

## 永赢基金管理有限公司

### 关于永赢量化混合型发起式证券投资基金根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改基金合同及托管协议的公告

根据中国证监会于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“《流动性风险管理规定》”），对已经成立的开放式基金，原基金合同内容不符合《流动性风险管理规定》的，应在《流动性风险管理规定》施行之日起6个月内，修改基金合同并公告。

根据《流动性风险管理规定》，经与基金托管人中信证券股份有限公司（以下简称“中信证券”）协商一致，并报监管机构备案，永赢基金管理有限公司（以下简称“本公司”）决定对永赢量化混合型发起式证券投资基金基金合同和托管协议进行相应修订，具体修改内容请详见附件《永赢量化混合型发起式证券投资基金基金合同修改条款前后文对照表》和《永赢量化混合型发起式证券投资基金托管协议修改条款前后文对照表》。

本公司将在更新的《永赢量化混合型发起式证券投资基金招募说明书》中对相关内容进行相应修改。

上述修改自【2018】年【3】月【30】日起生效。

#### 重要提示：

1、基金合同和托管协议的修订系因相应的法律法规发生变动而进行的修改。此次修订已经履行了规定的程序，符合相关法律法规及基金合同的规定；

2、本公司于本公告日在网站上同时公布经修改后的永赢量化混合型发起式证券投资基金基金合同和托管协议；

3、投资者可通过以下途径咨询有关详情：

本公司客户服务电话：021-51690111

本公司网站：[www.maxwealthfund.com](http://www.maxwealthfund.com)

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资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资者投资于上述基金时应认真阅读该基金的基金合同、招募说明书等文件。敬请投资者留意投资风险。

特此公告。

永赢基金管理有限公司

2018年3月23日

附件：

《永赢量化混合型发起式证券投资基金基金合同》修改条款前后文对照表

《永赢量化混合型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）按照证监会《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（证监会公告[2017]12号，以下简称“《流动性风险管理规定》”）的规定修改拟定，修改后的《永赢量化混合型发起式证券投资基金基金合同》与原《永赢量化混合型发起式证券投资基金基金合同》的对照说明如下：

所在部分	修改前内容	修改后内容	修改理由
第一部分 前言	<p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</p> <p>.....</p> <p>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。</p>	<p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</p> <p>.....</p> <p>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》”）、<b>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</b>（以下简称“<b>《流动性风险管理规定》</b>”）和其他有关法律法规。</p> <p>.....</p> <p><b>四、本基金单一投资者持有的基金份额占本基金总份额的比例不得达到或超过 50%（运作过程中，因基金份额赎回等情形导致被</b></p>	<p>根据《流动性风险管理规定》规定，进行适应性修订</p> <p>根据《流动性风险管理规定》第四十条第（四）项完善表</p>

		<p>动超标的除外），且基金管理人承诺后续不存在通过一致行动人等方式变相规避 50%集中度要求的情形。基金管理人使用固有资金、公司高级管理人员及基金经理等人员出资认购的基金份额超过基金总份额 50%的，不受此限制。（新增，以下序号顺延）</p>	述
<p>第二部分 释义</p>		<p>13、《流动性风险管理规定》：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（新增，以下序号顺延）</p> <p>.....</p> <p>55、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> <p>56、摆动定价机制：是指当开放式基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成</p>	<p>根据相关法律法规的修订情况进行适应性修改</p> <p>根据《流动性风险管理规定》第四十条，补充流动性受限资产定义</p> <p>根据《流动性风险管理规定》</p>

		<p>本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待（新增，以下序号顺延）</p>	<p>第四十条，补充摆动定价机制定义</p>
<p>第六部分 基金份额申购与赎回</p>	<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>.....</p> <p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p>	<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>.....</p> <p>4、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。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。具体规定请参见招募说明书或相关公告。（新增，以下序号顺延）</p> <p>.....</p> <p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>.....</p>	<p>根据《流动性风险管理规定》第十九条的规定补充</p>

