

# 国投瑞银基金管理有限公司

## 关于修改国投瑞银瑞福深证100指数证券投资基金（LOF）

### 基金合同有关条款的公告

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“《流动性风险规定》”），经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，国投瑞银基金管理有限公司（以下简称“本公司”）对旗下国投瑞银瑞福深证100指数证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）的《国投瑞银瑞福深证100指数证券投资基金（LOF）基金基金合同》（以下简称“基金合同”）有关条款进行修订。本次基金合同的修订内容包括前言、释义、基金份额的申购与赎回、基金的投资、基金的暂停估值和信息披露等条款，具体修订内容可详见附录。本基金托管协议涉及的上述内容已做同步修订，本基金的基金合同和托管协议本次修订的内容，将在本基金最近一期的招募说明书（更新）中做相应调整。

本基金基金合同修订的内容和程序符合有关法律法规和基金合同的规定并已报中国证券监督管理委员会深圳证监局备案。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%的赎回费并全额计入基金财产”的条款将于2018年3月31日起正式实施。

投资人欲了解基金信息请仔细阅读基金合同、招募说明书及相关法律文件，也可以登录本公司网站（[www.ubssdic.com](http://www.ubssdic.com)）或拨打客户服务电话（400-880-6868）了解详情。

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。基金的过往业绩不代表其将来表现。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。

国投瑞银基金管理有限公司

二〇一八年三月二十三日

附录：《国投瑞银瑞福深证100指数证券投资基金（LOF）基金基金合同》修改对照表

章节	原基金合同内容	修改后基金合同内容	《流动性风险规定》依据条款
封面	国投瑞银瑞福深证100指数分级证券投资基金基金合同	国投瑞银瑞福深证100指数分级证券投资基金基金合同 <b>【本基金已根据基金合同约定转换为国投瑞银瑞福深证100指数证券投资基金（LOF）】</b>	
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，规范国投瑞银瑞福深证100指数分级证券投资基金（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》）、《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》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》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《国投瑞银瑞福深证100指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“本合同”或“《基金合同》”）。</p> <p>.....</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，规范国投瑞银瑞福深证100指数分级证券投资基金（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》）、《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》）、<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“《流动性风险规定》”）</b>、《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》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》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《国投瑞银瑞福深证100指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“本合同”或“《基金合同》”）。</p> <p>.....</p>	全文
	<p>释义</p> <p>.....</p>	<p>释义</p> <p>.....</p> <p><b>《流动性风险规定》指《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订</b></p>	全文

		<p>.....</p> <p><b>流动性受限资产</b> 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>.....</p>	全文
第六部分 基金份额的申购与赎回	<p>二、本基金转换为上市开放式基金（LOF）后的申购与赎回</p> <p>（六）申购与赎回的数额限制</p> <p>.....</p>	<p>二、本基金转换为上市开放式基金（LOF）后的申购与赎回</p> <p>（六）申购与赎回的数额限制</p> <p>.....</p> <p><b>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。具体规定请参见《招募说明书》或相关公告；</b></p> <p>.....</p>	第19条
	<p>二、本基金转换为上市开放式基金（LOF）后的申购与赎回</p> <p>（七）申购费用和赎回费用</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为80%。</p> <p>.....</p>	<p>二、本基金转换为上市开放式基金（LOF）后的申购与赎回</p> <p>（七）申购费用和赎回费用</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。<b>对持续持有期少于7日的投资者收取不低于1.5%的赎回费并全额计入基金财产；其他</b>赎回费归入基金财产的比例为80%。</p> <p>.....</p>	第23条
	<p>二、本基金转换为上市开放式基金（LOF）后的申</p>	<p>二、本基金转换为上市开放式基金（LOF）后的申购</p>	

	<p>购与赎回        (十) 拒绝或暂停申购的情形及处理方式        .....</p>	<p>与赎回        (十) 拒绝或暂停申购的情形及处理方式        .....</p> <p><b><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基金总份额的50%，或者变相规避50%集中度的情形时；</u></b></p> <p><b><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。</u></b></p> <p>.....</p>	<p>第19条</p> <p>第24条</p>
	<p>二、本基金转换为上市开放式基金（LOF）后的申购与赎回        (十一) 暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式        .....</p> <p>发生上述情形之一且基金管理人决定拒绝接受或暂停基金份额持有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立即向中国证监会备案。已接受的赎回申请，基金管理人将足额支付；如暂时不能足额支付的，可延期支付部分赎回款项，按每个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分由基金管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续开放日予以支付。</p>	<p>二、本基金转换为上市开放式基金（LOF）后的申购与赎回        (十一) 暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式        .....</p> <p><b><u>5、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，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请；</u></b></p> <p>.....</p> <p>发生除上述第5项情形之一且基金管理人决定拒绝接受或暂停基金份额持有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立即向中国证监会备案。已接受的赎回申请，基金管理人将足额支付；如暂时不能足额支付的，可延期支付部分赎回款项，按每个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分由基金管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续开放日予以支付。</p>	<p>第24条</p>
	<p>二、本基金转换为上市开放式基金（LOF）后的申</p>	<p>二、本基金转换为上市开放式基金（LOF）后的申购</p>	

