

易方达基金管理有限公司关于易方达恒生中国企业交易型开放式 指数证券投资基金修订基金合同、托管协议部分条款的公告

根据《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《管理规定》）及基金合同和托管协议的有关规定，经与基金托管人协商一致并报监管机构备案，易方达基金管理有限公司决定对易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金（以下简称本基金）的基金合同、托管协议进行修订。现将相关事宜公告如下：

一、基金合同和托管协议修订

基金合同、托管协议具体修订内容详见附件《易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金基金合同、托管协议修订说明》。本次修订属于基金合同约定的基金管理人与基金托管人可以协商一致变更基金合同的事项，并已履行规定程序，符合相关法律法规及基金合同的规定。

二、上述基金合同、托管协议的修订等事宜自**2018年3月31日**起生效。

基金管理人将在届时更新本基金招募说明书时一并更新相关内容。

三、其他事项

1. 投资者可通过以下途径咨询有关详情

客户服务电话：400-881-8088

网址：www.efunds.com.cn

2. 风险提示：

（1）本次基金管理人系根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修订本基金的《基金合同》和《托管协议》，所修订内容可能对本基金投资运作及投资者办理基金申购、赎回业务产生一定影响，包括但不限于：出于流动性风险管理需要增加或调整了基金的部分投资限制规定；在规定的特定情形下可能会对投资者的申购/赎回申请数量进行限制、临时拒绝或暂停申购/赎回申请、对部分赎回申请进行延期办理等，由此可能导致投资者的申购/赎回

申请无法全部及时处理，从而可能影响投资者的资金安排及投资计划。敬请投资者关注以上变化和影响，并仔细阅读本基金修订后的基金合同及相关法律文件，审慎进行投资决策。

（2）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资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。销售机构根据法规要求对投资者类别、风险承受能力和基金的风险等级进行划分，并提出适当性匹配意见。投资者在投资基金前应认真阅读《基金合同》和《招募说明书》等基金法律文件，全面认识基金产品的风险收益特征，在了解产品情况及听取销售机构适当性意见的基础上，根据自身的风险承受能力、投资期限和投资目标，对基金投资作出独立决策，选择合适的基金产品。

特此公告。

附件：《易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金基金合同、托管协议修订说明》

易方达基金管理有限公司

2018年3月22日

附件：易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金基金合同、托管协议修订说明

(一) 基金合同

序号	章节	原文	修订
1	一、前言	<p>(2) 订立本基金合同的依据</p> <p>订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法通则》、《中华人民共和国合同法》、2003年10月28日第十届全国人民代表大会常务委员第五次会议通过并于2004年6月1日起施行的《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、2004年6月29日中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)发布并于2004年7月1日起施行的《证券投资基金运作管理办法》(以下简称《运作办法》)和2011年6月9日中国证监会发布并于2011年10月1日起施行的《证券投资基金销售管理办法》(以下简称《销售办法》)、2004年6月11日中国证监会发布并于2004年7月1日起施行的《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称《信息披露办法》)、2006年4月13日中国人民银行发布的《中国人民银行公告(2006)第5号》、2007年6月18日中国证监会发布并于2007年7月5日起施行的《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》(以下简称《试行办法》)、《关于实施〈合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法〉有关问题的通知》及其他有关规定。</p>	<p>(2) 订立本基金合同的依据</p> <p>订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法通则》、《中华人民共和国合同法》、2003年10月28日第十届全国人民代表大会常务委员第五次会议通过并于2004年6月1日起施行的《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、2004年6月29日中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)发布并于2004年7月1日起施行的《证券投资基金运作管理办法》(以下简称《运作办法》)和2011年6月9日中国证监会发布并于2011年10月1日起施行的《证券投资基金销售管理办法》(以下简称《销售办法》)、2004年6月11日中国证监会发布并于2004年7月1日起施行的《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称《信息披露办法》)、2006年4月13日中国人民银行发布的《中国人民银行公告(2006)第5号》、2007年6月18日中国证监会发布并于2007年7月5日起施行的《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》(以下简称《试行办法》)、《关于实施〈合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法〉有关问题的通知》、《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“《管理规定》”)及其他有关规定。</p>
2	二、释义	无	<p>新增释义：</p> <p>“《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”</p> <p>流动性受限资产：指由于法律法规、</p>

