

# 东吴基金管理有限公司关于修改东吴国企改革主题灵活配置混合型

## 证券投资基金基金合同、托管协议的公告

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《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》”）等法律法规和《东吴国企改革主题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”或“《基金合同》”）的有关规定，为保护投资者利益，东吴基金管理有限公司（以下简称“本公司”）经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致并报中国证券监督管理委员会上海监管局备案，对东吴国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金合同、托管协议相关内容进行修订。

现将具体事项公告如下：

### 一、基金合同的修订内容

根据 2017 年 10 月 1 日起实施的《流动性风险管理规定》，本公司对本基金基金合同和托管协议的相关内容进行了修订，具体修改内容请见附件修改前后条款对照表。本次修订是因相应的法律法规发生变动而进行的，不需召开基金份额持有人大会。本公司已就修订内容与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会上海监管局备案。基金合同和托管协议的具体修订内容详见附件。本次修改后的基金合同、托管协议将于 2018 年 3 月 31 日起正式施行。

### 二、重要提示

1、本次修改遵照法律法规、中国证监会的相关规定和基金合同的约定执行，可不经基金份额持有人大会表决。

2、本基金管理人将在指定媒介上公布经修改后的基金合同和托管协议。本基金管理人将在更新基金招募说明书时，对上述相关内容进行相应修订。

3、投资者可登录本基金管理人网站（[www.scfund.com.cn](http://www.scfund.com.cn)）或拨打本基金管理人的客户服务热线（400-821-0588、021-50509666）进行咨询、查询。

风险提示：本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。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。

东吴基金管理有限公司

二〇一八年三月二十六日

附件 1:《东吴国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》修改前后条款对照表

附件 2:《东吴国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金托管协议》修改前后条款对照表

附件 1:《东吴国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》修改前后条款对照表  
章节 原表述 修改后表述

第一部分：

前言

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。

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“《流动性风险规定》”)和其他有关法律、法规。 …

第一部分：

前言和释

义

增加《流动性风险规定》的释义：

13、《流动性风险规定》：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

第一部分：

前言和释

义

增加流动性受限资产的释义：

51、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

第六部分：

基金份额

的申购与

赎回

五、申购与赎回的数额限制

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，具体规定请参见相关公告。

第六部分：

基金份额

的申购与

## 赎回

### 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。赎回费依照相关法律法规规定的比例归入基金财产，具体见招募说明书，未归入基金财产的赎回费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，其中对持续持有期少于7日的投资者收取不低于1.5%的赎回费并全额计入基金财产。赎回费依照相关法律法规规定的比例归入基金财产，具体见招募说明书，未归入基金财产的赎回费用于支付登记费和其他必要的手续费。

## 第六部分：

### 基金份额

#### 的申购与

#### 赎回

### 七、拒绝或暂停申购的情形及处理方式

发生上述第1、2、3、5、6项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，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。

### 七、拒绝或暂停申购的情形及处理方式

.....

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基金申购申请。

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。

发生上述第1、2、3、5、6、8项暂停申购情形之一且基金管

理人决定暂停申购时，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全部或部分被拒绝的，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。

第六部分：

基金份额  
的申购与  
赎回

八、暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式

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，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请；

第六部分：

基金份额  
的申购与  
赎回

九、巨额赎回的情形及处理方式增加以下条款：

.....

(3) 如发生单个开放日内单个基金份额持有人申请赎回的基金份额占前一开放日基金总份额的比例超过 20%时，本基金管理人可以对该单个基金份额持有人超过前述约定比例的赎回申请实施延期赎回。

对该单个基金份额持有人不超过前述比例的赎回申请，与当日其他赎回申请一起，按上述“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”方式处理。如下一开放日，该单一基金份额持有人剩余未赎回部分仍旧超出前述比例约定的，继续按前述规则处理，直至该单一基金份额持有人单个开放日内申请赎回的基金份额占前一开放日基金总份额的比例低于前述比例。

