

关于根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修改 长城久源灵活配置混合型证券投资基金基金合同、托管协议的公告

根据中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》要求及《长城久源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”)的约定,长城基金管理有限公司(以下简称“本基金管理人”或“本公司”)经与基金托管人平安银行股份有限公司协商一致,对长城久源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、托管协议相关条款进行修改。现将有关情况说明如下:

一、本次修改按照相关法律法规和监管机构的规定执行,仅对基金合同、托管协议中信息披露相关条款进行修改,并进行了一些必要的更新,基金的投资目标、投资范围、风险收益特征等均未发生改变。本基金管理人已就本次修改履行了必要的程序,符合相关法律法规及基金合同的规定。基金合同的修改内容详见本公告附件《长城久源灵活配置混合型证券投资基金基金合同修订对照表》。

二、自 2020 年 4 月 3 日起,本次修改后的基金合同、托管协议正式生效。本基金管理人将于本公告发布当日将修改后的基金合同、托管协议登载于本公司网站及中国证监会基金电子披露网站,并同时根据基金合同、托管协议的修改内容对《长城久源灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及其摘要进行相应更新。

投资者可拨打本公司客户服务电话(400-8868-666)或登录本公司网站(www.ccfund.com.cn)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将来表现,基金管理人所管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。投资有风险,敬请投资者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

长城基金管理有限公司

2020 年 3 月 31 日

附件：《长城久源灵活配置混合型证券投资基金基金合同修订对照表》

章节	修订前	修订后
<p>第一部分 前言</p>	<p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</p> <p>.....</p> <p>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“《流动性风险规定》”)和其他有关法律法规。</p> <p>.....</p> <p>五、本基金按照中国法律法规成立并运作,若基金合同的内容与届时有效的法律法规的强制性规定不一致,应当以届时有效的法律法规的规定为准。</p>	<p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</p> <p>.....</p> <p>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》”)、<u>《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》</u>(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。</p> <p>.....</p> <p>五、本基金按照中国法律法规成立并运作,若基金合同的内容与届时有效的法律法规的强制性规定不一致,应当以届时有效的法律法规的规定为准。</p> <p><u>六、本基金合同约定的基金产品资料概要编制、披露与更新要求,自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行。</u></p>
<p>第二部分 释义</p>	<p>6、招募说明书:指《长城久源灵活配置混合型证券投资基金长城久源灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及其定期的更新</p> <p>.....</p> <p>10、《信息披露办法》:指指《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订</p> <p>.....</p> <p>53、指定媒介:指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒介</p>	<p>6、招募说明书:指《长城久源灵活配置混合型证券投资基金长城久源灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及其<u>定期</u>的更新</p> <p><u>7、基金产品资料概要:指《长城久源灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新</u></p> <p>.....</p> <p><u>11、《信息披露办法》:指中国证监会2019年7月26日颁布、同年9月1日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订</u></p> <p>.....</p> <p><u>53</u><u>54</u>、指定媒介:指中国证监会指定的用以进行信息披露的<u>全国性报刊及指定互联网网站(包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站)</u>等媒介</p>
<p>第六部分</p>	<p>一、申购和赎回场所</p>	<p>一、申购和赎回场所</p>

<p>基金份额的申购与赎回</p>	<p>本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售网点将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并予以公告。……</p> <p>……</p> <p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>……</p> <p>5、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。</p> <p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>2、……本基金的申购费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。……</p> <p>3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见《招募说明书》，赎回金额单位为元。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。……</p> <p>……</p> <p>九、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>……</p> <p>3、巨额赎回的公告</p> <p>当发生上述延期赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个工作日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒介上刊登公告。</p>	<p>本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售网点将由基金管理人在招募说明书<u>或者基金管理人网站披露并不时更新的销售机构名录中</u>或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并予以公告。……</p> <p>……</p> <p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>……</p> <p>5、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告<u>并报中国证监会备案。</u></p> <p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>2、……本基金的申购费率由基金管理人决定，并在招募说明书<u>及基金产品资料概要</u>中列示。……</p> <p>3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见《招募说明书》，赎回金额单位为元。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书<u>及基金产品资料概要</u>中列示。……</p> <p>……</p> <p>九、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>……</p> <p>3、巨额赎回的公告</p> <p>当发生上述延期赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个工作日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，<u>并在两日内同时</u>在指定媒介上刊登公告。</p>
<p>第七部分 基金合同当事人及权利义务</p>	<p>一、基金管理人</p> <p>……</p> <p>(二) 基金管理人的权利与义务</p> <p>……</p> <p>2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：</p> <p>……</p> <p>(9) 采取适当合理的措施使计算基金份额申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定</p>	<p>一、基金管理人</p> <p>……</p> <p>(二) 基金管理人的权利与义务</p> <p>……</p> <p>2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：</p> <p>……</p> <p>(9) 采取适当合理的措施使计算基金份额申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定</p>

