

关于平安大华行业先锋混合型证券投资基金

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》”），对已经成立或已获核准但尚未完成募集的开放式基金，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，修改基金合同并公告。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协商一致，平安大华基金管理有限公司（以下简称：“本公司”）对旗下平安大华行业先锋混合型证券投资基金（以下简称：“本基金”）的《平安大华行业先锋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。本次《基金合同》的修改内容包括释义、申购与赎回的数量限制、申购和赎回的价格、费用及其用途、拒绝或暂停申购的情形、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形、巨额赎回的处理方式、投资范围、投资限制、估值方法、暂停估值的情形、基金的信息披露等。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，不需召开基金份额持有人大会，并已报中国证监会备案。修订后的《基金合同》自 2018 年 3 月 31 日起生效。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《平安大华行业先锋混合型证券投资基金托管协议》，并将在更新的《平安大华行业先锋混合型证券投资基金招募说明书》中作相应调整。

投资者欲了解本基金的详细情况，请阅读本基金的基金合同、招募说明书及其更新。投资者也可访问本公司网站(www.fund.pingan.com)或拨打客户服务电话（400—800—4800）咨询相关情况。

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，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。敬请投资者留意投资风险。

特此公告。

平安大华基金管理有限公司

2018年3月24日

附件：《平安大华行业先锋混合型证券投资基金基金合同》根据流动性新规修改后前后条文对照表

章节	修订前《基金合同》条款	修订后《基金合同》条款
一、前言	<p>(一) 订立《平安大华行业先锋混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“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</p> <p>订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法通则》、《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》)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称《信息披露办法》)和《证券投资基金销售管理办法》(以下简称《销售办法》)及其他法律法规的有关规定。</p>	<p>(一) 订立《平安大华行业先锋混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“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</p> <p>订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法通则》、《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》)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称《信息披露办法》)和《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》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)</u>及其他法律法规的有关规定。</p>
二、释义	<p>本基金合同中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：</p> <p>.....</p> <p>《信息披露办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 8 日颁布并于 2004 年 7 月 1 日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及不时作出的修订</p> <p>.....</p> <p>不可抗力：指本基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服，且在本基金合同由基金管理人、基金托管人签署之日后发生的，使本基金合同当事人无法全部或部分履行本基金合同的任何事件</p>	<p>本基金合同中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：</p> <p>.....</p> <p>《信息披露办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 8 日颁布并于 2004 年 7 月 1 日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及不时作出的修订</p> <p><u>《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；</u></p> <p>.....</p> <p>不可抗力：指本基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服，且在本基金合同由基金管理人、基金托管人签署之日后发生的，使本基金合同当事人无法全部或部分履行本基金合同的任何事件</p> <p><u>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。</u></p>
六、基金份额的申购、赎回与转换	<p>(五) 申购与赎回的数额限制</p> <p>1、本基金申购和赎回的数额限制由基金管理人确定并在招募说明书中列示。</p> <p>2、基金管理人可根据市场情况，合理调整对申购金额和赎回份额的数量限制，基金管理人进行前述调整</p>	<p>(五) 申购与赎回的数额限制</p> <p>1、本基金申购和赎回的数额限制由基金管理人确定并在招募说明书中列示。</p> <p>2、<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</u></p>

