

东吴基金管理有限公司关于修改东吴价值成长双动力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《东吴价值成长双动力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农业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，对东吴价值成长双动力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。本次修订是对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农业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、根据《流动性风险管理规定》的规定及基金合同的约定，本基金管理人将对本基金的赎回费率进行调整，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，并将上述赎回费全额计入基金财产；对持续持有期不少于 7 日的投资者，仍按照原定的赎回费率标准收取。

上述基金赎回费率的调整亦将于 2018 年 3 月 31 日起生效。

敬请投资者关注以上变化和影响，并仔细阅读本基金修订后的基金合同及相关法律文件，审慎进行投资决策。

4、投资者可登录本基金管理人网站（www.scfund.com.cn）或拨打本基金管理人的客户服务电话（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:《东吴价值成长双动力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:《东吴价值成长双动力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:《东吴价值成长双动力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：前言和释义 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，规范东吴价值成长双动力混合型证券投资基金运作，依照《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》)及其他有关规定 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,规范东吴价值成长双动力混合型证券投资基金运作,依照《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》)、《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》)及其他有关规定,在自愿、公平、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《东吴价值成长双动力混合型证券投资基金基金合同》(以下简称本合同或《基金合同》)。

第一部分:前言和释义 《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》;

第一部分:前言和释义 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;

第三部分:基金份额的发售 2.投资者选择交纳前端认购费时,费率按认购金额递减,具体费率如下:

赎回费率

一年以内(含一年) 0.5% 2.投资者选择交纳前端认购费时,费率按认购金额递减,具体费率如下:

赎回费率

7 天以内(不含 7 天) 1.5%

7 天到一年(含一年) 0.5%

第五部分:基金的申购与赎回 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;

第五部分:基金的申购与赎回 六、申购费用和赎回费用

3、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人赎回本基金份额时收取,扣除注册登记手续费后,赎回费归基金资产的部分不低于赎回费的 25%。

4.本基金申购费率最高不超过 3%,赎回费率最高不超过 1%。 六、申购费用和赎回费用

3、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人赎回本基金份额时收取,扣除注册登记手续费后,赎回费归基金资产的部分不低于赎回费的 25%。其中,对持续持有期少于 7 日的投资人收取不低于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产。

4.本基金申购费率最高不超过 3%,赎回费率最高不超过 1.5%。

第五部分:基金的申购与赎回 九、拒绝或暂停申购、赎回的情况及处理方式

发生上述(1)到(4)项暂停申购情形时,基金管理人应当在指定媒体上刊登暂停申购公告。

九、拒绝或暂停申购、赎回的情况及处理方式

(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,基金管理人应当暂停接受基金申购申请;

(6)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;

(7)基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔申购。

发生上述(1)到(5)项暂停申购情形时,基金管理人应当在指定媒体上刊登暂停申购公告。

2、除下列情形外,基金管理人不得拒绝接受或暂停支付基金投资者的赎回款项:

(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,基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。

第五部分:基金的申购与赎回 十、巨额赎回的情形及处理方式

(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。

第八部分:《基金合同》当事人及权利义务 一、基金管理人

(一)基金管理人简况

法定代表人:吴永敏

二、基金托管人

(一)基金托管人简况

名称:中国农业银行

恢复时间:1979年2月23日

注册地址:北京市海淀区

区复兴路甲23号

法定代表人:杨明生

电话:010-68424199

传真:010-68424181

联系人:李芳菲

组织形式:国有独资企业

注册资本:1338.65亿元人民币

基金托管资格批文文号:证监基字[1998]23号

存续期间:持续经营 一、基金管理人

(一)基金管理人简况

法定代表人:王炯

二、基金托管人

(一)基金托管人简况

名称:中国农业银行股份有限公司

住所:北京市东城区建国门内大街69号

法定代表人:周慕冰

成立时间:2009年1月15日

批准设立机关和批准设立文号:中国银监会银监复[2009]13号

组织形式:股份有限公司

注册资本:32,479,411.7万元人民币

存续期间:持续经营

基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]23号

第十四部分：基金的投资（三）投资范围

本基金的投资范围为股票、债券、权证和法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具。其中，本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 60%-95%，债券投资比例为基金资产的 0-35%，现金以及到期日在一年以内债券等短期金融工具资产比例合计不低于基金资产净值的 5%。

（三）投资范围
本基金的投资范围为股票、债券、权证和法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具。其中，本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 60%-95%，债券投资比例为基金资产的 0-35%，现金以及到期日在一年以内债券等短期金融工具资产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。

