

# 关于以通讯方式召开前海开源沪港深新机遇灵活配置 混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性 公告

前海开源基金管理有限公司已于 2017 年 8 月 24 日在中国证监会指定媒介发布了《关于以通讯方式召开前海开源沪港深新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》。并于 2017 年 8 月 25 日在中国证监会指定媒介发布了《关于以通讯方式召开前海开源沪港深新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告》。为了使本次基金份额持有人大会顺利召开,现发布关于召开本次会议的第二次提示性公告。

## 一、召开会议基本情况

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》等法律法规的规定和《前海开源沪港深新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关约定,前海开源沪港深新机遇灵活配置混合型证券投资基金(以下简称前海开源沪港深新机遇混合或本基金,基金代码:002860)的基金管理人前海开源基金管理有限公司(以下简称本公司)经与本基金的基金托管人中国农业银行股份有限公司协商一致,决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会,会议的具体安排如下:

1、会议召开方式:通讯方式。

2、会议投票表决起止时间:自 2017 年 8 月 24 日起,至 2017 年 9 月 22 日 17:00 止(以基金管理人收到表决票时间为准)。

3、会议通讯表决票的寄达地点

基金管理人:前海开源基金管理有限公司

办公地址:广东省深圳市福田区深南大道 7006 号万科富春东方大厦 10 层

联系人:陈亮羽

联系电话:0755-83180379

邮政编码:518040

## 二、会议审议事项

《关于修改前海开源沪港深新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》(具体详见附件一)。

## 三、基金份额持有人大会的权益登记日

本次大会的权益登记日为 2017 年 8 月 24 日，即在权益登记日当日交易时间结束后，在前海开源基金管理有限公司登记在册的本基金的全体基金份额持有人均有权参加本次基金份额持有人大会。

#### 四、表决票的填写和寄交方式

1、本次会议表决票详见附件二。基金份额持有人可从相关报纸上剪裁、复印或登录本基金管理人网站（[www.qhkyfund.com](http://www.qhkyfund.com)）下载并打印表决票。

2、基金份额持有人应当按照表决票的要求填写相关内容，其中：

（1）个人投资者自行投票的，需在表决票上签字，并提供本人身份证复印件；

（2）机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章（或基金管理人认可的其他印章，下同），并提供加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；

（3）个人投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供被代理的个人投资者身份证复印件，以及填妥的授权委托书原件（具体详见附件三）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；

（4）机构投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供被代理持有人的加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等），以及填妥的授权委托书原件（具体详见附件三）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

3、基金份额持有人或其代理人需将填妥的表决票和所需的相关文件自 2017 年 8 月 24 日起，至 2017 年 9 月 22 日 17:00 以前（以基金管理人收到表决票时间为准）通过专人送交或邮寄的方式送达至本公司指定的办公地址，请在信封表面注明：前海开源沪港深新机遇混合基金份额持有人大会表决专用。

会议通讯表决票的寄达地点如下：

基金管理人：前海开源基金管理有限公司

办公地址：广东省深圳市福田区深南大道 7006 号万科富春东方大厦 10 层

邮政编码：518040

联系人：陈亮羽

联系电话：0755-83180379

#### 五、计票

1、本次会议的计票方式为：由本基金管理人授权的两名监票人在基金托管人（中国农业银行股份有限公

司)授权代表的监督下进行计票,并由公证机关对其计票过程予以公证。

2、基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权,且每份基金份额享有平等的表决权。

3、表决票效力的认定如下:

(1) 表决票填写完整清晰,所提供文件符合本会议通知规定,且在截止时间之前送达指定联系地址的,为有效表决票;有效表决票按表决意见计入相应的表决结果,其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

(2) 如表决票上的表决意见未选或表决意见空白、表决意见模糊不清或相互矛盾,但其他各项符合会议通知规定的,视为弃权表决,计入有效表决票;并按弃权计入对应的表决结果,其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

(3) 如表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的,或未能提供有效证明基金份额持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的,或未能在截止时间之前送达指定联系地址的,均为无效表决票;无效表决票不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

(4) 基金份额持有人重复提交表决票的,如各表决票表决意见相同,则视为同一表决票;如各表决票表决意见不相同,则按如下原则处理:

送达时间不是同一天的,以最后送达的填写有效的表决票为准,先送达的表决票视为被撤回;

送达时间为同一天的,视为在同一表决票上做出了不同表决意见,计入弃权表决票;

