

光大保德信基金管理有限公司

关于光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金修改基金合同部分条款的公告

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》”），对已经成立的开放式基金，原基金合同内容不符合该《规定》的，应当在《规定》施行之日起 6 个月内，修改基金合同并公告。为使光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）符合该《规定》的要求，光大保德信基金管理有限公司（以下简称“本公司”）经与基金托管人中国光大银行股份有限公司协商一致，并报监管机构备案，决定对《光大保德信鼎鑫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》”）中的相关条款进行修改。具体修改内容详见附件。

本次《基金合同》修改事项主要系因相关法律法规发生变化而应当对《基金合同》进行的修改，其他因基金管理人及基金托管人信息更新而做出的修改对基金份额持有人的利益无实质性不利影响，不需召开基金份额持有人大会。修改后的《基金合同》自本公告发布之日起生效。

本基金管理人经与基金托管人协商一致，已相应修改本基金的《光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金托管协议》，并将在更新的《光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》中作相应调整。

投资者可拨打光大保德信基金管理有限公司客户服务电话：021-80262888，400-820-2888，或登录公司网站 www.epf.com.cn，了解详情。

特此公告。

光大保德信基金管理有限公司

2018 年 3 月 31 日

附件：《光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》修改前后文对照表

| 章节 | 修改前 | 修改后 | 修改依据 |
|---|--|--|---|
| <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>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》”）和其他有关法律法规。</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》”）、《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管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）和其他有关法律法规。</p> | <p>将《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》”）纳入基金合同制订依据</p> |
| <p>第二部分 释义</p> | | <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改</p> <p>.....</p> <p>54、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</p> | <p>补充《流动性风险管理规定》释义</p> <p>根据《流动性风险管理规定》第四十条补充流动性受限</p> |

| | | | |
|---|---|---|----------------------|
| | | 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 | 资产释义 |
| 第六部分 基金份额的申购与赎回 五、申购和赎回的数量限制 | | 新增： 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。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告。 | 根据《流动性风险管理规定》第十九条补充 |
| 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。赎回费用应根据相关规定按照比例归入基金财产，未计入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。 | 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。赎回费用应根据相关规定按照比例归入基金财产，未计入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。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，并将上述赎回费全额计入基金财产。 | 根据《流动性风险管理规定》第二十三条补充 |
| 第六部分 基金份额的申购与赎回 | | 新增： 7、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导 | 根据《流动性风险 |

| | | | |
|---|--|--|---|
| 七、拒绝或暂停申购的情形 | | <p>致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%，或者变相规避50%集中度的情形。</p> <p>8、申请超过基金管理人设定的单笔申购的最高金额、单个投资人单日申购金额上限、本基金单日净申购比例上限、本基金总规模上限的。</p> <p>9、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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。</p> | <p>管理规定》第十四条补充</p> <p>根据《流动性风险管理规定》第十九条补充</p> <p>根据《流动性风险管理规定》第二十四条补充</p> |
| <p>第六部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> | <p>发生上述第1、2、3、5、6、7项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受基金投资者的申购申请时，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，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。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。</p> | <p>发生上述第1、2、3、5、6、9、10项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受基金投资者的申购申请时，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全部或部分拒绝的，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。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。</p> | <p>根据上文修改相应调整序号</p> |
| <p>第六部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>八、暂停赎回或延缓支</p> | | <p>新增：</p> <p>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</p> | <p>根据《流动性风险管理规定》第二十</p> |

| | | | |
|---|--|---|-------------------------|
| 付赎回款项的情形 | | 允价值存在重大不确定性时, 经与基金托管人协商确认后, 基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。 | 四条补充 |
| 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 2、巨额赎回的处理方式 | | 新增： 但若赎回申请人中存在当日申请赎回的份额超过前一工作日基金总份额 30%的单个赎回申请人（“大额赎回申请人”）的情形下，基金管理人应当按照保护其他赎回申请人（“小额赎回申请人”）利益的原则，优先确认小额赎回申请人的赎回申请，具体为：如小额赎回申请人的赎回申请在当日被全部确认，则基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10%的前提下，在仍可接受赎回申请的范围内对该等大额赎回申请人的赎回申请按比例确认，对大额赎回申请人未予确认的赎回申请延期办理。如小额赎回申请人的赎回申请在当日未被全部确认，则对全部未确认的赎回申请（含小额赎回申请人的其余赎回申请与大额赎回申请人的全部赎回申请）延期办理。延期办理的具体程序，按照本条规定的延期赎回或取消赎回的方式办理。基金管理人应当对延期办理事宜在指定媒介上刊登公告。 | 根据《流动性风险管理规定》第二十一条（二）补充 |

