

交银施罗德基金管理有限公司关于深证 300 价值交易型开放式指数 证券投资基金修改基金合同的公告

交银施罗德基金管理有限公司（以下简称“本公司”）根据中国证监会 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》的有关规定及相关监管要求，对本公司管理的深证 300 价值交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金合同作相应修改，前述修改已与基金托管人协商一致，并报监管机构备案。

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基金合同的约定。上述修改自本公告发布之日起生效。

重要提示：

1、本基金基金合同的修改内容详见附件修订对照表，本基金托管协议中相关条款根据基金合同进行修订。本公司将在网站上公布经修改后的深证 300 价值交易型开放式指数证券投资基金基金合同和托管协议，并更新基金管理人和基金托管人的相关信息。

2、本公司将在更新基金招募说明书时，对上述相关内容进行相应修订。

3、投资者可登录本公司网站（www.fund001.com，www.bocomschroder.com）或拨打本公司的客户服务电话 400-700-5000（免长途话费），（021）61055000 进行咨询、查询。

风险提示：本公司承诺以诚实信用、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。投资有风险，敬请投资人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。

交银施罗德基金管理有限公司

二〇一八年三月二十二日

附件《深证 300 价值交易型开放式指数证券投资基金基金合同》修改对照表

章节	原文内容	修改后内容
一、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。</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“《流动性规定》”)和其他有关法律法规。</p>
二、释义		<p>新增内容如下:</p> <p>13、《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>.....</p> <p>66、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>
八、基金份额的申购与赎回	(五) 申购和赎回的数额限制	<p>(五) 申购和赎回的数额限制</p> <p>新增内容如下：</p> <p>2、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。具体请参见相关公告。</p>
八、基金份额的申购与	(七) 拒绝或暂停申购的情形	<p>(七) 拒绝或暂停申购的情形</p> <p>新增内容如下：</p>

<p>赎回</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、基金份额的申购与赎回</p>	<p>(八)暂停赎回的情形</p>	<p>(八)暂停赎回的情形</p> <p>新增内容如下：</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确认后，基金管理人应当暂停接受基金赎回申请或延缓支付赎回款项；</p>
<p>九、基金合同当事人及权利义务</p>	<p>(一)基金管理人</p> <p>1、基金管理人简况</p> <p>办公地址：上海市浦东新区世纪大道 201 号渣打银行大厦 10 楼</p> <p>法定代表人：钱文挥</p> <p>.....</p>	<p>(一)基金管理人</p> <p>1、基金管理人简况</p> <p>办公地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号国金中心二期 21-22 楼</p> <p>法定代表人：于亚利</p> <p>.....</p>

	<p>(二)基金托管人</p> <p>1、基金托管人简况</p> <p>法定代表人：项俊波</p>	<p>(二)基金托管人</p> <p>1、基金托管人简况</p> <p>法定代表人：周慕冰</p>
十四、基金的投资	<p>(九) 投资限制</p>	<p>(九) 投资限制</p> <p>新增内容如下：</p> <p>4、本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>5、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>
十四、基金的投资	<p>(九) 投资限制</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。在符合</p>	<p>(九) 投资限制</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。在符合</p>

	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、标的指数成分股调整、基金申购或赎回带来现金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。	相关法律法规规定的前提下，除上述第 4、5 项以外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成分股调整、基金申购或赎回带来现金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。
十六、基金资产的估值	(七) 暂停估值的情形	(七) 暂停估值的情形 新增内容如下： 4、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值；
二十、基金的信息披露	(一) 本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定。	(一) 本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性规定》、基金合同及其他有关规定。
二十、基金	(五) 公开披露的基金信息	(五) 公开披露的基金信息

<p>的信息披露</p>	<p>9、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>9、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>新增内容如下：</p> <p>如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20%的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在定期报告“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>二十、基金的信息披露</p>	<p>(五)公开披露的基金信息</p> <p>10、临时报告</p>	<p>(五)公开披露的基金信息</p> <p>10、临时报告</p> <p>新增内容如下：</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>

