

关于广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 修改基金合同的公告

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,经与基金托管人中国工商银行股份有限公司(以下简称“工商银行”)协商一致,并报监管机构备案,广发基金管理有限公司(以下简称“本公司”)对旗下托管在工商银行的广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)的基金合同进行了修改,具体修改内容见附件。本基金的托管协议相应部分一并修改。

本公司将在本基金的招募说明书(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,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。

上述修改自本公告发布之日起生效,但为不影响原有基金份额持有人的利益,上述修改中“对于持续持有期少于 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”的条款将于 2018 年 3 月 31 日起正式实施,即:本基金将于 2018 年 3 月 31 日起,对持续持有期少于 7 日的投资者收取 1.5% 的赎回费。

投资者可登陆本公司网站(www.gffunds.com.cn)查询相关信息或拨打客户服务电话(95105828)咨询相关事宜。

特此公告。

广发基金管理有限公司
二〇一八年三月二十二日

附件：

《广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF)

基金合同》修订对照表

章节	原文条款	修改后条款	说明
	内容	内容	
第一部分 前言和释义	<p>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，规范广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)（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》）、《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 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《广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)基金合同》（以下简称“本合同”或“《基金合同》”）。</p>	<p>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，规范广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)（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》）、《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》）、<u>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</u>（以下简称“<u>《流动性风险管理规定》</u>”）、《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《广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)基金合同》（以下简称“本合同”</p>	新增合同订立依据

		或“《基金合同》”)	
第一部分 前言和释义	释义	<p>释义</p> <p><u>《流动性风险管理规定》指</u></p> <p><u>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</u></p> <p>.....</p> <p><u>流动性受限资产指由于法律</u></p> <p><u>法规、监管、合同或操作障碍</u></p> <p><u>等原因无法以合理价格予以</u></p> <p><u>变现的资产,包括但不限于到</u></p> <p><u>期日在 10 个交易日以上的逆</u></p> <p><u>回购与银行定期存款(含协议</u></p> <p><u>约定有条件提前支取的银行</u></p> <p><u>存款)、停牌股票、流通受限</u></p> <p><u>的新股及非公开发行股票、资</u></p> <p><u>产支持证券、因发行人债务违</u></p> <p><u>约无法进行转让或交易的债</u></p> <p><u>券等</u></p> <p>.....</p>	根据《流动性风险管理规定》，新增释义
第六部分 基金份额的 申购与赎回	<p>一、基金份额的场外申购与赎回</p> <p>5、申购和赎回的数量限制</p> <p>.....</p> <p>6、申购费用和赎回费用</p>	<p>一、基金份额的场外申购与赎回</p> <p>5、申购和赎回的数量限制</p> <p><u>(4) 当接受申购申请对存量</u></p> <p><u>基金份额持有人利益构成潜</u></p> <p><u>在重大不利影响时,基金管理</u></p> <p><u>人应当采取设定单一投资者</u></p> <p><u>申购金额上限或基金单日净</u></p> <p><u>申购比例上限、拒绝大额申</u></p> <p><u>购、暂停基金申购等措施,切</u></p> <p><u>实保护存量基金份额持有人的</u></p> <p><u>合法权益,基金管理人基于</u></p> <p><u>投资运作与风险控制的需要,</u></p> <p><u>可采取上述措施对基金规模</u></p> <p><u>予以控制。具体规定请参见相</u></p> <p><u>关公告;(新增,以下序号顺</u></p> <p><u>延)</u></p> <p>.....</p> <p>6、申购费用和赎回费用</p>	根据《流动性风险管理规定》的要求,增加相应的控制措施

	<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 25%。</p> <p>.....</p> <p>9、拒绝或暂停申购的情形及处理方式</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(6)项暂停申购情形时,</p> <p>10、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>(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 25%。<u>对于持续持有期少于 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。</u></p> <p><u>(新增)</u></p> <p>.....</p> <p>9、拒绝或暂停申购的情形及处理方式</p> <p>.....</p> <p><u>(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;</u><u>(新增, 以下序号顺延)</u>发生上述情形之一且基金管理人决定拒绝或暂停接受投资者的申购申请的,申购款项将全额退还投资者。发生上述(1)到(7)项暂停申购情形时,</p> <p>10、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><u>(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</u></p>	
--	--	---	--