	<p>.....</p> <p>6、本基金的申购费用最高不超过申购金额的 5%，赎回费用最高不超过赎回金额的 5%。本基金的申购费率、申购份额具体的计算方法、赎回费率、赎回金额具体的计算方法和收费方式由基金管理人根据基金合同的规定确定，并在招募说明书或相关公告中列示。基金管理人可以在法律法规、基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。</p> <p>.....</p> <p>七、拒绝或暂停申购的情形</p>	<p>6、<b>本基金对持续持有期少于 7 日的投资者，应当收取不低于 1.5% 的赎回费，该赎回费全额计入基金财产。</b>本基金的申购费用最高不超过申购金额的 5%，赎回费用最高不超过赎回金额的 5%。本基金的申购费率、申购份额具体的计算方法、赎回费率、赎回金额具体的计算方法和收费方式由基金管理人根据基金合同的规定确定，并在招募说明书或相关公告中列示。基金管理人可以在法律法规、基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。</p> <p>.....</p> <p><b>8、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。（新增）</b></p> <p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>.....</p> <p>4、基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益<b>或对存量基金份额持有人利益构成潜在</b></p>	<p>根据《流动性风险管理规定》第二十三条补充强制赎回费的规定</p> <p>根据《流动性风险管理规定》第二十五条补充摆动定价机制的适用情形</p> <p>根据《流动性风险管理规定》第十九条规定，完善表述</p>
--	--	--	--

	<p>.....</p> <p>4、基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。</p> <p>.....</p>	<p>重大不利影响时。</p> <p><b>5、基金管理人基于投资运作与风险控制的需要认为应当拒绝大额申购或暂停申购时。</b></p> <p><b>6、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投资人的申购申请。</b></p> <p><b>7、基金管理人使用固有资金、公司高级管理人员及基金经理等人员出资认购的基金份额超过基金总份额 50%的情形除外，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的持有基金份额占本基金总份额的比例达到或者超过 50%，或者通过一致行动人等方式变相使单一投资者持有本基金份额占本基金总份额的比例达到或超过 50%的情形时。（新增，以下序号顺延）</b></p> <p>.....</p> <p>发生上述第 1、2、3、5、6、<b>8、9、10</b> 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停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</p>	<p>根据《流动性风险管理规定》第二十四条补充应当暂停申购的情形</p> <p>根据《流动性风险管理规定》第四十条第（四）项完善表述</p>
--	--	--	--

	<p>发生上述第 1、2、3、5、6、7 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停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。</p> <p>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>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>.....</p>	<p>被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。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>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>.....</p> <p><b>7、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投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。（新增，以下序号顺延）</b></p> <p>.....</p> <p>九、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>.....</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>.....</p> <p>（2）部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比</p>	<p>根据《流动性风险管理规定》第二十四条的规定补充应当暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p>
--	---	--	--



	<p>九、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>.....</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>.....</p> <p>(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金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开放日基金总份额的 10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回</p>	<p>例不低于上一开放日基金总份额的 10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。<b>若进行上述延期办理，对于单个基金份额持有人当日赎回申请超过上一开放日基金总份额 10%以上的部分，将自动进行延期办理。对于其余当日非自动延期办理的赎回申请，应当按单个账户非自动延期办理的赎回申请量占非自动延期办理的赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；</b>对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。</p>	<p>根据《流动性风险管理规定》第二十一条第（二）项的规定修改</p>
--	---	---	-------------------------------------

	回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。		
第七部分 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>名称：中信证券股份有限公司</p> <p>住所：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座</p> <p>办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号</p> <p>法定代表人：王东明</p> <p>成立时间：1995年10月25日</p> <p>批准设立机关和批准设立文号：国家工商总局，100000000018305</p> <p>组织形式：股份有限公司（上市）</p> <p>注册资本：人民币壹佰壹拾亿壹仟陆佰玖拾万捌仟肆佰元整</p> <p>存续期间：无限期</p>	<p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况</p> <p>名称：中信证券股份有限公司</p> <p>住所：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座</p> <p>办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号</p> <p>法定代表人：<b>张佑君</b></p> <p>成立时间：1995年10月25日</p> <p>批准设立机关和批准设立文号：国家工商总局，100000000018305</p> <p>组织形式：股份有限公司（上市）</p> <p>注册资本：人民币壹佰壹拾亿壹仟陆佰玖拾万捌仟肆佰元整</p> <p>存续期间：无限期</p> <p>基金托管资格批文及文号：《关于核准中信证券股份有限公司证券投资基金托管资格的批复》（证监许可[2014]1044号）</p>	基金托管人法定代表人发生变更，根据实际情况进行相应修订

