按本条第（四）款有关估值方法规定的第 6 项条款进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。</p>	<p>(九) 特殊情形的处理</p> <p>1、基金管理人按本条第（四）款有关估值方法规定的第 7 项条款进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。</p>
<p>二十一、基金的信息披露</p> <p>(五)定期报告</p>		<p>增加：</p> <p>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。</p> <p>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例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文件中“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本基金的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。</p>

<p>二十一、基金的信息披露</p> <p>(六)临时报告与公告</p>		<p>增加：</p> <p>27、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；</p> <p>28、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；</p>
<p>二十九、基金合同内容摘要</p>		<p>根据基金合同正文修改</p>

二、托管协议

章节	原托管协议	修改内容
----	-------	------

<p>一、托管协议当事人</p>	<p>法定代表人：赵如冰</p>	<p>法定代表人：杨光裕</p>
<p>一、托管协议当事人</p>	<p>名称：中国银行股份有限公司</p> <p>住所：北京市西城区复兴门内大街1号</p> <p>法定代表人：肖钢</p> <p>成立时间：1983年10月31日</p> <p>基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号</p> <p>组织形式：股份有限公司</p> <p>注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整</p> <p>经营范围：吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业</p>	<p>名称：中国银行股份有限公司</p> <p>住所：北京市西城区复兴门内大街1号</p> <p>法定代表人：陈四清</p> <p>成立时间：1983年10月31日</p> <p>基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号</p> <p>组织形式：股份有限公司</p> <p>注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整</p> <p>经营范围：吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇兑换；国际结</p>

	<p>务；提供保险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当</p>	<p>算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；经中国人民银行批准的其他业务。</p> <p>存续期间： 持续经营</p>
--	--	--

	<p>地货币；经中国 人民银行批准 的其他业务。</p> <p>存续期间： 持续经营</p>	
--	--	--

<p>二、托管协议的依据、目的、原则和解释</p>	<p>(一) 依据</p> <p>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》”)、《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》”)及其他有关法律法规与《景顺长城上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)订立。</p>	<p>(一) 依据</p> <p>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》”)、《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》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其他有关法律法规与《景顺长城上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)订立。</p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>	<p>1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。本基金以目标 ETF、标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象，其中投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%；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%；同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于新股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、权证及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定，该部分资产比例不高于基金资产净值的 5%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范</p>	<p>1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。本基金以目标 ETF、标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象，其中投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%；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、存出保证金和应收申购款等；同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于新股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、权证及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定，该部分资产比例不高于基金资产净值的 5%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p>

	围。	
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	<p>2、对基金投融资比例进行监督。</p> <p>(2) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过基金总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；</p>	<p>2、对基金投融资比例进行监督。</p> <p>(2) 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、存出保证金和应收申购款等；中国证监会允许的其他金融工具的投资比例不高于基金资产净值的 5%；</p>
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查		<p>增加：</p> <p>(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述所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>(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。本基金管理人承诺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与基金合同约定的投资范围保持一致，并承担由于不一致所导致的风险或损失；</p>

关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改

基金合同、托管协议的内容说明

上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金

一 基金合同修改内容

章节	修订前	修订后
一、前言	<p>2、订立本基金合同的依据</p> <p>订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法通则》、《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》）、《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》）和《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）及其他法律法规的有关规定。</p>	<p>2、订立本基金合同的依据</p> <p>订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法通则》、《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》）、《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》）、《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《流动性规定》）和《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）及其他法律法规的有关规定。</p>
二、释义		<p>增加：</p> <p>《流动性规定》：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；</p> <p>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</p>

		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。
八、基金份额的申购与赎回 (五) 申购与赎回的数额限制		<p>增加:</p> <p>2、基金管理人可以规定单个投资者累计持有的基金份额上限, 具体规定参见招募说明书或其他公告。</p> <p>3、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份额上限、基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购或限制基金当日最大申购份额等措施, 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。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。具体请参见相关公告。</p>
八、基金份额的申购与赎回 (七) 拒绝或暂停申购赎回的情形及处理	<p>3、上海证券交易所、申购赎回代理券商、注册登记机构等因异常情况无法办理申购或赎回, 或者指数编制单位、上海证券交易所等因异常情况使申购赎回清单无法编制或编制不当。</p> <p>4、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况;</p>	<p>3、上海证券交易所、申购赎回代理券商、注册登记机构等因异常情况无法办理申购或赎回, 或者指数编制单位、上海证券交易所等因异常情况使申购赎回清单无法编制或编制不当;</p> <p>4、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况的, 基金管理人可以暂停接受投资者的申购、赎回申请。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</p>

		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对价或暂停接受基金申购、赎回申请的措施；
八、基金份额的申购与赎回 (七) 拒绝或暂停申购赎回的情形及处理	发生上述情形之一且基金管理人决定暂停申购或赎回的，基金管理人应在当日报中国证监会备案。本基金因除上述第 6 项之外的其他情形暂停申购或赎回的，基金管理人应当在指定媒体刊登暂停申购或赎回公告。已确认的赎回申请，基金管理人应当足额兑付。在暂停申购、赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购、赎回业务的办理，并予以公告。	发生上述情形之一且基金管理人决定暂停申购、赎回或延缓支付赎回对价的，基金管理人应在当日报中国证监会备案。本基金因除上述第 6 项之外的其他情形暂停申购或赎回的，基金管理人应当在指定媒体刊登暂停申购或赎回公告。已确认的赎回申请，基金管理人应当足额兑付。在暂停申购、赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购、赎回业务的办理，并予以公告。
十一、基金合同当事人及其权利义务 (一) 基金管理人	法定代表人：赵如冰	法定代表人：杨光裕
十一、基金合同当事人及其权利义务 (二) 基金托管人	<p>1、基金托管人基本情况</p> <p>名称：中国银行股份有限公司</p> <p>住所：北京市复兴门内大街 1 号</p> <p>法定代表人：肖钢</p> <p>成立日期：1983 年 10 月 31 日</p> <p>基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号</p> <p>组织形式：股份有限公司</p> <p>注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾</p>	<p>1、基金托管人基本情况</p> <p>名称：中国银行股份有限公司</p> <p>住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号</p> <p>法定代表人：陈四清</p> <p>成立时间：1983 年 10 月 31 日</p> <p>基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号</p> <p>组织形式：股份有限公司</p> <p>注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍</p>

	<p style="text-align: center;">伍元整</p> <p>存续期间：持续经营</p> <p>经营范围：吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外币兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代营外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；经中国人民银行批准的其他业务。</p>	<p>元整</p> <p>经营范围： 吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依</p>
--	--	--

		<p>据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；经中国人民银行批准的其他业务。</p> <p>存续期间： 持续经营</p>
十七、基金的投资 (八) 投资禁止行为与限制		<p>增加：</p> <p>(3) 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述所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>(4) 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>
十七、基金的投资	<p>(九) 投资组合比例调整</p> <p>基金管理人应当自基金合同生效之日起三个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。因证券市场波动、上市公司合并、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，基金管理人应当在十个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。</p>	<p>(九) 投资组合比例调整</p> <p>基金管理人应当自基金合同生效之日起三个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。除基金投资组合比例限制中第 (3)、(4) 项外，因证券市场波动、上市公司合并、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，基金管理人应当在十个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定</p>

		时，从其规定。
二十、基金资产的估值 (六) 暂停估值的情形		增加： 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一致后，应当暂停估值；
二十四、基金的信息披露 (八) 定期报告		增加： 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基金份额比例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。
二十四、基金的信息披露 (九) 临时报告与公告		增加： 27、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；
三十、基金合同内容摘要		根据基金合同正文对应修改

二 托管协议修改内容

章节	修订前	修订后
一、托管协议当事人	(一) 基金管理人(或简称“管理人”)	(一) 基金管理人(或简称“管理人”)

	法定代表人：赵如冰	法定代表人：杨光裕
一、托管协议当事人	<p>(二) 基金托管人 (或简称“托管人”)</p> <p>名称： 中国银行股份有限公司</p> <p>住所： 北京市西城区复兴门内大街 1 号</p> <p>法定代表人： 肖钢</p> <p>成立时间： 1983 年 10 月 31 日</p> <p>基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号</p> <p>组织形式： 股份有限公司</p> <p>注册资本： 人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整</p> <p>经营范围： 吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险</p>	<p>(二) 基金托管人 (或简称“托管人”)</p> <p>名称： 中国银行股份有限公司</p> <p>住所： 北京市西城区复兴门内大街 1 号</p> <p>法定代表人： 陈四清</p> <p>成立时间： 1983 年 10 月 31 日</p> <p>基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号</p> <p>组织形式： 股份有限公司</p> <p>注册资本： 人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整</p> <p>经营范围： 吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇兑换；国际结算；</p>

	<p>箱服务； 外汇存款； 外汇贷款； 外汇汇款； 外汇兑换； 国际结算； 同业外汇拆借； 外汇票据的承兑和贴现； 外汇借款； 外汇担保； 结汇、 售汇； 发行和代理发行股票以外的外币有价证券； 买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券； 自营外汇买卖； 代客外汇买卖； 外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款； 资信调查、 咨询、 见证业务； 组织或参加银团贷款； 国际贵金属买卖； 海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务； 在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币； 经中国人民银行批准的其他业务。</p> <p>存续期间： 持续经营</p>	<p>同业外汇拆借； 外汇票据的承兑和贴现； 外汇借款； 外汇担保； 结汇、 售汇； 发行和代理发行股票以外的外币有价证券； 买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券； 自营外汇买卖； 代客外汇买卖； 外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款； 资信调查、 咨询、 见证业务； 组织或参加银团贷款； 国际贵金属买卖； 海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务； 在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币； 经中国人民银行批准的其他业务。</p> <p>存续期间： 持续经营</p>
--	---	--

<p>二、托管协议的依据、目的、原则和解释</p>	<p>(一) 依据</p> <p>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》”)、《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》”)及其他有关法律法规与《上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)订立。</p>	<p>(一) 依据</p> <p>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》”)、《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》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其他有关法律法规与《上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)订立。</p>
---------------------------	---	--

<p>三、 基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>		<p>增加：</p> <p>(3) 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述所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>(4) 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；本基金管理人承诺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与本基金基金合同约定的投资范围保持一致，并承担由于不一致所导致的风险或损失；</p>
-----------------------------------	--	--

关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改 基金合同、托管协议的内容说明

景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数证券投资基金

一 基金合同修订内容

章节	修订前	修订后
<p>第一部分 前言 一、订立</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</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</p>

<p>本基金合同的目的、依据和原则</p>	<p>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》”)、《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>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》”)、《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“《流动性规定》”)和其他有关法律法规。</p>
<p>第二部分 释义</p>		<p>增加:</p> <p>66、《流动性规定》: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</p> <p>67、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>第八部分 基金份额 的申购与 赎回</p>	<p>五、申购和赎回的数额限制</p> <p>投资人申购、赎回的基金份额需为基金最小申购、赎回单位的整数倍。最小申购、赎回单位由基金管理人综合考虑对投资组合跟踪误差的影响以及市场需求等因素确定，并在招募说明书或其他公告中列明。</p> <p>基金管理人可根据基金运作情况、市场变化以及投资人需求等因素对基金的最小申购、赎回单位进行调整并提前公告。</p>	<p>五、申购和赎回的数额限制</p> <p>1、投资人申购、赎回的基金份额需为基金最小申购、赎回单位的整数倍。最小申购、赎回单位由基金管理人综合考虑对投资组合跟踪误差的影响以及市场需求等因素确定，并在招募说明书或其他公告中列明。</p> <p>2、基金管理人可以规定单个投资者累计持有的基金份额上限，具体规定参见招募说明书或其他公告。</p> <p>3、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份额上限、基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购或限制基金当日最大申购份额等措施，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。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。具体请参见相关公告。</p> <p>4、基金管理人可根据基金运作情况、市场变化以及投资人需求等因素对基金的最小申购、赎回单位进行调整并提前公告。</p>
<p>第八部分</p>	<p>七、拒绝或暂停申购、赎回</p>	<p>七、拒绝或暂停申购、赎回的</p>

<p>基金份额的申购与赎回</p>	<p>的情形</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。</p>	<p>情形</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况的，基金管理人可以暂停接受投资者的申购、赎回申请。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、赎回申请或延缓支付赎回对价的措施。</p>
<p>第八部分基金份额的申购与赎回</p>	<p>发生上述第 1-7、9-11 项情形之一且基金管理人决定暂停基金投资者的申购、赎回时，基金管理人应当及时公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购对价将退还给投资人。在暂停申购、赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购、赎回业务的办理，并依照《信息披露办法》有关规定在指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个开放日的基金份额净值。</p> <p>巨额赎回指本基金单个开放日，基金净赎回申请(赎回申请份额总数扣除申购申请份额</p>	<p>发生上述第 1-7、9-11 项情形之一且基金管理人决定暂停基金投资者的申购、赎回或延缓支付赎回对价时，基金管理人应当及时公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购对价将退还给投资人。在暂停申购、赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购、赎回业务的办理，并依照《信息披露办法》有关规定在指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个开放日的基金份额净值。</p> <p>巨额赎回指本基金单个开放日，基金净赎回申请(赎回申请份额总数扣除申购申请份额总数的余</p>

	总数的余额)超过上一开放日基金总份额的 10%	额)超过上一开放日基金总份额的 10%。
第九部分 基金合同 当事人及 权利义务 一、基金 管理人	法定代表人：赵如冰	法定代表人：杨光裕
第九部分 基金合同 当事人及 权利义务 二、基金 托管人	<p>(一) 基金托管人简况</p> <p>名称：中国银行股份有限公司</p> <p>住所：北京市复兴门内大街 1 号</p> <p>法定代表人：田国立</p> <p>成立时间：1983 年 10 月 31 日</p> <p>批准设立机关和批准设立文号：国务院批转中国人民银行《关于改革中国银行体制的请示报告》(国发[1979]72 号)。</p> <p>组织形式：股份有限公司</p> <p>注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整</p> <p>存续期间：持续经营</p> <p>基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字【1998】24 号</p>	<p>(一) 基金托管人简况</p> <p>名称：中国银行股份有限公司</p> <p>住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号</p> <p>法定代表人：陈四清</p> <p>成立时间：1983 年 10 月 31 日</p> <p>批准设立机关和批准设立文号：国务院批转中国人民银行《关于改革中国银行体制的请示报告》(国发[1979]72 号)</p> <p>组织形式：股份有限公司</p> <p>注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整</p> <p>存续期间：持续经营</p> <p>基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字【1998】24 号</p>
第十四部分 基金 的投资 七、投资	12.6 本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳	12.6 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

限制	的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金;	证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;
第十四部分 基金的投资 七、投资限制		<p>增加:</p> <p>(13) 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述所规定比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;</p> <p>(14) 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>
第十四部分 基金的投资 七、投资限制	<p>因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制、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。法律法规另有规定的,从其规定。</p>	<p>除上述(9)、(13)、(14)项及 12.6 外,因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制、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。法律法规另有规定的,从其规定。</p>

<p>第十六部分 基金资产的估值</p> <p>六、暂停估值的情形</p>		<p>增加：</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后，应当暂停估值；</p>
<p>第二十部分 基金的信息披露</p> <p>五、公开披露的基金信息</p> <p>（八）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</p>		<p>增加：</p> <p>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。</p> <p>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例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。</p>
<p>第二十部分 基金的信息披露</p> <p>五、公开披露的基金信息</p> <p>（九）临时报告</p>		<p>增加：</p> <p>29、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；</p>
<p>第二十六部分 基</p>		<p>对应基金合同正文内容进行同步修</p>

金合同内 容摘要		改。
-------------	--	----

二 托管协议修订内容

章节	修订前	修订后
----	-----	-----

<p>一、 托管协议 当事人</p>	<p>(一) 基金管理人 (或简称“管理人”)</p> <p>法定代表人: 赵如冰</p>	<p>(一) 基金管理人 (或简称“管理人”)</p> <p>法定代表人: 杨光裕</p>
<p>一、 托管协议 当事人</p>	<p>(二) 基金托管人 (或简称“托管人”)</p> <p>名称: 中国银行股份有限公司</p> <p>住所: 北京市西城区复兴门内大街 1 号</p> <p>法定代表人: 田国立</p> <p>成立时间: 1983 年 10 月 31 日</p> <p>批准设立机关和批准设立文号: 国务院批转中国人民银行《关于改革中国银行体制的请示报告》(国发[1979]72 号)。</p> <p>基金托管业务批准文号: 中国证监会证监基字【1998】24 号</p> <p>组织形式: 股份有限公司</p> <p>注册资本: 人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整</p> <p>经营范围: 吸收人民币存款; 发放短期、中期和长期贷款; 办理结算; 办理票据贴</p>	<p>(二) 基金托管人 (或简称“托管人”)</p> <p>名称: 中国银行股份有限公司</p> <p>住所: 北京市西城区复兴门内大街 1 号</p> <p>法定代表人: 陈四清</p> <p>成立时间: 1983 年 10 月 31 日</p> <p>基金托管业务批准文号: 中国证监会证监基字【1998】24 号</p> <p>组织形式: 股份有限公司</p> <p>注册资本: 人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整</p> <p>经营范围: 吸收人民币存款; 发放短期、中期和长期贷款; 办理结算; 办理票据贴现; 发行金融债券; 代理发行、代理兑付、承销政府债券; 买卖政府债券; 从事同业拆借; 提供信用证服务及担保; 代理收付款项及代理</p>

	<p>现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银</p>	<p>保险业务；提供保险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；经中国人民银行批准的其他业务。</p> <p>存续期间： 持续经营</p>
--	--	--

	<p>行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；经中国人民银行批准的其他业务。</p> <p>存续期间： 持续经营</p>	
--	---	--

<p>二、 托管协议的 依据、 目的、原 则和解释</p>	<p>(一) 依据</p> <p>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》”)、《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》”)及其他有关法律法规与《景顺长城中证 TMT 150 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)订立。</p>	<p>(一) 依据</p> <p>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》”)、《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》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其他有关法律法规与《景顺长城中证 TMT 150 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)订立。</p>
<p>三、 基金托管 人对基金 管理人的 业务监督 和核查</p>	<p>12.6 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,应当保持不低于交易保证金一倍的现金;</p>	<p>12.6 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,应当保持不低于交易保证金一倍的现金,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>增加:</p> <p>(13) 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述所规定比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;</p> <p>(14) 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</p>

		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。本基金管理人承诺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与基金合同约定的投资范围保持一致，并承担由于不一致所导致的风险或损失；
三、 基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制、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。法律法规另有规定的，从其规定。	除上述（9）、（13）、（14）项及 12.6 外，因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制、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。法律法规另有规定的，从其规定。

关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改基金合同、托管协议的内容说明

景顺长城稳定收益债券型证券投资基金

一、 基金合同修订内容

章节	修订前	修订后
一、前言	（一）订立《景顺长城稳定收益债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“本基金合同”）的目的、依据和原	（一）订立《景顺长城稳定收益债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“本基金合同”）的目的、依据和

	<p>则</p> <p>2、订立本基金合同的依据</p> <p>订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法通则》、《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》）、《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》）和《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）及其他法律法规的有关规定。</p>	<p>原则</p> <p>2、订立本基金合同的依据</p> <p>订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法通则》、《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》）、《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》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《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》）及其他法律法规的有关规定。</p>
二、释义		<p>增加：</p> <p>《流动性风险管理规定》：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</p> <p>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>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>
六、基金份额的申购、赎回		<p>（五） 申购与赎回的数额限制</p> <p>增加：</p> <p>3、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。具体请参见相关公告。</p>
六、基金份额的申购、赎回	<p>（七） 申购和赎回的费用及其用途</p> <p>4、本基金的申购费用由申购人承担，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金财</p>	<p>（七） 申购和赎回的费用及其用途</p> <p>4、本基金的申购费用由申购人承担，主要用于本基金的市场推广、销</p>

	<p>产。</p> <p>本基金的赎回费用由基金份额持有人承担，其中不低于 25% 的部分归入基金财产（具体比例见招募说明书），其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。</p>	<p>售、注册登记等各项费用，不列入基金财产。</p> <p>本基金的赎回费用由基金份额持有人承担，其中对于持续持有期少于 7 日的投资者，本基金将收取不低于 1.5% 的赎回费并全额计入基金财产，对于持续持有期不少于 7 日的投资者，不低于 25% 的部分归入基金财产（具体比例见招募说明书），未归入基金财产的部分用于支付注册登记费等相关手续费。</p>
六、基金份额的申购、赎回		<p>增加：</p> <p>6、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，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、自律组织的规定。</p>
六、基金份额的申购、赎回	<p>（九）巨额赎回的认定及处理方式</p>	<p>（九）巨额赎回的认定及处理方式</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>增加：</p> <p>（3）如果基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人超过上一日基金总份额 20% 以上的赎回申请的情形下，基金管理人可以对该基金份额持有人超过 20% 以上的部分延期办理赎回申请。对于当日非延期的赎回申请，应当按单个账户非延期赎回申请量占非延期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。</p>
六、基金份额的申购、赎回	<p>（十）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>（1）因不可抗力导致基金管理人无法受理投资者的申购申请；</p> <p>（2）证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金财产净值；</p>	<p>（十）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>（1）因不可抗力导致基金管理人无法受理投资者的申购申请；</p> <p>（2）证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当</p>

	<p>(3) 发生本基金合同规定的暂停基金财产估值情况；</p> <p>(4) 基金财产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益的情形；</p> <p>(5) 本基金管理人、基金托管人、基金销售机构或注册登记机构因技术故障或异常情况导致基金销售系统、注册登记系统、基金会计系统或证券结算登记系统无法正常运行；</p> <p>(6) 基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔申购；</p> <p>(7) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。</p> <p>基金管理人决定拒绝或暂停接受某些投资者的申购申请时，申购款项将退回投资者账户。发生上述(1)到(5)及第(7)项暂停申购情形时，基金管理人应当按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。在暂停申购的情形消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理并依法公告。</p>	<p>日基金财产净值；</p> <p>(3) 发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受申购申请；</p> <p>(4) 基金财产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益的情形；</p> <p>(5) 本基金管理人、基金托管人、基金销售机构或注册登记机构因技术故障或异常情况导致基金销售系统、注册登记系统、基金会计系统或证券结算登记系统无法正常运行；</p> <p>(6) 基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔申购；</p> <p>(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%，或者变相规避 50%集中度的情形时；</p> <p>(8) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。</p> <p>基金管理人决定全部或部分拒绝或者暂停接受某些投资者的申购申请时，被拒绝的申购款项将退回投资者账户。发生上述(1)到(5)及第(8)项暂停申购情形时，基金管理人应当按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。在暂停申购的情形消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理并依法公告。</p>
<p>六、基金份额的申购、赎回</p>	<p>2、在以下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请：</p> <p>(1) 因不可抗力导致基金管理人无法支付赎回款项；</p> <p>(2) 证券交易场所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金财产净值；</p> <p>(3) 基金连续发生巨额赎回，根据本基金合同规定，可以暂停接受赎回申请的情况；</p> <p>(4) 发生本基金合同规定的暂停基金财产估值的情况；</p> <p>(5) 基金管理人、基金托管人、基金销售机构或注册登记机构因技术故障或异常情况导致基金销售系统、注册登记系统、基金会计系统或证券结算</p>	<p>2、在以下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请：</p> <p>(1) 因不可抗力导致基金管理人无法支付赎回款项；</p> <p>(2) 证券交易场所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金财产净值；</p> <p>(3) 基金连续发生巨额赎回，根据本基金合同规定，可以暂停接受赎回申请的情况；</p> <p>(4) 发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，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。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</p>

	<p>登记系统无法正常运行；</p> <p>(6) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。</p>	<p>允价值存在重大不确定性，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；</p> <p>(5) 基金管理人、基金托管人、基金销售机构或注册登记机构因技术故障或异常情况导致基金销售系统、注册登记系统、基金会计系统或证券结算登记系统无法正常运行；</p> <p>(6) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。</p>
八、基金合同当事人及其权利义务	<p>(一) 基金管理人</p> <p>1、基金管理人基本情况</p> <p>法定代表人：赵如冰</p>	<p>(一) 基金管理人</p> <p>1、基金管理人基本情况</p> <p>法定代表人：杨光裕</p>
八、基金合同当事人及其权利义务	<p>(二) 基金托管人</p> <p>1、基金托管人基本情况</p> <p>名称：中国银行股份有限公司</p> <p>住所：北京市复兴门内大街1号</p> <p>法定代表人：肖钢</p> <p>成立日期：1983年10月31日</p> <p>基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号</p> <p>组织形式：股份有限公司</p> <p>注册资本：人民币贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰仟零玖元</p> <p>存续期间：持续经营</p>	<p>(二) 基金托管人</p> <p>1、基金托管人基本情况</p> <p>名称：中国银行股份有限公司</p> <p>住所：北京市复兴门内大街1号</p> <p>法定代表人：陈四清</p> <p>成立日期：1983年10月31日</p> <p>基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号</p> <p>组织形式：股份有限公司</p> <p>注册资本：人民币贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰仟零玖元</p> <p>存续期间：持续经营</p>
十四、基金的投资	<p>(二) 投资范围</p> <p>本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、央行票据、企业（公司）债、可转换债券（含分离型可转换债券）、资产支持证券、债券回购、A股股票（包括中小板、创业板及其它经中国证监会核准上市的股票）以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。本基金不主动从二级市场买入权益类资产，仅限于参与和持有二级市场新股申购、增发、可转债转股、所持股票配售及派发、权证行权所形成的股票，以及所持股票派发和可分离债券分离所形成的权证等其它所有非直接从二级市场获得的权益资产。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p> <p>本基金投资组合的比例范围为：本基金投资于债券类资产（含可转换债券）的比例不低于基金资产的80%，投资于股票、权证等权益类资产的比例不超过基金资产的20%，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不</p>	<p>(二) 投资范围</p> <p>本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、央行票据、企业（公司）债、可转换债券（含分离型可转换债券）、资产支持证券、债券回购、A股股票（包括中小板、创业板及其它经中国证监会核准上市的股票）以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。本基金不主动从二级市场买入权益类资产，仅限于参与和持有二级市场新股申购、增发、可转债转股、所持股票配售及派发、权证行权所形成的股票，以及所持股票派发和可分离债券分离所形成的权证等其它所有非直接从二级市场获得的权益资产。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p> <p>本基金投资组合的比例范围为：本基金投资于债券类资产（含可转换债券）的比例不低于基金资产的80%，投资于股票、权证等权益类资产的比例不超过基金资产的20%，持有现金</p>

	低于基金资产净值的 5%。	或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。
十四、基金的投资	<p>(八) 投资禁止行为与限制</p> <p>2、基金投资组合比例限制</p> <p>(5) 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>(八) 投资禁止行为与限制</p> <p>2、基金投资组合比例限制</p> <p>(5) 持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；</p>
十四、基金的投资		<p>增加：</p> <p>(9) 本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不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，不超过该上市公司可流通股票的 30%；</p> <p>(10) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 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项所规定的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>(11) 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投资范围保持一致；</p>
十四、基金的投资	<p>(九) 投资组合比例调整</p> <p>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。因证券市场波动、上市公司合并、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，基金管理人应当在十个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。</p>	<p>(九) 投资组合比例调整</p> <p>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。除上述“(八) 投资禁止行为与限制”中“2、基金投资组合比例限制”部分第(5)、(8)、(10)、(11)项外，因证券市场波动、上市公司合并、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，基金管理人应当在十个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。</p>
十七、基金财产的估值	(四) 估值方法	<p>(四) 估值方法</p> <p>增加：</p> <p>7、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。</p>
十七、基金财产的估值	(六) 暂停估值的情形	<p>(六) 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</p>

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后，应当暂停估值；
二十一、基金的信息披露	(五) 定期报告	(五) 定期报告 增加： 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，但中国证监会认定的特殊情形除外。
二十一、基金的信息披露	(六) 临时报告与公告	(六) 临时报告与公告 增加： 28、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的重大事项时； 29、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；
二十七、基金合同内容摘要		摘要部分也做了相应修改，与合同修订内容保持一致。

二、对基金托管协议的修改内容

章节	修订前	修订后
一、托管协议当事人	(一) 基金管理人（或简称“管理人”） 法定代表人：赵如冰	(一) 基金管理人（或简称“管理人”） 法定代表人：杨光裕
一、托管协议当事人	(二) 基金托管人（或简称“托管人”） 名称： 中国银行股份有限公司 住所： 北京市西城区复兴门内大街 1 号 法定代表人：肖钢 成立时间： 1983 年 10 月 31 日 基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号 组织形式：股份有限公司	(二) 基金托管人（或简称“托管人”） 名称： 中国银行股份有限公司 住所： 北京市西城区复兴门内大街 1 号 法定代表人：陈四清 成立时间： 1983 年 10 月 31 日 基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号 组织形式：股份有限公司

	注册资本：人民币贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰仟零玖元	注册资本：人民币贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰仟零玖元
二、托管协议的依据、目的、原则和解释	<p>(一) 依据</p> <p>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》”)、《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》”)及其他有关法律法规与《景顺长城稳定收益债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)订立。</p>	<p>(一) 依据</p> <p>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》”)、《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》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其他有关法律法规与《景顺长城稳定收益债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)订立。</p>
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	<p>2、对基金投融资比例进行监督；</p> <p>本基金投资组合的比例范围为：本基金投资于债券类资产(含可转换债券)的比例不低于基金资产的80%，投资于股票、权证等权益类资产的比例不超过基金资产的20%，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。</p>	<p>2、对基金投融资比例进行监督；</p> <p>本基金投资组合的比例范围为：本基金投资于债券类资产(含可转换债券)的比例不低于基金资产的80%，投资于股票、权证等权益类资产的比例不超过基金资产的20%，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</p>
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	<p>(5) 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>(5) 持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；</p>
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查		<p>增加：</p> <p>(9) 本基金管理人管理的且由本托管人托管的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不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且由本托管人托管的投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不超过该上市公司可流通股票的30%；</p> <p>(10) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的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项所</p>

		<p>规定的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>(11) 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投资范围保持一致；本基金管理人承诺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与本基金合同约定的投资范围保持一致，并承担由于不一致所导致的风险或损失；</p>
--	--	---

关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改基金合同、托管协议的内容说明

景顺长城优信增利债券型证券投资基金

一、 基金合同修订内容

章节	修订前	修订后
一、前言	<p>(一) 订立《景顺长城优信增利债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“本基金合同”)的目的、依据和原则</p> <p>2、订立本基金合同的依据</p> <p>订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法通则》、《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》)、《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》)和《证券投资基金销售管理办法》(以下简称《销售办法》)及其他法律法规的有关规定。</p>	<p>(一) 订立《景顺长城优信增利债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“本基金合同”)的目的、依据和原则</p> <p>2、订立本基金合同的依据</p> <p>订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法通则》、《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》)、《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》)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称《销售办法》)、《公开募集开放式证券投资基金流</p>

		动性风险管理规定》(以下简称《流动性风险管理规定》)及其他法律法规的有关规定。
二、释义		<p>增加:</p> <p>《流动性风险管理规定》: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</p> <p>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>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>
六、基金份额的申购、赎回		<p>(五) 申购与赎回的数额限制增加:</p> <p>3、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。具体请参见相关公告。</p>
六、基金份额的申购、赎回	<p>(七) 申购和赎回的费用及其用途</p> <p>4、本基金的申购费用由申购人承担,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用,不列入基金财产。</p> <p>本基金的赎回费用由基金份额持有人承担,其中不低于25%的部分归入基金财产(具体比例见招募说明书),其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。</p>	<p>(七) 申购和赎回的费用及其用途</p> <p>4、本基金的申购费用由申购人承担,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用,不列入基金财产。</p> <p>本基金的赎回费用由基金份额持有人承担,其中对于持续持有期少于7日的投资者,本基金将收取不低于1.5%的赎回费并全额计入基金财产,对于持续持有期不少于7日的投资者,不低于25%的部分归入基金财</p>

		产（具体比例见招募说明书），未归入基金财产的部分用于支付注册登记费等相关手续费。
六、基金份额的申购、赎回		增加： 6、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，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、自律组织的规定。
六、基金份额的申购、赎回		（九）巨额赎回的认定及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 增加： （3）如果基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人超过上一日基金总份额 20%以上的赎回申请的情形下，基金管理人可以对该基金份额持有人超过 20%以上的部分延期办理赎回申请。对于当日非延期的赎回申请，应当按单个账户非延期赎回申请量占非延期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。
六、基金份额的申购、赎回	（十）拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理 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： （1）因不可抗力导致基金管理人无法受理投资者的申购申请； （2）证券交易场所交易时间临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值； （3）发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况； （4）基金财产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，	（十）拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理 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： （1）因不可抗力导致基金管理人无法受理投资者的申购申请； （2）证券交易场所交易时间临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值； （3）发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。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

	<p>从而损害现有基金份额持有人的利益的情形；</p> <p>(5)本基金管理人、基金托管人、基金销售机构或注册登记机构因技术故障或异常情况导致基金销售系统、注册登记系统、基金会计系统或证券结算登记系统无法正常运行；</p> <p>(6)基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔申购；</p> <p>(7)法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。</p> <p>基金管理人决定拒绝或暂停接受某些投资者的申购申请时，申购款项将退回投资者账户。发生上述(1)到(5)及第(7)项暂停申购情形时，基金管理人应当按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。在暂停申购的情形消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理并依法公告。</p>	<p>采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受申购申请；</p> <p>(4)基金财产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益的情形；</p> <p>(5)本基金管理人、基金托管人、基金销售机构或注册登记机构因技术故障或异常情况导致基金销售系统、注册登记系统、基金会计系统或证券结算登记系统无法正常运行；</p> <p>(6)基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔申购；</p> <p>(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%，或者变相规避50%集中度的情形时；</p> <p>(8)法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。</p> <p>基金管理人决定全部或部分拒绝或者暂停接受某些投资者的申购申请时，被拒绝的申购款项将退回投资者账户。发生上述(1)到(5)及第(8)项暂停申购情形时，基金管理人应当按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。在暂停申购的情形消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理并依法公告。</p>
<p>六、基金份额的申购、赎回</p>	<p>2、在以下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请：</p> <p>(1)因不可抗力导致基金管理人无法支付赎回款项；</p> <p>(2)证券交易所交易时间临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；</p> <p>(3)基金连续发生巨额赎回，根据本基金合同规定，可以暂停接受赎回申请的情况；</p> <p>(4)发生本基金合同规定的暂停基金资产估值的情况；</p> <p>(5)法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。</p>	<p>2、在以下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请：</p> <p>(1)因不可抗力导致基金管理人无法支付赎回款项；</p> <p>(2)证券交易所交易时间临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；</p> <p>(3)基金连续发生巨额赎回，根据本基金合同规定，可以暂停接受赎回申请的情况；</p> <p>(4)发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，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。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，经与基金托管人协商确定后，基金管</p>

		理人应当暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项； (5) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。
八、基金合同当事人及其权利义务	(一) 基金管理人 1、基金管理人基本情况 法定代表人：赵如冰	(一) 基金管理人 1、基金管理人基本情况 法定代表人：杨光裕
八、基金合同当事人及其权利义务	(二) 基金托管人 1、基金托管人基本情况 名称：中国银行股份有限公司 住所：北京市复兴门内大街1号 法定代表人：肖钢 成立日期：1983年10月31日 基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号 组织形式：股份有限公司 注册资本：人民币贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰仟零玖元 存续期间：持续经营	(二) 基金托管人 1、基金托管人基本情况 名称：中国银行股份有限公司 住所：北京市复兴门内大街1号 法定代表人：陈四清 成立日期：1983年10月31日 基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号 组织形式：股份有限公司 注册资本：人民币贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰仟零玖元 存续期间：持续经营
十四、基金的投资	(二) 投资范围 本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、央行票据、企业（公司）债、可转换债券（含分离型可转换债券）、资产支持证券、债券回购、A股股票（包括中小板、创业板及其它经中国证监会核准上市的股票）、权证以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。 本基金投资组合的比例范围为： 本基金投资于债券类资产（含可转换债券）的比例不低于基金资产的80%，其中对信用债券的投资比例不低于基金债券类资产的80%（信用债券包括：短期融资券、企业债、公司债、金融债（不含政策性金融债）、地方政府债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、资产支持证券等除国债、央行票据和政策性金融债之外的、非国家信用的固定收益类金融工具，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他信用类金融工具。），投资于股票、权证等权益类证券的比例不超过基金资产的20%，其中，投资于权证的比例不超过基金资产净值的3%，持有现	(二) 投资范围 本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、央行票据、企业（公司）债、可转换债券（含分离型可转换债券）、资产支持证券、债券回购、A股股票（包括中小板、创业板及其它经中国证监会核准上市的股票）、权证以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。 本基金投资组合的比例范围为： 本基金投资于债券类资产（含可转换债券）的比例不低于基金资产的80%，其中对信用债券的投资比例不低于基金债券类资产的80%（信用债券包括：短期融资券、企业债、公司债、金融债（不含政策性金融债）、地方政府债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、资产支持证券等除国债、央行票据和政策性金融债之外的、非国家信用的固定收益类金融工具，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他信用类金融工具。），投资于股票、权证等权益类证券的比例不超过基金资产的20%，其

	金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。	中,投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%,持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。
十四、基金的投资	<p>(八) 投资禁止行为与限制</p> <p>2、基金投资组合比例限制</p> <p>(7) 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>(八) 投资禁止行为与限制</p> <p>2、基金投资组合比例限制</p> <p>(7) 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、存出保证金和应收申购款等;</p>
十四、基金的投资		<p>增加:</p> <p>(10)本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票,不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,不超过该上市公司可流通股票的 30%;</p> <p>(11)本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 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项所规定的比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;</p> <p>(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投资范围保持一致;</p>
十四、基金的投资	<p>(九) 投资组合比例调整</p> <p>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。因证券市场波动、上市公司合并、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,基金管理人应当在十个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定时,从其规定。</p>	<p>(九) 投资组合比例调整</p> <p>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。除上述“(八)投资禁止行为与限制”中“2、基金投资组合比例限制”部分第(7)、(11)、(12)、(13)项外,因证券市场波动、上市公司合并、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,基金管理人应当在十个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定时,从其规定。</p>
十七、基金资产的	(四) 估值方法	<p>(四) 估值方法</p> <p>增加:</p> <p>7、当发生大额申购或赎回情形</p>

估值		时,在履行适当程序后,基金管理人可以采用摆动定价机制,以确保基金估值的公平性。
十七、基金资产的估值		<p>(六) 暂停估值的情形 增加: 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一致后,应当暂停估值;</p>
二十一、基金的信息披露		<p>(五) 定期报告 增加: 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,但中国证监会认定的特殊情形除外。</p>
二十一、基金的信息披露	(六) 临时报告与公告	<p>(六) 临时报告与公告 增加: 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的重大事项时; 28、基金管理人采用摆动定价机制进行估值;</p>
二十七、基金合同内容摘要		摘要部分也做了相应修改,与合同修订内容保持一致。

二、对基金托管协议的修改内容

章节	修订前	修订后
一、托管协议当事人	<p>(一) 基金管理人(或简称“管理人”) 法定代表人: 赵如冰</p>	<p>(一) 基金管理人(或简称“管理人”) 法定代表人: 杨光裕</p>
一、托管协议当事人	<p>(二) 基金托管人(或简称“托管人”)</p>	<p>(二) 基金托管人(或简称“托管人”)</p>

人	<p>名称： 中国银行股份有限公司</p> <p>住所： 北京市西城区复兴门内大街1号</p> <p>法定代表人：肖钢</p> <p>成立时间： 1983年10月31日</p> <p>基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号</p> <p>组织形式：股份有限公司</p> <p>注册资本：人民币贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰仟零玖元</p>	<p>名称： 中国银行股份有限公司</p> <p>住所： 北京市西城区复兴门内大街1号</p> <p>法定代表人：陈四清</p> <p>成立时间： 1983年10月31日</p> <p>基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号</p> <p>组织形式：股份有限公司</p> <p>注册资本：人民币贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰仟零玖元</p>
二、托管协议的依据、目的、原则和解释	<p>(一) 依据</p> <p>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》”)、《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》”)及其他有关法律法规与《景顺长城优信增利债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)订立。</p>	<p>(一) 依据</p> <p>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》”)、《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》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其他有关法律法规与《景顺长城优信增利债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)订立。</p>
三、基金托管人对基金管理人业务监督和核查	<p>2、对基金投融资比例进行监督；本基金投资于债券类资产(含可转换债券)的比例不低于基金资产的80%，其中对信用债券的投资比例不低于基金债券类资产的80%(信用债券包括：短期融资券、企业债、公司债、金融债(不含政策性金融债)、地方政府债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、资产支持证券等除国债、央行票据和政策性金融债之外的、非国家信用的固定收益类金融工具，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他信用类金融工具。)，投资于股票、权证等权益类证券的比例不超过基金资产的20%，其中，投资于权证的比例不超过基金资产净值的3%，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。</p>	<p>2、对基金投融资比例进行监督；本基金投资于债券类资产(含可转换债券)的比例不低于基金资产的80%，其中对信用债券的投资比例不低于基金债券类资产的80%(信用债券包括：短期融资券、企业债、公司债、金融债(不含政策性金融债)、地方政府债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、资产支持证券等除国债、央行票据和政策性金融债之外的、非国家信用的固定收益类金融工具，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他信用类金融工具。)，投资于股票、权证等权益类证券的比例不超过基金资产的20%，其中，投资于权证的比例不超过基金资产净值的3%，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</p>
三、基金托管人对基金管理人业务监督和核	<p>(7) 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>(7) 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、存出保证金和应收申购款等；</p>

查		
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查		<p>增加：</p> <p>(10)本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票,不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且由本基金托管人托管的投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不超过该上市公司可流通股票的 30%;</p> <p>(11)本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 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该项所规定的比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;</p> <p>(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投资范围保持一致;本基金管理人承诺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与基金合同约定的投资范围保持一致,并承担由于不一致所导致</p>

		的风险或损失；
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	(11)本基金投资流通受限证券，持有一家公司发行的流通受限证券，其市值不得超过基金资产净值的8%；本基金持有的所有流通受限证券，其市值不得超过该基金资产净值的20%；经基金管理人和基金托管人协商，可对以上比例进行调整。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。	(14)本基金投资流通受限证券，持有一家公司发行的流通受限证券，其市值不得超过基金资产净值的8%；经基金管理人和基金托管人协商，可对以上比例进行调整。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。

关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改基金合同、托管协议的内容说明

景顺长城品质投资混合型证券投资基金

一、基金合同修订内容

章节	修订前	修订后
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》”)、《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。	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》”)、《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。
第二部分 释义		增加： 52、《流动性风险管理规定》：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 53、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

		<p>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>54、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>第六部分 基金份额 的申购、 赎回</p>	<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>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，具体规定请参见招募说明书。</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。</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，具体规定请参见招募说明书。</p> <p>4、基金管理人可在法律法规允许的情况下，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体上公告并报中国证监会备案。</p>	<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>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，具体规定请参见招募说明书。</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。</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，具体规定请参见招募说明书。</p> <p>4、基金管理人可在法律法规允许的情况下，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体上公告并报中国证监会备案。</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。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。具体请参见相关公告。</p>
<p>第六部分 基金份额 的申购、 赎回</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。不低于赎回费总额的 25% 应归基金财产，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。对于持续持有期少于 7 日的投资者，本基金将收取不低于 1.5% 的赎回费并全额计入基金财产，对于持续持有期不少于</p>

		7日的投资者，不低于赎回费总额的25%应归基金财产，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。
第六部分 基金份额 的申购、 赎回		增加： 8、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，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、自律组织的规定。
第六部分 基金份额 的申购、 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：</p> <p>1、因不可抗力导致基金无法正常运作。</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。</p> <p>3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</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>5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人利益的情形。</p> <p>6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述第1、2、3、5、6项暂停申购情形时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体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>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：</p> <p>1、因不可抗力导致基金无法正常运作。</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受申购申请。</p> <p>3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</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>5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人利益的情形。</p> <p>6、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。</p> <p>7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述第1、2、3、5、7项暂停申购情形时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，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、 赎回</p>	<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 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： 1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，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>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 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： 1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，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。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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项。</p>
<p>第六部分 基金份额 的申购、 赎回</p>		<p>九、巨额赎回的情形及处理方式增加： (3) 如果基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额 20%以上的赎回申请的情形下，基金管理人可以对该基金份额持有人超过 20%以上的部分延期办理赎回申请。对于当日非延期的赎回申请，应当按单个账户非延期赎回申请量占非延期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。</p>
<p>第七部分 基金合同 当事人及 权利义务</p>	<p>二、基金托管人 (一) 基金托管人简况 名称：中国农业银行股份有限公司 住所：北京市东城区建国门内大街 69 号 法定代表人：刘士余 成立时间：2009 年 1 月 15 日 批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复【2009】13 号</p>	<p>二、基金托管人 (一) 基金托管人简况 名称：中国农业银行股份有限公司 住所：北京市东城区建国门内大街 69 号 法定代表人：周慕冰 成立时间：2009 年 1 月 15 日 批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复【2009】13 号</p>

	<p>组织形式：股份有限公司 注册资本：32,479,411.7 万元人民币 存续期间：持续经营 基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]23 号</p>	<p>组织形式：股份有限公司 注册资本：32,479,411.7 万元人民币 存续期间：持续经营 基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]23 号</p>
第十二部分 基金的投资	<p>二、投资范围 本基金投资范围包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括中小企业私募债）、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其它品种，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。 本基金将基金资产的 60%-95% 投资于股票等权益类资产（其中，股票投资比例不低于基金资产的 60%，权证投资比例不超过基金资产净值的 3%），将基金资产的 5%-40% 投资于债券和现金等固定收益类品种（其中，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%。</p>	<p>二、投资范围 本基金投资范围包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括中小企业私募债）、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其它品种，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。 本基金将基金资产的 60% -95% 投资于股票等权益类资产（其中，股票投资比例不低于基金资产的 60%，权证投资比例不超过基金资产净值的 3%），将基金资产的 5% -40% 投资于债券和现金等固定收益类品种（其中，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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等）。</p>
第十二部分 基金的投资	<p>四、投资限制 1、组合限制 （2）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；若本基金投资股指期货的，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>四、投资限制 1、组合限制 （2）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、存出保证金和应收申购款等；若本基金投资股指期货的，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>
第十二部分 基金的投资		<p>增加： （12）本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不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，不超过该上市公司可流通股票的 30%； （13）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资</p>

		<p>产的 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项所规定的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>(14)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投资范围保持一致；</p>
第十二部分 基金的投资	<p>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。</p>	<p>除上述第(2)、(13)、(14)、(15)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。</p>
第十四部分 基金财产的估值	<p>三、估值方法</p> <p>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>(3)首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>	<p>三、估值方法</p> <p>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>(3) 流通受限股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等(不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票)，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>
第十四部分 基金财产的估值	<p>三、估值方法</p>	<p>三、估值方法</p> <p>增加：</p> <p>6、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。</p>
第十四部分 基金财产的估值	<p>六、暂停估值的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</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值出现重大转变，而基金管理人为保障基金份额持有人的利益，决定延迟估值；</p> <p>4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。</p>	<p>六、暂停估值的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</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值出现重大转变，而基金管理人为保障基金份额持有人的利益，决定延迟估值；</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时，经与基金托管人协商确认后，应当暂停估值；</p> <p>5、中国证监会和基金合同认定</p>

