

本文件乃重要文件，需要閣下即時垂注。若閣下對本文件之內容有任何疑問，應諮詢閣下的銀行經理、法律顧問、會計師或其他獨立財務顧問。上投摩根基金管理有限公司就本文件於刊發日期所載資料的準確性承擔全部責任，並在作出一切合理查詢後確認，盡其所知及所信，概無遺漏任何其他事實，足以令該等文件的任何聲明產生誤導。

上投摩根基金管理有限公司

關於修改上投摩根雙息平衡混合型證券投資基金基金合同的公告

根據《中華人民共和國證券投資基金法》、《公開募集證券投資基金運作管理辦法》等法律法規的規定以及上投摩根雙息平衡混合型證券投資基金(以下簡稱「本基金」)的基金合同的有關約定，經與本基金的基金託管人協商一致，上投摩根基金管理有限公司(以下簡稱「本公司」)決定按照中國證監會於2018年6月6日頒布並實施的《存託憑證發行與交易管理辦法(試行)》以及中國證監會於2020年7月10日頒布、同年8月1日實施的《公開募集證券投資基金側袋機制指引(試行)》和本基金的基金合同的有關規定，就本基金參與中國存託憑證投資、引入側袋機制事宜修改基金合同，並相應修改託管協議的相關內容，現將相關修改事項公告如下：

一、本次修改的基本情況

1、根據中國證監會2018年6月6日頒布並自公布之日起施行的《存託憑證發行與交易管理辦法(試行)》的規定，就本基金參與存中國託憑證投資相關事宜對基金合同等法律文件進行了修訂，主要包括明確投資範圍包含中國存託憑證、增加中國存託憑證的投資策略、投資比例限制、估值方法等。

2、根據中國證監會2020年7月10日頒布並自2020年8月1日起施行的

《公開募集證券投資基金側袋機制指引（試行）》的規定，就引入側袋機制的事宜對基金合同等法律文件進行了修訂，主要包括增加側袋機制實施的條件、側袋機制實施期間的基金申購與贖回、投資、估值、費用、收益分配、信息披露及持有人大會安排等。

二、本次修訂的主要內容

（一）針對基金參與中國存託憑證投資的修訂

針對基金參與中國存託憑證投資的修訂具體涉及基金合同中的前言、基金的投資、基金資產的估值等章節的內容，具體為：

1、在基金合同的「一、前言」部分增加投資中國存託憑證的風險揭示如下：

「本基金的投資範圍包括存託憑證，除與其他僅投資於滬深市場股票的基金所面臨的共同風險外，本基金還將面臨中國存託憑證價格大幅波動甚至出現較大虧損的風險，以及與中國存託憑證發行機制相關的風險。」

2、對基金合同的「十二、基金的投資」部分的修訂

（1）明確「（二）投資範圍」中包含中國存託憑證，將「（二）投資範圍」修訂為：

「本基金的投資範圍為具有良好流動性的金融工具，包括國內依法發行上市的股票、存託憑證、債券及法律、法規或中國證監會允許基金投資的其他金融工具。」

（2）在「（四）投資策略」中增加中國存託憑證投資策略描述如下：

「4、存託憑證投資策略

本基金將根據本基金的投資目標和股票投資策略，基於對基礎證券投資價值的深入研究判斷，進行存託憑證的投資。」

(3) 在「(七) 投資限制」中增加中國存託憑證投資限制描述如下：

「(13) 本基金投資存託憑證的比例限制依照境內上市交易的股票執行，並與境內上市交易的股票合併計算，法律法規或監管機構另有規定的從其規定。」

3、對基金合同「十四、基金資產的估值」部分的修訂

(1) 在「(二) 估值方法」中增加中國存託憑證估值方法描述如下：

「2. 本基金投資存託憑證的估值核算，依照境內上市的股票執行。」

(2) 在「(三) 估值對象」中增加中國存託憑證作為估值對象的描述如下：

「基金所擁有的股票、中國存託憑證、債券和銀行存款本息、應收款項、其他投資等資產。」

4、本基金將在更新的招募說明書中揭示投資中國存託憑證的風險。

5、託管協議涉及上述內容的條款已一併調整。

(二) 針對基金引入側袋機制的修訂

針對基金引入側袋機制的修訂具體涉及基金合同中的前言、釋義、基金單位的申購與贖回、基金合同當事人及權利義務、基金單位持有人大會、基金的投資、基金資產的估值、基金的費用與稅收、基金的收益與分配、基金的信息披露等章節的內容，具體為：

