

# 关于富国新机遇灵活配置混合型发起式证券投资基金投资范围增加 新三板精选层股票、增加侧袋机制并相应修订基金合同及托管协议的 公告

为更好地满足广大投资者的理财需求，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金投资全国中小企业股份转让系统挂牌股票指引》、《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》等法律法规，以及《富国新机遇灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）的约定，富国基金管理有限公司（以下简称“本公司”或“基金管理人”）作为富国新机遇灵活配置混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金管理人，经与基金托管人中国工商银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）协商一致，决定本基金投资范围增加新三板精选层股票、增加侧袋机制的相关约定，并相应修订本基金的基金合同及托管协议。现将具体事宜公告如下：

## 一、基金合同及招募说明书的修订

本次修订内容包括明确投资范围包含新三板精选层股票以及增加侧袋机制的相关约定，具体包括增加新三板精选层股票的投资策略、投资比例限制、估值方法、信息披露等约定，以及侧袋机制实施条件、实施程序和特定资产范围、侧袋账户运作安排、主袋账户的投资安排、基金份额持有人大会表决权等安排，并将在基金招募说明书（更新）、产品资料概要中增加投资新三板精选层股票及启动侧袋机制的风险揭示。本次修订对基金份额持有人利益无实质性不利影响，基金合同的具体修订内容详见附件。

## 二、新三板精选层股票投资风险揭示

本基金投资全国中小企业股份转让系统（以下简称“全国股转系统”）精选层挂牌股票，由于全国股转系统的挂牌条件、转让规则等制度与上海、深圳证券交易所存在较大差别，基金投资全国股转系统精选层挂牌股票将面临特有风险，具体包括但不限于：

1、公司经营风险：挂牌公司具有规模较小，对单一技术依赖度较高，受技术更新换代影响较大；对核心技术人员依赖度较高；客户集中度高，议价能力不

强等特点。部分公司抗市场风险和行业风险的能力较弱，业务收入可能波动较大；

2、流动性风险：与上市公司相比，挂牌公司股权相对集中，市场整体流动性低于沪深证券交易所；

3、降层风险：全国股转系统实施挂牌公司分层管理，符合不同条件的挂牌公司分别纳入不同市场层级管理。精选层挂牌公司可能因财务条件、股本情况、股票交易市值等不符合规定而被全国股转公司定期或即时调出精选层。基金投资股票被调出精选层的，可能不能及时将该股票调出投资组合；

4、终止挂牌风险：挂牌公司可能因其股票在证券交易所上市而终止挂牌，也可能因信息披露违规、主办券商解除督导协议、公司清算等情形而终止挂牌，相较于沪深交易所退市规则，全国股转系统的终止挂牌时间更短；

5、波动风险：全国股转系统精选层实施盘中连续竞价与开收盘集合竞价的交易方式，对连续竞价股票实行价格涨跌幅限制，涨跌幅限制比例为30%；但挂牌股票采取连续竞价交易方式的成交首日，以及股票恢复交易期间的成交首日，不设置价格涨跌幅限制。相较于沪深交易所上市股票，精选层挂牌股票可能面临更高的波动风险。

本基金可根据投资策略需要，选择将部分基金资产投资于新三板精选层股票或选择不将基金资产投资于新三板精选层股票，基金资产并非必然投资新三板精选层股票。

### **三、实施侧袋机制对投资者的影响**

侧袋机制是一种流动性风险管理工具，是将特定资产分离至专门的侧袋账户进行处置清算，并以处置变现后的款项向基金份额持有人进行支付，目的在于有效隔离并化解风险。但基金启用侧袋机制后，侧袋账户份额将停止披露基金份额净值，并不得办理申购、赎回和转换，仅主袋账户份额正常开放赎回，因此启用侧袋机制时持有基金份额的持有人将在启用侧袋机制后同时持有主袋账户份额和侧袋账户份额，侧袋账户份额不能赎回，其对应特定资产的变现时间具有不确定性，最终变现价格也具有不确定性并且有可能大幅低于启用侧袋机制时的特定资产的估值，基金份额持有人可能因此面临损失。

