

中欧基金管理有限公司

关于旗下中欧新动力混合型证券投资基金（LOF）因法律法规变动相应修改

基金合同和托管协议的公告

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“《流动性管理规定》”），经与基金托管人中国光大银行股份有限公司协商一致，并报上海证监局备案，中欧基金管理有限公司（以下简称“本公司”）对中欧新动力混合型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）的基金合同进行了修改，具体修改内容见附件。本基金的托管协议相应部分一并修改。

上述修改系因相应法律法规发生变动而进行的修改，且对基金原有基金份额持有人的利益无实质性不利影响，根据《基金合同》的规定无需召开基金份额持有人大会。本基金管理人已就修订内容履行了规定的程序，符合相关法律法规及基金合同的规定。

上述修改自本公告发布之日起生效，但不影响原有基金份额持有人的利益，上述修改中“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”的条款将于 2018 年 3 月 30 日起正式实施，即：基金将于 2018 年 3 月 30 日起（含当日），分别对其持续持有期少于 7 日的投资者收取 1.5% 的赎回费。

基金管理人将在更新的基金更新招募说明书中，对涉及上述修订的内容进行相应更新。投资者欲了解基金信息请仔细阅读相关基金的《基金合同》、《招募说明书》及相关法律文件。

投资者可通过登录中欧基金管理有限公司网站（www.zofund.com），或拨打客户服务电话 400-700-9700、021-68609700 咨询相关信息。

本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。敬请投资者留意投资风险。

特此公告。

中欧基金管理有限公司

2017 年 3 月 23 日

附：中欧新动力混合型证券投资基金（LOF）基金合同修订对照表

章节	修订前	修订内容	修订依据
前言	无	新增： <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“《流动性管理规定》”）</u>	将《流动性管理规定》纳入基金合同制订依据
释义	无	新增： <u>13、《流动性管理规定》：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订</u> <u>58、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</u>	补充《流动性管理规定》释义 《流动性管理规定》第四十条
基金的申购与赎回	无	“五、申购和赎回的数量限制”中，增加： “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。”	《流动性管理规定》第十九条第二款
基金的申购与赎回 - 申购和赎回的价格、费用及其用途	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。不低于赎回费总额的 25%应归基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。	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。不低于赎回费总额的 25%应归基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费， <u>其中，对持续持有期少于 7 日的投资者收取不少于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产。</u>	《流动性管理规定》第二十三条

章节	修订前	修订内容	修订依据
基金的申购与赎回	七、拒绝或暂停申购的情形 3、发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况； …… 发生上述第 1、2、3、5、6、7……	七、拒绝或暂停申购的情形 3、发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况；<u>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>7、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> <u>8、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、单一投资者单日或单笔申购金额上限的。</u> 发生上述第 1、2、3、5、6、9……	《流动性管理规定》第十九、二十四条
基金的申购与赎回	无	“八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形” 中，增加： “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基金估值并选择采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。”	《流动性管理规定》第二十四条
基金的申购与赎回	无	“九、巨额赎回的情形及处理方式” 中新增： （3）若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一工作日基金总份额 30%的，基金管理人有权对该单个基金份额持有人超出该比例的赎回申请实施延期办理，对该单个基金份额持有人剩余赎回申请与其他账户赎回申请按前述条款处理。	《流动性管理规定》第二十一条(二)
基金的投资	二、投资范围 ……	二、投资范围 ……	《流动性管理规定》第十八条

章节	修订前	修订内容	修订依据
	基金的投资组合比例为： 本基金的投资组合比例为：股票、权证等权益类资产占基金资产的 60%~95%，其中投资于新动力主题的基金资产占投资于股票的基金资产的比例不低于 80%，权证资产比例不超过基金资产净值的 3%；债券等固定收益类资产以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的 5%~40%，其中现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。 	基金的投资组合比例为： 本基金的投资组合比例为：股票、权证等权益类资产占基金资产的 60%~95%，其中投资于新动力主题的基金资产占投资于股票的基金资产的比例不低于 80%，权证资产比例不超过基金资产净值的 3%；债券等固定收益类资产以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的 5%~40%，其中现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。 	
基金的投资	（七）投资限制 1、组合限制	（七）投资限制 1、组合限制 <u>（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%；</u> <u>（7）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；</u> <u>（8）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</u>	《流动性管理规定》第十五、十六、十七、十八条