	<p>必须提前 3 个工作日在至少一种指定媒体上公告。</p>	<p><u>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，具体请参见相关公告。</u></p> <p>3、基金管理人可根据市场情况，合理调整对申购金额和赎回份额的数量限制，基金管理人进行前述调整必须提前 3 个工作日在至少一种指定媒体上公告。</p>
<p>六、基金份额的申购、赎回与转换</p>	<p>(七) 申购和赎回的费用及其用途</p> <p>1、本基金申购费率最高不超过申购金额的 5%，赎回费率最高不超过赎回金额的 5%。</p> <p>2、本基金申购费率按照申购金额递减，即申购金额越大，所适用的申购费率越低，申购费用等于申购金额减净申购金额（见前述计算公式）。实际执行的申购费率在招募说明书中载明。投资者在一天之内如有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。</p> <p>3、本基金的赎回费率按照持有时间递减，即相关基金份额持有时间越长，所适用的赎回费率越低，赎回费用等于赎回金额乘以所适用的赎回费率（见前述计算公式）。实际执行的赎回费率在招募说明书中载明。</p> <p>4、本基金的申购费用由申购人承担，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金财产。</p> <p>本基金的赎回费用由基金份额持有人承担，对持续持有期不少于 7 日的投资者收取的赎回费，其中不低于 25% 的部分归入基金财产（具体比例见招募说明书），其余部分用于支付注册登记等相关手续费。</p> <p>5、基金管理人可以在法律法规和本基金合同规定范围内调整申购费率和赎回费率。费率如发生变更，基金管理人应在调整实施 3 个工作日前在至少一种指定媒体上公告。</p>	<p>(七) 申购和赎回的费用及其用途</p> <p>1、本基金申购费率最高不超过申购金额的 5%，赎回费率最高不超过赎回金额的 5%，<u>其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。</u></p> <p>2、本基金申购费率按照申购金额递减，即申购金额越大，所适用的申购费率越低，申购费用等于申购金额减净申购金额（见前述计算公式）。实际执行的申购费率在招募说明书中载明。投资者在一天之内如有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。</p> <p>3、本基金的赎回费率按照持有时间递减，即相关基金份额持有时间越长，所适用的赎回费率越低，赎回费用等于赎回金额乘以所适用的赎回费率（见前述计算公式）。实际执行的赎回费率在招募说明书中载明。</p> <p>4、本基金的申购费用由申购人承担，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金财产。</p> <p>本基金的赎回费用由基金份额持有人承担，<u>对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费将全额计入基金资产</u>，对持续持有期不少于 7 日的投资者收取的赎回费，其中不低于 25% 的部分归入基金财产（具体比例见招募说明书），其余部分用于支付注册登记等相关手续费。</p> <p>5、基金管理人可以在法律法规和本基金合同规定范围内调整申购费率和赎回费率。费率如发生变更，基金管理人应在调整实施 3 个工作日前在至少一种指定媒体上公告。</p>
<p>六、基金份额的申购、赎回与转换</p>	<p>(九) 巨额赎回的认定及处理方式</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>出现巨额赎回时，基金管理人可以根据本基金当时的资产组合状况决定接受全额赎回或部分延期赎回。</p> <p>(1) 接受全额赎回：当基金管理人认为有能力兑付投资者的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。</p> <p>(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为兑付投资者的赎回申请有困难，或认为兑付投资者的赎回申请进行的资产变现可能使基金资产净值发生较大波动时，</p>	<p>(九) 巨额赎回的认定及处理方式</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>出现巨额赎回时，基金管理人可以根据本基金当时的资产组合状况决定接受全额赎回或部分延期赎回。</p> <p>(1) 接受全额赎回：当基金管理人认为有能力兑付投资者的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。</p> <p>(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为兑付投资者的赎回申请有困难，或认为兑付投资者的赎回申请</p>