<p>第十八部分 基金的信息披露</p>	<p>(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</p> <p>基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内, 编制完成基金年度报告, 并将年度报告正文登载于网站上, 将年度报告摘要登载在指定报刊上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。</p> <p>基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内, 编制完成基金半年度报告, 并将半年度报告正文登载在网站上, 将半年度报告摘要登载在指定报刊上。</p> <p>基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内, 编制完成基金季度报告, 并将季度报告登载在指定媒体上。</p> <p>基金合同生效不足 2 个月的, 基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。</p> <p>基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日, 分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。</p>	<p>的其它情形。</p> <p>(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</p> <p>基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内, 编制完成基金年度报告, 并将年度报告正文登载于网站上, 将年度报告摘要登载在指定报刊上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。</p> <p>基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内, 编制完成基金半年度报告, 并将半年度报告正文登载在网站上, 将半年度报告摘要登载在指定报刊上。</p> <p>基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内, 编制完成基金季度报告, 并将季度报告登载在指定媒体上。</p> <p>基金合同生效不足 2 个月的, 基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。</p> <p>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。</p> <p>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例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文件中“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本基金的特定风险, 中国证监会认定的特殊情形除外。</p> <p>基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日, 分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。</p>
<p>第十八部分 基金的信息披露</p>	<p>(七) 临时报告</p>	<p>(七) 临时报告</p> <p>增加:</p> <p>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;</p> <p>27、基金管理人采用摆动定价机制进行估值;</p>
<p>第二十四部分 基金合同内</p>		<p>摘要部分也做了相应修改, 与合同修订内容保持一致。</p>

容摘要		
-----	--	--

二、对基金托管协议的修改内容

章节	修订前	修订后
一、基金托管协议当事人	<p>(二) 基金托管人 名称：中国农业银行股份有限公司 注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号 办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座九层 邮政编码：100031 法定代表人：刘士余 成立时间：2009 年 1 月 15 日 基金托管资格批准文号：中国证监会证监基字[1998]23 号 注册资本：32,479,411.7 万元人民币 存续期间：持续经营</p>	<p>(二) 基金托管人 名称：中国农业银行股份有限公司 注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号 办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座九层 邮政编码：100031 法定代表人：周慕冰 成立时间：2009 年 1 月 15 日 基金托管资格批准文号：中国证监会证监基字[1998]23 号 注册资本：32,479,411.7 万元人民币 存续期间：持续经营</p>
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的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池和交易对手库，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督。</p> <p>本基金投资范围包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括中小企业私募债）、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其它品种，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p> <p>本基金参与股指期货交易，应符合法律法规规定和基金合同约定的投资限制并遵守相关期货交易所的业务规则。</p> <p>本基金将基金资产的 60%-95% 投资于股票等权益类资产（其中，股</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。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池和交易对手库，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督。</p> <p>本基金投资范围包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括中小企业私募债）、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其它品种，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p> <p>本基金参与股指期货交易，应符合法律法规规定和基金合同约定的投资限制并遵守相关期货交易所的业务规则。</p> <p>本基金将基金资产的 60% -95% 投资于股票等权益类资产（其</p>

	票投资比例不低于基金资产的 60%，权证投资比例不超过基金资产净值的 3%)，将基金资产的 5%-40%投资于债券和现金等固定收益类品种(其中，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%。	中，股票投资比例不低于基金资产的 60%，权证投资比例不超过基金资产净值的 3%)，将基金资产的 5%-40%投资于债券和现金等固定收益类品种(其中，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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等)。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	<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>(1) 股票等权益类资产：60% -95%，其中，股票投资比例不低于基金资产的 60%，债券和现金等固定收益类品种：5%-40%；</p> <p>(2) 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；若本基金投资股指期货的，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>(1) 股票等权益类资产：60% -95%，其中，股票投资比例不低于基金资产的 60%，债券和现金等固定收益类品种：5%-40%；</p> <p>(2) 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、存出保证金和应收申购款等；若本基金投资股指期货的，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>
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查		<p>增加：</p> <p>(12)本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不超过该上市公司可流通股票的 30%；</p> <p>(13)本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 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该项所规定的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>(14)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投资范围保持一致；</p>

三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	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。	除上述第(2)、(13)、(14)、(15)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。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	<p>(七)基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金投资流通受限证券进行监督。</p> <p>1、基金投资流通受限证券,应遵守《关于规范基金投资非公开发行股票行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。</p> <p>2、流通受限证券,包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>	<p>(七)基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金投资流通受限证券进行监督。</p> <p>1、基金投资流通受限证券,应遵守《关于规范基金投资非公开发行股票行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。</p> <p>2、流通受限证券与上文所述流动性受限资产并不完全一致,包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>
八、基金资产净值计算和会计核算	<p>(二)基金资产估值方法和特殊情形的处理</p> <p>(2)处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:</p> <p>3)首次公开发行有明确锁定期的股票,同一股票在交易所上市后,按交易所上市的同一股票的估值方法估值;非公开发行有明确锁定期的股票,按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>	<p>(二)基金资产估值方法和特殊情形的处理</p> <p>(2)处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:</p> <p>3)流通受限的股票,包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等(不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票),按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>
八、基金资产净值计算和会计核算		<p>增加:</p> <p>(6)当发生大额申购或赎回情形时,在履行适当程序后,基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。</p>
八、基金资产净值计算和会计核算		<p>(四)暂停估值与公告基金份额净值的情形</p> <p>增加:</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时,经与基金托管人协商确认后,应当暂停估值;</p>

<p>十、基金信息披露</p>	<p>(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</p> <p>1. 职责</p> <p>基金托管人和基金管理人在信息披露过程中应以保护基金份额持有人利益为宗旨,诚实信用,严守秘密。基金管理人负责办理与基金有关的信息披露事宜,对于本章第(二)条规定的应由基金托管人复核的事项,应经基金托管人复核无误后,由基金管理人予以公布。</p> <p>基金管理人应当在中国证监会规定的时间内,将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的全国性报刊和基金管理人的互联网网站等媒介披露。根据法律法规应由基金托管人公开披露的信息,基金托管人将通过指定报刊和基金托管人的互联网网站公开披露。</p> <p>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信息:</p> <p>(1)不可抗力;</p> <p>(2)法律法规、基金合同或中国证监会规定的情况。</p>	<p>(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</p> <p>1. 职责</p> <p>基金托管人和基金管理人在信息披露过程中应以保护基金份额持有人利益为宗旨,诚实信用,严守秘密。基金管理人负责办理与基金有关的信息披露事宜,对于本章第(二)条规定的应由基金托管人复核的事项,应经基金托管人复核无误后,由基金管理人予以公布。</p> <p>基金管理人应当在中国证监会规定的时间内,将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的全国性报刊和基金管理人的互联网网站等媒介披露。根据法律法规应由基金托管人公开披露的信息,基金托管人将通过指定报刊和基金托管人的互联网网站公开披露。</p> <p>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信息:</p> <p>(1)不可抗力;</p> <p>(2)发生基金合同约定的暂停估值的情形;</p> <p>(3)法律法规、基金合同或中国证监会规定的情况。</p>
------------------------	---	---

关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改基金合同、托管协议的内容说明

景顺长城四季金利债券型证券投资基金

一、 基金合同修订内容

章节	修订前	修订后
----	-----	-----

<p>第一部分 前言</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>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>第二部分 释义</p>		<p>增加：</p> <p>51、《流动性风险管理规定》：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</p> <p>52、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>53、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>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>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，具体规定请参见招募说明书。</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。</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，具体规定请参见招募说明书。</p> <p>4、基金管理人可在法律法规允许</p>	<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>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，具体规定请参见招募说明书。</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。</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，具体规定请参见招募说明书。</p> <p>4、基金管理人可在法律法规允</p>

	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体上公告并报中国证监会备案。	许的情况下，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体上公告并报中国证监会备案。 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。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。具体请参见相关公告。
第六部分 基金份额 的申购、 赎回	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 6、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。不低于赎回费总额的 25%应归基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 6、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。对于持续持有期少于 7 日的投资者，本基金将收取不低于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产，对于持续持有期不少于 7 日的投资者，不低于赎回费总额的 25%应归基金财产，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。
第六部分 基金份额 的申购、 赎回		增加： 9、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，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、自律组织的规定。
第六部分 基金份额 的申购、 赎回	七、拒绝或暂停申购的情形 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： 1、因不可抗力导致基金无法正常运作。 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时。 3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。 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。 5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人利益的情	七、拒绝或暂停申购的情形 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： 1、因不可抗力导致基金无法正常运作。 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受申购申请。 3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

	<p>形。</p> <p>6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</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申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体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>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>5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人利益的情形。</p> <p>6、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。</p> <p>7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述第 1、2、3、5、7 项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体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，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、 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>1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时。</p>	<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>1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，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。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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项。</p>
<p>第六部分 基金份额 的申购、 赎回</p>		<p>九、巨额赎回的情形及处理方式增加：</p> <p>(3) 如果基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额 20%以上的赎回申请的情形下，基金管理人可以对该基金份额持有人超过 20%以上的部分延期办理赎回申请。对于当日非延期的赎回申请，应当按单个账户非延期赎回申请量占非延期赎回申请总量</p>

		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。
第七部分 基金合同 当事人及 权利义务	<p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况</p> <p>名称：中国农业银行股份有限公司</p> <p>住所：北京市东城区建国门内大街69号</p> <p>法定代表人：蒋超良</p> <p>成立时间：2009年1月15日</p> <p>批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复【2009】13号</p> <p>组织形式：股份有限公司</p> <p>注册资本：32,479,411.7万元人民币</p> <p>存续期间：持续经营</p> <p>基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]23号</p>	<p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况</p> <p>名称：中国农业银行股份有限公司</p> <p>住所：北京市东城区建国门内大街69号</p> <p>法定代表人：周慕冰</p> <p>成立时间：2009年1月15日</p> <p>批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复【2009】13号</p> <p>组织形式：股份有限公司</p> <p>注册资本：32,479,411.7万元人民币</p> <p>存续期间：持续经营</p> <p>基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]23号</p>
第十二部分 基金 的投资	<p>二、投资范围</p> <p>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的国家债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、中小企业私募债券、公司债券、中期票据、短期融资券、质押及买断式回购、协议存款、通知存款、定期存款、资产支持证券、可转换债券（含分离型可转换债券）、银行存款等。本基金同时投资于股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证等权益类品种以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金</p>	<p>二、投资范围</p> <p>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的国家债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、中小企业私募债券、公司债券、中期票据、短期融资券、质押及买断式回购、协议存款、通知存款、定期存款、资产支持证券、可转换债券（含分离型可转换债券）、银行存款等。本基金同时投资于股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证等权益类品种以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金</p>

	对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，其中，本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。	对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，其中，本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。
第十二部分 基金的投资	四、投资限制 1、组合限制 (2) 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；	四、投资限制 1、组合限制 (2) 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、存出保证金和应收申购款等；
第十二部分 基金的投资		增加： (8) 本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不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，不超过该上市公司可流通股票的 30%； (9) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 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项所规定的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资； (10) 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投资范围保持一致；
第十二部分 基金的投资	因证券市场波动、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 个工作日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。	除上述第(2)、(9)、(10)、(11)项外，因证券市场波动、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 个工作日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。
第十四部分 基金财产的估值		三、估值方法 增加： 7、流通受限股票，指在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发

		<p>行时股票公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等,按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p> <p>8、当发生大额申购或赎回情形时,在履行适当程序后,基金管理人可以采用摆动定价机制,以确保基金估值的公平性。</p>
第十四部分 基金财产的估值	<p>六、暂停估值的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;</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值出现重大转变,而基金管理人为保障基金份额持有人的利益,决定延迟估值;</p> <p>4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。</p>	<p>六、暂停估值的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;</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值出现重大转变,而基金管理人为保障基金份额持有人的利益,决定延迟估值;</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后,应当暂停估值;</p> <p>5、中国证监会和基金合同认定的其它情形。</p>
第十八部分 基金的信息披露	<p>(四)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</p> <p>基金管理人应当在每年结束之日起90日内,编制完成基金年度报告,并将年度报告正文登载于网站上,将年度报告摘要登载在指定媒体上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。</p> <p>基金管理人应当在上半年结束之日起60日内,编制完成基金半年度报告,并将半年度报告正文登载在网站上,将半年度报告摘要登载在指定媒体上。</p> <p>基金管理人应当在每个季度结束之日起15个工作日内,编制完成基金季度报告,并将季度报告登载在指定媒体上。</p> <p>基金定期报告在公开披露的第2个工作日,分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。</p>	<p>(四)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</p> <p>基金管理人应当在每年结束之日起90日内,编制完成基金年度报告,并将年度报告正文登载于网站上,将年度报告摘要登载在指定媒体上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。</p> <p>基金管理人应当在上半年结束之日起60日内,编制完成基金半年度报告,并将半年度报告正文登载在网站上,将半年度报告摘要登载在指定媒体上。</p> <p>基金管理人应当在每个季度结束之日起15个工作日内,编制完成基金季度报告,并将季度报告登载在指定媒体上。</p> <p>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。</p> <p>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</p>

		<p>20%的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人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。</p> <p>基金定期报告在公开披露的第2个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。</p>
第十八部分 基金的信息披露		<p>(五) 临时报告 增加： 25、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的重大事项时； 26、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；</p>
第二十四部分 基金合同内容摘要		<p>摘要部分也做了相应修改，与合同修订内容保持一致。</p>

二、 基金托管协议修订内容

章节	修订前	修订后
一、基金托管协议当事人	<p>(二) 基金托管人 名称：中国农业银行股份有限公司 注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号 办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座九层 邮政编码：100031 法定代表人：蒋超良 成立时间：2009 年 1 月 15 日 基金托管资格批准文号：中国证监会证监基字[1998]23 号 注册资本：32,479,411.7 万元人民币 存续期间：持续经营</p>	<p>(二) 基金托管人 名称：中国农业银行股份有限公司 注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号 办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座九层 邮政编码：100031 法定代表人：周慕冰 成立时间：2009 年 1 月 15 日 基金托管资格批准文号：中国证监会证监基字[1998]23 号 注册资本：32,479,411.7 万元人民币 存续期间：持续经营</p>
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核	<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。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金</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。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基</p>

查	<p>托管人要求的格式提供投资品种池和交易对手库，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。</p> <p>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的国家债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、中小企业私募债券、公司债券、中期票据、短期融资券、质押及买断式回购、协议存款、通知存款、定期存款、资产支持证券、可转换债券（含分离型可转换债券）、银行存款等。本基金同时投资于股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证等权益类品种以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，其中，本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>金托管人要求的格式提供投资品种池和交易对手库，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。</p> <p>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的国家债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、中小企业私募债券、公司债券、中期票据、短期融资券、质押及买断式回购、协议存款、通知存款、定期存款、资产支持证券、可转换债券（含分离型可转换债券）、银行存款等。本基金同时投资于股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证等权益类品种以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，其中，本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</p>
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	<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>1、本基金投资于债券类资产的比例不低于基金资产的 80%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%；</p> <p>2、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>（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>1、本基金投资于债券类资产的比例不低于基金资产的 80%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%；</p> <p>2、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、存出保证金和应收申购款等；</p>
三、基金托管人对		<p>增加：</p> <p>8、本基金管理人管理的、且由本托管人托管的全部开放式基金（包</p>

<p>基金管理人的业务监督和核查</p>		<p>括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票,不超过该上市公司可流通股票的 15%;本基金管理人管理的、且由本托管人托管的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不超过该上市公司可流通股票的 30%;</p> <p>9、本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 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项所规定的比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;</p> <p>10、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投资范围保持一致;</p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>	<p>因证券市场波动、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>除上述第 2、9、10、11 项外,因证券市场波动、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>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>	<p>(七)基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金投资流通受限证券进行监督。</p> <p>1、基金投资流通受限证券,应遵守《关于规范基金投资非公开发行股票行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。</p> <p>2、流通受限证券,包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>	<p>(七)基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金投资流通受限证券进行监督。</p> <p>1、基金投资流通受限证券,应遵守《关于规范基金投资非公开发行股票行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。</p> <p>2、流通受限证券与上文所述流动性受限资产并不完全一致,包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>
<p>八、基金资产净值计算和会计核算</p>		<p>(二)基金资产估值方法和特殊情形的处理</p> <p>增加:</p> <p>6、流通受限股票,指在发行时明确一定期限限售期的股票,包括但</p>

		<p>不限于非公开发行股票、首次公开发行时股票公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等,按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p> <p>7、当发生大额申购或赎回情形时,在履行适当程序后,基金管理人可以采用摆动定价机制,以确保基金估值的公平性。</p>
八、基金资产净值计算和会计核算		<p>(四)暂停估值与公告基金份额净值的情形</p> <p>增加:</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后,应当暂停估值;</p>
十、基金信息披露	<p>(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</p> <p>1. 职责</p> <p>基金托管人和基金管理人在信息披露过程中应以保护基金份额持有人利益为宗旨,诚实信用,严守秘密。基金管理人负责办理与基金有关的信息披露事宜,对于本章第(二)条规定的应由基金托管人复核的事项,应经基金托管人复核无误后,由基金管理人予以公布。</p> <p>基金管理人应当在中国证监会规定的时间内,将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的全国性报刊和基金管理人的互联网网站等媒介披露。根据法律法规应由基金托管人公开披露的信息,基金托管人将通过指定报刊和基金托管人的互联网网站公开披露。</p> <p>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信息:</p> <p>(1)不可抗力;</p> <p>(2)法律法规、基金合同或中国证监会规定的情况。</p>	<p>(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</p> <p>1. 职责</p> <p>基金托管人和基金管理人在信息披露过程中应以保护基金份额持有人利益为宗旨,诚实信用,严守秘密。基金管理人负责办理与基金有关的信息披露事宜,对于本章第(二)条规定的应由基金托管人复核的事项,应经基金托管人复核无误后,由基金管理人予以公布。</p> <p>基金管理人应当在中国证监会规定的时间内,将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的全国性报刊和基金管理人的互联网网站等媒介披露。根据法律法规应由基金托管人公开披露的信息,基金托管人将通过指定报刊和基金托管人的互联网网站公开披露。</p> <p>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信息:</p> <p>(1)不可抗力;</p> <p>(2)发生基金合同约定的暂停估值的情形;</p> <p>(3)法律法规、基金合同或中国证监会规定的情况。</p>

关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规

定》修改基金合同、托管协议的内容说明

景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金

一、 基金合同修订内容

章节	修订前	修订后
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》”)、《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。	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》”)、《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。
第二部分 释义		<p>增加：</p> <p>52、《流动性风险管理规定》：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</p> <p>53、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>54、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>
第六部分 基金份额	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	五、申购和赎回的数量限制 1、基金管理人可以规定投资人

<p>的申购与赎回</p>	<p>次申购和每次申购的最低金额以及每次赎回的最低份额，具体规定请参见招募说明书。</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。</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，具体规定请参见招募说明书。</p> <p>4、基金管理人可在法律法规允许的情况下，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实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案。</p>	<p>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，具体规定请参见招募说明书。</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。</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，具体规定请参见招募说明书。</p> <p>4、基金管理人可在法律法规允许的情况下，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实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案。</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。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。具体请参见相关公告。</p>
<p>第六部分基金份额的申购、赎回</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。不低于赎回费总额的 25%应归基金财产，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。对于持续持有期少于 7 日的投资者，本基金将收取不低于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产，对于持续持有期不少于 7 日的投资者，不低于赎回费总额的 25%应归基金财产，未归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>第六部分基金份额的申购、赎回</p>		<p>增加：</p> <p>8、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，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、自律组织的规定。</p>
<p>第六部分基金份额的申购、赎回</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：</p> <p>1、因不可抗力导致基金无法正常运作。</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停</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：</p> <p>1、因不可抗力导致基金无法正常运作。</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂</p>

	<p>接受投资人的申购申请。</p> <p>3、证券、期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</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>5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人利益的情形。</p> <p>6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</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体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>停接受投资人的申购申请。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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受申购申请。</p> <p>3、证券、期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</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>5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人利益的情形。</p> <p>6、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。</p> <p>7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述第 1、2、3、5、7 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体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，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、 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>1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，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>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>1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，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。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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项。</p>

<p>第六部分 基金份额 的申购、 赎回</p>		<p>九、巨额赎回的情形及处理方式增加： （3）如果基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额 20%以上的赎回申请的情形下，基金管理人可以对该基金份额持有人超过 20%以上的部分延期办理赎回申请。对于当日非延期的赎回申请，应当按单个账户非延期赎回申请量占非延期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。</p>
<p>第七部分 基金合同 当事人及 权利义务</p>	<p>二、基金托管人 （一） 基金托管人简况 名称：中国农业银行股份有限公司 住所：北京市东城区建国门内大街 69 号 法定代表人：蒋超良 成立时间：2009 年 1 月 15 日 批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复【2009】13 号 组织形式：股份有限公司 注册资本：32,479,411.7 万元人民币 存续期间：持续经营 基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]23 号</p>	<p>二、基金托管人 （一） 基金托管人简况 名称：中国农业银行股份有限公司 住所：北京市东城区建国门内大街 69 号 法定代表人：周慕冰 成立时间：2009 年 1 月 15 日 批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复【2009】13 号 组织形式：股份有限公司 注册资本：32,479,411.7 万元人民币 存续期间：持续经营 基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]23 号</p>
<p>第十二部分 基金 的投资</p>	<p>二、投资范围 本基金投资范围主要为标的指数成分股及备选成分股。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成分股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、一级市场新股或增发的股票、衍生工具（权证、股指期货等）、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转</p>	<p>二、投资范围 本基金投资范围主要为标的指数成分股及备选成分股。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成分股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、一级市场新股或增发的股票、衍生工具（权证、股指期货等）、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离</p>

	<p>债、央行票据、中期票据、短期融资券、中小企业私募债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产,以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。</p> <p>基金的投资组合比例为:股票投资比例范围为基金资产的90%—95%,投资于标的指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的80%,每个交易日日终在扣除股指期货保证金以后,本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%。</p>	<p>交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、中小企业私募债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产,以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。</p> <p>基金的投资组合比例为:股票投资比例范围为基金资产的90%—95%,投资于标的指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的80%,每个交易日日终在扣除股指期货保证金以后,本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</p>
第十二部分 基金的投资		<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>增加:</p> <p>(11)本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票,不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,不超过该上市公司可流通股票的30%;</p> <p>(12)本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的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项所规定的比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;</p> <p>(13)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投资范围保持一致;</p>
第十二部分 基金的投资	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>14.6 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</p>	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>17.6 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</p>

	债券；	政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；
第十二部分 基金的投资	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。法律法规另有规定的，从其规定。	除上述第（12）、（13）、（14）项及 17.6 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。法律法规另有规定的，从其规定。
第十四部分 基金财产的估值	三、估值方法 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理： （3）首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。	三、估值方法 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理： （3）流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等（不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票），按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。
第十四部分 基金财产的估值	三、估值方法	三、估值方法 增加： 7、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。
第十四部分 基金财产的估值	六、暂停估值的情形 1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； 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； 3、中国证监会和基金合同认定的其它情形。	六、暂停估值的情形 1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； 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； 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时，经与基金托管人协商确认后，应当暂停估值； 4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。
第十八部分 基金的信息披露	（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 基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定报刊上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。	（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 基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定报刊上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。

	<p>基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定报刊上。</p> <p>基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定报刊和网站上。</p> <p>基金应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告中披露中小企业私募债券的投资情况。</p> <p>《基金合同》生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。</p> <p>基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。</p>	<p>基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定报刊上。</p> <p>基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定报刊和网站上。</p> <p>基金应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告中披露中小企业私募债券的投资情况。</p> <p>《基金合同》生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。</p> <p>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。</p> <p>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例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文件中“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本基金的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。</p> <p>基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。</p>
<p>第十八部分 基金的信息披露</p>		<p>(七) 临时报告</p> <p>增加：</p> <p>27、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> <p>28、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；</p>
<p>第二十四部分 基金合同内容摘要</p>		<p>摘要部分也做了相应修改，与合同修订内容保持一致。</p>

二、 基金托管协议修订内容

章节	修订前	修订后
<p>一、基金托管协议当事人</p>	<p>(二) 基金托管人 名称：中国农业银行股份有限公司 注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号 办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座九层 邮政编码：100031 法定代表人：蒋超良 成立时间：2009 年 1 月 15 日 基金托管资格批准文号：中国证监会证监基字[1998]23 号 注册资本：32,479,411.7 万元人民币 存续期间：持续经营</p>	<p>(二) 基金托管人 名称：中国农业银行股份有限公司 注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号 办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座九层 邮政编码：100031 法定代表人：周慕冰 成立时间：2009 年 1 月 15 日 基金托管资格批准文号：中国证监会证监基字[1998]23 号 注册资本：32,479,411.7 万元人民币 存续期间：持续经营</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。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池和交易对手库，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。</p> <p>本基金投资范围主要为标的指数成分股及备选成分股。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成分股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、一级市场新股或增发的股票、衍生工具（权证、股指期货等）、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、中小企业私募债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产，以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p> <p>基金的投资组合比例为：股票投资比例范围为基金资产的 90%—95%，投资于标的指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的</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。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池和交易对手库，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。</p> <p>本基金投资范围主要为标的指数成分股及备选成分股。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成分股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、一级市场新股或增发的股票、衍生工具（权证、股指期货等）、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、中小企业私募债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产，以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p> <p>基金的投资组合比例为：股票投资比例范围为基金资产的 90%—95%，投资于标的指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金</p>

	80%，每个交易日日终在扣除股指期货期货保证金以后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%。	资产的80%，每个交易日日终在扣除股指期货期货保证金以后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查		<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>增加:</p> <p>(11)本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票,不超过该上市公司可流通股票的15%;本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不超过该上市公司可流通股票的30%;</p> <p>(12)本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的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该项所规定的比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;</p> <p>(13)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投资范围保持一致;</p>
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	14.6 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;	17.6 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、存出保证金和应收申购款等;
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	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。法律法规另有规定的,从其规定。	除上述第(12)、(13)、(14)项及17.6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。法律法规另有规定的,从其规定。
三、基金	(八)基金托管人根据有关法律	(八)基金托管人根据有关法律

<p>托管人对基金管理人业务监督和核查</p>	<p>法规的规定及基金合同的约定,对基金投资流通受限证券进行监督。</p> <p>1、基金投资流通受限证券,应遵守《关于规范基金投资非公开发行股票行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。</p> <p>2、流通受限证券,包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>	<p>法规的规定及基金合同的约定,对基金投资流通受限证券进行监督。</p> <p>1、基金投资流通受限证券,应遵守《关于规范基金投资非公开发行股票行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。</p> <p>2、流通受限证券与上文所述流动性受限资产并不完全一致,包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>
<p>八、基金资产净值计算和会计核算</p>	<p>(二)基金资产估值方法和特殊情形的处理</p> <p>2、估值方法</p> <p>(2)处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:</p> <p>3)首次公开发行有明确锁定期的股票,同一股票在交易所上市后,按交易所上市的同一股票的估值方法估值;非公开发行有明确锁定期的股票,按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>	<p>(二)基金资产估值方法和特殊情形的处理</p> <p>2、估值方法</p> <p>(2)处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:</p> <p>3)流通受限的股票,包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等(不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票),按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>
<p>八、基金资产净值计算和会计核算</p>		<p>增加:</p> <p>(7)当发生大额申购或赎回情形时,在履行适当程序后,基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。</p>
<p>八、基金资产净值计算和会计核算</p>		<p>(四)暂停估值与公告基金份额净值的情形</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时,经与基金托管人协商确认后,应当暂停估值;</p>
<p>十、基金信息披露</p>	<p>(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</p> <p>1. 职责</p> <p>基金托管人和基金管理人在信息披露过程中应以保护基金份额持有人利益为宗旨,诚实信用,严守秘密。基金管理人负责办理与基金有关的信息披露事宜,对于本章第(二)条规</p>	<p>(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</p> <p>1. 职责</p> <p>基金托管人和基金管理人在信息披露过程中应以保护基金份额持有人利益为宗旨,诚实信用,严守秘密。基金管理人负责办理与基金有关</p>

	<p>定的应由基金托管人复核的事项，应经基金托管人复核无误后，由基金管理人予以公布。</p> <p>基金管理人应当在中国证监会规定的时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的全国性报刊和基金管理人的互联网网站等媒介披露。根据法律法规应由基金托管人公开披露的信息，基金托管人将通过指定报刊和基金托管人的互联网网站公开披露。</p> <p>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信息：</p> <p>(1) 不可抗力；</p> <p>(2) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的情况。</p>	<p>的信息披露事宜，对于本章第（二）条规定的应由基金托管人复核的事项，应经基金托管人复核无误后，由基金管理人予以公布。</p> <p>基金管理人应当在中国证监会规定的时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的全国性报刊和基金管理人的互联网网站等媒介披露。根据法律法规应由基金托管人公开披露的信息，基金托管人将通过指定报刊和基金托管人的互联网网站公开披露。</p> <p>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信息：</p> <p>(1) 不可抗力；</p> <p>(2) 发生基金合同约定的暂停估值的情形；</p> <p>(3) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的情况。</p>
--	--	---

关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改基金合同、托管协议的内容说明

景顺长城中小板创业板精选股票型证券投资基金

一、 基金合同修订内容

章节	修订前	修订后
第一部分 前言	<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》”)、《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>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》”)、《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>
第二部分 释义		<p>增加： 52、《流动性风险管理规定》：指</p>

		<p>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</p> <p>53、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>54、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>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>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，具体规定请参见招募说明书。</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。</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，具体规定请参见招募说明书。</p> <p>4、基金管理人可在法律法规允许的情况下，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实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案。</p>	<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>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，具体规定请参见招募说明书。</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。</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，具体规定请参见招募说明书。</p> <p>4、基金管理人可在法律法规允许的情况下，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实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案。</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。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。具体请参见相关公告。</p>

<p>第六部分 基金份额 的申购、 赎回</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。对持续持有期少于7日的投资人收取不低于1.5%的赎回费，对持续持有期少于30日的投资人收取不低于0.75%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产；对持续持有期少于3个月的投资人收取不低于0.5%的赎回费，并将不低于赎回费总额的75%计入基金财产；对持续持有期长于3个月但少于6个月的投资人收取不低于0.5%的赎回费，并将不低于赎回费总额的50%计入基金财产；对持续持有期长于6个月的投资人，应当将不低于赎回费总额的25%计入基金财产，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。对持续持有期少于7日的投资人收取不低于1.5%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产；对持续持有期少于30日的投资人收取不低于0.75%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产；对持续持有期少于3个月的投资人收取不低于0.5%的赎回费，并将不低于赎回费总额的75%计入基金财产；对持续持有期长于3个月但少于6个月的投资人收取不低于0.5%的赎回费，并将不低于赎回费总额的50%计入基金财产；对持续持有期长于6个月的投资人，应当将不低于赎回费总额的25%计入基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。</p>
<p>第六部分 基金份额 的申购、 赎回</p>		<p>增加：</p> <p>8、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，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、自律组织的规定。</p>
<p>第六部分 基金份额 的申购、 赎回</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：</p> <p>1、因不可抗力导致基金无法正常运作。</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。</p> <p>3、证券、期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</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>5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人利益的情形。</p> <p>6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</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申购</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：</p> <p>1、因不可抗力导致基金无法正常运作。</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受申购申请。</p> <p>3、证券、期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</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>5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，</p>

	<p>时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体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>从而损害现有基金份额持有人利益的情形。</p> <p>6、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。</p> <p>7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述第1、2、3、5、7项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体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，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、 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>1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，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>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>1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，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。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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项。</p>
<p>第六部分 基金份额 的申购、 赎回</p>		<p>九、巨额赎回的情形及处理方式增加：</p> <p>(3) 如果基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额20%以上的赎回申请的情形下，基金管理人可以对该基金份额持有人超过20%以上的部分延期办理赎回申请。对于当日非延期的赎回申请，应当按单个账户非延期赎回申请量占非延期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</p>

		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。
第七部分 基金合同 当事人及 权利义务	<p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况</p> <p>名称:中国农业银行股份有限公司</p> <p>注册地址:北京市东城区建国门内大街 69 号</p> <p>办公地址:北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座九层</p> <p>法定代表人:蒋超良</p> <p>成立时间:2009 年 1 月 15 日</p> <p>批准设立机关和批准设立文号:中国银监会银监复【2009】13 号</p> <p>基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]23 号</p> <p>注册资本:32,479,411.7 万元人民币</p> <p>存续期间:持续经营</p>	<p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况</p> <p>名称:中国农业银行股份有限公司</p> <p>注册地址:北京市东城区建国门内大街 69 号</p> <p>办公地址:北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座九层</p> <p>法定代表人:周慕冰</p> <p>成立时间:2009 年 1 月 15 日</p> <p>批准设立机关和批准设立文号:中国银监会银监复【2009】13 号</p> <p>基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]23 号</p> <p>注册资本:32,479,411.7 万元人民币</p> <p>存续期间:持续经营</p>
第十二部分 基金 的投资	<p>二、投资范围</p> <p>本基金投资范围包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括中小企业私募债券)、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其它品种,本基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。</p> <p>本基金将基金资产的 80%-95% 投资于股票资产,其中投资于中小板及创业板的上市公司股票不低于非现金基金资产的 80%,权证投资比例不超过基金资产净值的 3%,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,本基金保留的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%。</p>	<p>二、投资范围</p> <p>本基金投资范围包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括中小企业私募债券)、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其它品种,本基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。</p> <p>本基金将基金资产的 80% -95% 投资于股票资产,其中投资于中小板及创业板的上市公司股票不低于非现金基金资产的 80%,权证投资比例不超过基金资产净值的 3%,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,本基金保留的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%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</p>
第十二部	四、投资限制	四、投资限制

分基金的投资	<p>1、组合限制</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%的现金或到期日在一年以内的政府债券;</p>	<p>1、组合限制</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、存出保证金和应收申购款等;</p>
第十二部分基金的投资		<p>增加:</p> <p>(12)本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票,不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,不超过该上市公司可流通股票的30%;</p> <p>(13)本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的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项所规定的比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;</p> <p>(14)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投资范围保持一致;</p>
第十二部分基金的投资	<p>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。法律法规另有规定,从其规定。</p>	<p>除上述第(2)、(13)、(14)、(15)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。法律法规另有规定,从其规定。</p>
第十四部分基金财产的估值	<p>三、估值方法</p> <p>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:</p> <p>(3)首次公开发行有明确锁定期的股票,同一股票在交易所上市后,按交易所上市的同一股票的估值方法估值;非公开发行有明确锁定期的股票,按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>	<p>三、估值方法</p> <p>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:</p> <p>(3)流通受限的股票,包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等(不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票),按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>
第十四部分	三、估值方法	三、估值方法 增加:

分基金财产的估值		8、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。
第十四部分基金财产的估值	<p>六、暂停估值的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</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、中国证监会和基金合同认定的其它情形。</p>	<p>六、暂停估值的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</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、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时，经与基金托管人协商确认后，应当暂停估值；</p> <p>4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。</p>
第十八部分基金的信息披露	<p>(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</p> <p>基金管理人应当在每年结束之日起90日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定媒体上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。</p> <p>基金管理人应当在上半年结束之日起60日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定媒体上。</p> <p>基金管理人应当在每个季度结束之日起15个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定媒体和网站上。</p> <p>基金合同生效不足2个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。</p> <p>基金定期报告在公开披露的第2个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。</p>	<p>(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</p> <p>基金管理人应当在每年结束之日起90日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定媒体上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。</p> <p>基金管理人应当在上半年结束之日起60日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定媒体上。</p> <p>基金管理人应当在每个季度结束之日起15个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定媒体和网站上。</p> <p>基金合同生效不足2个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。</p> <p>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。</p> <p>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例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文件中“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本基金的特定风险，中国证监会认定的特殊情</p>

		形除外。 基金定期报告在公开披露的第2个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。
第十八部分 基金的信息披露		(七) 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； 27、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；
第二十四部分 基金合同内容摘要		摘要部分也做了相应修改，与合同修订内容保持一致。

二、 基金托管协议修订内容

章节	修订前	修订后
一、基金托管协议当事人	<p>(二) 基金托管人 名称：中国农业银行股份有限公司 注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号 办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座九层 邮政编码：100031 法定代表人：蒋超良 成立时间：2009 年 1 月 15 日 基金托管资格批准文号：中国证监会证监基字[1998]23 号 注册资本：32,479,411.7 万元人民币 存续期间：持续经营</p>	<p>(二) 基金托管人 名称：中国农业银行股份有限公司 注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号 办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座九层 邮政编码：100031 法定代表人：周慕冰 成立时间：2009 年 1 月 15 日 基金托管资格批准文号：中国证监会证监基字[1998]23 号 注册资本：32,479,411.7 万元人民币 存续期间：持续经营</p>
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的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池和交易对手库，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。</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。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池和交易对手库，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。</p>

	<p>本基金投资范围包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括中小企业私募债券）、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其它品种，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p> <p>本基金将基金资产的 80%-95% 投资于股票资产，其中投资于中小板及创业板的上市公司股票不低于非现金基金资产的 80%，权证投资比例不超过基金资产净值的 3%，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，本基金保留的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%。</p>	<p>本基金投资范围包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括中小企业私募债券）、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其它品种，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p> <p>本基金将基金资产的 80% -95% 投资于股票资产，其中投资于中小板及创业板的上市公司股票不低于非现金基金资产的 80%，权证投资比例不超过基金资产净值的 3%，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，本基金保留的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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</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>8、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>（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>8、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、存出保证金和应收申购款等；</p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>		<p>增加：</p> <p>9、本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不超过该上市公司可流通股票的 30%；</p> <p>10、本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 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该项所规定的比例限制的，基金管理人不可</p>

		得主动新增流动性受限资产的投资； 11、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投资范围保持一致；
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	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的投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。法律法规另有规定，从其规定。	除上述第8、10、11项及7.5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的投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。法律法规另有规定，从其规定。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	<p>(七)基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资流通受限证券进行监督。</p> <p>1、基金投资流通受限证券，应遵守《关于规范基金投资非公开发行股票行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。</p> <p>2、流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>	<p>(七)基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资流通受限证券进行监督。</p> <p>1、基金投资流通受限证券，应遵守《关于规范基金投资非公开发行股票行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。</p> <p>2、流通受限证券与上文所述流动性受限资产并不完全一致，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>
八、基金资产净值计算和会计核算	<p>(二)基金资产估值方法和特殊情形的处理</p> <p>2、估值方法</p> <p>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>(3)首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>	<p>(二)基金资产估值方法和特殊情形的处理</p> <p>2、估值方法</p> <p>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>(3)流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等(不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票)，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>
八、基金资产净值计算和会计核算		<p>增加：</p> <p>8、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。</p>

八、基金资产净值计算和会计核算		<p>(四)暂停估值与公告基金份额净值的情形 增加： (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时，经与基金托管人协商确认后，应当暂停估值；</p>
十、基金信息披露	<p>(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 1. 职责 基金托管人和基金管理人在信息披露过程中应以保护基金份额持有人利益为宗旨，诚实信用，严守秘密。基金管理人负责办理与基金有关的信息披露事宜，对于本章第(二)条规定的应由基金托管人复核的事项，应经基金托管人复核无误后，由基金管理人予以公布。 基金管理人应当在中国证监会规定的时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的全国性报刊和基金管理人的互联网网站等媒介披露。根据法律法规应由基金托管人公开披露的信息，基金托管人将通过指定报刊和基金托管人的互联网网站公开披露。 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信息： (1)不可抗力； (2)法律法规、基金合同或中国证监会规定的情况。</p>	<p>(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 1. 职责 基金托管人和基金管理人在信息披露过程中应以保护基金份额持有人利益为宗旨，诚实信用，严守秘密。基金管理人负责办理与基金有关的信息披露事宜，对于本章第(二)条规定的应由基金托管人复核的事项，应经基金托管人复核无误后，由基金管理人予以公布。 基金管理人应当在中国证监会规定的时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的全国性报刊和基金管理人的互联网网站等媒介披露。根据法律法规应由基金托管人公开披露的信息，基金托管人将通过指定报刊和基金托管人的互联网网站公开披露。 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信息： (1)不可抗力； (2)发生基金合同约定的暂停估值的情形； (3)法律法规、基金合同或中国证监会规定的情况。</p>

关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改基金合同、托管协议的内容说明

景顺长城低碳科技主题灵活配置混合型证券投资基金

一、 基金合同修订内容

章节	修订前	修订后
第一部分 前言	<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>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>
第二部分 释义		<p>增加：</p> <p>52、《流动性风险管理规定》：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</p> <p>53、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>54、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>
第六部分 基金份额的申购与赎回	<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>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>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>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，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</p> <p>4、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额等数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。</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，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</p> <p>4、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额等数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。</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。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。具体请参见相关公告。</p>
第六部分 基金份额 的申购、 赎回	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入的方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p>	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示，对于持续持有期少于7日的投资者，本基金将收取不低于1.5%的赎回费并全额计入基金财产。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入的方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p>
第六部分 基金份额 的申购、 赎回		<p>增加：</p> <p>8、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，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、自律组织的规定。</p>
第六部分 基金份额 的申购、 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：</p> <p>1、因不可抗力导致基金无法正常运作。</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。</p> <p>3、证券、期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算</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：</p> <p>1、因不可抗力导致基金无法正常运作。</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。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</p>

	<p>当日基金资产净值。</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>5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形。</p> <p>6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</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>用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受申购申请。</p> <p>3、证券、期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</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>5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形。</p> <p>6、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。</p> <p>7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述第 1、2、3、5、7 项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全部或部分拒绝的，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、 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>1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，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>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>1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，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。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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项。</p>
<p>第六部分 基金份额</p>		<p>九、巨额赎回的情形及处理方式增加：</p> <p>(3) 如果基金发生巨额赎回，</p>

<p>的申购、赎回</p>		<p>在单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额 20%以上的赎回申请的情形下,基金管理人可以对该基金份额持有人超过 20%以上的部分延期办理赎回申请。对于当日非延期的赎回申请,应当按单个账户非延期赎回申请量占非延期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。</p>
<p>第七部分 基金合同当事人及权利义务</p>	<p>二、基金托管人 (一) 基金托管人简况 名称:中国农业银行股份有限公司 住所:北京市东城区建国门内大街 69 号 法定代表人:刘士余 成立时间:2009 年 1 月 15 日 批准设立机关和批准设立文号:中国银监会银监复【2009】13 号 组织形式:股份有限公司 注册资本:32,479,411.7 万元人民币 存续期间:持续经营 基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字【1998】23 号</p>	<p>二、基金托管人 (一) 基金托管人简况 名称:中国农业银行股份有限公司 住所:北京市东城区建国门内大街 69 号 法定代表人:周慕冰 成立时间:2009 年 1 月 15 日 批准设立机关和批准设立文号:中国银监会银监复【2009】13 号 组织形式:股份有限公司 注册资本:32,479,411.7 万元人民币 存续期间:持续经营 基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字【1998】23 号</p>
<p>第十二部分 基金的投资</p>	<p>二、投资范围 本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、中小企业私募债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场</p>	<p>二、投资范围 本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、中小企业私募债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、</p>

	<p>工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。</p> <p>本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 0%–95%。本基金投资于低碳科技主题相关上市公司证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；权证占基金资产净值的比例不超过 3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约缴纳的保证金后，基金保留的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%。</p>	<p>货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。</p> <p>本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 0%–95%。本基金投资于低碳科技主题相关上市公司证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；权证占基金资产净值的比例不超过 3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约缴纳的保证金后，基金保留的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、存出保证金和应收申购款等。</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>(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>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</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、存出保证金和应收申购款等；</p>
<p>第十二部分 基金的投资</p>		<p>增加：</p> <p>(12) 本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不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，不超过该上市公司可流通股票的 30%；</p> <p>(13) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 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项所规定的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>(14) 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投资范</p>

		围保持一致；
第十二部分 基金的投资	因证券、期货市场波动、上市公司合并、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，从其规定。	除上述第(2)、(13)、(14)、(15)项外，因证券、期货市场波动、上市公司合并、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，从其规定。
第十四部分 基金财产的估值	三、估值方法 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理： (4)首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。	三、估值方法 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理： (4) 流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等(不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票)，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。
第十四部分 基金财产的估值	三、估值方法	三、估值方法 增加： 8、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。
第十四部分 基金财产的估值	六、暂停估值的情形 1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； 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； 3、中国证监会和基金合同认定的其它情形。	六、暂停估值的情形 1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； 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； 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时，经与基金托管人协商确认后，应当暂停估值； 4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。
第十八部分 基金的信息披露	(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 基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定媒介上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。 基金管理人应当在上半年结束之	(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 基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定媒介上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。 基金管理人应当在上半年结束

	<p>日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定媒介上。</p> <p>基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定媒介上。</p> <p>基金合同生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。</p> <p>基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。</p>	<p>之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定媒介上。</p> <p>基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定媒介上。</p> <p>基金合同生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。</p> <p>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。</p> <p>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例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文件中“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本基金的特定风险，中国证监会认定的特殊情形除外。</p> <p>基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。</p>
第十八部分 基金的信息披露		<p>(七) 临时报告</p> <p>增加：</p> <p>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；</p> <p>27、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；</p>
第二十四部分 基金合同内容摘要		<p>摘要部分也做了相应修改，与合同修订内容保持一致。</p>

二、 基金托管协议修订内容

章节	修订前	修订后
一、基金托管协议当事人	<p>(二) 基金托管人 名称：中国农业银行股份有限公司</p>	<p>(二) 基金托管人 名称：中国农业银行股份有限公司</p>

	<p>注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号 办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座九层 邮政编码：100031 法定代表人：刘士余 成立时间：2009 年 1 月 15 日 基金托管资格批准文号：中国证监会证监基字[1998]23 号 注册资本：32,479,411.7 万元人民币</p> <p>存续期间：持续经营</p>	<p>注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号 办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座九层 邮政编码：100031 法定代表人：周慕冰 成立时间：2009 年 1 月 15 日 基金托管资格批准文号：中国证监会证监基字[1998]23 号 注册资本：32,479,411.7 万元人民币</p> <p>存续期间：持续经营</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。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的,基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池和交易对手库,以便基金托管人运用相关技术系统,对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督,对存在疑义的事项进行核查。</p> <p>本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、中小企业私募债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。</p> <p>本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的 0%-95%。本基金投资于低碳科技主题相关上市公司证券的比例不低于非现金基金资产的 80%;权证占基金资产净值的比例不超过 3%;每个交易日日终在扣除股指期货合约缴纳的保证金后,基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券占</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。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的,基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池和交易对手库,以便基金托管人运用相关技术系统,对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督,对存在疑义的事项进行核查。</p> <p>本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、中小企业私募债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。</p> <p>本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的 0%-95%。本基金投资于低碳科技主题相关上市公司证券的比例不低于非现金基金资产的 80%;权证占基金资产净值的比例不超过 3%;每个交易日日终在扣除股指期货合约缴纳的保证金后,基金</p>

	基金资产净值的比例不低于 5%。	保留的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、存出保证金和应收申购款等。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	<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>10、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>(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>10、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、存出保证金和应收申购款等;</p>
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查		<p>增加:</p> <p>11、本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票,不超过该上市公司可流通股票的 15%;本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不超过该上市公司可流通股票的 30%;</p> <p>12、本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 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该项所规定的比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;</p> <p>13、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投资范围保持一致;</p>
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	<p>因证券、期货市场波动、上市公司合并、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。</p>	<p>除上述第 10、12、13 项及 9.5 外,因证券、期货市场波动、上市公司合并、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。</p>
三、基金托管人对基金管理人的业务	<p>(七)基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金投资流通受限证券进行监督。</p> <p>1、基金投资流通受限证券,应遵守《关于规范基金投资非公开发行证</p>	<p>(七)基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金投资流通受限证券进行监督。</p> <p>1、基金投资流通受限证券,应遵守《关于规范基金投资非公开发行证</p>