章节	修订前	修订内容	修订依据
	(17) 现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%；	<u>基金合同约定的投资范围保持一致；</u> (17) 现金<u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%； 除上述第（7）、（8）、（14）、（17）项外，……	
基金资产估值	无	“六、暂停估值的情形”中新增： <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，基金管理人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>	《流动性管理规定》第二十四条
基金的信息披露	无	“（八）基金年度报告、基金半年度报告、基金季度报告”中新增： <u>6、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> <u>7、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本基金的特定风险，中国证监会认定的特殊情形除外。</u>	《流动性管理规定》第二十六、二十七条

章节	修订前	修订内容	修订依据
基金的信息披露	无	“（九）临时报告与公告”中新增： <u>28、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>	《流动性管理规定》第二十六条

附：中欧新动力混合型证券投资基金（LOF）托管协议修订对照表

章节	修订前	修订内容	修订依据
基金托管协议的依据、目的和原则	无	新增： <u>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</u>	将《流动性管理规定》纳入托管协议制订依据
基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	（一）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。 1、基金托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，对下述基金投资范围、投资对象进行监督。 本基金的投资组合比例为：股票、权证等权益类资产占基金资产的 60%～95%，其中投资于新动力主题的基金资产占投资于股票的基金资产的比例不低于 80%，权证资产比例不超过基金资产净值的 3%；债券等固定收益类资产以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的 5%～40%，其中现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。	（一）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。 1、基金托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，对下述基金投资范围、投资对象进行监督。 本基金的投资组合比例为：股票、权证等权益类资产占基金资产的 60%～95%，其中投资于新动力主题的基金资产占投资于股票的基金资产的比例不低于 80%，权证资产比例不超过基金资产净值的 3%；债券等固定收益类资产以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的 5%～40%，其中现金（<u>不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>）或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。 （二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约	《流动性管理规定》第十五、十六、十七、十八条

章节	修订前	修订内容	修订依据
	(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。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督: (17) 现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%;	定,对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督: <u>(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%;</u> <u>(7) 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;</u> <u>(8) 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> (17) 现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%; <u>除上述第(7)、(8)、(14)、(17)项外,……</u>	
基金托管人对基金管理人的业务监	(五)基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金投资流通受限证券进行监督。 (1) 基金投资流通受限证券,应遵守《关于规范基金	(五)基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金投资流通受限证券进行监督。 (1) 基金投资流通受限证券,应遵守有关法律法规规定。	《流动性管理规定》第四十条

章节	修订前	修订内容	修订依据
督和核查	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。 （2）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。	（2）此处的流通受限证券与上文提及的流动性受限资产并不完全一致，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。<u>基金投资流通受限证券，还应遵守《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。</u>	
交易及清算 交收安排	（四）申赎净额结算 基金托管账户与“基金在中国证券登记结算有限责任公司开立的清算账户”间的资金结算遵循“全额清算、净额交收”的原则，每日按照托管账户应收资金与应付资金的差额来确定托管账户净应收额或净应付额，以此确定资金交收额。	（四）申赎净额结算 基金托管账户与“基金清算账户”间的资金结算遵循“全额清算、净额交收”的原则，每日按照托管账户应收资金与应付资金的差额来确定托管账户净应收额或净应付额，以此确定资金交收额。	根据实际情况更新
基金资产净值 计算和会计核算	无	“（四）暂停估值与公告基金份额净值的情形”中新增： <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，基金管理人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>	《流动性管理规定》第二十四条