	<p>基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额 10%的前提下，对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个基金份额持有人申请赎回份额占当日申请赎回总份额的比例，确定该基金份额持有人当日受理的赎回份额；未受理部分除投资者在提交赎回申请时选择将当日未获受理部分予以撤销者外，延迟至下一开放日办理，赎回价格为下一个开放日的价格。转入下一开放日的赎回申请不享有赎回优先权，以此类推，直到全部赎回为止。</p> <p>(3) 当发生巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或招募说明书规定的其他方式，在 3 个工作日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在至少一种指定媒体予以上公告。</p> <p>(4) 暂停接受和延缓支付：本基金连续 2 个开放日以上发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但延缓期限不得超过 20 个工作日，并应当在至少一种指定媒体上公告。</p>	<p>进行的资产变现可能使基金资产净值发生较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额 10%的前提下，对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个基金份额持有人申请赎回份额占当日申请赎回总份额的比例，确定该基金份额持有人当日受理的赎回份额；未受理部分除投资者在提交赎回申请时选择将当日未获受理部分予以撤销者外，延迟至下一开放日办理，赎回价格为下一个开放日的价格。转入下一开放日的赎回申请不享有赎回优先权，以此类推，直到全部赎回为止。</p> <p>(3) 当发生巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或招募说明书规定的其他方式，在 3 个工作日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在至少一种指定媒体予以上公告。</p> <p>(4) 暂停接受和延缓支付：本基金连续 2 个开放日以上发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但延缓期限不得超过 20 个工作日，并应当在至少一种指定媒体上公告。</p> <p><u>(5) 若本基金发生巨额赎回的，在单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额 20%以上的赎回申请的情形下，基金管理人有权延期办理赎回申请；对于该基金份额持有人当日超过上一开放日基金总份额 20%以上的那部分赎回申请，有权全部自动进行延期办理；对于该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人根据前段“（1）接受全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。但是，如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。</u></p>
<p>六、基金份额的申购、赎回与转换</p>	<p>(十) 拒绝或暂停申购、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形及处理</p> <p>1、在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请：</p> <p>(1) 因不可抗力导致基金管理人无法受理投资者的申购申请；</p> <p>(2) 证券交易场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；</p> <p>(3) 发生本基金合同规定的暂停基金财产估值情况；</p> <p>(4) 基金财产规模过大，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，从而损害现有基金份额持有人的利益的情形；</p>	<p>(十) 拒绝或暂停申购、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形及处理</p> <p>1、在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请：</p> <p>(1) 因不可抗力导致基金管理人无法受理投资者的申购申请；</p> <p>(2) 证券交易场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；</p> <p>(3) 发生本基金合同规定的暂停基金财产估值情况；</p> <p>(4) 基金财产规模过大，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，从而损害现有基金份额持有人的利益的情形；</p>

<p>(5) 基金管理人、基金托管人、基金销售机构或注册登记机构因技术故障或异常情况导致基金销售系统或基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行；</p> <p>(6) 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>(7) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。</p> <p>基金管理人决定拒绝或暂停接受某些投资者的申购申请时，申购款项将退回投资者账户。基金管理人决定暂停接受申购申请时(第(6)种情形除外)，应当依法公告。在暂停申购的情形消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理并依法公告。</p> <p>2、在以下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请或延缓支付赎回款项：</p> <p>(1) 因不可抗力导致基金管理人无法支付赎回款项；</p> <p>(2) 证券交易场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；</p> <p>(3) 基金连续发生巨额赎回，根据本基金合同规定，可以暂停接受赎回申请的情况；</p> <p>(4) 发生本基金合同规定的暂停基金财产估值的情况；</p> <p>(5) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。</p>	<p>(5) 基金管理人、基金托管人、基金销售机构或注册登记机构因技术故障或异常情况导致基金销售系统或基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行；</p> <p>(6) 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>(7) <u>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；</u></p> <p><u>(9) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。</u></p> <p>基金管理人决定拒绝或暂停接受某些投资者的申购申请时，申购款项将相应退回投资者账户。基金管理人决定暂停接受申购申请时(第(6)、(7)种情形除外)，应当依法公告。在暂停申购的情形消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理并依法公告。</p> <p>2、在以下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请或延缓支付赎回款项：</p> <p>(1) 因不可抗力导致基金管理人无法支付赎回款项；</p> <p>(2) 证券交易场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；</p> <p>(3) 基金连续发生巨额赎回，根据本基金合同规定，可以暂停接受赎回申请的情况；</p> <p>(4) 发生本基金合同规定的暂停基金财产估值的情况；</p> <p>(5) <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，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请；</u></p> <p><u>(6) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。</u></p>
<p>十四、基金的投资</p> <p>(二) 投资范围</p> <p>基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例范围为60%-95%，除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为5%-40%，其中权证投资比例不高于基金资产净值的3%，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金以及到期日在一年以内的</p>	<p>(二) 投资范围</p> <p>基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例范围为60%-95%，除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为5%-40%，其中权证投资比例不高于基金资产净值的3%，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金以及到期日在一年</p>