	<p>11、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上一日基金总份额的 10%的前提下，对其余赎回申请延期予以办理。对于单个基金份额持有人的赎回申请，应当按照其申请赎回份额占当日申请赎回总份额的比例，确定该单个基金份额持有人当日办理的赎回份额；投资者未能赎回部分，除投资者在提交赎回申请时选择将当日未获办理部分予以撤销外，延迟至下一个开放日办理，赎回价格为下一个开放日的价格。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><u>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；</u>（新增，以下序号顺延）</p> <p>.....</p> <p>11、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<u>全部</u>赎回申请有困难或认为支付投资者的<u>全部</u>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上一日基金总份额的 10%的前提下，对其余赎回申请延期予以办理。对于单个基金份额持有人的赎回申请，应当按照其申请赎回份额占当日申请赎回总份额的比例，确定该单个<u>账户</u>当日办理的赎回份额；投资者未能赎回部分，除投资者在提交赎回申请时选择将当日未获办理部分予以撤销外，延迟至下一个开放日办理，赎回价格为下一个开放日的价格。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>③ <u>若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额 20%的，基金管理人有权</u></p>	
--	--	---	--

		述赎回费全额计入基金财产。	
第七部分 基金合同当 事人及权利 义务	<p>一、基金管理人 注册资本：人民币 <u>1.2</u> 亿元</p> <p>二、基金托管人 法定代表人：姜建清 注册资本：人民币 <u>349,018,545,827</u> 元</p>	<p>一、基金管理人 注册资本：人民币 <u>1.2688</u> 亿 元</p> <p>二、基金托管人 法定代表人：易会满 注册资本：人民币 <u>35,640,625.71</u> 万元</p>	更新管理 人、托管人 信息
第十二部分 基金的投资	<p>二、投资范围 本基金以目标 ETF 基金份额、 标的指数成份股及备选成份 股为主要投资对象。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%，持 有现金或到期日在一年以内 的政府债券的比例不低于基 金资产净值的 5%。</p> <p>.....</p> <p>五、投资限制 （二）投资组合限制 本基金的投资组合将遵循以 下限制：</p>	<p>二、投资范围 本基金以目标 ETF 基金份额、 标的指数成份股及备选成份 股为主要投资对象。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%，持 有现金或到期日在一年以内 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、应收申购款等；</p> <p>.....</p> <p>五、投资限制 （二）投资组合限制 本基金的投资组合将遵循以 下限制：</p> <p><u>9、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 合前款所规定比例限制的，基 金管理人不得主动新增流动 性受限资产的投资；</u></p> <p><u>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</u></p>	根据《流动 性风险管理 规定》的要 求，新增投 资限制

	<p>.....</p> <p>由于证券市场波动、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><u>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；</u>（新增，以下序号顺延）</p> <p>.....</p> <p><u>除上述 7、9、10 项规定的情形外，</u>由于证券市场波动、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>第十四部分 基金资产估值</p>	<p>六、暂停估值的情形</p> <p>.....</p>	<p>六、暂停估值的情形</p> <p><u>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的，基金管理人应当暂停估值；</u>（新增，以下序号顺延）</p> <p>.....</p>	<p>根据《流动性风险管理规定》，新增暂停估值的情形</p>

<p style="text-align: center;">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>(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>.....</p> <p>(七) 临时报告</p> <p>.....</p>	<p>五、公开披露的基金信息</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>.....</p> <p><u>基金管理人应当在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。</u></p> <p><u>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过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，中国证监会认定的特殊情形除外。(新增)</u></p> <p>.....</p> <p>(七) 临时报告</p> <p>.....</p> <p><u>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等重大事项时；</u></p> <p><u>(新增，以下序号顺延)</u></p> <p>.....</p>	<p>根据《流动性风险管理规定》，新增信息披露相关内容</p>
---	--	---	---------------------------------