

**永赢基金管理有限公司关于永赢双利债券型证券投资基金根据  
《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》，经与基金托管人华泰证券股份有限公司（以下简称“华泰证券”）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”）决定对永赢双利债券型证券投资基金基金合同和托管协议进行相应修改，具体修改内容请详见附件《永赢双利债券型证券投资基金基金合同修改条款前后文对照表》和《永赢双利债券型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《永赢双利债券型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双利债券型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：《永赢双利债券型证券投资基金基金合同》修改条款前后文对照表

《永赢双利债券型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》”）规定修改拟定，具体新《永赢双利债券型证券投资基金基金合同》与原《永赢双利债券型证券投资基金基金合同》修改条文的对照说明如下：

| 页码                 | 《永赢双利债券型证券投资基金基金合同》   | 《永赢双利债券型证券投资基金基金合同》修改条款版本   | 修改理由                       |
|--------------------|---|---|----------------------------|
|                    | 内容  | 内容  |                            |
| 1、 P1<br>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>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>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》”）、《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》”）和其他有关法律、法规。</p> | 根据《流动性风险管理规定》规定，进行适应性修订    |
| 2、 P2<br>第一部分 前言   |   | <p>（增加）</p> <p>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。</p>   | 根据《流动性风险管理规定》第四十条第（四）项完善表述 |
| 3、 P3-7<br>第二部分 释义 | <p>54、C 类基金份额：指在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用，在赎回时不收取赎回费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额</p>   | <p>（增加）</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</p>  | 根据相关法律法规的修订情况进行适应性         |

|   |   |   |   |
|---|---|---|---|
|   |   | <p>风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订</p> <p>52、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>53、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</p> <p>57、C类基金份额：指在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用，在赎回时不收取赎回费用（持续持有期少于7日必须收取赎回费的情况除外），而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额</p> | <p>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》第四十条，补充摆动定价机制定义</p> <p>根据《流动性风险管理规定》第二十三条，完善表述</p> |
| <p>4、 P8-9</p> <p><b>第三部分 八、基金份额的类别</b></p> | <p>本基金根据认购费用、申购费用、赎回费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额称为A类基金份额。从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用，在赎回时不收取赎回费用的基金份额，称为C类基金份额。</p> | <p>本基金根据认购费用、申购费用、赎回费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额称为A类基金份额。从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用，在赎回时不收取赎回费用（持续持有期少于7日必须收取赎回费的情况除外）的基金份额，称为C类基金份额。</p>  | <p>根据《流动性风险管理规定》第二十三条，明确本基金C类基金份额必须收取赎回费用的情形</p>  |

|   |   |  |  |
|---|---|--|--|
| <p>5、 P15<br/>第六部分 五、申购和赎回的数量限制</p>         |   | <p>(增加)</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。</p>   | <p>根据《流动性风险管理规定》第十九条的规定补充</p>  |
| <p>6、 P16-17<br/>第六部分 六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> | <p>5、A类基金份额的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用归入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。C类基金份额不收取赎回费用。</p> <p>6、本基金A类基金份额的申购费率、A类基金份额和C类基金份额的申购份额具体的计算方法、A类基金份额的赎回费率、A类基金份额和C类基金份额的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>5、本基金份额的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用归入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。<del>C类基金份额不收取赎回费用。</del></p> <p>(增加)</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></p> <p>7、本基金A类基金份额的申购费率、A类基金份额和C类基金份额的申购份额具体的计算方法、A类基金份额和C类基金份额的赎回费率、A类基金份额和C类基金份额的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>(增加)</p> <p>9、当本基金各类份额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。</p> | <p>完善表述</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>完善表述</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>7、 P17-18<br/>第六部分 七、拒绝或暂停申购的情形</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>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。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>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或对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时。</p> <p>(增加)</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>发生上述第 1、2、3、5、6、8、9、10 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>根据《流动性风险管理规定》第十九条规定,完善表述</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>8、 P18<br/>第六部分 八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> |  | <p>(增加)</p> <p>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赎回申请或延缓支付赎回款项。</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>9、 P19<br/>第六部分 九、巨额赎回的情形及处理方式</p> | <p>2、巨额赎回的处理方式<br/>(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该类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>2、巨额赎回的处理方式<br/>(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。<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</b>赎回申请，应当按单个账户<b>非自动延期办理</b>的赎回申请量占<b>非自动延期办理</b>的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该类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> |
| <p>10、 P25<br/>第七部分 二、基金托管人</p>       | <p>法定代表人：吴万善</p>  | <p>法定代表人：周易</p>  | <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> |
| <p>11、 P43<br/>第十二部分 二、投资范围</p>       | <p>基金的投资组合比例为：本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%；投资于股票、权证等权益类资产的投资比例合计不超过基金资产的 20%；其中基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终，扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，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%。</p>  | <p>基金的投资组合比例为：本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%；投资于股票、权证等权益类资产的投资比例合计不超过基金资产的 20%；其中基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终，扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金（<b>不含结算备付金、存出保证金、应收申购款等</b>）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%。</p>  | <p>根据《流动性风险管理规定》第十八条修改</p>          |
| <p>12、 P46-48</p>                     | <p>1、组合限制</p>   | <p>1、组合限制</p>  | <p>根据《流动性风险管理</p>                   |