	<p>政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</p>
<p>十四、基金的投资</p>	<p>(八) 投资禁止行为与限制</p> <p>(1) 持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；</p> <p>(2) 本基金与基金管理人管理的其他基金持有一家上市公司发行的证券总和，不超过该证券的 10%；</p> <p>(3) 本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例范围为 60%-95%，除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为 5%-40%；</p> <p>(4) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；</p> <p>(5) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%；</p> <p>(6) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；</p> <p>(7) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；</p> <p>(8) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；</p> <p>(9) 本基金财产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；</p> <p>(10) 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%；</p> <p>(11) 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 95%；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；</p> <p>(12) 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%；本基金管理人应当按照中国金融期货交易所要求的内容、格式与时限向交易所报告所交易和持有的卖出期货合约情况、交易目的及对应的证券资产情况等；</p> <p>(13) 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>(八) 投资禁止行为与限制</p> <p>(1) 持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；</p> <p>(2) 本基金与基金管理人管理的其他基金持有一家上市公司发行的证券总和，不超过该证券的 10%；</p> <p><u>(3) 基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)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>(4) 本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例范围为 60%-95%，除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为 5%-40%；</u></p> <p><u>(5) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；</u></p> <p><u>(6) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%；</u></p> <p><u>(7) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；</u></p> <p><u>(8) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；</u></p> <p><u>(9) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；</u></p> <p><u>(10) 本基金财产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；</u></p> <p><u>(11) 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%；</u></p> <p><u>(12) 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 95%；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；</u></p> <p><u>(13) 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%；</u></p>

	<p>(14) 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%的现金以及到期日在一年以内的政府债券;</p> <p>(15) 相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。</p>	<p>本基金管理人应当按照中国金融期货交易所要求的内容、格式与时限向交易所报告所交易和持有的卖出期货合约情况、交易目的及对应的证券资产情况等;</p> <p><u>(14) 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%;</u></p> <p><u>(15) 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%的现金以及到期日在一年以内的政府债券,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><u>(16) 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述所规定比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;</u></p> <p><u>(17) 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><u>(18) 相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。</u></p>
<p>十四、 基金的 投资</p>	<p>(九) 投资组合比例调整</p> <p>基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。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不符合基金合同约定的投资比例规定的,基金管理人应当在十个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定时,从其规定。</p>	<p>(九) 投资组合比例调整</p> <p>基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。<u>除上述第(15)、(16)、(17)项外</u>,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不符合基金合同约定的投资比例规定的,基金管理人应当在十个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定时,从其规定。</p>
<p>十七、 基金资 产的估 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所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;</p> <p>2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金财产价值时;</p> <p>3、中国证监会认定的其他情形。</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所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;</p> <p>2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金财产价值时;</p> <p>3、<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一致的,基金管理人应当暂停估值;</u></p> <p>4、中国证监会认定的其他情形。</p>
<p>二十一、 基金的</p>	<p>(五) 定期报告</p> <p>基金定期报告由基金管理人按照法律法规和中国证</p>	<p>(五) 定期报告</p> <p>基金定期报告由基金管理人按照法律法规和中国证</p>