送达时间按如下原则确定:专人送达的以实际递交时间为准,邮寄的以基金管理人收到的时间为准。

## 六、决议生效条件

1、本人直接出具表决意见和授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的50%以上(含50%);

2、本次议案审议事项经出席会议的基金份额持有人及代理人所持表决权的50%以上(含50%)通过方为有效;

3、本次基金份额持有人大会决议通过的事项,本基金管理人自通过之日起五日内报中国证监会备案,基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。

## 七、二次召集基金份额持有人大会及二次授权

如果本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见基金份额持有人持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一,则召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月后、六个月以内,就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应有代表三分之一以上(含三分之一)基金份额的持有人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见。根据2013年6月1日生效的新修订的《基金法》,本基金管理人可在规定时间内就同一议案重新召集基金份额持有人大会。

重新召开基金份额持有人大会时,除非授权文件另有载明,本次基金份额持有人大会授权期间基金份额持有人作出的各类授权依然有效,但如果授权方式发生变化或者基金份额持有人重新作出授权,则以最新方式或最新授权为准,详细说明见届时发布的重新召集基金份额持有人大会的通知。

#### 八、本次大会相关机构

1、召集人（基金管理人）：前海开源基金管理有限公司

2、基金托管人：中国农业银行股份有限公司

3、公证机关：北京市中信公证处

4、律师事务所：上海源泰律师事务所

#### 九、重要提示

1、请基金份额持有人在提交表决票时，充分考虑邮寄在途时间，提前寄出表决票。

2、本次基金份额持有人大会有关公告可通过本公司网站 [www.qhkyfund.com](http://www.qhkyfund.com) 查阅，投资者如有任何疑问，可致电本公司客户服务电话 4001-666-998 咨询。

3、本通知的有关内容由前海开源基金管理有限公司负责解释。

附件一：《关于修改前海开源沪港深新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》

附件二：《前海开源沪港深新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决票》

附件三：《授权委托书》

附件四：《前海开源沪港深新机遇灵活配置混合型证券投资基金对法律文件的修改说明》

前海开源基金管理有限公司

二〇一七年八月二十八日

附件一

关于修改前海开源沪港深新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案

前海开源沪港深新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人：

为提高基金资产的运作效率，保护基金份额持有人利益，前海开源基金管理有限公司依据《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》和《前海开源沪港深新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，经与基金托管人中国农业银行股份有限公司协商一致，现提议对《前海开源沪港深新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金合同》按照《前海开源沪港深新机遇灵活配置混合型证券投资基金对法律文件的修改说明》（见附件四）的内容进行修改，并相应修改《前海开源沪港深新机遇灵活配置混合型证券投资基金托管协议》相关内容。

以上议案，请予审议。

基金管理人：前海开源基金管理有限公司

二〇一七年八月二十四日

附件二

前海开源沪港深新机遇灵活配置混合型证券投资基金

基金份额持有人大会表决票

基金份额持有人姓名或名称

证件号码（身份证号/营业执照号）

基金账号

受托人（代理人）姓名/名称：

受托人（代理人）证件号码（身份证号/营业执照号）：

审议事项 同意 反对 弃权

关于修改前海开源沪港深新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案

基金份额持有人/受托人（代理人）签名或盖章

年月日

说明：

- 1、请以标记在审议事项后标明表决意见。持有人必须选择一种且只能选择一种表决意见。表决意见代表基金份额持有人所持全部基金份额的表决意见。
- 2、表决意见未选、多选、模糊不清或相互矛盾的，视为弃权表决；表决票上的签字/盖章部分填写不完整、不清晰的，或未能提供有效证明持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的，或未能在截止时间之前送达指定联系地址的，视为无效表决。
- 3、本表决票中证件号码，仅指基金份额持有人认购、申购本基金时所使用的证件号码或该证件号码的更新。基金账号错填、漏填但不影响认定基金份额持有人身份的，不影响表决票效力。

（本表决票可剪报、复印或登录本基金管理人网站（[www.qhkyfund.com](http://www.qhkyfund.com)）下载并打印，在填写完整并签字盖章后均为有效。）

附件三

授权委托书

兹委托先生/女士/公司代表本人（或本机构）参加投票截止日为 2017 年月日的以通讯方式召开的前海开源沪港深新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会，并代为全权行使对所有议案的表决权。授权有效期自签署日起至本次基金份额持有人大会会议结束之日止。若前海开源沪港深新机遇灵活配置混合型证券投资基金重新召开审议相同议案的基金份额持有人大会的，本授权继续有效。