|   |  |   |  |
|---|--|---|--|
| <p><b>第十二部分 四、投资限制</b></p>                | <p>(2) 本基金在任何交易日日终, 扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后, 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%;</p> <p>因证券、期货市场波动、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>(2) 本基金在任何交易日日终, 扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后, 现金 (不含结算备付金、存出保证金、应收申购款等) 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%;</p> <p><b>(增加)</b></p> <p><b>(19) 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>(20) 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>(21) 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;</b></p> <p>除上述第 (2)、(19)、(21) 项外, 因证券、期货市场波动、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>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、十六、十七条修改</p> |
| <p>13、 P53<br/><b>第十四部分 三、估值方法</b></p>    |  | <p><b>(增加)</b></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。</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>14、 P56<br/><b>第十四部分 五、估值错误的处理</b></p> | <p>5、特殊情况的处理</p> <p>(1) 基金管理人或基金托管人按基金合同约定的估值方法第 8 项进行估值时, 所造成的误差不作为基金资产估值错误处理;</p>  | <p>5、特殊情况的处理</p> <p>(1) 基金管理人或基金托管人按基金合同约定的估值方法第 9 项进行估值时, 所造成的误差不作为基金资产估值错误处理;</p>   | <p>根据估值方法调整序号</p>                                  |

|  |  |  |   |
|--|--|--|---|
| <p>15、P56<br/>第十四部分 六、暂停估值的情形</p>      |  | <p>(增加)<br/>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；</p>  | <p>根据《流动性风险管理规定》第二十四条补充</p>   |
| <p>16、P66-68<br/>第十八部分 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<br/>法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。<br/>(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<br/>(增加)<br/>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。<br/>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。<br/>法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。<br/>(七) 临时报告<br/>(增加)<br/>28、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；<br/>29、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；</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<br/><br/>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：《永赢双利债券型证券投资基金托管协议》修改条款前后文对照表

《永赢双利债券型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，具体新《永赢双利债券型证券投资基金托管协议》与原《永赢双利债券型证券投资基金托管协议》修改条文的对照说明如下：

| 页码                               | 《永赢双利债券型证券投资基金托管协议》  | 《永赢双利债券型证券投资基金托管协议》修改条款版本  | 修改理由   |
|----------------------------------|--|--|--|
|                                  | 内容   | 内容   |  |
| 17、P3                            |  | <p>（增加）</p> <p>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。</p> | 根据《流动性风险管理规定》进行适应性修订                               |
| 18、P4<br>一、基金托管协议当事人（二）基金托管人     | 法定代表人：吴万善  | 法定代表人：周易   | 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。                       |
| 19、P5-8<br>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查 | （一）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。《基金合同》明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合《基金合同》关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。 | （一）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。《基金合同》明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合《基金合同》关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。                 | 根据《流动性风险管理规定》第十五条、第十六条、第十七条和第十八条规定，对投资限制中的组合限制进行修改 |

|  |  |   |  |
|--|--|---|--|
|  | <p>基金的投资组合比例为：本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%；投资于股票、权证等权益类资产的投资比例合计不超过基金资产的 20%；其中基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终，扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，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%。</p> <p>（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：</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>（2）本基金在任何交易日日终，扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，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%；</p> <p>因证券、期货市场波动、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 个工作日内进行调整。法律法规另有规定的，从其规定。</p> | <p>基金的投资组合比例为：本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%；投资于股票、权证等权益类资产的投资比例合计不超过基金资产的 20%；其中基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终，扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金（<b>不含结算备付金、存出保证金、应收申购款等</b>）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%。</p> <p>（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：</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>（2）本基金在任何交易日日终，扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金（<b>不含结算备付金、存出保证金、应收申购款等</b>）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%；</p> <p><b>（增加）</b></p> <p><b>（19）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>（20）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>（21）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；</b></p> |  |
|--|--|---|--|

|   |   |  |   |
|---|---|--|---|
|   |   | 除上述第(2)、(19)、(21)项外，因证券、期货市场波动、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。  |   |
| 20、P24-25<br>八、基金资产净值<br>计算和会计核算<br>(二)基金资产估值方法和特殊情形的处理 | 2、估值方法<br>3、特殊情形的处理<br>(1)基金管理人、基金托管人按估值方法的第(8)项进行估值时，所造成的误差不能作为基金份额净值错误处理。 | 2、估值方法<br>(增加)<br>(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。<br>3、特殊情形的处理<br>(1)基金管理人、基金托管人按估值方法的第(9)项进行估值时，所造成的误差不能作为基金份额净值错误处理。 | 根据《流动性风险管理规定》第二十五条规定，进行适应性修改。<br><br>根据估值方法调整序号 |
| 21、P26<br>八、基金资产净值<br>计算和会计核算<br>(四)暂停估值与公告基金份额净值的情形    |   | (增加)<br>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；  | 根据《流动性风险管理规定》第二十四条规定，进行适应性修订                    |