			<p>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>
3	八、基金份额的申购、赎回	<p>（六）申购与赎回的数额限制</p> <p>1、投资者日常申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。最小申购、赎回单位由基金管理人确定和调整，具体详见招募说明书或相关公告的规定。</p> <p>2、基金管理人可根据基金运作情况、市场情况和投资者需求等因素，在法律法规允许的情况下，调整申购和赎回的数额限制。基金管理人必须在调整生效前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体公告。</p>	<p>（六）申购与赎回的数额限制</p> <p>1、投资者日常申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。最小申购、赎回单位由基金管理人确定和调整，具体详见招募说明书或相关公告的规定。</p> <p>2、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份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。</p> <p>3、基金管理人可根据基金运作情况、市场情况和投资者需求等因素，在法律法规允许的情况下，调整申购和赎回的数额限制，如规定每个基金交易账户的最低场内基金份额余额、单个投资者单日或单笔申购份额上限和净申购比例上限等，或者新增基金规模控制措施。基金管理人必须在调整生效前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体公告。</p>
4	八、基金份额的申购、赎回	<p>（八）暂停申购、赎回和延缓支付赎回款项的情形</p> <p>发生如下情况时，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购、赎回申请：</p> <p>.....</p> <p>在发生暂停申购或赎回的情形之一时，本基金的申购和赎回可能同时暂停。</p> <p>发生上述 1)-10)、12) 项情形之一的，基金管理人应当在网站及其他媒介上刊登暂停公告并报中国证监</p>	<p>（八）暂停申购、赎回和延缓支付赎回款项的情形</p> <p>发生如下情况时，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购、赎回申请：</p> <p>新增：“12) 当一笔新的申购申请被确认成功，使本基金总规模超过基金管理人规定的本基金总规模上限时；或使本基金单日申购份额或净申购比例超过基金管理人规定的当日申购份额或净申购比例上限时；或该投资人累计持有的份额超过单个投</p>

		<p>会备案。在暂停申购、赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购、赎回业务的办理并予以公告。</p> <p>发生上述第 2)、3)、6)、7)、10) 等项情形时，对于已经确认的赎回申请，基金管理人可以根据该情形的实际影响延缓支付赎回款项。</p>	<p>资人累计持有的份额上限时；或该投资人当日申购份额超过单个投资人单日或单笔申购份额上限时；</p> <p>13) 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或者延缓支付赎回款项或者暂停接受基金赎回申请的措施；”</p> <p>在发生暂停申购或赎回的情形之一时，本基金的申购和赎回可能同时暂停。</p> <p>发生上述 1) -10)、12) -14) 项情形之一的，基金管理人应当在网站及其他媒介上刊登暂停公告并报中国证监会备案。在暂停申购、赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购、赎回业务的办理并予以公告。</p> <p>发生上述第 2)、3)、6)、7)、10)、13) 等项情形时，对于已经确认的赎回申请，基金管理人可以根据该情形的实际影响延缓支付赎回款项。</p>
5	九、基金合同当事人及其权利义务	<p>(一) 基金管理人</p> <p>(1) 基金管理人基本情况 住所：广东省珠海市香洲区情侣路 428 号九州港大厦 4001 室 法定代表人：叶俊英</p>	<p>(一) 基金管理人</p> <p>(1) 基金管理人基本情况 住所：广东省珠海市横琴新区宝中路 3 号 4004-8 室 法定代表人：刘晓艳</p>
6	九、基金合同当事人及其权利义务	<p>(二) 基金托管人</p> <p>法定代表人：胡怀邦 注册资本：618.85 亿元人民币</p>	<p>(二) 基金托管人</p> <p>法定代表人：牛锡明 注册资本：742.62 亿元人民币</p>
7	十四、基金的投资	<p>(九) 投资限制</p> <p>1、本基金的投资组合将遵循以下限制： 若基金超过上述投资比例限制，应当在超过比例后 30 个工作日内采用合理的商业措施减仓以符合投资比例限制要求。中国证监会根据证券市场发展情况或基金具体个案，可以调整上述投资比例限制。</p>	<p>(九) 投资限制</p> <p>1、本基金的投资组合将遵循以下限制： 新增：“(8) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 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。</p> <p>(9) 本基金与私募类证券资管</p>