	<p>计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回的价格；</p> <p>.....</p> <p>(11) 编制季度、半年度和年度基金报告；</p> <p>二、基金托管人</p> <p>.....</p> <p>(二) 基金托管人的权利与义务</p> <p>.....</p> <p>2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：</p> <p>.....</p> <p>(9) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格；</p> <p>.....</p> <p>(11) 对基金财务会计报告、季度报告、中期报告半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；</p>	<p>计算并公告基金资产净值<u>信息</u>，确定基金份额申购、赎回的价格；</p> <p>.....</p> <p>(11) 编制<u>季度报告、中期报告</u>半年度和年度<u>基金</u>报告；</p> <p>二、基金托管人</p> <p>(二) 基金托管人的权利与义务</p> <p>.....</p> <p>2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：</p> <p>.....</p> <p>(9) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、<u>基金份额净值</u>、<u>基金份额</u>申购、赎回价格；</p> <p>.....</p> <p>(11) 对基金财务会计报告、<u>季度报告</u>、<u>中期报告</u>半年度和年度<u>基金</u>报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；</p>
第十五部分 基金费用与 税收	<p>四、费用调整</p> <p>基金管理人和基金托管人可协商在履行适当程序后酌情降低基金管理费和基金托管费。</p> <p>基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 2 日在至少一种指定媒介上公告。</p>	<p>四、费用调整</p> <p>基金管理人和基金托管人可协商在履行适当程序后酌情降低基金管理费和基金托管费。</p> <p>基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 2 日在<u>至少一种</u>指定媒介上公告。</p>
第十六部分 基金的收益 与分配	<p>五、收益分配方案的确定、公告与实施</p> <p>本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在 2 个工作日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。</p>	<p>五、收益分配方案的确定、公告与实施</p> <p>本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在 <u>2 个工作日</u>内在指定媒介公告并<u>报中国证监会备案</u>。</p>
第十七部分 基金的会计 与审计	<p>二、基金的年度审计</p> <p>1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券从业资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。</p> <p>.....</p> <p>3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需在 2 个工作日内在指定媒介</p>	<p>二、基金的年度审计</p> <p>1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有<u>证券、期货相关业务</u>从业资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。</p> <p>.....</p> <p>3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需在 <u>2 个工作日</u>内在指定媒介</p>

	公告并报中国证监会备案。	公告并报中国证监会备案。
<p>第十八部分 基金的信息披露</p>	<p>二、信息披露义务人</p> <p>本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。</p> <p>本基金信息披露义务人按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。</p> <p>本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定媒介披露，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。</p> <p>三、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：</p> <p>……</p> <p>5、登载任何自然人、法人或者其他组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；</p> <p>……</p> <p>四、本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的，以中文文本为准。</p> <p>本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。</p> <p>五、公开披露的基金信息</p> <p>公开披露的基金信息包括：</p> <p>（一）基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议</p> <p>……</p> <p>2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后，基金管理人在每 6 个月结束之日起 45 日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定媒介上；基金管理人在公告的 15 日前向主要办公场所所在地的中国证监会派出机构报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提</p>	<p>二、信息披露义务人</p> <p>本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和<u>非法人</u>其他组织。</p> <p>本基金信息披露义务人以<u>保护基金份额持有人利益为根本出发点</u>，按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性和<u>完整性、及时性、简明性和易得性</u>。</p> <p>本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的<u>全国性报刊（以下简称“指定报刊”）及指定媒介和基金管理人、基金托管人的互联网网站（以下简称“指定网站”）</u>等媒介披露，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。</p> <p>三、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：</p> <p>……</p> <p>5、登载任何自然人、法人和<u>非法人</u>或<u>者其他</u>组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；</p> <p>……</p> <p>四、本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证<u>不同两种</u>文本的内容一致。<u>不同两种文本之间</u>发生歧义的，以中文文本为准。</p> <p>本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。</p> <p>五、公开披露的基金信息</p> <p>公开披露的基金信息包括：</p> <p>（一）基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、<u>基金产品资料概要</u></p> <p>……</p> <p>2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生</p>