<p>信息披露</p>	<p>会颁布的有关证券投资基金信息披露内容与格式的相关文件的规定单独编制，由基金托管人按照法律法规的规定对相关内容进行复核。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及更新的招募说明书。</p> <p>1、基金年度报告：基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定报刊上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。</p> <p>2、基金半年度报告：基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定报刊上。</p> <p>3、基金季度报告：基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定报刊和网站上。</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>法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。</p>	<p>监会颁布的有关证券投资基金信息披露内容与格式的相关文件的规定单独编制，由基金托管人按照法律法规的规定对相关内容进行复核。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及更新的招募说明书。</p> <p>1、基金年度报告：基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定报刊上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。</p> <p>2、基金半年度报告：基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定报刊上。</p> <p>3、基金季度报告：基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定报刊和网站上。</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><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，基金管理人应当至少在季度报告、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产品的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。</u></p> <p><u>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。</u></p> <p>法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。</p>
<p>二十一、基金的信息披露</p>	<p>(六) 临时报告与公告</p> <p>……</p> <p>27、基金份额持有人大会的决议</p> <p>28、中国证监会规定的其他事项。</p>	<p>(六) 临时报告与公告</p> <p>……</p> <p>27、基金份额持有人大会的决议</p> <p>28、<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的；</u></p> <p><u>29、</u> 中国证监会规定的其他事项。</p>
<p>二十八、基金合同内容摘要</p>	<p>(二) 投资范围</p> <p>基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例范围为 60%-95%，除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为 5%-40%，其中权证投资比例不高于基金资产净值的 3%，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金以及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>(二) 投资范围</p> <p>基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例范围为 60%-95%，除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为 5%-40%，其中权证投资比例不高于基金资产净值的 3%，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金以及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>5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</p>
<p>二十八、基金合同内容摘要</p>	<p>(八) 投资禁止行为与限制</p> <p>(1) 持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；</p> <p>(2) 本基金与基金管理人管理的其他基金持有一家上市公司发行的证券总和，不超过该证券的 10%；</p> <p>(3) 本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例范围为 60%-95%，除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为 5%-40%；</p> <p>(4) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；</p> <p>(5) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%；</p> <p>(6) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；</p> <p>(7) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；</p> <p>(8) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；</p> <p>(9) 本基金财产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；</p> <p>(10) 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%；</p> <p>(11) 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 95%；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；</p> <p>(12) 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%；本基金管理人应当按照中国金融期货交易所要求的内容、格式与时限向交易所报告所交易和持有的卖出期货合约情况、交易目的及对应的证券资产情况等；</p> <p>(13) 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>(14) 本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需</p>	<p>(八) 投资禁止行为与限制</p> <p>(1) 持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；</p> <p>(2) 本基金与基金管理人管理的其他基金持有一家上市公司发行的证券总和，不超过该证券的 10%；</p> <p><u>(3) 基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)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>(4) 本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例范围为 60%-95%，除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为 5%-40%；</u></p> <p><u>(5) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；</u></p> <p><u>(6) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%；</u></p> <p><u>(7) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；</u></p> <p><u>(8) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；</u></p> <p><u>(9) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；</u></p> <p><u>(10) 本基金财产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；</u></p> <p><u>(11) 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%；</u></p> <p><u>(12) 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 95%；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；</u></p> <p><u>(13) 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%；</u>本基金管理人应当按照中国金融期货交易所要求的</p>

	<p>缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金以及到期日在一年以内的政府债券；</p> <p>(15) 相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。</p>	<p>内容、格式与时限向交易所报告所交易和持有的卖出期货合约情况、交易目的及对应的证券资产情况等；</p> <p><u>(14) 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%；</u></p> <p><u>(15) 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%的现金以及到期日在一年以内的政府债券，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><u>(16) 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述所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u></p> <p><u>(17) 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><u>(18) 相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。</u></p>
<p>二十八、基金合同摘要</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所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</p> <p>2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金财产价值时；</p> <p>3、中国证监会认定的其他情形。</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所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</p> <p>2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金财产价值时；</p> <p>3、<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一致的，基金管理人应当暂停估值；</u></p> <p>4、<u>中国证监会认定的其他情形。</u></p>