			<p>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>除上述（8）、（9）以外，若基金超过上述投资比例限制，应当在超过比例后 30 个工作日内采用合理的商业措施减仓以符合投资比例限制要求。中国证监会根据证券市场发展情况或基金具体个案，可以调整上述投资比例限制。</p>
8	十六、基金资产的估值	<p>（六）暂停估值的情形</p> <p>（1）基金投资所涉及的境外投资主要市场或外汇市场临时停市时；</p> <p>（2）因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金财产价值时；</p> <p>（3）占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障基金份额持有人的利益，决定延迟估值时；</p> <p>（4）出现基金管理人认为属于紧急情况的情况，导致基金管理人不能出售或评估基金资产时；</p> <p>（5）中国证监会认定的其他情形。</p>	<p>（六）暂停估值的情形</p> <p>（1）基金投资所涉及的境外投资主要市场或外汇市场临时停市时；</p> <p>（2）因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金财产价值时；</p> <p>（3）占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障基金份额持有人的利益，决定延迟估值时；</p> <p>（4）出现基金管理人认为属于紧急情况的情况，导致基金管理人不能出售或评估基金资产时；</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一致的；</p> <p>（6）中国证监会认定的其他情形。</p>
9	二十、基金的信息披露	<p>（三）定期报告</p> <p>.....</p>	<p>（三）定期报告</p> <p>新增：“报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情形，基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告文件中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。</p> <p>基金持续运作过程中，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>
10	二十、基金的	（七）临时报告与公告	（七）临时报告与公告

信息披露	增加：“(30)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；”
------	-------	---

(二) 托管协议

序号	章节	原文	修订
1	一、基金托管协议当事人	<p>(一) 基金管理人</p> <p>住所：广东省珠海市香洲区情侣路428号九洲港大厦4001室</p> <p>办公地址：广东省广州市天河区体育西路189号城建大厦25-28楼</p> <p>法定代表人：叶俊英</p>	<p>(一) 基金管理人</p> <p>住所：广东省珠海市横琴新区宝中路3号4004-8室</p> <p>办公地址：广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼</p> <p>法定代表人：刘晓艳</p>
2	一、基金托管协议当事人	<p>(二) 基金托管人</p> <p>办公地址：上海市浦东新区银城中路188号（邮政编码：200120）</p> <p>法定代表人：胡怀邦</p> <p>注册资本：618.85亿元人民币</p>	<p>(二) 基金托管人</p> <p>办公地址：上海市长宁区仙霞路18号（邮政编码：200336）</p> <p>法定代表人：牛锡明</p> <p>注册资本：742.62亿元人民币</p>
3	二、基金托管协议的依据、目的和原则	<p>本协议依据《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》）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》（以下简称《试行办法》）、《关于实施〈合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法〉有关问题的通知》及其他有关法律法规与《易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称《基金合同》）及其他有关规定订立。</p>	<p>本协议依据《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》）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》（以下简称《试行办法》）、《关于实施〈合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法〉有关问题的通知》、《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《管理规定》）及其他有关法律法规与《易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称《基金合同》）及其他有关规定订立。</p>
4	四、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	<p>(一) 基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权</p> <p>2、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》和本协议的约定，对基金投资、融资比例进行监督。</p> <p>(1) 本基金的投资组合将遵循以下限制：</p> <p>.....</p> <p>若基金超过上述投资比例限制，应当在超过比例后30个工作日内采用合</p>	<p>(一) 基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权</p> <p>2、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》和本协议的约定，对基金投资、融资比例进行监督。</p> <p>(1) 本基金的投资组合将遵循以下限制：</p> <p>.....</p> <p>新增：“8) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过</p>

		<p>理的商业措施减仓以符合投资比例限制要求。中国证监会根据证券市场 发展情况或基金具体个案，可以调整 上述投资比例限制，基金管理人和基 金托管人根据中国证监会的意见进 行相应调整。</p>	<p>该基金资产净值的 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。</p> <p>9) 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>除上述 8)、9) 以外，若基金超 过上述投资比例限制，应当在超过比 例后 30 个工作日内采用合理的商业 措施减仓以符合投资比例限制要求。 中国证监会根据证券市场 发展情况或基金具体个案，可以调整上述投资 比例限制，基金管理人和基金托管人 根据中国证监会的意见进行相应调 整。</p>
--	--	---	--