

# 红土创新基金管理有限公司关于红土创新改革红利灵活配置混合型发起式证券投资基金修改基金合同和托管协议的公告

公告送出日期：2018年3月24日

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》的有关规定，红土创新基金管理有限公司（以下简称“本公司”）经与基金托管人中信银行股份有限公司协商一致并报中国证监会备案，已完成对旗下红土创新改革红利灵活配置混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）基金合同和托管协议的修改，现将具体事宜公告如下。

## 一、《基金合同》的修改内容

本基金修改事项对原有基金份额持有人的利益无实质性影响，不涉及法律法规规定或《基金合同约定》经基金份额持有人大会决议通过的事项。《基金合同》的具体修改内容如下：

章节 原文条款 修改后条款

内容 内容

### 第一部分前言

#### 一、订立本基金合同的目的、依据和原则

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》”）、《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。

#### 一、订立本基金合同的目的、依据和原则

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。

七、本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%（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的情形除外），但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的除外。

## 第二部分释义

9、《基金法》：指《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机构对其不时做出的修订

9、《基金法》：指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，经2012年12月28日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自2013年6月1日起实施的，并经2015年4月24日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修改的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订

无

14、《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

无

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

56、摆动定价机制：指当本基金各类份额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

#### 第四部分基金份额

的发售

##### 三、基金份额认购金额的限制

无

##### 三、基金份额认购金额的限制

5、如本基金单个投资人累计认购的基金份额数达到或者超过基金总份额的 50%，基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的认购申请进行限制（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的情形除外）。基金管理人接受某笔或者某些认购申请有可能导致投资者变相规避前述 50%比例要求的，基金管理人有权拒绝该等全部或者部分认购申请。投资人认购的基金份额数以基金合同生效后登记机构的确认为准。

#### 第六部分基金份额

的申购与赎回

##### 五、申购和赎回的数量限制

无

##### 五、申购和赎回的数量限制

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。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。

## 六、申购和赎回的价格、费用及其用途

### 5、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。

不低于赎回费总额的 25% 应归基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。

## 六、申购和赎回的价格、费用及其用途

### 5、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。不低于赎回费总额的

25% 应归基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续

费。本基金对持续持有期少于 7 日的基金份额投资者收取不低

于 1.5% 的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。法律法

规或监管机构另有规定的从其规定。

无

### 8、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。

## 七、拒绝或暂停申购的情形

### 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。

.....

发生上述第 1、2、3、5、6、7 项暂停申购情形时，

基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登

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。

## 七、拒绝或暂停申购的情形

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收投资人的申购申请。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。

.....

5、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数的比例达到或者超过基金份额总数的 50%，或者有可能导致投资者变相规避前述 50%比例要求的情形(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的情形除外)。

.....

发生上述第 1、2、3、6、7、8 项暂停申购情形时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体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。

#### 八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时。

#### 八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

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收投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。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赎回申请。

#### 九、巨额赎回的情形及处理方式

2、巨额赎回的处理方式

(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。

## 九、巨额赎回的情形及处理方式

### 2、巨额赎回的处理方式

(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的全部赎回申请有困难或认为因支付投资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，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。若进行上述延期处理，对于单个基金份额持有人当日超过上一开放日基金总份额 10%以上的赎回申请，将自动进行延期办理；对于其余赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日可确认的赎回份额。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，当日未获确认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某一类别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。部分延期赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

无

十八、基金管理人可在法律法规允许的范围内，在不影响基金份额持有人实质利益的前提下，根据市场情况对上述申购和赎回的安排进行补充和调整并提前公告。

## 第十二部分基金的

### 投资

#### 四、投资限制

##### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

(2) 每个交易日日终持有现金或者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%；

.....

(9) 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%

(14) 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%；

#### 四、投资限制

##### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

(2) 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，基金保留的现金或投资于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%；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

.....

(9) 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%，中国证监会规定的特殊品种除外；

(14) 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%；债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不展期；

.....

(18) 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%；

(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。

(20) 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；

因证券市场波动、债券发行人合并、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

或本基金合同另有约定的除外。法律法规另有规

定的，从其规定。

除上述 (2)、(12)、(19)、(20) 项规定以外，因证券市场波

动、债券发行人合并、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



形或本基金合同另有约定的除外。法律法规另有规定的，从其规定。

#### 第十四部分基金资

产估值

##### 三、估值方法

无

##### 三、估值方法

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。

##### 六、暂停估值的情形

无

##### 六、暂停估值的情形

4、经与基金托管人协商确认，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，基金管理人应当暂停基金估值；

#### 第十八部分基金的

信息披露

##### 五、公开披露的基金信息

(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

...

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。报备应当采用电子文本或书面报告方式。

##### 五、公开披露的基金信息

(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

...

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。报备应当采用电子文本或书面报告方式。

基金管理人应在年度报告、半年度报告、季度报告中分别披露基金管理人及基金管理人股东持有基金的份额、期限及期间的变动情况。

本基金持续运作过程中，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。

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。

## 五、公开披露的基金信息

### （七）临时报告

无

## 五、公开披露的基金信息

### （七）临时报告

23、本基金发生巨额赎回并延缓支付赎回款项；

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；

28、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；

29、增加或调整基金份额类别；

## 二、《托管协议》的修改内容

本基金修改事项经双方当事人协商一致，修改后的新协议，内容与基金合同的规定没有冲突。《托管协议》的具体修改内容如下：

《红土创新改革红利灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议修改前后文对照表》

章节 原文条款 修改后条款

内容 内容

第三条基金托管人对

基金管理人的业务监

督和核查

### 3.1.1

本基金各类资产的投资比例范围为：

股票占基金资产的比例为 0-95%；投资于改革红利主题相关证券的投资比例不低于非现金基金资产的 80%。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、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

### 3.1.1

本基金各类资产的投资比例范围为：

股票占基金资产的比例为 0-95%；投资于改革红利主题相关证券的投资比例不低于非现金基金资产的 80%。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%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

### 3.1.2 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：

(2) 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，应当保持现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；

(9) 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%；

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，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。

3.1.2 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：

(2) 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，应当保持现金或到期日在一年以内的政府债券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；

(9) 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%，中国证监会规定的特殊品种除外；

(18) 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%；

(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。

(20) 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；

(21) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第 (2)、(12)、(19)、(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，基金管理人应当在 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。

## 第八条基金资产净值

### 计算和会计核算

#### 8.2.2 估值方法

无

#### 8.2.2 估值方法

(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。

### 8.6 暂停估值的情形

(1) 与本基金投资有关的证券交易场所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

### 8.6 暂停估值的情形

(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；

(4) 经与基金托管人协商确认，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，基金管理人应当暂停基金估值；

## 三、重要提示

1、本公司于本公告日在网站上同时公布经修改后的本基金基金合同及托管协议；招募说明书及摘要将随后在定期更新时进行相应修改；

2、投资者可拨打本公司客户服务电话（4000603333）或登录本公司网站（[www.htcxfund.com](http://www.htcxfund.com)）咨询相关事宜。

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。投资人投资于本基金时应认真阅读本基金的基金合同、招募说明书等文件。敬请投资人留意投资风险。

特此公告。

红土创新基金管理有限公司

2018 年