委托人（签字/盖章）：

委托人身份证号或营业执照号：

委托人前海开源基金账户号：

受托人（代理人）（签字/盖章）：

受托人（代理人）身份证号或营业执照号：

委托日期：年月日

附注：

- 1、此授权委托书可剪报、复印或按以上格式自制、在填写完整并签字盖章后均为有效。
- 2、本授权委托书中委托人身份证号或营业执照号，指基金份额持有人认购、申购本基金时的证件号码或该证件号码的更新。
- 3、受托人的表决意见代表委托人本基金账户下全部基金份额的表决意见。

附件四

前海开源沪港深新机遇灵活配置混合型证券投资基金

对法律文件的修改说明

《前海开源沪港深新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》）于2016年08月30日生效，考虑到持有人的利益，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》等相关法律法规，本基金修订投资范围、投资策略、投资限制、业绩比较基准等事项需召开基金份额持有人大会，对本基金基金合同修改内容进行审议。需修改的合同条款列示如下：

一、《前海开源沪港深新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金合同》修改内容

章节 原文 修订后内容

第一部分前言 无 六、本基金投资内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所有限公司上市的股票的，将承担汇率风险以及境外市场的风险。

第二部分释义 13、《沪港通试点规定》：指中国证监会2014年6月13日颁布并实施的《沪港股票市场交易互联互通机制试点若干规定》及颁布机关对其不时做出的修订

14、《沪港通试点办法》：指上海证券交易所2014年9月26日颁布并实施的《上海证券交易所沪港通试点办法》

15、《沪港通交易指引》：指中国证监会2015年03月27日颁布并实施的《公开募集证券投资基金参与沪港通交易指引》

16、《沪港通登记、存管、结算业务实施细则》：指中国证券登记结算有限公司2014年9月26日颁布、实施的《沪港股票市场交易互联互通机制试点登记、存管、结算业务实施细则》

17、港股通：指内地投资者委托内地证券公司，经由上海证券交易所设立的证券交易服务公司，向香港联

合交易所进行申报，买卖规定范围内的香港联合交易所上市的股票

36、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日（若该工作日为非港股通交易日，则本基金不开放基金份额申购、赎回或其他业务）

13、港股通：指内地投资者委托内地证券公司，经由上海证券交易所和深圳证券交易所设立的证券交易服务公司，向香港联合交易所有限公司（以下简称香港联合交易所）进行申报，买卖规定范围内的香港联合交易所上市的股票

36、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

## 第六部分基金份额的申购与赎回 二、申购和赎回的开放日及时间

### 1、开放日及开放时间

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，本基金的申购与赎回的开放日为上海证券交易所、深圳证券交易所、香港联合交易所的正常交易日（若该交易日为非港股通交易日，则本基金不开放申购与赎回），具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。开放日的具体业务办理时间在招募说明书或相关公告中载明。

### 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：

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。

发生上述第 1、2、3、5、6、7 项暂停申购情形

## 二、申购和赎回的开放日及时间

### 1、开放日及开放时间

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。若本基金参与港股通交易且该工作日为非港股通交易日时，则基金管理人可调整本基金的开放时间，具体安排以届时公告为准。

### 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：

3、证券、期货交易所交易时间非正常停市或者港股通临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

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、港股通交易每日额度不足。

发生上述第 1、2、3、5、6、8、9 项暂停申购情形

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：

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。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：

3、证券、期货交易所交易时间非正常停市或者港股通临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

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（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、可转换债券等）、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)。 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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制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、可转换债券等）、资产支持证券、同业存单、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)。

三、投资策略

2、股票投资策略

(3) 被错杀的公司。

本基金将通过沪港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度进行境外投资。 三、投资策略

2、股票投资策略

(3) 被错杀的公司。

本基金将通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度进行境外投资。

#### 四、投资限制

##### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

(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%；

(16) 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%；

(17) 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；

(18) 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基金持有的股票总市值的 20%；

(19) 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；

(20) 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%；

#### 四、投资限制

##### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

(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（同一家公司在境内和香港同时上市的 A+H 股合并计算），不超过该证券的 10%；

(16) 本基金参与股指期货交易，应遵循下列要求：

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%；

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；

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基金持有的股票总市值的 20%；

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；

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%；

## 五、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 35%+恒生指数收益率 35%+中证全债指数收益率 30%。

业绩比较基准选择理由：

沪深 300 指数是由中证指数公司编制发布、表征 A 股市场走势的权威指数。该指数是由上海和深圳证券交易所市场中选取 300 只 A 股作为样本编制而成的成份股指数。其样本覆盖了沪深市场六成左右的市值，具有良好的市场代表性。本基金选择该指数来衡量 A 股投资部分的绩效。