实施侧袋机制期间，因本基金不披露侧袋账户份额的净值，即便基金管理人在基金定期报告中披露报告期末特定资产可变现净值或净值区间的，也不作为特

定资产最终变现价格的承诺，因此对于特定资产的公允价值和最终变现价格，基金管理人不承担任何保证和承诺的责任。

基金管理人将根据主袋账户运作情况合理确定申购政策，因此实施侧袋机制后主袋账户份额存在暂停申购的可能。

启用侧袋机制后，基金管理人计算各项投资运作指标和基金业绩指标时仅需考虑主袋账户资产，并根据相关规定对分割侧袋账户资产导致的基金净资产减少进行按投资损失处理，因此本基金披露的业绩指标不能反映特定资产的真实价值及变化情况。

**重要提示：**

1、本基金基金合同的修订已经履行了规定的程序，符合相关法律法规及基金合同的规定，无需召开基金份额持有人大会。

2、本公司于本公告日在网站上同时公布经修订后的基金合同、托管协议；招募说明书、产品资料概要涉及前述内容的，将一并修订，并依照《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定在规定媒介上公告。

3、投资者可以登陆富国基金管理有限公司网站（[www.fullgoal.com.cn](http://www.fullgoal.com.cn)）或拨打富国基金管理有限公司客户服务热线95105686、4008880688（全国统一，均免长途费）进行相关咨询。

**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。敬请投资人注意投资风险。投资者投资于基金前应认真阅读基金的基金合同和招募说明书等法律文件，确认已知悉基金产品资料概要，全面认识基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，在了解产品情况及销售机构适当性匹配意见的基础上，理性判断市场，谨慎做出投资决策。基金具体风险评级结果以销售机构提供的评级结果为准。

特此公告。

富国基金管理有限公司

2020年12月19日

附件1：《富国新机遇灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》修订前后文对照表

章节	修订前	修订后
<p><b>第一部分 前言</b></p> <p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</p>	<p>八、本基金合同关于基金产品资料概要的编制、披露及更新等内容，将不晚于 2020 年 9 月 1 日起执行。</p>	<p>八、本基金的投资范围包括全国中小企业股份转让系统（以下简称“新三板”）精选层股票，由于新三板的挂牌条件、转让规则等制度与上海、深圳证券交易所存在较大差别，基金投资新三板精选层股票将面临特有风险，包括流动性风险、挂牌公司经营风险、挂牌公司降层风险、挂牌公司终止挂牌风险、精选层市场波动风险等，具体风险请查阅本基金招募说明书的“风险揭示”章节的具体内容。本基金可根据投资策略需要，选择将部分基金资产投资于新三板精选层股票或选择不将基金资产投资于新三板精选层股票，基金资产并非必然投资新三板精选层股票。</p>
<p><b>第二部分 释义</b></p>		<p>60、新三板精选层股票：指在全国中小企业股份转让系统精选层挂牌并公开转让的股票</p> <p>61、侧袋机制：指将基金投资组合中的特定资产从原有账户分离至一个专门账户进行处置清算，目的在于有效隔离并化解风险，确保投资者得到公平对待，属于流动性风险管</p>

章节	修订前	修订后
		<p>理工具。侧袋机制实施期间，原有账户称为主袋账户，专门账户称为侧袋账户</p> <p>62、特定资产：包括：（1）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的资产；（2）按摊余成本计量且计提资产减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产；（3）其他资产价值存在重大不确定性的资产</p>
<p><b>第六部分 基金份额的申购与赎回</b></p>		<p>十七、实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回</p> <p>本基金实施侧袋机制的，本基金的申购与赎回安排详见招募说明书或相关公告。</p>
<p><b>第八部分 基金份额持有人大会</b></p>		<p>九、实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定</p> <p>若本基金实施侧袋机制，则相关基金份额或表决权的比例指主袋份额持有人和侧袋份额持有人分别持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例，但若相关基金份额持有人大会召集和审议事项不涉及侧袋账户的，则仅指主袋份额持有人持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例：</p>

