

关于广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金（QDII-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银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）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”）对旗下托管在中国银行的广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金（QDII-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 A 类份额收取 1.5%的赎回费并全额计入基金财产；本基金在《招募说明书》中已约定对持有期小于 7 日的 C 类份额收取 1.5%的赎回费，且全额计入基金财产，因此本基金对持续持有期少于 7 日的 C 类份额收取的赎回费遵照原规定执行。

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：

**《广发道琼斯美国石油开发与生产指数
证券投资基金（QDII-LOF）基金合同》修订对照表**

章节	原文条款内容	修改后条款内容	说明
第一部分 前言	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《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》”)、和其他有关法律法规。	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《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》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)</u> 和其他有关法律法规。	新增合同订立依据
第二部分 释义	<u>17、《流动性风险管理规定》</u> ：指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的 <u>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</u> 及颁布机关对其不时做出的修订（ <u>新增，以下序号顺延</u> ） <u>66、流动性受限资产</u> ：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 <u>（新增，以下序号顺延）</u>	根据《流动性风险管理规定》，新增释义
第七部分 基金份额的 申购与 赎回	五、申购和赎回的数量限制 	五、申购和赎回的数量限制 5、 <u>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</u>	根据《流动性风险管理规定》的要求，增加相应的控

	<p>.....</p> <p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>3、赎回金额的计算及处理方式： 本基金赎回金额的计算详见《招募说明书》，赎回金额单位为元。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p> <p>.....</p> <p>八、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>.....</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接收投资人的申购申请。</p> <p>.....</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拒绝或暂停接受投资者的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投</p>	<p><u>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。具体规定请参见相关公告（新增，以下序号顺延）</u></p> <p>.....</p> <p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>3、赎回金额的计算及处理方式： 本基金赎回金额的计算详见《招募说明书》，赎回金额单位为元。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。<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>.....</p> <p>八、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>.....</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接收投资人的申购申请。<u>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></p> <p><u>10、接受某笔或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% 集中度时。</u></p> <p><u>（新增，以下序号顺延）</u></p> <p>发生上述除第 6、10 项以外的暂停申购情形且基金管理人决定拒绝或暂停接受投资者的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给</p>	<p>制措施</p>
--	--	---	------------

<p>资人。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>九、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>.....</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接收投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。</p> <p>.....</p> <p>发生上述情形且基金管理人决定暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付，并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额。若出现上述第 4 项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。</p> <p>十、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>(2) 部分延期赎回：.....</p>	<p>投资人。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>九、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>.....</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接收投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。<u>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></p> <p>.....</p> <p>发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付，并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额。若出现上述第 4 项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。</p> <p>十、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>(2) 部分延期赎回：.....</p> <p><u>(3) 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，基金管理人有权对该单个基金份额持有人超过该比例以上的赎回申请实施延期办理（基金份额持有人可在提交赎回申请时选择将当日未获办理部分予以撤销），对该单个基金份额持有人剩余赎回申请与其他账户赎回申请按前述条</u></p>	
--	---	--

		款处理。(新增, 以下序号顺延)	
第八部分 基金合同 当事人及 权利义务	<p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况</p> <p>.....</p> <p>法定代表人: <u>田国立</u></p> <p>.....</p> <p>注册资本: <u>人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整</u></p>	<p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况</p> <p>.....</p> <p>法定代表人: <u>陈四清</u></p> <p>.....</p> <p>注册资本: <u>人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整</u></p>	更新基金 托管人法 人、注册资 本信息
第十三部分 基金的投资	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制:</p> <p>.....</p> <p>(2) 在扣除需缴纳的交易保证金后, 保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券;</p> <p>.....</p> <p><u>若基金超过上述 (1) - (8) 项投资比例限制要求, 应当在超过比例后 30 个工作日内采用合理的商业措施以符合投资比例限制要求。(删)</u></p> <p>.....</p> <p>因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整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投资比例的, 基金管理人应当在 30 个交易日内进行调整。</p> <p>.....</p>	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制:</p> <p>.....</p> <p>(2) 在扣除需缴纳的交易保证金后, 保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券, <u>其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;</u></p> <p>.....</p> <p>(9) <u>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;</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></p> <p>.....</p> <p>除前述本基金投资组合限制第 (2)、(9)、(10) 条规定外, 因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整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投资比例的, 基金管理人应当在 30 个交易日内进行调整。</p> <p>.....</p>	根据《流动性风险管理规定》的要求, 新增投资限制
第十五部分 基金资产 估值	<p>六、暂停估值的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;</p>	<p>六、暂停估值的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;</p>	根据《流动性风险管理规定》, 新增暂停

	<p>2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；</p> <p>3、中国证监会和基金合同认定的其它情形。</p>	<p>2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；</p> <p><u>3、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></p> <p>4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。</p>	<p>估值的情形</p>
<p>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>(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</p> <p>.....</p> <p>《基金合同》生效不足2个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。</p> <p>基金定期报告在公开披露的第2个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。</p> <p>(七) 临时报告</p> <p>.....</p>	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>(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</p> <p>.....</p> <p>《基金合同》生效不足2个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。</p> <p>基金定期报告在公开披露的第2个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。</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>(七) 临时报告</p> <p>.....</p> <p>26、<u>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；(新增，以下序号顺延)</u></p>	<p>根据《流动性风险管理规定》，新增信息披露相关内容</p>