在不违反法律法规的前提下，基金管理人在履行适当程序后，有权根据当时市场环境调整前述比例及处理规则，并在指定媒介上进行公告。

第七部分

基金合同  
当事人及  
权利义务

一、基金管理人

法定代表人：任少华

一、基金管理人

法定代表人：王炯

第七部分

基金合同  
当事人及

权利义务

二、基金托管人

法定代表人：王洪章

二、基金托管人

法定代表人：田国立

第十二部

分：基金的

投资

二、投资范围

本基金投资组合比例为：股

票投资占基金资产的比例为 0%

-95%，投资于国企改革主题的

股票的比例不低于非现金基金

资产的 80%；债券、货币市场工

具、银行存款、资产支持证券等

固定收益类资产的投资比例不

低于基金资产的 5%；权证投资占

基金资产净值的比例不高于

3%；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，股指期货的

投资比例遵循国家相关法律法规。

本基金投资于其他金融工具

的比例依照法律法规或监管机构

的规定执行。

二、投资范围

本基金投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为

0%-95%，投资于国企改革主题的股票的比例不低于非现金

基金资产的 80%；债券、货币市场工具、银行存款、资产支持

证券等固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的 5%；权

证投资占基金资产净值的比例不高于 3%；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，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购

款等。股指期货的投资比例遵循国家相关法律法规。本基金

投资于其他金融工具的比例依照法律法规或监管机构的规定

执行。

第十二部

分：基金的

投资

四、投资限制

(2) 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；因证券、期货市场波动、证券发行人合并、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除外。

#### 四、投资限制

(2) 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，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

(20) 本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%；

(21) 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；

(22) 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；

除上述第（2）、（12）、（21）、（22）项之外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、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除外。

#### 第十四部

##### 分：基金资

##### 产估值

#### 六、暂停估值的情形增加以下条款：

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后，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

(七) 临时报告

26、中国证监会规定的其他事项。

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

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，为保障其他投资者利益，基金管理人至少应当在定期报告“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本基金的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

本基金持续运作过程中，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。

(七) 临时报告

26、发生涉及本基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；

27、中国证监会规定和基金合同约定的其他事项。

附件 2：《东吴国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金托管协议》修改前后条款对照表  
章节 原文条款 修改后条款

一、基金托管

协议当事人

(一) 基

金管理人

法定代表人：任少华 法定代表人:王炯

一、基金托管

协议当事人

(二) 基

金托管人

法定代表人：王洪章 法定代表人：田国立

二、基金托管

协议的依据、

目的和原则

(一) 订

立托管协 议

的依据

本协议依据 《中华人民共和国

证券投资基金法》(以下简称

“《基金法》”)、《基金合同》及

其他有关规定制订。

本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法律法规、《基金合同》及其他有关规定制订。

### 三、基金托管

人对基金管

理人的业务

监督和核查

本基金投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为0%-95%；投资于国企改革主题的股票的比例不低于非现金基金资产的80%；债券、货币市场工具、银行存款、资产支持证券等固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的5%；权证投资占基金资产净值的比例不高于3%；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；股指期货的投资比例遵循国家相关法律法规。本基金投资于其他金融工具的比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

(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：

(2) 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；

.....

因证券、期货市场波动、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。

本基金投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 0%-95%；投资于国企改革主题的股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；债券、货币市场工具、银行存款、资产支持证券等固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的 5%；权证投资占基金资产净值的比例不高于 3%；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，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；股指期货的投资比例遵循国家相关法律法规。本基金投资于其他金融工具的比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

（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：

（2）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，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

.....

（20）本基金管理人管理的、并由本基金托管人托管的全部开放式基金（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、并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%；

（21）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；

（22）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；除上述第（2）、（12）、（21）、（22）项之外，因证券、期货市场波动、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 个工作日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

## 八、基金资产

净值计算和

会计核算

（四）暂停估

值与公告基

金份额净值

的情形

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后，基金管理人应当暂停基金估值；