<p>监督和核查</p>	<p>券行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。</p> <p>2、流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>	<p>证券行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。</p> <p>2、流通受限证券与上文所述流动性受限资产并不完全一致，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>
<p>八、基金资产净值计算和会计核算</p>	<p>(二)基金资产估值方法和特殊情形的处理</p> <p>2、估值方法</p> <p>(2)处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>4)首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>	<p>(二)基金资产估值方法和特殊情形的处理</p> <p>2、估值方法</p> <p>(2)处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>4)流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等(不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票)，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>
<p>八、基金资产净值计算和会计核算</p>		<p>增加：</p> <p>(8)当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。</p>
<p>八、基金资产净值计算和会计核算</p>		<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时，经与基金托管人协商确认后，应当暂停估值；</p>

关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改基金合同、托管协议的内容说明

景顺长城景盈金利债券型证券投资基金

一、 基金合同修订内容

章节	修订前	修订后
第一部分 前言	<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>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>
第二部分 释义		<p>增加：</p> <p>54、《流动性风险管理规定》：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</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>56、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>
第六部分 基金份额的申购与赎回	<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>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</p>	<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>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</p>

	<p>人累计持有的基金份额上限，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</p> <p>4、基金管理人可在法律法规允许的情况下，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实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。</p>	<p>资人累计持有的基金份额上限，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</p> <p>4、基金管理人可在法律法规允许的情况下，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实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。</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。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。具体请参见相关公告。</p>
第六部分 基金份额 的申购、 赎回	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>4、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见《招募说明书》。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额的基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入的方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p>	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>4、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见《招募说明书》。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示，对于持续持有期少于7日的投资者，本基金将收取不低于1.5%的赎回费并全额计入基金财产。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额的基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入的方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p>
第六部分 基金份额 的申购、 赎回		<p>增加：</p> <p>9、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，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、自律组织的规定。</p>
第六部分 基金份额 的申购、 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：</p> <p>1、因不可抗力导致基金无法正常运作。</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。</p> <p>3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</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：</p> <p>1、因不可抗力导致基金无法正常运作。</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。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</p>

	<p>4、基金管理人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>5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形。</p> <p>6、销售机构或登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统、基金登记系统或基金会计系统无法正常运行。</p> <p>7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述第 1、2、3、5、6、7 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>大不确定性，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受申购申请。</p> <p>3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</p> <p>4、基金管理人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>5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形。</p> <p>6、销售机构或登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统、基金登记系统或基金会计系统无法正常运行。</p> <p>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%，或者变相规避 50%集中度的情形时。</p> <p>8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>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全部或部分拒绝的，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、 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>1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，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>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>1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，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。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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项。</p>

<p>第六部分 基金份额 的申购、 赎回</p>		<p>九、巨额赎回的情形及处理方式增加：</p> <p>(3) 如果基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额 20%以上的赎回申请的情形下，基金管理人可以对该基金份额持有人超过 20%以上的部分延期办理赎回申请。对于当日非延期的赎回申请，应当按单个账户非延期赎回申请量占非延期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该类基金份额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。</p>
<p>第十二部分 基金 的投资</p>	<p>二、投资范围</p> <p>本基金的投资范围主要为依法发行的固定收益类品种，包括国内依法发行上市的国家债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、中小企业私募债券、公司债券、中期票据、短期融资券、质押及买断式回购、协议存款、通知存款、同业存单、定期存款、资产支持证券、可转换债券（含分离型可转换债券）、银行存款等。本基金同时投资于股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证等权益类品种以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，其中，本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>二、投资范围</p> <p>本基金的投资范围主要为依法发行的固定收益类品种，包括国内依法发行上市的国家债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、中小企业私募债券、公司债券、中期票据、短期融资券、质押及买断式回购、协议存款、通知存款、同业存单、定期存款、资产支持证券、可转换债券（含分离型可转换债券）、银行存款等。本基金同时投资于股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证等权益类品种以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，其中，本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</p>

第十二部分 基金的投资	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(1)本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的80%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的20%，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%；</p>	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(1)本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的80%，股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的20%；</p> <p>(2)现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；</p>
第十二部分 基金的投资		<p>增加：</p> <p>(12)本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不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，不超过该上市公司可流通股票的30%；</p> <p>(13)本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的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项所规定的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>(14)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投资范围保持一致；</p>
第十二部分 基金的投资	<p>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，从其规定。</p>	<p>除上述第(2)、(13)、(14)、(15)项外，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，从其规定。</p>
第十四部分 基金财产的估值	<p>三、估值方法</p> <p>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>(3)首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>	<p>三、估值方法</p> <p>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>(3)流通受限股票，指在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行时股票公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，按监管机构或行业协会有关规</p>

		定确定公允价值。
第十四部分 基金财产的估值	三、估值方法	三、估值方法 增加： 7、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。
第十四部分 基金财产的估值	六、暂停估值的情形 1、基金投资所涉及的证券交易所市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； 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； 3、中国证监会和基金合同认定的其它情形。	六、暂停估值的情形 1、基金投资所涉及的证券交易所市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； 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； 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一致后，应当暂停估值； 4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。
第十八部分 基金的信息披露	（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 基金管理人应当在每年结束之日起90日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于其网站上，将年度报告摘要登载在指定媒介上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。 基金管理人应当在上半年结束之日起60日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在其网站上，将半年度报告摘要登载在指定媒介上。 基金管理人应当在每个季度结束之日起15个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定媒介上。 《基金合同》生效不足2个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。 基金定期报告在公开披露的第2个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。	（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 基金管理人应当在每年结束之日起90日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于其网站上，将年度报告摘要登载在指定媒介上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。 基金管理人应当在上半年结束之日起60日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在其网站上，将半年度报告摘要登载在指定媒介上。 基金管理人应当在每个季度结束之日起15个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定媒介上。 《基金合同》生效不足2个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。 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，基金管理人应当在基金定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”

		<p>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。</p> <p>基金定期报告在公开披露的第2个工作日,分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。</p>
第十八部分 基金的信息披露		<p>(七) 临时报告</p> <p>增加:</p> <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的重大事项时;</p> <p>28、基金管理人采用摆动定价机制进行估值;</p>
第二十四部分 基金合同内容摘要		<p>摘要部分也做了相应修改,与合同修订内容保持一致。</p>

二、 基金托管协议修订内容

章节	修订前	修订后
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的约定,对基金投资范围、投资对象进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的,基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池和交易对手库,以便基金托管人运用相关技术系统,对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督,对存在疑义的事项进行核查。</p> <p>本基金的投资范围主要为依法发行的固定收益类品种,包括国内依法发行上市的国家债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、中小企业私募债券、公司债券、中期票据、短期融资券、质押及买断式回购、协议存款、通知存款、同业存单、定期存款、资产支持证券、可转换债券(含分离型可转换债券)、银行存款等。本基金同时投资于股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证等权益类品种以</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。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的,基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池和交易对手库,以便基金托管人运用相关技术系统,对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督,对存在疑义的事项进行核查。</p> <p>本基金的投资范围主要为依法发行的固定收益类品种,包括国内依法发行上市的国家债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、中小企业私募债券、公司债券、中期票据、短期融资券、质押及买断式回购、协议存款、通知存款、同业存单、定期存款、资产支持证券、可转换债券(含分离型可转换债券)、银行存款等。本基金同时投资于股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证等权益类品</p>

	<p>及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。</p> <p>本基金的配置比例为：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，其中，本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>种以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。</p> <p>本基金的配置比例为：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，其中，本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</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>1、本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</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>1、本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%，股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%；</p> <p>2、现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；</p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>		<p>增加：</p> <p>12、本基金管理人管理的、且由本基金托管人托管的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的、且由本基金托管人托管的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不超过该上市公司可流通股票的 30%；</p> <p>13、本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 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项所规定的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>14、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投资范围保持一致；</p>

三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	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，从其规定。	除上述第2、13、14、15项外，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，从其规定。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	<p>(七)基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资流通受限证券进行监督。</p> <p>1、基金投资流通受限证券，应遵守《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。</p> <p>2、流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>	<p>(七)基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资流通受限证券进行监督。</p> <p>1、基金投资流通受限证券，应遵守《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。</p> <p>2、流通受限证券与上文所述流动性受限资产并不完全一致，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>
八、基金资产净值计算和会计核算	<p>(二)基金资产估值方法和特殊情形的处理</p> <p>2、估值方法</p> <p>(2)处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>3)首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>	<p>(二)基金资产估值方法和特殊情形的处理</p> <p>2、估值方法</p> <p>(2)处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>3)流通受限股票，指在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行时股票公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>
八、基金资产净值计算和会计核算		<p>增加：</p> <p>(7)当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。</p>
八、基金资产净值计算和会计核算		<p>(四)暂停估值与公告基金份额净值的情形</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一致后，应当暂停估值；</p>

<p>十、基金信息披露</p>	<p>(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</p> <p>1. 职责</p> <p>基金托管人和基金管理人在信息披露过程中应以保护基金份额持有人利益为宗旨,诚实信用,严守秘密。基金管理人负责办理与基金有关的信息披露事宜,对于本章第(二)条规定的应由基金托管人复核的事项,应经基金托管人复核无误后,由基金管理人予以公布。</p> <p>基金管理人应当在中国证监会规定的时间内,将应予披露的基金信息通过指定媒介披露。根据法律法规应由基金托管人公开披露的信息,基金托管人将通过指定媒介公开披露。</p> <p>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信息:</p> <p>(1)不可抗力;</p> <p>(2)法律法规、基金合同或中国证监会规定的情况。</p>	<p>(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</p> <p>1. 职责</p> <p>基金托管人和基金管理人在信息披露过程中应以保护基金份额持有人利益为宗旨,诚实信用,严守秘密。基金管理人负责办理与基金有关的信息披露事宜,对于本章第(二)条规定的应由基金托管人复核的事项,应经基金托管人复核无误后,由基金管理人予以公布。</p> <p>基金管理人应当在中国证监会规定的时间内,将应予披露的基金信息通过指定媒介披露。根据法律法规应由基金托管人公开披露的信息,基金托管人将通过指定媒介公开披露。</p> <p>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信息:</p> <p>(1)不可抗力;</p> <p>(2)发生基金合同约定的暂停估值的情形;</p> <p>(3)法律法规、基金合同或中国证监会规定的情况。</p>
------------------------	---	---

关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改 基金合同、托管协议的内容说明

景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金

一、 基金合同修订内容

章节	修订前	修订后
<p>第一部分 前言</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</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</p>

	<p>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>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>第二部分 释义</p>		<p>增加： 55、《流动性风险管理规定》：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 56、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 57、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>第七部分 基金份额的申购与赎回</p>	<p>二、转型前“景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金”的申购、赎回 (四) 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，具体规定请参见招募说明书或相关公告。 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。 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，具体规定请参见招募说明书或相关公告。 4、基金管理人可在法律法规允许的情况下，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实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中</p>	<p>二、转型前“景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金”的申购、赎回 (四) 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，具体规定请参见招募说明书或相关公告。 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。 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，具体规定请参见招募说明书或相关公告。 4、基金管理人可在法律法规允许的情况下，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实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。</p>

	国证监会备案。	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。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。具体请参见相关公告。
第七部分 基金份额 的申购与 赎回	<p>(五) 申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见《招募说明书》本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入的方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p>	<p>(五) 申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见《招募说明书》本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示，对于持续持有期少于7日的投资者，本基金将收取不低于1.5%的赎回费并全额计入基金财产。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入的方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p>
第七部分 基金份额 的申购与 赎回		<p>增加：</p> <p>8、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，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。</p>
第七部分 基金份额 的申购与 赎回	<p>(六) 拒绝或暂停申购的情形</p> <p>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：</p> <p>1、因不可抗力导致基金无法正常运作。</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。</p> <p>3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</p> <p>4、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>5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形。</p>	<p>(六) 拒绝或暂停申购的情形</p> <p>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：</p> <p>1、因不可抗力导致基金无法正常运作。</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受申购申请。</p> <p>3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</p> <p>4、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</p>

	<p>6、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。</p> <p>7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述第 1、2、3、5、7 项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。如封闭期结束之日后第一个工作日因不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放申购业务的，开放期自不可抗力或其他情形的影响因素消除之日起的下一个工作日开始。开放期内因发生不可抗力或其他情形而发生基金暂停申购业务的，开放期将按因不可抗力或其他情形而暂停申购的期间相应延长。</p>	<p>人利益时。</p> <p>5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形。</p> <p>6、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。</p> <p>7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述第 1、2、3、5、7 项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全部或部分拒绝的，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。如封闭期结束之日后第一个工作日因不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放申购业务的，开放期自不可抗力或其他情形的影响因素消除之日起的下一个工作日开始。开放期内因发生不可抗力或其他情形而发生基金暂停申购业务的，开放期将按因不可抗力或其他情形而暂停申购的期间相应延长。</p>
<p>第七部分 基金份额 的申购与 赎回</p>	<p>(七) 暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>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：</p> <p>1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，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>3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</p> <p>4、继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时，可暂停接受投资人的赎回申请。</p> <p>5、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形或者基金合同约定的其他情形。</p>	<p>(七) 暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>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：</p> <p>1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，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。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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项。</p> <p>3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</p> <p>4、继续接受赎回申请将损害现</p>

		<p>有基金份额持有人利益的情形时,可暂停接受投资人的赎回申请。</p> <p>5、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形或者基金合同约定的其他情形。</p>
<p>第七部分 基金份额 的申购与 赎回</p>	<p>(八)巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>当基金出现巨额赎回时,基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或延缓支付赎回款项。</p> <p>(1) 全额赎回:当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时,按正常赎回程序执行。</p> <p>(2) 延缓支付赎回款项:本基金单个开放日出现巨额赎回的,基金管理人对于符合法律法规及基金合同约定的赎回申请应于当日全部予以办理和确认。但对于已接受的赎回申请,如基金管理人认为全额支付投资人的赎回款项有困难或认为全额支付投资人的赎回款项可能会对基金的资产净值造成较大波动的,基金管理人应当接受并确认所有的赎回申请,当日按比例办理的赎回份额不得低于基金总份额的 20%,基金管理人可对其余赎回款项进行延缓支付,但不得超过 20 个工作日。延缓支付的赎回申请以赎回申请当日的基金份额净值为基础计算赎回金额。</p> <p>3、延缓支付的公告</p> <p>当发生上述巨额赎回并延缓支付赎回款项时,基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个工作日内通知基金份额持有人,说明有关处理方法,同时在指定媒介上刊登公告。</p>	<p>(八)巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>当基金出现巨额赎回时,基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回、延缓支付赎回款项或部分延期赎回。</p> <p>(1) 全额赎回:当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时,按正常赎回程序执行。</p> <p>(2) 延缓支付赎回款项:本基金单个开放日出现巨额赎回的,基金管理人对于符合法律法规及基金合同约定的赎回申请应于当日全部予以办理和确认。但对于已接受的赎回申请,如基金管理人认为全额支付投资人的赎回款项有困难或认为全额支付投资人的赎回款项可能会对基金的资产净值造成较大波动的,基金管理人应当接受并确认所有的赎回申请,当日按比例办理的赎回份额不得低于基金总份额的 20%,基金管理人可对其余赎回款项进行延缓支付,但不得超过 20 个工作日。延缓支付的赎回申请以赎回申请当日的基金份额净值为基础计算赎回金额。</p> <p>(3) 部分延期赎回:在自由开放期内,在单个基金份额持有人超过上一工作日基金总份额 40%以上的赎回申请的情形下,基金管理人可以对该基金份额持有人超过 40%以上的部分延期办理赎回。对于其余当日非自动延期办理的赎回申请,应当按单个账户非自动延期办理的赎回申请量占非自动延期办理的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</p>

		<p>止。如延期办理期限超过开放期，则开放期相应延长，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前一开放日基金总份额 40%而被延期办理赎回的单个基金份额持有人办理赎回业务。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。部分延期赎回不受单笔赎回最低份额的限制。</p> <p>3、巨额赎回的公告</p> <p>当发生上述巨额赎回并延缓支付赎回款项或部分延期赎回时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒介上刊登公告。</p>
<p>第七部分 基金份额 的申购与 赎回</p>	<p>三、转型为“景顺长城景瑞睿利回报混合型证券投资基金”的申购、赎回</p> <p>(四) 申购和赎回的数量限制</p> <p>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，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</p> <p>4、基金管理人可在法律法规允许的情况下，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实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。</p>	<p>三、转型为“景顺长城景瑞睿利回报混合型证券投资基金”的申购、赎回</p> <p>(四) 申购和赎回的数量限制</p> <p>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，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</p> <p>4、基金管理人可在法律法规允许的情况下，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实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。</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。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。具体请参见相关公告。</p>

<p>第七部分 基金份额 的申购与 赎回</p>	<p>(五) 申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后2位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p>	<p>(五) 申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示，对于持续持有期少于7日的投资者，本基金将收取不低于1.5%的赎回费并全额计入基金财产。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后2位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p> <p>增加：</p> <p>8、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，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。</p>
<p>第七部分 基金份额 的申购与 赎回</p>	<p>(六) 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：</p> <p>1、因不可抗力导致基金无法正常运作。</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。</p> <p>3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</p> <p>4、接受某笔或某些申购申请影响或损害现有基金份额持有人利益时。</p> <p>5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或其他损害现有基金份额持有人利益的情形。</p> <p>6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</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>(六) 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：</p> <p>1、因不可抗力导致基金无法正常运作。</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受申购申请。</p> <p>3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</p> <p>4、接受某笔或某些申购申请影响或损害现有基金份额持有人利益时。</p> <p>5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或其他损害现有基金份额持有人利益的情形。</p> <p>6、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</p>

		<p>形时。</p> <p>7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述第1、2、3、5、7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全部或部分拒绝的，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>
第七部分 基金份额 的申购与 赎回	<p>(七) 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> <ol style="list-style-type: none"> 1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，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。 3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。 4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。 5、继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时，可暂停接受投资人的赎回申请。 6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形或者基金合同约定的其他情形。 	<p>(七) 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> <ol style="list-style-type: none"> 1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，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。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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项。 3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。 4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。 5、继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时，可暂停接受投资人的赎回申请。 6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形或者基金合同约定的其他情形。
第七部分 基金份额 的申购与 赎回	<p>(八) 巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。</p> <p>(1) 全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。</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</p>	<p>(八) 巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。</p> <p>(1) 全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。</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</p>

	<p>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。</p> <p>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。</p>	<p>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。</p> <p>若进行上述延期办理，在单个基金份额持有人超过上一工作日基金总份额 20%以上的赎回申请的情形下，基金管理人可以对该基金份额持有人超过 20%以上的部分延期办理赎回申请。对于其余当日非自动延期办理的赎回申请，应当按单个账户非自动延期办理的赎回申请量占非自动延期办理的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。部分延期赎回不受单笔赎回最低份额的限制。</p>
<p>第八部分 基金合同 当事人及 权利义务</p>	<p>删除： 联系电话：010-66060069 传真：010-68121816 联系人：林葛</p>	
<p>第十三部分 基金的投资</p>	<p>二、投资范围 本基金的投资范围主要为依法发行的债券（包括国内依法发行上市的国家债券、金融债券、次级债券、企业债券、公司债券、可转换债券（含分离型可转换债券）、中央银行票据、中期票据、短期融资券及其他经中国证监会允许投资的债券）、债券回购、同业存单、资产支持证券、银行存款（包括协议存款、通知存款、定期存款）等。本基金同时投资于股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。</p>	<p>二、投资范围 本基金的投资范围主要为依法发行的债券（包括国内依法发行上市的国家债券、金融债券、次级债券、企业债券、公司债券、可转换债券（含分离型可转换债券）、中央银行票据、中期票据、短期融资券及其他经中国证监会允许投资的债券）、债券回购、同业存单、资产支持证券、银行存款（包括协议存款、通知存款、定期存款）等。本基金同时投资于股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。</p>

	<p>基金的投资组合比例为： 转型前“景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金”的投资组合比例：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 70%（开放期开始前 10 个工作日内至开放期结束后 10 个工作日内不受此比例限制），股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 30%，其中，本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%。任一开放期内，本基金持有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%，封闭期内不受前述 5%的限制。</p> <p>转型为“景顺长城景瑞睿利回报混合型证券投资基金”的投资组合比例：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 70%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 30%，其中，本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>基金的投资组合比例为： 转型前“景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金”的投资组合比例：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 70%（开放期开始前 10 个工作日内至开放期结束后 10 个工作日内不受此比例限制），股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 30%，其中，本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%。任一开放期内，本基金持有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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等，封闭期内不受前述 5%的限制。</p> <p>转型为“景顺长城景瑞睿利回报混合型证券投资基金”的投资组合比例：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 70%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 30%，其中，本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</p>
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>(2) 转型前，任一开放期内，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，在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制；转型后，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>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>(2) 转型前，任一开放期内，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、存出保证金和应收申购款等，在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制；转型后，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、存出保证金和应收申购款等；</p>
第十三部分基金的投资		<p>增加：</p> <p>(11) 本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不超过该上市公司可流通股票的 15%；本</p>

		<p>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，不超过该上市公司可流通股票的30%；</p> <p>(12) 转型前，任一开放期内，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的15%；转型后，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的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项所规定的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>(13) 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投资范围保持一致；</p>
第十三部分基金的投资	除上述第(11)项规定外，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。	除上述第(2)、(12)、(13)、(14)项规定外，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。
第十五部分基金资产估值	<p>三、估值方法</p> <p>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>(4) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>	<p>三、估值方法</p> <p>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>(4) 流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等(不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票)，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>
第十五部分基金资产估值		<p>三、估值方法</p> <p>增加：</p> <p>7、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。</p>
第十五部分基金资产估值		<p>六、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</p>

		允价值存在重大不确定时, 经与基金托管人协商确认后, 应当暂停估值;
第十五部分基金资产估值	<p>八、特殊情况的处理</p> <p>1、基金管理人或基金托管人按本基金合同规定的估值方法的第 7 项进行估值时, 所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。</p>	<p>八、特殊情况的处理</p> <p>1、基金管理人或基金托管人按本基金合同规定的估值方法的第 8 项进行估值时, 所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。</p>
第十九部分基金的信息披露	<p>(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</p> <p>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例超过 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。</p>	<p>(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</p> <p>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。</p> <p>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例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文件中“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本基金的特有风险, 中国证监会认定的特殊情形除外。</p>
第十九部分基金的信息披露		<p>(七) 临时报告</p> <p>增加:</p> <p>28、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> <p>29、基金管理人采用摆动定价机制进行估值;</p>
第二十五部分基金合同内容摘要		对应基金合同正文内容进行同步修改。

二、 基金托管协议修订内容

章节	修订前	修订后
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的约定, 对基金投资范围、投资对象进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的, 基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池和交易对手库, 以便基金托管人运用相关技术系统, 对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定</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。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的, 基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池和交易对手库, 以便基金托管人运用相关技术系统, 对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准</p>

	<p>进行监督，对存在疑义的事项进行核查。</p> <p>本基金的投资范围主要为依法发行的债券（包括国内依法发行上市的国家债券、金融债券、次级债券、企业债券、公司债券、可转换债券（含分离型可转换债券）、中央银行票据、中期票据、短期融资券及其他经中国证监会允许投资的债券）、债券回购、同业存单、资产支持证券、银行存款（包括协议存款、通知存款、定期存款）等。本基金同时投资于股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。</p> <p>本基金的投资组合比例为：转型前“景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金”的投资组合比例：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 70%（开放期开始前 10 个工作日至开放期结束后 10 个工作日内不受此比例限制），股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 30%，其中，本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%。任一开放期内，本基金持有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%，封闭期内不受前述 5%的限制。</p> <p>转型为“景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金”的投资组合比例：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 70%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 30%，其中，本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。</p> <p>本基金的投资范围主要为依法发行的债券（包括国内依法发行上市的国家债券、金融债券、次级债券、企业债券、公司债券、可转换债券（含分离型可转换债券）、中央银行票据、中期票据、短期融资券及其他经中国证监会允许投资的债券）、债券回购、同业存单、资产支持证券、银行存款（包括协议存款、通知存款、定期存款）等。本基金同时投资于股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。</p> <p>本基金的投资组合比例为：转型前“景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金”的投资组合比例：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 70%（开放期开始前 10 个工作日至开放期结束后 10 个工作日内不受此比例限制），股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 30%，其中，本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%。任一开放期内，本基金持有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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等，封闭期内不受前述 5%的限制。</p> <p>转型为“景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金”的投资组合比例：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 70%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 30%，其中，本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</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）转型前，任一开放期内，保</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）转型前，任一开放期内，</p>

	<p>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，在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制；转型后，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>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、存出保证金和应收申购款等，在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制；转型后，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、存出保证金和应收申购款等；</p> <p>增加：</p> <p>（11）本基金管理人管理的、且由本基金托管人托管的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的、且由本基金托管人托管的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不超过该上市公司可流通股票的 30%；</p> <p>（12）转型前，任一开放期内，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 15%；转型后，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 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项所规定的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>（13）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投资范围保持一致；</p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>	<p>除上述第（11）项规定外，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。</p>	<p>除上述第（2）、（12）、（13）、（14）项规定外，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。</p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>	<p>（七）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资流通受限证券进行监督。</p> <p>2、流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大</p>	<p>（七）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资流通受限证券进行监督。</p> <p>2、流通受限证券与上文提到的流动性受限资产并不完全一致，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定</p>

	消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。	期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。
八、基金资产净值计算和会计核算	<p>(二)基金资产估值方法和特殊情形的处理</p> <p>2、估值方法</p> <p>(2)处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:</p> <p>④首次公开发行有明确锁定期的股票,同一股票在交易所上市后,按交易所上市的同一股票的估值方法估值;非公开发行有明确锁定期的股票,按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>	<p>(二)基金资产估值方法和特殊情形的处理</p> <p>2、估值方法</p> <p>(2)处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:</p> <p>④流通受限的股票,包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等(不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票),按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>
八、基金资产净值计算和会计核算		<p>增加:</p> <p>(7)当发生大额申购或赎回情形时,在履行适当程序后,基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。</p>
八、基金资产净值计算和会计核算	<p>3、特殊情形的处理</p> <p>(1)基金管理人或基金托管人按本基金合同规定的估值方法的第(7)项进行估值时,所造成的误差不得作为基金资产估值错误处理。</p>	<p>3、特殊情形的处理</p> <p>(1)基金管理人或基金托管人按本基金合同规定的估值方法的第(8)项进行估值时,所造成的误差不得作为基金资产估值错误处理。</p>
八、基金资产净值计算和会计核算		<p>(四)暂停估值与公告基金份额净值的情形</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时,经与基金托管人协商确认后,应当暂停估值;</p>

关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改 基金合同、托管协议的内容说明

景顺长城资源垄断混合型证券投资基金(LOF)

一、 基金合同修订内容

章节	修订前	修订后
一、前言	2、订立本基金合同的依据是《中华人	2、订立本基金合同的依据是《中

	<p>人民共和国民法通则》、《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国信托法》、2003年10月28日第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过并于2004年6月1日起施行的《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、2004年6月29日中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)发布并于2004年7月1日起施行的《证券投资基金运作管理办法》(以下简称《运作办法》)和《证券投资基金销售管理办法》(以下简称《销售办法》)、2004年6月11日中国证监会发布并于2004年7月1日起施行的《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称《信息披露办法》)以及2004年8月17日深圳证券交易所发布并于2004年8月17日施行的《深圳证券交易所上市开放式基金业务规则》(以下简称《业务规则》)及其他有关规定。</p>	<p>人民共和国民法通则》、《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国信托法》、2003年10月28日第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过并于2004年6月1日起施行的《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、2004年6月29日中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)发布并于2004年7月1日起施行的《证券投资基金运作管理办法》(以下简称《运作办法》)和《证券投资基金销售管理办法》(以下简称《销售办法》)、2004年6月11日中国证监会发布并于2004年7月1日起施行的《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称《信息披露办法》)以及2004年8月17日深圳证券交易所发布并于2004年8月17日施行的《深圳证券交易所上市开放式基金业务规则》(以下简称《业务规则》)、《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》)及其他有关规定。</p>
<p>二、释义</p>		<p>增加： 《流动性风险管理规定》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 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 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>八、基金的申购和赎回</p>	<p>(一) 场外基金份额的申购与赎回 5、申购、赎回的数额约定</p>	<p>(一) 场外基金份额的申购与赎回 5、申购、赎回的数额约定</p>

	<p>(1)基金管理人可以规定投资人首次购买的最低金额、追加申购的最低金额、每个交易账户的最低基金余额、单个投资人累计持有的基金份额上限等,具体规定请参见招募说明书。</p> <p>(2)基金管理人可根据市场情况调整申购与赎回的有关数额限制,调整结果必须至少提前三个工作日在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。</p> <p>(3)本基金的申购有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后,以当日基金份额净值为基准计算并保留小数点后两位,小数点后第三位四舍五入,由此产生的误差计入基金资产。</p> <p>(4)赎回金额的处理方式:本基金的赎回金额按实际确认的有效赎回份额以当日基金份额净值为基准按四舍五入的方法计算并扣除相应的费用。</p>	<p>(1)基金管理人可以规定投资人首次购买的最低金额、追加申购的最低金额、每个交易账户的最低基金余额、单个投资人累计持有的基金份额上限等,具体规定请参见招募说明书。</p> <p>(2)基金管理人可根据市场情况调整申购与赎回的有关数额限制,调整结果必须至少提前三个工作日在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。</p> <p>(3)本基金的申购有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后,以当日基金份额净值为基准计算并保留小数点后两位,小数点后第三位四舍五入,由此产生的误差计入基金资产。</p> <p>(4)赎回金额的处理方式:本基金的赎回金额按实际确认的有效赎回份额以当日基金份额净值为基准按四舍五入的方法计算并扣除相应的费用。</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。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。具体请参见相关公告。</p>
<p>八、基金的申购和赎回</p>	<p>(三) 申购、赎回的价格、费用及其用途</p> <p>(1)申购和赎回本基金基金份额的价格按照基金份额净值加减一定的手续费产生。</p> <p>(2)本基金的申购费率、赎回费率最高不得超过法律法规规定的限额。</p> <p>(3)本基金的申购费由申购人承担,归销售机构所有。本基金的赎回费由赎回人承担,所收取的赎回费中不低于 25%的部分归入基金财产。申购费和赎回费用的用途为市场推广、基金份额销售及注册登记等。</p> <p>(4)本基金的申购费率、赎回费率由基金管理人确定并在招募说明书中列示。基金管理人可依照法律法规和中国证监会规定的程序在基金合同约定的范围内调整申购费率、赎回</p>	<p>(三) 申购、赎回的价格、费用及其用途</p> <p>(1)申购和赎回本基金基金份额的价格按照基金份额净值加减一定的手续费产生。</p> <p>(2)本基金的申购费率、赎回费率最高不得超过法律法规规定的限额。</p> <p>(3)本基金的申购费由申购人承担,归销售机构所有。本基金的赎回费由赎回人承担,对于持续持有期少于 7 日的投资者,本基金将收取不低于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产。对于持续持有期不少于 7 日的投资者,所收取的赎回费中不低于 25%的部分归入基金财产。申购费和赎回费用的用途为市场推广、基金份额销售及注册登记等。</p> <p>(4)本基金的申购费率、赎回</p>

	<p>率，调整申购费率、赎回费率应在实施前3个工作日内在至少一种指定媒体和网站上公告。</p> <p>(5)基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，在取得有关监管机构核准之后，对促销期间的基金申购费等实行优惠。</p>	<p>费率由基金管理人确定并在招募说明书中列示。基金管理人可依照法律法规和中国证监会规定的程序在基金合同约定的范围内调整申购费率、赎回费率，调整申购费率、赎回费率应在实施前3个工作日内在至少一种指定媒体和网站上公告。</p> <p>(5)基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，在取得有关监管机构核准之后，对促销期间的基金申购费等实行优惠。</p> <p>(6)当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，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。</p>
<p>八、基金的申购和赎回</p>	<p>(五)拒绝或暂停申购的情形及处理</p> <p>1、本基金出现以下情况之一时，基金管理人可拒绝或暂停接受基金投资者的申购申请：</p> <p>(1)不可抗力；</p> <p>(2)证券交易所交易时间非正常停市或其他情形，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；</p> <p>(3)基金管理人认为市场缺乏合适的投资机会，继续接受申购可能对已有基金份额持有人利益产生损害；</p> <p>(4)基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔申购；</p> <p>(5)基金管理人、基金托管人、代销机构或注册登记人的技术保障或人员支持等不充分；</p> <p>(6)法律、法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生暂停申购情形时，基金管理人应当立即在指定媒体上刊登暂停申购公告。</p> <p>发生本基金合同或招募说明书中未予载明的事项，但基金管理人认为有正当理由认为需要暂停基金申购，应当报中国证监会批准；经批准后，基金管理人应当立即在中国证监会指定的信息披露媒体上刊登暂停申购公告。</p>	<p>(五)拒绝或暂停申购的情形及处理</p> <p>1、本基金出现以下情况之一时，基金管理人可全部或部分拒绝或暂停接受基金投资者的申购申请：</p> <p>(1)不可抗力；</p> <p>(2)证券交易所交易时间非正常停市或其他情形，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；</p> <p>(3)基金管理人认为市场缺乏合适的投资机会，继续接受申购可能对已有基金份额持有人利益产生损害；</p> <p>(4)基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔申购；</p> <p>(5)基金管理人、基金托管人、代销机构或注册登记人的技术保障或人员支持等不充分；</p> <p>(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及采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受申购申请。</p> <p>(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%，或者变相规避50%集中度的情形时。</p> <p>(8)法律、法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p>

		<p>发生暂停申购情形（除第(7)项外）时，基金管理人应当立即在指定媒体上刊登暂停申购公告。</p> <p>发生本基金合同或招募说明书中未予载明的重大事项，但基金管理人认为有正当理由认为需要暂停基金申购，应当报中国证监会批准；经批准后，基金管理人应当立即在中国证监会指定的信息披露媒体上刊登暂停申购公告。</p>
八、基金的申购和赎回	<p>2、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形和处理</p> <p>本基金发生下列情形之一时，基金管理人可暂停接受基金投资者的赎回申请或延缓支付赎回款项：</p> <p>(1) 不可抗力；</p> <p>(2) 证券交易所交易时间非正常停市或其他情形，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；</p> <p>(3) 法律、法规、规章规定或中国证监会认定的其他情形。</p>	<p>2、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形和处理</p> <p>本基金发生下列情形之一时，基金管理人可暂停接受基金投资者的赎回申请或延缓支付赎回款项：</p> <p>(1) 不可抗力；</p> <p>(2) 证券交易所交易时间非正常停市或其他情形，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；</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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项。</p> <p>(4) 法律、法规、规章规定或中国证监会认定的其他情形。</p>
八、基金的申购和赎回	<p>(六) 巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为基金兑付投资者的全部赎回申请有困难，或认为为实现投资者的赎回申请进行的资产变现可能使基金份额净值发生较大波动时，基金管理人在当日接受赎回的比例不低于上一日基金总份额 10%的前提下，对其余申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占基金赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；当日未获受理的场内赎回将自动撤消，中国证券登记结算有限公司深圳分公司不受理延迟处理申报，当日未受理的场外赎回除投资者在提交申请时选择将当日未获受理部分予以撤销者外，延迟至下一开放日办理。转入下一开放日的申请不享有赎回优先权并将以该开放日的基金份额净值为基准计算，以此类推，直到全部完成赎回申请为止。</p>	<p>(六) 巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为基金兑付投资者的全部赎回申请有困难，或认为为实现投资者的赎回申请进行的资产变现可能使基金份额净值发生较大波动时，基金管理人在当日接受赎回的比例不低于上一日基金总份额 10%的前提下，对其余申请延期办理。</p> <p>若进行上述延期办理，在单个基金份额持有人超过上一工作日基金总份额 20%以上的赎回申请的情形下，基金管理人可以对该基金份额持有人超过 20%以上的部分延期办理赎回申请。对于其余当日非自动延期办理的赎回申请，应当按单个账户非自动延期办理的赎回申请量占非自动延期办理的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</p>

		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。部分延期赎回不受单笔赎回最低份额的限制。
九、基金合同当事人及其权利和义务	<p>(一) 基金合同当事人</p> <p>1、基金管理人 法定代表人：赵如冰</p> <p>2、基金托管人 法定代表人：刘士余</p>	<p>(一) 基金合同当事人</p> <p>1、基金管理人 法定代表人：杨光裕</p> <p>2、基金托管人 法定代表人：周慕冰</p>
十七、基金的投资	<p>2、投资管理的方法和标准</p> <p>(1) 资产配置</p> <p>本基金是一只高持股的混合型基金，对于股票的投资不少于基金资产净值的 65%，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。</p> <p>本基金投资于具有自然资源优势以及垄断优势的优质上市公司的股票比例至少高于股票投资的 80%。</p>	<p>2、投资管理的方法和标准</p> <p>(1) 资产配置</p> <p>本基金是一只高持股的混合型基金，对于股票的投资不少于基金资产净值的 65%，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</p> <p>本基金投资于具有自然资源优势以及垄断优势的优质上市公司的股票比例至少高于股票投资的 80%。</p>
十七、基金的投资		<p>(七) 投资限制</p> <p>2、本基金遵守以下投资组合比例限制：</p> <p>增加：</p> <p>(7) 本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不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，不超过该上市公司可流通股票的 30%；</p> <p>(8) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 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</p>

		<p>项所规定的比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;</p> <p>(9) 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投资范围保持一致;</p>
十七、基金的投资	<p>因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资组合不符合上述约定的比例的,基金管理人将根据《运作办法》的规定,在10个交易日内进行调整。</p>	<p>除上述第(8)、(9)项外,因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资组合不符合上述约定的比例的,基金管理人将根据《运作办法》的规定,在10个交易日内进行调整。</p>
二十、基金资产的估值	<p>四、估值方法</p> <p>1、股票估值方法:</p> <p>(2) 未上市股票的估值:</p> <p>①首次发行未上市的股票,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本价估值;</p> <p>②送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票,按估值日在证券交易所上市的同一种股票的市价进行估值;</p> <p>③首次公开发行有明确锁定期的股票,同一股票在交易所上市后,按估值日在证券交易所上市的同一种股票的市价进行估值;</p> <p>④非公开发行的且在发行时明确一定期限锁定期的股票,按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>	<p>四、估值方法</p> <p>1、股票估值方法:</p> <p>(2) 未上市股票的估值:</p> <p>①首次发行未上市的股票,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本价估值;</p> <p>②送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票,按估值日在证券交易所上市的同一种股票的市价进行估值;</p> <p>③流通受限的股票,包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等(不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票),按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>
二十、基金资产的估值		<p>四、估值方法</p> <p>增加:</p> <p>4、当发生大额申购或赎回情形时,在履行适当程序后,基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。</p>
二十、基金资产的估值		<p>七、暂停估值的情形</p> <p>增加</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时,经与基金托管人协商确认后,应当暂停估值;</p>
二十四、基金的信息披露	<p>(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</p>	<p>(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</p>

	<p>基金管理人应当在每年结束之日起九十日内,编制完成基金年度报告,并将年度报告正文登载于网站上,将年度报告摘要登载在指定报刊上。</p> <p>基金管理人应当在上半年结束之日起六十日内,编制完成基金半年度报告,并将半年度报告正文登载在网站上,将半年度报告摘要登载在指定报刊上。</p> <p>基金管理人应当在每个季度结束之日起十五个工作日内,编制完成基金季度报告,并将季度报告登载在指定报刊和网站上。</p> <p>基金合同生效不足两个月的,基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。</p> <p>《基金法》及其他有关法律法规或中国证监会另有规定的,从其规定。</p>	<p>基金管理人应当在每年结束之日起九十日内,编制完成基金年度报告,并将年度报告正文登载于网站上,将年度报告摘要登载在指定报刊上。</p> <p>基金管理人应当在上半年结束之日起六十日内,编制完成基金半年度报告,并将半年度报告正文登载在网站上,将半年度报告摘要登载在指定报刊上。</p> <p>基金管理人应当在每个季度结束之日起十五个工作日内,编制完成基金季度报告,并将季度报告登载在指定报刊和网站上。</p> <p>基金合同生效不足两个月的,基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。</p> <p>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。</p> <p>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例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文件中“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本基金的特有风险,中国证监会认定的特殊情形除外。</p> <p>《基金法》及其他有关法律法规或中国证监会另有规定的,从其规定。</p>
<p>二十四、基金的信息披露</p>		<p>(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; 27、基金管理人采用摆动定价机</p>

	制进行估值；
--	--------

二、 基金托管协议修订内容

章节	修订前	修订后
一、托管协议当事人	<p>(一) 基金管理人(或简称“管理人”)</p> <p>法定代表人: 赵如冰</p> <p>基金托管人(或简称“托管人”)</p> <p>法定代表人: 刘士余</p>	<p>(一) 基金管理人(或简称“管理人”)</p> <p>法定代表人: 杨光裕</p> <p>(二) 基金托管人(或简称“托管人”)</p> <p>法定代表人: 周慕冰</p>
二、托管协议的依据、目的、原则和解释	<p>(一) 依据</p> <p>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》(以下称“《基金法》”)、《证券投资基金运作管理办法》(以下称“《管理办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律、法规与《景顺长城资源垄断混合型证券投资基金(LOF)基金合同》(以下称“《基金合同》”)制订。</p>	<p>(一) 依据</p> <p>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》(以下称“《基金法》”)、《证券投资基金运作管理办法》(以下称“《管理办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其他有关法律、法规与《景顺长城资源垄断混合型证券投资基金(LOF)基金合同》(以下称“《基金合同》”)制订。</p>
十一、基金信息披露		<p>(二)基金管理人和基金托管人在信息披露中的职责和信息披露程序增加:</p> <p>4、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。</p> <p>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例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文件中“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</p>

		期内持有份额变化情况及本基金的 特有风险,中国证监会认定的特殊情 形除外。
--	--	---

关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改 基金合同、托管协议的内容说明

景顺长城内需增长混合型证券投资基金

一、 基金合同修订内容

章节	修订前	修订后
一、前言	<p>2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法通则》、《中华人民共和国信托法》、《中华人民共和国合同法》、1997年11月14日经国务院批准发布的《证券投资基金管理暂行办法》</p> <p>(以下简称《暂行办法》)、2000年10月8日中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)发布的《开放式证券投资基金试点办法》(以下简称《试点办法》)及其他有关规定。自2004年6月1日起,本基金合同同时适用《中华人民共和国证券投资基金法》之规定,若本基金合同内容存在与该法冲突之处的,应以该法规定为准,本基金合同相应内容自动根据该法规定作相应变更和调整。届时如果该法和/或其他法律、法规或本基金合同要求对前述变更和调整进行公告的,还应进行公告。</p>	<p>2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法通则》、《中华人民共和国信托法》、《中华人民共和国合同法》、1997年11月14日经国务院批准发布的《证券投资基金管理暂行办法》</p> <p>(以下简称《暂行办法》)、2000年10月8日中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)发布的《开放式证券投资基金试点办法》(以下简称《试点办法》)、《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》)及其他有关规定。自2004年6月1日起,本基金合同同时适用《中华人民共和国证券投资基金法》之规定,若本基金合同内容存在与该法冲突之处的,应以该法规定为准,本基金合同相应内容自动根据该法规定作相应变更和调整。届时如果该法和/或其他法律、法规或本基金合同要求对前述变更和调整进行公告的,还应进行公告。</p>
二、释义		<p>增加:</p> <p>《流动性风险管理规定》: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</p>

		<p>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>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>
三、基金合同当事人	<p>(一) 基金发起人 法定代表人：赵如冰</p> <p>(二) 基金托管人 法定代表人：刘士余</p>	<p>(一) 基金发起人 法定代表人：杨光裕</p> <p>(二) 基金托管人 法定代表人：周慕冰</p>
十三、基金的申购、赎回	<p>(五) 申购、赎回的数额限制</p> <p>1、基金管理人可以规定投资人首次购买的最低金额、追加申购的最低金额、每个交易账户的最低基金余额、单个投资人累计持有的基金份额上限等，具体规定请参见招募说明书或公开说明书。</p> <p>2、基金管理人可根据市场情况调整申购与赎回的有关数额限制，调整结果必须至少提前三个工作日在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。</p>	<p>(五) 申购、赎回的数额限制</p> <p>1、基金管理人可以规定投资人首次购买的最低金额、追加申购的最低金额、每个交易账户的最低基金余额、单个投资人累计持有的基金份额上限等，具体规定请参见招募说明书或公开说明书。</p> <p>2、基金管理人可根据市场情况调整申购与赎回的有关数额限制，调整结果必须至少提前三个工作日在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。</p> <p>3、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。具体请参见相关公告。</p>
十三、基金的申购、赎回	<p>(六) 申购、赎回的费用</p> <p>1、本基金的申购费率最高不超过 3%，赎回费率最高不超过 1.0%。</p> <p>2、本基金的申购费由申购人承担，归销售机构所有。</p>	<p>(六) 申购、赎回的费用</p> <p>1、本基金的申购费率最高不超过 3%，赎回费率最高不超过 1.0%（对于持续持有期少于 7 日的投资者除外）。</p>

	<p>3、本基金的赎回费由赎回人承担，所收取赎回费的 25%归入基金财产，其余部分作为注册登记费和其他手续费支出。</p> <p>4、本基金的申购费率、赎回费率由基金管理人确定并在招募说明书或公开说明书中列示。基金管理人可按中国证监会规定程序在基金合同约定的范围内调整申购费率、赎回费率，调整申购费率、赎回费率应在实施前 3 个工作日内在至少一种指定媒体上公告。</p> <p>5、基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资者以及以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等定期或不定期地开展基金促销活动。</p>	<p>2、本基金的申购费由申购人承担，归销售机构所有。</p> <p>3、本基金的赎回费由赎回人承担，对于持续持有期少于7日的投资者，本基金将收取不低于1.5%的赎回费并全额计入基金财产。对于持续持有期不少于7日的投资者，所收取赎回费的 25%归入基金财产，未归入基金财产的部分作为注册登记费和其他手续费支出。</p> <p>4、本基金的申购费率、赎回费率由基金管理人确定并在招募说明书或公开说明书中列示。基金管理人可按中国证监会规定程序在基金合同约定的范围内调整申购费率、赎回费率，调整申购费率、赎回费率应在实施前 3 个工作日内在至少一种指定媒体上公告。</p> <p>5、基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资者以及以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等定期或不定期地开展基金促销活动。</p>
十三、基金的申购、赎回		<p>增加：</p> <p>6、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，在基金管理人可以采用摆动定价机制，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。</p>
十三、基金的申购、赎回	<p>(九) 巨额赎回的情形及处理</p> <p>2、巨额赎回的处理</p> <p>(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为基金兑付投资者的全部赎回申请有困难，或认为为实现投资者的赎回申请进行的资产变现可能使基金份额资产净值发生较大波动时，基金管理人在当日接受赎回的比例不低于上一日基金总份额 10%的前提下，对其余申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占基金赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；未受理部分除投资者在提交申请时选择将当日未获受理部分予以撤销者外，延迟至下一开放日办理。转入下一开放日的申请不享有赎回优先权并将以该开放日的基金份额净值为基准计算，以此类推，直到全部完成赎回申请为止。</p>	<p>(九) 巨额赎回的情形及处理</p> <p>2、巨额赎回的处理</p> <p>(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为基金兑付投资者的全部赎回申请有困难，或认为为实现投资者的赎回申请进行的资产变现可能使基金份额资产净值发生较大波动时，基金管理人在当日接受赎回的比例不低于上一日基金总份额 10%的前提下，对其余申请延期办理。</p> <p>若进行上述延期办理，在单个基金份额持有人超过上一工作日基金总份额 20%以上的赎回申请的情形下，基金管理人可以对该基金份额持有人超过 20%以上的部分延期办理赎回申请。对于其余当日非自动延期办理的赎回申请，应当按单个账户非自动延期办理的赎回申请量占非自动延期办理的赎回申请总量的比例，</p>