	基金托管资格批文及文号：《关于核准中信证券股份有限公司证券投资基金托管资格的批复》（证监许可[2014]1044号）		
第十二部分 基金的投资	<p>二、投资范围</p> <p>.....</p> <p>本基金每个交易日日终，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。</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>（3）本基金每个交易日日终，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的</p>	<p>二、投资范围</p> <p>.....</p> <p>本基金每个交易日日终，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金（<b>不含结算备付金、存出保证金、应收申购款等</b>）或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。</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>（3）本基金每个交易日日终，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金（<b>不含结算备付金、存出保证金、应收申购款等</b>）或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低</p>	<p>根据《流动性风险管理规定》第十八条修改</p> <p>根据《流动性风险管理规定》第十八条修改</p>

	<p>5%;</p> <p>.....</p>	<p>于基金资产净值的 5%;</p> <p>.....</p> <p><b>(18) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 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;</b></p> <p><b>(19) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 15%; 本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 30%;</b></p> <p><b>(20) 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; (新增, 以下序号顺延)</b></p> <p>.....</p> <p><b>除上述第 (3)、(18)、(20) 项外, 因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价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</b></p>	<p>根据《流动性风险管理规定》第十五、第十六及第十七条修改</p>
--	-------------------------	--	------------------------------------

	<p>因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价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 10 个交易日内进行调整。法律法规另有规定的，从其规定。</p>	<p>金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。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>三、估值方法</p> <p>.....</p> <p>六、暂停估值的情形</p> <p>.....</p>	<p>三、估值方法</p> <p>.....</p> <p><b>7、当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。（新增，以下序号顺延）</b></p> <p>.....</p> <p>六、暂停估值的情形</p> <p>.....</p> <p><b>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</b></p>	<p>根据《流动性风险管理规定》第二十五条补充完善估值方法</p> <p>根据《流动性风险管理规定》</p>

		<p>时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停基金估值；</p> <p>（新增，以下序号顺延）</p>	<p>第二十四条补充</p>
<p>第十八部分 基金的信息披露</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>（七）临时报告</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><b>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基金定期报告“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产品的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。</b></p> <p><b>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。</b></p> <p>.....</p> <p>（七）临时报告</p> <p>本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在2个工作日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会</p>	<p>根据《流动性风险管理规定》第二十六条及第二十七条补充定期报告的内容</p>

	<p>本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在2个工作日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。</p> <p>前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件：</p> <p>……</p>	<p>和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。</p> <p>前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件：</p> <p>……</p> <p><b>27、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；</b></p> <p><b>28、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；</b>（新增，以下序号顺延）</p>	<p>根据《流动性风险管理规定》第二十五、二十六条补充临时报告的内容</p>
--	---	---	--

附件：

《永赢量化混合型发起式证券投资基金托管协议》修改条款前后文对照表

《永赢量化混合型发起式证券投资基金托管协议》（以下简称“《托管协议》”）按照证监会《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（证监会公告[2017]12号，以下简称“《流动性风险管理规定》”）规定修改拟定，修改后的《永赢量化混合型发起式证券投资基金托管协议》与原《永赢量化混合型发起式证券投资基金托管协议》的对照说明如下：

所在部分	修改前内容	修改后内容	修改理由
一、托管协议当事人	<p>（一）基金托管人(或简称“托管人”)</p> <p>名称： 中信证券股份有限公司</p> <p>注册地址： 广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座</p> <p>办公地址： 北京市朝阳区亮马桥路48号</p> <p>法定代表人： 王东明</p> <p>成立时间： 1995年10月25日</p> <p>批准设立机关： 国家工商总局</p> <p>批准设立文号： 100000000018305</p>	<p>（一）基金托管人(或简称“托管人”)</p> <p>名称： 中信证券股份有限公司</p> <p>注册地址： 广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座</p> <p>办公地址： 北京市朝阳区亮马桥路48号</p> <p>法定代表人： 张佑君</p> <p>成立时间： 1995年10月25日</p> <p>批准设立机关： 国家工商总局</p> <p>批准设立文号： 100000000018305</p> <p>组织形式： 股份有限公司（上市）</p>	基金托管人法定代表人发生变更，根据实际情况进行相应修订



