

富国基金管理有限公司关于旗下部分基金投资范围增加存托凭证并相应修订基金合同及托管协议的公告

为更好地满足广大投资者的理财需求，根据《中华人民共和国证券法》、《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》和《存托凭证发行与交易管理办法(试行)》等法律法规的规定和基金合同的约定，经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，富国基金管理有限公司（以下简称“本公司”或“基金管理人”）决定自2020年10月14日起，在旗下部分基金的投资范围中增加存托凭证，并对基金合同及托管协议的相应条款进行修订，现将有关情况说明如下：

一、本次投资范围增加存托凭证的基金

经与基金托管人协商一致，本公司在以下基金的投资范围中增加存托凭证：

序号	基金名称
1	富国通胀通缩主题轮动混合型证券投资基金
2	富国新机遇灵活配置混合型发起式证券投资基金
3	富国中证智能汽车指数证券投资基金(LOF)
4	富国研究量化精选混合型证券投资基金
5	富国中证800交易型开放式指数证券投资基金
6	上证综指交易型开放式指数证券投资基金

二、基金合同及招募说明书的修订

本次修订内容包括明确投资范围包含存托凭证，增加存托凭证的投资策略、投资比例限制、估值方法及信息披露等约定，并将在基金招募说明书（更新）、产品资料概要中增加投资存托凭证的风险揭示。本次修订对基金份额持有人利益无实质性不利影响，基金合同的具体修订内容详见附件。

三、存托凭证投资风险揭示

基金投资存托凭证在承担境内上市交易股票投资的共同风险外，还将承担与

存托凭证、创新企业发行、境外发行人以及交易机制相关的特有风险，具体包括但不限于以下风险：

1、与存托凭证相关的风险

1) 存托凭证是新证券品种，由存托人签发、以境外证券为基础在中国境内发行，代表境外基础证券权益。存托凭证持有人实际享有的权益与境外基础证券持有人的权益虽然基本相当，但并不能等同于直接持有境外基础证券。

2) 基金买入或者持有红筹公司境内发行的存托凭证，即被视为自动加入存托协议，成为存托协议的当事人。存托协议可能通过红筹公司和存托人商议等方式进行修改，基金无法单独要求红筹公司或者存托人对存托协议作出额外修改。

3) 基金持有红筹公司存托凭证，不是红筹公司登记在册的股东，不能以股东身份直接行使股东权利；基金仅能根据存托协议的约定，通过存托人享有并行使分红、投票等权利。

4) 存托凭证存续期间，存托凭证项目内容可能发生重大、实质变化，包括但不限于存托凭证与基础证券转换比例发生调整、红筹公司和存托人可能对存托协议作出修改，更换存托人、更换托管人、存托凭证主动退市等。部分变化可能仅以事先通知的方式，即对基金生效。基金可能无法对此行使表决权。

5) 存托凭证存续期间，对应的基础证券等财产可能出现被质押、挪用、司法冻结、强制执行等情形，基金可能存在失去应有权利的风险。

6) 存托人可能向存托凭证持有人收取存托凭证相关费用。

7) 存托凭证退市的，基金可能面临存托人无法根据存托协议的约定卖出基础证券，基金持有的存托凭证无法转到境内其他市场进行公开交易或者转让，存托人无法继续按照存托协议的约定为基金提供相应服务等风险。

2、与创新企业发行相关的风险

创新企业证券首次公开发行的价格可能高于公司每股净资产账面值，或者高于公司在境外其他市场公开发行的股票或者存托凭证的发行价格或者二级市场交易价格。

3、与境外发行人相关的风险

1) 红筹公司在境外注册设立，其股权结构、公司治理、运行规范等事项适用境外注册地公司法等法律法规的规定；已经在境外上市的，还需要遵守境外上

市地相关规则。投资者权利及其行使可能与境内市场存在一定差异。此外，境内股东和境内存托凭证持有人享有的权益还可能受境外法律变化影响。

2) 红筹公司可能仅在境内市场发行并上市较小规模的股票或者存托凭证，公司大部分或者绝大部分的表决权由境外股东等持有，境内投资者可能无法实际参与公司重大事务的决策。