章节	修订前	修订后
		<p>1、基金份额持有人行使提议权、召集权、提名权所需单独或合计代表相关基金份额 10%以上（含 10%）；</p> <p>2、现场开会的到会者在权益登记日代表的基金份额不少于本基金在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；</p> <p>3、通讯开会的直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；</p> <p>4、在参与基金份额持有人大会投票的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日相关基金份额的二分之一、召集人在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内就原定审议事项重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）相关基金份额的持有人参与或授权他人参与基金份额持有人大会投票；</p> <p>5、现场开会由出席大会的基金份额持有人和代理人所</p>

章节	修订前	修订后
		<p>持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人；</p> <p>6、一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过；</p> <p>7、特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过。</p> <p>同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。</p>
<p><b>第十二部分 基金的投资</b></p>	<p>二、投资范围</p> <p>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板以及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、可交换债券、中小企业私募债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、权证以及经中国证监会批准允许</p>	<p>二、投资范围</p> <p>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板以及其他经中国证监会核准上市的股票）、<b>新三板精选层股票</b>、存托凭证、债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、可交换债券、中小企业私募债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、权证以</p>

章节	修订前	修订后
	<p>基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。</p> <p>基金的投资组合比例为：股票及存托凭证投资占基金资产的比例为 0%-95%，权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%，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、应收申购款等。</p> <p>三、投资策略</p>	<p>及经中国证监会批准允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。</p> <p><b>本基金所投资新三板精选层挂牌公司被调出精选层的，自调出之日起，基金管理人不得新增投资该股票，并应当逐步将该股票调出投资组合；基金所投资精选层挂牌公司因转板上市被调出精选层的除外。</b></p> <p>基金的投资组合比例为：股票（含新三板精选层股票）及存托凭证投资占基金资产的比例为 0%-95%，权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%，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、应收申购款等。</p> <p>三、投资策略</p> <p><b>3、新三板精选层股票投资策略</b></p> <p><b>本基金将精选优质的新三板精选层挂牌公司纳入本基</b></p>



章节	修订前	修订后
	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>（1）本基金股票及存托凭证投资占基金资产的比例为0%-95%；</p> <p>除第（2）、（12）、（18）、（19）条外，因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。</p>	<p><b>金的股票投资组合。此外，本基金还将关注新三板精选层挂牌公司股票的交易活跃度和公司的股权分散度。</b></p> <p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>（1）本基金股票（<b>含新三板精选层股票</b>）及存托凭证投资占基金资产的比例为0%-95%；</p> <p>.....</p> <p><b>（21）本基金投资于新三板精选层股票的市值合计不得超过本基金资产净值的5%；</b></p> <p>除第（2）、（12）、（18）、（19）、<b>（21）</b>条外，因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。</p> <p><b>因证券市场波动、挂牌公司或上市公司合并、基金规模</b></p>

章节	修订前	修订后
	<p>六、风险收益特征</p> <p>本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金，属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。</p>	<p><b>变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述第（21）项规定投资比例的，基金管理人应当在 20 个交易日内进行调整。</b></p> <p>六、风险收益特征</p> <p>本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金，属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。<b>本基金投资全国中小企业股份转让系统挂牌股票，会面临参与挂牌公司股票交易产生的公司风险、流动性风险、信息风险等特有风险。</b></p> <p>八、侧袋机制的实施和投资运作安排</p> <p>当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制。</p> <p>侧袋机制实施期间，本部分约定的投资组合比例、投资</p>

