

# 浙江浙商证券资产管理有限公司关于旗下浙商汇金鼎盈定增灵活配置混合型证券投资基金修改基金合同及托管协议的公告

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证券投资基金，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协商一致，浙江浙商证券资产管理有限公司（以下简称：“本公司”）对旗下浙商汇金鼎盈定增灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）的《浙商汇金鼎盈定增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》”）相关条款进行修订。具体修改内容见附件。

本次《基金合同》修订的内容系因相应的法律法规发生变动而应当进行的必要修改，且对原有基金份额持有人的利益无实质性影响，根据《基金合同》的约定，可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会，并报监管机构备案。修订后的《基金合同》自本公告发布之日起生效，但不影响原有基金份额持有人的利益，《基金合同》中“对于持续持有期少于 7 日的投资

者收取不少于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产”的条款将于 2018 年 3 月 30 日起正式实施。本基金将于 2018 年 3 月 30 日起，对持续持有期少于 7 日的投资者收取 1.5%的赎回费。本基金管理人经与基金托管人协商一致，已相应修改本基金的《浙商汇金鼎盈定增灵活配置混合型证券投资基金托管协议》，具体修改内容见附件。

投资者可访问浙江浙商证券资产管理有限公司网站（[www.stocke.com.cn](http://www.stocke.com.cn)）或拨打客户服务电话（95345）咨询相关情况。

特此公告。

浙江浙商证券资产管理有限公司

2018 年 3 月 23 日

附件：浙商汇金鼎盈定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同和托管协议修改对照表

《浙商汇金鼎盈定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同》修订对照表

章节	原文条款	修改后条款
	内容	内容
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》”）、<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管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）和其他有关法律、法规。</p>
第二部分“释义”	-	<u>《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《公开募集开放式证券投资基金流

		<u>动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订</u>
第二部分“释义”	-	<p><u>流动性受限资产：是指由于法律法规、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></p> <p><u>摆动定价机制：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</u></p>
第七部分“基金份额的申购与赎回”	<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>1、基金管理人可以规定投资人首次申购和每次申购的最低金额以及每次赎回的最低份额，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</p> <p>2、基金管理人可以规定投资人每个基金交易账户的最低基金</p>	<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>1、基金管理人可以规定投资人首次申购和每次申购的最低金额以及每次赎回的最低份额，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</p> <p>2、基金管理人可以规定投资人每个基金交易账户的最低基金</p>

	<p>份额余额，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</p> <p>3、基金管理人可以规定单个投资人累计持有的基金份额上限，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</p> <p>4、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。</p> <p>.....</p>	<p>份额余额，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</p> <p>3、基金管理人可以规定单个投资人累计持有的基金份额上限<u>或累计持有的基金份额占基金份额总数的比例上限</u>，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</p> <p><b><u>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个投资者当日申购金额上限或本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，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</u></b></p> <p>5、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。</p> <p>.....</p>
<p>第七部分</p> <p>“基金份额的申购与赎回”</p>	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>.....</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</p>	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>.....</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</p>

	<p>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，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p> <p>.....</p>	<p>金管理人决定，并在招募说明书中列示。<u>其中，对于持续持有期少于7日的投资者收取不少于1.5%的赎回费并全额计入基金财产。</u>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，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p> <p>.....</p> <p><u>8、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。</u></p>
<p>第七部分 “基金份额的 申购与赎回”</p>	<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>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：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、因不可抗力导致基金无法正常运作。</li> <li>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受投资人的申购申请。</li> <li>3、证券、期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人</li> </ol>	<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>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：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、因不可抗力导致基金无法正常运作。</li> <li>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受投资人的申购申请。</li> <li>3、证券、期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人</li> </ol>

<p>无法计算当日基金资产净值。</p> <p>4、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>5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或基金管理人认定的其他损害现有基金份额持有人利益的情形。</p> <p>6、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。</p> <p>7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p>	<p>无法计算当日基金资产净值。</p> <p>4、接受某笔或某些申购申请可能会对<u>存量</u>基金份额持有人利益<u>构成潜在重大不利影响</u>时。</p> <p>5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或基金管理人认定的其他损害现有基金份额持有人利益的情形。</p> <p>6、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。</p> <p><u>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。</u></p> <p><u>8、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的措施。</u></p> <p>9、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p>
--	--

	<p>发生上述第1、2、3、5、6、7项暂停申购情形且基金管理人决定暂停接受投资人的申购申请时，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，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。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>发生上述第1、2、3、5、6、<b>8、9</b>项暂停申购情形且基金管理人决定暂停接受投资人的申购申请时，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，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。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>第七部分 “基金份额的 申购与赎回”</p>	<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>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：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。</li> <li>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受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。</li> <li>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。</li> <li>4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。</li> <li>5、发生继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形。</li> </ol>	<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>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：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。</li> <li>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受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。</li> <li>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。</li> <li>4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。</li> <li>5、发生继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形。</li> <li><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</b></li> </ol>