<p>供书面说明。</p> <p>3、基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。</p> <p>基金管理人应将基金招募说明书、《基金合同》摘要登载在指定媒介上；基金管理人、基金托管人应当将《基金合同》、基金托管协议登载在网站上。</p> <p>(二) 基金资产净值、基金份额净值</p> <p>《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。</p> <p>在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。</p> <p>基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒介上。</p> <p>(三) 基金份额申购、赎回价格</p> <p>基金管理人应当在《基金合同》、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。</p> <p>(四) 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</p> <p>基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定媒介上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。</p> <p>基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定媒介上。</p> <p>基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定媒介上。</p>	<p>效后，<u>基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在指定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。</u>基金管理人应当在每 6 个月结束之日起 45 日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定媒介上；基金管理人应当在公告的 15 日前向主要办公场所所在地的中国证监会派出机构报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。</p> <p>3、基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。</p> <p><u>4、基金产品资料概要是基金招募说明书的摘要文件，用于向投资者提供简明的基金概要信息。《基金合同》生效后，基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金产品资料概要，并登载在指定网站及基金销售机构网站或营业网点；基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金产品资料概要。</u></p> <p>基金管理人应将基金招募说明书、<u>基金产品资料概要</u>《基金合同》摘要登载在指定媒介上；基金管理人、基金托管人应当将《基金合同》、基金托管协议登载在网站上。</p> <p>(二) <u>基金净值信息</u>资产净值、基金份额净值</p> <p>《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。</p> <p>在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在<u>不晚于</u>每个开放日的次日，通过<u>指定网站、基金销售机构网站或者营业网点</u>基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。</p> <p>基金管理人应当在<u>不晚于</u>半年度和年</p>
--	--

<p>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。</p> <p>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。</p> <p>.....</p> <p>本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 个工作日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。</p> <p>前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、基金份额持有人大会的召开； 2、终止《基金合同》； 3、转换基金运作方式； 4、更换基金管理人、基金托管人； 5、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更； 6、基金管理人股东及其出资比例发生变更； 7、基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动； 8、基金管理人的董事在一年内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过百分之三十； 10、涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或者仲裁； 11、基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查； 12、基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚； 13、重大关联交易事项； 14、基金收益分配事项； 15、管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更； 	<p><u>度最后一日的次日，在指定网站披露半年度和年度最后一日的基金份额净值和基金份额累计净值公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒介上。</u></p> <p>(三) 基金份额申购、赎回价格</p> <p>基金管理人应当在《基金合同》、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金销售机构网站或营业网点份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。</p> <p>(四) 基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期半年度报告和基金季度报告</p> <p>基金管理人应当在每年结束之日起<u>三个月 90 日</u>内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上<u>并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定媒介上。</u>基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。</p> <p>基金管理人应当在上半年结束之日起<u>两个月 60 日</u>内，编制完成基金中期半年度报告，将中期报告登载在指定网站上，并将中期报告提示性公告登载在指定报刊上<u>并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定媒介上。</u></p> <p>基金管理人应当在<u>每个</u>季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在指定网站上，并将季度报告提示性公告登载在指定报刊媒介上。</p> <p>《基金合同》生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、<u>中期半年度报告</u>或者年度报告。</p> <p><u>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。</u></p>
--	--