恒生指数是由恒生指数服务有限公司编制，以香港股票市场中的 50 家上市股票为成份股样本，以其发行量为权数的加权平均股价指数，是反映香港股市价幅趋势最有影响的一种股价指数。本基金选择该指数来衡量港股投资部分的绩效。

中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数。该指数的样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成，中证指数公司每日计算并发布中证全债的收盘指数及相应的债券属性指标。该指数的一个重要特点在于对异常价格和无价情况下使用了模型价，能更为真实地反映债券的实际价值和收益率特征。本基金选择该指数来衡量债券投资部分的绩效。

根据本基金的投资范围和投资比例约束，设定本基金的基准为沪深 300 指数收益率 35%+恒生指数收益率 35%+中证全债指数收益率 30%，该基准能客观衡量本基金的投资绩效。

## 五、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 40%+恒生指数收益率 40%+中证全债指数收益率 20%。

业绩比较基准选择理由：

沪深 300 指数是由中证指数有限公司编制发布、表征 A 股市场走势的权威指数。该指数是由上海和深圳证券交易所市场中选取 300 只 A 股作为样本编制而成的成份股指数。其样本覆盖了沪深市场六成左右的市值，具有良好的市场代表性。本基金选择该指数来衡量 A 股投资部分的绩效。

恒生指数是由恒生指数服务有限公司编制，以香港股票市场中的 50 家上市股票为成份股样本，以其发行量为权数的加权平均股价指数，是反映香港股市价幅趋势最有影响的一种股价指数。本基金选择该指数来衡量港股投资部分的绩效。

中证全债指数是中证指数有限公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数。该指数的样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成，中证指数有限公司每日计算并发布中证全债的收盘指数及相应的债券属性指标。该指数的一个重要特点在于对异常价格和无价情况下使用了模型价，能更为真实地反映债券的实际价值和收益率特征。本基金选择该指数来衡量债券投资部分的绩效。

根据本基金的投资范围和投资比例约束，设定本基金的基准为沪深 300 指数收益率 40%+恒生指数收益率

40%+中证全债指数收益率 20%，该基准能客观衡量本基金的投资绩效。

#### 第十四部分

##### 基金资产估值 三、估值方法

###### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

###### 八、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。

##### 三、估值方法

###### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

7、对于按照中国法律法规和基金投资内地与香港股票市场交易互联互通机制涉及的境外交易场所所在地的法律法规规定应交纳的各项税金，本基金将按权责发生制原则进行估值；对于因税收规定调整或其他原因导致基金实际交纳税金与估算的应交税金有差异的，基金将在相关税金调整日或实际支付日进行相应的估值调整。

###### 八、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。

#### 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

##### 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

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。

(十二) 基金投资香港联合交易所上市股票的相关公告

基金管理人应当在基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中按届时有效的法律法规或监管机构的要求披露港股通标的股票的投资情况。若中国证监会对公开募集证券投资基金通过沪港股票市场交易互联互通机制投资香港股票市场的信息披露另有规定的，从其规定。

(十二) 基金投资香港联合交易所上市股票的相关公告

基金管理人应当在基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中按届时有效的法律法规或监管机构的要求披露港股通标的股票的投资情况。若中国证监会对公开募集

证券投资基金通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资香港股票市场的信息披露另有规定的，从其规定。

## 第二十四部分

基金合同内容摘要 对上述相应修订内容进行修订。

### 二、《前海开源沪港深新机遇灵活配置混合型证券投资基金托管协议》修改内容

章节 原文 修订后内容

全文 本基金合同 基金合同

#### 三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查 (一)

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、可转换债券等）、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)。(一)

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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制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、可转换债券等）、资产支持证券、同业存单、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)。

(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：

4、本基金管理人管理的、且由本基金托管人托管的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%；

17、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%；

18、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；

19、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基金持有的股票总市值的 20%；

20、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；

21、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%；

（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：

4、本基金管理人管理的、且由本基金托管人托管的全部基金持有一家上市公司发行的证券（同一家公司在境内和香港同时上市的 A+H 股合并计算），不超过该证券的 10%；

17、本基金参与股指期货交易，应遵循下列要求：

（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%；

（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；

（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基金持有的股票总市值的 20%；

（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；

（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%；

（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。

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。

（八）基金管理人应在基金首次投资中期票据或中小企业私募债券前，与基金托管人签署相应的风险控制补充协议，并按照法律法规的规定和补充协议的约定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中期票据或中小企业私募债券的投资管理制度。

