

景顺长城基金管理有限公司关于修改景顺长城核心竞争力混合型证券投资基金基金合同及托管协议的公告

根据中国证监会 2017 年 8 月 31 日发布的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《规定》”),对已经存续的开放式基金,原基金合同内容不符合该《规定》的,应当在《规定》施行之日起 6 个月内予以调整。

根据《规定》等法律法规,经与本基金托管人中国农业银行股份有限公司(以下简称“农业银行”)协商一致,并报监管机构备案,景顺长城基金管理有限公司(以下简称“本公司”)对旗下托管在农业银行的景顺长城核心竞争力混合型证券投资基金的基金合同和托管协议进行了修改,具体修改内容见附件。

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。

上述修改系因相应的法律法规发生变动而进行的修改,且对基金份额持有人利益无实质性不利影响,并已履行了规定的程序,符合相关法律法规的规定及对应基金合同的约定。

依据《规定》“基金管理人应当强化对投资者短期投资行为的管理,对除货币市场基金与交易型开放式指数基金以外的开放式基金,对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5%的赎回费,并将上述赎回费全额计入基金财产”的规定,我司将按照法规要求对本基金 A 类别基金份额持续持有期少于 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本基金的基金财产。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。

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：

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

一、 基金合同主要修订内容

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		增加： 67、《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 68、流动性受限资产： 指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在10个交易日以上的逆回购与银行定期存款(含协议约定有条件提前支取的银行存款)、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等
六、基金份额的申购与赎回	(五)申购和赎回的数额限制 1、基金管理人可以规定基金投资者首次申购和每笔申购的最低金额以及每笔赎回的最低份额，具体规定请参见招募说明书。 2、基金管理人可以规定基金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。	(五)申购和赎回的数额限制 1、基金管理人可以规定基金投资者首次申购和每笔申购的最低金额以及每笔赎回的最低份额，具体规定请参见招募说明书。 2、基金管理人可以规定基金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>3、基金管理人可以规定单个投资者累计持有的基金份额数量或持有的基金份额占基金份额总数的比例上限，具体规定请参见招募说明书。</p> <p>4、基金管理人可以根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述规定的数量或比例限制。基金管理人必须在调整前依照有关规定在指定媒体上公告。</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数量或持有的基金份额占基金份额总数的比例上限，具体规定请参见招募说明书。</p> <p>4、基金管理人可以根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述规定的数量或比例限制。基金管理人必须在调整前依照有关规定在指定媒体上公告。</p> <p>5、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。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、基金份额的申购与赎回</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5%，赎回费率最高不超过基金份额赎回金额的5%。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。</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A类别基金份额投资者，本基金将收取不低于1.5%的赎回费并全额计入基金财产。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。</p>
<p>六、基金份额的申购与赎回</p>	<p>(八)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基金投资者的申购申请：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、因不可抗力导致基金无法正常运作； 2、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； 3、发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况； 4、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或注册登记机构的技术保障不充分或人员伤亡等异常情况导致基金销售系统或基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行； 	<p>(八)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基金投资者的申购申请：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、因不可抗力导致基金无法正常运作； 2、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； 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。