	<p>购与赎回</p> <p>(十二) 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>与赎回</p> <p>(十二) 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><u>(3) 当本基金出现巨额赎回时，在单个基金份额持有人赎回申请超过前一开放日基金总份额30%的情形下，基金管理人认为支付该基金份额持有人的全部赎回申请有困难或者因支付该基金份额持有人的全部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，可对该基金份额持有人的赎回申请超过前一开放日基金总份额30%的部分进行延期办理。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。而对该单个基金份额持有人赎回比例在前一开放日基金总份额30%以内（含30%）的赎回申请与其他投资者的赎回申请一并按上述（1）、（2）方式处理。</u></p> <p>.....</p>	<p>第21条</p>
<p>第九部分 基金合同当事人及权利义务</p>	<p>一、基金管理人</p> <p>(一) 基金管理人简况</p> <p>法定代表人：<b>钱蒙</b></p> <p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况</p> <p>法定代表人：<b>姜建清</b></p> <p>注册资本：人民币<b>349,019,463,180</b>元</p>	<p>一、基金管理人</p> <p>(一) 基金管理人简况</p> <p>法定代表人：<b>叶柏寿</b></p> <p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况</p> <p>法定代表人：<b>易会满</b></p> <p>注册资本：人民币<b>35,640,625.71</b>万元</p>	
<p>第十四部分 基金的投资</p>	<p>二、投资范围</p> <p>.....</p> <p>本基金投资于深证100指数成份股票及其备选成份股票的市值不低于基金资产净值的80%；投资于标的指数成份股票及其备选成份股票的市值加上买入、卖出股</p>	<p>二、投资范围</p> <p>.....</p> <p>本基金投资于深证100指数成份股票及其备选成份股票的市值不低于基金资产净值的80%；投资于标的指数成份股票及其备选成份股票的市值加上买入、卖出股指期</p>	

<p>股指期货合约的轧差合计值不低于基金资产净值的90%；本基金持有的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%；权证以及其他金融工具的投资比例符合法律法规和中国证监会的规定。</p> <p>.....</p>	<p>货合约的轧差合计值不低于基金资产净值的90%；本基金持有的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，上述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>；权证以及其他金融工具的投资比例符合法律法规和中国证监会的规定。</p> <p>.....</p>	<p>第18条</p>
<p>五、投资限制</p> <p>.....</p> <p>（二）投资组合限制</p> <p>.....</p> <p>3、本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的10%；本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的100%。其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）不低于基金资产净值的90%；本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%；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，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券；</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，以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。</p>	<p>五、投资限制</p> <p>.....</p> <p>（二）投资组合限制</p> <p>.....</p> <p>3、本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的10%；本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的100%。其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）不低于基金资产净值的90%；本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%；</p> <p>4、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，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，<u>其中，上述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>；</p> <p><u>5、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>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</u></p>	<p>第18条</p> <p>第16条</p>

		<p><u>的投资；</u></p> <p><u>6、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><u>除上述第4、5、6项外，</u>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，以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。</p>	第17条
第十六部分 基金资产估值	<p>七、暂停估值的情形</p> <p>.....</p>	<p>七、暂停估值的情形</p> <p>.....</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确认后，应当暂停基金估值；</u></p> <p>.....</p>	第24条
第二十分 基金的信息披露	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>公开披露的基金信息包括：</p> <p>.....</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>（八）临时报告</p> <p>.....</p>	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>公开披露的基金信息包括：</p> <p>.....</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>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本基金的特定风险，中国证监会认定的特殊情形除外。</u></p> <p><u>本基金持续运作过程中，应当在基金年度报告和半</u></p>	<p>第27条</p> <p>第26条</p>

		<p><u>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>(八) 临时报告</p> <p>.....</p> <p><u>25、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>.....</p>	第26条
--	--	--	------