1、在基金合同中的「一、前言」部分中增加對基金管理人啟用側袋機制的說明，「前言」部分增加描述如下：

「當本基金持有特定資產且存在或潛在大額贖回申請時，基金管理人履行相應程序後，可以啟用側袋機制，具體詳見基金合同和招募說明書的有關章節。側袋機制實施期間，基金管理人將對基金簡稱進行特殊標識，並不辦理側袋賬戶的

申購贖回。請基金單位持有人仔細閱讀相關內容並關注本基金啟用側袋機制時的特定風險。」

2、在基金合同的「二、釋義」部分增加「側袋機制」和「特定資產」的釋義如下：

「59、側袋機制：指將基金投資組合中的特定資產從原有賬戶分離至一個專門賬戶進行處置清算，目的在於有效隔離並化解風險，確保投資者得到公平對待，屬於流動性風險管理工具。側袋機制實施期間，原有賬戶稱為主袋賬戶，專門賬戶稱為側袋賬戶」

「60、特定資產：包括：(1)無可參考的活躍市場價格且採用估值技術仍導致公允價值存在重大不確定性的資產；(2)按攤銷成本計量且計提資產減值準備仍導致資產價值存在重大不確定性的資產；(3)其他資產價值存在重大不確定性的資產」

3、對基金合同的「六、基金單位的申購與贖回」部分的修訂

(1)在「(六)拒絕或暫停申購的情形」處修訂如下：

「7、當特定資產佔前一估值日基金資產淨值 50%以上的，經與基金託管人協商確認後，基金管理人應當暫停接受基金申購申請」

(2)在「(七)暫停贖回或延緩支付贖回款項的情形」處修訂如下：

「5、當特定資產佔前一估值日基金資產淨值 50%以上的，經與基金託管人協商確認後，基金管理人應當採取延緩支付贖回款項或暫停接受基金贖回申請的措施。」

(3)增加對「(十四)實施側袋機制期間本基金的申購與贖回」的描述如下：

「(十四)實施側袋機制期間本基金的申購與贖回

本基金實施側袋機制的，本基金的申購和贖回安排詳見招募說明書或相關公告。」

4、對基金合同的「七、基金合同當事人及權利義務」部分「基金單位持有人」持有基金單位權益的修訂如下：

「除法律法規另有規定或本基金合同另有約定外，同一股份類別每份基金單位具有同等的合法權益。」

5、對基金合同的「八、基金單位持有人大會」部分的修訂

(1) 對基金單位持有人所持每一基金單位的表決權修訂如下：

「除法律法規另有規定或本基金合同另有約定外，基金單位持有人所持每一基金單位享有平等的表決權。」

(2) 增加實施側袋機制期間基金單位持有人大會的特殊約定描述如下：

「(十) 實施側袋機制期間基金單位持有人大會的特殊約定

若本基金實施側袋機制，則相關基金單位或表決權的比例指主袋單位持有人和側袋單位持有人分別持有或代表的基金單位或表決權符合該等比例，但若相關基金單位持有人大會召集和審議事項不涉及側袋賬戶的，則僅指主袋單位持有人持有或代表的基金單位或表決權符合該等比例：

1、基金單位持有人行使提議權、召集權、提名權所需單獨或合計代表相關基金單位 10%以上 (含 10%)；

2、現場開會的到會者在權益登記日代表的基金單位不少於本基金在權益登記日相關基金單位的二分之一 (含二分之一)；

3、通訊開會的直接出具表決意見或授權他人代表出具表決意見的基金單位持有人所持有的基金單位不少於在權益登記日相關基金單位的二分之一 (含二分

之一)；

4、當參與基金單位持有人大會投票的基金單位持有人所持有的基金單位小於在權益登記日相關基金單位的二分之一，召集人在原公告的基金單位持有人大會召開時間的3個月以後、6個月以內就原定審議事項重新召集的基金單位持有人大會應當有代表三分之一以上(含三分之一)相關基金單位的持有人參與或授權他人參與基金單位持有人大會投票；

5、現場開會由出席大會的基金單位持有人和代理人所持表決權的50%以上(含50%)選舉產生一名基金單位持有人作為該次基金單位持有人大會的主持人；

6、一般決議須經參加大會的基金單位持有人或其代理人所持表決權的二分之一以上(含二分之一)通過；

7、特別決議應當經參加大會的基金單位持有人或其代理人所持表決權的三分之二以上(含三分之二)通過。

側袋機制實施期間，基金單位持有人大會審議事項涉及主袋賬戶和側袋賬戶的，應分別由主袋賬戶、側袋賬戶的基金單位持有人進行表決，同一主側袋賬戶內的同一類別每份基金單位具有平等的表決權。表決事項未涉及側袋賬戶的，側袋賬戶份額無表決權。