	<p>6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>.....</p>	<p><u>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>7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>.....</p>
<p>第七部分 “基金份额的 申购与赎回”</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>当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。</p> <p>（1）全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。</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</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>当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。</p> <p>（1）全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。</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。<u>若进行上述延期办理，对于单个基金</u></p>

	<p>户办理赎回申请量占办理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>.....</p>	<p><u>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。</u>对于<u>其余</u>当日<u>非自动延期办理</u>的赎回申请，应当按单个账户<u>非自动延期办理</u>赎回申请量占<u>非自动延期办理</u>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>.....</p>
<p>第八部分“基金合同当事人及权利义务”</p>	<p>二、基金托管人</p> <p>名称：中国工商银行股份有限公司</p> <p>住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号（100032）</p> <p>法定代表人：姜建清</p>	<p>二、基金托管人</p> <p>名称：中国工商银行股份有限公司</p> <p>住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号（100032）</p> <p>法定代表人：易会满</p>

	.....	.....
第十二部分 “基金的投资”	<p>二、投资范围</p> <p>.....</p> <p>基金的投资组合比例为：封闭期内，股票资产投资比例为基金资产的0%—100%，其中定向增发（非公开发行）股票资产占本基金非现金资产的比例不低于80%，每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；转换为上市开放式基金（LOF）后股票资产投资比例为基金资产的0%—95%，其中以事件驱动策略投资的股票资产占非现金基金资产的比例不低于80%，开放期内每个交易日日终，扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，债券等固定收益类证券投资比例为基金资产的0%-100%，投资于权证的比例不超过基金资产的3%。</p>	<p>二、投资范围</p> <p>.....</p> <p>基金的投资组合比例为：封闭期内，股票资产投资比例为基金资产的0%—100%，其中定向增发（非公开发行）股票资产占本基金非现金资产的比例不低于80%，每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；转换为上市开放式基金（LOF）后股票资产投资比例为基金资产的0%—95%，其中以事件驱动策略投资的股票资产占非现金基金资产的比例不低于80%，开放期内每个交易日日终，扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，<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>，债券等固定收益类证券投资比例为基金资产的0%-100%，投资于权证的比例不超过基金资产的3%。</p>
第十二部分 “基金的投资”	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p>	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p>

	<p>.....</p> <p>(2) 转成上市开放式基金 (LOF) 后的每个交易日日终, 在扣除股指期货和国债期货合约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; 在封闭期内, 本基金不受 5% 的限制, 但每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后, 应当保持不低于交易保证金一倍的现金;</p> <p>.....</p>	<p>.....</p> <p>(2) 转成上市开放式基金 (LOF) 后的每个交易日日终, 在扣除股指期货和国债期货合约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; 在封闭期内, 本基金不受 5% 的限制, 但每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后, 应当保持不低于交易保证金一倍的现金; <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><u>(17) 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%;</u></p> <p><u>(18) 转成上市开放式基金 (LOF) 后, 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</u> <u>之外的因素致使基金投资比例不符合该项规定投资比例的, 基</u></p>
--	--	--

	<p>(17) 法律法规及中国证监会规定的其他投资比例限制。</p> <p>.....</p> <p>因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动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，但中国证监会规定的特殊情形除外。</p> <p>.....</p>	<p><u>金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u></p> <p><u>(19) 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基金合同约定的投资范围保持一致；</u></p> <p><u>(20) 法律法规及中国证监会规定的其他投资比例限制。</u></p> <p>.....</p> <p>因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动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，但<u>上述第(2)、(12)、(18)、(19)条</u>及中国证监会规定的特殊情形除外。</p> <p>.....</p>
<p>第十四部分</p> <p>“基金资产估值”</p>	<p>三、估值方法</p> <p>.....</p> <p>9、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如</p>	<p>三、估值方法</p> <p>.....</p> <p><u>9、当本基金发生大额申购或赎回情形时，本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。</u></p> <p>10、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如</p>

	<p>有新增事项，按国家最新规定估值。</p> <p>.....</p>	<p>有新增事项，按国家最新规定估值。</p> <p>.....</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>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>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>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>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><b><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，应当采取暂停估值的措施；</u></b></p> <p>4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。</p>
<p>第十八部分 “基金的信息 披露”</p>	<p>(五) 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。</p>	<p>(五) 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。</p>

