

光大保德信基金管理有限公司

关于光大保德信量化核心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。为使光大保德信量化核心证券投资基金（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《光大保德信量化核心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《光大保德信量化核心证券投资基金托管协议》，并将在更新的《光大保德信量化核心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：《光大保德信量化核心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
一、前言	<p>2. 订立本《基金合同》的依据是 1997 年 11 月 14 日经国务院批准发布的《证券投资基金管理暂行办法》(以下简称“《暂行办法》”)、2000 年 10 月 8 日中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)发布的《开放式证券投资基金试点办法》(以下简称“《试点办法》”)及其他有关法律法规。自 2004 年 6 月 1 日起,本《基金合同》同时适用《中华人民共和国证券投资基金法》及相关法规、规章之规定,若本《基金合同》内容存在与上述法律、法规和规章冲突之处的,应以上述法律、法规和规章之规定为准,本《基金合同》相应内容自动根据上述法律、法规和规章之规定作相应变更和调整。届时如果上述法律、法规、规章和 / 或《基金合同》要求对前述变更和调整进行公告的,还应进行公告。</p>	<p>2. 订立本《基金合同》的依据是 1997 年 11 月 14 日经国务院批准发布的《证券投资基金管理暂行办法》(以下简称“《暂行办法》”)、2000 年 10 月 8 日中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)发布的《开放式证券投资基金试点办法》(以下简称“《试点办法》”)及其他有关法律法规。自 2004 年 6 月 1 日起,本《基金合同》同时适用《中华人民共和国证券投资基金法》、《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》”)及相关法规、规章之规定,若本《基金合同》内容存在与上述法律、法规和规章冲突之处的,应以上述法律、法规和规章之规定为准,本《基金合同》相应内容自动根据上述法律、法规和规章之规定作相应变更和调整。届时如果上述法律、法规、规章和 / 或《基金合同》要求对前述变更和调整进行公告的,还应进行公告。</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>
二、释义		<p>新增: 《流动性风险管理规定》:指 2017 年 8 月 31 日由中国</p>	<p>补充《流动性风险管</p>

		<p>证监会颁布、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作出的修改；</p> <p>.....</p> <p>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>	<p>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资产释义</p>
<p>三、《基金合同》当事人及其权利义务</p> <p>(一) 基金发起人</p> <p>1. 基金发起人概述</p>	<p>注册地址：上海市延安东路 222 号外滩中心 46-47 楼</p> <p>法定代表人：周立群</p> <p>总经理：汤臣 (PAUL THOMPSON)</p> <p>.....</p> <p>注册资本：人民币 1 亿元</p> <p>.....</p> <p>电话：(021) 33074700</p> <p>传真：(021) 63351152</p>	<p>注册地址：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>法定代表人：林昌</p> <p>总经理：包爱丽</p> <p>.....</p> <p>注册资本：人民币 1.6 亿元</p> <p>.....</p> <p>电话：(021) 80262888</p>	<p>根据基金管理人情况修改</p>

	<p>客服电话：(021) 53524620</p> <p>联系人：宋宜农 汪毓</p>		
<p>三、《基金合同》</p> <p>当事人及其权利义务</p> <p>(二) 基金管理人</p> <p>1. 基金管理人概述</p>	<p>名称：光大保德信基金管理有限公司</p> <p>注册地址：上海市延安东路 222 号外滩中心 46-47 楼</p> <p>法定代表人：周立群</p> <p>总经理：汤臣 (PAUL THOMPSON)</p> <p>成立日期：2004 年 4 月 22 日</p> <p>批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2004]42 号</p> <p>组织形式：有限责任公司</p> <p>注册资本：人民币 1 亿元</p> <p>存续期间：持续经营</p> <p>电话：(021) 33074700</p> <p>传真：(021) 63351152</p> <p>客服电话：(021) 53524620</p> <p>联系人：宋宜农 汪毓</p> <p>网址：www.epf.com.cn</p>	<p>名称：光大保德信基金管理有限公司</p> <p>注册地址：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>法定代表人：林昌</p> <p>总经理：包爱丽</p> <p>成立日期：2004 年 4 月 22 日</p> <p>批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2004]42 号</p> <p>组织形式：有限责任公司</p> <p>注册资本：人民币 1.6 亿元</p> <p>存续期间：持续经营</p> <p>电话：(021) 80262888</p> <p>网址：www.epf.com.cn</p>	<p>根据基金管理人情况修改</p>
<p>三、《基金合同》</p> <p>当事人及其权利</p>	<p>名称：中国光大银行</p> <p>地址：北京市西城区复兴门外大街 6 号光大大厦</p>	<p>名称：中国光大银行股份有限公司</p> <p>住所：北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国</p>	<p>根据基金托管人情况修改</p>