	<p>当发生巨额赎回并部分延期赎回时，基金管理人应立即向中国证监会备案并在 3 个工作日内在至少一种指定媒体上公告，并说明有关处理办法。</p>	<p>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。部分延期赎回不受单笔赎回最低份额的限制。</p> <p>当发生巨额赎回并部分延期赎回时，基金管理人应立即向中国证监会备案并在 3 个工作日内在至少一种指定媒体上公告，并说明有关处理办法。</p>
<p>十三、基金的申购、赎回</p>	<p>(十) 拒绝或暂停申购、赎回的情形与处理</p> <p>1、本基金出现以下情况之一时，基金管理人可拒绝或暂停接受基金投资者的申购申请：</p> <p>(1)不可抗力；</p> <p>(2) 证券交易所交易时间非正常停市或其他情形，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；</p> <p>(3) 基金管理人认为市场缺乏合适的投资机会，继续接受申购可能对已有基金份额持有人利益产生损害；</p> <p>(4) 法律、法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生暂停申购情形时，基金管理人应当立即在指定媒体上刊登暂停申购公告。</p> <p>发生本基金合同或招募说明书中未予载明的事项，但基金管理人认为有正当理由认为需要暂停</p> <p>基金申购，应当报中国证监会批准；经批准后，基金管理人应当立即在中国证监会指定的信息披露媒体上刊登暂停申购公告。</p> <p>2、拒绝或暂停赎回的情形和处理</p> <p>本基金发生下列情形之一时，基金管理人可拒绝或暂停接受基金投资者的赎回申请：</p> <p>(1) 不可抗力；</p> <p>(2) 证券交易所交易时间非正常停市或其他情形，导致基金管理人无</p>	<p>(十) 拒绝或暂停申购、赎回的情形与处理</p> <p>1、本基金出现以下情况之一时，基金管理人可全部或部分拒绝或暂停接受基金投资者的申购申请：</p> <p>(1)不可抗力；</p> <p>(2) 证券交易所交易时间非正常停市或其他情形，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；</p> <p>(3) 基金管理人认为市场缺乏合适的投资机会，继续接受申购可能对已有基金份额持有人利益产生损害；</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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受申购申请；</p> <p>(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；</p> <p>(6) 法律、法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生暂停申购情形（除第(5)项外）时，基金管理人应当立即在指定媒体上刊登暂停申购公告。</p> <p>发生本基金合同或招募说明书中未予载明的事项，但基金管理人认为有正当理由认为需要暂停</p>

	<p>法计算当日基金资产净值；</p> <p>(3) 法律、法规、规章规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述情形时，基金管理人应在当日向中国证监会报告，已确认的赎回申请，基金管理人将足额按时支付；如暂时不能足额支付，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，其余部分在后续开放日予以兑付，并以该开放日的基金份额净值为依据计算赎回份额。投资者在申请赎回时可以选择将当日未获受理部分予以撤销。</p> <p>发生本基金合同或招募说明书中未予载明的事项，但基金管理人无正当理由认为需要暂停赎回，应当报中国证监会批准；经批准后，基金管理人应当立即在指定媒体上刊登暂停赎回公告。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。</p>	<p>基金申购，应当报中国证监会批准；经批准后，基金管理人应当立即在中国证监会指定的信息披露媒体上刊登暂停申购公告。</p> <p>2、拒绝或暂停赎回的情形和处理</p> <p>本基金发生下列情形之一时，基金管理人可拒绝或暂停接受基金投资者的赎回申请：</p> <p>(1) 不可抗力；</p> <p>(2) 证券交易所交易时间非正常停市或其他情形，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；</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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；</p> <p>(4) 法律、法规、规章规定或中国证监会认定的其他情形。发生上述情形时，基金管理人应在当日向中国证监会报告，已确认的赎回申请，基金管理人将足额按时支付；如暂时不能足额支付，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，其余部分在后续开放日予以兑付，并以该开放日的基金份额净值为依据计算赎回份额。投资者在申请赎回时可以选择将当日未获受理部分予以撤销。</p> <p>发生本基金合同或招募说明书中未予载明的事项，但基金管理人无正当理由认为需要暂停赎回，应当报中国证监会批准；经批准后，基金管理人应当立即在指定媒体上刊登暂停赎回公告。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。</p>
<p>十八、基金的投资</p>		<p>(五) 投资组合比例限制增加：</p> <p>(6) 本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不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，不超过该上市公司可流通股票的</p>

		<p>30%；</p> <p>(7) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 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项所规定的比例限制的，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投资范围保持一致；</p>
十八、基金的投资	<p>本基金合同生效后，投资建仓期为 3 个月，特殊情况下最长不超过 6 个月达到上述比例限制。</p> <p>由于基金规模或市场的变化导致投资组合超过上述约定的比例不在限制之内，基金管理人将在合理期限内进行调整，以达到标准。</p>	<p>本基金合同生效后，投资建仓期为 3 个月，特殊情况下最长不超过 6 个月达到上述比例限制。</p> <p>由于基金规模或市场的变化导致投资组合超过上述约定的比例不在限制之内，除上述第 (7)、(8) 项外，基金管理人将在合理期限内进行调整，以达到标准。</p>
二十二、基金财产估值	<p>(四) 估值方法</p> <p>1、股票估值方法：</p> <p>(2) 未上市股票的估值：</p> <p>③首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按估值日在证券交易所上市的同时股票的市价进行估值；</p> <p>④非公开发行的且在发行时明确一定期限锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>	<p>(四) 估值方法</p> <p>1、股票估值方法：</p> <p>(2) 未上市股票的估值：</p> <p>③流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等（不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票），按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>
二十二、基金财产估值		<p>(四) 估值方法</p> <p>增加：</p> <p>4、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。</p>
二十二、基金财产估值		<p>(七) 暂停估值的情形</p> <p>增加：</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时，经与基金托管人协商确认后，应当暂停估值；</p>
二十六、基金的信息披露		<p>(四) 定期报告</p> <p>增加：</p> <p>5、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</p>

		资产情况，及其流动性风险分析等。 6、报告期内出现单一投资者持有基金份额比例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文件中“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本基金的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。
第二十六部分 基金的信息披露		(五) 临时报告与公告 增加： 18、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； 19、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；

二、 托管协议修订内容

章节	修订前	修订后
一、基金托管协议当事人	(一) 基金管理人(或简称“管理人”) 法定代表人: 赵如冰 (二) 基金托管人(或简称“托管人”) 法定代表人: 刘士余	(一) 基金管理人(或简称“管理人”) 法定代表人: 杨光裕 (二) 基金托管人(或简称“托管人”) 法定代表人: 周慕冰

关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改 基金合同、托管协议的内容说明

景顺长城内需增长贰号混合型证券投资基金

一、 基金合同修订内容

章节	修订前	修订后
一、前言	<p>2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法通则》、《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国信托法》、2003年10月28日第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过并于2004年6月1日起施行的《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、2004年6月29日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）发布并于2004年7月1日起施行的《证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）和《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、2004年6月11日中国证监会发布并于2004年7月1日起施行的《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）及其他有关规定。</p>	<p>2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法通则》、《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国信托法》、2003年10月28日第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过并于2004年6月1日起施行的《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、2004年6月29日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）发布并于2004年7月1日起施行的《证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）和《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、2004年6月11日中国证监会发布并于2004年7月1日起施行的《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》）及其他有关规定。</p>
二、释义		<p>增加：</p> <p>《流动性风险管理规定》：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</p> <p>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>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</p>

		平对待
六、基金的申购和赎回及其他注册登记业务	五、申购与赎回的数额限制	五、申购与赎回的数额限制 增加： 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。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。具体请参见相关公告。
六、基金的申购和赎回及其他注册登记业务	六、申购费用和赎回费用 4、本基金的申购费率、赎回费率和收费方式由基金管理人根据《基金合同》的规定确定并在《招募说明书》中列示。基金管理人可以在《基金合同》约定的范围内调整费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前2个工作日在至少一家中国证监会指定的媒体公告。	六、申购费用和赎回费用 4、本基金的申购费率、赎回费率和收费方式由基金管理人根据《基金合同》的规定确定并在《招募说明书》中列示，对于持续持有期少于7日的投资者，本基金将收取不低于1.5%的赎回费并全额计入基金财产。基金管理人可以在《基金合同》约定的范围内调整费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前2个工作日在至少一家中国证监会指定的媒体公告。
六、基金的申购和赎回及其他注册登记业务		增加： 6、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，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、基金的申购和赎回及其他注册登记业务	九、拒绝或暂停申购的情形及处理方式 发生上述 1、到 4 项暂停申购情形时，基金管理人应当在至少一家中国证监会指定的媒体刊登暂停申购公告。	九、拒绝或暂停申购的情形及处理方式 增加： 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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受申购申请。 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%，或者变相规避50%集中度的情形时。 发生上述 1、到 4、6 项暂停申购情形时，基金管理人应当在至少一家中国证监会指定的媒体刊登暂停申购公告。
六、基金	十、暂停赎回或者延缓支付赎回	十、暂停赎回或者延缓支付赎回

<p>的申购和赎回及其他注册登记业务</p>	<p>款项的情形及处理方式</p>	<p>款项的情形及处理方式</p> <p>除非出现如下情形,基金管理人不得拒绝接受或暂停基金份额持有人的赎回申请或者延缓支付赎回款项:</p> <p>增加:</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,经与基金托管人协商确定后,基金管理人应当暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项。</p>
<p>六、基金的申购和赎回及其他注册登记业务</p>	<p>十一、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>(2) 部分顺延赎回:当基金管理人认为支付投资者的赎回申请有困难或认为支付投资者的赎回申请可能会对基金的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基金总份额的10%的前提下,对其余赎回申请延期予以办理。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;投资者未能赎回部分,除投资者在提交赎回申请时明确作出不参加顺延下一个开放日赎回的表示外,自动转为下一个开放日赎回处理。依照上述规定转入下一个开放日的赎回不享有赎回优先权并将以下一个开放日的基金份额净值为准进行计算,并以此类推,直到全部赎回为止。部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的限制。</p>	<p>十一、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>(2) 部分顺延赎回:当基金管理人认为支付投资者的赎回申请有困难或认为支付投资者的赎回申请可能会对基金的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基金总份额的10%的前提下,对其余赎回申请延期予以办理。</p> <p>若进行上述延期办理,在单个基金份额持有人超过上一工作日基金总份额20%以上的赎回申请的情形下,基金管理人可以对该基金份额持有人超过20%以上的部分延期办理赎回申请。对于其余当日非自动延期办理的赎回申请,应当按单个账户非自动延期办理的赎回申请量占非自动延期办理的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。部分延期赎回不受单笔赎回最低份额的限制。</p>
<p>七、基金合同当事</p>	<p>一、基金管理人</p> <p>(一) 基金管理人简况</p> <p>法定代表人: 赵如冰</p>	<p>一、基金管理人</p> <p>(一) 基金管理人简况</p> <p>法定代表人: 杨光裕</p>

人及其权利和义务		
七、基金合同当事人及其权利和义务	二、基金托管人 (一) 基金托管人简况 法定代表人: 刘士余	二、基金托管人 (一) 基金托管人简况 法定代表人: 周慕冰
十三、基金的投资	六、投资限制	六、投资限制 2、投资组合限制 增加: (7) 本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票,不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,不超过该上市公司可流通股票的 30%; (8) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 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项所规定的比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资; (9) 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投资范围保持一致;
十三、基金的投资	基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。 由于证券市场波动、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。	基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。 除上述第(8)、(9)项外,由于证券市场波动、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。
十五、基金资产估值	四、估值方法 1、股票估值方法: (2) 未上市股票的估值: ③首次公开发行有明确锁定期的股票,同一股票在交易所上市后,按交易所上市的同一股票的估值方法估值; ④非公开发行有明确锁定期的股	四、估值方法 1、股票估值方法: (2) 未上市股票的估值: ③流通受限的股票,包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等(不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券

	票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。	等流通受限股票)，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。
十五、基金资产估值	四、估值方法	四、估值方法 增加： 4、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。
十五、基金资产估值	七、暂停估值的情形	七、暂停估值的情形 增加： 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时，经与基金托管人协商确认后，应当暂停估值；
十九、基金的信息披露	(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	(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 增加： 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基金份额比例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文件中“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本基金的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。
十九、基金的信息披露	(七) 临时报告	(七) 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； 27、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；

二、对基金托管协议的修改内容

章节	修订前	修订后
一、基金托管协议	一、基金管理人 法定代表人：赵如冰	一、基金管理人 法定代表人：杨光裕

当事人		
一、基金 托管协议 当事人	二、基金托管人 法定代表人：刘士余	二、基金托管人 法定代表人：周慕冰
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。基金托管 人按下述比例和调整期限进行监督：	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。基金托管 人按下述比例和调整期限进行监督： 增加： (7) 本基金管理人管理的且由 本基金基金托管人托管的全部开放 式基金(包括开放式基金以及处于开 放期的定期开放基金)持有一家上市 公司发行的可流通股票，不超过该上 市公司可流通股票的 15%；本基金 管理人管理的且由本基金基金托管 人托管的全部投资组合持有一家上 市公司发行的可流通股票，不超过该 上市公司可流通股票的 30%； (8) 本基金主动投资于流动性 受限资产的市值合计不超过基金资 产的 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 项所规定的比例限制的，基金管理人 不得主动新增流动性受限资产的投 资； (9) 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投资范 围保持一致；
三、基金 托管人对 基金管理 人的业务 监督和核 查	因证券市场波动、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 1-6 项规定的 投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。	因证券市场波动、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 1-7 项规定的投资比例的，基金管理人应 当在 10 个交易日内进行调整。
八、基金 资产净值 计算和会 计核算	二、基金资产估值方法和特殊情 形的处理 2、估值方法 (1) 股票估值方法	二、基金资产估值方法和特殊情 形的处理 2、估值方法 (1) 股票估值方法 增加： c) 流通受限的股票，包括非公 开发行股票、首次公开发行股票时公 司股东公开发售股份、通过大宗交易 取得的带限售期的股票等(不包括停 牌、新发行未上市、回购交易中的质

		押券等流通受限股票), 按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。
八、基金资产净值计算和会计核算		增加: (4) 当发生大额申购或赎回情形时, 在履行适当程序后, 基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。
八、基金资产净值计算和会计核算	四、暂停估值与公告基金份额净值的情形	四、暂停估值与公告基金份额净值的情形 增加: 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时, 经与基金托管人协商确认后, 应当暂停估值;
十、基金信息披露	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 1、职责 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信息: (1) 不可抗力; (2) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的情况。	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 1、职责 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信息: (1) 不可抗力; (2) 发生基金合同约定的暂停估值的情形; (3) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的情况。

关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改 基金合同、托管协议的内容说明

景顺长城能源基建混合型证券投资基金

一、 基金合同修订内容

章节	修订前	修订后
一、前言	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《中华人民共和国合同法》、《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	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《中华人民共和国合同法》、《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

	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。	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。
二、释义		<p>增加:</p> <p>56、《流动性风险管理规定》: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</p> <p>57、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>58、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>
六、基金份额的申购与赎回	(五)申购和赎回的金额	<p>(五)申购和赎回的金额</p> <p>增加:</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。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。具体请参见相关公告。</p>
六、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>6.本基金的申购费率最高不超过申购金额的 5%,赎回费率最高不超过基金份额赎回金额的 5%。本基金赎回费的 25%归入基金财产所有。本基金的申购费率、赎回费率和收费方式由基金管理人根据基金合同的规定确定,并在招募说明书中列示。基金</p>	<p>(六)申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>6.本基金的申购费率最高不超过申购金额的 5%,赎回费率最高不超过基金份额赎回金额的 5%。对于持续持有期少于 7 日的投资者,本基金将收取不低于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产。对于持续持有期不少于 7 日的投资者,本基金赎回费的</p>

	<p>管理人可以在履行相关手续后，在基金合同约定的范围内调整申购、赎回费率或调整收费方式，基金管理人依照有关规定最迟应于新的费率或收费方式实施日 2 日前在至少一种指定媒体和基金管理人网站上公告。</p>	<p>25%归入基金财产所有。本基金的申购费率、赎回费率和收费方式由基金管理人根据基金合同的规定确定，并在招募说明书中列示。基金管理人可以在履行相关手续后，在基金合同约定的范围内调整申购、赎回费率或调整收费方式，基金管理人依照有关规定最迟应于新的费率或收费方式实施日 2 日前在至少一种指定媒体和基金管理人网站上公告。</p>
六、基金份额的申购与赎回		<p>增加： 9、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，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。</p>
六、基金份额的申购与赎回	<p>(七) 拒绝或暂停申购的情形 发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受基金投资者的申购申请： 3.发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况； 6.法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述暂停申购情形时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体和基金管理人网站上刊登暂停申购公告。如果基金投资者的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资者。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>(七) 拒绝或暂停申购的情形 发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受基金投资者的申购申请： 3.发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况；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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受申购申请。 6.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。 7.法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述暂停申购情形（除第 6 项外）时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体和基金管理人网站上刊登暂停申购公告。如果基金投资者的申购申请全部或部分拒绝的，被拒绝的申购款项将退还给投资者。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>
六、基金份额的申购与赎回	<p>(八) 暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 4.发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。</p>	<p>(八) 暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 4.发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参</p>

		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,经与基金托管人协商确定后,基金管理人应当暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项。
第六部分 基金份额 的申购、 赎回	<p>(九)巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>2.巨额赎回的处理方式</p> <p>(2)部分顺延赎回:当基金管理人认为支付基金投资者的赎回申请有困难或认为支付投资者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日基金总份额的 10%的前提下,对其余赎回申请延期办理。</p>	<p>(九)巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>2.巨额赎回的处理方式</p> <p>(2)部分顺延赎回:当基金管理人认为支付基金投资者的赎回申请有困难或认为支付投资者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日基金总份额的 10%的前提下,对其余赎回申请延期办理。</p> <p>若进行上述延期办理,在单个基金份额持有人超过上一工作日基金总份额 20%以上的赎回申请的情形下,基金管理人可以对该基金份额持有人超过 20%以上的部分延期办理赎回申请。对于其余当日非自动延期办理的赎回申请,应当按单个账户非自动延期办理的赎回申请量占非自动延期办理的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。部分延期赎回不受单笔赎回最低份额的限制。</p>
十二、基 金的投资	<p>(三)投资范围</p> <p>本基金股票投资比例范围为基金资产的 60-95%,持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>(三)投资范围</p> <p>本基金股票投资比例范围为基金资产的 60-95%,持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</p>
十二、基	(八)投资限制	(八)投资限制

<p>金的投资</p>	<p>本基金的投资组合将遵循以下限制： (5)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>本基金的投资组合将遵循以下限制： (5)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、存出保证金和应收申购款等；</p>
<p>第十二部分 基金的投资</p>		<p>增加： (7) 本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不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，不超过该上市公司可流通股票的 30%； (8) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 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项所规定的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资； (9) 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投资范围保持一致；</p>
<p>十二、基金的投资</p>	<p>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。在符合相关法律法规规定的前提下，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等非本基金管理人的因素致使基金的投资组合不符合上述规定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。</p>	<p>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。在符合相关法律法规规定的前提下，除上述第(5)、(8)、(9)项外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等非本基金管理人的因素致使基金的投资组合不符合上述规定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。</p>
<p>十四、基金财产的估值</p>	<p>(四) 估值方法 1、股票估值方法： (2) 未上市股票的估值： ③首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值； ④非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定</p>	<p>(四) 估值方法 1、股票估值方法： (2) 未上市股票的估值： ③流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等（不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票），按监管机构或行</p>

	确定公允价值。	业协会有关规定确定公允价值。
十四、基金财产的估值	(四) 估值方法	(四) 估值方法 增加： 4、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。
十四、基金财产的估值	(七) 暂停估值的情形	(七) 暂停估值的情形 增加： 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时，经与基金托管人协商确认后，应当暂停估值；
十八、基金的信息披露	6.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	6.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 增加： 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基金份额比例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文件中“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本基金的特定风险，中国证监会认定的特殊情形除外。
十八、基金的信息披露	7.临时报告	7.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； (27)基金管理人采用摆动定价机制进行估值；
二十四、基金合同内容摘要		摘要部分也做了相应修改，与合同修订内容保持一致。

二、对基金托管协议的修改内容

章节	修订前	修订后
----	-----	-----

三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	本基金股票投资比例范围为基金资产的 60-95%，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。	本基金股票投资比例范围为基金资产的 60-95%，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	<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>7.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,以备支付基金份额持有人的赎回款项;</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>7.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,以备支付基金份额持有人的赎回款项,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等;</p>
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查		<p>增加:</p> <p>8.本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票,不超过该上市公司可流通股票的 15%;</p> <p>9.本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不超过该上市公司可流通股票的 30%;</p> <p>10.本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不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项所规定的比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;</p> <p>11.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本基金合同约定的投资范围保持一致;</p>
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	因证券市场波动、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的投资比例的,基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。	因证券市场波动、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 1、2、4、5、6、8、9、12、13 项规定的投资比例的,基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>	<p>(六)基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金投资流通受限证券进行监督。</p> <p>2、流通受限证券包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>	<p>(六)基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金投资流通受限证券进行监督。</p> <p>2、流通受限证券与上文提到的流动性受限资产并不完全一致,包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>
<p>八、基金资产净值计算和会计核算</p>	<p>(二)基金资产估值方法和特殊情形的处理</p> <p>2.估值方法</p> <p>(1)股票估值方法:</p> <p>2)未上市股票的估值</p> <p>③首次公开发行有明确锁定期的股票,同一股票在交易所上市后,按交易所上市的同一股票的估值方法估值;</p> <p>④非公开发行有明确锁定期的股票,按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>	<p>(二)基金资产估值方法和特殊情形的处理</p> <p>2.估值方法</p> <p>(1)股票估值方法:</p> <p>2)未上市股票的估值</p> <p>③流通受限的股票,包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等(不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票),按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>
<p>八、基金资产净值计算和会计核算</p>		<p>增加:</p> <p>(4)当发生大额申购或赎回情形时,在履行适当程序后,基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。</p>
<p>八、基金资产净值计算和会计核算</p>		<p>(四)暂停估值与公告基金份额净值的情形</p> <p>增加:</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时,经与基金托管人协商确认后,应当暂停估值;</p>
<p>十、基金信息披露</p>	<p>(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</p> <p>1.职责</p> <p>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信息:</p> <p>(1)不可抗力;</p> <p>(2)法律法规、基金合同或中国证监会规定的情况。</p>	<p>(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</p> <p>1.职责</p> <p>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信息:</p> <p>(1)不可抗力;</p> <p>(2)发生基金合同约定的暂停估值的情形;</p> <p>(3)法律法规、基金合同或中国证监会规定的情况。</p>

关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改
基金合同、托管协议的内容说明

景顺长城景益货币市场基金

一、 基金合同修订内容

章节	修订前	修订后
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>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》”)、《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》”)、《货币市场基金管理暂行规定》(以下简称“《暂行规定》”)、《证券投资基金信息披露编报规则第5号〈货币市场基金信息披露特别规定〉》(以下简称“《信息披露特别规定》”)、《关于货币市场基金投资等相关问题的通知》和其他有关法律法规。</p>	<p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</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》”)、《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》”)、《货币市场基金管理暂行规定》(以下简称“《暂行规定》”)、《证券投资基金信息披露编报规则第5号〈货币市场基金信息披露特别规定〉》(以下简称“《信息披露特别规定》”)、《关于货币市场基金投资等相关问题的通知》、《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“《流动性风险管理规定》”)和其他有关法律法规。</p>
第二部分 释义		<p>增加：</p> <p>60、《流动性风险管理规定》：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</p> <p>61、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</p>

		议约定有条件提前支取的银行存款)、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
第六部分 基金份额的 申购与赎回	五、申购和赎回的数量限制	五、申购和赎回的数量限制 增加： 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。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。具体请参见相关公告。
第六部分 基金份额的 申购与 赎回	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 1、本基金不收取申购费用和赎回费用。 2、本基金的申购、赎回价格为每份基金单位 1.00 元。投资者申购所得的份额等于申购金额除以 1.00 元，赎回所得的金额等于赎回份额乘以 1.00 元。	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 1、本基金在一般情况下不收取申购费用和赎回费用，但是当本基金前10名基金份额持有人的持有份额合计超过基金总份额50%，且本基金投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计低于10%且偏离度为负时，为确保基金平稳运作，避免诱发系统性风险，对当日单个基金份额持有人申请赎回基金份额超过基金总份额的1%以上的赎回申请（超过1%的部分）征收1%的强制赎回费用，并将上述赎回费用全额计入基金资产。基金管理人与基金托管人协商确认上述做法无益于基金利益最大化的情形除外。 2、本基金的申购、赎回价格为每份基金单位 1.00 元。投资者申购所得的份额等于申购金额除以 1.00 元。
第六部分 基金份额的 申购与 赎回	七、申购份额与赎回金额的计算 1、申购份额的计算 本基金的申购费用为零，基金份额净值保持为人民币1.00 元，计算方法见招募说明书。 2、赎回金额的计算 本基金的赎回费用为零，基金份额净值保持为人民币1.00 元。赎回金额的计算方式见招募说明书。	七、申购份额与赎回金额的计算 1、申购份额的计算 本基金的申购费用为零，基金份额净值保持为人民币1.00 元，计算方法见招募说明书。 2、赎回金额的计算 除按上文收取强制赎回费外，本基金的赎回费用为零，基金份额净值保持为人民币1.00 元。赎回金额的计算方式见招募说明书。
第六部分 基金份额的 申购与 赎回	九、拒绝或暂停申购的情形 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： 1、因不可抗力导致基金无法正常	九、拒绝或暂停申购的情形 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： 1、因不可抗力导致基金无法正

	<p>运作。</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。</p> <p>3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</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>5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人利益的情形。</p> <p>6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</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体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>常运作。</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受申购申请。</p> <p>3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</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>5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人利益的情形。</p> <p>6、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。</p> <p>7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述第 1、2、3、5、7 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体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，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>十、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>1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，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>3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</p>	<p>十、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>1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，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。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，经</p>

	<p>4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。</p> <p>法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述情形之一且基金管理人决定暂停赎回或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>与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项。</p> <p>3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</p> <p>4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。</p> <p>5、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述情形之一且基金管理人决定暂停赎回或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>十一、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。</p>	<p>十一、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。</p> <p>增加：</p> <p>(3) 如果基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额 10%以上的赎回申请的情形下，基金管理人可以对该基金份额持有人超过 10%以上的部分延期办理赎回申请。对于当日非延期的赎回申请，应当按单个账户非延期赎回申请量占非延期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该类别基金份额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</p>

		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。
第七部分 基金合同 当事人及 权利义务	<p>一、基金管理人</p> <p>(一) 基金管理人简况 名称: 景顺长城基金管理有限公司 住所: 深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第 1 座 21 层 法定代表人: 赵如冰 设立日期: 2003 年 6 月 12 日 批准设立机关: 中国证券监督管理委员会 批准设立文号: 中国证监会证监基金字【2003】76 号 组织形式: 有限责任公司 注册资本: 1.3 亿元人民币 存续期限: 持续经营</p>	<p>一、基金管理人</p> <p>(一) 基金管理人简况 名称: 景顺长城基金管理有限公司 住所: 深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第 1 座 21 层 法定代表人: 杨光裕 设立日期: 2003 年 6 月 12 日 批准设立机关: 中国证券监督管理委员会 批准设立文号: 中国证监会证监基金字【2003】76 号 组织形式: 有限责任公司 注册资本: 1.3 亿元人民币 存续期限: 持续经营</p>
第七部分 基金合同 当事人及 权利义务	<p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况 名称: 中国农业银行股份有限公司 住所: 北京市东城区建国门内大街 69 号 办公地址: 北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座九层 法定代表人: 蒋超良 成立时间: 2009 年 1 月 15 日 批准设立机关和批准设立文号: 中国银监会银监复【2009】13 号 组织形式: 股份有限公司 注册资本: 32,479,411.7 万元人民币 存续期间: 持续经营 基金托管资格批文及文号: 中国证监会证监基金字[1998]23 号</p>	<p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况 名称: 中国农业银行股份有限公司 住所: 北京市东城区建国门内大街 69 号 办公地址: 北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 法定代表人: 周慕冰 成立时间: 2009 年 1 月 15 日 批准设立机关和批准设立文号: 中国银监会银监复【2009】13 号 组织形式: 股份有限公司 注册资本: 32,479,411.7 万元人民币 存续期间: 持续经营 基金托管资格批文及文号: 中国证监会证监基金字[1998]23 号</p>
第十二部分、基金的投资	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(1) 本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日都不得超过 120 天;</p> <p>(2) 本基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券, 不得超过该证券的 10%;</p> <p>(3) 本基金投资于定期存款的比例不得超过基金资产净值的 30% (有存款期限, 但根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款, 可不受此限制);</p> <p>(4) 本基金存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款, 不得超过基金资产净值的 30%; 存放在在不具</p>	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(1) 当货币市场基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 50% 时, 货币市场基金投资组合的平均剩余期限不得超过 60 天, 平均剩余存续期不得超过 120 天; 投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 30%; 当货币市场基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 20% 时, 货币市场基金投资组合的平均剩余期限不得超过 90 天, 平均剩余存续期不得超过 180 天; 投资组合</p>

	<p>有基金托管资格的同一商业银行的存款，不得超过基金资产净值的 5%；</p> <p>(5) 本基金通过买断式回购融入的基础债券的剩余期限不得超过 397 天；</p> <p>(6) 在全国银行间债券市场债券正回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；在全国银行间同业市场的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；</p> <p>(7) 本基金持有的剩余期限不超过 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本总计不得超过当日基金资产净值的 20%；</p> <p>(8) 本基金投资于同一公司发行的短期融资券及短期企业债券的比例，合计不得超过基金资产净值的 10%；</p> <p>(9) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；</p> <p>(10) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；</p> <p>(11) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；基金管理人管理的全部证券投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；</p> <p>(12) 本基金投资的资产支持证券须具有评级资质的资信评级机构进行持续信用评级。本基金投资的资产支持证券不得低于国内信用评级机构评定的 AAA 级或相当于 AAA 级的信用级别。本基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降且不再符合投资标准，本基金应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；</p> <p>(13) 除发生巨额赎回情形外，本基金债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%。因发生巨额赎回导致债券正回购的资金余额超过基金资产净值 20% 的，基金管理人应在 5 个交易日内进行调整；</p> <p>(14) 本基金投资的短期融资券的信用评级应不低于以下标准：</p> <p>1) 国内信用评级机构评定的 A-1</p>	<p>中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 20%；</p> <p>(2) 本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日都不得超过 120 天，但上述第 (1) 项另有约定的除外；</p> <p>(3) 本基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；</p> <p>(4) 本基金投资于定期存款的比例不得超过基金资产净值的 30%（有存款期限，但根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款，可不受此限制）；</p> <p>(5) 本基金存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款，不得超过基金资产净值的 30%；存放在不具有基金托管资格的同一商业银行的存款，不得超过基金资产净值的 5%；</p> <p>(6) 本基金通过买断式回购融入的基础债券的剩余期限不得超过 397 天；</p> <p>(7) 在全国银行间债券市场债券正回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；在全国银行间同业市场的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；</p> <p>(8) 本基金持有的剩余期限不超过 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本总计不得超过当日基金资产净值的 20%；</p> <p>(9) 本基金投资于同一公司发行的短期融资券及短期企业债券的比例，合计不得超过基金资产净值的 10%；</p> <p>(10) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；</p> <p>(11) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；</p> <p>(12) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；基金管理人管理的全部证券投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券</p>
--	--	---

	<p>级或相当于 A-1 级的短期信用级别；</p> <p>2) 根据有关规定予以豁免信用评级的短期融资券，其发行人最近 3 年的信用评级和跟踪评级具备下列条件之一：</p> <p>i. 国内信用评级机构评定的 AAA 级或相当于 AAA 级的长期信用级别；</p> <p>ii. 国际信用评级机构评定的低于中国主权评级一个级别的信用级别。同一发行人同时具有国内信用评级和国际信用评级的，以国内信用级别为准。本基金持有短期融资券期间，如果其信用等级下降且不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 20 个交易日内予以全部减持；</p>	<p>合计规模的 10%；</p> <p>(13) 本基金投资的资产支持证券须具有评级资质的资信评级机构进行持续信用评级。本基金投资的资产支持证券不得低于国内信用评级机构评定的 AAA 级或相当于 AAA 级的信用级别。本基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降且不再符合投资标准，本基金应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；</p> <p>(14) 除发生巨额赎回情形外，本基金债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%。因发生巨额赎回导致债券正回购的资金余额超过基金资产净值 20% 的，基金管理人应在 5 个交易日内进行调整；</p> <p>(15) 本基金投资的短期融资券的信用评级应不低于以下标准：</p> <p>1) 国内信用评级机构评定的 A-1 级或相当于 A-1 级的短期信用级别；</p> <p>2) 根据有关规定予以豁免信用评级的短期融资券，其发行人最近 3 年的信用评级和跟踪评级具备下列条件之一：</p> <p>i. 国内信用评级机构评定的 AAA 级或相当于 AAA 级的长期信用级别；</p> <p>ii. 国际信用评级机构评定的低于中国主权评级一个级别的信用级别。同一发行人同时具有国内信用评级和国际信用评级的，以国内信用级别为准。本基金持有短期融资券期间，如果其信用等级下降且不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 20 个交易日内予以全部减持；</p>
第十二部分 基金的投资		<p>增加：</p> <p>(16) 本基金管理人管理的全部货币市场基金投资于同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券，不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的 10%；</p> <p>(17) 本基金投资于主体信用评级低于 AAA 的机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 10%，其中单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 2%；前述金融工具包括债券、非金融企业债务融资工具、银行存款、同业存单、相关机构作为原始权</p>

		<p>益人的资产支持证券及中国证监会认定的其他品种；</p> <p>本基金拟投资于主体信用评级低于 AA+ 的商业银行的银行存款与同业存单的，应当经基金管理人董事会审议批准，相关交易应当事先征得基金托管人的同意，并作为重大事项履行信息披露程序；</p> <p>(18) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 10%；因证券市场波动、证券停牌、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项所规定的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>(19) 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本基金合同约定的投资范围保持一致；</p>
第十二部分 基金的投资	除上述 (12)、(13)、(14) 项外，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。法律法规另有规定的，从其规定。	除上述 (2)、(13)、(14)、(15)、(18)、(19) 项外，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。法律法规另有规定的，从其规定。
第十四部分 基金资产估值	六、暂停估值的情形	<p>六、暂停估值的情形</p> <p>增加：</p> <p>4、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时，经与基金托管人协商确认后，应当暂停估值；</p>
第十八部分 基金的信息披露	(五) 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	<p>(五) 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</p> <p>增加：</p> <p>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。</p> <p>本基金应当在年度报告、半年度报告中，至少披露报告期末基金前 10 名份额持有人的类别、持有份额及占总份额的比例等信息。</p> <p>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例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</p>

		期报告文件中“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本基金的特定风险，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	(六) 临时报告	(六) 临时报告 增加： 28、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； 29、本基金拟投资于主体信用评级低于 AA+商业银行的银行存款与同业存单的；
第二十四部分 基金合同内容摘要		根据基金合同正文进行同步修改

二、对基金托管协议的修改内容

章节	修订前	修订后
一、基金托管协议当事人	<p>名称：景顺长城基金管理有限公司</p> <p>注册地址：深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第1座21层</p> <p>办公地址：深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第1座21层</p> <p>邮政编码：518048</p> <p>法定代表人：赵如冰</p> <p>成立日期：2003年6月12日</p> <p>批准设立机关：中国证券监督管理委员会</p> <p>批准设立文号：中国证监会证监基字【2003】76号</p> <p>组织形式：有限责任公司</p> <p>注册资本：1.3亿元人民币</p> <p>存续期间：持续经营</p> <p>经营范围：基金管理业务、发起设立基金及中国证券监督管理委员会批准的其他业务。</p>	<p>名称：景顺长城基金管理有限公司</p> <p>注册地址：深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第1座21层</p> <p>办公地址：深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第1座21层</p> <p>邮政编码：518048</p> <p>法定代表人：杨光裕</p> <p>成立日期：2003年6月12日</p> <p>批准设立机关：中国证券监督管理委员会</p> <p>批准设立文号：中国证监会证监基字【2003】76号</p> <p>组织形式：有限责任公司</p> <p>注册资本：1.3亿元人民币</p> <p>存续期间：持续经营</p> <p>经营范围：基金管理业务、发起设立基金及中国证券监督管理委员会批准的其他业务。</p>
一、基金托管协议当事人	<p>(二) 基金托管人</p> <p>法定代表人：蒋超良</p>	<p>(二) 基金托管人</p> <p>法定代表人：周慕冰</p>

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:

1、组合限制

(1) 本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日都不得超过 120 天;

(2) 本基金与由基金管理人管理的、且由本托管人托管的其他基金持有一家公司发行的证券, 不得超过该证券的 10%;

(3) 本基金投资于定期存款的比例不得超过基金资产净值的 30% (有存款期限, 但根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款, 可不受此限制);

(4) 本基金存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款, 不得超过基金资产净值的 30%; 存放在不具有基金托管资格的同一商业银行的存款, 不得超过基金资产净值的 5%;

(5) 本基金通过买断式回购融入的基础债券的剩余期限不得超过 397 天;

(6) 在全国银行间债券市场债券正回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%; 在全国银行间同业市场的债券回购最长期限为 1 年, 债券回购到期后不得展期;

(7) 本基金持有的剩余期限不超过 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本总计不得超过当日基金资产净值的 20%; ;

(8) 本基金投资于同一公司发行的短期融资券及短期企业债券的比例, 合计不得超过基金资产净值的 10%;

(9) 本基金持有的全部资产支持证券, 其市值不得超过基金资产净值的 20%;

(10) 本基金持有的同一 (指同一信用级别) 资产支持证券的比例, 不得超过该资产支持证券规模的 10%;

(11) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例, 不得超过基金资产净值的 10%; 基金管理人管理的、且由本托管人托管的全部证券投资基金投资于同一原始权益

(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:

1、组合限制

(1) 当货币市场基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 50% 时, 货币市场基金投资组合的平均剩余期限不得超过 60 天, 平均剩余存续期不得超过 120 天; 投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 30%; 当货币市场基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 20% 时, 货币市场基金投资组合的平均剩余期限不得超过 90 天, 平均剩余存续期不得超过 180 天; 投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 20%;

(2) 本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日都不得超过 120 天, 但上述第 (1) 项另有约定的除外;

(3) 本基金与由基金管理人管理的、且由本托管人托管的其他基金持有一家公司发行的证券, 不得超过该证券的 10%;

(4) 本基金投资于定期存款的比例不得超过基金资产净值的 30% (有存款期限, 但根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款, 可不受此限制);

(5) 本基金存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款, 不得超过基金资产净值的 30%; 存放在不具有基金托管资格的同一商业银行的存款, 不得超过基金资产净值的 5%;

(6) 本基金通过买断式回购融入的基础债券的剩余期限不得超过 397 天;

(7) 在全国银行间债券市场债券正回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%; 在全国银行间同业市场的债券回购最长期限为 1 年, 债券回购到期后不得展期;

	<p>人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；</p> <p>(12) 本基金投资的资产支持证券须具有评级资质的资信评级机构进行持续信用评级。本基金投资的资产支持证券不得低于国内信用评级机构评定的 AAA 级或相当于 AAA 级的信用级别。本基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降且不再符合投资标准，本基金应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；</p> <p>(13) 除发生巨额赎回情形外，本基金债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%。因发生巨额赎回导致债券正回购的资金余额超过基金资产净值 20% 的，基金管理人应在 5 个工作日内进行调整；</p> <p>(14) 本基金投资的短期融资券的信用评级应不低于以下标准：</p> <p>1) 国内信用评级机构评定的 A-1 级或相当于 A-1 级的短期信用级别；</p> <p>2) 根据有关规定予以豁免信用评级的短期融资券，其发行人最近 3 年的信用评级和跟踪评级具备下列条件之一：</p> <p>i. 国内信用评级机构评定的 AAA 级或相当于 AAA 级的长期信用级别；</p> <p>ii. 国际信用评级机构评定的低于中国主权评级一个级别的信用级别。同一发行人同时具有国内信用评级和国际信用评级的，以国内信用级别为准。本基金持有短期融资券期间，如果其信用等级下降且不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 20 个工作日内予以全部减持；</p>	<p>(8) 本基金持有的剩余期限不超过 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本总计不得超过当日基金资产净值的 20%；；</p> <p>(9) 本基金投资于同一公司发行的短期融资券及短期企业债券的比例，合计不得超过基金资产净值的 10%；</p> <p>(10) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；</p> <p>(11) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；</p> <p>(12) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；基金管理人管理的、且由本托管人托管的全部证券投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；</p> <p>(13) 本基金投资的资产支持证券须具有评级资质的资信评级机构进行持续信用评级。本基金投资的资产支持证券不得低于国内信用评级机构评定的 AAA 级或相当于 AAA 级的信用级别。本基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降且不再符合投资标准，本基金应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；</p> <p>(14) 除发生巨额赎回情形外，本基金债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%。因发生巨额赎回导致债券正回购的资金余额超过基金资产净值 20% 的，基金管理人应在 5 个工作日内进行调整；</p> <p>(15) 本基金投资的短期融资券的信用评级应不低于以下标准：</p> <p>1) 国内信用评级机构评定的 A-1 级或相当于 A-1 级的短期信用级别；</p> <p>2) 根据有关规定予以豁免信用评级的短期融资券，其发行人最近 3 年的信用评级和跟踪评级具备下列条件之一：</p> <p>i. 国内信用评级机构评定的 AAA 级或相当于 AAA 级的长期信用级别；</p> <p>ii. 国际信用评级机构评定的低</p>
--	---	--

		于中国主权评级一个级别的信用级别。同一发行人同时具有国内信用评级和国际信用评级的,以国内信用级别为准。 本基金持有短期融资券期间,如果其信用等级下降且不再符合投资标准,应在评级报告发布之日起20个交易日内予以全部减持;
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查		<p>增加:</p> <p>(16)本基金管理人管理的全部货币市场基金投资于同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券,不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的10%;</p> <p>(17)本基金投资于主体信用评级低于 AAA 的机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过10%,其中单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过2%; 前述金融工具包括债券、非金融企业债务融资工具、银行存款、同业存单、相关机构作为原始权益人的资产支持证券及中国证监会认定的其他品种;</p> <p>本基金拟投资于主体信用评级低于 AA+的商业银行的银行存款与同业存单的,应当经基金管理人董事会审议批准,相关交易应当事先征得基金托管人的同意,并作为重大事项履行信息披露程序;</p> <p>(18)本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的10%;因证券市场波动、证券停牌、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项所规定的比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;</p> <p>(19)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本基金合同约定的投资范围保持一致;</p>
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	除上述(12)、(13)、(14)项外,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。法律法规另有规定的,从其规定。	除上述(2)、(13)、(14)、(15)、(18)、(19)项外,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。法律法规另有规定的,从其规定。

八、基金资产净值计算和会计核算	(四) 暂停估值与公告每万份基金已实现收益的情形	(四)暂停估值与公告每万份基金已实现收益的情形 增加： (4) 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时，经与基金托管人协商确认后，应当暂停估值；
十、基金信息披露	(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信息： (1)不可抗力； (2) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的情况。	(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信息： (1)不可抗力； (2)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时，经与基金托管人协商确认暂停估值的； (3) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的情况。

关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改

基金合同、托管协议的内容说明

景顺长城支柱产业混合型证券投资基金

一、 基金合同修订内容

章节	修订前	修订后
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>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》”)、《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</p>	<p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</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》”)、《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</p>

	办法》(以下简称“《信息披露办法》”)和其他有关法律法规。	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。
第二部分 释义		<p>增加:</p> <p>51、《流动性风险管理规定》: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</p> <p>52、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>53、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>
第六部分 基金份额 的申购、 赎回	<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>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,具体规定请参见招募说明书。</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。</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,具体规定请参见招募说明书。</p> <p>4、基金管理人可在法律法规允许的情况下,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体上公告并报中国证监会备案。</p>	<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>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,具体规定请参见招募说明书。</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。</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,具体规定请参见招募说明书。</p> <p>4、基金管理人可在法律法规允许的情况下,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体上公告并报中国证监会备案。</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</p>

		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。具体请参见相关公告。
第六部分 基金份额 的申购、 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。不低于赎回费总额的 25%应归基金财产,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。对于持续持有期少于 7 日的投资者,本基金将收取不低于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产。对于持续持有期不少于 7 日的投资者,不低于赎回费总额的 25%应归基金财产,未归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>
第六部分 基金份额 的申购、 赎回		<p>增加:</p> <p>8、当发生大额申购或赎回情形时,在履行适当程序后,基金管理人可以采用摆动定价机制,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。</p>
第六部分 基金份额 的申购、 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:</p> <p>1、因不可抗力导致基金无法正常运作。</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时,基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。</p> <p>3、证券交易所交易时间非正常停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</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>5、基金资产规模过大,使基金管理人无法找到合适的投资品种,或其他可能对基金业绩产生负面影响,从而损害现有基金份额持有人利益的情形。</p> <p>6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述第 1、2、3、5、6 项暂停申购情形时,基金管理人应当根据有关规定在指定媒体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。</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:</p> <p>1、因不可抗力导致基金无法正常运作。</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时,基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。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,经与基金托管人协商确定后,基金管理人应当暂停接受申购申请。</p> <p>3、证券交易所交易时间非正常停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</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>5、基金资产规模过大,使基金管理人无法找到合适的投资品种,或其他可能对基金业绩产生负面影响,从而损害现有基金份额持有人利益的情形。</p> <p>6、基金管理人接受某笔或者某</p>

	<p>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>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。</p> <p>7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述第1、2、3、5、7项暂停申购情形时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，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、 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>1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，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>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>1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，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。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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项。</p>
<p>第六部分 基金份额 的申购、 赎回</p>	<p>九、巨额赎回的情形及处理方式</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。</p>	<p>九、巨额赎回的情形及处理方式</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。</p> <p>若进行上述延期办理，在单个基金份额持有人超过上一工作日基金总份额20%以上的赎回申请的情形下，基金管理人可以对该基金份额持有人超过20%以上的部分延期办理赎回申请。对于其余当日非自动延期办理的赎回申请，应当按单个账户非自动延期办理的赎回申请量占非自动延期办理的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</p>

	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。	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。部分延期赎回不受单笔赎回最低份额的限制。
第七部分 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: 赵如冰	一、基金管理人 (一) 基金管理人简况 法定代表人: 杨光裕
第七部分 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: 刘士余	二、基金托管人 (一) 基金托管人简况 法定代表人: 周慕冰
第十二部分 基金 的投资	二、投资范围 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具, 包括国内依法发行上市的股票(含中小板股票、创业板股票, 以及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、资产支持证券、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种, 基金管理人在履行适当程序后, 可以将其纳入投资范围。 基金的投资组合比例为: 本基金将基金资产的 60%-95% 投资于股票类资产, 其中投资于以制造业为主的支柱产业的股票的资产不低于基金股票资产的 80%; 将基金资产的 5%-40% 投资于债券和现金等固定收益类品种, 其中, 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%; 本基金投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%。 本基金参与股指期货交易, 应符合法律法规规定和基金合同约定的投资限制并遵守相关期货交易所的业务规则。	二、投资范围 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具, 包括国内依法发行上市的股票(含中小板股票、创业板股票, 以及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、资产支持证券、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种, 基金管理人在履行适当程序后, 可以将其纳入投资范围。 基金的投资组合比例为: 本基金将基金资产的 60%-95% 投资于股票类资产, 其中投资于以制造业为主的支柱产业的股票的资产不低于基金股票资产的 80%; 将基金资产的 5%-40% 投资于债券和现金等固定收益类品种, 其中, 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%, 其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等; 本基金投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%。 本基金参与股指期货交易, 应符合法律法规规定和基金合同约定的投资限制并遵守相关期货交易所的业务规则。

