

关于招商深证 100 指数证券投资基金

修订基金合同的公告

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证券投资基金且基金合同内容不符合《规定》要求的，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，经与基金托管人协商一致，招商基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）对旗下招商深证 100 指数证券投资基金（以下简称“本基金”）的《招商深证 100 指数证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）相关条款进行修订。本次《基金合同》修订的内容包括前言和释义、基金份额的申购与赎回、基金的投资、基金资产估值、基金的信息披露等。具体修订内容详见公告附件。

本次《基金合同》修订系因相关法律法规发生变动而进行，且对现有基金份额持有人的利益无实质性影响，根据《基金合同》的约定，不需要召开基金份额持有人大会。本次《基金合同》修订已经过本基金管理人与基金托管人协商一致并已报监管机构备案。修订后的《基金合同》自本公告发布之日起生效，但为不影响现有基金份额持有人的利益，《基金合同》中“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”的条款约定将于 2018 年 3 月 31 日起正式实施。本基金将于 2018 年 3 月 31 日起，对持续持有期少于 7 日的基金份额持有人收取 1.5% 的赎回费。本基金管理人经与基金托管人协商一致，已相应修订了本基金的《招商深证 100 指数证券投资基金托管协议》，并将在更新的《招商深证 100 指数证券投资基金招募说明书》中作出相应调整。

本基金管理人将于公告当日将修改后的《基金合同》、《招商深证 100 指数证券投资基金托管协议》登载于本基金管理人网站。投资者可通过本基金管理人的网站：www.cmfchina.com 或客户服务电话：400-887-9555 了解详情。

特此公告。

招商基金管理有限公司
二〇一八年三月二十二日

附件：《基金合同》修订对照表

章节	原文条款	修改后条款
	内容	内容
第一部分 前言和释义之前言	为保护基金投资者合法权益，明确《基金合同》当事人的权利与义务，规范招商深证 100 指数证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）运作，依照《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》（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》）、《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》及其他有关规定，在平等自愿、诚实信用、充分保护基金投资者及相关当事人的合法权益的原则基础上，特订立《招商深证 100 指数证券投资基金基金合同》（以下简称“本合同”或“《基金合同》”）。	为保护基金投资者合法权益，明确《基金合同》当事人的权利与义务，规范招商深证 100 指数证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）运作，依照《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》（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》）、 <u>《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》”）</u> 、《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》及其他有关规定，在平等自愿、诚实信用、充分保护基金投资者及相关当事人的合法权益的原则基础上，特订立《招商深证 100 指数证券投资基金基金合同》（以下简称“本合同”或“《基金合同》”）。
第一部分 前言和释义之释义	无	<u>《流动性风险管理规定》《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</u> <u>流动性受限资产</u> 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
第五部分 基金份额的申购与赎回	五、申购与赎回的数额限制	五、申购与赎回的数额限制
	无	<u>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。具体请参见相关公告；</u>
	六、申购费用和赎回费用	六、申购费用和赎回费用

	<p>2、投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取，扣除用于市场推广、注册登记费和其他手续费后的余额归基金财产，赎回费归入基金财产的比例不得低于赎回费总额的 25%。</p>	<p>2、投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取，扣除用于市场推广、注册登记费和其他手续费后的余额归基金财产，赎回费归入基金财产的比例不得低于赎回费总额的 25%。<u>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。</u></p>
<p>九、 拒绝或暂停申购的情形及处理方式 发生上述（1）到（4）项暂停申购情形时，基金管理人应当在至少一家指定媒体及基金管理人网站刊登暂停申购公告并报中国证监会备案。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>九、 拒绝或暂停申购的情形及处理方式 <u>（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，基金管理人应当暂停接受基金申购申请；</u> <u>（6）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%集中度的情形时。</u> 发生上述（1）到（5）项暂停申购情形时，基金管理人应当在至少一家指定媒体及基金管理人网站刊登暂停申购公告并报中国证监会备案。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>九、 拒绝或暂停申购的情形及处理方式 <u>（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，基金管理人应当暂停接受基金申购申请；</u> <u>（6）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%集中度的情形时。</u> 发生上述（1）到（5）项暂停申购情形时，基金管理人应当在至少一家指定媒体及基金管理人网站刊登暂停申购公告并报中国证监会备案。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>十、 暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式 无</p>	<p>十、 暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式 <u>（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，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请；</u></p>	<p>十、 暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式 <u>（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，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请；</u></p>
<p>十一、 巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 （2）部分顺延赎回：当基金管理人认为支付投资者的赎回申请有困难或认为支付投资者的赎回申请可能会对基金的资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额的 10%的前提下，对其余赎回申请延期予以办理。<u>对于单个基金份额持有人的赎回申请，应当按照其申请赎回份额占当日申请</u></p>	<p>十一、 巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 （2）部分顺延赎回：当基金管理人认为支付投资者的赎回申请有困难或认为支付投资者的赎回申请可能会对基金的资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额的 10%的前提下，对其余赎回申请延期予以办理。<u>若进行上述延期办理，对于单个基金份额持有人当日赎回申请超过上一日基</u></p>	<p>十一、 巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 （2）部分顺延赎回：当基金管理人认为支付投资者的赎回申请有困难或认为支付投资者的赎回申请可能会对基金的资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额的 10%的前提下，对其余赎回申请延期予以办理。<u>若进行上述延期办理，对于单个基金份额持有人当日赎回申请超过上一日基</u></p>