3) 红筹公司存托凭证的境内投资者可以依据境内《证券法》提起证券诉讼，但境内投资者无法直接作为红筹公司境外注册地或者境外上市地的投资者，依据当地法律制度提起证券诉讼。

4、与交易机制相关的风险

1) 境内外市场证券停复牌制度存在差异，红筹公司境内外上市的股票或者存托凭证可能出现在一个市场正常交易而在另一个市场实施停牌等现象。

2) 红筹公司在境外上市股票或存托凭证的价格可能因基本面变化、第三方研究报告观点、境内外交易机制差异、异常交易情形、做空机制等出现较大波动，可能对境内证券价格产生影响。

3) 在境内法律及监管政策允许的情况下，红筹公司现在及将来境外发行的股票可能转移至境内市场上市交易，或者公司实施配股、非公开发行、回购等行为，从而增加或者减少境内市场的股票或者存托凭证流通数量，可能引起交易价格波动。

4) 基金持有的红筹公司境内发行的证券，暂不允许转换为公司在境外发行的相同类别的股票或者存托凭证；基金持有境内发行的存托凭证，暂不允许转换为境外基础证券。

重要提示：

1、上述基金基金合同的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，无需召开基金份额持有人大会。

2、本公司于本公告日在网站上同时公布经修改后的基金合同、托管协议；招募说明书、产品资料概要涉及前述内容的，将一并修改，并依照《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定在规定媒介上公告。

3、投资者可以登陆富国基金管理有限公司网站（www.fullgoal.com.cn）或拨打富国基金管理有限公司客户服务热线 95105686、4008880688（全国统一，均免长途费）进行相关咨询。

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。敬请投资人注意投资风险。投资者投资于基金前应认真阅读基金的基金合同和招募说明书等法律文件，确认已知悉基金产品资料概要，全面认识基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，在了解产品情况及销售机构适当性匹配意见的基础上，理性判断市场，谨慎做出投资决策。基金具体风险评级结果以销售机构提供的评级结果为准。

特此公告。

富国基金管理有限公司

2020年10月14日

富国通胀通缩主题轮动混合型证券投资基金基金合同修订对照表

章节	修改前	修改后
<p>第一部分 前言和释义</p>	<p>无</p>	<p><u>新增加：</u> 本基金的投资范围包括存托凭证。存托凭证是新证券品种，本基金投资存托凭证在承担境内上市交易股票投资的共同风险外，还将承担与存托凭证、创新企业发行、境外发行人以及交易机制相关的特有风险。</p>
<p>第十一部分 基金的投资</p>	<p>二、投资范围 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中，股票资产的投资比例占基金资产的60%—95%，债券、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种的投资比例占基金资产的5%—40%，其中，权证资产的投资比例占基金资产净值的0%—3%，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。投资于受益于通货膨胀或通货紧缩等当期相关投资主题的资产比例不低于基金股票投资的80%。</p>	<p>二、投资范围 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、<u>存托凭证</u>、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中，<u>股票及存托凭证</u>资产的投资比例占基金资产的60%—95%，债券、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种的投资比例占基金资产的5%—40%，其中，权证资产的投资比例占基金资产净值的0%—3%，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。投资于受益于通货膨胀或通货紧缩等当期相关投资主题的资产比例不低于基金股票投资的80%。</p>
<p>第十一部分</p>	<p>无</p>	<p><u>新增加：</u> 四、投资策略</p>

基金的投资		<p>.....</p> <p>(四) <u>存托凭证投资策略</u></p> <p><u>本基金投资存托凭证的策略依照上述境内上市交易的股票投资策略执行。</u></p> <p>.....</p>
第十一部分基金的投资	无	<p><u>新增加：</u></p> <p>五、投资限制</p> <p>(二) 投资组合限制</p> <p>.....</p> <p><u>n、本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行；</u></p>
第十三部分基金资产估值	无	<p>新增加：</p> <p>五、估值方法</p> <p>.....</p> <p><u>6、本基金投资存托凭证的估值核算依照境内上市交易的股票执行。</u></p> <p>.....</p>
第十七部分基金的信息披露	无	<p>新增加：</p> <p>五、公开披露的基金信息</p> <p>.....</p> <p><u>(十一) 本基金投资存托凭证的信息披露依照境内上市交易的股票执行。</u></p> <p>.....</p>