第十二部分 基金的投资	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(2) 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；若本基金投资股指期货的，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>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(2) 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；若本基金投资股指期货的，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、存出保证金和应收申购款等；</p>
第十二部分 基金的投资		<p>增加：</p> <p>(12) 本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不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，不超过该上市公司可流通股票的 30%；</p> <p>(13) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 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项所规定的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>(14) 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投资范围保持一致；</p>
第十二部分 基金的投资	<p>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。</p>	<p>除上述第(2)、(13)、(14)、(15)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。</p>
第十四部分 基金财产的估值	<p>三、估值方法</p> <p>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>	<p>三、估值方法</p> <p>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>(3) 流通受限股票，指在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行时股票公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，按监管机构或行业协会有关规</p>

		定确定公允价值。
第十四部分 基金财产的估值	三、估值方法	三、估值方法 增加： 6、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。
第十四部分 基金财产的估值	六、暂停估值的情形 1、基金投资所涉及的证券交易所市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； 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； 3、中国证监会和基金合同认定的其它情形。	六、暂停估值的情形 1、基金投资所涉及的证券交易所市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； 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； 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时，经与基金托管人协商确认后，应当暂停估值； 4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。
第十八部分 基金的信息披露	(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 基金管理人应当在每年结束之日起90日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定报刊上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。 基金管理人应当在上半年结束之日起60日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定报刊上。 基金管理人应当在每个季度结束之日起15个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定媒体上。 基金合同生效不足2个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。 基金定期报告在公开披露的第2个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。	(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 基金管理人应当在每年结束之日起90日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定报刊上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。 基金管理人应当在上半年结束之日起60日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定报刊上。 基金管理人应当在每个季度结束之日起15个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定媒体上。 基金合同生效不足2个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。 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基金份额比例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文件中“影响投资者决策的其

		<p>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本基金的特定风险,中国证监会认定的特殊情形除外。</p> <p>基金定期报告在公开披露的第2个工作日,分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。</p>
第十八部分 基金的信息披露	(七) 临时报告	<p>(七) 临时报告</p> <p>增加:</p> <p>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;</p> <p>27、基金管理人采用摆动定价机制进行估值;</p>
第二十四部分 基金合同内容摘要		<p>摘要部分也做了相应修改,与合同修订内容保持一致。</p>

二、对基金托管协议的修改内容

章节	修订前	修订后
一、基金托管协议当事人	<p>(一) 基金管理人 法定代表人: 赵如冰</p> <p>(二) 基金托管人 法定代表人: 刘士余</p>	<p>(一) 基金管理人 法定代表人: 杨光裕</p> <p>(二) 基金托管人 法定代表人: 周慕冰</p>
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的约定,对基金投资范围、投资对象进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的,基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池和交易对手库,以便基金托管人运用相关技术系统,对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督。</p> <p>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(含中小板股票、创业板股票,以及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、资产支持证券、货币市场工具、权证、股指期货以及法</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。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的,基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池和交易对手库,以便基金托管人运用相关技术系统,对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督。</p> <p>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(含中小板股票、创业板股票,以及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、资产支持证券、货币市场工具、权证、股指期货以及</p>

	<p>法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。</p> <p>本基金参与股指期货交易,应符合法律法规规定和基金合同约定的投资限制并遵守相关期货交易所的业务规则。</p> <p>本基金的配置比例为本基金将基金资产的 60%-95% 投资于股票类资产,其中投资于以制造业为主的支柱产业的股票的资产不低于基金股票资产的 80%;将基金资产的 5%-40% 投资于债券和现金等固定收益类品种,其中,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%;本基金投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%。</p>	<p>法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。</p> <p>本基金参与股指期货交易,应符合法律法规规定和基金合同约定的投资限制并遵守相关期货交易所的业务规则。</p> <p>本基金的配置比例为本基金将基金资产的 60%-95% 投资于股票类资产,其中投资于以制造业为主的支柱产业的股票的资产不低于基金股票资产的 80%;将基金资产的 5%-40% 投资于债券和现金等固定收益类品种,其中,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%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等;本基金投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%。</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) 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;若本基金投资股指期货的,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) 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;若本基金投资股指期货的,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、存出保证金和应收申购款等;</p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>		<p>增加:</p> <p>(12) 本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票,不超过该上市公司可流通股票的 15%;本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不超过该上市公司可流通股票的 30%;</p> <p>(13) 本基金主动投资于流动性</p>

		<p>受限资产的市值合计不超过基金资产的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项所规定的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>(14)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投资范围保持一致；</p>
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	<p>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。</p>	<p>除上述第(2)、(13)、(14)、(15)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。</p>
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	<p>(七)基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资流通受限证券进行监督。</p> <p>1、基金投资流通受限证券，应遵守《关于规范基金投资非公开发行股票行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。</p> <p>2、流通受限证券包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>	<p>(七)基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资流通受限证券进行监督。</p> <p>1、基金投资流通受限证券，应遵守《关于规范基金投资非公开发行股票行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。</p> <p>2、流通受限证券与上文流动性受限资产并不完全一致，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>
八、基金资产净值计算和会计核算	<p>(二)基金资产估值方法和特殊情形的处理</p> <p>(2)处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>3)首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>	<p>(二)基金资产估值方法和特殊情形的处理</p> <p>(2)处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>3)流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等(不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票)，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>

八、基金资产净值计算和会计核算		<p>增加：</p> <p>(6) 当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。</p>
八、基金资产净值计算和会计核算		<p>(四) 暂停估值与公告基金份额净值的情形</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时，经与基金托管人协商确认后，应当暂停估值；</p>
十、基金信息披露	<p>(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</p> <p>1. 职责</p> <p>基金托管人和基金管理人在信息披露过程中应以保护基金份额持有人利益为宗旨，诚实信用，严守秘密。基金管理人负责办理与基金有关的信息披露事宜，对于本章第（二）条规定的应由基金托管人复核的事项，应经基金托管人复核无误后，由基金管理人予以公布。</p> <p>基金管理人应当在中国证监会规定的时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的全国性报刊和基金管理人的互联网网站等媒介披露。根据法律法规应由基金托管人公开披露的信息，基金托管人将通过指定报刊和基金托管人的互联网网站公开披露。</p> <p>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信息：</p> <p>(1) 不可抗力；</p> <p>(2) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的情况。</p>	<p>(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</p> <p>1. 职责</p> <p>基金托管人和基金管理人在信息披露过程中应以保护基金份额持有人利益为宗旨，诚实信用，严守秘密。基金管理人负责办理与基金有关的信息披露事宜，对于本章第（二）条规定的应由基金托管人复核的事项，应经基金托管人复核无误后，由基金管理人予以公布。</p> <p>基金管理人应当在中国证监会规定的时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的全国性报刊和基金管理人的互联网网站等媒介披露。根据法律法规应由基金托管人公开披露的信息，基金托管人将通过指定报刊和基金托管人的互联网网站公开披露。</p> <p>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信息：</p> <p>(1) 不可抗力；</p> <p>(2) 发生基金合同约定的暂停估值的情形；</p> <p>(3) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的情况。</p>

关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改 基金合同、托管协议的内容说明

景顺长城景瑞收益定期开放债券型证券投资基金

一、 基金合同修订内容

章节	修订前	修订后
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》”)、《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》”)、《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。
第二部分 释义	31、自由开放期：本基金在每个运作周期结束后设自由开放期，在自由开放期内赎回基金，本基金不收取赎回费，每个自由开放期为 5 至 15 个工作日	31、自由开放期：本基金在每个运作周期结束后设自由开放期，在自由开放期内赎回基金，除持有期未滿 7 日的，本基金不收取赎回费，每个自由开放期为 5 至 15 个工作日
第二部分 释义		增加： 56、《流动性风险管理规定》：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 57、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)、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 58、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
第三部分	三、基金的运作方式	三、基金的运作方式

基金的基本情况	自由开放期：本基金在相邻两个运作周期之间设置自由开放期，在自由开放期内赎回基金，本基金不收取赎回费。	自由开放期：本基金在相邻两个运作周期之间设置自由开放期，在自由开放期内赎回基金，除持有期未滿7日的，本基金不收取赎回费。
第六部分基金份额的运作周期、自由开放期、受限开放期和封闭期	二、基金的自由开放期 本基金在相邻两个运作周期之间设置自由开放期，在自由开放期内赎回基金，本基金不收取赎回费。	二、基金的自由开放期 本基金在相邻两个运作周期之间设置自由开放期，在自由开放期内赎回基金，除持有期未滿7日的，本基金不收取赎回费。
第七部分基金份额的申购与赎回	二、转型前“景顺长城景瑞收益定期开放债券型证券投资基金”的申购、赎回 (四) 申购和赎回的数量限制	二、转型前“景顺长城景瑞收益定期开放债券型证券投资基金”的申购、赎回 (四) 申购和赎回的数量限制增加： 6、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。具体请参见相关公告。
第七部分基金份额的申购与赎回	(五) 申购和赎回的价格、申购费用、受限开放期赎回费用及其用途 5、受限开放期的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人在受限开放期赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的具体归入比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。	(五) 申购和赎回的价格、申购费用、开放期赎回费用及其用途 5、开放期的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人在开放期赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的具体归入比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。其中对于持续持有期少于7日的投资者，本基金将收取不低于1.5%的赎回费并全额计入基金财产。
第七部分基金份额的申购与赎回	(五)申购和赎回的价格、费用及其用途 3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见《招募说明书》本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入的方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。	(五)申购和赎回的价格、费用及其用途 3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见《招募说明书》本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示，对于持续持有期少于7日的投资者，本基金将收取不低于1.5%的赎回费并全额计入基金财产。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入的方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财

		产承担。
第七部分 基金份额 的申购与 赎回		增加： 8、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，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。
第七部分 基金份额 的申购与 赎回	<p>(六) 拒绝或暂停申购的情形</p> <p>在任一自由开放期或受限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：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、因不可抗力导致基金无法正常运作。 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。 3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。 4、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。 5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或其他损害现有基金份额持有人利益的情形。 6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 <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。如封闭期或运作周期结束之日后第一个工作日因不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放申购业务的，开放期自不可抗力或其他情形的影响因素消除之日起的下一个工作日开始。自由开放期内因发生不可抗力或其他情形而发生基金暂停申购业务的，自由开放期将按因不可抗力或其他情形而暂停申购的期间相应延长。</p>	<p>(六) 拒绝或暂停申购的情形</p> <p>在任一自由开放期或受限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：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、因不可抗力导致基金无法正常运作。 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受申购申请。 3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。 4、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。 5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或其他损害现有基金份额持有人利益的情形。 6、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。 7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 <p>发生上述第 1、2、3、5、7 项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全部或部分拒绝的，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。如封闭期或运作周期结束之日后第一个工作日因不可抗力或其他情</p>

		形致使基金无法按时开放申购业务的,开放期自不可抗力或其他情形的影响因素消除之日起的下一个工作日开始。自由开放期内因发生不可抗力或其他情形而发生基金暂停申购业务的,自由开放期将按因不可抗力或其他情形而暂停申购的期间相应延长。
第七部分 基金份额 的申购与 赎回	<p>(七) 暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>在任一自由开放期或受限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:</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时。</p>	<p>(七) 暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>在任一自由开放期或受限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:</p> <p>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,经与基金托管人协商确定后,基金管理人应当暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项。</p>
第七部分 基金份额 的申购与 赎回	<p>(八) 巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>1、巨额赎回的认定</p> <p>若本基金单个自由开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一工作日的基金总份额的 20%,即认为是发生了巨额赎回。</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>当基金出现巨额赎回时,基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或延缓支付赎回款项。</p> <p>(1) 全额赎回:当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时,按正常赎回程序执行。</p> <p>(2) 延缓支付赎回款项:本基金单个自由开放日出现巨额赎回的,基金管理人对于符合法律法规及基金合同约定的赎回申请应于当日全部予以办理和确认。但对于已接受的赎回申请,如基金管理人认为全额支付投资人的赎回款项可能会对基金的资产净值造成较大波动的,基金管理人可对赎回款项进行延缓支付,但不得超过 20 个工作日。延缓支付的赎回申请以</p>	<p>(八) 巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>1、巨额赎回的认定</p> <p>若本基金单个自由开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一工作日的基金总份额的 20%,即认为是发生了巨额赎回。</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>当基金出现巨额赎回时,基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回、延缓支付赎回款项或部分延期赎回。</p> <p>(1) 全额赎回:当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时,按正常赎回程序执行。</p> <p>(2) 延缓支付赎回款项:本基金单个自由开放日出现巨额赎回的,基金管理人对于符合法律法规及基金合同约定的赎回申请应于当日全部予以办理和确认。但对于已接受的赎回申请,如基金管理人认为全额支付投资人的赎回款项可能会对基金的资产净值造成较大波动的,基金管理人可对赎回款项进行延缓支付,但不得超过 20 个工作日。延缓</p>

	<p>赎回申请确认当日的基金份额净值为基础计算赎回金额。</p> <p>(3) 暂停赎回：自由开放期内，连续 2 个开放日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。</p> <p>3、延缓支付的公告</p> <p>当发生上述巨额赎回并延缓支付赎回款项时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒介上刊登公告。</p>	<p>支付的赎回申请以赎回申请确认当日的基金份额净值为基础计算赎回金额。</p> <p>(3) 部分延期赎回：在自由开放期内，在单个基金份额持有人超过上一工作日基金总份额 40% 以上的赎回申请的情形下，基金管理人可以对该基金份额持有人超过 40% 以上的部分延期办理赎回。对于其余当日非自动延期办理的赎回申请，应当按单个账户非自动延期办理的赎回申请量占非自动延期办理的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。如延期办理期限超过开放期，则开放期相应延长，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前一开放日基金总份额 40% 而被延期办理赎回的单个基金份额持有人办理赎回业务。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。部分延期赎回不受单笔赎回最低份额的限制。</p> <p>(4) 暂停赎回：自由开放期内，连续 2 个开放日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。</p> <p>3、巨额赎回的公告</p> <p>当发生上述巨额赎回并延缓支付赎回款项或部分延期赎回时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒介上刊登公告。</p>
第七部分	三、转型为“景顺长城景瑞收益债券型证券投资基金”的申购、赎回	三、转型为“景顺长城景瑞收益债券型证券投资基金”的申购、赎回

<p>基金份额的申购与赎回</p>	<p>(四) 申购和赎回的数量限制</p> <p>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，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</p> <p>4、基金管理人可在法律法规允许的情况下，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实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。</p>	<p>(四) 申购和赎回的数量限制</p> <p>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，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</p> <p>4、基金管理人可在法律法规允许的情况下，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实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。</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。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。具体请参见相关公告。</p>
<p>第七部分 基金份额的申购与赎回</p>	<p>(五) 申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p>	<p>(五) 申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示，对于持续持有期少于 7 日的投资者，本基金将收取不低于 1.5% 的赎回费并全额计入基金财产。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p> <p>增加：</p> <p>8、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，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。</p>

<p>第七部分 基金份额 的申购与 赎回</p>	<p>(六) 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:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、因不可抗力导致基金无法正常运作。 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时, 基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。 3、证券交易所交易时间非正常停市, 导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。 4、接受某笔或某些申购申请影响或损害现有基金份额持有人利益时。 5、基金资产规模过大, 使基金管理人无法找到合适的投资品种, 或其他可能对基金业绩产生负面影响, 或其他损害现有基金份额持有人利益的情形。 6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 <p>发生上述第 1、2、3、5、6 项之一的暂停申购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>(六) 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:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、因不可抗力导致基金无法正常运作。 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时, 基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。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, 经与基金托管人协商确定后, 基金管理人应当暂停接受申购申请。 3、证券交易所交易时间非正常停市, 导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。 4、接受某笔或某些申购申请影响或损害现有基金份额持有人利益时。 5、基金资产规模过大, 使基金管理人无法找到合适的投资品种, 或其他可能对基金业绩产生负面影响, 或其他损害现有基金份额持有人利益的情形。 6、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。 7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 <p>发生上述第 1、2、3、5、7 项之一的暂停申购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全部或部分拒绝的, 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>第七部分 基金份额 的申购与 赎回</p>	<p>(七) 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> <ol style="list-style-type: none"> 1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时, 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>(七) 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> <ol style="list-style-type: none"> 1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时, 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>回款项。</p> <p>3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</p> <p>4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。</p> <p>5、继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时，可暂停接受投资人的赎回申请。</p> <p>6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形或者基金合同约定的其他情形。</p>	<p>付赎回款项。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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项。</p> <p>3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</p> <p>4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。</p> <p>5、继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时，可暂停接受投资人的赎回申请。</p> <p>6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形或者基金合同约定的其他情形。</p>
<p>第七部分 基金份额 的申购与 赎回</p>	<p>(八) 巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。</p> <p>(1) 全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。</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。</p>	<p>(八) 巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。</p> <p>(1) 全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。</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。</p> <p>若进行上述延期办理，若进行上述延期办理，在单个基金份额持有人超过上一工作日基金总份额 20%以上的赎回申请的情形下，基金管理人可以对该基金份额持有人超过 20%以上的部分延期办理赎回申请。对于其余当日非自动延期办理的赎回申请，应当按单个账户非自动延期办理的赎回申请量占非自动延期办理的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</p>

		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。部分延期赎回不受单笔赎回最低份额的限制。
第八部分 基金合同 当事人及 权利义务	<p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况</p> <p>名称: 兴业银行股份有限公司 住所: 福州市湖东路 154 号 法定代表人: 高建平 成立时间: 1988 年 8 月 26 日 批准设立机关和批准设立文号: 中国人民银行总行, 银复[1988]347 号 组织形式: 股份有限公司 注册资本: 190.52 亿元人民币 存续期间: 持续经营 基金托管资格批文及文号: 中国证监会证监基金字【2005】74 号</p>	<p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况</p> <p>名称: 兴业银行股份有限公司 住所: 福州市湖东路 154 号 法定代表人: 高建平 成立时间: 1988 年 8 月 26 日 批准设立机关和批准设立文号: 中国人民银行总行, 银复[1988]347 号 组织形式: 股份有限公司 注册资本: 207.74 亿元人民币 存续期间: 持续经营 基金托管资格批文及文号: 中国证监会证监基金字【2005】74 号</p>
第十三部分 基金的投资	<p>二、投资范围</p> <p>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具, 包括国内依法发行上市的国债、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、中小企业私募债券、公司债券、中期票据、短期融资券、质押及买断式回购、协议存款、通知存款、定期存款、资产支持证券、可转换债券(含可分离交易可转换债券)、可交换债等金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益证券品种, 但需符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种, 基金管理人在履行适当程序后, 可以将其纳入投资范围。</p> <p>本基金不投资于股票、权证等权益类资产。</p> <p>本基金投资组合的比例范围为: 转型前“景顺长城景瑞收益定期开放债券型证券投资基金”的投资组合比例: 本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%(自由开放期开始前三个月至自由开放期结束后三个月内不受此比例限制)。任一开放期内, 本基金持有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%。</p> <p>转型为“景顺长城景瑞收益债券</p>	<p>二、投资范围</p> <p>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具, 包括国内依法发行上市的国债、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、中小企业私募债券、公司债券、中期票据、短期融资券、质押及买断式回购、协议存款、通知存款、定期存款、资产支持证券、可转换债券(含可分离交易可转换债券)、可交换债等金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益证券品种, 但需符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种, 基金管理人在履行适当程序后, 可以将其纳入投资范围。</p> <p>本基金不投资于股票、权证等权益类资产。</p> <p>本基金投资组合的比例范围为: 转型前“景顺长城景瑞收益定期开放债券型证券投资基金”的投资组合比例: 本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%(自由开放期开始前三个月至自由开放期结束后三个月内不受此比例限制)。任一开放期内, 本基金持有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%, 其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款</p>

	<p>型证券投资基金”的投资组合比例：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%。本基金持有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%。</p>	<p>等。</p> <p>转型为“景顺长城景瑞收益债券型证券投资基金”的投资组合比例：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%。本基金持有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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</p>
<p>第十三部分基金的投资</p>	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>(2) 转型前，任一开放期内，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，在封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制；转型后，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>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>(2) 转型前，任一开放期内，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、存出保证金和应收申购款等，在封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制；转型后，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、存出保证金和应收申购款等；</p>
<p>第十三部分基金的投资</p>		<p>增加：</p> <p>(11) 转型前的任一开放期内或转型后，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 15%；转型后，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 15%；因证券市场波动、债券停牌、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项所规定的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>(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投资范围保持一致；</p>
<p>第十三部分基金的投资</p>	<p>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。</p>	<p>除上述第(2)、(11)、(12)、(13)项外，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</p>

		法规另有规定的，从其规定。
第十五部分基金资产估值	三、估值方法	三、估值方法 增加： 6、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。
第十五部分基金资产估值	六、暂停估值的情形	六、暂停估值的情形 增加： 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时，经与基金托管人协商确认后，应当暂停估值；
第十五部分基金资产估值	八、特殊情况的处理 1、基金管理人或基金托管人按本基金合同规定的估值方法的第6项进行估值时，所造成的误差不得作为基金资产估值错误处理。	八、特殊情况的处理 1、基金管理人或基金托管人按本基金合同规定的估值方法的第7项进行估值时，所造成的误差不得作为基金资产估值错误处理。
第十九部分基金的信息披露	(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	(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 增加： 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基金份额比例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文件中“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本基金的特定风险，中国证监会认定的特殊情形除外。
第十九部分基金的信息披露	(七) 临时报告	(七) 临时报告 增加： 29、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； 30、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；
第二十五部分基金合同内容摘要		摘要部分也做了相应修改，与合同修订内容保持一致。

二、对基金托管协议的修改内容

章节	修订前	修订后
<p>一、基金托管协议当事人</p>	<p>(二) 基金托管人 名称: 兴业银行股份有限公司(简称: 兴业银行) 注册地址: 福建省福州市湖东路154号 办公地址: 上海市江宁路168号 邮政编码: 350013 法定代表人: 高建平 成立日期: 1988年8月22日 批准设立机关和批准设立文号: 中国人民银行总行, 银复[1988]347号 基金托管业务批准文号: 中国证监会证监基金字[2005]74号 组织形式: 股份有限公司 注册资本: 190.52336751 亿元人民币 存续期间: 持续经营 经营范围: 吸收公众存款; 发放短期、中期和长期贷款; 办理国内外结算; 办理票据承兑与贴现; 发行金融债券; 代理发行、代理兑付、承销政府债券; 买卖政府债券、金融债券; 代理发行股票以外的有价证券; 买卖、代理买卖股票以外的有价证券; 资产托管业务; 从事同业拆借; 买卖、代理买卖外汇; 结汇、售汇业务; 从事银行卡业务; 提供信用证服务及担保; 代理收付款项及代理保险业务; 提供保管箱服务; 财务顾问、资信调查、咨询、见证业务; 经中国银行业监督管理委员会批准的其他业务(以上范围凡涉及国家专项专营规定的从其规定)。</p>	<p>(二) 基金托管人 名称: 兴业银行股份有限公司(简称: 兴业银行) 注册地址: 福建省福州市湖东路154号 办公地址: 上海市江宁路168号 邮政编码: 350013 法定代表人: 高建平 成立日期: 1988年8月22日 批准设立机关和批准设立文号: 中国人民银行总行, 银复[1988]347号 基金托管业务批准文号: 中国证监会证监基金字[2005]74号 组织形式: 股份有限公司 注册资本: 207.74190751 亿元人民币 存续期间: 持续经营 经营范围: 吸收公众存款; 发放短期、中期和长期贷款; 办理国内外结算; 办理票据承兑与贴现; 发行金融债券; 代理发行、代理兑付、承销政府债券; 买卖政府债券、金融债券; 代理发行股票以外的有价证券; 买卖、代理买卖股票以外的有价证券; 资产托管业务; 从事同业拆借; 买卖、代理买卖外汇; 结汇、售汇业务; 从事银行卡业务; 提供信用证服务及担保; 代理收付款项及代理保险业务; 提供保管箱服务; 财务顾问、资信调查、咨询、见证业务; 经中国银行业监督管理委员会批准的其他业务(以上范围凡涉及国家专项专营规定的从其规定)。</p>
<p>二、基金托管协议的依据、目的和原则</p>	<p>(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办法》(以下简称“《信息披露办法》”)等有关法律法规、《景顺长城景瑞收益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</p>	<p>(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》等有关法律法规、《景顺长城景瑞收益定期开放</p>

	有关规定制订。	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。
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>	<p>(一)基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权</p> <p>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。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的,基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池,以便基金托管人运用相关技术系统,对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督,对存在疑义的事项进行核查。</p> <p>本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的国债、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、中小企业私募债券、公司债券、中期票据、短期融资券、质押及买断式回购、协议存款、通知存款、定期存款、资产支持证券、可转换债券(含可分离交易可转换债券)、可交换债等金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益证券品种,但需符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。</p> <p>本基金不投资于股票、权证等权益类资产。</p> <p>本基金投资组合的比例范围为: 转型前“景顺长城景瑞收益定期开放债券型证券投资基金”的投资组合比例:</p> <p>本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%(自由开放期开始前三个月至自由开放期结束后三个月内不受此比例限制)。任一开放期内,本基金持有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%。</p> <p>转型为“景顺长城景瑞收益债券型证券投资基金”的投资组合比例: 本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%。本基金持有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%。</p>	<p>(一)基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权</p> <p>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。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的,基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池,以便基金托管人运用相关技术系统,对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督,对存在疑义的事项进行核查。</p> <p>本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的国债、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、中小企业私募债券、公司债券、中期票据、短期融资券、质押及买断式回购、协议存款、通知存款、定期存款、资产支持证券、可转换债券(含可分离交易可转换债券)、可交换债等金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益证券品种,但需符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。</p> <p>本基金不投资于股票、权证等权益类资产。</p> <p>本基金投资组合的比例范围为: 转型前“景顺长城景瑞收益定期开放债券型证券投资基金”的投资组合比例:</p> <p>本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%(自由开放期开始前三个月至自由开放期结束后三个月内不受此比例限制)。任一开放期内,本基金持有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%,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>转型为“景顺长城景瑞收益债券型证券投资基金”的投资组合比例: 本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%。本基金持有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%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应</p>

		收申购款等。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	<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、融资比例进行监督。</p> <p>(2) 转型前, 任一开放期内, 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、应收申购款等, 在封闭期内, 本基金不受上述 5% 的限制; 转型后, 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>(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。</p> <p>(2) 转型前, 任一开放期内, 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、应收申购款等, 在封闭期内, 本基金不受上述 5% 的限制; 转型后, 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;</p> <p>增加:</p> <p>(13) 转型前, 任一开放期内, 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 15%; 转型后, 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 15%; 因证券市场波动、债券停牌、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项所规定的比例限制的, 基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;</p> <p>(14) 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投资范围保持一致;</p>
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	<p>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。</p>	<p>除上述第(2)、(11)、(13)、(14)项外, 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。</p>
八、基金资产净值计算和会计核算	<p>(二) 基金资产估值方法和特殊情形的处理</p>	<p>(二) 基金资产估值方法和特殊情形的处理</p> <p>增加:</p> <p>6、当发生大额申购或赎回情形时, 在履行适当程序后, 基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。</p>
八、基金资产净值计算和会计核算	<p>3、特殊情形的处理</p> <p>(1) 基金管理人或基金托管人按本基金合同规定的估值方法的第(5)项进行估值时, 所造成的误差不得作为基金资产估值错误处理。</p>	<p>3、特殊情形的处理</p> <p>基金管理人、基金托管人按估值方法的第 7 项进行估值时, 所造成的误差不得作为基金资产估值错误处理。</p>

八、基金资产净值计算和会计核算	(四) 暂停估值与公告基金份额净值的情形	(四)暂停估值与公告基金份额净值的情形 增加： 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一致后，应当暂停估值；
-----------------	----------------------	---

关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改 基金合同、托管协议的内容说明

景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金

一、 基金合同修订内容

章节	修订前	修订后
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》”)、《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》”)、《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。
第二部分 释义		增加： 56、《流动性风险管理规定》：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 57、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

		<p>议约定有条件提前支取的银行存款)、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>58、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>
第七部分 基金份额 的申购与 赎回	<p>二、转型前“景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金”的申购、赎回</p> <p>(四) 申购和赎回的数量限制</p>	<p>二、转型前“景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金”的申购、赎回</p> <p>(四) 申购和赎回的数量限制增加：</p> <p>6、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。具体请参见相关公告。</p>
第七部分 基金份额 的申购与 赎回	<p>(五) 申购和赎回的价格、申购费用、受限开放期赎回费用及其用途</p> <p>3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见《招募说明书》。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入的方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p> <p>4、申购费用由投资人承担，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用，不列入基金财产。</p> <p>5、受限开放期的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人在受限开放期赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的具体归入比例详见招募说明书，未归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>6、本基金的申购费率、申购份额具体的计算方法、受限开放期的赎回费率、赎回金额具体的计算方法和收</p>	<p>(五) 申购和赎回的价格、申购费用、开放期赎回费用及其用途</p> <p>3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见《招募说明书》。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示，对于持续持有期少于7日的投资者，本基金将收取不低于1.5%的赎回费并全额计入基金财产。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入的方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p> <p>4、申购费用由投资人承担，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用，不列入基金财产。</p> <p>5、开放期的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人在开放期赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的具体归入比例详见招募说明书，未归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>6、本基金的申购费率、申购份</p>

	<p>费方式由基金管理人根据基金合同的规定确定，并在招募说明书中列示。基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。</p>	<p>率、赎回金额具体的计算方法和收费方式由基金管理人根据基金合同的规定确定，并在招募说明书中列示。基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。</p>
第七部分 基金份额 的申购与 赎回		<p>增加： 8、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，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。</p>
第七部分 基金份额 的申购与 赎回	<p>(六) 拒绝或暂停申购的情形 在任一自由开放期或受限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： 1、因不可抗力导致基金无法正常运作。 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。 3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。 4、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。 5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或其他损害现有基金份额持有人利益的情形。 6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 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。如封闭期或运作周期结束之日后第一个工作日因不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放申购业务的，开放期自不可抗力或其他情形的影响因素消除之日起的下一个工作日开始。自由开放期内因发生不可抗力或其他情形而发生基金</p>	<p>(六) 拒绝或暂停申购的情形 在任一自由开放期或受限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： 1、因不可抗力导致基金无法正常运作。 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受申购申请。 3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。 4、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。 5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或其他损害现有基金份额持有人利益的情形。 6、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。 7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、5、7 项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</p>

	<p>暂停申购业务的，自由开放期将按因不可抗力或其他情形而暂停申购的期间相应延长。</p>	<p>指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，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。如封闭期或运作周期结束之日后第一个工作日因不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放申购业务的，开放期自不可抗力或其他情形的影响因素消除之日起的下一个工作日开始。自由开放期内因发生不可抗力或其他情形而发生基金暂停申购业务的，自由开放期将按因不可抗力或其他情形而暂停申购的期间相应延长。</p>
第七部分 基金份额 的申购与 赎回	<p>(七) 暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>在任一自由开放期或受限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：</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时。</p>	<p>(七) 暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>在任一自由开放期或受限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：</p> <p>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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项。</p>
第七部分 基金份额 的申购与 赎回	<p>(八) 巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>1、巨额赎回的认定</p> <p>若本基金单个自由开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一工作日的基金总份额的 20%，即认为是发生了巨额赎回。</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或延缓支付赎回款项。</p> <p>(1) 全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。</p> <p>(2) 延缓支付赎回款项：本基金单个自由开放日出现巨额赎回的，基金管理人符合法律法规及基金合同约定的赎回申请应于当日全部予以办</p>	<p>(八) 巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>1、巨额赎回的认定</p> <p>若本基金单个自由开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一工作日的基金总份额的 20%，即认为是发生了巨额赎回。</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回、延缓支付赎回款项或部分延期赎回。</p> <p>(1) 全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。</p> <p>(2) 延缓支付赎回款项：本基金单个自由开放日出现巨额赎回的，基金管理人符合法律法规及基金合同约定的赎回申请应于当日全部予以办</p>

	<p>理和确认。但对于已接受的赎回申请，如基金管理人认为全额支付投资人的赎回款项有困难或认为全额支付投资人的赎回款项可能会对基金的资产净值造成较大波动的，基金管理人可对赎回款项进行延缓支付，但不得超过 20 个工作日。延缓支付的赎回申请以赎回申请确认当日的基金份额净值为基础计算赎回金额。</p> <p>在开放日发生 20% 以上净赎回时，基金管理人应当接受并确认所有的赎回申请，当日按比例办理的赎回份额不得低于基金总份额的 20%，其余赎回申请可以延缓支付赎回款项，但延缓支付的期限不得超过二十个工作日，并应当在指定报刊及其他相关媒体上予以公告。</p> <p>3、延缓支付的公告</p> <p>当发生上述巨额赎回并延缓支付赎回款项时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒介上刊登公告。</p>	<p>予以办理和确认。但对于已接受的赎回申请，如基金管理人认为全额支付投资人的赎回款项有困难或认为全额支付投资人的赎回款项可能会对基金的资产净值造成较大波动的，基金管理人可对赎回款项进行延缓支付，但不得超过 20 个工作日。延缓支付的赎回申请以赎回申请确认当日的基金份额净值为基础计算赎回金额。</p> <p>(3) 部分延期赎回：在自由开放期内，在单个基金份额持有人超过上一工作日基金总份额 40% 以上的赎回申请的情形下，基金管理人可以对该基金份额持有人超过 40% 以上的部分延期办理赎回。对于其余当日非自动延期办理的赎回申请，应当按单个账户非自动延期办理的赎回申请量占非自动延期办理的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。如延期办理期限超过开放期，则开放期相应延长，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前一开放日基金总份额 40% 而被延期办理赎回的单个基金份额持有人办理赎回业务。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。部分延期赎回不受单笔赎回最低份额的限制。</p> <p>3、巨额赎回的公告</p> <p>当发生上述巨额赎回并延缓支付赎回款项或部分延期赎回时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒介上刊登公告。</p>
第七部分	三、转型为“景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金”的申购、赎回	三、转型为“景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金”的申购、赎回

<p>基金份额的申购与赎回</p>	<p>(四) 申购和赎回的数量限制</p> <p>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，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</p> <p>4、基金管理人可在法律法规允许的情况下，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实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。</p>	<p>(四) 申购和赎回的数量限制</p> <p>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，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</p> <p>4、基金管理人可在法律法规允许的情况下，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实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。</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。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。具体请参见相关公告。</p>
<p>第七部分 基金份额的申购与赎回</p>	<p>(五) 申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p>	<p>(五) 申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示，对于持续持有期少于 7 日的投资者，本基金将收取不低于 1.5% 的赎回费并全额计入基金财产。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p> <p>增加：</p> <p>8、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，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。</p>

<p>第七部分 基金份额 的申购与 赎回</p>	<p>(六) 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:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、因不可抗力导致基金无法正常运作。 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时, 基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。 3、证券交易所交易时间非正常停市, 导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。 4、接受某笔或某些申购申请影响或损害现有基金份额持有人利益时。 5、基金资产规模过大, 使基金管理人无法找到合适的投资品种, 或其他可能对基金业绩产生负面影响, 或其他损害现有基金份额持有人利益的情形。 6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 <p>发生上述第 1、2、3、5、6 项之一的暂停申购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>(六) 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:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、因不可抗力导致基金无法正常运作。 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时, 基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。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, 经与基金托管人协商确定后, 基金管理人应当暂停接受申购申请。 3、证券交易所交易时间非正常停市, 导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。 4、接受某笔或某些申购申请影响或损害现有基金份额持有人利益时。 5、基金资产规模过大, 使基金管理人无法找到合适的投资品种, 或其他可能对基金业绩产生负面影响, 或其他损害现有基金份额持有人利益的情形。 6、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。 7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 <p>发生上述第 1、2、3、5、7 项之一的暂停申购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全部或部分拒绝的, 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>第七部分 基金份额 的申购与 赎回</p>	<p>(七) 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> <ol style="list-style-type: none"> 1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时, 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>(七) 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> <ol style="list-style-type: none"> 1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时, 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>回款项。</p> <p>3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</p> <p>4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。</p> <p>5、继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时，可暂停接受投资人的赎回申请。</p> <p>6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形或者基金合同约定的其他情形。</p>	<p>付赎回款项。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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项。</p> <p>3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</p> <p>4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。</p> <p>5、继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时，可暂停接受投资人的赎回申请。</p> <p>6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形或者基金合同约定的其他情形。</p>
<p>第七部分 基金份额 的申购与 赎回</p>	<p>(八) 巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。</p> <p>(1) 全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。</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。</p>	<p>(八) 巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。</p> <p>(1) 全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。</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。</p> <p>若进行上述延期办理，在单个基金份额持有人超过上一工作日基金总份额 20%以上的赎回申请的情形下，基金管理人可以对该基金份额持有人超过 20%以上的部分延期办理赎回申请。对于其余当日非自动延期办理的赎回申请，应当按单个账户非自动延期办理的赎回申请量占非自动延期办理的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</p>

		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。部分延期赎回不受单笔赎回最低份额的限制。
第八部分 基金合同 当事人及 权利义务	<p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况</p> <p>名称: 兴业银行股份有限公司 住所: 福州市湖东路 154 号 法定代表人: 高建平 成立时间: 1988 年 8 月 26 日 批准设立机关和批准设立文号: 中国人民银行总行, 银复[1988]347 号 组织形式: 股份有限公司 注册资本: 190.52 亿元人民币 存续期间: 持续经营 基金托管资格批文及文号: 中国证监会证监基金字【2005】74 号</p>	<p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况</p> <p>名称: 兴业银行股份有限公司 住所: 福州市湖东路 154 号 法定代表人: 高建平 成立时间: 1988 年 8 月 26 日 批准设立机关和批准设立文号: 中国人民银行总行, 银复[1988]347 号 组织形式: 股份有限公司 注册资本: 207.74 亿元人民币 存续期间: 持续经营 基金托管资格批文及文号: 中国证监会证监基金字【2005】74 号</p>
第十三部分 基金的投资	<p>二、投资范围</p> <p>本基金的投资范围主要包括债券(包括国内依法发行上市的国家债券、金融债券、次级债券、企业债券、中小企业私募债券、公司债券、可转换债券(含分离型可转换债券)及其他经中国证监会允许投资的债券)、中央银行票据、中期票据、短期融资券、质押及买断式回购、同业存单、资产支持证券、银行存款(包括协议存款、通知存款、定期存款)等。本基金同时投资于国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。</p> <p>本基金投资组合的比例范围为: 转型前“景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金”的投资组合比例: 本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%(自由开放期开始前一个月至自由开放期结束后一个月内不受此比例限制), 股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%, 其中, 本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%。任一开放期内, 本基金持有现金或到期日在一年以内的政府</p>	<p>二、投资范围</p> <p>本基金的投资范围主要包括债券(包括国内依法发行上市的国家债券、金融债券、次级债券、企业债券、中小企业私募债券、公司债券、可转换债券(含分离型可转换债券)及其他经中国证监会允许投资的债券)、中央银行票据、中期票据、短期融资券、质押及买断式回购、同业存单、资产支持证券、银行存款(包括协议存款、通知存款、定期存款)等。本基金同时投资于国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。</p> <p>本基金投资组合的比例范围为: 转型前“景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金”的投资组合比例: 本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%(自由开放期开始前一个月至自由开放期结束后一个月内不受此比例限制), 股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%, 其中, 本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%。任一开放期内, 本基金持有现金或到期日在一年以</p>

	<p>债券不低于基金资产净值的 5%，封闭期内不受前述 5% 的限制。</p> <p>转型为“景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金”的投资组合比例：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，其中，本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>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、存出保证金和应收申购款等，封闭期内不受前述 5% 的限制。</p> <p>转型为“景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金”的投资组合比例：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，其中，本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</p>
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>(2) 转型前，任一开放期内，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，在封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制；转型后，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>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>(2) 转型前，任一开放期内，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、存出保证金和应收申购款等，在封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制；转型后，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、存出保证金和应收申购款等；</p>
第十三部分基金的投资		<p>增加：</p> <p>(11) 本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不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，不超过该上市公司可流通股票的 30%；</p> <p>(12) 转型前，任一开放期内，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 15%；转型后，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 15%；因证券市场波动、上市公司</p>

		<p>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项所规定的比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;</p> <p>(13)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投资范围保持一致;</p>
第十三部分基金的投资	<p>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。</p>	<p>除上述第(2)、(12)、(13)、(14)项外,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。</p>
第十五部分基金资产估值	<p>三、估值方法</p> <p>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:</p> <p>(1)送股、转增股、配股和公开增发的新股,按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值;该日无交易的,以最近一日的市价(收盘价)估值;</p> <p>(2)首次公开发行未上市的股票、债券和权证,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值;</p> <p>(3)首次公开发行有明确锁定期的股票,同一股票在交易所上市后,按交易所上市的同一股票的估值方法估值;非公开发行有明确锁定期的股票,按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>	<p>三、估值方法</p> <p>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:</p> <p>(1)送股、转增股、配股和公开增发的新股,按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值;该日无交易的,以最近一日的市价(收盘价)估值;</p> <p>(2)首次公开发行未上市的股票、债券和权证,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值;</p> <p>(3)流通受限的股票,包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等(不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票),按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>
第十五部分基金资产估值	<p>三、估值方法</p>	<p>三、估值方法</p> <p>增加:</p> <p>5、当发生大额申购或赎回情形时,在履行适当程序后,基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。</p>
第十五部分基金资产估值	<p>六、暂停估值的情形</p>	<p>六、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时,经与基</p>

		金托管人协商确认后，应当暂停估值；
第十五部分基金资产估值	八、特殊情况的处理 1、基金管理人或基金托管人按本基金合同规定的估值方法的第5项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。	八、特殊情况的处理 1、基金管理人或基金托管人按本基金合同规定的估值方法的第6项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。
第十九部分基金的信息披露	(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	(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 增加： 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基金份额比例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文件中“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本基金的特定风险，中国证监会认定的特殊情形除外。
第十九部分基金的信息披露	(七) 临时报告	(七) 临时报告 增加： 29、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； 30、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；
第二十五部分基金合同内容摘要		摘要部分也做了相应修改，与合同修订内容保持一致。

二、对基金托管协议的修改内容

章节	修订前	修订后
一、基金托管协议当事人	(二) 基金托管人 名称：兴业银行股份有限公司(简称：兴业银行) 注册地址：福建省福州市湖东路154号 办公地址：上海市江宁路168号 邮政编码：350013 法定代表人：高建平	(二) 基金托管人 名称：兴业银行股份有限公司(简称：兴业银行) 注册地址：福建省福州市湖东路154号 办公地址：上海市江宁路168号 邮政编码：350013

	<p>成立日期：1988年8月22日 批准设立机关和批准设立文号： 中国人民银行总行，银复[1988]347号 基金托管业务批准文号：中国证 监会证监基金字[2005]74号 组织形式：股份有限公司 注册资本：190.52336751 亿元人 民币 存续期间：持续经营 经营范围：吸收公众存款；发放 短期、中期和长期贷款；办理国内外 结算；办理票据承兑与贴现；发行金 融债券；代理发行、代理兑付、承销 政府债券；买卖政府债券、金融债券； 代理发行股票以外的有价证券；买卖、 代理买卖股票以外的有价证券；资产 托管业务；从事同业拆借；买卖、代 理买卖外汇；结汇、售汇业务；从事 银行卡业务；提供信用证服务及担保； 代理收付款项及代理保险业务；提供 保管箱服务；财务顾问、资信调查、 咨询、见证业务；经中国银行业监督 管理机构批准的其他业务（以上范围 凡涉及国家专项专营规定的从其规 定）。</p>	<p>法定代表人：高建平 成立日期：1988年8月22日 批准设立机关和批准设立文号： 中国人民银行总行，银复[1988]347 号 基金托管业务批准文号：中国证 监会证监基金字[2005]74号 组织形式：股份有限公司 注册资本：207.74190751 亿元 人民币 存续期间：持续经营 经营范围：吸收公众存款；发放 短期、中期和长期贷款；办理国内外 结算；办理票据承兑与贴现；发行金 融债券；代理发行、代理兑付、承销 政府债券；买卖政府债券、金融债券； 代理发行股票以外的有价证券；买 卖、代理买卖股票以外的有价证券； 资产托管业务；从事同业拆借；买卖、 代理买卖外汇；结汇、售汇业务；从 事银行卡业务；提供信用证服务及担 保；代理收付款项及代理保险业务； 提供保管箱服务；财务顾问、资信调 查、咨询、见证业务；经中国银行业 监督管理机构批准的其他业务（以上 范围凡涉及国家专项专营规定的从 其规定）。</p>
<p>二、基金 托管协议 的依据、 目的和原 则</p>	<p>（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 办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、 《景顺长城景瑞双利定期开放债券型 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。</p>	<p>（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 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》等有关法律 法规、《景顺长城景瑞双利定期开 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。</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）基金托管人对基金管理人的 投资行为行使监督权 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。基金合同 明确约定基金投资风格或证券选择标 准的，基金管理人应按照基金托管人 要求的格式提供投资品种池，以便基 金托管人运用相关技术系统，对基金 实际投资是否符合基金合同关于证券 选择标准的约定进行监督，对存在疑</p>	<p>（一）基金托管人对基金管理人的 投资行为行使监督权 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。基金合同 明确约定基金投资风格或证券选择 标准的，基金管理人应按照基金托 管人要求的格式提供投资品种池，以 便基金托管人运用相关技术系统，对 基金实际投资是否符合基金合同关 于证券选择标准的约定进行监督，对</p>

	<p>义的事项进行核查。</p> <p>本基金投资于包括债券（包括国内依法发行上市的国家债券、金融债券、次级债券、企业债券、中小企业私募债券、公司债券、可转换债券（含分离型可转换债券）及其他经中国证监会允许投资的债券）、中央银行票据、中期票据、短期融资券、质押及买断式回购、同业存单、资产支持证券、银行存款（包括协议存款、通知存款、定期存款）等。本基金同时投资于国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。</p> <p>本基金投资组合的比例范围为： 转型前“景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金”的投资组合比例：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%（自由开放期开始前一个月至自由开放期结束后一个月内不受此比例限制），股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，其中，本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%。任一开放期内，本基金持有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%，封闭期内不受前述 5%的限制。</p> <p>转型为“景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金”的投资组合比例：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，其中，本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>存在疑义的事项进行核查。</p> <p>本基金投资于包括债券（包括国内依法发行上市的国家债券、金融债券、次级债券、企业债券、中小企业私募债券、公司债券、可转换债券（含分离型可转换债券）及其他经中国证监会允许投资的债券）、中央银行票据、中期票据、短期融资券、质押及买断式回购、同业存单、资产支持证券、银行存款（包括协议存款、通知存款、定期存款）等。本基金同时投资于国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。</p> <p>本基金投资组合的比例范围为： 转型前“景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金”的投资组合比例：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%（自由开放期开始前一个月至自由开放期结束后一个月内不受此比例限制），股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，其中，本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%。任一开放期内，本基金持有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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等，封闭期内不受前述 5%的限制。</p> <p>转型为“景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金”的投资组合比例：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，其中，本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</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、融资比例进行监督。</p> <p>（2）转型前，任一开放期内，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，在</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、融资比例进行监督。</p> <p>（2）转型前，任一开放期内，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</p>