	<p>组织形式： 股份有限公司（上市）</p> <p>注册资本： 人民币壹佰壹拾亿壹仟陆佰玖拾万捌仟肆佰元整</p> <p>经营范围： 许可经营项目： 证券经纪（限山东省、河南省、浙江省、福建省、江西省以外的区域）； 证券投资咨询； 与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问； 证券承销与保荐； 证券自营； 证券资产管理； 融资融券； 证券投资基金代销； 为期货公司提供中间介绍业务； 代销金融产品（有效期至2015年12月17日）。</p> <p>存续期间： 无限期</p>	<p>注册资本： 人民币壹佰壹拾亿壹仟陆佰玖拾万捌仟肆佰元整</p> <p>经营范围： 许可经营项目： 证券经纪（限山东省、河南省、浙江省、福建省、江西省以外的区域）； 证券投资咨询； 与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问； 证券承销与保荐； 证券自营； 证券资产管理； 融资融券； 证券投资基金代销； 为期货公司提供中间介绍业务； 代销金融产品（有效期至2015年12月17日）。</p> <p>存续期间： 无限期</p>	
<p>二、托管协议的依据、目的、原则和解释</p>	<p>（一） 依据</p> <p>订立本协议的依据是《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《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》）、《证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流</p>	<p>（一） 依据</p> <p>订立本协议的依据是《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《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》）、</p> <p><b>《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</b></p>	<p>根据《流动性风险管理规</p>

	<p>露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）、《证券投资基金托管业务管理办法》、《非银行金融机构开展证券投资基金托管业务暂行规定》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第7号〈托管协议的内容与格式〉》、《永赢量化混合型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称《基金合同》）及其他有关规定。</p> <p>.....</p> <p>（四）解释</p> <p>.....</p>	<p><b>动性风险管理规定》”）、《证券投资基金托管业务管理办法》、《非银行金融机构开展证券投资基金托管业务暂行规定》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第7号〈托管协议的内容与格式〉》、《永赢量化混合型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称《基金合同》）及其他有关规定。</b></p> <p>.....</p> <p>（四）解释</p> <p>.....</p> <p><b>《流动性风险管理规定》指《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</b></p>	<p>定》进行适应性修订</p> <p>根据相关法律法规的修订情况进行适应性修改</p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>	<p>（一）基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权</p> <p>.....</p> <p>2、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投融资比例进行监督。</p>	<p>（一）基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权</p> <p>.....</p> <p>2、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投融资比例进行监督。</p> <p>.....</p>	

	<p>.....</p> <p>本基金每个交易日日终，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。</p> <p>.....</p> <p>(2) 根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金投资组合遵循以下投资限制：</p> <p>.....</p> <p>3) 本基金每个交易日日终，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%；</p> <p>.....</p>	<p>本基金每个交易日日终，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金（不含结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。</p> <p>.....</p> <p>(2) 根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金投资组合遵循以下投资限制：</p> <p>.....</p> <p>3) 本基金每个交易日日终，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金（不含结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%；</p> <p>.....</p> <p><b>18) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的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；</b></p> <p><b>19) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的15%；本基金管理人管理的全部</b></p>	<p>根据《流动性风险管理规定》第十八条修改</p> <p>根据《流动性风险管理规定》第十八条修改</p> <p>根据《流动性风险管理规定》第十五、第十六及第十七条修改</p>
--	--	--	--

	<p>由于证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价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，基金管理人应在10个交易日内进行调整，以达到规定的投资比例限制要求。法律法规另有规定的，从其规定。</p>	<p>投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；</p> <p>20) 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；（新增，以下序号顺延）</p> <p>.....</p> <p>除上述第3)、18)、20)项外，由于证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价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，基金管理人应在10个交易日内进行调整，以达到规定的投资比例限制要求。法律法规另有规定的，从其规定。</p>	
--	---	---	--

<p>八、基金资产净值计算和会计核算</p>	<p>(二) 基金资产估值方法</p> <p>2、估值方法</p> <p>本基金的估值方法为：</p> <p>.....</p> <p>(四) 暂停估值与公告基金份额净值的情形</p>	<p>(二) 基金资产估值方法</p> <p>2、估值方法</p> <p>本基金的估值方法为：</p> <p>.....</p> <p><b>(7) 当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。（新增，以下序号顺延）</b></p> <p>.....</p> <p>(四) 暂停估值与公告基金份额净值的情形</p> <p>.....</p> <p><b>(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基金估值；（新增，以下序号顺延）</b></p> <p>.....</p>	<p>根据《流动性风险管理规定》第二十五条补充完善估值方法</p> <p>根据《流动性风险管理规定》第二十四条补充</p>
------------------------	--	---	---