側袋機制實施期間，關於基金單位持有人大會的相關規定以本節特殊約定內容為準，本節沒有規定的適用上文相關約定。」

6、在基金合同的「十二、基金的投資」部分增加側袋機制的實施和投資運作安排描述如下：

「(九)側袋機制的實施和投資運作安排

當基金持有特定資產且存在或潛在大額贖回申請時，根據最大限度保護基金單位持有人利益的原則，基金管理人經與基金託管人協商一致，並諮詢會計師事務所意見後，可以依照法律法規及基金合同的約定啟用側袋機制，無需召開基金單位持有人大會審議。

側袋機制實施期間，本部分約定的投資組合比例、投資策略、組合限制、業績比較基準、風險收益特徵等約定僅適用於主袋賬戶。

側袋賬戶的實施條件、實施程序、運作安排、投資安排、特定資產的處置變現和支付等對投資者權益有重大影響的事項詳見招募說明書的規定。

基金託管人依照相關法律法規的規定和基金合同的約定，對側袋機制啟用、特定資產處置和資訊披露等方面進行覆核和監督。」

7、對基金合同的「十四、基金資產估值」部分的修訂

(1) 對「(六) 暫停估值的情形」部分修訂如下：

「3、當特定資產佔前一估值日基金資產淨值 50%以上的，經與基金託管人協商確認後，基金管理人應當暫停基金估值。」

(2) 增加實施側袋機制期間的基金資產估值描述如下：

「(八) 實施側袋機制期間的基金資產估值

本基金實施側袋機制的，應根據本部分的約定對主袋賬戶資產進行估值並披露主袋賬戶的基金淨值信息，暫停披露側袋賬戶基金單位淨值。」

8、在基金合同的「十五、基金的費用與稅收」部分增加實施側袋機制期間的基金費用描述如下：

「(六) 實施側袋機制期間的基金費用

本基金實施側袋機制的，與側袋賬戶有關的費用可以從側袋賬戶中列支，但

應待側袋賬戶資產變現後方可列支，有關費用可酌情收取或減免，但不得收取管理費，詳見招募說明書的規定。」

9、在基金合同的「十六、基金的收益與分配」部分增加實施側袋機制期間的收益分配描述如下：

「(六) 實施側袋機制期間的收益分配

本基金實施側袋機制的，側袋賬戶不進行收益分配，詳見招募說明書的規定。」

10、在基金合同的「十八、基金的信息披露」部分增加實施側袋機制期間的信息披露描述如下：

「(十三) 實施側袋機制期間的信息披露

本基金實施側袋機制的，相關信息披露義務人應當根據法律法規、基金合同和招募說明書的規定進行信息披露，詳見招募說明書的規定。」

11、本基金將在更新的招募說明書中補充「側袋機制」章節並揭示啟用側袋機制的風險。

12、託管協議涉及上述內容的條款已一併調整。

三、重要提示

對於本次基金合同修改的內容，託管協議及招募說明書對應內容亦隨之相應修改。具體修改內容請見登載於本公司網站（www.cifm.com）和中國證監會基金電子披露網站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）的更新後的基金合同、託管協議及招募說明書。

本次依據《存託憑證發行與交易管理辦法（試行）》、《公開募集證券投資基金側袋機制指引（試行）》對本基金的基金合同所作的修訂，對基金單位持有人

利益無實質不利影響，且係因相應的法律法規發生變動而對基金合同進行修訂，根據本基金基金合同的約定，本次修訂不需要召開基金單位持有人大會。

本次修訂自 2021 年 4 月 21 日起生效。

投資者可撥打客戶服務電話（400-889-4888）或登錄本公司網站（www.cifm.com）諮詢相關信息。

風險提示：

本基金管理人承諾以誠實守信、勤勉盡責的原則管理和運用基金財產，但不保證基金一定盈利，亦不保證最低收益。基金的過往業績並不代表其將來表現，基金管理人所管理的其他基金的業績並不構成對基金業績表現的保證。投資有風險，敬請投資者認真閱讀基金的相關法律文件，並選擇適合自身風險承受能力的投資品種進行投資。

特此公告。

上投摩根基金管理有限公司

2021 年 4 月 21 日

如閣下對本文件的內容有任何疑問，請聯絡摩根基金（亞洲）有限公司：

- 閣下的銀行或財務顧問；
- 本公司的代理客戶服務熱線（852）2265 1000；
- 本公司的分銷商服務熱線（852）2978 7788；或
- 如閣下通常直接與我們聯絡，請致電摩根基金理財專線（852）2265 1188。