

关于上证国有企业100交易型开放式指数证券投资基金 修改基金合同、托管协议的公告

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》”），对已经存续的开放式基金，原基金合同内容不符合《规定》的，应当在《规定》施行之日起6个月内予以调整。

根据《规定》等法律法规，经与基金托管人招商银行股份有限公司协商一致，并报监管机构备案，中银基金管理有限公司（以下简称：“本公司”）对旗下上证国有企业100交易型开放式指数证券投资基金（以下简称：“本基金”）的《上证国有企业100交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称：“《基金合同》”）的相关条款进行修改，《上证国有企业100交易型开放式指数证券投资基金托管协议》的相应部分一并修改。具体修改内容请见附件。

本公司将在本基金的更新招募说明书中，对上述内容进行相应调整。

上述修改系因相应的法律法规发生变动而进行的修改，且对基金份额持有人利益无实质性不利影响，并已履行了规定的程序，符合相关法律法规的规定及《基金合同》的约定。上述修改自本公告发布之日起生效。

投资者可访问中银基金管理有限公司网站(www.bocim.com)或拨打本公司的客户服务电话：021-38834788 / 400-888-5566咨询相关情况。

特此公告

附件一：《上证国有企业100交易型开放式指数证券投资基金基金合同》修改前后对照表

附件二：《上证国有企业100交易型开放式指数证券投资基金托管协议》修改前后对照表

中银基金管理有限公司
二〇一八年三月二十四日

附件一：《上证国有企业 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》修改前后对照表

章节	修改前	修改后
一、前言	<p>（一）订立本基金合同的目的、依据和原则</p> <p>2、订立本基金合同的依据是《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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 6 号〈基金合同的内容与格式〉》和其他有关法律法规。</p>	<p>（一）订立本基金合同的目的、依据和原则 2、订立本</p> <p>2、订立本基金合同的依据是《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》、《证券投资基金销售管理办法》、《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》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 6 号〈基金合同的内容与格式〉》和其他有关法律法规。</p>
二、释义		<p>新增：</p> <p>13、《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 日起实施的《公开募集开</p>

		<p>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</p> <p>.....</p> <p>69、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</p>
八、基金份额的申购与赎回	（五）申购和赎回的数额限制	<p>（五）申购和赎回的数额限制</p> <p>新增：</p> <p>2、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。具体请参见相关规定。</p>
八、基金份额的申购	（八）拒绝或暂停申购、赎回的情形及处理方式	（八）拒绝或暂停申购、赎回的情形及处理方式

与赎回	3、发生基金合同规定的暂停基金资产估值的情况；	<p>3、发生基金合同规定的暂停基金资产估值的情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请；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投资人的申购申请；</p> <p>……</p> <p>新增：</p> <p>7、申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单个投资人单日或单笔申购金额上限的；</p> <p>8、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赎回申请；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投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项；</p>
十一、基金合同当事	(一) 基金管理人	(一) 基金管理人

<p>人及权利义务</p>	<p>办公地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 45 楼 法定代表人：贾建平 (二) 基金托管人 法定代表人：傅育宁 注册资本：人民币 215.77 亿元</p>	<p>办公地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 26 楼、27 楼、45 楼 法定代表人：章砚 (二) 基金托管人 法定代表人：李建红 注册资本：人民币 252.20 亿元</p>
<p>十六、基金的投资</p>	<p>(八) 投资限制 1、投资组合限制 </p>	<p>(八) 投资限制 1、投资组合限制 新增： (5) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 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； (6) 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</p>

	<p>由于证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动或标的指数成份股调整等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例的，基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到标准。</p>	<p>品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；</p> <p>.....</p> <p>除第（5）、（6）项外，由于证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动或标的指数成份股调整等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例的，基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到标准。</p>
<p>十八、基金资产的估值</p>	<p>（六）暂停估值的情形</p>	<p>（六）暂停估值的情形</p> <p>新增：</p> <p>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一致的，基金管理人应当暂停估值；</p>
<p>二十二、基金的信息披露</p>	<p>（十）基金年度报告、基金半年度报告、基金季度报告</p>	<p>（十）基金年度报告、基金半年度报告、基金季度报告</p> <p>新增：</p> <p>6、报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或</p>