<p>利义务</p> <p>(三) 基金托管人</p> <p>1. 基金托管人概述</p>	<p>法定代表人：王明权</p> <p>成立日期：1992年8月18日</p> <p>组织形式：股份制商业银行</p> <p>注册资本：82.1689亿元人民币</p> <p>存续期间：持续经营</p> <p>基金托管资格批准文号：证监基金字[2002]75号</p>	<p>光大中心</p> <p>法定代表人：唐双宁</p> <p>成立时间：1992年6月18日</p> <p>批准设立机关和批准设立文号：国务院、国函[1992]7号</p> <p>组织形式：股份有限公司</p> <p>注册资本：人民币466.79095亿元</p> <p>存续期间：持续经营</p> <p>基金托管资格批文及文号：证监基金字[2002]75号</p>	
<p>九、基金的申购与赎回</p> <p>(五) 申购与赎回的数额限制</p>		<p>新增：</p> <p>7. 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。</p>	<p>根据《流动性风险管理规定》第十九条补充</p>
<p>九、基金的申购与赎回</p> <p>(七) 申购</p>	<p>本基金的申购费由申购人承担，不记入基金资产，用于基金的市场推广及销售等各项费用。赎回费由赎回人承担，赎回费在扣除手续费及注册登记费后，余额部分全</p>	<p>本基金的申购费由申购人承担，不记入基金资产，用于基金的市场推广及销售等各项费用。赎回费由赎回人承担，赎回费在扣除手续费及注册登记费后，余额</p>	<p>根据《流动性风险管理规定》第二十三条补充</p>

和赎回的费用	部归入基金资产，归入基金资产的赎回费比例不得低于赎回费总额的 25%。本基金申购、赎回费率设置如下表所示：		部分全部归入基金资产，其中对持续持有期少于 7 日的投资者收取 1.5%的赎回费，并将赎回费全额计入基金财产，其他情形下，赎回费归入基金资产的比例不得低于赎回费总额的 25%。本基金申购、赎回费率设置如下表所示：		
九、基金的申购与赎回 (七) 申购和赎回的费用	持有期	赎回费率	持有期	赎回费率	根据《流动性风险管理规定》第二十三条补充
	1 年以内	0.5%	7 日以内	1.5%	
	1 年至 2 年（含 1 年）	0.2%	7 日至 1 年（含 7 日）	0.5%	
	2 年及以上	0%	1 年至 2 年（含 1 年）	0.2%	
			2 年及以上	0%	
九、基金的申购与赎回 (九) 拒绝或暂停申购、赎回的情形及处理方式	1. 拒绝或暂停申购		<p>新增：</p> <p>(5) 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>(6) 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>(7) 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</p>		<p>根据《流动性风险管理规定》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</p>

	<p>.....</p> <p>发生上述（1）至（3）项或（5）项情形时，基金管理人应立即报中国证监会备案，并及时在指定信息披露媒体上刊登暂停申购的公告。</p> <p>发生上述（4）项情形时，基金管理人应将申购款项全额退还申购申请人。</p>	<p>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>.....</p> <p>发生上述（1）至（3）项或（7）、（8）项情形时，基金管理人应立即报中国证监会备案，并及时在指定信息披露媒体上刊登暂停申购的公告。</p> <p>如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，被拒绝的申购款项将退还给投资人。</p>	补充
<p>九、基金的申购与赎回</p> <p>（九）拒绝或暂停申购、赎回的情形及处理方式</p>	<p>2. 暂停接受和办理赎回申请</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；</p>	<p>根据《流动性风险管理规定》第二十四条</p> <p>补充</p>
<p>九、基金的申购与赎回</p> <p>（十）巨额赎回的情形及处理方式</p>	<p>（2）部分延期赎回：.....</p>	<p>新增：</p> <p>若本基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人超过基金总份额 30%以上（“大额赎回申请人”）的赎回申请的情形下，基金管理人可以延期办理赎回申请。基金管理人应当按照保护其他赎回申请人（“小额赎回申请</p>	<p>根据《流动性风险管理规定》第二十一条</p> <p>（二）补充</p>

<p>2、巨额赎回的处理方式</p>		<p>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, 基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一工作日基金总份额的 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, 对该等大额赎回申请人当日未予确认的部分延期办理。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理, 无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额, 以此类推, 直至全部赎回。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赎回申请的事宜在指定媒介上刊登公告。</p>	
<p>十四、基金的投资 (九) 投资限制</p>		<p>新增: 4. 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股票, 不得超过该上市公司可流通股股票的 15%; 本基金管理人管理的全部投资组合持有</p>	<p>根据《流动性风险管理规定》第十五、十六、十七、十八条补充</p>

		<p>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%；</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>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>十六、基金资产与基金资产估值</p> <p>(二) 基金资产估值</p>	7. 暂停估值的情形	<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>	根据《流动性风险管理规定》第二十四条补充
<p>二十、基金的信息披露</p> <p>(二) 信息披露的内容及</p>	3. 定期报告	<p>新增：</p> <p>(6) 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>(7) 报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到</p>	根据《流动性风险管理规定》第二十六条、第二十七条补充

时间		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。	
二十、基金的信息披露 (二) 信息披露的内容及时间	4. 临时报告与公告	新增： (23)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；	根据《流动性风险管理规定》第二十六条补充