	<p>16、基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；</p> <p>17、基金改聘会计师事务所；</p> <p>18、变更基金销售机构；</p> <p>19、更换基金登记机构；</p> <p>20、本基金开始办理申购、赎回；</p> <p>21、本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；</p> <p>22、本基金发生巨额赎回并延期支付；</p> <p>23、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；</p> <p>24、本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；</p> <p>25、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；</p> <p>26、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；</p> <p>27、中国证监会规定的其他事项。</p> <p>(六) 资产支持证券投资</p> <p>基金管理人应在基金年报及半年报中披露基金所持有的资产支证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。基金管理人应在基金季度报告中披露基金所持有的资产支证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序前 10 名资产支持证券明细。</p> <p>(七) 中小企业私募债投资</p> <p>基金管理人应在基金招募说明书的显著位置披露投资中小企业私募债券的流动性风险和信用风险，说明投资中小企业私募债券对基金总体风险的影响。本基金投资中小企业私募债券后两个交易日内，基金管理人应在中国证监会指定媒介披露所投资中小企业私募债券的名称、数量、期限、收益率等信息，并在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露中小企业私募债券的投资情况。</p> <p>(八) 投资股指期货信息披露</p> <p>在季度报告、半年度报告、年度报告</p>	<p>基金管理人应当在基金年度报告和<u>中期半年度</u>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>.....</p> <p>(五) 临时报告</p> <p>本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 <u>2 个工作日内</u> 编制临时报告书，<u>并登载在指定报刊和指定网站上予以公告</u>，并在公开披露日分别报<u>中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构</u>备案。</p> <p>前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件：</p> <p>1、<u>基金份额持有人大会的召开及决定的事项</u>；</p> <p>2、<u>终止《基金合同》终止、基金清算</u>；</p> <p>3、<u>转换基金运作方式、基金合并</u>；</p> <p>4、<u>更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所</u>；</p> <p>5、<u>基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项</u>；</p> <p>56、<u>基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更</u>；</p> <p>67、<u>基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更</u>及<u>其出资比例发生变更</u>；</p> <p>78、<u>基金管理人的高级管理人员、基金经理、董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人</u>基金托管部门负责人发生变动；</p> <p>89、<u>基金管理人的董事在最近 12 个月</u>一年内<u>变更超过百分之五十</u>，10、<u>基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月</u>一年内<u>变动超过百分之三十</u>；</p> <p>10、<u>涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或者仲裁</u>；</p> <p>11、<u>基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其</u></p>
--	--	---

<p>等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露股指期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。</p> <p>（九）澄清公告</p> <p>在《基金合同》存续期限内，任何公共媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。</p> <p>……</p> <p>六、信息披露事务管理</p> <p>基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专人负责管理信息披露事务。</p> <p>基金信息披露义务人公开披露基金信息，应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则的规定。</p> <p>基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。</p> <p>基金管理人、基金托管人应当在指定媒介中选择披露信息的报刊。</p> <p>……</p> <p>七、信息披露文件的存放与查阅</p> <p>招募说明书公布后，应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的住所，供公众查阅、复制。</p> <p>基金定期报告公布后，应当分别置备于基金管理人和基金托管人的住所，以供公众查阅、复制。</p>	<p><u>专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；</u></p> <p>12、基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；</p> <p><u>12、基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，但中国证监会另有规定的除外；</u></p> <p>13<u>13、基金收益分配事项；</u></p> <p>14<u>14、管理费、托管费、销售服务费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；</u></p> <p>15<u>15、基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；</u></p> <p>17、基金改聘会计师事务所；</p> <p>18、变更基金销售机构；</p> <p>19、更换基金登记机构；</p> <p>20<u>16、本基金开始办理申购、赎回；</u></p> <p>21<u>17、本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；</u></p> <p>21、本基金发生巨额赎回并延期办理支付；</p> <p>23<u>18、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；</u></p> <p>24<u>19、本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；</u></p> <p>25<u>20、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；</u></p> <p>26<u>21、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；</u></p> <p>27<u>22、基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定的其他事项。</u></p> <p>（六）资产支持证券投资</p> <p>基金管理人应在基金年报及<u>中期报告半年报</u>中披露基金所持有的资产支证券总</p>
--	--

		<p>额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。基金管理人应在基金季度报告中披露基金所持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序前 10 名资产支持证券明细。</p> <p>（七）中小企业私募债投资</p> <p>基金管理人应在基金招募说明书的显著位置披露投资中小企业私募债券的流动性风险和信用风险，说明投资中小企业私募债券对基金总体风险的影响。本基金投资中小企业私募债券后两个交易日内，基金管理人应在中国证监会指定媒介披露所投资中小企业私募债券的名称、数量、期限、收益率等信息，并在季度报告、<u>中期半年度</u>报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露中小企业私募债券的投资情况。</p> <p>（八）投资股指期货信息披露</p> <p>在季度报告、<u>中期半年度</u>报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露股指期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。</p> <p>（九）澄清公告</p> <p>在《基金合同》存续期限内，任何公共媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动，<u>以及可能损害基金份额持有人权益的</u>，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。</p> <p>.....</p> <p>六、信息披露事务管理</p> <p>基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定<u>专门部门及高级管理人员</u>专人负责管理信息披露事务。</p> <p>基金信息披露义务人公开披露基金信息，应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则<u>等法规</u>的规定。</p> <p>基金托管人应当按照相关法律法规、</p>
--	--	--