		<p>者超过基金总份额 20%的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在基金定期报告“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。</p> <p>7、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。</p>
二十二、基金的信息披露	(十一) 临时报告与公告	<p>(十一) 临时报告与公告</p> <p>新增：</p> <p>24、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；</p>
二十二、基金的信息披露		<p>新增：</p> <p>(十六) 暂停或延迟信息披露的情形</p> <p>当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金相关信息：</p> <p>1、因不可抗力或其它情形致使基金管理人、基金托管</p>

		<p>人无法准确评估基金资产价值时；</p> <p>2、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；</p> <p>3、出现基金管理人认为属于会导致基金管理人不能评估基金资产的紧急事故的任何情况；</p> <p>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，基金管理人经与基金托管人协商一致暂停估值的；</p> <p>5、法律法规、基金合同或中国证监会规定的情况。</p>
--	--	---

附件二：《上证国有企业 100 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》修改前后对照表

章节	修改前	修改后
<p>一、基金托管协议当事人</p>	<p>（一）基金管理人 办公地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 45 楼 …… 法定代表人：贾建平</p> <p>（二）基金托管人 法定代表人：傅育宁 注册资本：人民币 215.77 亿元</p>	<p>（一）基金管理人 办公地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 26 楼、27 楼、45 楼 …… 法定代表人：章砚</p> <p>（二）基金托管人 法定代表人：李建红 注册资本：人民币 252.20 亿元</p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>	<p>（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。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应事先向基金托管人提供投资品种池，以便基金托管人对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督。</p>	<p>（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。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应事先向基金托管人提供投资品种池，以便基金托管人对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督。</p>

	<p>本基金投资组合遵循以下投资限制：</p> <p>.....</p> <p>对于因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动或标的指数成份股调整等基金管理人之外的原因导致基金的投资不符合基金合同的约定的，基金管理人应在 10 个交易日内进行调整以符合基金合同的约定。</p>	<p>本基金投资组合遵循以下投资限制：</p> <p>新增：</p> <p>（5）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 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；</p> <p>（6）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；</p> <p>.....</p> <p>除第（5）、（6）项外，对于因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动或标的指数成份股调整等基金管理人之外的原因导致基金的投资不符合基金合同的约定的，基金管理人应在 10 个交易日内进行调整以符合基金合同的约定。</p>
<p>三、基金托管人对基</p>	<p>（五）本基金投资流通受限证券， 应遵守《关于规范基</p>	<p>（五）本基金投资流通受限证券， 应遵守《关于规范基</p>

基金管理人的业务监督和核查	<p>金投资非公开发行证券行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。</p> <p>1.本协议所称的流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>	<p>金投资非公开发行证券行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。</p> <p>1.本协议所称的流通受限证券与上文规定的流动性受限资产定义不一致，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>
八、基金资产净值计算和会计核算	<p>（四）暂停估值与公告基金份额净值的情形</p>	<p>（四）暂停估值与公告基金份额净值的情形</p> <p>新增：</p> <p>（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一致的，基金管理人应当暂停估值；</p>
十、基金信息披露	<p>（二）信息披露的内容</p>	<p>（二）信息披露的内容</p> <p>新增：</p>

		<p>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在基金定期报告“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。</p> <p>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。</p>
<p>十、基金信息披露</p>	<p>（三）基金托管人和基金管理人在信息披露中的职责和信息披露程序</p> <p>当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金相关信息：</p>	<p>（三）基金托管人和基金管理人在信息披露中的职责和信息披露程序</p> <p>当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金相关信息：</p> <p>新增：</p> <p>（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，基金管理人经与基金托管人协商一致暂停估值的；</p>