

上投摩根基金管理有限公司

关于修改上投摩根行业轮动混合型证券投资基金基金合同的公告

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定以及上投摩根行业轮动混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金合同的有关约定，经与本基金的基金托管人协商一致，上投摩根基金管理有限公司（以下简称“本公司”）决定按照中国证监会于2018年6月6日颁布并实施的《存托凭证发行与交易管理办法（试行）》以及中国证监会于2020年7月10日颁布、同年8月1日实施的《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》和本基金的基金合同的有关规定，就本基金参与存托凭证投资、引入侧袋机制事宜修改基金合同，并相应修改托管协议的相关内容，现将相关修改事项公告如下：

一、本次修改的基本情况

1、根据中国证监会2018年6月6日颁布并自公布之日起施行的《存托凭证发行与交易管理办法（试行）》的规定，就本基金参与存托凭证投资相关事宜对基金合同等法律文件进行了修订，主要包括明确投资范围包含存托凭证、增加存托凭证的投资策略、投资比例限制、估值方法等。

2、根据中国证监会2020年7月10日颁布并自2020年8月1日起施行的《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》的规定，就引入侧袋机制的事宜对基金合同等法律文件进行了修订，主要包括增加侧袋机制实施的条件、侧袋机制实施期间的基金申购与赎回、投资、估值、费用、收益分配、信息披露及持有人大会安排等。

二、本次修订的主要内容

（一）针对基金参与存托凭证投资的修订

针对基金参与存托凭证投资的修订具体涉及基金合同中的前言、基金的投资、基金资产的估值等章节的内容，具体为：

1、在基金合同的“一、前言”部分增加投资存托凭证的风险揭示如下：

“本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险。”

2、对基金合同的“十二、基金的投资”部分的修订

(1) 明确“(二)投资范围”中包含存托凭证，将“(二)投资范围”修订为：

“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A股、**存托凭证**、国债、金融债、企业债、央行票据、可转换债券、权证及国家证券监管机构允许基金投资的其它金融工具。本基金投资组合的资产配置范围为：股票资产占基金资产的60%—95%；债券、权证、现金、货币市场工具及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具占基金资产的5%—40%；其中，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低于5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金将不低于80%的股票资产投资于强势行业中具有核心竞争优势的上市公司股票。

(2) 在“(三)投资策略”中增加存托凭证投资策略描述如下：

“7. 存托凭证投资策略

本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。”

(3) 在“(六)投资限制”中增加存托凭证投资限制描述如下：

“(20) 本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行，并与境内上市交易的股票合并计算，法律法规或监管机构另有规定的从其规定；”

3、对基金合同“十四、基金资产的估值”部分的修订

(1) 在“(二)估值方法”中增加存托凭证估值方法描述如下：

“(5) 本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市执行的股票执行。”

(2) 在“(三)估值对象”中增加存托凭证作为估值对象的描述如下：

“基金所拥有的股票、**存托凭证**、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产。”

4、本基金将在更新的招募说明书中揭示投资存托凭证的风险。

5、托管协议涉及上述内容的条款已一并调整。

(二) 针对基金引入侧袋机制的修订

针对基金引入侧袋机制的修订具体涉及基金合同中的前言、释义、基金份额的申购与赎回、基金合同当事人及权利义务、基金份额持有人大会、基金的投资、基金资产的估值、基金的费用与税收、基金的收益与分配、基金的信息披露等章节的内容, 具体为:

1、在基金合同中的“一、前言”部分中增加对基金管理人启用侧袋机制的说明, “前言”部分增加描述如下:

“当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时, 基金管理人履行相应程序后, 可以启用侧袋机制, 具体详见基金合同和招募说明书的有关章节。侧袋机制实施期间, 基金管理人将对基金简称进行特殊标识, 并不办理侧袋账户的申购赎回。请基金份额持有人仔细阅读相关内容并关注本基金启用侧袋机制时的特定风险。”

2、在基金合同的“二、释义”部分增加“侧袋机制”和“特定资产”的释义如下:

“60.侧袋机制: 指将基金投资组合中的特定资产从原有账户分离至一个专门账户进行处置清算, 目的在于有效隔离并化解风险, 确保投资者得到公平对待, 属于流动性风险管理工具。侧袋机制实施期间, 原有账户称为主袋账户, 专门账户称为侧袋账户”

“61.特定资产: 包括: (1) 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的资产; (2) 按摊余成本计量且计提资产减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产; (3) 其他资产价值存在重大不确定性的资产”

3、对基金合同的“六、基金份额的申购与赎回”部分的修订

(1) 在“(七) 拒绝或暂停申购的情形”处修订如下:

“6. 当特定资产占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”

(2) 在“(八) 暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形”处修订如下：

“5. 当特定资产占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，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。”

(3) 增加对“实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回”的描述如下：

“(十六) 实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回

本基金实施侧袋机制的，本基金的申购和赎回安排详见招募说明书或相关公告。”