富国新机遇灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同基金合同修订对照表

章节	修改前	修改后
<p>第一部 分 前 言</p>	<p>无</p>	<p>新增加： <u>七、本基金的投资范围包括存托凭证。存托凭证是新证券品种，本基金投资存托凭证在承担境内上市交易股票投资的共同风险外，还将承担与存托凭证、创新企业发行、境外发行人以及交易机制相关的特有风险。</u></p>
<p>第十二 部 分 基 金 的 投 资</p>	<p>二、投资范围</p> <p>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板以及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、可交换债券、中小企业私募债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、权证以及经中国证监会批准允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。</p> <p>……</p> <p>基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 0%-95%，权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%，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。</p> <p>……</p>	<p>二、投资范围</p> <p>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板以及其他经中国证监会核准上市的股票）、<u>存托凭证</u>、债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、可交换债券、中小企业私募债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、权证以及经中国证监会批准允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。</p> <p>……</p> <p>基金的投资组合比例为：股票<u>及存托凭证</u>投资占基金资产的比例为 0%-95%，权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%，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。</p> <p>……</p>

第十二部分 基金的投资	无	<p><u>新增加：</u></p> <p>三、投资策略</p> <p>.....</p> <p><u>3、存托凭证投资策略</u></p> <p><u>本基金投资存托凭证的策略依照上述境内上市交易的股票投资策略执行。</u></p> <p>.....</p>
第十二部分 基金的投资	<p>四、投资限制</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>（1）本基金股票投资占基金资产的比例为0%-95%；</p> <p>.....</p>	<p>四、投资限制</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>（1）本基金股票<u>及存托凭证</u>投资占基金资产的比例为0%-95%；</p> <p>.....</p> <p><u>（20）本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行；</u></p>
第十四部分 基金资产估值	无	<p><u>新增加：</u></p> <p>三、估值方法</p> <p>.....</p> <p><u>6、本基金投资存托凭证的估值核算依照境内上市交易的股票执行。</u></p> <p>.....</p>
第十八部分 基金的信息披露	无	<p><u>新增加：</u></p> <p>五、公开披露的基金信息</p> <p>.....</p> <p><u>（十三）本基金投资存托凭证的信息披露依照境内上市交易的股票执行。</u></p> <p>.....</p>

富国中证智能汽车指数证券投资基金（LOF）基金合同修订对照表

章节	修改前	修改后
<p>第一部分 分 前言</p>	<p>无</p>	<p><u>新增加：</u> <u>六、本基金的投资范围包括存托凭证。存托凭证是新证券品种，本基金投资存托凭证在承担境内上市交易股票投资的共同风险外，还将承担与存托凭证、创新企业发行、境外发行人以及交易机制相关的特有风险。</u></p>
<p>第十四 部 分 基 金 的 投 资</p>	<p>二、投资范围 本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证智能汽车主题指数的成份股、备选成份股、其他股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、固定收益资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、资产支持证券、质押及买断式回购、银行存款（包括银行定期存款、银行协议存款、银行通知存款等）等）、衍生工具（股指期货、权证等）及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。 基金的投资组合比例为：本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的 90%，其中投资于中证智能汽车主题指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%，每</p>	<p>二、投资范围 本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证智能汽车主题指数的成份股、备选成份股、其他股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、<u>存托凭证</u>、固定收益资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、资产支持证券、质押及买断式回购、银行存款（包括银行定期存款、银行协议存款、银行通知存款等）等）、衍生工具（股指期货、权证等）及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。 基金的投资组合比例为：本基金的股票<u>及存托凭证</u>资产投资比例不低于基金资产的 90%，其中投资于中证智能汽车主题指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%，每个</p>