第十四部分：基金的投资（八）投资限制

（6）基金保持不低于基金资产净值百分之五的现金或者到期日在一年以内的政府债券；

（7）法律、法规中国证监会另有规定的从其规定。

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比例不符合上述比例，基金管理人应当在十个交易日内进行调整并使之比例符合上述规定。法律法规另有规定时，从其规定。

（6）基金保持不低于基金资产净值百分之五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；

（7）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%；

（8）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；

（9）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；

（10）法律、法规中国证监会另有规定的从其规定。

除上述第（6）、（8）、（9）项之外，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比例不符合上述比例，基金管理人应当在十个交易日内进行调整并使之比例符合上述规定。法律法规另有规定时，从其规定。

第十七部分基金资产的估值 七、暂停估值的情形

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；

第二十一部分：基金的信息披露 8、基金定期报告

8、基金定期报告

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。

第二十一部分：基金的信息披露 9、临时报告

（26）中国证监会规定

的其他事项。 9、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:《东吴价值成长双动力混合型证券投资基金托管协议》修改前后条款对照表

章节 原表述 修改后表述

一、基金托管协议当事人 (一) 基金管理人

法定代表人: 吴永敏 (一) 基金管理人

法定代表人: 王炯

一、基金托管协议当事人 (二) 基金托管人

名称: 中国农业银行

恢复时间: 1979 年 2 月 23 日

注册地址: 北京市海淀区复兴路甲 23 号

法定代表人: 杨明生

电话: 010-68424199

传真: 010-68424181

联系人: 李芳菲

组织形式: 国有独资企业

注册资本: 1338.65 亿元人民币

批准设立机关和设立文号: 国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》

存续期间: 持续经营

经营范围: (1)人民币业务。吸收公众存款; 发放短期、中期和长期贷款; 办理国内外结算; 办理票据贴现; 发行金融债券; 代理发行、代理兑付、承销政府债券; 买卖政府债券; 从事同业拆借; 买卖、代理买卖外汇; 提供信用证服务及担保; 代理收付款项及代理保险业务等。(2)外汇业务。外汇存款; 外汇贷款; 外汇汇款; 外币兑换; 国际结算; 外汇票据的承兑和贴现; 外汇借款; 外汇担保; 结汇、售汇; 发行和代理发行股票以外的外币有价证券; 买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券; 代客外汇买卖; 资信调查、咨询、见证业务。(二) 基金托管人

名称: 中国农业银行股份有限公司

注册地址: 北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址: 北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座九层

邮政编码: 100031

法定代表人: 周慕冰

成立时间: 2009 年 1 月 15 日

基金托管资格批准文号: 中国证监会证监基字[1998]23 号

组织形式: 股份有限公司

注册资本: 32,479,411.7 万元人民币

存续期间: 持续经营

经营范围: 吸收公众存款; 发放短期、中期、长期贷款; 办理国内外结算; 办理票据承兑与贴现; 发行金融债券; 代理发行、代理兑付、承销政府债券; 买卖政府债券、金融债券; 从事同业拆借; 买卖、代理买卖外汇; 结汇、售汇; 从事银行卡业务; 提供信用证服务及担保; 代理收付款项及代理保险业务; 提供保管箱服务; 代理资金清算; 各类汇兑业务; 代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务; 贷款承诺; 组织或参加银团贷款; 外汇存款; 外汇贷款; 外汇汇款; 外汇借款; 发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券; 外汇票据承兑和贴现; 自营、代客外汇买卖; 外币兑换; 外汇担保; 资信调查、咨询、见证业务; 企业、个人财务顾问服务; 证券公司客户交易结算资金存管业务; 证券投资基金托管业务; 企业年金

托管业务；产业投资基金托管业务；合格境外机构投资者境内证券投资托管业务；代理开放式基金业务；电话银行、手机银行、网上银行业务；金融衍生产品交易业务；经国务院银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务。

二、基金托管协议的依据、目的和原则 本协议依据《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》）、《东吴价值成长双动力股票型证券投资基金合同》（以下简称《基金合同》）及其他有关规定制订。本协议依据《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》）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》、《东吴价值成长双动力股票型证券投资基金合同》（以下简称《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 (6)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的投资比例的，基金管理人应当在 10 个工作日内进行调整。

(6)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；

(7) 本基金管理人管理的、且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、且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%；

(8) 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；

(9) 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（6）、（8）、（9）项之外，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比例不符合上述规定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个工作日内进行调整。