	<p>赎回总份额的比例，确定该单个基金份额持有人当日办理的赎回份额；投资者未能赎回部分，除投资者在提交赎回申请时选择将当日未获办理部分予以撤销外，延迟至下一个开放日办理，赎回价格为下一个开放日的价格。依照上述规定转入下一个开放日的赎回不享有赎回优先权，并以此类推，直到全部赎回为止。部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的限制。</p>	<p><u>金总份额 10%以上的部分，将自动进行延期办理。对于其余当日非自动延期办理的赎回申请，应当按单个账户非自动延期办理的赎回申请量占非自动延期办理的赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额。</u>投资者未能赎回部分，除投资者在提交赎回申请时选择将当日未获办理部分予以撤销外，延迟至下一个开放日办理，赎回价格为下一个开放日的价格。依照上述规定转入下一个开放日的赎回不享有赎回优先权，并以此类推，直到全部赎回为止。部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的限制。</p>
<p>第十一部分 基金的投资</p>	<p>二、投资范围</p> <p>.....</p> <p>本基金股票等权益类资产的投资比例为基金资产的 85%-95%，其中投资于标的指数成份股、备选成份股的资产占基金资产的比例不低于 80%；现金、债券等固定收益类资产的投资比例为基金资产的 5%-15%，其中现金及到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>二、投资范围</p> <p>.....</p> <p>本基金股票等权益类资产的投资比例为基金资产的 85%-95%，其中投资于标的指数成份股、备选成份股的资产占基金资产的比例不低于 80%；现金、债券等固定收益类资产的投资比例为基金资产的 5%-15%，其中现金及到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，<u>现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</u></p>
	<p>四、投资策略</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金股票等权益类资产的投资比例为基金资产的 85%-95%，其中投资于标的指数成份股、备选成份股的资产占基金资产的比例不低于 80%；现金、债券等固定收益类资产的投资比例为基金资产的 5%-15%，其中现金及到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>四、投资策略</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金股票等权益类资产的投资比例为基金资产的 85%-95%，其中投资于标的指数成份股、备选成份股的资产占基金资产的比例不低于 80%；现金、债券等固定收益类资产的投资比例为基金资产的 5%-15%，其中现金及到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，<u>现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</u></p>
	<p>(二) 投资组合限制</p> <p>3、现金和到期日不超过一年的政府债券不低于基金资产净值的 5%；</p> <p>.....</p> <p>基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合法律法规的规定和基金合同的约定。由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不</p>	<p>(二) 投资组合限制</p> <p>3、现金和到期日不超过一年的政府债券不低于基金资产净值的 5%，<u>其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</u></p> <p><u>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本基金资产净值的 15%；</u></p> <p><u>因证券市场波动、上市公司股票停牌、基</u></p>

	<p>符合上述约定的比例不在限制之内，但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到规定的投资比例限制要求。法律法规另有规定的从其规定。</p>	<p><u>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；</u></p> <p><u>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；</u></p> <p>.....</p> <p>基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合法律法规的规定和基金合同的约定。<u>除上述第 3、5、6 项外</u>，由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动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不在限制之内，但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到规定的投资比例限制要求。法律法规另有规定的从其规定。</p>
<p>第十三部分 基金资产估值</p>	<p>七、暂停估值的情形</p> <p>无</p>	<p>七、暂停估值的情形</p> <p><u>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一致的，基金管理人应当暂停基金估值；</u></p>
<p>第十七部分 基金的信息披露</p>	<p>五、公开披露的基金信息</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>无</p> <p>(七) 临时报告</p> <p>23、本基金发生巨额赎回并延期支付；</p>	<p>五、公开披露的基金信息</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><u>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。</u></p> <p><u>如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 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产品的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。</u></p> <p>(七) 临时报告</p> <p>23、本基金发生巨额赎回并延期<u>办理</u>；</p> <p><u>26、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；</u></p>