	<p>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，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。</p> <p>.....</p>	<p>交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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。</p> <p>.....</p>
<p>第十四部分 基金的投资</p>	<p>三、投资策略</p> <p>.....</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金管理人主要按照中证智能汽车主题指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的 90%，其中投资于中证智能汽车主题指数成份股和备选成份股的资产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，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，权证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。</p> <p>.....</p>	<p>三、投资策略</p> <p>.....</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金管理人主要按照中证智能汽车主题指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金的股票<u>及存托凭证</u>资产投资比例不低于基金资产的 90%，其中投资于中证智能汽车主题指数成份股和备选成份股的资产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，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，权证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。</p> <p>.....</p>
<p>第十四部分 基金的投资</p>	<p>无</p>	<p><u>新增加：</u></p> <p>三、投资策略</p> <p>.....</p> <p><u>3、存托凭证的投资策略：</u></p> <p><u>本基金在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素的基础上，根据审慎原则合理参与存托凭证的投资，以更好地跟踪标的指数，追求跟踪</u></p>

		<u>偏离度和跟踪误差的最小化。</u>
第十四部分 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： （1）本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的 90%，	四、投资限制 1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： （1）本基金的股票及 <u>存托凭证</u> 资产投资比例不低于基金资产的 90%， <u>（22）本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行；</u>
第十六部分 基金资产估值	无	新增加： 三、估值方法 <u>6、本基金投资存托凭证的估值核算依照境内上市交易的股票执行。</u>
第二十部分 基金的信息披露	无	新增加： 五、公开披露的基金信息 <u>（十四）本基金投资存托凭证的信息披露依照境内上市交易的股票执行。</u>

富国研究量化精选混合型证券投资基金基金合同修订对照表

章节	修改前	修改后
前言	无	<p>新增加：</p> <p><u>六、本基金的投资范围包括存托凭证。存托凭证是新证券品种，本基金投资存托凭证在承担境内上市交易股票投资的共同风险外，还将承担与存托凭证、创新企业发行、境外发行人以及交易机制相关的特有风险。</u></p>
第十二部分 基金的投资	<p>二、投资范围</p> <p>本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、固定收益资产（国家债券、央行票据、地方政府债券、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据、中小企业私募债券、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单等）、衍生工具（股指期货、国债期货、权证等）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。</p> <p>……</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金股票资产的投资比例占基金资产的 60-95%；每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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</p>	<p>二、投资范围</p> <p>本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、<u>存托凭证</u>、固定收益资产（国家债券、央行票据、地方政府债券、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据、中小企业私募债券、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单等）、衍生工具（股指期货、国债期货、权证等）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。</p> <p>……</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金股票<u>及存托凭证</u>资产的投资比例占基金资产的 60-95%；每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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</p>

	券；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。	金、应收申购款等。
第十二部分 基金的投资	无	<p><u>新增加：</u></p> <p>三、投资策略</p> <p>.....</p> <p><u>（三）存托凭证投资策略</u></p> <p><u>本基金投资存托凭证的策略依照上述境内上市交易的股票投资策略执行。</u></p> <p>.....</p>
第十二部分 基金的投资	<p>四、投资限制</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>（1）本基金股票资产的投资比例占基金资产的60-95%；</p> <p>.....</p>	<p>四、投资限制</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>（1）本基金股票<u>及存托凭证</u>资产的投资比例占基金资产的60-95%；</p> <p>.....</p> <p><u>（25）本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行；</u></p>
第十四部分 基金资产估值	无	<p>新增加：</p> <p>三、估值方法</p> <p>.....</p> <p><u>6、本基金投资存托凭证的估值核算依照境内上市交易的股票执行。</u></p> <p>.....</p>
第十八部分 基金的信息披露	无	<p>新增加：</p> <p>五、公开披露的基金信息</p> <p>.....</p> <p><u>（十五）本基金投资存托凭证的信息披露依照境内上市交易的股票执行。</u></p> <p>.....</p>