| | | | |
|--|--|---|----------------------------|
| <p>第七部分 基金合同</p> <p>当事人及权利义务</p> <p>一、基金管理人</p> <p>(一) 基金管理人简况</p> | <p>住所：上海市延安东路 222 号外滩中心大厦 46 层</p> <p>邮政编码：200002</p> <p>……</p> <p>联系电话：021-33074700</p> | <p>住所：上海市黄浦区中山东二路 558 号外滩金融中心 1 幢，6 层至 10 层</p> <p>邮政编码：200010</p> <p>……</p> <p>联系电话：021-80262888</p> | <p>根据基金管理人情况修改</p> |
| <p>第七部分 基金合同</p> <p>当事人及权利义务</p> <p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况</p> | <p>住所：北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心</p> <p>……</p> <p>成立时间：1992 年 8 月 18 日</p> <p>……</p> <p>注册资本：人民币 404.3479 亿元</p> <p>存续期间：持续经营</p> <p>……</p> <p>基金托管资格批文及文号：证监基金字【2002】75 号</p> | <p>住所：北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心</p> <p>……</p> <p>成立时间：1992 年 6 月 18 日</p> <p>……</p> <p>注册资本：人民币 404.3479 亿元</p> <p>存续期间：持续经营</p> <p>……</p> <p>基金托管资格批文及文号：证监基金字【2002】75 号</p> | <p>根据基金托管人情况修改</p> |
| <p>第十二部分 基金的投资</p> <p>二、投资范围</p> | <p>基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比例范围为 0%—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，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。如法律法规或中国证监会变更</p> | <p>基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比例范围为 0%—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，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。前述现金资产不包括结算备付金、存</p> | <p>根据《流动性风险管理规定》第十八条补充</p> |

| | | | |
|------------------------------|--|---|------------------------------|
| | 上述投资品种的比例限制，以变更后的比例为准，本基金的投资比例会做相应调整。 | 出保证金、应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制，以变更后的比例为准，本基金的投资比例会做相应调整。 | |
| 第十二部分 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： （2）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以后，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； | 1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： （2）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以后，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。前述现金资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等； 新增： （26）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%； （27）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计 | 根据《流动性风险管理规定》第十五、十六、十七、十八条补充 |

| | | | |
|---|---|---|-----------------------------|
| | <p>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 个工作日内进行调整，但法律法规或中国证监会规定的特殊情形除外。</p> | <p>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本款所规定比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>（28）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>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，除第（2）、（12）、（27）、（28）项外，基金管理人应当在 10 个工作日内进行调整，但法律法规或中国证监会规定的特殊情形除外。</p> | |
| <p>第十四部分 基金资产估值</p> <p>六、暂停估值的情形</p> | | <p>新增：</p> <p>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确认后，基金管理人应当暂停基金估值；</p> | <p>《根据流动性风险管理规定》第二十四条补充</p> |

| | | | |
|--|--|---|-----------------------------------|
| <p>第十八部分 基金的信息披露</p> <p>(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</p> | | <p>新增:</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>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20%的情形, 为保障其他投资者权益, 基金管理人至少应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告文件中“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。</p> | <p>根据《流动性风险管理规定》第二十六条、第二十七条补充</p> |
| <p>第十八部分 基金的信息披露</p> <p>(七) 临时报告</p> | | <p>新增</p> <p>27、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> | <p>根据《流动性风险管理规定》第二十六条补充</p> |
| <p>第十八部分 基金的信息披露</p> <p>八、暂停或延迟信息披露的情形</p> | | <p>新增:</p> <p>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暂停基金估值;</p> | <p>《根据流动性风险管理规定》第二十四条补充</p> |