		<p>中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告、和定期更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或电子确认。出具书面文件或者盖章确认。</p> <p>基金管理人、基金托管人应当在指定报刊媒介中选择一家报刊披露本基金信息的报刊。<u>基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。</u></p> <p>.....</p> <p>七、信息披露文件的存放与查阅</p> <p><u>依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于各自住所，供社会公众查阅、复制。招募说明书公布后，应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的住所，供公众查阅、复制。</u></p> <p>基金定期报告公布后，应当分别置备于基金管理人和基金托管人的住所，以供公众查阅、复制。</p>
<p>第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算</p>	<p>三、基金财产的清算</p> <p>.....</p> <p>2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。</p> <p>.....</p> <p>六、基金财产清算的公告</p> <p>清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组进行公告。</p>	<p>三、基金财产的清算</p> <p>.....</p> <p>2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券、<u>期货</u>相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。</p> <p>.....</p> <p>六、基金财产清算的公告</p> <p>清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经<u>具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所</u>审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组进行公告，<u>基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在</u></p>

<p>第二十四部分 基金合同内容摘要</p>	<p>一、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利、义务</p> <p>.....</p> <p>(9) 采取适当合理的措施使计算基金份额申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回的价格；</p> <p>(10) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；</p> <p>(11) 编制季度、半年度和年度基金报告；</p> <p>.....</p> <p>4、基金托管人的义务</p> <p>.....</p> <p>(9) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格；</p> <p>(10) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；</p> <p>(11) 对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；</p> <p>.....</p> <p>三、基金收益分配原则、执行方式</p> <p>.....</p> <p>(五) 收益分配方案的确定、公告与实施</p> <p>本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在 2 个工作日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。</p> <p>.....</p> <p>六、基金资产净值的计算方法和公告方式</p> <p>.....</p> <p>(二) 基金资产净值、基金份额净值公告</p> <p>《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份</p>	<p><u>指定报刊上。</u></p> <p>一、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利、义务</p> <p>.....</p> <p>(9) 采取适当合理的措施使计算基金份额申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金<u>资产净值信息</u>，确定基金份额申购、赎回的价格；</p> <p>(10) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；</p> <p>(11) 编制<u>季度报告、中期报告、半年度</u>和年度基金报告；</p> <p>.....</p> <p>4、基金托管人的义务</p> <p>.....</p> <p>(9) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、<u>基金份额净值、基金份额</u>申购、赎回价格；</p> <p>(10) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；</p> <p>(11) 对基金财务会计报告、<u>季度报告、中期报告</u>、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；</p> <p>.....</p> <p>三、基金收益分配原则、执行方式</p> <p>.....</p> <p>(五) 收益分配方案的确定、公告与实施</p> <p>本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在 2 个<u>2 个</u>工作日内在指定媒介公告<u>并报中国证监会备案</u>。</p> <p>.....</p> <p>六、基金资产净值的计算方法和公告方式</p> <p>.....</p> <p>(二) 基金<u>资产净值、基金份额净值信息</u>公告</p> <p>《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当</p>
-------------------------------	--	--

	<p>额净值。</p> <p>在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。</p> <p>基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒介上。</p> <p>……</p> <p>七、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式</p> <p>……</p> <p>(三) 基金财产的清算</p> <p>……</p> <p>2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。</p> <p>……</p> <p>(六) 基金财产清算的公告</p> <p>清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。</p>	<p>至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。</p> <p>在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当<u>不晚于</u>在每个开放日的次日，通过<u>指定网站、基金销售机构网站或者营业网点</u>基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。</p> <p>基金管理人应当在<u>不晚于半年度和年度最后一日的次日，在指定网站披露半年度和年度最后一日的基金份额净值和基金份额累计净值公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值</u>。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，<u>将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒介上</u>。</p> <p>……</p> <p>七、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式</p> <p>……</p> <p>(三) 基金财产的清算</p> <p>……</p> <p>2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券、<u>期货</u>相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。</p> <p>……</p> <p>(六) 基金财产清算的公告</p> <p>清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经<u>具有证券、期货相关业务资格的</u>会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，<u>并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上</u>。</p>
--	--	--