	<p>报备应当采用电子文本或书面报告方式。</p>	<p>报备应当采用电子文本或书面报告方式。</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，基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告文件中“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有风险，中国证监会认定的特殊情况除外。</u></p> <p><u>本基金持续运作过程中，基金管理人应当依照相关法律法规规定，在基金半年度报告、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>第十八部分 “基金的信息披露”</p>	<p>(七) 临时报告</p> <p>.....</p> <p>29、中国证监会规定的其他事项。</p>	<p>(七) 临时报告</p> <p>.....</p> <p><u>29、在发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项情形；</u></p> <p><u>30、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；</u></p> <p><u>31、中国证监会规定的其他事项。</u></p>

## 《浙商汇金鼎盛定增灵活配置混合型证券投资基金托管协议》修订对照表

章节	原文条款	修改后条款
	内容	内容
一、基金托管协议当事人	<p>(二) 基金托管人</p> <p>名称：中国工商银行股份有限公司</p> <p>住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号（100032）</p> <p>法定代表人：姜建清</p> <p>.....</p> <p>注册资本：人民币 349,018,545,827 元</p> <p>.....</p>	<p>(二) 基金托管人</p> <p>名称：中国工商银行股份有限公司</p> <p>住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号（100032）</p> <p>法定代表人：<b>易会满</b></p> <p>.....</p> <p>注册资本：人民币 <b>35,640,625.71 万元</b></p> <p>.....</p>
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	<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>(1) 按法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金的投</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>(1) 按法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金的投</p>



<p>资资产配置比例为：封闭期内，股票资产投资比例为基金资产的 0%—100%，其中定向增发（非公开发行）股票资产占本基金非现金资产的比例不低于 80%，每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；转换为上市开放式基金（LOF）后股票资产投资比例为基金资产的 0%—95%，其中以事件驱动策略投资的股票资产占非现金基金资产的比例不低于 80%，开放期内每个交易日日终，扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，债券等固定收益类证券投资比例为基金资产的 0%—100%，投资于权证的比例不超过基金资产的 3%。</p> <p>.....</p> <p>（2）根据法律法规的规定、《基金合同》的约定及托管人实际可监督范围，托管人按照以下投资限制对本基金投资组合进行投资监督：</p> <p>.....</p>	<p>资资产配置比例为：封闭期内，股票资产投资比例为基金资产的 0%—100%，其中定向增发（非公开发行）股票资产占本基金非现金资产的比例不低于 80%，每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；转换为上市开放式基金（LOF）后股票资产投资比例为基金资产的 0%—95%，其中以事件驱动策略投资的股票资产占非现金基金资产的比例不低于 80%，开放期内每个交易日日终，扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，<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>，债券等固定收益类证券投资比例为基金资产的 0%—100%，投资于权证的比例不超过基金资产的 3%。</p> <p>.....</p> <p>（2）根据法律法规的规定、《基金合同》的约定及托管人实际可监督范围，托管人按照以下投资限制对本基金投资组合进行投资监督：</p> <p>.....</p>
--	---

<p>2) 转成上市开放式基金 (LOF) 后的每个交易日日终, 在扣除股指期货和国债期货合约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>在封闭期内, 本基金不受 5% 的限制, 但每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后, 应当保持不低于交易保证金一倍的现金;</p> <p>.....</p>	<p>2) 转成上市开放式基金 (LOF) 后的每个交易日日终, 在扣除股指期货和国债期货合约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>在封闭期内, 本基金不受 5% 的限制, 但每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后, 应当保持不低于交易保证金一倍的现金; <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><u>17) 基金管理人管理的且由本基金托管人托管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且由本基金托管人托管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%;</u></p> <p><u>18) 转成上市开放式基金 (LOF) 后, 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%;</u></p> <p><u>19) 法律法规及中国证监会规定的其他投资比例限制。</u></p> <p>.....</p>
---	---

	<p>17) 法律法规及中国证监会规定的其他投资比例限制。</p> <p>.....</p> <p>由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动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>.....</p>	<p>由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动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，以达到规定的投资比例限制要求，<u>但上述第（2）、（12）、（18）条及中国证监会或</u>法律法规另有规定的从其规定。</p> <p>.....</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>.....</p> <p>2、估值方法</p> <p>本基金的估值方法为：</p> <p>.....</p> <p>（9）相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。</p>	<p>（二）基金资产估值方法</p> <p>.....</p> <p>2、估值方法</p> <p>本基金的估值方法为：</p> <p>.....</p> <p>（9）<u>当本基金发生大额申购或赎回情形时，本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。</u></p>

		<p>(10) 相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。 如有新增事项，按国家最新规定估值。</p>
--	--	--