（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。

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。

删除

六、指令的发送、确认及执行 （八）其他事项

2、除因其自身原因致使基金的利益受到损害而负赔偿责任外，基金托管人按照法律法规、本合同的规定执行基金管理人指令而引起的任何可能发生的损失，均由基金管理人负责。（八）其他事项

2、除因其自身原因致使基金的利益受到损害而负赔偿责任外，基金托管人按照法律法规、本协议的规定执行基金管理人指令而引起的任何可能发生的损失，均由基金管理人负责。

## 七、交易及清算交收安排（二）基金投资证券后的清算交收安排

### （二）基金投资证券后的清算交收安排

#### 2、港股通证券交易及清算交收安排

港股通交易的境内结算由基金托管人通过中国证券登记结算有限责任公司（以下简称中国结算）根据相关业务规则组织完成。香港中央结算有限公司（以下简称香港结算）因无法交付证券对中国结算实施现金结算的，中国结算参照香港结算的处理原则进行相应业务处理；香港结算发生破产而导致其未全部履行对中国结算的交收义务的，由中国结算协助向香港结算追索，中国结算和基金托管人不承担由此产生的相关损失。

港股通交易各项业务的收付款时点按如下约定：

#### （1）交易资金

对于 T 日港股通交易的清算结果为净应付的，基金管理人应保证在 T+1 日 14:00 前托管账户有足够的资金用于交易所的证券交易资金清算，如基金的资金头寸不足，则基金托管人应按照中国结算的有关规定办理。对于 T 日港股通交易清算结果为净应付的，基金托管人于 T+1 日 14:00 之前扣收应付资金。

对于 T 日港股通交易的清算结果为净应收的，基金托管人于 T+3 日上午 12:00 前返还应收资金。

#### （2）风控资金、红利/公司收购资金、证券组合费

对于 T 日清算的风控资金、红利/公司收购资金、证券组合费，如为净应付的，基金管理人应保证在 T+1 日上午 10:00 前托管账户有足够的资金，托管人于 T+1 日上午 10:00 扣收委托人的净应付资金。

对于 T 日清算的风控资金、红利/公司收购资金，如为净应收的，托管人于 T+1 日上午 12:00 前返还应收资金。

基金托管人负责差额缴款、按金等风控资金的计算，基金管理人应按照基金托管人的计算结果按时缴纳风控资金。

对于遇恶劣天气等原因导致延迟交收时，若托管资产为净应付的，则仍按前述约定的时间进行扣收；若托管资产为净应收的，则交收时间视中国结算向基金托管人的支付情况确定。

基金管理人应做好头寸管理，避免因延迟交收而导致的透支。

由于基金管理人或基金托管人原因导致基金资金透支、超买或超卖等情形的，由责任方承担相应的责任。

由于基金管理人出现资金交收违约并造成基金托管人对中国结算违约的，基金托管人有权将基金管理人相

当于交收违约金额的应收证券指定为暂不交付证券并由中国结算按其业务规则进行处理，由此造成的风险、损失和责任，由基金管理人承担。基金管理人出现证券交收违约的，基金托管人有权将相当于证券交收违约金额的资金暂不划付给基金管理人。

基金管理人知晓并认可，出于降低全市场资金成本的原因，中国结算可以依照香港结算相关业务规则，将每日净卖出证券向香港结算提交作为交收担保品。

## 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

#### （二）基金资产估值方法和特殊情形的处理

### 2、估值方法

（7）对于按照中国法律法规和基金投资内地与香港股票市场交易互联互通机制涉及的境外交易场所所在地的法律法规规定应交纳的各项税金，本基金将按权责发生制原则进行估值；对于因税收规定调整或其他原因导致基金实际交纳税金与估算的应交税金有差异的，基金将在相关税金调整日或实际支付日进行相应的估值调整。

#### （三）基金份额净值错误的处理方式

### 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。（三）基金份额净值错误的处理方式

### 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。

## 十六、托管协议的变更、终止与基金财产的清算（一）托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会备案后生效。（一）托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会备案。

## 三、《前海开源沪港深新机遇灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》修改内容

《前海开源沪港深新机遇灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》将在定期更新时根据《前海开源沪港深新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《前海开源沪港深新机遇灵活配置混合型证券投资基金托管协议》的内容进行相应修改。