富国中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同修订对照表

章节	修改前	修改后
<p>第一部 分 前言</p>	<p>无</p>	<p>新增加： 六、本基金的投资范围包括存托凭证。存托凭证是新证券品种，本基金投资存托凭证在承担境内上市交易股票投资的共同风险外，还将承担与存托凭证、创新企业发行、境外发行人以及交易机制相关的特有风险。</p>
<p>第十四 部 分 基 金 的 投 资</p>	<p>二、投资范围 本基金的投资范围主要为标的指数成份股、备选成份股和其他股票。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会允许发行的股票）、债券（国家债券、央行票据、地方政府债券、政府支持债券、政府支持机构债、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、衍生工具（股指期货、国债期货等）、现金资产以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。</p>	<p>二、投资范围 本基金的投资范围主要为标的指数成份股、备选成份股和其他股票。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会允许发行的股票）、<u>存托凭证</u>、债券（国家债券、央行票据、地方政府债券、政府支持债券、政府支持机构债、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、衍生工具（股指期货、国债期货等）、现金资产以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。</p>
<p>第十四 部 分 基 金 的 投 资</p>	<p>无</p>	<p><u>新增加：</u> 三、投资策略 …… <u>4、存托凭证投资策略</u> <u>本基金在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素的基础上，根据审慎原则合理参与存托凭</u></p>

		<p><u>证的投资，以更好地跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。</u></p> <p>.....</p>
第十四部分 基金的投资	<p>四、投资限制</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>.....</p>	<p>四、投资限制</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><u>(20) 本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行；</u></p>
第十六部分 基金资产估值	<p>无</p>	<p>新增加：</p> <p>三、估值方法</p> <p>.....</p> <p><u>8、本基金投资存托凭证的估值核算依照境内上市交易的股票执行。</u></p> <p>.....</p>
第二十部分 基金的信息披露	<p>无</p>	<p>新增加：</p> <p>五、公开披露的基金信息</p> <p>.....</p> <p><u>(十八) 本基金投资存托凭证的信息披露依照境内上市交易的股票执行。</u></p> <p>.....</p>

上证综指交易型开放式指数证券投资基金基金合同修订对照表

章节	修改前	修改后
<p>第一部 分前 言和释 义</p>	<p>无</p>	<p>新增加： <u>本基金的投资范围包括存托凭证。存托凭证是新证券品种，本基金投资存托凭证在承担境内上市交易股票投资的共同风险外，还将承担与存托凭证、创新企业发行、境外发行人以及交易机制相关的特有风险。</u></p>
<p>第十三 部分 基金的 投资</p>	<p>二、投资范围</p> <p>本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象，指数化投资比例即投资于指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的95%，如因标的指数成份股调整、基金份额申购、赎回清单内现金替代、现金差额、基金规模或市场变化等因素导致基金投资比例不符合上述标准的，基金管理人将在10个交易日内进行调整。同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，该部分资产比例不高于基金资产净值的5%。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他金融工具，基金管理人可在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p>	<p>二、投资范围</p> <p>本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象，指数化投资比例即投资于指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的95%，如因标的指数成份股调整、基金份额申购、赎回清单内现金替代、现金差额、基金规模或市场变化等因素导致基金投资比例不符合上述标准的，基金管理人将在10个交易日内进行调整。同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于<u>存托凭证</u>、新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，该部分资产比例不高于基金资产净值的5%。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他金融工具，基金管理人可在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p>
<p>第十三 部分 基金的 投资</p>	<p>无</p>	<p><u>新增加：</u></p> <p>三、投资策略</p> <p>……</p> <p><u>2、存托凭证的投资策略</u></p> <p><u>本基金在综合考虑预期收益、风险、流动性等</u></p>

		<p><u>因素的基础上，根据审慎原则合理参与存托凭证的投资，以更好地跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。</u></p> <p>.....</p>
第十三部分 基金的投资	无	<p>新增加：</p> <p>六、投资限制</p> <p>（二）投资组合限制</p> <p>本基金的投资组合将遵循以下限制：</p> <p>.....</p> <p><u>e、本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行；</u></p>
第十五部分 基金资产估值	无	<p>新增加：</p> <p>五、估值方法</p> <p>.....</p> <p><u>6、本基金投资存托凭证的估值核算依照境内上市交易的股票执行。</u></p> <p>.....</p>
第十九部分 基金的信息披露	无	<p>新增加：</p> <p>五、公开披露的基金信息</p> <p>.....</p> <p><u>（十四）本基金投资存托凭证的信息披露依照境内上市交易的股票执行。</u></p> <p>.....</p>