	<p>封闭期内，本基金不受上述 5%的限制；转型后，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>券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等，在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制；转型后，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、存出保证金和应收申购款等；</p> <p>增加：</p> <p>(11)本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不超过该上市公司可流通股票的 30%；</p> <p>(12)转型前，任一开放期内，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 15%；转型后，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 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项所规定的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>(13)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投资范围保持一致；</p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>	<p>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。</p>	<p>除上述第(2)、(12)、(13)、(14)项外，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。</p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>	<p>(五)基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资流通受限证券进行监督。</p> <p>2、流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质</p>	<p>(五)基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资流通受限证券进行监督。</p> <p>2、流通受限证券与上文流动性受限资产并不完全一致，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的</p>

	押券等流通受限证券。	证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。
八、基金资产净值计算和会计核算	<p>(二)基金资产估值方法和特殊情形的处理</p> <p>2.估值方法</p> <p>(2)处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:</p> <p>① 送股、转增股、配股和公开增发的新股,按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值;该日无交易的,以最近一日的市价(收盘价)估值;</p> <p>② 首次公开发行未上市的股票、债券和权证,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值;</p> <p>③ 首次公开发行有明确锁定期的股票,同一股票在交易所上市后,按交易所上市的同一股票的估值方法估值;非公开发行有明确锁定期的股票,按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>	<p>(二)基金资产估值方法和特殊情形的处理</p> <p>2.估值方法</p> <p>(2)处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:</p> <p>① 送股、转增股、配股和公开增发的新股,按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值;该日无交易的,以最近一日的市价(收盘价)估值;</p> <p>② 首次公开发行未上市的股票、债券和权证,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值;</p> <p>③流通受限的股票,包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等(不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票),按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>
八、基金资产净值计算和会计核算	<p>(二)基金资产估值方法和特殊情形的处理</p>	<p>(二)基金资产估值方法和特殊情形的处理</p> <p>增加:</p> <p>(5)当发生大额申购或赎回情形时,在履行适当程序后,基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。</p>
八、基金资产净值计算和会计核算	<p>3、特殊情形的处理</p> <p>(1)基金管理人或基金托管人按本基金合同规定的估值方法的第(5)项进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。</p>	<p>3、特殊情形的处理</p> <p>基金管理人、基金托管人按估值方法的第(6)项进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。</p>
八、基金资产净值计算和会计核算	<p>(四)暂停估值与公告基金份额净值的情形</p>	<p>(四)暂停估值与公告基金份额净值的情形</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一致后,应当暂停估值;</p>

关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改

基金合同、托管协议的内容说明

景顺长城景颐增利债券型证券投资基金

一、基金合同修改内容

章节	修订前	修订后
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>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>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</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>
第二部分 释义		<p>（新增）</p> <p>54、《流动性风险管理规定》：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</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</p>

		<p>让或交易的债券等</p> <p>56、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>
第六部分 基金份额的申 购与赎回		<p>五、申购和赎回的数量限制 (新增)</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。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。具体请参见相关公告。</p>
第六部分 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>4、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见《招募说明书》。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额的基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入的方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p>	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>4、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见《招募说明书》。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示，对于持续持有期少于7日的投资者，本基金将收取不低于1.5%的赎回费并全额计入基金财产。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额的基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入的方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承</p>

		<p>担。</p> <p>(新增)</p> <p>9、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，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、自律组织的规定。</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>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。</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>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。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，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受申购申请。</p> <p>(新增)</p> <p>6、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。</p> <p>发生上述第 1、2、3、5、7 项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全部或部分拒绝的，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>2、发生基金合同规定的暂停基金资</p>	<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资</p>

	<p>产估值情况时，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>产估值情况时，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。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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项。</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 (新增)</p> <p>(3) 如果基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额 20%以上的赎回申请的情形下，基金管理人可以对该基金份额持有人超过 20%以上的部分延期办理赎回申请。对于当日非延期的赎回申请，应当按单个账户非延期赎回申请量占非延期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该类基金份额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。</p>

第七部分 基金合同当事人及权利义务	一、基金管理人 法定代表人：赵如冰	一、基金管理人 法定代表人：杨光裕
第十二部分 基金的投资	二、投资范围 基金的投资组合比例为：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，其中，本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。 如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。	二、投资范围 基金的投资组合比例为：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，其中，本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。 如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。
第十二部分 基金的投资	四、投资限制 1、组合限制 (2) 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；	四、投资限制 1、组合限制 (2) 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、存出保证金和应收申购款等； (新增) (12) 本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不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，不超过该上市公司可流通股票的 30%； (13) 本基金主动投资于流动性受

	<p>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。</p>	<p>限资产的市值合计不超过基金资产的 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该项所规定的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>（14）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投资范围保持一致；</p> <p>除上述第（2）、（8）、（13）、（14）项外，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。</p>
<p>第十四部分 基金资产估值</p>	<p>三、估值方法</p> <p>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>（3）首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>	<p>三、估值方法</p> <p>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>（3）流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等（不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票），按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p> <p>（新增）</p> <p>5、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可</p>

		以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。
第十四部分 基金资产估值		六、暂停估值的情形 (新增) 3、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时，经与基金托管人协商确认后，应当暂停估值；
第十四部分 基金资产估值	八、特殊情况的处理 1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 5 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。	八、特殊情况的处理 1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 6 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。
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 (新增) 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基金份额比例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文件中“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本基金的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。
第十八部分		五、公开披露的基金信息

基金的信息披露		<p>(七) 临时报告</p> <p>(新增)</p> <p>27、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> <p>28、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；</p>
第二十四部分 基金合同内容摘要		对应基金合同正文内容进行同步修改。

二、托管协议修改内容

章节	修订前	修订后
一、基金托管协议当事人	<p>(一) 基金管理人(也可称资产管理人)</p> <p>法定代表人: 赵如冰</p>	<p>(一) 基金管理人(也可称资产管理人)</p> <p>法定代表人: 杨光裕</p>
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》”)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>本协议依据《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》和其他有关法律法规制订。</p>
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以及《基金合同》的约定,对基金投资范围、投资比例、投资风格、投资限制、关联方交易等,进行严格监督。《基金合同》明确约定基金投资风格或证券选择标准的,基金管理人应事先或定期向基金托管人提供</p>	<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定以及《基金合同》的约定,对基金投资范围、投资比例、投资风格、投资限制、关联方交易等,进行严格监督。《基金合同》明确约定基金投资风格或证券选择标准的,基金管理人应事先或定期向基</p>

	<p>投资品种池，以便基金托管人对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，其中，本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>金托管人提供投资品种池，以便基金托管人对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，其中，本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>	<p>2. 本基金各类品种的投资比例、投资限制为：</p> <p>（2）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>2. 本基金各类品种的投资比例、投资限制为：</p> <p>（2）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、存出保证金和应收申购款等；</p> <p>（新增）</p> <p>（12）本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不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，不超过该上市公司可流通股票的 30%；</p> <p>（13）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 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该</p>

		<p>项所规定的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>(14) 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投资范围保持一致；</p>
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	<p>5. 基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。</p> <p>基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。因证券市场波动、证券发行人合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致投资组合不符合上述规定的，基金管理人应在 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。</p>	<p>5. 基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。</p> <p>基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。除上述第 (2)、(8)、(13)、(14) 项外，因证券市场波动、证券发行人合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致投资组合不符合上述规定的，基金管理人应在 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。</p>
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	<p>(六) 本基金投资流通受限证券，应遵守《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。</p> <p>1. 本协议所称的流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>	<p>(六) 本基金投资流通受限证券，应遵守《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。</p> <p>1. 本协议所称的流通受限证券与上文流动性受限资产不同，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、</p>

		回购交易中的质押券等流通受限证券。
十、基金信息披露	<p>(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</p> <p>1. 职责</p> <p>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:</p> <p>(1) 不可抗力;</p> <p>(2) 基金投资所涉及的证券、期货交易遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;</p> <p>(3) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的情况。</p>	<p>(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</p> <p>1. 职责</p> <p>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:</p> <p>(1) 不可抗力;</p> <p>(2) 基金投资所涉及的证券、期货交易遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;</p> <p>(3) 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时,经与基金托管人协商确认后暂停估值;</p> <p>(4) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的情况。</p>

关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改 基金合同、托管协议的内容说明

景顺长城景颐宏利债券型证券投资基金

一、基金合同修订内容

章节	修订前	修订后
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>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</p>	<p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</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</p>

	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。	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。
第二部分 释义		<p>(新增)</p> <p>54、《流动性风险管理规定》: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</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>56、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>
第六部分 基金份额的申购与赎回		<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>(新增)</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</p>

		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。具体请参见相关公告。
第六部分 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>4、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见《招募说明书》。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额的基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入的方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p>	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>4、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见《招募说明书》。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示，对于持续持有期少于7日的投资者，本基金将收取不低于1.5%的赎回费并全额计入基金财产。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额的基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入的方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p> <p>（新增）</p> <p>9、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，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、自律组织的规定。</p>
第六部分 基金份额的申购与赎回	<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。</p> <p>...</p>	<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。当前一估值日基金资产净值50%以上的资产</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>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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受申购申请。…</p> <p>（新增）</p> <p>6、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。</p> <p>7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述第 1、2、3、5、7 项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全部或部分拒绝的，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>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，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>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，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。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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项。</p>
<p>第六部分 基金份额的申</p>		<p>九、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>（新增）</p>

购与赎回		<p>(3) 如果基金发生巨额赎回, 在单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额 20%以上的赎回申请的情形下, 基金管理人可以对该基金份额持有人超过 20%以上的部分延期办理赎回申请。对于当日非延期的赎回申请, 应当按单个账户非延期赎回申请量占非延期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该类基金份额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。</p>
第七部分 基金合同当事人及权利义务	<p>一、基金管理人 法定代表人: 赵如冰</p>	<p>一、基金管理人 法定代表人: 杨光裕</p>
第十二部分 基金的投资	<p>二、投资范围 基金的投资组合比例为: 本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%; 股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%, 其中, 本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%; 现金或到期日在一年以内的政</p>	<p>二、投资范围 基金的投资组合比例为: 本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%; 股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%, 其中, 本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%; 现金或到期日在一年以内的政</p>

	<p>府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p>	<p>府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p>
<p>第十三部分 基金的投资</p>	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(2) 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>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。</p>	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(2) 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、存出保证金和应收申购款等；</p> <p>(新增)</p> <p>(12) 本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不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，不超过该上市公司可流通股票的 30%；</p> <p>(13) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 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该项所规定的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>(14) 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投资范</p>

		<p>围保持一致；…</p> <p>除上述第（2）、（8）、（13）、（14）项外，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。</p>
第十四部分 基金资产估值	<p>三、估值方法</p> <p>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>（3）首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>	<p>三、估值方法</p> <p>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>（3）流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等（不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票），按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p> <p>（新增）</p> <p>5、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。</p>
第十四部分 基金资产估值		<p>六、暂停估值的情形</p> <p>（新增）</p> <p>3、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时，经与基金托管人协商确认后，应当暂停估值；</p>
第十四部分	八、特殊情况的处理	八、特殊情况的处理

基金资产估值	1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 5 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。	1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 6 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。
第十八部分 基金的信息披露		<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>（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</p> <p>（新增）</p> <p>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。</p> <p>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例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文件中“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本基金的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。</p>
第十八部分 基金的信息披露		<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>（七）临时报告</p> <p>（新增）</p> <p>27、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> <p>28、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；</p>
第二十四部分 基金合同内容摘要		对应基金合同正文内容进行同步修改。

二、托管协议修改内容

章节	修订前	修订后
一、基金托管协议当事人	<p>(一) 基金管理人(也可称资产管理人)</p> <p>法定代表人: 赵如冰</p>	<p>(一) 基金管理人(也可称资产管理人)</p> <p>法定代表人: 杨光裕</p>
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》”)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》)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第7号〈托管协议的内容与格式〉》、《景顺长城景颐宏利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。</p>
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以及《基金合同》的约定,对基金投资范围、投资比例、投资风格、投资限制、关联方交易等,进行严格监督。《基金合同》明确约定基金投资风格或证券选择标准的,基金管理人应事先或定期向基金托管人提供投资品种池,以便基金托管人对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督。</p> <p>基金的投资组合比例为:本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的80%;股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的20%,其中,本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的3%;现金或到期日在一年以内的政府债券的投</p>	<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定以及《基金合同》的约定,对基金投资范围、投资比例、投资风格、投资限制、关联方交易等,进行严格监督。《基金合同》明确约定基金投资风格或证券选择标准的,基金管理人应事先或定期向基金托管人提供投资品种池,以便基金托管人对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督。</p> <p>基金的投资组合比例为:本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的80%;股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的20%,其中,本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的</p>

	<p>资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>3%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>	<p>2. 本基金各类品种的投资比例、投资限制为：</p> <p>(2) 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>2. 本基金各类品种的投资比例、投资限制为：</p> <p>(2) 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、存出保证金和应收申购款等；</p> <p>(新增)</p> <p>(12) 本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不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，不超过该上市公司可流通股票的 30%；</p> <p>(13) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 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该项所规定的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>(14) 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投资范围保持一致；</p>
<p>三、基金托管人对基金管理</p>	<p>5. 基金管理人应当自基金合同生效日起 6 个月内使基金的投资组合比例</p>	<p>5. 基金管理人应当自基金合同生效日起 6 个月内使基金的投资组合比</p>

<p>人的业务监督和核查</p>	<p>符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。</p> <p>基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。因证券市场波动、证券发行人合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致投资组合不符合上述规定的，基金管理人应在 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。</p>	<p>例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。</p> <p>基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。除上述第（2）、（8）、（13）、（14）项外，因证券市场波动、证券发行人合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致投资组合不符合上述规定的，基金管理人应在 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。</p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>	<p>（六）本基金投资流通受限证券，应遵守《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。</p> <p>1. 本协议所称的流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>	<p>（六）本基金投资流通受限证券，应遵守《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。</p> <p>1. 本协议所称的流通受限证券与上文流动性受限资产不同，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>
<p>十、基金信息披露</p>	<p>（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</p> <p>1. 职责</p> <p>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：</p> <p>(1) 不可抗力；</p> <p>(2) 基金投资所涉及的证券、期货交</p>	<p>（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</p> <p>1. 职责</p> <p>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：</p> <p>(1) 不可抗力；</p> <p>(2) 基金投资所涉及的证券、期货交</p>

	易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； (3) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的情况。	易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； (3) 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时，经与基金托管人协商确认后暂停估值； (4) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的情况。
--	--	--

关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改 基金合同、托管协议的内容说明

景顺长城稳健回报灵活配置混合型证券投资基金

一、基金合同修订内容

章节	修订前	修订后
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。
第二部分 释义		（新增） 54、《流动性风险管理规定》：指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10

		<p>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</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>56、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>
第六部分 基金份额 的申购与 赎回		<p>五、申购和赎回的数量限制 （新增）</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。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。具体请参见相关公告。</p>
第六部分 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>4、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日某类别基金份额净值并扣除相应</p>	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>4、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示，对于持续持有期少于 7 日的投资者，本基金将收取不低于 1.5% 的赎回费并全额计入基金财产。赎回金额为按实际确认的有效赎回</p>

	<p>的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入的方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p>	<p>份额乘以当日某类别基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入的方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p> <p>（新增）</p> <p>9、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，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、自律组织规则的规定。</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>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。</p> <p>...</p> <p>6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</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>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受申购申请。</p> <p>（新增）</p> <p>6、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。</p> <p>7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述第 1、2、3、5、7 项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全部或部分拒绝的，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</p>

		复申购业务的办理。
第六部分 基金份额 的申购与 赎回	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，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。	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，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。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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项。
第六部分 基金份额 的申购与 赎回		九、巨额赎回的情形及处理方式 (新增) (3) 如果基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额 20%以上的赎回申请的情形下，基金管理人可以对该基金份额持有人超过 20%以上的部分延期办理赎回申请。若进行该种超比例延期赎回，对于当日非延期的赎回申请，应当按单个账户非延期赎回申请量占非延期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该类基金份额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。
第七部分 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:赵如冰	一、基金管理人 (一)基金管理人简况 法定代表人:杨光裕
第七部分 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 注册资本:470亿元人民币	二、基金托管人 (一)基金托管人简况 注册资本:810.31亿元人民币
第十二部分 基金的投资	二、投资范围 本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范围为0-95%。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。	二、投资范围 本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范围为0-95%。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、存出保证金和应收申购款等。
第十三部分 基金的投资	四、投资限制 1、组合限制 (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; ... 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。法律法规另有规定,从其规定。	四、投资限制 1、组合限制 (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,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、存出保证金和应收申购款等; ... (新增) (12)本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票,不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,不超过该上市公司可

	<p>流通股票的 30%；</p> <p>(13)本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 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该项所规定的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>(14)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投资范围保持一致；</p> <p>...</p> <p>除上述第 (2)、(13)、(14)、(15) 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。法律法规另有规定，从其规定。</p>
<p>第十四部分 基金资产估值</p>	<p>三、估值方法</p> <p>(新增)</p> <p>7、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。</p> <p>8、流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等（不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票），按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>

<p>第十四部分 基金资产估值</p>	<p>六、暂停估值的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的证券、期货市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</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、中国证监会和基金合同认定的其它情形。</p>	<p>六、暂停估值的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的证券、期货市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</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、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时，经与基金托管人协商确认后，应当暂停估值；</p> <p>4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。</p>
<p>第十四部分 基金资产估值</p>	<p>八、特殊情况的处理</p> <p>1、基金管理人或基金托管人按本基金合同规定的估值方法的第 7 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。</p>	<p>八、特殊情况的处理</p> <p>1、基金管理人或基金托管人按本基金合同规定的估值方法的第 9 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。</p>
<p>第十八部分 基金的信息披露</p>		<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>（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</p> <p>...</p> <p>（新增）</p> <p>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。</p> <p>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例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文件中“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本基金的特定风险，中国证监会</p>

		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 (新增) 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； 27、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；
第二十四部分 基金合同内容摘要		对应基金合同正文内容进行同步修改。

二、托管协议修订内容

章节	修订前	修订后
一、基金托管协议当事人	(一) 基金管理人 法定代表人：赵如冰 (二) 基金托管人 注册资本：470 亿元人民币	(一) 基金管理人 法定代表人：杨光裕 (二) 基金托管人 注册资本：810.31 亿元人民币
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 《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》)、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 7 号〈托管协议的内容与格式〉》、《景顺长城稳健回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合	(一) 订立托管协议的依据 《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》)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 7 号〈托管协议的内容与格式〉》、《景顺长城稳健回报灵活配置混

	同”)及其他有关规定订立本托管协议。	合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关规定订立本托管协议。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	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范围为0-95%。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。	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范围为0-95%。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、存出保证金和应收申购款等。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	<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%的现金或者到期日在一年以内的政府债券;</p> <p>...</p> <p>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。在上述期间内,本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。在符合相关法律法规规定的前提下,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非基金管理人的因素致使基金的投资组合不符合上述规定的投资比例的,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。</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、存出保证金和应收申购款等;</p> <p>...</p> <p>(新增)</p> <p>12、本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票,不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,不超过该上市公司可流通股票的30%;</p> <p>13、本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的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</p>

		<p>致使基金不符合该项所规定的比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;</p> <p>14、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投资范围保持一致;</p> <p>...</p> <p>在符合相关法律法规规定的前提下,除上述第(2)、(13)、(14)、(15)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非基金管理人的因素致使基金的投资组合不符合上述规定的投资比例的,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。</p> <p>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。在上述期间内,本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。</p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>		<p>(四)基金托管人依据有关法律法规的规定和基金合同的约定对于基金关联投资限制进行监督。</p> <p>(新增)</p> <p>基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销的证券,或者从事其他重大关联交易的,应当符合基金的投资目标和投资策略,遵循基金份额持有人利益优先原则,防范利益冲突,建立健全内部审批机制和评估机</p>

		制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	<p>(七) 基金托管人对基金投资流通受限证券的监督</p> <p>1. 基金投资流通受限证券，应遵守《关于规范基金投资非公开发行股票行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。2. 流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>	<p>(七)基金托管人对基金投资流通受限证券的监督</p> <p>1. 基金投资流通受限证券，应遵守《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。</p> <p>2. 流通受限证券与上文流动性受限资产不同，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>
八、基金资产净值计算和会计核算		<p>2. 估值方法</p> <p>(新增)</p> <p>7、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。</p> <p>8、流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等（不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票），按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>

八、基金资产净值计算和会计核算	<p>3. 特殊情形的处理</p> <p>基金管理人、基金托管人按估值方法第5款进行估值时，所造成的误差不得作为基金资产估值错误处理。</p> <p>由于不可抗力原因，或由于证券、期货交易场所及登记结算公司发送的数据错误等原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金财产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。</p>	<p>3. 特殊情形的处理</p> <p>基金管理人、基金托管人按估值方法第9款进行估值时，所造成的误差不得作为基金资产估值错误处理。</p> <p>由于不可抗力原因，或由于证券、期货交易场所及登记结算公司发送的数据错误等原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金财产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。</p>
八、基金资产净值计算和会计核算		<p>(四) 暂停估值与公告基金份额净值的情形</p> <p>(新增)</p> <p>3. 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时，经与基金托管人协商确认后，应当暂停估值；</p>

关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改

基金合同、托管协议的内容说明

景顺长城景泰丰利纯债债券型证券投资基金

一、基金合同修订内容

章节	修订前	修订后
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</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》(以下简称“《合同</p>

	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。	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。
第二部分 释义		<p>…</p> <p>(新增)</p> <p>54、《流动性风险管理规定》: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</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)、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>56、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>
第六部分 基金份额的 申购与赎回	五、 申购和赎回的数量限制 …	<p>五、 申购和赎回的数量限制</p> <p>…(新增)</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</p>

		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。具体请参见相关公告。
第六部分 基金份额的 申购与赎回	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 ... 4、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日某类别基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入的方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 ... 4、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示，对于持续持有期少于7日的投资者，本基金将收取不低于1.5%的赎回费并全额计入基金财产。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日某类别基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入的方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。 (新增) 9、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，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、自律组织的规定。
第六部分 基金份额的 申购与赎回	七、拒绝或暂停申购的情形 ... 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。 ...	七、拒绝或暂停申购的情形 ... 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受申购申请。... (新增)

	<p>发生上述第 1、2、3、5、6、7 项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>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%，或者变相规避 50%集中度的情形时。</p> <p>8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述第 1、2、3、5、6、8 项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全部或部分拒绝的，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>...</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，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>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>...</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，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。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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项。</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</p>	<p>九、巨额赎回的情形及处理方式 (新增)</p> <p>(3) 如果基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额 20%以上的赎回申请的情形下，基金管理人可以对该基金份额持有人超过 20%以上的部分延期办理赎回申</p>

		<p>请。若进行该种超比例延期赎回，对于当日非延期的赎回申请，应当按单个账户非延期赎回申请量占非延期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该类基金份额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。</p>
第七部分 基金合同当事人及权利义务	<p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况</p> <p>注册资本：686.04 亿元人民币</p>	<p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况</p> <p>注册资本：810.31 亿元人民币</p>
第十二部分 基金的投资	<p>二、投资范围</p> <p>...</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%；本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p>	<p>二、投资范围</p> <p>...</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%；本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p>
第十二部分	四、投资限制	四、投资限制

<p>基金的投资</p>	<p>1、组合限制</p> <p>...</p> <p>(2) 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>在符合相关法律法规规定的前提下，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，从其规定。</p>	<p>1、组合限制</p> <p>...</p> <p>(2) 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、存出保证金和应收申购款等；</p> <p>...</p> <p>(新增)</p> <p>(12) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 15%；因证券市场波动、债券停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该项所规定的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>(13) 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投资范围保持一致；</p> <p>...</p> <p>在符合相关法律法规规定的前提下，除上述第 (2)、(9)、(12)、(13) 项外，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，从其规定。</p>
<p>第十四部分 基金资产估</p>	<p>三、估值方法</p> <p>1、证券交易所上市的有价证券的估</p>	<p>三、估值方法</p> <p>1、证券交易所上市的有价证券的估</p>

值	值…	<p>值…</p> <p>(新增)</p> <p>(2) 交易所上市交易的可转换债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值; 估值日没有交易的, 且最近交易日后经济环境未发生重大变化, 按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的, 可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素, 调整最近交易市价, 确定公允价值; …</p> <p>(新增)</p> <p>6、当发生大额申购或赎回情形时, 在履行适当程序后, 基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。</p>
第十四部分 基金资产估值	六、暂停估值的情形	<p>六、暂停估值的情形</p> <p>(新增)</p> <p>3、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时, 经与基金托管人协商确认后, 应当暂停估值;</p>
第十四部分 基金资产估值	<p>八、特殊情况的处理</p> <p>1、基金管理人或基金托管人按本基金合同规定的估值方法的第 6 项进行估值时, 所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。</p>	<p>八、特殊情况的处理</p> <p>1、基金管理人或基金托管人按本基金合同规定的估值方法的第 7 项进行估值时, 所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。</p>
第十八部分 基金的信息披露	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>…</p> <p>(六) 基金定期报告, 包括基金年</p>	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>…</p> <p>(六) 基金定期报告, 包括基金年度报</p>

	<p>度报告、基金半年度报告和基金季度报告</p> <p>...</p>	<p>告、基金半年度报告和基金季度报告</p> <p>...</p> <p>(新增)</p> <p>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。</p> <p>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例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文件中“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本基金的特定风险,中国证监会认定的特殊情形除外。</p>
<p>第十八部分 基金的信息 披露</p>	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>...</p> <p>(七) 临时报告</p> <p>...</p>	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>...</p> <p>(七) 临时报告</p> <p>...(新增)</p> <p>27、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> <p>28、基金管理人采用摆动定价机制进行估值;</p>
<p>第二十四部分 基金合同内 容摘要</p>		<p>根据基金合同正文同步修改</p>

二、托管协议修改内容

章节	修订前	修订后
一、基金托管协议当事人	(二) 基金托管人 注册资本: 686.04 亿元人民币	(二) 基金托管人 注册资本: 810.31 亿元人民币

<p>二、基金托管协议的依据、目的和原则</p>	<p>(一) 订立托管协议的依据 《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》)、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第7号〈托管协议的内容与格式〉》、《景顺长城景泰丰利纯债债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关规定订立本托管协议。</p>	<p>(一) 订立托管协议的依据 《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》)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第7号〈托管协议的内容与格式〉》、《景顺长城景泰丰利纯债债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关规定订立本托管协议。</p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>	<p>...</p> <p>基金的投资组合比例为:本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%;本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%。</p>	<p>...</p> <p>基金的投资组合比例为:本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%;本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</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>...</p> <p>(2) 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>...</p> <p>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。在上述期间内,本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。在符合相关法律法规规定的前提下,因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等非基金管理人的因素致使基金的投资组合不符合上述规定的投资比例的,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。</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) 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、存出保证金和应收申购款等;</p> <p>...</p> <p>(新增)</p> <p>(12) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的15%;因证券市场波动、债券停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该项所规定的比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;</p> <p>(13) 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投资范围保持一致;</p>

		<p>...</p> <p>在符合相关法律法规规定的前提下，除上述第（2）、（9）、（12）、（13）项外，因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等非基金管理人的因素致使基金的投资组合不符合上述规定的投资比例的，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。</p> <p>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。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。</p>
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	<p>（四）基金托管人依据有关法律法规的规定和基金合同的约定对于基金关联投资限制进行监督。</p> <p>...</p>	<p>（四）基金托管人依据有关法律法规的规定和基金合同的约定对于基金关联投资限制进行监督。</p> <p>...</p> <p>（新增）</p> <p>基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。</p>
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	<p>（七）基金托管人对基金投资流通受限证券的监督</p> <p>...</p> <p>2. 流通受限证券，包括由《上市公</p>	<p>（七）基金托管人对基金投资流通受限证券的监督</p> <p>...</p> <p>2. 流通受限证券与上文流动性受限资</p>

	司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。	产不同，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。
八、基金资产净值计算和会计核算	2. 估值方法 ...	2. 估值方法 ... (新增) (2) 交易所上市交易的可转换债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值； ... (新增) 6、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。
八、基金资产净值计算和会计核算	3. 特殊情形的处理 基金管理人、基金托管人按估值方法第6款进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。	3. 特殊情形的处理 基金管理人、基金托管人按估值方法第7款进行估值时，所造成的误差作为基金资产估值错误处理。
八、基金资产净值计算和会计核算	(四) 暂停估值与公告基金份额净值的情形 ...	(四) 暂停估值与公告基金份额净值的情形 ... (新增) 3. 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时，经与基金托管人协商确认后，应当暂停估值；

关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改

基金合同、托管协议的内容说明

景顺长城泰安回报灵活配置混合型证券投资基金

一、基金合同修订内容

章节	修订前	修订后
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>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>
第二部分 释义		<p>...</p> <p>(新增)</p> <p>54、《流动性风险管理规定》：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</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>56、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</p>

		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
第六部分 基金份额 的申购与 赎回	五、申购和赎回的数量限制 …	五、申购和赎回的数量限制 …（新增） 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。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。具体请参见相关公告。
第六部分 基金份额 的申购与 赎回	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 … 4、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日某类别基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入的方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 … 4、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示，对于持续持有期少于 7 日的投资者，本基金将收取不低于 1.5% 的赎回费并全额计入基金财产。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日某类别基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入的方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。 （新增） 9、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，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、自律组织规则的规定。
第六部分 基金份额	七、拒绝或暂停申购的情形 …	七、拒绝或暂停申购的情形 …

<p>的申购与赎回</p>	<p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。</p> <p>...</p> <p>7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述第 1、2、3、5、6、7 项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。</p> <p>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>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受申购申请。</p> <p>...</p> <p>(新增)</p> <p>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%，或者变相规避 50%集中度的情形时。</p> <p>8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述第 1、2、3、5、6、8 项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全部或部分拒绝的，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>...</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，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>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>...</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，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。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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项。</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…</p>	<p>九、巨额赎回的情形及处理方式 (新增) (3) 如果基金发生巨额赎回, 在单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额 20%以上的赎回申请的情形下, 基金管理人可以对该基金份额持有人超过 20%以上的部分延期办理赎回申请。若进行该种超比例延期赎回, 对于当日非延期的赎回申请, 应当按单个账户非延期赎回申请量占非延期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该类基金份额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。</p>
<p>第七部分 基金合同 当事人及 权利义务</p>	<p>二、基金托管人 (一) 基金托管人简况 注册资本: 686.04 亿元人民币</p>	<p>二、基金托管人 (一) 基金托管人简况 注册资本: 810.31 亿元人民币</p>
<p>第十二部分 基金的投 资</p>	<p>二、投资范围 … 本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范围为 0-95%。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</p>	<p>二、投资范围 … 本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范围为 0-95%。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</p>

	以内的政府债券。	结算备付金、存出保证金和应收申购款等。
第十二部分 基金的投资	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>…</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>…</p> <p>在符合相关法律法规规定的前提下,因证券、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,从其规定。</p>	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>…</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、存出保证金和应收申购款等;</p> <p>…</p> <p>(新增)</p> <p>(12) 本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票,不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,不超过该上市公司可流通股票的30%;</p> <p>(13) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的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该项所规定的比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;</p> <p>(14) 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投资范围保持一致;</p> <p>在符合相关法律法规规定的前提下,除上述第(2)、(13)、(14)、(15)项外,因证券、期货市场波动、证券发行人合并、</p>

		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，从其规定。
第十四部分 基金资产估值	<p>三、估值方法</p> <p>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>...</p> <p>(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>	<p>三、估值方法</p> <p>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>...</p> <p>(3) 流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等（不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票），按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p> <p>(新增)</p> <p>5、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。</p>
第十四部分 基金资产估值	<p>六、暂停估值的情形</p>	<p>六、暂停估值的情形</p> <p>新增：</p> <p>3、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时，经与基金托管人协商确认后，应当暂停估值；</p>
第十四部分 基金资产估值	<p>八、特殊情况的处理</p> <p>1、基金管理人或基金托管人按本基金合同规定的估值方法的第 5 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。</p>	<p>八、特殊情况的处理</p> <p>1、基金管理人或基金托管人按本基金合同规定的估值方法的第 6 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。</p>
第十八部分	五、公开披露的基金信息	五、公开披露的基金信息

<p>分基金的信息披露</p>	<p>… (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 …</p>	<p>… (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基金份额比例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文件中“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本基金的特有风险, 中国证监会认定的特殊情形除外。</p>
<p>第十八部分基金的信息披露</p>	<p>五、公开披露的基金信息 … (七) 临时报告 …</p>	<p>五、公开披露的基金信息 … (七) 临时报告 … (新增) 27、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; 28、基金管理人采用摆动定价机制进行估值;</p>
<p>第二十四部分基金合同内容摘要</p>		<p>根据基金合同正文进行同步修改</p>

二、托管协议修改内容

章节	修订前	修订后
一、基金托管协议当事人	(二) 基金托管人 注册资本： 686.04 亿元人民币	(二) 基金托管人 注册资本： 810.31 亿元人民币
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 《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》)、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 7 号〈托管协议的内容与格式〉》、《景顺长城泰安回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关规定订立本托管协议。	(一) 订立托管协议的依据 《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》)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 7 号〈托管协议的内容与格式〉》、《景顺长城泰安回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关规定订立本托管协议。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	... 本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范围为 0-95%。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。	... 本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范围为 0-95%。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、存出保证金和应收申购款等。
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： ... 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	(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： ... 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

	<p>的政府债券；</p> <p>…</p> <p>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。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。在符合相关法律法规规定的前提下，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等非基金管理人的因素致使基金的投资组合不符合上述规定的投资比例的，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。</p>	<p>包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；</p> <p>…</p> <p>（新增）</p> <p>12、本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不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，不超过该上市公司可流通股票的 30%；</p> <p>13、本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 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该项所规定的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>14、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投资范围保持一致；</p> <p>…</p> <p>在符合相关法律法规规定的前提下，除上述第（2）、（13）、（14）、（15）项外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等非基金管理人的因素致使基金的投资组合不符合上述规定的投资比例的，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。</p> <p>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</p>
--	--	--

		金合同的约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	<p>(四) 基金托管人依据有关法律法规的规定和基金合同的约定对于基金关联投资限制进行监督。</p> <p>...</p>	<p>(四)基金托管人依据有关法律法规的规定和基金合同的约定对于基金关联投资限制进行监督。</p> <p>...</p> <p>(新增)</p> <p>基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券,或者从事其他重大关联交易的,应当符合基金的投资目标和投资策略,遵循基金份额持有人利益优先原则,防范利益冲突,建立健全内部审批机制和评估机制,按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意,并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议,并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。</p>
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	<p>(七) 基金托管人对基金投资流通受限证券的监督</p> <p>...</p> <p>2. 流通受限证券, 包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券, 不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>	<p>(七)基金托管人对基金投资流通受限证券的监督</p> <p>...</p> <p>2. 流通受限证券与上文流动性受限资产不同, 包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券, 不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>
八、基金资产净值	<p>2. 估值方法</p> <p>(2) 处于未上市期间的有价证券应</p>	<p>2. 估值方法</p> <p>(2) 处于未上市期间的有价证券应区分</p>

<p>计算和会计核算</p>	<p>区分如下情况处理： ... 3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>	<p>如下情况处理： ... 3) 流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等（不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票），按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。 ... (新增) (5) 当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。</p>
<p>八、基金资产净值计算和会计核算</p>	<p>3. 特殊情形的处理 基金管理人、基金托管人按估值方法第 5 款进行估值时，所造成的误差不能作为基金资产估值错误处理。 由于不可抗力原因，或由于证券、期货交易所及登记结算公司发送的数据错误等原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金财产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。</p>	<p>3. 特殊情形的处理 基金管理人、基金托管人按估值方法第（6）款进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。 由于不可抗力原因，或由于证券、期货交易所及登记结算公司发送的数据错误等原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金财产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。</p>
<p>八、基金资产净值计算和会计核算</p>	<p>（四）暂停估值与公告基金份额净值的情形 ... （新增）</p>	<p>（四）暂停估值与公告基金份额净值的情形 ... (新增) 3. 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</p>

		确定时，经与基金托管人协商确认后，应当暂停估值；
--	--	--------------------------

关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改基金合同、托管协议的内容说明

景顺长城景丰货币市场基金

一、基金合同修改内容

章节	修订前	修订后
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》”）、《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》”）、《货币市场基金管理暂行规定》（以下简称“《暂行规定》”）、《证券投资基金信息披露编报规则第5号〈货币市场基金信息披露特别规定〉》（以下简称“《信息披露特别规定》”）、《关于货币市场基金投资等相关问题的通知》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》”）、《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》”）、《货币市场基金管理暂行规定》（以下简称“《暂行规定》”）、《证券投资基金信息披露编报规则第5号〈货币市场基金信息披露特别规定〉》（以下简称“《信息披露特别规定》”）、《关于货币市场基金投资等相关问题的通知》、《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“《流动性风险管理规定》”）和其他有关法律法规。
第二部分 释义		增加： 61、《流动性风险管理规定》：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 62、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）、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
第六部分 基金	五、申购和赎回的数量限制	五、申购和赎回的数量限制 增加：

份 额 的 申 购 与 赎 回		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。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。具体请参见相关公告。
第 六 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>1、本基金不收取申购费用和赎回费用。</p> <p>2、本基金的申购、赎回价格为每份基金份额 1.00 元。投资者申购所得的份额等于申购金额除以 1.00 元，赎回所得的金额等于赎回份额乘以 1.00 元。</p>	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>1、本基金在一般情况下不收取申购费用和赎回费用，但当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额 50%，且投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个工作日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计低于 10%且偏离度为负时，对当日单个基金份额持有人超过基金总份额 1%以上的赎回申请（超过 1%的部分）征收 1%的强制赎回费用，并将上述赎回费用全额计入基金资产。基金管理人与基金托管人协商确认上述做法无益于基金利益最大化的情形除外。</p> <p>2、本基金的申购、赎回价格为每份基金份额 1.00 元。投资者申购所得的份额等于申购金额除以 1.00 元。</p>
第 六 部 分 基 金 份 额 的 申 购 与 赎 回	<p>七、申购份额与赎回金额的计算</p> <p>2、赎回金额的计算</p> <p>本基金的赎回费用为零，基金份额净值保持为人民币 1.00 元。赎回金额的计算方式见招募说明书。</p>	<p>七、申购份额与赎回金额的计算</p> <p>2、赎回金额的计算</p> <p>除按上文收取强制赎回费外，本基金的赎回费用为零，基金份额净值保持为人民币 1.00 元。赎回金额的计算方式见招募说明书。</p>
第 六 部 分 基 金 份 额 的 申 购 与 赎 回	<p>九、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：</p> <p>1、因不可抗力导致基金无法正常运作。</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。</p> <p>3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</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>5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，</p>	<p>九、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：</p> <p>1、因不可抗力导致基金无法正常运作。</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受申购申请。</p> <p>3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</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</p>

	<p>从而损害现有基金份额持有人利益的情形。</p> <p>6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</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体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>有人利益时。</p> <p>5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人利益的情形。</p> <p>6、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。</p> <p>7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述情形之一（除第 4、6 项外）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体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，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>十、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>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，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>十、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>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，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。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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项。</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增加：</p> <p>(3) 如果基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额 10%以上的赎回申请的情形下，基金管理人可以对该基金份额持有人超过 10%以上的部分延期办理赎回申请。对于当日非延期的赎回申请，应当按单个账户非延期赎回申请量占非延期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，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</p>

		期赎回处理。
第七部分 基金合同当事人及权利义务	<p>一、基金管理人</p> <p>(一) 基金管理人简况 法定代表人: 赵如冰</p>	<p>一、基金管理人</p> <p>(一) 基金管理人简况 法定代表人: 杨光裕</p>
第七部分 基金合同当事人及权利义务	<p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况 名称: 兴业银行股份有限公司 住所: 福州市湖东路 154 号 法定代表人: 高建平 成立时间: 1988 年 8 月 26 日 批准设立机关和批准设立文号: 中国人民银行总行, 银复[1988]347 号 组织形式: 股份有限公司 注册资本: 190.52 亿元人民币 存续期间: 持续经营 基金托管资格批文及文号: 中国证监会证监基金字【2005】74 号</p>	<p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况 名称: 兴业银行股份有限公司 住所: 福州市湖东路 154 号 法定代表人: 高建平 成立时间: 1988 年 8 月 26 日 批准设立机关和批准设立文号: 中国人民银行总行, 银复[1988]347 号 组织形式: 股份有限公司 注册资本: 207.74 亿元人民币 存续期间: 持续经营 基金托管资格批文及文号: 中国证监会证监基金字【2005】74 号</p>
第十二部分 基金的投资	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(1) 本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日都不得超过 120 天;</p> <p>(2) 本基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券, 不得超过该证券的 10%;</p> <p>(3) 本基金投资于定期存款的比例不得超过基金资产净值的 30% (有存款期限, 但根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款, 可不受此限制)。本基金的存款银行应当是具有证券投资基金托管人资格、证券投资基金销售业务资格或合格境外机构投资者托管人资格的商业银行;</p> <p>(4) 本基金存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款, 不得超过基金资产净值的 30%; 存放在不具有基金托管资格的同一商业银行的存款, 不得超过基金资产净值的 5%;</p> <p>(5) 本基金通过买断式回购融入的基础债券的剩余期限不得超过 397 天;</p> <p>(6) 在全国银行间同业市场的债券回购最长期限为 1 年, 债券回购到期后不得展期;</p> <p>(7) 本基金持有的剩余期限不</p>	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(1) 当货币市场基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 50%时, 货币市场基金投资组合的平均剩余期限不得超过 60 天, 平均剩余存续期不得超过 120 天; 投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 30%; 当货币市场基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 20%时, 货币市场基金投资组合的平均剩余期限不得超过 90 天, 平均剩余存续期不得超过 180 天; 投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 20%;</p> <p>(2) 本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日都不得超过 120 天, 但前述第 (1) 项另有约定的除外;</p> <p>(3) 本基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券, 不得超过该证券的 10%;</p> <p>(4) 本基金投资于主体信用评级低于 AAA 的机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 10%, 其中单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 2%。前述金融工具包括债券、短期融资券、中期票据、银行存款、同业</p>

<p>超过 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本总计不得超过当日基金资产净值的 20%。本基金不得投资于以定期存款利率为基准利率的浮动利率债券；</p> <p>(8) 本基金投资于同一公司发行的短期融资券及短期企业债券的比例，合计不得超过基金资产净值的 10%；</p> <p>(9) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；</p> <p>(10) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；</p> <p>(11) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；基金管理人管理的全部证券投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；</p> <p>(12) 本基金投资的资产支持证券须具有评级资质的资信评级机构进行持续信用评级。本基金投资的资产支持证券不得低于国内信用评级机构评定的 AAA 级或相当于 AAA 级的信用级别。本基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降且不再符合投资标准，本基金应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；</p> <p>(13) 除发生巨额赎回情形外，本基金债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%。因发生巨额赎回导致债券正回购的资金余额超过基金资产净值 20%的，基金管理人应在 5 个工作日内进行调整；</p> <p>(14) 本基金投资的短期融资券的信用评级应不低于以下标准：</p> <p>1) 国内信用评级机构评定的 A-1 级或相当于 A-1 级的短期信用级别；</p> <p>2) 根据有关规定予以豁免信用评级的短期融资券，其发行人最近 3 年的信用评级和跟踪评级具备下列条件之一：</p> <p>i. 国内信用评级机构评定的 AAA 级或相当于 AAA 级的长期信用级别；</p> <p>ii. 国际信用评级机构评定的低于中国主权评级一个级别的信用级</p>	<p>存单、相关机构作为原始权益人的资产支持证券及中国证监会认定的其他品种；且本基金投资于主体信用评级低于 AA+ 的商业银行的银行存款与同业存单的，应当经基金管理人董事会审议批准，相关交易应当事先征得基金托管人的同意，并作为重大事项履行信息披露程序；</p> <p>(5) 本基金管理人管理的全部货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券，不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的 10%；</p> <p>(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的 10%；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该项所规定的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>(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投资范围保持一致；</p> <p>(8) 本基金投资于定期存款的比例不得超过基金资产净值的 30%（有存款期限，但根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款，可不受此限制）。本基金的存款银行应当是具有证券投资基金托管人资格、证券投资基金销售业务资格或合格境外机构投资者托管人资格的商业银行；</p> <p>(9) 本基金存放在具有基金托管资格的同业商业银行的存款，不得超过基金资产净值的 30%；存放在不具有基金托管资格的同业商业银行的存款，不得超过基金资产净值的 5%；</p> <p>(10) 本基金通过买断式回购融入的基础债券的剩余期限不得超过 397 天；</p> <p>(11) 在全国银行间同业市场的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；</p> <p>(12) 本基金持有的剩余期限不超过 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本总计不得超过当日基金资产净值的 20%。本基金不得投资于以定期存款利率为基准利率的浮动利率债券；</p> <p>(13) 本基金投资于同一公司发行的短期融资券及短期企业债券的比例，合计不得超过基金资产净值的 10%；</p> <p>(14) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；</p> <p>(15) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；</p>
---	--

<p>别。同一发行人同时具有国内信用评级和国际信用评级的，以国内信用评级为准。本基金持有短期融资券期间，如果其信用等级下降且不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 20 个交易日内予以全部减持；</p> <p>(15) 法律法规或监管部门对上述比例、限制另有规定的，从其规定。除上述 (12)、(13)、(14) 项外，由于证券市场波动、债券发行人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。法律法规另有规定的，从其规定。(1) 本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日都不得超过 120 天；</p>	<p>(16) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；基金管理人管理的全部证券投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；</p> <p>(17) 本基金投资的资产支持证券须具有评级资质的资信评级机构进行持续信用评级。本基金投资的资产支持证券不得低于国内信用评级机构评定的 AAA 级或相当于 AAA 级的信用级别。本基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降且不再符合投资标准，本基金应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；</p> <p>(18) 除发生巨额赎回情形外，本基金债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%。因发生巨额赎回导致债券正回购的资金余额超过基金资产净值 20%的，基金管理人应在 5 个交易日内进行调整；</p> <p>(19) 本基金投资的短期融资券的信用评级应不低于以下标准：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1) 国内信用评级机构评定的 A-1 级或相当于 A-1 级的短期信用级别； 2) 根据有关规定予以豁免信用评级的短期融资券，其发行人最近 3 年的信用评级和跟踪评级具备下列条件之一： <ol style="list-style-type: none"> i. 国内信用评级机构评定的 AAA 级或相当于 AAA 级的长期信用级别； ii. 国际信用评级机构评定的低于中国主权评级一个级别的信用级别。同一发行人同时具有国内信用评级和国际信用评级的，以国内信用级别为准。本基金持有短期融资券期间，如果其信用等级下降且不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 20 个交易日内予以全部减持； <p>(20) 法律法规或监管部门对上述比例、限制另有规定的，从其规定。</p> <p>除上述 (2)、(6)、(7)、(17)、(18)、(19) 项外，由于证券市场波动、债券发行人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。法律法规另有规定的，从其规定。</p> <p>基金管理人应当在每个交易日 10:00 前将货币市场基金前一交易日前 10 名基金份额持有人合计持有比例等信息报送基金托管人，基金托管人依法履行投资监督职责。</p>
--	--