	<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，或基金管理人认为会损害已有基金份额持有人利益的申购；</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、因销售地区不同导致本基金结算安排无法得到满足；</p> <p>8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述除第 6 项以外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体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>4、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或注册登记机构的技术保障不充分或人员伤亡等异常情况导致基金销售系统或基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行；</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，或基金管理人认为会损害已有基金份额持有人利益的申购；</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、因销售地区不同导致本基金结算安排无法得到满足；</p> <p>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>9、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述除第 6、8 项以外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体上刊登暂停申购公告。如果基金投资者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>六、基金份额的申购与赎回</p>	<p>(九)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基金投资者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、证券交易所交易时间依法决定临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</p> <p>3、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难。</p> <p>4、发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。</p> <p>5、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p>	<p>(九)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基金投资者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、证券交易所交易时间依法决定临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</p> <p>3、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难。</p> <p>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考的活跃市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、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。
六、基金份额的申购与赎回	<p>(十)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前一日基金总份额的 10%的前提下,对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请,应当按基金份额持有人提交的每笔赎回申请量占赎回申请总量的比例,确定该笔赎回申请当日部分确认的赎回份额;对于 A 类别基金份额的基金投资者未能赎回部分,投资者在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。A 类别基金份额选择延期赎回的,将自动转入下一个开放日继续赎回,直到全部赎回为止;A 类别基金份额选择取消赎回的,当日未获赎回的部分申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理,无优先权并以该开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额,并以此类推,直到全部赎回为止。如基金投资者在提交赎回申请时未作明确选择,投资者未能赎回部分作自动延期赎回处理。对于 H 类别基金份额的未受理部分,默认采用延期赎回方式,并自动转入下一个 H 类基金份额的开放日继续赎回,直到全部赎回为止;延期的赎回申请与下一 H 类基金份额开放日的赎回申请一并处理,无优先权并以下一 H 类基金份额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。顺延赎回不受 H 类基金份额单笔赎回最低份额的限制。在延期赎回期内,基金管理人有权根据香港销售机构的申请,取消 H 份额类别的部分或全部延期赎回申请。</p> <p>当发生巨额赎回并延期办理时,基金管理人将依据中国证监会与香港证监会的相关要求,进行相关披露。</p>	<p>(十)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前一日基金总份额的 10%的前提下,对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请,应当按基金份额持有人提交的每笔赎回申请量占赎回申请总量的比例,确定该笔赎回申请当日部分确认的赎回份额;对于 A 类别基金份额的基金投资者未能赎回部分,投资者在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。A 类别基金份额选择延期赎回的,将自动转入下一个开放日继续赎回,直到全部赎回为止;A 类别基金份额选择取消赎回的,当日未获赎回的部分申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理,无优先权并以该开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额,并以此类推,直到全部赎回为止。如基金投资者在提交赎回申请时未作明确选择,投资者未能赎回部分作自动延期赎回处理。对于 H 类别基金份额的未受理部分,默认采用延期赎回方式,并自动转入下一个 H 类基金份额的开放日继续赎回,直到全部赎回为止;延期的赎回申请与下一 H 类基金份额开放日的赎回申请一并处理,无优先权并以下一 H 类基金份额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。顺延赎回不受 H 类基金份额单笔赎回最低份额的限制。在延期赎回期内,基金管理人有权根据香港销售机构的申请,取消 H 份额类别的部分或全部延期赎回申请。</p> <p>若进行上述延期办理,在单个 A 类别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</p>

		<p>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>当发生巨额赎回并延期办理时，基金管理人将依据中国证监会与香港证监会的相关要求，进行相关披露。</p>
七、基金合同当事人及权利义务	(一)基金管理人 1、基金管理人简况 法定代表人：赵如冰	(一)基金管理人 1、基金管理人简况 法定代表人：杨光裕
七、基金合同当事人及权利义务	(二)基金托管人 1、基金托管人简况 法定代表人：刘士余	(二)基金托管人 1、基金托管人简况 法定代表人：周慕冰
十二、基金的投资	<p>(三)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、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 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>本基金投资于具有核心竞争力的</p>	<p>(三)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、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 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</p>

	<p>公司股票的资产不低于基金股票资产的 80%。</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>金和应收申购款等)。</p> <p>本基金投资于具有核心竞争力的公司股票的资产不低于基金股票资产的 80%。</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>
十二、基金的投资	<p>(八) 投资限制</p> <p>5、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>(八) 投资限制</p> <p>5、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>
十二、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>
十二、基金的投资	<p>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。因证券或期货市场波动、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投资比</p>	<p>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 5、12、13 项外，因证券或期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致</p>

	例的,基金管理人应当在 10 个交易日 内进行调整。法律法规另有规定时, 从其规定。	使基金投资比例不符合上述投资比 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 时,从其规定。
十四、基 金资产 的 估值	(四) 估值方法 1、股票估值方法: (2) 未上市股票的估值: ③首次公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 确定公允价值。	(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 业协会有关规定确定公允价值。
第十四部 分基金资 产的估值	(七) 暂停估值的情形	(七) 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时,经与基 金托管人协商确认后,应当暂停估 值;
第十八部 分基金 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 A 类别基金份额 单一投资者或 H 类别基金份额名 义持有人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 资者利益,基金管理人至少应当在定 期报告“影响投资者决策的其他重要 信息”项下披露该 A 类别基金份额 投资者或该 H 类别基金份额名 义持有人的类别、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	7、临时报告	7、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;
第二十四 部分基金 合同内容		摘要部分也做了相应修改,与合 同修订内容保持一致。

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>(一) 基金管理人</p> <p>法定代表人：赵如冰</p>	<p>(一) 基金管理人</p> <p>法定代表人：杨光裕</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：刘士余</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	<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限于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、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>本基金的配置比例为： 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%。</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</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限于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、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>本基金的配置比例为： 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%，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</p>

	规则。	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。
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>3、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>3、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>增加:</p> <p>9、本基金管理人管理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>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	<p>因证券或期货市场波动、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1-5项以及7-10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>	<p>除上述3、6、10、11项外,因证券或期货市场波动、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	(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。	(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>基金管理人的业务监督和核查</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>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>
<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) 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一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>(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) 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>(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>(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(以下简称“指定报刊”)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>(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(以下简称“指定报刊”)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</p>

	<p>(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>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>
--	--	---