4、对基金合同的“七、基金合同当事人及权利义务”部分“基金份额持有人”持有基金份额权益的修订如下：

“除法律法规另有规定或本基金合同另有约定外，同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。”

5、对基金合同的“八、基金份额持有人大会”部分的修订

(1) 对基金份额持有人持有的每一基金份额的投票权修订如下：

“除法律法规另有规定或本基金合同另有约定外，基金份额持有人持有的每一基金份额具有同等的投票权。”

(2) 增加实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定描述如下：

“(十) 实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定

若本基金实施侧袋机制，则相关基金份额或表决权的比例指主袋份额持有人和侧袋份额持有人分别持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例，但若相关基金份额持有人大会召集和审议事项不涉及侧袋账户的，则仅指主袋份额持有人持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例：

1、基金份额持有人行使提议权、召集权、提名权所需单独或合计代表相关基金份额 10%以上（含 10%）；

2、现场开会的到会者在权益登记日代表的基金份额不少于本基金在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；

3、通讯开会的直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二

分之一);

4、当参与基金份额持有人大会投票的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日相关基金份额的二分之一，召集人在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内就原定审议事项重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上(含三分之一)相关基金份额的持有人参与或授权他人参与基金份额持有人大会投票；

5、现场开会由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的50%以上(含50%)选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人；

6、一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上(含二分之一)通过；

7、特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过。

侧袋机制实施期间，基金份额持有人大会审议事项涉及主袋账户和侧袋账户的，应分别由主袋账户、侧袋账户的基金份额持有人进行表决，同一主侧袋账户内的同一类别每份基金份额具有平等的表决权。表决事项未涉及侧袋账户的，侧袋账户份额无表决权。

侧袋机制实施期间，关于基金份额持有人大会的相关规定以本节特殊约定内容为准，本节没有规定的适用上文相关约定。”

6、在基金合同的“十二、基金的投资”部分增加侧袋机制的实施和投资运作安排描述如下：

“(九) 侧袋机制的实施和投资运作安排

当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制，无需召开基金份额持有人大会审议。

侧袋机制实施期间，本部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。

侧袋账户的实施条件、实施程序、运作安排、投资安排、特定资产的处置变

现和支付等对投资者权益有重大影响的事项详见招募说明书的规定。”

7、对基金合同的“十四、基金资产的估值”部分的修订

(1) 对“(六) 暂停估值的情形”部分修订如下：

“4. 当特定资产占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，应当暂停基金估值。”

(2) 增加实施侧袋机制期间的基金资产估值描述如下：

“(八) 实施侧袋机制期间的基金资产估值

本基金实施侧袋机制的，应根据本部分的约定对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的基金份额净值和基金份额累计净值，暂停披露侧袋账户基金份额净值。”

8、在基金合同的“十五、基金的费用与税收”部分增加实施侧袋机制期间的基金费用描述如下：

“(六) 实施侧袋机制期间的基金费用

本基金实施侧袋机制的，与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费，详见招募说明书的规定。”

9、在基金合同的“十六、基金的收益与分配”部分增加实施侧袋机制期间的收益分配描述如下：

“(六) 实施侧袋机制期间的收益分配

本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配，详见招募说明书的规定。”

10、在基金合同的“十八、基金的信息披露”部分的“公开披露的基金信息”增加实施侧袋机制期间的信息披露描述如下：

“(十二) 实施侧袋机制期间的信息披露

本基金实施侧袋机制的，相关信息披露义务人应当根据法律法规、基金合同和招募说明书的规定进行信息披露，详见招募说明书的规定。”

11、本基金将在更新的招募说明书中补充“侧袋机制”章节并揭示启用侧袋机制的风险。

12、托管协议涉及上述内容的条款已一并调整。

三、重要提示

对于本次基金合同修改的内容，托管协议、招募说明书及基金产品资料概要对应内容也随之相应修改。具体修改内容请见登载于本公司网站(www.cifm.com)和中国证监会基金电子披露网站(<http://eid.csrc.gov.cn/fund>)的更新后的基金合同、托管协议、招募说明书及基金产品资料概要。

本次依据《存托凭证发行与交易管理办法（试行）》、《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》对本基金的基金合同所做的修订，对基金份额持有人利益无实质不利影响，且系因相应的法律法规发生变动而对基金合同进行修订，根据本基金基金合同的约定，本次修订不需要召开基金份额持有人大会。

本次修订自2021年5月28日起生效。

投资者可拨打客户服务电话(400-889-4888)或登录本公司网站(www.cifm.com)咨询相关信息。

风险提示：

本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其将来表现，基金管理人所管理的其他基金的业绩并不构成对基金业绩表现的保证。投资有风险，敬请投资者认真阅读基金的相关法律文件，并选择适合自身风险承受能力的投资品种进行投资。

特此公告。

上投摩根基金管理有限公司

2021年5月28日