<p>第十四部分 基金资产估值</p>	<p>六、暂停估值的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</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、中国证监会和基金合同认定的其它情形。</p>	<p>六、暂停估值的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</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、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时，经与基金托管人协商确认后，应当暂停估值；</p> <p>4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。</p>
<p>第十八部分 基金的信息披露</p>	<p>(五) 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</p> <p>基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定媒体上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。</p> <p>基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定媒体上。</p> <p>基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定媒体上。</p> <p>《基金合同》生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。</p> <p>基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。</p>	<p>(五) 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</p> <p>基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定媒体上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。</p> <p>基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定媒体上。</p> <p>基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定媒体上。</p> <p>《基金合同》生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。</p> <p>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。</p> <p>本基金应当在年度报告、半年度报告中，至少披露报告期末基金前 10 名份额持有人的类别、持有份额及占总份额的比例等信息。</p> <p>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例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文件中“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本基金的特定风险，中国证监会认定的特殊情形除外。</p> <p>基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。</p>
<p>第十八</p>		<p>(六) 临时报告 增加：</p>

部分基金的信息披露		28、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； 29、本基金拟投资于主体信用评级低于AA+商业银行的银行存款与同业存单的；
第二十四部分基金合同内容摘要		根据基金合同正文同步修改

二、 托管协议修改内容

章节	修订前	修订后
一、基金托管协议当事人	<p>(一) 基金管理人 名称：景顺长城基金管理有限公司 住所：深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第 1 座 21 层 法定代表人：赵如冰 设立日期： 2003 年 6 月 12 日 批准设立机关：中国证券监督管理委员会 批准设立文号：中国证监会证监基金字【2003】76 号 组织形式：有限责任公司 注册资本： 1.3 亿元人民币 存续期限：持续经营</p>	<p>(一) 基金管理人 名称：景顺长城基金管理有限公司 住所：深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第 1 座 21 层 法定代表人：杨光裕 设立日期： 2003 年 6 月 12 日 批准设立机关：中国证券监督管理委员会 批准设立文号：中国证监会证监基金字【2003】76 号 组织形式：有限责任公司 注册资本： 1.3 亿元人民币 存续期限：持续经营</p>
一、基金托管协议当事人	<p>(二) 基金托管人 名称：兴业银行股份有限公司 注册地址：福州市湖东路 154 号 办公地址：福州市湖东路 154 号 法定代表人：高建平 成立日期：1988 年 8 月 26 日 批准设立机关和批准设立文号：中国人民银行总行，银复[1988]347 号 基金托管业务批准文号：中国证监会证监基金字[2005]74 号 注册资本：190.52 亿元人民币 经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；代理发行股票以外的有价证券；买卖、</p>	<p>(二) 基金托管人 名称：兴业银行股份有限公司 注册地址：福州市湖东路 154 号 办公地址：福州市湖东路 154 号 法定代表人：高建平 成立时间：1988 年 8 月 26 日 批准设立机关和批准设立文号：中国人民银行总行，银复[1988]347 号 组织形式：股份有限公司 注册资本：207.74 亿元人民币 存续期间：持续经营 基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字【2005】74 号 经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外</p>

	<p>代理买卖股票以外的有价证券；资产托管业务；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；结汇、售汇业务；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；财务顾问、资信调查、咨询、见证业务；经中国银行业监督管理委员会批准的其他业务。</p> <p>组织形式：股份有限公司 存续期间：持续经营</p>	<p>结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；代理发行股票以外的有价证券；买卖、代理买卖股票以外的有价证券；资产托管业务；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；结汇、售汇业务；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；财务顾问、资信调查、咨询、见证业务；经中国银行业监督管理委员会批准的其他业务。</p>
<p>二、基金托管协议的依据、目的和原则</p>	<p>(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》”)、《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》”)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 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》”)、《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》”)、《公开募集开放式证券投资基金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>三、基金托管人对基金管理人业务监督和核查</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，对基金投资比例进行监督。</p> <p>2、本基金投资组合遵循以下投资限制：</p> <p>(1) 本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日都不得超过 120 天；</p> <p>(2) 本基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；</p> <p>(3) 本基金投资于定期存款的比例不得超过基金资产净值的 30% (有存款期限，但根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款，可不受此限制)。本基金的存款银行应当是具有证券投资基金托管人资格、证券投资基金销售业务资格或合格境外机构投资者托管人资格的商业银行；</p> <p>(4) 本基金存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款，不得超过基金资产净值的 30%；存放在不具有基金托管资格的同一商业银行的存款，不得超过基金资产净值的 5%；</p> <p>(5) 本基金通过买断式回购融入的基础债券的剩余期限不得超过 397 天；</p> <p>(6) 在全国银行间同业市场的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到</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，对基金投资比例进行监督。</p> <p>2、本基金投资组合遵循以下投资限制：</p> <p>(1) 当货币市场基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 50% 时，货币市场基金投资组合的平均剩余期限不得超过 60 天，平均剩余存续期不得超过 120 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 30%；当货币市场基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 20% 时，货币市场基金投资组合的平均剩余期限不得超过 90 天，平均剩余存续期不得超过 180 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 20%；</p> <p>(2) 本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日都不得超过 120 天，但前述第 (1) 项另有约定的除外；</p> <p>(3) 本基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的</p>

<p>期后不得展期；</p> <p>(7) 本基金持有的剩余期限不超过 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本总计不得超过当日基金资产净值的 20%。本基金不得投资于以定期存款利率为基准利率的浮动利率债券；</p> <p>(8) 本基金投资于同一公司发行的短期融资券及短期企业债券的比例，合计不得超过基金资产净值的 10%；</p> <p>(9) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；</p> <p>(10) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；</p> <p>(11) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；基金管理人管理的全部证券投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；</p> <p>(12) 本基金投资的资产支持证券须具有评级资质的资信评级机构进行持续信用评级。本基金投资的资产支持证券不得低于国内信用评级机构评定的 AAA 级或相当于 AAA 级的信用级别。本基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降且不再符合投资标准，本基金应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；</p> <p>(13) 除发生巨额赎回情形外，本基金债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%。因发生巨额赎回导致债券正回购的资金余额超过基金资产净值 20% 的，基金管理人应在 5 个工作日内进行调整；</p> <p>(14) 本基金投资的短期融资券的信用评级应不低于以下标准：</p> <p>1) 国内信用评级机构评定的 A-1 级或相当于 A-1 级的短期信用级别；</p> <p>2) 根据有关规定予以豁免信用评级的短期融资券，其发行人最近 3 年的信用评级和跟踪评级具备下列条件之一：</p> <p>i. 国内信用评级机构评定的 AAA 级或相当于 AAA 级的长期信用级别；</p> <p>ii. 国际信用评级机构评定的低</p>	<p>证券，不得超过该证券的 10%；</p> <p>(4) 本基金投资于主体信用评级低于 AAA 的机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 10%，其中单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 2%。前述金融工具包括债券、短期融资券、中期票据、银行存款、同业存单、相关机构作为原始权益人的资产支持证券及中国证监会认定的其他品种；且本基金投资于主体信用评级低于 AA+ 的商业银行的银行存款与同业存单的，应当经基金管理人董事会审议批准，相关交易应当事先征得基金托管人的同意，并作为重大事件履行信息披露程序；</p> <p>(5) 本基金管理人管理的全部货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券，不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的 10%；</p> <p>(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的 10%；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该项所规定的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>(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投资范围保持一致；</p> <p>(8) 本基金投资于定期存款的比例不得超过基金资产净值的 30%（有存款期限，但根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款，可不受此限制）。本基金的存款银行应当是具有证券投资基金托管人资格、证券投资基金销售业务资格或合格境外机构投资者托管人资格的商业银行；</p> <p>(9) 本基金存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款，不得超过基金资产净值的 30%；存放在不具有基金托管资格的同一商业银行的存款，不得超过基金资产净值的 5%；</p> <p>(10) 本基金通过买断式回购融入的基础债券的剩余期限不得超过 397 天；</p>
---	--

	<p>于中国主权评级一个级别的信用级别。同一发行人同时具有国内信用评级和国际信用评级的，以国内信用级别为准。本基金持有短期融资券期间，如果其信用等级下降且不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起20个交易日内予以全部减持；</p> <p>(15) 法律法规或监管部门对上述比例、限制另有规定的，从其规定。</p> <p>除上述(12)、(13)、(14)项外，由于证券市场波动、债券发行人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。法律法规另有规定的，从其规定。</p>	<p>(11)在全国银行间同业市场的债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；</p> <p>(12)本基金持有的剩余期限不超过397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本总计不得超过当日基金资产净值的20%。本基金不得投资于以定期存款利率为基准利率的浮动利率债券；</p> <p>(13)本基金投资于同一公司发行的短期融资券及短期企业债券的比例，合计不得超过基金资产净值的10%；</p> <p>(14)本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；</p> <p>(15)本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；</p> <p>(16)本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的10%；基金管理人管理的全部证券投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；</p> <p>(17)本基金投资的资产支持证券须具有评级资质的资信评级机构进行持续信用评级。本基金投资的资产支持证券不得低于国内信用评级机构评定的AAA级或相当于AAA级的信用级别。本基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降且不再符合投资标准，本基金应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；</p> <p>(18)除发生巨额赎回情形外，本基金债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的20%。因发生巨额赎回导致债券正回购的资金余额超过基金资产净值20%的，基金管理人应在5个交易日内进行调整；</p> <p>(19)本基金投资的短期融资券的信用评级应不低于以下标准：</p> <p>1) 国内信用评级机构评定的A-1级或相当于A-1级的短期信用级别；</p> <p>2) 根据有关规定予以豁免信用评级的短期融资券，其发行人最近3年的信用评级和跟踪评级具备下列</p>
--	---	--

		<p>条件之一：</p> <p>i. 国内信用评级机构评定的AAA级或相当于AAA级的长期信用级别；</p> <p>ii. 国际信用评级机构评定的低于中国主权评级一个级别的信用级别。同一发行人同时具有国内信用评级和国际信用评级的，以国内信用级别为准。本基金持有短期融资券期间，如果其信用等级下降且不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起20个交易日内予以全部减持；</p> <p>(20)法律法规或监管部门对上述比例、限制另有规定的，从其规定。</p> <p>除上述(2)、(6)、(7)、(17)、(18)、(19)项外，由于证券市场波动、债券发行人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。法律法规另有规定的，从其规定。</p> <p>基金管理人应当在每个交易日10:00前将货币市场基金前一交易日前10名基金份额持有人合计持有比例等信息报送基金托管人，基金托管人依法履行投资监督职责。</p>
<p>八、基金资产净值计算和会计核算</p>	<p>(四)可以暂停估值的情形</p> <p>1. 基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</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资产价值时；</p> <p>3. 中国证监会和基金合同认定的其它情形。</p>	<p>(四)可以暂停估值的情形</p> <p>1. 基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</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资产价值时；</p> <p>3. 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时，经与基金托管人协商确认后，应当暂停估值；</p> <p>4. 中国证监会和基金合同认定的其它情形。</p>
<p>八、基金资产净值计算和会计核算</p>	<p>(七)基金定期报告的编制和复核</p>	<p>(七)基金定期报告的编制和复核</p> <p>增加：</p> <p>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。</p> <p>本基金应当在年度报告、半年度报告中，至少披露报告期末基金前10名份额持有人的类别、持有份额及占总份额的比例等信息。</p>

		<p>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例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文件中“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本基金的特定风险,中国证监会认定的特殊情形除外。</p>
十、基金信息披露	<p>(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</p> <p>1. 职责</p> <p>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:</p> <p>(1) 不可抗力;</p> <p>(2) 基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;</p> <p>(3) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的情况。</p>	<p>(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</p> <p>1. 职责</p> <p>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:</p> <p>(1) 不可抗力;</p> <p>(2) 基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;</p> <p>(3) 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时,经与基金托管人协商确认后暂停估值;</p> <p>(4) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的情况。</p>

关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改基金合同、托管协议的内容说明

景顺长城领先回报灵活配置混合型证券投资基金

一、基金合同修改内容

章节	修订前	修订后
第一部分 前言	<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</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</p>

	“《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。	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。
第二部分 释义		<p>增加:</p> <p>54、《流动性风险管理规定》: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</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>56、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>
第六部分 基金份额的申购与赎回	五、申购和赎回的数量限制	<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>增加:</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。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。具体请参见相关公告。</p>
第六部分 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>4、赎回金额的计算及处理方式:本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定,并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘</p>	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>4、赎回金额的计算及处理方式:本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定,并在招募说明书中列示,对于持续持有期少于7日的投资者,本</p>

	以当日基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入的方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。	基金将收取不低于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入的方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。
第六部分 基金份额 的申购与 赎回		增加： 9、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，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、自律组织的规定。
第六部分 基金份额 的申购与 赎回	七、拒绝或暂停申购的情形 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，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。	七、拒绝或暂停申购的情形 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，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受申购申请。
第六部分 基金份额 的申购与 赎回		增加： 6、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。
第六部分 基金份额 的申购与 赎回	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全部或部分拒绝的，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。	发生上述情形之一（除第 4、6 项外）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全部或部分拒绝的，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。
第六部分 基金份额 的申购与 赎回	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 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，基金管理人可暂停	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 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，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。	停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项。
第六部分 基金份额的申购与赎回		<p>九、巨额赎回的情形及处理方式增加：</p> <p>(3) 如果基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额 20%以上的赎回申请的情形下，基金管理人可以对该基金份额持有人超过 20%以上的部分延期办理赎回申请。对于当日非延期的赎回申请，应当按单个账户非延期赎回申请量占非延期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。</p>
第七部分 基金合同当事人及权利义务	<p>一、基金管理人</p> <p>(一) 基金管理人简况 法定代表人：赵如冰</p>	<p>一、基金管理人</p> <p>(一) 基金管理人简况 法定代表人：杨光裕</p>
第七部分 基金合同当事人及权利义务	<p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况 名称：兴业银行股份有限公司 住所：福州市湖东路 154 号 法定代表人：高建平 成立时间：1988 年 8 月 26 日 批准设立机关和批准设立文号：中国人民银行福建省分行闽银 1988 第[271]号 组织形式：股份有限公司 注册资本：190.52 亿元人民币 存续期间：持续经营 基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字[2005]74 号</p>	<p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况 名称：兴业银行股份有限公司 住所：福州市湖东路 154 号 法定代表人：高建平 成立时间：1988 年 8 月 26 日 批准设立机关和批准设立文号：中国人民银行福建省分行闽银 1988 第[271]号 组织形式：股份有限公司 <u>注册资本：207.74 亿元人民币</u> 存续期间：持续经营 基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字[2005]74 号</p>

第十二部分 基金的投资	<p>二、投资范围</p> <p>本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范围为0-95%。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>二、投资范围</p> <p>本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范围为0-95%。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、存出保证金和应收申购款等。</p>
第十二部分 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>(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>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>(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、存出保证金和应收申购款等；</p>
第十二部分 基金的投资		<p>增加：</p> <p>(12) 本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不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，不超过该上市公司可流通股票的30%；</p> <p>(13) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的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项所规定的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>(14) 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投资范围保持一致；</p>
第十二部分 基金的投资	<p>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。法律法规另有规定，从其规定。</p>	<p>除上述第(2)、(13)、(14)、(15)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。法律法规另有规定，从其规定。</p>

第十四部分 基金资产估值	三、估值方法	<p>三、估值方法 增加： 3、流通受限股票，指在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时股票公司公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。 8、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。</p>
第十四部分 基金资产估值	六、暂停估值的情形	<p>六、暂停估值的情形 增加： 3、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时，经与基金托管人协商确认后，应当暂停估值；</p>
第十四部分 基金资产估值	<p>八、特殊情况的处理 1、基金管理人或基金托管人按本基金合同规定的估值方法的第 7 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。</p>	<p>八、特殊情况的处理 1、基金管理人或基金托管人按本基金合同规定的估值方法的第 9 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。</p>
第十八部分 基金的信息披露	<p>(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</p>	<p>(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 增加： 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基金份额比例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文件中“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本基金的特定风险，中国证监会认定的特殊情形除外。</p>
第十八部分 基金的信息披露		<p>(七) 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； 27、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；</p>
第二十四		摘要部分也做了相应修改，与合

部分基金合同内容摘要	同修订内容保持一致。
------------	------------

二、 托管协议修改内容

章节	修订前	修订后
一、基金托管协议当事人	(一) 基金管理人 法定代表人：赵如冰	(一) 基金管理人 法定代表人：杨光裕
一、基金托管协议当事人	(二) 基金托管人 名称：兴业银行股份有限公司 注册地址：福州市湖东路154号 办公地址：上海市江宁路168号 法定代表人：高建平 成立日期：1988年8月26日 基金托管业务批准文号：证监基金字[2005]74号 组织形式：股份有限公司 注册资本：190.52亿元人民币 存续期间：持续经营 经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付；承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；代理发行股票以外的有价证券；买卖、代理买卖股票以外的有价证券；资产托管业务；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；结汇、售汇业务；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；财务顾问、资信调查、咨询、见证业务；经中国银行业监督管理委员会批准的其他业务（以上范围凡涉及国家专项专营规定的从其规定）。	(二) 基金托管人 名称：兴业银行股份有限公司 注册地址：福州市湖东路154号 办公地址：上海市江宁路168号 法定代表人：高建平 成立日期：1988年8月26日 基金托管业务批准文号：证监基金字[2005]74号 组织形式：股份有限公司 注册资本：207.74亿元人民币 存续期间：持续经营 经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付；承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；代理发行股票以外的有价证券；买卖、代理买卖股票以外的有价证券；资产托管业务；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；结汇、售汇业务；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；财务顾问、资信调查、咨询、见证业务；经中国银行业监督管理委员会批准的其他业务（以上范围凡涉及国家专项专营规定的从其规定）。
二、基金托管协议的依据、目的、原则	(一) 订立托管协议的依据 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。	(一) 订立托管协议的依据 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》等有关法律法规、基金合

		同及其他有关规定制订。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	<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、融资比例进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的, 基金管理人应事先向基金托管人提供投资品种池, 以便基金托管人对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督。</p> <p>本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范围为 0-95%。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>(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。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的, 基金管理人应事先向基金托管人提供投资品种池, 以便基金托管人对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督。</p> <p>本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范围为 0-95%。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、存出保证金和应收申购款等。</p>
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	<p>本基金投资组合遵循以下投资限制:</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>本基金投资组合遵循以下投资限制:</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、存出保证金和应收申购款等;</p>
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查		<p>(12) 本基金管理人管理的全部开放式基金 (包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金) 持有一家上市公司发行的可流通股票, 不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, 不超过该上市公司可流通股票的 30%;</p> <p>(13) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 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项所规定的比例限制的, 基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;</p> <p>(14) 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投资范围保持一致;</p>
三、基金托管人对	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	除上述第(2)、(13)、(14)、(15)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

基金管理人的业务监督和核查	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 个工作日内进行调整，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。	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 个工作日内进行调整，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	<p>(五) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资流通受限证券进行监督。</p> <p>2. 流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>	<p>(五) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资流通受限证券进行监督。</p> <p>2. 本基金投资的流通受限证券与上文流动性受限资产不同，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>
八、基金资产净值计算和会计核算	<p>(二) 基金资产估值方法和特殊情形的处理</p>	<p>(二) 基金资产估值方法和特殊情形的处理</p> <p>增加：</p> <p>(3) 流通受限股票，指在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时股票公司公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p> <p>(8) 当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。</p>
八、基金资产净值计算和会计核算		<p>(四) 暂停估值与公告基金份额净值的情形</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一致后，应当暂停估值；</p>
十、基金信息披露	<p>(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</p> <p>1. 职责</p> <p>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：</p> <p>(1) 不可抗力；</p> <p>(2) 基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</p>	<p>(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</p> <p>1. 职责</p> <p>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：</p> <p>(1) 不可抗力；</p> <p>(2) 基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因</p>

	(3) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的情况。	暂停营业时； (3) 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时，经与基金托管人协商确认后暂停估值； (4) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的情况。
--	---------------------------	---

关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改基金合同、托管协议的内容说明

景顺长城安享回报灵活配置混合型证券投资基金

一、 基金合同修改内容

章节	修订前	修订后
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》”)、《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》”)、《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。
第二部分 释义		增加： 54、《流动性风险管理规定》：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 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

		<p>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>56、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>
第六部分 基金份额 的申购与 赎回	五、申购和赎回的数量限制	<p>五、申购和赎回的数量限制增加：</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。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。具体请参见相关公告。</p>
第六部分 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>4、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日某类别基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入的方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p>	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>4、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示，对于持续持有期少于7日的投资者，本基金将收取不低于1.5%的赎回费并全额计入基金财产。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日某类别基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入的方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p>
第六部分 基金份额 的申购与 赎回		<p>增加：</p> <p>9、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，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、自律组织的规定。</p>
第六部分 基金份额	七、拒绝或暂停申购的情形 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：	七、拒绝或暂停申购的情形 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：

<p>的申购与赎回</p>	<p>1、因不可抗力导致基金无法正常运作。</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。</p> <p>3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</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>5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人利益的情形。</p> <p>6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</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申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体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>1、因不可抗力导致基金无法正常运作。</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受申购申请。</p> <p>3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</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>5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人利益的情形。</p> <p>6、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。</p> <p>7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述情形之一（除第 4、6 项外）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体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，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>1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，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>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>1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，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。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</p>

		致公允价值存在重大不确定性，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项。
第六部分 基金份额 的申购与 赎回		<p>九、巨额赎回的情形及处理方式增加：</p> <p>(3) 如果基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额 20%以上的赎回申请的情形下，基金管理人可以对该基金份额持有人超过 20%以上的部分延期办理赎回申请。对于当日非延期的赎回申请，应当按单个账户非延期赎回申请量占非延期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。</p>
第七部分 基金合同 当事人及 权利义务	<p>一、基金管理人</p> <p>(一) 基金管理人简况 法定代表人：赵如冰</p>	<p>一、基金管理人</p> <p>(一) 基金管理人简况 法定代表人：杨光裕</p>
第七部分 基金合同 当事人及 权利义务	<p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况 名称：兴业银行股份有限公司 住所：福州市湖东路 154 号 法定代表人：高建平 成立时间：1988 年 8 月 26 日 批准设立机关和批准设立文号： 中国人民银行福建省分行闽银 1988 第[271]号</p> <p>组织形式：股份有限公司 注册资本：190.52 亿元人民币 存续期间：持续经营 基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字[2005]74 号</p>	<p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况 名称：兴业银行股份有限公司 住所：福州市湖东路 154 号 法定代表人：高建平 成立时间：1988 年 8 月 26 日 批准设立机关和批准设立文号： 中国人民银行福建省分行闽银 1988 第[271]号</p> <p>组织形式：股份有限公司 注册资本：207.74 亿元人民币 存续期间：持续经营 基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字[2005]74 号</p>
第十二部分 基金 的投资	<p>二、投资范围</p> <p>本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范围为 0-95%。本基金每个交易日日终在扣除</p>	<p>二、投资范围</p> <p>本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范围为 0-95%。本基金每个交易日日终在</p>

	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。	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、存出保证金和应收申购款等。
第十二部分 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>(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>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>(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、存出保证金和应收申购款等；</p>
第十二部分 基金的投资		<p>增加：</p> <p>(12) 本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不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，不超过该上市公司可流通股票的 30%；</p> <p>(13) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 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项所规定的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>(14) 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投资范围保持一致；</p>
第十二部分 基金的投资	因证券、期货市场波动、上市公司合并、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，从其规定。	除上述第(2)、(13)、(14)、(15)项外，因证券、期货市场波动、上市公司合并、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，从其规定。
第十四部分 基金资产估值	三、估值方法	<p>三、估值方法</p> <p>增加：</p> <p>3、流通受限股票，指在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发</p>

		<p>行时股票公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p> <p>8、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。</p>
第十四部分 基金资产估值	六、暂停估值的情形	<p>六、暂停估值的情形</p> <p>增加：</p> <p>3、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时，经与基金托管人协商确认后，应当暂停估值；</p>
第十四部分 基金资产估值	<p>八、特殊情况的处理</p> <p>1、基金管理人或基金托管人按本基金合同规定的估值方法的第 7 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。</p>	<p>八、特殊情况的处理</p> <p>1、基金管理人或基金托管人按本基金合同规定的估值方法的第 9 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。</p>
第十八部分 基金的信息披露	(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	<p>(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</p> <p>增加：</p> <p>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。</p> <p>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例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文件中“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本基金的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。</p>
第十八部分 基金的信息披露		<p>(七) 临时报告</p> <p>增加：</p> <p>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；</p> <p>27、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；</p>
第二十四部分 基金合同内容摘要		<p>摘要部分也做了相应修改，与合同修订内容保持一致。</p>

二、 托管协议修改内容

章节	修订前	修订后
一、基金托管协议当事人	(一) 基金管理人 法定代表人：赵如冰	(一) 基金管理人 法定代表人：杨光裕
一、基金托管协议当事人	(二) 基金托管人 名称：兴业银行股份有限公司 注册地址：福州市湖东路 154 号 办公地址：上海市江宁路 168 号 法定代表人：高建平 成立日期：1988 年 8 月 26 日 基金托管业务批准文号：证监基金字[2005]74 号 组织形式：股份有限公司 注册资本：190.52 亿元人民币 存续期间：持续经营 经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付；承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；代理发行股票以外的有价证券；买卖、代理买卖股票以外的有价证券；资产托管业务；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；结汇、售汇业务；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；财务顾问、资信调查、咨询、见证业务；经中国银行业监督管理委员会批准的其他业务（以上范围凡涉及国家专项专营规定的从其规定）。	(二) 基金托管人 名称：兴业银行股份有限公司 注册地址：福州市湖东路 154 号 办公地址：上海市江宁路 168 号 法定代表人：高建平 成立日期：1988 年 8 月 26 日 基金托管业务批准文号：证监基金字[2005]74 号 组织形式：股份有限公司 注册资本：207.74 亿元人民币 存续期间：持续经营 经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付；承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；代理发行股票以外的有价证券；买卖、代理买卖股票以外的有价证券；资产托管业务；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；结汇、售汇业务；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；财务顾问、资信调查、咨询、见证业务；经中国银行业监督管理委员会批准的其他业务（以上范围凡涉及国家专项专营规定的从其规定）。
二、基金托管协议的依据、目的、原则	(一) 订立托管协议的依据 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》”）等有关法律法规、基金合同及其他有关规定制订。	(一) 订立托管协议的依据 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》”）、《公开募集开放式证券投资基金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。
三、基金托管人对基金管理人的业务	(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。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应事先向基金托	(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。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应事先向基金

<p>监督和核查</p>	<p>管人提供投资品种池，以便基金托管人对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督。</p> <p>本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范围为0-95%。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>托管人提供投资品种池，以便基金托管人对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督。</p> <p>本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范围为0-95%。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、存出保证金和应收申购款等。</p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>	<p>本基金投资组合遵循以下投资限制： （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>本基金投资组合遵循以下投资限制： （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、存出保证金和应收申购款等；</p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>		<p>增加：</p> <p>（12）本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不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，不超过该上市公司可流通股票的30%；</p> <p>（13）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的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项所规定的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>（14）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投资范围保持一致；</p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>	<p>因证券、期货市场波动、上市公司合并、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。</p>	<p>除上述第（2）、（13）、（14）、（15）项外，因证券、期货市场波动、上市公司合并、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。</p>

<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>	<p>(五) 基金托管人根据有关法律、法规的规定及基金合同的约定, 对基金投资流通受限证券进行监督。</p> <p>2. 流通受限证券, 包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券, 不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>	<p>(五) 基金托管人根据有关法律、法规的规定及基金合同的约定, 对基金投资流通受限证券进行监督。</p> <p>2. 本基金投资的流通受限证券与上文流动性受限资产不同, 包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券, 不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>
<p>八、基金资产净值计算和会计核算</p>	<p>(二) 基金资产估值方法和特殊情形的处理</p>	<p>(二) 基金资产估值方法和特殊情形的处理</p> <p>增加:</p> <p>(3) 流通受限股票, 指在发行时明确一定期限限售期的股票, 包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时股票公司公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等, 按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p> <p>(8) 当发生大额申购或赎回情形时, 在履行适当程序后, 基金管理人可以采用摆动定价机制, 以确保基金估值的公平性。</p>
<p>八、基金资产净值计算和会计核算</p>	<p>(四) 暂停估值与公告基金份额净值的情形</p>	<p>(四) 暂停估值与公告基金份额净值的情形</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一致后, 应当暂停估值;</p>
<p>十、基金信息披露</p>	<p>(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</p> <p>1. 职责</p> <p>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:</p> <p>(1) 不可抗力;</p> <p>(2) 基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;</p> <p>(3) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的情况。</p>	<p>(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</p> <p>1. 职责</p> <p>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:</p> <p>(1) 不可抗力;</p> <p>(2) 基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;</p> <p>(3) 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时, 经与基金托管人协商确认后暂停估值;</p>

	(4) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的情况。
--	---------------------------

关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改基金合同、托管协议的内容说明

景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金

一、 基金合同修改内容

章节	修订前	修订后
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》”)、《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》”)、《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。
第二部分 释义		<p>增加：</p> <p>53、《流动性风险管理规定》：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</p> <p>54、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>55、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</p>

		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
第六部分 基金份额 的申购与 赎回	<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>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,具体规定请参见招募说明书或相关公告。</p> <p>4、基金管理人可在法律法规允许的情况下,调整上述规定申购金额和赎回份额等数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。</p>	<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>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,具体规定请参见招募说明书或相关公告。</p> <p>4、基金管理人可在法律法规允许的情况下,调整上述规定申购金额和赎回份额等数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。</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。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。具体请参见相关公告。</p>
第六部分 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>3、赎回金额的计算及处理方式:本基金赎回金额的计算详见招募说明书,赎回金额单位为元。本基金的赎回费率由基金管理人决定,并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用,赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入的方法,保留到小数点后两位,由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p>	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>3、赎回金额的计算及处理方式:本基金赎回金额的计算详见招募说明书,赎回金额单位为元。本基金的赎回费率由基金管理人决定,并在招募说明书中列示,对于持续持有期少于7日的投资者,本基金将收取不低于1.5%的赎回费并全额计入基金财产。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用,赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入的方法,保留到小数点后两位,由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p>
第六部分		<p>增加:</p> <p>8、当发生大额申购或赎回情形</p>

<p>基金份额的申购与赎回</p>		<p>时,在履行适当程序后,基金管理人可以采用摆动定价机制,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、自律组织的规定。</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 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: 1、因不可抗力导致基金无法正常运作。 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时,基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。 3、证券、期货交易所交易时间非正常停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。 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。 5、基金资产规模过大,使基金管理人无法找到合适的投资品种,或其他可能对基金业绩产生负面影响,或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形。 6、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。 7、指数编制单位或指数发布机构因异常情况使指数数据无法正常计算、计算错误或发布异常时。 8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第1、2、3、5、6、7、8项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>七、拒绝或暂停申购的情形 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: 1、因不可抗力导致基金无法正常运作。 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时,基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。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,经与基金托管人协商确定后,基金管理人应当暂停接受申购申请。 3、证券、期货交易所交易时间非正常停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。 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。 5、基金资产规模过大,使基金管理人无法找到合适的投资品种,或其他可能对基金业绩产生负面影响,或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形。 6、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。 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%,或者变相规避50%集中度的情形时。 8、指数编制单位或指数发布机构因异常情况使指数数据无法正常计算、计算错误或发布异常时。 9、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述暂停申购情形之一(除第4、7项外)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全部或</p>

		部分拒绝的,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。
第六部分 基金份额 的申购与 赎回	<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>1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时,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>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>1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时,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。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,经与基金托管人协商确定后,基金管理人应当暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项。</p>
第六部分 基金份额 的申购与 赎回		<p>九、巨额赎回的情形及处理方式增加:</p> <p>(3) 如果基金发生巨额赎回,在单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额 20%以上的赎回申请的情形下,基金管理人可以对该基金份额持有人超过 20%以上的部分延期办理赎回申请。对于当日非延期的赎回申请,应当按单个账户非延期赎回申请量占非延期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。</p>
第七部分 基金合同 当事人及 权利义务	<p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况</p> <p>名称: 上海浦东发展银行股份有限公司</p> <p>住所: 上海市中山东一路 12 号</p> <p>法定代表人: 吉晓辉</p>	<p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况</p> <p>名称: 上海浦东发展银行股份有限公司</p> <p>住所: 上海市中山东一路 12 号</p> <p>法定代表人: 高国富</p>

	<p>成立时间：1992年10月19日 批准设立机关和批准设立文号：中国人民银行银复1992（601）号 组织形式：股份有限公司 注册资本：人民币186.5347亿元 存续期间：永久存续 基金托管资格批文及文号：证监基金字[2003]105号</p>	<p>成立时间：1992年10月19日 批准设立机关和批准设立文号：中国人民银行银复1992（601）号 组织形式：股份有限公司 注册资本：293.52亿元人民币 存续期间：永久存续 基金托管资格批文及文号：证监基金字[2003]105号</p>
第十二部分 基金的投资	<p>二、投资范围</p> <p>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以标的指数成份股及其备选成份股为主要投资对象。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于国内依法上市的非成份股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、银行存款、同业存单、债券、债券回购、权证、股指期货、中小企业私募债券、资产支持证券、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p> <p>本基金的股票资产投资比例不得低于基金资产的90%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%；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，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、投资范围</p> <p>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以标的指数成份股及其备选成份股为主要投资对象。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于国内依法上市的非成份股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、银行存款、同业存单、债券、债券回购、权证、股指期货、中小企业私募债券、资产支持证券、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p> <p>本基金的股票资产投资比例不得低于基金资产的90%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%；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，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、存出保证金和应收申购款等。</p>
第十二部分 基金的投资	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金管理人主要按照标的指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金的股票资产投资比例不得低于基金资产的90%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%；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，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>1、资产配置策略</p> <p>本基金管理人主要按照标的指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金的股票资产投资比例不得低于基金资产的90%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%；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，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、存出保证金和应收申购款等。</p>

第十二部分 基金的投资	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(2)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,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>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(2)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,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、存出保证金和应收申购款等;</p>
第十二部分 基金的投资		<p>增加:</p> <p>(10)本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的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该项所规定的比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;</p> <p>(11)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投资范围保持一致;</p>
第十二部分 基金的投资	<p>因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制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。</p>	<p>除上述第(2)、(10)、(11)、(12)外,因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制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。</p>
第十四部分 基金资产估值	<p>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:</p> <p>(5)首次公开发行有明确锁定期的股票,同一股票在交易所上市后,按交易所上市的同一股票的估值方法估值;非公开发行有明确锁定期的股票,按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>	<p>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:</p> <p>(5)流通受限的股票,包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等(不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票),按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>
第十四部分 基金资产估值		<p>三、估值方法</p> <p>增加:</p> <p>8、当发生大额申购或赎回情形时,在履行适当程序后,基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。</p>
第十四部分 基金		<p>六、暂停估值的情形</p> <p>增加:</p>

资产估值		5、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时,经与基金托管人协商确认后,应当暂停估值;
第十四部分 基金资产估值	八、特殊情况的处理 1、基金管理人或基金托管人按本基金合同规定的估值方法的第8项进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。	八、特殊情况的处理 1、基金管理人或基金托管人按本基金合同规定的估值方法的第9项进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。
第十八部分 基金的信息披露	<p>(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</p> <p>基金管理人应当在每年结束之日起90日内,编制完成基金年度报告,并将年度报告正文登载于其网站上,将年度报告摘要登载在指定媒介上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。</p> <p>基金管理人应当在上半年结束之日起60日内,编制完成基金半年度报告,并将半年度报告正文登载在其网站上,将半年度报告摘要登载在指定媒介上。</p> <p>基金管理人应当在每个季度结束之日起15个工作日内,编制完成基金季度报告,并将季度报告登载在指定媒介上。</p> <p>《基金合同》生效不足2个月的,基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。</p> <p>基金定期报告在公开披露的第2个工作日,分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。</p>	<p>(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</p> <p>基金管理人应当在每年结束之日起90日内,编制完成基金年度报告,并将年度报告正文登载于其网站上,将年度报告摘要登载在指定媒介上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。</p> <p>基金管理人应当在上半年结束之日起60日内,编制完成基金半年度报告,并将半年度报告正文登载在其网站上,将半年度报告摘要登载在指定媒介上。</p> <p>基金管理人应当在每个季度结束之日起15个工作日内,编制完成基金季度报告,并将季度报告登载在指定媒介上。</p> <p>《基金合同》生效不足2个月的,基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。</p> <p>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。</p> <p>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例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文件中“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本基金的特定风险,中国证监会认定的特殊情形除外。</p> <p>基金定期报告在公开披露的第2个工作日,分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。</p>
第十八部		(七)临时报告 增加:

分基金的信息披露		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； 27、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；
第二十四部分基金合同内容摘要		对应基金合同正文内容进行同步修改。

二、 托管协议修订内容

章节	修订前	修订后
	<p>基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司 办公地址：上海市中山东一路12号 法定代表人：吉晓辉 成立日期：1992年10月19日 基金托管业务资格批准机关：中国证监会 基金托管业务资格文号：证监基金字[2003]105号 组织形式：股份有限公司（上市） 注册资本：人民币186.5347亿元 经营期限：永久存续</p>	<p>基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司 办公地址：上海市中山东一路12号 法定代表人：高国富 成立日期：1992年10月19日 基金托管业务资格批准机关：中国证监会 基金托管业务资格文号：证监基金字[2003]105号 组织形式：股份有限公司（上市） 注册资本：293.52亿元人民币 经营期限：永久存续</p>
一、基金托管协议的依据、目的、原则和解释	<p>（一）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》）、《证券投资基金托管业务管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第7号〈托管协议的内容与格式〉》、《景顺长城中证500行业中性低波动指数型证券投资基金基金合同》（以下简称《基金合同》）及其他有关法律、法规制定。</p>	<p>（一）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》）、《证券投资基金托管业务管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第7号〈托管协议的内容与格式〉》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》、《景顺长城中证500行业中性低波动指数型证券投资基金基金合同》（以下简称《基金合同》）及其他有关法律、法规制定。</p>
二、基金托管人对基金管理人的业务	<p>（1）按法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金的投资资产配置比例为： 本基金的股票资产投资比例不得低于基金资产的90%，其中投资于标</p>	<p>（1）按法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金的投资资产配置比例为： 本基金的股票资产投资比例不得低于基金资产的90%，其中投资于</p>

<p>监督和核查</p>	<p>的指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；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，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>(2) 根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金投资组合遵循以下投资限制：</p> <p>1) 本基金的股票资产投资比例不得低于基金资产的 90%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；</p> <p>2) 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，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>标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；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，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、存出保证金和应收申购款等。</p> <p>(2)根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金投资组合遵循以下投资限制：</p> <p>1)本基金的股票资产投资比例不得低于基金资产的 90%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；</p> <p>2)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，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、存出保证金和应收申购款等；</p>
<p>二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>		<p>增加：</p> <p>10)本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 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该项所规定的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>11)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投资范围保持一致；</p>
<p>二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>	<p>因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制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。</p>	<p>除前述第 2)、10)、11)、12)项外，因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制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。</p>
<p>二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核</p>	<p>7. 基金托管人对基金投资流通受限证券的监督</p> <p>基金管理人投资流通受限证券，应事先根据中国证监会相关规定，明确基金投资流通受限证券的比例，制订严格的投资决策流程和风险控制制</p>	<p>7. 基金托管人对基金投资流通受限证券的监督</p> <p>基金管理人投资流通受限证券，应事先根据中国证监会相关规定，明确基金投资流通受限证券的比例，制订严格的投资决策流程和风险控制</p>

查	<p>度, 防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。基金托管人对基金管理人是否遵守相关制度、流动性风险处置预案以及相关投资额度和比例等的情况进行监督。</p> <p>(1) 本基金投资的流通受限证券须为经中国证监会批准的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券, 不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。本基金不投资有锁定期但锁定期不明确的证券。</p>	<p>制度, 防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。基金托管人对基金管理人是否遵守相关制度、流动性风险处置预案以及相关投资额度和比例等的情况进行监督。</p> <p>(1) 本基金投资的流通受限证券与上文所述流动性受限资产并不完全一致, 须为经中国证监会批准的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券, 不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。本基金不投资有锁定期但锁定期不明确的证券。</p>
七、基金资产净值计算和会计核算	<p>(2) 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:</p> <p>⑤首次公开发行有明确锁定期的股票, 同一股票在交易所上市后, 按交易所上市的同一股票的估值方法估值; 非公开发行有明确锁定期的股票, 按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>	<p>(2) 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:</p> <p>⑤流通受限的股票, 包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等 (不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票), 按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>
七、基金资产净值计算和会计核算		<p>2. 估值方法 增加:</p> <p>(8) 当发生大额申购或赎回情形时, 在履行适当程序后, 基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。</p>
七、基金资产净值计算和会计核算	<p>3. 特殊情况的处理</p> <p>(1) 基金管理人或基金托管人按本基金合同规定的估值方法的第 8 项进行估值时, 所造成的误差不得作为基金资产估值错误处理。</p>	<p>3. 特殊情况的处理</p> <p>(1) 基金管理人或基金托管人按本基金合同规定的估值方法的第 (9) 项进行估值时, 所造成的误差不得作为基金资产估值错误处理。</p>
七、基金资产净值计算和会计核算		<p>(四) 暂停估值与公告基金份额净值的情形 增加:</p> <p>5、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时, 经与基金托管人协商确认后, 应当暂停估值;</p>
九、信息披露		<p>4、暂停或延迟披露基金相关信息的情形 增加:</p> <p>(4) 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</p>

		允价值存在重大不确定时, 经与基金托管人协商确认后暂停估值;
--	--	--------------------------------

关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改基金合同、托管协议的内容说明

景顺长城景颐盛利债券型证券投资基金

一、 基金合同修改内容

章节	修订前	修订后
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》”)、《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》”)、《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。
第二部分 释义		<p>增加:</p> <p>54、《流动性风险管理规定》: 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</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>56、摆动定价机制: 指当开放式</p>

		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
第六部分 基金份额 的申购与 赎回	<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>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,具体规定请参见招募说明书或相关公告。</p> <p>4、基金管理人可在法律法规允许的情况下,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实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。</p>	<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>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,具体规定请参见招募说明书或相关公告。</p> <p>4、基金管理人可在法律法规允许的情况下,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实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。</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。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。具体请参见相关公告。</p>
第六部分 基金份额 的申购、 赎回	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>4、赎回金额的计算及处理方式:本基金赎回金额的计算详见《招募说明书》。本基金的赎回费率由基金管理人决定,并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额的基金份额净值并扣除相应的费用,赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入的方法,保留到小数点后两位,由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p>	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>4、赎回金额的计算及处理方式:本基金赎回金额的计算详见《招募说明书》。本基金的赎回费率由基金管理人决定,并在招募说明书中列示,对于持续持有期少于7日的投资者,本基金将收取不低于1.5%的赎回费并全额计入基金财产。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额的基金份额净值并扣除相应的费用,赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入的方法,保留到小数点后两位,由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p>

第六部分 基金份额 的申购、 赎回		增加： 9、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，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、自律组织的规定。
第六部分 基金份额 的申购、 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：</p> <p>1、因不可抗力导致基金无法正常运作。</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。</p> <p>3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</p> <p>4、基金管理人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>5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或其他损害现有基金份额持有人利益的情形。</p> <p>6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</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>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：</p> <p>1、因不可抗力导致基金无法正常运作。</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受申购申请。</p> <p>3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</p> <p>4、基金管理人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>5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或其他损害现有基金份额持有人利益的情形。</p> <p>6、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。</p> <p>7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述暂停申购情形之一（除第 4、6 项外）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全部或部分拒绝的，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>
第六部分 基金份额	<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</p>	<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</p>

<p>的申购、赎回</p>	<p>暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项： 1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，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>暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项： 1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，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。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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项。</p>
<p>第六部分 基金份额的申购、赎回</p>		<p>九、巨额赎回的情形及处理方式增加： (3) 如果基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额 20%以上的赎回申请的情形下，基金管理人可以对该基金份额持有人超过 20%以上的部分延期办理赎回申请。对于当日非延期的赎回申请，应当按单个账户非延期赎回申请量占非延期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。</p>
<p>第七部分 基金合同当事人及权利义务</p>	<p>二、基金托管人 (一) 基金托管人简况 基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司 办公地址：上海市黄浦区中山东一路12号 法定代表人：吉晓辉 成立日期：1992年10月19日 基金托管业务资格批准机关：中国证监会 基金托管业务资格文号：证监基金字[2003]105号 组织形式：股份有限公司（上市）</p>	<p>二、基金托管人 (一) 基金托管人简况 基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司 办公地址：上海市黄浦区中山东一路12号 法定代表人：高国富 成立日期：1992年10月19日 基金托管业务资格批准机关：中国证监会 基金托管业务资格文号：证监基金字[2003]105号 组织形式：股份有限公司</p>

	<p>注册资本：人民币 186.5347 亿元 经营期限：永久存续</p>	<p>注册资本：293.52 亿元人民币 经营期限：永久存续</p>
第十二部分 基金的投资	<p>二、投资范围</p> <p>本基金的投资范围包括国内依法发行上市的国家债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、中小企业私募债券、公司债券、中期票据、短期融资券、质押及买断式回购、协议存款、通知存款、定期存款、资产支持证券、可转换债券（含分离型可转换债券）、可交换债券、银行存款等。本基金同时投资于国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证等权益类品种以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，其中，本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>二、投资范围</p> <p>本基金的投资范围包括国内依法发行上市的国家债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、中小企业私募债券、公司债券、中期票据、短期融资券、质押及买断式回购、协议存款、通知存款、定期存款、资产支持证券、可转换债券（含分离型可转换债券）、可交换债券、银行存款等。本基金同时投资于国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证等权益类品种以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，其中，本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</p>
第十二部分 基金的投资	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(2) 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>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(2) 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、存出保证金和应收申购款等；</p>
第十二部分 基金的投资		<p>增加：</p> <p>(12) 本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不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，不超过该上市公司可流通股票的 30%；</p> <p>(13) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 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该项所规定的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投</p>

		<p>资：</p> <p>(14)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投资范围保持一致；</p>
第十二部分 基金的投资	<p>因证券期货市场波动、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。</p>	<p>除上述第(2)、(8)、(13)、(14)项外，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。</p>
第十四部分 基金资产估值	<p>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>(1)送股、转增股、配股和公开增发新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；</p> <p>(2)首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；</p> <p>(3)首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>	<p>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>(1)送股、转增股、配股和公开增发新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；</p> <p>(2)首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；</p> <p>(3)流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等（不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票），按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>
第十四部分 基金资产估值		<p>三、估值方法</p> <p>增加：</p> <p>5、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。</p>
第十四部分 基金资产估值	<p>六、暂停估值的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</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、中国证监会和基金合同认定的其它情形。</p>	<p>六、暂停估值的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</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、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时，经与基金托管人协商确认后，应当暂停估值；</p>

		4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。
第十四部分 基金资产估值	八、特殊情况的处理 1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 5 项进行估值时，所造成的误差 不 作为基金资产估值错误处理。	八、特殊情况的处理 1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 6 项进行估值时，所造成的误差 不 作为基金资产估值错误处理。
第十八部分 基金的信息披露	<p>(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</p> <p>基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定媒介上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。</p> <p>基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定媒介上。</p> <p>基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定媒介上。</p> <p>《基金合同》生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。</p> <p>基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。</p>	<p>(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</p> <p>基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定媒介上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。</p> <p>基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定媒介上。</p> <p>基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定媒介上。</p> <p>《基金合同》生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。</p> <p>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。</p> <p>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例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文件中“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本基金的特定风险，中国证监会认定的特殊情形除外。</p> <p>基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。</p>
第十八部分 基金的信息披露		<p>(七) 临时报告</p> <p>增加：</p> <p>27、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> <p>28、基金管理人采用摆动定价机</p>