章节	修订前	修订后
		<p>策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。</p> <p>侧袋账户的实施条件、实施程序、运作安排、投资安排、特定资产的处置变现和支付等对投资者权益有重大影响的事项详见招募说明书的规定。</p>
<p><b>第十四部分 基金资产估值</b></p>	<p>三、估值方法</p> <p>1、证券交易所上市的非固定收益品种的估值</p> <p>交易所上市的非固定收益品种（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。</p> <p>2、交易所上市的固定收益品种的估值</p>	<p>三、估值方法</p> <p>1、证券交易所上市或全国中小企业股份转让系统挂牌的有价证券的估值</p> <p>（1）除本部分另有约定的品种外，交易所上市的有价证券（包括股票等）或全国中小企业股份转让系统挂牌的股票，以其估值日在证券交易所或全国中小企业股份转让系统挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的</p>

章节	修订前	修订后
	<p>(1) 对在交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（另有规定的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。</p> <p>(2) 对在交易所上市交易的可转换债券，按估值日收盘价减去可转换债券收盘价中所含债券应收利息后得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日收盘价减去可转换债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。</p> <p>(3) 对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债券（含中小企业私募债券），采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。</p> <p>3、银行间市场交易的固定收益品种，选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。</p>	<p>现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值；</p> <p>(2) 交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；</p> <p>(3) 交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值；</p> <p>(4) 交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价；</p> <p>(5) 交易所上市或全国中小企业股份转让系统挂牌不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所市场挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值。</p> <p>2、处于未上市或未挂牌期间的有价证券应区分如下情况处理：</p>

章节	修订前	修订后
	<p>4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。</p> <p>5、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>（1）送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值。</p> <p>（2）首次公开发行未上市的股票、权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。</p> <p>（3）首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p> <p>（4）对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。</p>	<p>（1）送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所（或全国中小企业股份转让系统）挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；</p> <p>（2）首次公开发行未上市、未挂牌的股票、债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；</p> <p>（3）在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值；</p> <p>（4）对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认估值日的</p>

章节	修订前	修订后
	<p>(5) 对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，按成本估值。</p>	<p>公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，应采用估值技术确定其公允价值。</p> <p>3、对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。</p> <p>4、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。</p> <p>5、本基金投资同业存单，按估值日第三方估值机构提供的价格数据估值；选定的第三方估值机构未提供估值价格</p>

章节	修订前	修订后
	<p>六、暂停估值的情形</p> <p>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；</p> <p>八、特殊情形的处理</p> <p>1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 7 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理；</p>	<p>的，按成本估值。</p> <p>6、本基金所投资的新三板精选层股票价值存在重大不确定性且面临潜在大额赎回申请时，基金管理人可基于保护基金份额持有人利益的原则，履行相应程序后启用侧袋机制。</p> <p>六、暂停估值的情形</p> <p>3、当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，经与基金托管人协商一致，基金管理人应当暂停基金估值；</p> <p>八、特殊情形的处理</p> <p>1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 8 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理；</p> <p>九、实施侧袋机制期间的基金资产估值</p> <p>本基金实施侧袋机制的，应根据本部分的约定对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的基金净值信息，暂停披露</p>

章节	修订前	修订后
		侧袋账户份额净值。
第十五部分 基金费用与税收		<p>五、实施侧袋机制期间的基金费用</p> <p>本基金实施侧袋机制的，与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费，详见招募说明书的规定。</p>
第十六部分 基金的收益与分配		<p>七、实施侧袋机制期间的收益分配</p> <p>本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配，详见招募说明书的规定。</p>
第十八部分 基金的信息披露		<p>（十一）实施侧袋机制期间的信息披露</p> <p>本基金实施侧袋机制的，相关信息披露义务人应当根据法律法规、基金合同和招募说明书的规定进行信息披露，详见招募说明书的规定。</p> <p>（十五）投资于新三板精选层股票的信息披露</p> <p>基金管理人应在季度报告、中期报告、年度报告中披露其持有的挂牌股票总额、挂牌股票市值占基金资产净值比</p>



章节	修订前	修订后
		例、报告期内持有的挂牌股票明细。
第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算		<p>八、实施侧袋机制期间的基金清算</p> <p>本基金实施侧袋机制的，若《基金合同》终止，主袋账户资产的清算适用本部分的约定，侧袋账户特定资产的处置变现和支付详见招募说明书的规定。</p>