

西部利得基金管理有限公司关于西部利得中证 500 等权重指数 分级证券投资基金修改基金合同的公告

公告送出日期：2018 年 3 月 26 日

根据中国证券监督管理委员会于 2017 年 8 月 31 日颁布的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（证监会公告[2017]12 号），经与基金托管人中国兴业银行股份有限公司协商一致并报中国证监会上海证监局备案，西部利得基金管理有限公司（以下简称“本公司”）对西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）的《西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）相关条款进行调整，并更新基金管理人信息，现将具体事宜公告如下：

一、《基金合同》的修改内容

本基金《基金合同》修改事项属于因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改，且其他相应修改对基金份额持有人的利益无实质性不利影响，不属于法律法规规定或《基金合同》约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项。《基金合同》的具体修改内容如下：

章节	原文条款	修改后条款
前言	<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》）、《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》）、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。</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》）、《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》）、<u>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</u>（以下简称“<u>《流动性规定》</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。</p>
释义	无	<u>《流动性规定》</u> <u>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</u>

		<p><u>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></p>
西部利得中证 500 等权重份额的申购与赎回	五、申购与赎回的数额限制 无	<p>五、申购与赎回的数额限制</p> <p><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></p>
	六、申购费用和赎回费用 2、投资者可将其持有的全部或部分西部利得中证 500 等权重份额赎回。西部利得中证 500 等权重份额的赎回费用在投资者赎回西部利得中证 500 等权重份额时收取，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法律法规或中国证监会规定的比例下限。	<p>六、申购费用和赎回费用</p> <p>2、投资者可将其持有的全部或部分西部利得中证 500 等权重份额赎回。西部利得中证 500 等权重份额的赎回费用在投资者赎回西部利得中证 500 等权重份额时收取，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法律法规或中国证监会规定的比例下限。<u>本基金将对持续持有期少于 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>
	九、拒绝或暂停申购的情形及处理方式 …… 发生上述情形之一且基金管理人决定拒绝或暂停接受某些投资者的申购申请的，申购款项本金将全额退还投资者。发生上述（1）到（6）项暂停申购情形时，基金管理人决定暂停接受申购申请的，应当在指定媒介上刊登暂停申购公告。……	<p>九、拒绝或暂停申购的情形及处理方式</p> <p><u>（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；</u></p> <p><u>（8）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></p> <p>……</p> <p>发生上述情形之一且基金管理人决定拒绝或暂停接受某些投资者的申购申请的，申购款项本金将全额退还投资者。发生上述（1）到（7）项暂停申购情形时，基金管</p>

		理人决定暂停接受申购申请的，应当在指定媒介上刊登暂停申购公告。……
	<p>十、暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式</p> <p>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</p> <p><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，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施；</u></p>
	<p>十一、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>2、巨额赎回的场外处理方式</p> <p>(2) 部分顺延赎回：……</p> <p>无</p>	<p>十一、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>2、巨额赎回的场外处理方式</p> <p>(2) 部分顺延赎回：……</p> <p><u>当基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人超过基金总份额 20%以上的赎回申请情形下，基金管理人可以延期办理赎回申请。基金管理人对于单个基金份额持有人超过基金总份额 20%以上部分的赎回申请，实施延期办理，对该单个基金份额持有人 20%以内（含 20%）的赎回申请，当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金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开放日基金总份额的 10%的前提下，对于当日的赎回申请，按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例支付当日的赎回款项。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，直到全部赎回为止。延期部分如选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。</u></p>
<p>《基金合同》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：上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 19 楼</p> <p>法定代表人：安保和</p> <p>注册资本：叁亿元</p> <p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况</p> <p>注册资本：190.52 亿元人民币</p>	<p>一、基金管理人</p> <p>(一) 基金管理人简况</p> <p>住所：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 11 层 02、03 单元</p> <p>法定代表人：徐剑钧</p> <p>注册资本：叁亿伍仟万元</p> <p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况</p> <p>注册资本：2077419.075100 万元人民币</p>

<p>基金的投资</p>	<p>二、投资范围</p> <p>投资于具有良好流动性的金融工具，包括股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（不含中小企业私募债）、债券回购、资产支持证券、权证、央行票据、货币市场工具、银行存款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（但需符合中国证监会的相关规定）。其中，中证 500 等权重指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的 90% 且不低于非现金资产的 80%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。</p>	<p>二、投资范围</p> <p>投资于具有良好流动性的金融工具，包括股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（不含中小企业私募债）、债券回购、资产支持证券、权证、央行票据、货币市场工具、银行存款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（但需符合中国证监会的相关规定）。其中，中证 500 等权重指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的 90% 且不低于非现金资产的 80%，现金或者到期日在一年以内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、存出保证金及应收申购款等</u>，其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。</p>
	<p>四、投资限制</p> <p>1、投资比例限制</p> <p>（1）本基金投资于中证 500 等权重指数成份股及备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90% 且不低于非现金资产的 80%，<u>现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%</u>；本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%</p> <p>.....</p> <p>因证券市场波动、证券发行人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，以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。</p>	<p>四、投资限制</p> <p>1、投资比例限制</p> <p>（1）本基金投资于中证 500 等权重指数成份股及备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90% 且不低于非现金资产的 80%，本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；</p> <p><u>（2）本基金投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等；</u></p> <p><u>（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，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>（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；</u></p>

		<p>.....</p> <p><u>除第(2)、(6)、(8)、(9)项以外，因证券市场波动、证券发行人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，以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。</u></p>
第十四部分基金资产估值	八、暂停估值的情形 无	<p>八、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，基金管理人应当暂停基金估值；</u></p>
第十八部分基金的信息披露	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>(六)西部利得中证500等权重份额申购、赎回价格</p> <p>.....</p> <p>无</p>	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>(六)西部利得中证500等权重份额申购、赎回价格</p> <p>.....</p> <p><u>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。</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，为保障其他投资者利益，基金管理人至少应当在定期报告“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></p>
	(八)临时报告 无	<p>(八)临时报告</p> <p><u>34、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>

*基金合同内容摘要部分、托管协议涉及上述内容的一并修改；

二、重要提示

1、为不影响原有基金份额持有人的利益，本次修订后的《基金合同》将自2018年3月31日起正式实施。同时，本基金将于2018年3月31日起，对持续持有基金份额少于7日的投资者收取1.5%的赎回费并全额计入基金财产。

2、本公司于本公告日在网站上同时公布经修改后的本基金基金合同及托管

协议；招募说明书及摘要将随后在定期更新时进行相应修改。

3、投资者可拨打本公司客户服务电话（4007-007-818）或登陆本公司网站（www.westleadfund.com）咨询相关事宜。

风险提示：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。投资人投资于本基金时应认真阅读本基金的基金合同、招募说明书等文件。敬请投资人留意投资风险。

特此公告。

西部利得基金管理有限公司
2018年3月26日