		制进行估值；
第二十四部分 基金合同内容摘要		对应基金合同正文内容进行同步修改。

二、 托管协议修改内容

章节	修订前	修订后
	<p>基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司 办公地址：上海市黄浦区中山东一路12号 法定代表人：吉晓辉 成立日期：1992年10月19日 基金托管业务资格批准机关：中国证监会 基金托管业务资格文号：证监基金字[2003]105号 组织形式：股份有限公司（上市） 注册资本：人民币186.5347亿元 经营期限：永久存续</p>	<p>基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司 办公地址：上海市黄浦区中山东一路12号 法定代表人：高国富 成立日期：1992年10月19日 基金托管业务资格批准机关：中国证监会 基金托管业务资格文号：证监基金字[2003]105号 组织形式：股份有限公司 注册资本：293.52亿元人民币 经营期限：永久存续</p>
一、基金托管协议的依据、目的、原则和解释	<p>（一）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》）、《证券投资基金托管业务管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第7号〈托管协议的内容与格式〉》、《景顺长城景颐盛利债券型证券投资基金基金合同》（以下简称《基金合同》）及其他有关法律、法规制定。</p>	<p>（一）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》）、《证券投资基金托管业务管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第7号〈托管协议的内容与格式〉》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》、《景顺长城景颐盛利债券型证券投资基金基金合同》（以下简称《基金合同》）及其他有关法律、法规制定。</p>
二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	<p>（1）按法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金的投资资产配置比例为： 基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的80%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的20%，其中，本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的</p>	<p>（1）按法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金的投资资产配置比例为： 基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的80%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的20%，其中，本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产</p>

	<p>3%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。</p> <p>(2) 根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金投资组合遵循以下投资限制：</p> <p>1) 本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的80%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的20%；</p> <p>2) 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>净值的3%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</p> <p>(2)根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金投资组合遵循以下投资限制：</p> <p>1)本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的80%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的20%；</p> <p>2) 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、存出保证金和应收申购款等；</p>
二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查		<p>增加：</p> <p>12)本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不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，不超过该上市公司可流通股票的30%；</p> <p>13)本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的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该项所规定的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>14)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投资范围保持一致；</p>
二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	<p>由于证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素导致的投资组合不符合上述规定投资比例的，基金管理人应在10个交易日内进行调整，以达到规定的投资比例限制要求，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。</p>	<p>除上述第2)、8)、13)、14)项外，由于证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素导致的投资组合不符合上述规定投资比例的，基金管理人应在10个交易日内进行调整，以达到规定的投资比例限制要求，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。</p>
二、基金托管人对基金管理的	<p>7、基金托管人对基金投资流通受限证券的监督</p> <p>基金管理人投资流通受限证券，应事先根据中国证监会相关规定，明</p>	<p>7、基金托管人对基金投资流通受限证券的监督</p> <p>基金管理人投资流通受限证券，应事先根据中国证监会相关规定，明</p>

<p>人的业务监督和核查</p>	<p>确基金投资流通受限证券的比例，制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。基金托管人对基金管理人是否遵守相关制度、流动性风险处置预案以及相关投资额度和比例等的情况进行监督。</p> <p>(1) 本基金投资的流通受限证券须为经中国证监会批准的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。本基金不投资有锁定期但锁定期不明确的证券。</p>	<p>确基金投资流通受限证券的比例，制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。基金托管人对基金管理人是否遵守相关制度、流动性风险处置预案以及相关投资额度和比例等的情况进行监督。</p> <p>(1) 本基金投资的流通受限证券与前述所述流动性受限资产并不完全一致，须为经中国证监会批准的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。本基金不投资有锁定期但锁定期不明确的证券。</p>
<p>七、基金资产净值计算和会计核算</p>	<p>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；</p> <p>(2) 首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；</p> <p>(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>	<p>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；</p> <p>(2) 首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；</p> <p>(3) 流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等（不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票），按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>
<p>七、基金资产净值计算和会计核算</p>		<p>(二) 基金资产估值方法增加：</p> <p>5、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。</p>
<p>七、基金资产净值计算和会计核算</p>	<p>(四) 暂停估值与公告基金份额净值的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</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>(四) 暂停估值与公告基金份额净值的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</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>

	3、中国证监会和基金合同认定的其它情形。	3、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时,经与基金托管人协商确认后,应当暂停估值; 4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。
九、信息披露	(四) 暂停或延迟信息披露的情形 1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时; 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资产价值时; 3、法律法规规定、中国证监会或《基金合同》认定的其他情形。	(四) 暂停或延迟信息披露的情形 1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时; 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资产价值时; 3、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时,经与基金托管人协商确认后暂停估值; 4、法律法规规定、中国证监会或《基金合同》认定的其他情形。

关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改基金合同、托管协议的内容说明

景顺长城泰和回报灵活配置混合型证券投资基金

一、 基金合同修改内容

章节	修订前	修订后
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》”)、《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》”)、《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。
第二部分 释义		<p>增加:</p> <p>54、《流动性风险管理规定》: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</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>56、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>
第六部分 基金份额的申购与赎回	<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>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,具体规定请参见招募说明书或相关公告。</p> <p>4、基金管理人可在法律法规允许的情况下,调整上述规定申购金额和赎回份额等数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。</p>	<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>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,具体规定请参见招募说明书或相关公告。</p> <p>4、基金管理人可在法律法规允许的情况下,调整上述规定申购金额和赎回份额等数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。</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</p>

		<p>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。具体请参见相关公告。</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>4、赎回金额的计算及处理方式:本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定,并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日某类别基金份额净值并扣除相应的费用,赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入的方法,保留到小数点后两位,由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p>	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>4、赎回金额的计算及处理方式:本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定,并在招募说明书中列示,对于持续持有期少于7日的投资者,本基金将收取不低于1.5%的赎回费并全额计入基金财产。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日某类别基金份额净值并扣除相应的费用,赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入的方法,保留到小数点后两位,由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p>
<p>第六部分 基金份额 的申购与 赎回</p>		<p>增加:</p> <p>9、当发生大额申购或赎回情形时,在履行适当程序后,基金管理人可以采用摆动定价机制,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、自律组织的规定。</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>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:</p> <p>1、因不可抗力导致基金无法正常运作。</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时,基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。</p> <p>3、证券、期货交易所交易时间非正常停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</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>5、基金资产规模过大,使基金管理人无法找到合适的投资品种,或其他可能对基金业绩产生负面影响,或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形。</p> <p>6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</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申购时,基金管理人应当根据有关规定在</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:</p> <p>1、因不可抗力导致基金无法正常运作。</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时,基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。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,经与基金托管人协商确定后,基金管理人应当暂停接受申购申请。</p> <p>3、证券、期货交易所交易时间非正常停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</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>5、基金资产规模过大,使基金管理人无法找到合适的投资品种,或其他可能对基金业绩产生负面影响,或发生其他损害现有基金份额持有</p>

	<p>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>人利益的情形。</p> <p>6、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。</p> <p>7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述情形之一（除第4、6项外）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全部或部分拒绝的，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>1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，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>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>1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，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。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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项。</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增加：</p> <p>（3）如果基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额20%以上的赎回申请的情形下，基金管理人可以对该基金份额持有人超过20%以上的部分延期办理赎回申请。对于当日非延期的赎回申请，应当按单个账户非延期赎回申请量占非延期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</p>

		<p>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某类别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。</p>
第十二部分 基金的投资	<p>二、投资范围</p> <p>本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、资产支持证券、中小企业私募债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。</p> <p>本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范围为0-95%。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>二、投资范围</p> <p>本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、资产支持证券、中小企业私募债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。</p> <p>本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范围为0-95%。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、存出保证金和应收申购款等。</p>
第十二部分 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>(1)本基金股票投资占基金资产的比例范围为0-95%;</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>(3)本基金持有一家公司发行的证券,其市值不超过基金资产净值的</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:</p> <p>(1)本基金股票投资占基金资产的比例范围为0-95%;</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、存出保证金和应收申购款等;</p>

<p>10%；</p> <p>(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；</p> <p>(5) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；</p> <p>(6) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；</p> <p>(7) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；</p> <p>(8) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；</p> <p>(9) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；</p> <p>(10) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；</p> <p>(11) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；</p> <p>(12) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；</p> <p>(13) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；</p> <p>(14) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；</p> <p>(15) 本基金参与股指期货交易依据下列标准建构组合：</p> <p>15.1 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；</p> <p>15.2 本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和不得超过基金资产净值的 95%，其中，有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、权</p>	<p>(3) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；</p> <p>(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；</p> <p>(5) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；</p> <p>(6) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；</p> <p>(7) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；</p> <p>(8) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；</p> <p>(9) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；</p> <p>(10) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；</p> <p>(11) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；</p> <p>(12) 本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家公司发行的可流通股票，不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公司发行的可流通股票，不超过该上市公司可流通股票的 30%；</p> <p>(13) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 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项所规定的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>(14) 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投资范围保持一致；</p>
--	--

	<p>证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；</p> <p>15.3 本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过本基金持有的股票总市值的 20%；</p> <p>15.4 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；</p> <p>15.5 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；</p> <p>（16）本基金持有单只中小企业私募债券的市值不得超过基金资产净值的 10%；</p> <p>（17）本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；</p> <p>（18）法律法规及中国证监会规定的其他投资限制。</p> <p>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。法律法规另有规定，从其规定。</p>	<p>（15）本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；</p> <p>（16）基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；</p> <p>（17）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；</p> <p>（18）本基金参与股指期货交易依据下列标准建构组合：</p> <p>18.1 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；</p> <p>18.2 本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和不得超过基金资产净值的 95%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；</p> <p>18.3 本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过本基金持有的股票总市值的 20%；</p> <p>18.4 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；</p> <p>18.5 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；</p> <p>（19）本基金持有单只中小企业私募债券的市值不得超过基金资产净值的 10%；</p> <p>（20）本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；</p> <p>（21）法律法规及中国证监会规定的其他投资限制。</p> <p>除上述第（2）、（13）、（14）、（15）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</p>
--	---	--

		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,从其规定。
第十四部分 基金资产估值	<p>4、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:</p> <p>(3)首次公开发行有明确锁定期的股票,同一股票在交易所上市后,按交易所上市的同一股票的估值方法估值;非公开发行有明确锁定期的股票,按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>	<p>4、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:</p> <p>(3) 流通受限的股票,包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等(不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票),按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>
第十四部分 基金资产估值		<p>三、估值方法</p> <p>增加:</p> <p>7、当发生大额申购或赎回情形时,在履行适当程序后,基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。</p>
第十四部分 基金资产估值	<p>六、暂停估值的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;</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、中国证监会和基金合同认定的其它情形。</p>	<p>六、暂停估值的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;</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、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时,经与基金托管人协商确认后,应当暂停估值;</p> <p>4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。</p>
第十四部分 基金资产估值	<p>八、特殊情况的处理</p> <p>1、基金管理人或基金托管人按本基金合同规定的估值方法的第 7 项进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。</p>	<p>八、特殊情况的处理</p> <p>1、基金管理人或基金托管人按本基金合同规定的估值方法的第 8 项进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。</p>
第十八部分 基金的信息披露	<p>(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</p> <p>基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内,编制完成基金年度报告,并将年度报告正文登载于网站上,将年度报告摘要登载在指定媒介上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。</p> <p>基金管理人应当在上半年结束之</p>	<p>(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</p> <p>基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内,编制完成基金年度报告,并将年度报告正文登载于网站上,将年度报告摘要登载在指定媒介上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。</p> <p>基金管理人应当在上半年结束</p>

	<p>日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定媒介上。</p> <p>基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定媒介上。</p> <p>基金合同生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。</p> <p>基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。</p>	<p>之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定媒介上。</p> <p>基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定媒介上。</p> <p>基金合同生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。</p> <p>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。</p> <p>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例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文件中“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本基金的特定风险，中国证监会认定的特殊情形除外。</p> <p>基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。</p>
第十八部分 基金的信息披露		<p>(七) 临时报告</p> <p>增加：</p> <p>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；</p> <p>27、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；</p>
第二十四部分 基金合同内容摘要		<p>对应基金合同正文内容进行同步修改。</p>

二、 托管协议修订内容

章节	修订前	修订后
一、基金托管协议当事人	<p>(二) 基金托管人</p> <p>名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）</p>	<p>(二) 基金托管人</p> <p>名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）</p>

	<p>住所：上海市浦东新区银城中路188号（邮政编码：200120） 办公地址：上海市长宁区仙霞路18号（邮政编码：200336） 法定代表人：牛锡明 成立时间：1987年3月30日 批准设立机关及批准设立文号：国务院国发(1986)字第81号文和中国人民银行银发[1987]40号文 基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]25号 经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项业务；提供保管箱服务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务；经营结汇、售汇业务。</p> <p>注册资本：742.62亿元人民币 组织形式：股份有限公司 存续期间：持续经营</p>	<p>住所：上海市浦东新区银城中路188号 法定代表人：牛锡明 成立时间：1987年3月30日 批准设立机关及批准设立文号：国务院国发(1986)字第81号文和中国人民银行银发[1987]40号文 组织形式：股份有限公司 注册资本：742.62亿元人民币 存续期间：持续经营 基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]25号 经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项业务；提供保管箱服务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务；经营结汇、售汇业务。</p>
<p>二、基金托管协议的依据、目的和原则</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》)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称《销售办法》)、《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》)、《景顺长城泰和回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(以下简称《基金合同》)及其他有关规定订立。</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》)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称《销售办法》)、《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》)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》、《景顺长城泰和回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(以下简称《基金合同》)及其他有关规定订立。</p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>	<p>(1)基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》和本协议的约定，对基金的投资范围、投资对象进行监督。</p> <p>本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、资产支持证券、中小企业</p>	<p>(1)基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》和本协议的约定，对基金的投资范围、投资对象进行监督。</p> <p>本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、资产支持证券、</p>

	<p>私募债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。</p> <p>本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范围为0-95%。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>中小企业私募债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。</p> <p>本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范围为0-95%。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、存出保证金和应收申购款等。</p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>	<p>(2)基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》和本协议的约定,对基金投资、融资比例进行监督。</p> <p>根据《基金合同》的约定,本基金投资组合比例应符合以下规定:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. 本基金股票投资占基金资产的比例范围为0-95%; 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; 3. 本基金持有一家公司发行的证券,其市值不超过基金资产净值的10%; 4. 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券,不超过该证券的10%; 5. 本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%; 6. 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的10%; 7. 本基金在任何交易日买入权证的总金额,不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%; 8. 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过基金资产净值的10%; 	<p>(2)基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》和本协议的约定,对基金投资、融资比例进行监督。</p> <p>根据《基金合同》的约定,本基金投资组合比例应符合以下规定:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. 本基金股票投资占基金资产的比例范围为0-95%; 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、存出保证金和应收申购款等; 3. 本基金持有一家公司发行的证券,其市值不超过基金资产净值的10%; 4. 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券,不超过该证券的10%; 5. 本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%; 6. 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的10%; 7. 本基金在任何交易日买入权证的总金额,不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%; 8. 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得

<p>9. 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；</p> <p>10. 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；</p> <p>11. 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；</p> <p>12. 本基金应投资于信用级别评级为BBB以上（含BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；</p> <p>13. 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；</p> <p>14. 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%；债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；</p> <p>15. 本基金参与股指期货交易依据下列标准建构组合：</p> <p>15.1 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的10%；</p> <p>15.2 本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和不得超过基金资产净值的95%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；</p> <p>15.3 本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过本基金持有的股票总市值的20%；</p> <p>15.4 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；</p> <p>15.5 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%；</p> <p>16. 本基金持有单只中小企业私募债券的市值不得超过基金资产净值</p>	<p>超过基金资产净值的10%；</p> <p>9. 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；</p> <p>10. 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；</p> <p>11. 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；</p> <p>12. 本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不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，不超过该上市公司可流通股票的30%；</p> <p>13. 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的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项所规定的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>14. 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投资范围保持一致；</p> <p>15. 本基金应投资于信用级别评级为BBB以上（含BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；</p> <p>16. 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；</p> <p>17. 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%；债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；</p> <p>18. 本基金参与股指期货交易依据下列标准建构组合：</p>
---	---

	<p>的 10%;</p> <p>17. 本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%;</p> <p>18. 法律法规及中国证监会规定的其他投资限制。</p> <p>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。法律法规另有规定,从其规定。</p>	<p>18.1 本基金在任何交易日日终,持有的买入股指期货合约价值,不得超过基金资产净值的 10%;</p> <p>18.2 本基金在任何交易日日终,持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和不得超过基金资产净值的 95%,其中,有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;</p> <p>18.3 本基金在任何交易日日终,持有的卖出期货合约价值不得超过本基金持有的股票总市值的 20%;</p> <p>18.4 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定;</p> <p>18.5 本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%;</p> <p>19. 本基金持有单只中小企业私募债券的市值不得超过基金资产净值的 10%;</p> <p>20. 本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%;</p> <p>21. 法律法规及中国证监会规定的其他投资限制。</p> <p>除上述第 2、13、14、15 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。法律法规另有规定,从其规定。</p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>	<p>(6)基金托管人对基金投资流通受限证券的监督</p> <p>1. 基金投资流通受限证券,应遵守《关于规范基金投资非公开发行股票行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。</p> <p>2. 流通受限证券,包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质</p>	<p>(6) 基金托管人对基金投资流通受限证券的监督</p> <p>1. 基金投资流通受限证券,应遵守《关于规范基金投资非公开发行股票行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。</p> <p>2. 本基金投资的流通受限证券与上文流动性受限资产不同,包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于</p>

	押券等流通受限证券。	发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。
八、基金资产净值计算和会计核算	<p>4、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；</p> <p>(2) 首次公开发行未上市的股票和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。</p> <p>(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>	<p>4、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；</p> <p>(2) 首次公开发行未上市的股票和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。</p> <p>(3) 流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等（不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票），按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>
八、基金资产净值计算和会计核算		<p>(一) 基金资产净值及基金份额净值的计算与复核</p> <p>增加：</p> <p>7、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。</p>
八、基金资产净值计算和会计核算	<p>(二) 净值差错处理</p> <p>当发生净值计算错误时，由基金管理人负责处理，由此给基金份额持有人和基金造成损失的，由基金管理人对基金份额持有人或者基金先行支付赔偿金。基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿。</p> <p>(1) 如采用本协议第八章“基金资产净值及各类基金份额的基金份额净值的计算与复核”中估值方法的第(1) — (6)、(8) 进行处理时，若基金管理人净值计算出错，基金托管人在复核过程中没有发现，且造成基金份额持有人损失的，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，由基金管理人与基金托管人按照管理费率 and 托管费率的比例各自承担相应的责任；</p> <p>(2) 如基金管理人和基金托管人对各类基金份额的基金份额净值的计</p>	<p>(二) 净值差错处理</p> <p>当发生净值计算错误时，由基金管理人负责处理，由此给基金份额持有人和基金造成损失的，由基金管理人对基金份额持有人或者基金先行支付赔偿金。基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿。</p> <p>(1) 如采用本协议第八章“基金资产净值及各类基金份额的基金份额净值的计算与复核”中估值方法的第(1) — (7)、(9) 进行处理时，若基金管理人净值计算出错，基金托管人在复核过程中没有发现，且造成基金份额持有人损失的，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，由基金管理人与基金托管人按照管理费率 and 托管费率的比例各自承担相应的责任；</p> <p>(2) 如基金管理人和基金托管</p>

	<p>算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布各类基金份额的基金份额净值的情形，以基金管理人的计算结果对外公布，由此给基金份额持有人和基金造成的损失以及因该交易日基金资产净值计算顺延错误而引起的损失，由基金管理人负责赔付，基金托管人不负赔偿责任；</p> <p>基金管理人、基金托管人按估值方法的第（7）项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。</p>	<p>人对各类基金份额的基金份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布各类基金份额的基金份额净值的情形，以基金管理人的计算结果对外公布，由此给基金份额持有人和基金造成的损失以及因该交易日基金资产净值计算顺延错误而引起的损失，由基金管理人负责赔付，基金托管人不负赔偿责任；</p> <p>基金管理人、基金托管人按估值方法的第 8 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。</p>
十、基金信息披露	<p>（三）暂停或延迟信息披露的情形</p> <p>（1）发生暂停估值的情形；</p> <p>（2）不可抗力；</p> <p>（3）法律法规规定、中国证监会或基金合同认定的其他情形。</p>	<p>（三）暂停或延迟信息披露的情形</p> <p>（1）不可抗力；</p> <p>（2）基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</p> <p>（3）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时，经与基金托管人协商确认后暂停估值；</p> <p>（4）法律法规、基金合同或中国证监会规定的情况。</p>

关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改基金合同、托管协议的内容说明

景顺长城顺益回报混合型证券投资基金

一、 基金合同修改内容

章节	修订前	修订后
第一部分 前言	<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</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</p>

	披露办法》”)和其他有关法律法规。	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。
第二部分 释义		<p>增加:</p> <p>54、《流动性风险管理规定》: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</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>56、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>
第六部分 基金份额的申购与赎回		<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>增加:</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。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。具体请参见相关公告。</p>
第六部分 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>4、赎回金额的计算及处理方式:本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定,并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类别基金份额净值并扣除相应的费用,赎回金额单位为元。上述</p>	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>4、赎回金额的计算及处理方式:本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定,并在招募说明书中列示,对于持续持有期少于 7 日的投资者,本基金将收取不低于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产。赎回金额为按实</p>

	计算结果均按四舍五入的方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。	实际确认的有效赎回份额乘以当日该类别基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入的方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。
第六部分 基金份额 的申购与 赎回		增加： 9、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，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、自律组织的规定。
第六部分 基金份额 的申购与 赎回	七、拒绝或暂停申购的情形 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。 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。	七、拒绝或暂停申购的情形 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受申购申请。 增加： 6、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。 发生上述情形之一（除第 4、6 项外）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全部或部分拒绝的，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。
第六部分 基金份额 的申购与 赎回	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，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。	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，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。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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项。

<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增加：</p> <p>(3) 如果基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额 20%以上的赎回申请的情形下，基金管理人可以对该基金份额持有人超过 20%以上的部分延期办理赎回申请。对于当日非延期的赎回申请，应当按单个账户非延期赎回申请量占非延期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该类别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。</p>
<p>第十二部分 基金 的投资</p>	<p>二、投资范围</p> <p>本基金的投资范围主要为依法发行的固定收益类品种，包括债券（包括国内依法发行上市的国家债券、金融债券、次级债券、企业债券、中小企业私募债券、公司债券、可转换债券（含分离型可转换债券）及其他经中国证监会允许投资的债券、中央银行票据、中期票据、短期融资券、质押及买断式回购、协议存款、通知存款、同业存单、定期存款、资产支持证券、银行存款等。本基金同时投资于股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证等权益类品种以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 70%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 30%，其中，本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>二、投资范围</p> <p>本基金的投资范围主要为依法发行的固定收益类品种，包括债券（包括国内依法发行上市的国家债券、金融债券、次级债券、企业债券、中小企业私募债券、公司债券、可转换债券（含分离型可转换债券）及其他经中国证监会允许投资的债券、中央银行票据、中期票据、短期融资券、质押及买断式回购、协议存款、通知存款、同业存单、定期存款、资产支持证券、银行存款等。本基金同时投资于股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证等权益类品种以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 70%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 30%，其中，本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备</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>(2) 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>因证券市场波动、上市公司合并、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。</p>	<p>付金、存出保证金和应收申购款等。</p> <p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(2) 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、存出保证金和应收申购款等；</p> <p>增加：</p> <p>(12)本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不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，不超过该上市公司可流通股票的30%；</p> <p>(13)本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的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项所规定的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>(14)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投资范围保持一致；</p> <p>除上述第(2)、(8)、(13)、(14)项外，因证券市场波动、上市公司合并、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。</p>
<p>第十四部分 基金资产估值</p>	<p>三、估值方法</p> <p>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>(3)首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>	<p>三、估值方法</p> <p>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>(3) 流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等(不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票)，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p> <p>增加：</p> <p>5、当发生大额申购或赎回情形</p>

		时,在履行适当程序后,基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。
第十四部分 基金资产估值		六、暂停估值的情形 增加: 4、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时,经与基金托管人协商确认后,应当暂停估值;
第十四部分 基金资产估值	八、特殊情况的处理 1、基金管理人或基金托管人按本基金合同规定的估值方法的第5项进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。	八、特殊情况的处理 1、基金管理人或基金托管人按本基金合同规定的估值方法的第6项进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。
第十八部分 基金的信息披露		(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 增加: 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基金份额比例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文件中“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本基金的特有风险,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		(七)临时报告 增加: 27、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; 28、基金管理人采用摆动定价机制进行估值;
第二十四部分 基金合同内容摘要		摘要部分也做了相应修改,与合同修订内容保持一致。

二、 托管协议修改内容

章节	修订前	修订后
<p>一、基金托管协议当事人</p>	<p>(二) 基金托管人 名称: 交通银行股份有限公司(简称: 交通银行) 住所: 上海市浦东新区银城中路188号(邮政编码: 200120) 办公地址: 上海市长宁区仙霞路18号(邮政编码: 200336) 法定代表人: 牛锡明 成立时间: 1987年3月30日 批准设立机关及批准设立文号: 国务院国发(1986)字第81号文和中国人民银行银发[1987]40号文 基金托管业务批准文号: 中国证监会证监基字[1998]25号 经营范围: 吸收公众存款; 发放短期、中期和长期贷款; 办理国内外结算; 办理票据承兑与贴现; 发行金融债券; 代理发行、代理兑付、承销政府债券; 买卖政府债券、金融债券; 从事同业拆借; 买卖、代理买卖外汇; 从事银行卡业务; 提供信用证服务及担保; 代理收付款项业务; 提供保管箱服务; 经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务; 经营结汇、售汇业务。 注册资本: 742.62亿元人民币 组织形式: 股份有限公司 存续期间: 持续经营</p>	<p>(二) 基金托管人 名称: 交通银行股份有限公司(简称: 交通银行) 住所: 上海市浦东新区银城中路188号 法定代表人: 牛锡明 成立时间: 1987年3月30日 批准设立机关及批准设立文号: 国务院国发(1986)字第81号文和中国人民银行银发[1987]40号文 注册资本: 742.62亿元人民币 组织形式: 股份有限公司 存续期间: 持续经营 基金托管业务批准文号: 中国证监会证监基字[1998]25号 经营范围: 吸收公众存款; 发放短期、中期和长期贷款; 办理国内外结算; 办理票据承兑与贴现; 发行金融债券; 代理发行、代理兑付、承销政府债券; 买卖政府债券、金融债券; 从事同业拆借; 买卖、代理买卖外汇; 从事银行卡业务; 提供信用证服务及担保; 代理收付款项业务; 提供保管箱服务; 经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务; 经营结汇、售汇业务。</p>
<p>二、基金托管协议的依据、目的和原则</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》)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称《销售办法》)、《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》)、《景顺长城顺益回报混合型证券投资基金基金合同》(以下简称《基金合同》)及其他有关规定订立。</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》)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称《销售办法》)、《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》)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》、《景顺长城顺益回报混合型证券投资基金基金合同》(以下简称《基金合同》)及其他有关规定订立。</p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>	<p>(1) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》和本协议的约定, 对基金的投资范围、投资对象进行监督。 本基金的投资范围主要为依法发行的固定收益类品种, 包括债券(包括国内依法发行上市的国家债券、金融债券、次级债券、企业债券、中小企业私募债券、公司债券、可转换债</p>	<p>(1) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》和本协议的约定, 对基金的投资范围、投资对象进行监督。 本基金的投资范围主要为依法发行的固定收益类品种, 包括债券(包括国内依法发行上市的国家债券、金融债券、次级债券、企业债券、中小企业私募债券、公司债券、可转</p>

	<p>券（含分离型可转换债券）及其他经中国证监会允许投资的债券）、中央银行票据、中期票据、短期融资券、质押及买断式回购、协议存款、通知存款、同业存单、定期存款、资产支持证券、银行存款等。本基金同时投资于股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证等权益类品种以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 70%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 30%，其中，本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>换债券（含分离型可转换债券）及其他经中国证监会允许投资的债券）、中央银行票据、中期票据、短期融资券、质押及买断式回购、协议存款、通知存款、同业存单、定期存款、资产支持证券、银行存款等。本基金同时投资于股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证等权益类品种以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 70%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 30%，其中，本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</p>
<p>三、基金托管人对基金管理的业务监督和核查</p>	<p>(2)基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》和本协议的约定，对基金投资、融资比例进行监督。</p> <p>根据《基金合同》的约定，本基金投资组合比例应符合以下规定：</p> <p>(2) 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>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</p>	<p>(2) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》和本协议的约定，对基金投资、融资比例进行监督。</p> <p>根据《基金合同》的约定，本基金投资组合比例应符合以下规定：</p> <p>(2) 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、存出保证金和应收申购款等；</p> <p>增加：</p> <p>(8) 本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不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，不超过该上市公司可流通股票的 30%；</p> <p>(9) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 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项所规定的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>(10) 本基金与私募类证券资管</p>

	约定的投资比例规定的，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。	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投资范围保持一致； 除上述第（2）、（9）、（10）、（11）项外，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，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	（6）基金托管人对基金投资流通受限证券的监督 2. 流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。	（6）基金托管人对基金投资流通受限证券的监督 2. 本基金投资的流通受限证券与上文流动性受限资产不同，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。
八、基金资产净值计算和会计核算	（一）基金资产净值及基金份额净值的计算与复核 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理： （3）首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。	（一）基金资产净值及基金份额净值的计算与复核 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理： （3）流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等（不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票），按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。
八、基金资产净值计算和会计核算		（一）基金资产净值及基金份额净值的计算与复核 增加： 5、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。
八、基金资产净值计算和会计核算	（二）净值差错处理 （1）如采用本协议第八章“基金资产净值及基金份额净值的计算与复核”中估值方法的第 1-4、6 项进行处理时，若基金管理人净值计算出错，基金托管人在复核过程中没有发现，且造成基金份额持有人损失的，应根	（二）净值差错处理 （1）如采用本协议第八章“基金资产净值及基金份额净值的计算与复核”中估值方法的第 1-5、7 项进行处理时，若基金管理人净值计算出错，基金托管人在复核过程中没有发现，且造成基金份额持有人损失

	<p>据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，由基金管理人与基金托管人按照管理费率 and 托管费率的比例各自承担相应的责任；</p> <p>(3) 基金管理人、基金托管人按本协议第八章“基金资产净值及基金份额净值的计算与复核”中估值方法的第 5 项进行估值时，所造成的误差不得作为基金资产估值错误处理。</p>	<p>的，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，由基金管理人与基金托管人按照管理费率 and 托管费率的比例各自承担相应的责任；</p> <p>(3) 基金管理人、基金托管人按本协议第八章“基金资产净值及基金份额净值的计算与复核”中估值方法的第 6 项进行估值时，所造成的误差不得作为基金资产估值错误处理。</p>
十、基金信息披露	<p>(三) 暂停或延迟信息披露的情形</p> <p>(1) 发生暂停估值的情形；</p> <p>(2) 不可抗力；</p> <p>(3) 法律法规规定、中国证监会或基金合同认定的其他情形。</p>	<p>(三) 暂停或延迟信息披露的情形</p> <p>(1) 不可抗力；</p> <p>(2) 基金投资所涉及的证券市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</p> <p>(3) 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时，经与基金托管人协商确认后暂停估值；</p> <p>(4) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的情况。</p>

关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改基金合同、托管协议的内容说明

景顺长城景颐双利债券型证券投资基金

一、 基金合同修改内容

章节	修订前	修订后
第一部分 前言	<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》”）、《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>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》”）、《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</p>

		定》”)和其他有关法律法规。
第二部分 释义		<p>增加：</p> <p>54、《流动性风险管理规定》：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</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>56、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>
第六部分 基金份额的申购与赎回		<p>增加：</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。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。具体请参见相关公告。</p>
第六部分 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>6、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。不低于赎回费总额的 25%应归基金财产，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>6、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。对于持续持有期少于 7 日的投资者，本基金将收取不低于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产；对于持续持有期不少于 7 日的投资者，不低于赎回费总额的 25%应归基金财产，未归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>
第六部分		<p>增加：</p> <p>9、当发生大额申购或赎回情形</p>

基金份额的申购与赎回		时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，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、自律组织的规定。
第六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>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。</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申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体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>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受申购申请。</p> <p>增加：</p> <p>6、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。</p> <p>发生上述暂停申购情形之一（除第 4、6 项外）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体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，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>
第六部分基金份额的申购与赎回	<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，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>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，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。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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项。</p>
第六部分基金份额的申购与赎回		<p>九、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>增加：</p> <p>(3) 如果基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额 20%以上的赎回申请的情形下，基金管理人可以对该基金份额持有人超过 20%以上的部分延期办理赎回申请。对于当日非延期的赎回</p>

		<p>回申请，应当按单个账户非延期赎回申请量占非延期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。</p>
第七部分 基金合同 当事人及 权利义务	<p>一、基金管理人 (一) 基金管理人简况 法定代表人：赵如冰</p>	<p>一、基金管理人 (一) 基金管理人简况 法定代表人：杨光裕</p>
第七部分 基金合同 当事人及 权利义务	<p>二、基金托管人 (一) 基金托管人简况 名称：北京银行股份有限公司 住所：北京市西城区金融大街甲17号 法定代表人：闫冰竹 成立时间：1996年1月29日 批准设立机关和批准设立文号：中国人民银行1995年12月28日《关于北京城市合作银行开业的批复》（银复[1995]470号） 组织形式：股份有限公司（上市） 注册资本：88亿元 存续期间：持续经营</p>	<p>二、基金托管人 (一) 基金托管人简况 名称：北京银行股份有限公司 住所：北京市西城区金融大街甲17号首层 法定代表人：张东宁 成立时间：1996年1月29日 批准设立机关和批准设立文号：中国人民银行1995年12月28日《关于北京城市合作银行开业的批复》（银复[1995]470号） 组织形式：股份有限公司 注册资本：人民币1520667.5685万元 存续期间：持续经营</p>
第十二部分 基金 的投资	<p>二、投资范围 本基金的投资范围主要为依法发行的固定收益类品种，包括国内依法发行上市的国家债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、中小企业私募债券、公司债券、中期票据、短期融资券、质押及买断式回购、协议存款、通知存款、定期存款、资产支持证券、可转换债券（含分离型可转换债券）、银行存款等。本基金同时投资于A股股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证等权益类品种以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国</p>	<p>二、投资范围 本基金的投资范围主要为依法发行的固定收益类品种，包括国内依法发行上市的国家债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、中小企业私募债券、公司债券、中期票据、短期融资券、质押及买断式回购、协议存款、通知存款、定期存款、资产支持证券、可转换债券（含分离型可转换债券）、银行存款等。本基金同时投资于A股股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证等权益类品种以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证</p>

	<p>证监会的相关规定。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，其中，本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>监会的相关规定。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，其中，本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</p>
第十二部分 基金的投资	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(2) 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>因证券市场波动、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。法律法规另有规定的，从其规定。</p>	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(2) 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、存出保证金和应收申购款等；</p> <p>增加：</p> <p>(12) 本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不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，不超过该上市公司可流通股票的 30%；</p> <p>(13) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 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项所规定的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>(14) 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投资范围保持一致；</p> <p>除上述第 (2)、(8)、(13)、(14) 项外，因证券市场波动、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。法律法规另有规定的，从其规定。</p>
第十四部分 基金	<p>三、估值方法</p> <p>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p>	<p>三、估值方法</p> <p>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p>

资产估值	(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票, 同一股票在交易所上市后, 按交易所上市的同一股票的估值方法估值; 非公开发行有明确锁定期的股票, 按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。	(3) 流通受限的股票, 包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等(不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票), 按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。
第十四部分 基金资产估值		三、估值方法 增加: 7、当发生大额申购或赎回情形时, 在履行适当程序后, 基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。
第十四部分 基金资产估值		六、暂停估值的情形 增加: 4、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时, 经与基金托管人协商确认后, 应当暂停估值;
第十四部分 基金资产估值	八、特殊情况的处理 1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 7 项进行估值时, 所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。	八、特殊情况的处理 1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 8 项进行估值时, 所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。
第十八部分 基金的信息披露		(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 增加: 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基金份额比例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文件中“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本基金的特有风险, 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		(七) 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; 27、基金管理人采用摆动定价机

		制进行估值；
第二十四部分 基金合同内容摘要		摘要部分也做了相应修改，与合同修订内容保持一致。

二、 托管协议修改内容

章节	修订前	修订后
一、基金托管协议当事人	(一) 基金管理人 法定代表人：赵如冰	(一) 基金管理人 法定代表人：杨光裕
一、基金托管协议当事人	(二) 基金托管人 名称：北京银行股份有限公司 住所：北京市西城区金融大街甲17号 法定代表人：闫冰竹 电话：(010) 66223584 传真：(010) 66226045 联系人：王曦 成立时间：1996年1月29日 组织形式：股份有限公司(上市) 注册资本：人民币88亿元 批准设立机关和设立文号：中国人民银行1995年12月28日《关于北京城市合作银行开业的批复》(银复[1995]470号) 存续期间：持续经营	(二) 基金托管人 名称：北京银行股份有限公司 住所：北京市西城区金融大街甲17号首层 法定代表人：张东宁 电话：(010) 66223584 传真：(010) 66226045 联系人：王曦 成立时间：1996年1月29日 组织形式：股份有限公司 注册资本：人民币1520667.5685万元 批准设立机关和设立文号：中国人民银行1995年12月28日《关于北京城市合作银行开业的批复》(银复[1995]470号) 存续期间：持续经营
二、基金托管协议的依据、目的、原则	订立本协议的依据是《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、《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》)、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第7号〈托管协议的内容与格式〉》、《景顺长城景颐双利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。	订立本协议的依据是《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、《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》)、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第7号〈托管协议的内容与格式〉》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》、《景顺长城景颐双利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。
三、基金托管人对基金管理	(1) 按法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金的投资资产配置比例为： 基金的投资组合比例为：本基金	(1) 按法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金的投资资产配置比例为： 基金的投资组合比例为：本基金

人的业务监督和核查	对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，其中，本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。	对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，其中，本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	<p>(2) 根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金投资组合遵循以下投资限制：</p> <p>2) 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>法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准。</p>	<p>(2) 根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金投资组合遵循以下投资限制：</p> <p>2) 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、存出保证金和应收申购款等；</p> <p>增加：</p> <p>12) 本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不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，不超过该上市公司可流通股票的 30%；</p> <p>13) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 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项所规定的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准。</p>
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	<p>6、基金托管人对基金投资流通受限证券的监督</p> <p>(2) 流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>	<p>6、基金托管人对基金投资流通受限证券的监督</p> <p>(2) 流通受限证券，与上文提到的流动性受限资产并不完全一致，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>
八、基金	<p>2、估值方法和特殊情形的处理</p> <p>(2) 处于未上市期间的有价证</p>	<p>2、估值方法和特殊情形的处理</p> <p>(2) 处于未上市期间的有价证</p>

资产净值 计算和会 计核算	券应区分如下情况处理： 3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。	券应区分如下情况处理： 3) 流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等（不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票），按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。
八、基金 资产净值 计算和会 计核算		(二) 基金资产估值方法 增加： (7) 当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。
八、基金 资产净值 计算和会 计核算	3、特殊情形的处理 基金管理人、基金托管人按估值方法的第(7)项进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。	3、特殊情形的处理 基金管理人、基金托管人按估值方法的第(8)项进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。
八、基金 资产净值 计算和会 计核算		(六) 暂停估值的情形 增加： 4、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时，经与基金托管人协商确认后，应当暂停估值；
十、信息 披露		(三) 暂停或延迟信息披露的情形 增加： 4、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时，经与基金托管人协商确认后暂停估值；

关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改基金合同、托管协议的内容说明

景顺长城景颐丰利债券型证券投资基金

一、 基金合同修改内容

章节	修订前	修订后
<p>第一部分 前言</p>	<p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</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>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</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>第二部分 释义</p>		<p>增加：</p> <p>54、《流动性风险管理规定》：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</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>56、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>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>增加：</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</p>

		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。具体请参见相关公告。
第六部分 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>4、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见《招募说明书》。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额的基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入的方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p>	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>4、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见《招募说明书》。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示，对于持续持有期少于7日的投资者，本基金将收取不低于1.5%的赎回费并全额计入基金财产。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额的基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入的方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p>
第六部分 基金份额 的申购与 赎回		<p>增加：</p> <p>9、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，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、自律组织的规定。</p>
第六部分 基金份额 的申购与 赎回	<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。</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>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受申购申请。</p> <p>增加：</p> <p>6、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。</p> <p>发生上述暂停申购情形之一（除第4、6项外）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全部或部分拒绝的，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>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，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>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，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。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，经与基金托管人协商确定后，基金管理人应当暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项。</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增加：</p> <p>(3) 如果基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额 20%以上的赎回申请的情形下，基金管理人可以对该基金份额持有人超过 20%以上的部分延期办理赎回申请。对于当日非延期的赎回申请，应当按单个账户非延期赎回申请量占非延期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。</p>
<p>第七部分 基金合同 当事人及 权利义务</p>	<p>(一) 基金托管人简况</p> <p>名称： 住所： 办公地址： 邮政编码： 法定代表人： 成立时间： 基金托管业务批准文号：</p>	<p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况</p> <p>名称：北京银行股份有限公司 住所：北京市西城区金融大街甲 17 号首层 法定代表人：张东宁 成立时间：1996 年 1 月 29 日 批准设立机关和批准设立文号：中国人民银行 1995 年 12 月 28 日《关于北京城市合作银行开业的批复》（银复[1995]470 号） 组织形式：股份有限公司 注册资本：人民币 1520667.5685 万元</p>

		<p>存续期间：持续经营 基金托管资格批文及文号：中国证监会证监许可[2008]776号</p>
第十二部分 基金的投资	<p>二、投资范围</p> <p>本基金的投资范围主要为依法发行的固定收益类品种，包括国内依法发行上市的国家债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、中小企业私募债券、公司债券、中期票据、短期融资券、质押及买断式回购、协议存款、通知存款、定期存款、资产支持证券、可转换债券（含分离型可转换债券）、银行存款等。本基金同时投资于 A 股股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证等权益类品种以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，其中，本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>二、投资范围</p> <p>本基金的投资范围主要为依法发行的固定收益类品种，包括国内依法发行上市的国家债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、中小企业私募债券、公司债券、中期票据、短期融资券、质押及买断式回购、协议存款、通知存款、定期存款、资产支持证券、可转换债券（含分离型可转换债券）、银行存款等。本基金同时投资于 A 股股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证等权益类品种以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，其中，本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</p>
第十二部分 基金的投资	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(2) 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>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>(2) 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、存出保证金和应收申购款等；</p> <p>增加：</p> <p>(12) 本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不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，不超过该上市公司可流通股票的 30%；</p> <p>(13) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的 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</p>

	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。	项所规定的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资； (14) 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投资范围保持一致； 除上述第 (2)、(8)、(13)、(14) 项外，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。
第十四部分 基金资产估值	三、估值方法 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理： (3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。	三、估值方法 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理： (3) 流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等（不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票），按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。
第十四部分 基金资产估值		三、估值方法 增加： 5、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。
第十四部分 基金资产估值		六、暂停估值的情形 增加： 3、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时，经与基金托管人协商确认后，应当暂停估值；
第十四部分 基金资产估值	八、特殊情况的处理 1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 5 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。	八、特殊情况的处理 1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 6 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。
第十八部分 基金的信息披露		(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 增加： 基金管理人应当在基金年度报

		<p>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。</p> <p>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例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文件中“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本基金的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。</p>
第十八部分 基金的信息披露		<p>(七) 临时报告</p> <p>增加：</p> <p>27、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> <p>28、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；</p>
第二十四部分 基金合同内容摘要		<p>摘要部分也做了相应修改，与合同修订内容保持一致。</p>

二、 托管协议修改内容

章节	修订前	修订后
一、基金托管协议当事人	<p>(二) 基金托管人</p> <p>名称：北京银行股份有限公司</p> <p>住所：北京市西城区金融大街甲 17 号</p> <p>法定代表人：闫冰竹</p> <p>电话：(010) 66223584</p> <p>传真：(010) 66226045</p> <p>联系人：王曦</p> <p>成立时间：1996 年 1 月 29 日</p> <p>组织形式：股份有限公司(上市)</p> <p>注册资本：人民币 88 亿元</p> <p>批准设立机关和设立文号：中国人民银行 1995 年 12 月 28 日《关于北京城市合作银行开业的批复》(银复[1995]470 号)</p> <p>存续期间：持续经营</p>	<p>(二) 基金托管人</p> <p>名称：北京银行股份有限公司</p> <p>住所：北京市西城区金融大街甲 17 号首层</p> <p>法定代表人：张东宁</p> <p>电话：(010) 66223584</p> <p>传真：(010) 66226045</p> <p>联系人：王曦</p> <p>成立时间：1996 年 1 月 29 日</p> <p>组织形式：股份有限公司</p> <p>注册资本：人民币 1520667.5685 万元</p> <p>批准设立机关和设立文号：中国人民银行 1995 年 12 月 28 日《关于北京城市合作银行开业的批复》(银复[1995]470 号)</p> <p>存续期间：持续经营</p>
二、基金托管协议的依据、	<p>订立本协议的依据是《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</p>	<p>订立本协议的依据是《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</p>

<p>目的和原则</p>	<p>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》)、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第7号〈托管协议的内容与格式〉》、《景顺长城景颐丰利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。</p>	<p>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》)、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第7号〈托管协议的内容与格式〉》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》、《景顺长城景颐丰利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。</p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>	<p>(1) 按法律法规的规定及《基金合同》的约定,本基金的投资资产配置比例为:</p> <p>基金的投资组合比例为:本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的80%;股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的20%,其中,本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的3%;现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。</p>	<p>(1) 按法律法规的规定及《基金合同》的约定,本基金的投资资产配置比例为:</p> <p>基金的投资组合比例为:本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的80%;股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的20%,其中,本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的3%;现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>	<p>(2)根据法律法规的规定及《基金合同》的约定,本基金投资组合遵循以下投资限制:</p> <p>2)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>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。</p>	<p>(2)根据法律法规的规定及《基金合同》的约定,本基金投资组合遵循以下投资限制:</p> <p>2)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、存出保证金和应收申购款等;</p> <p>增加:</p> <p>12)本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票,不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,不超过该上市公司可流通股票的30%;</p> <p>13)本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的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项所规定的比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;</p> <p>除上述第2)、8)、13)项外,因证券市场波动、证券发行人合并、基</p>

		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	<p>6、基金托管人对基金投资流通受限证券的监督</p> <p>(2) 流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>	<p>6、基金托管人对基金投资流通受限证券的监督</p> <p>(2) 流通受限证券，与上文提到的流动性受限资产并不完全一致，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>
八、基金资产净值计算和会计核算	<p>2、估值方法</p> <p>(2) 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>③首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>	<p>2、估值方法</p> <p>(2) 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>③流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等（不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票），按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>
八、基金资产净值计算和会计核算		<p>(二) 基金资产估值方法增加：</p> <p>(5) 当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。</p>
八、基金资产净值计算和会计核算		<p>(六) 暂停估值的情形增加：</p> <p>3、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时，经与基金托管人协商确认后，应当暂停估值；</p>
十、信息披露		<p>(三) 暂停或延迟信息披露的情形增加：</p> <p>3、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时，经与基金托管人协商确认后暂停估值；</p>