

## 泰达荷银基金管理有限公司 关于修改《泰达荷银价值优化型 系列行业类别证券投资基金基金 合同》、《泰达荷银风险预算混合型 证券投资基金基金合同》及托管 协议的公告

根据中国证监会发布的《关于基金管理公司及证券投资基金执行<企业会计准则>的通知》和中国证券业协会正式发布的《基金核算业务指引》的要求,泰达荷银基金管理有限公司作为泰达荷银价值优化型系列行业类别证券投资基金(以下简称“合丰系列基金”),其三只基金分别为:泰达荷银成长类行业证券投资基金(合丰成长)、泰达荷银周期类行业证券投资基金(合丰周期)、泰达荷银稳定类行业证券投资基金(合丰稳健),该三只基金的基金管理人以“泰达荷银基金管理有限公司”名义对上述各只基金的基金托管人交通银行股份有限公司协商一致,泰达荷银风险预算混合型证券投资基金(以下简称“基金合同”)之下的相关条款进行了修改,修改内容为定期报告及基金资产的估值。该基金合同的修改已报中国证监会备案。

上述各只基金的托管协议进行了相应修改,修改后的基金合同和托管协议全文,请详见公司网站 [www.wateeda.com](http://www.wateeda.com)。

一、《泰达荷银价值优化型系列行业类别证券投资基金基金合同》的修改说明:

《基金合同》的主要修改内容如下:将荷银旗下基金的《基金合同》第十四节“基金资产的估值”的内容以及第二十五节“基金合同摘要”的第(八)项“基金资产净值的计算与公告”修改为:

(一)估值目的

本基金的估值目的是客观、准确地反映基金财产的价值,并为基金份额的申购与赎回提供计价依据。

(二)估值日

本基金的估值日为基金合同生效后相关的证券交易场所的正常营业日以及国家法律法规规定需要对基金资产净值进行非营业日。

本基金所持有的股票、债券、权证和银行存款本息、应收款项和其他投资资产。

(四)估值方法

(1)股票估值方法

1)上市流通股票按估值日其所处证券交易所的收盘价估值;估值日无交易的,以最近交易日的收盘价估值;

2)送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票,按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值。

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,按估值日其所在证券交易所上市的第一股票的以第1条确定的估值价格进行估值;

4)送股、转增股、配股和公开增发新股等发行的股票,按估值日该上市公司在证券交易所挂牌的同一股票的第1条确定的估值价格进行估值;

5)国家有最新规定的,按其规定进行估值。

(2)债券估值方法

1)在证券交易场所挂牌交易的实行净价交易的债券按估值日收盘价估值,估值日无交易的,但最近交易日经济环境未发生重大变化的,以最近交易日的收盘价估值;估值日无交易,且最近交易日后经济环境发生了重大变化的,将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易日收盘价,确定公允价值进行估值。如无充分证据表明最近交易日收盘价不能真实地反映公允价值的,应对最近交易日的收盘价进行调整,确定公允价值进行估值。

2)未上市债券的估价:

①首次发行的股票,采用估值技术确定公允价值进行估值,在估值技术难以可靠计量的情况下,应采用在证券交易所上市交易的同一股票的以第1条确定的估值价格低于非公开发行股票的初始取得成本,即按非公开发售股票的市价扣除公开发售时的费用,C为该非公开发行股票的初始取得成本(因该业务导致上市股票价格除权时,股票市价为B,D为该非公开发行股票锁定期的股票的市价,即为该非公开发行股票的市价)。D为估值日剩余锁定期,即估值日至锁定日期所含的交易天数,不含估值日当天);

②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,按估值日其所在证券交易所上市的第一股票的以第1条确定的估值价格进行估值;

③送股、转增股、配股和公开增发新股等发行的股票,按估值日该上市公司在证券交易所挂牌的同一股票的第1条确定的估值价格进行估值;

④非公开发行并明确锁定期的股票,按估值日进行估值;

A.估值日在证券交易所上市交易的同一股票的以第1条确定的估值价格低于非公开发行股票的初始取得成本,应采用在证券交易所上市交易的同一股票的以第1条确定的估值价格;

B.估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价,即为该非公开发行股票的市价;

C=F+C-(P-C)/(D1-D)/PV(其中D1为估值日之前非公开发售股票的市价,C为该非公开发行股票的初始取得成本(因该业务导致上市股票价格除权时,股票市价为B,D为该非公开发行股票锁定期的股票的市价,即为该非公开发行股票的市价)。D为估值日剩余锁定期,即估值日至锁定日期所含的交易天数,不含估值日当天);

D.估值日为最近交易日的收盘价,即为该非公开发行股票的市价;

⑤国家有最新规定的,按其规定进行估值。

(3)货币市场基金的估值方法

1)在证券交易所挂牌交易的实行净价交易的债券按估值日收盘价估值,估值日无交易的,但最近交易日经济环境未发生重大变化的,以最近交易日的收盘价估值;估值日无交易,且最近交易日后经济环境发生了重大变化的,将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易日收盘价,确定公允价值进行估值。如无充分证据表明最近交易日收盘价不能真实地反映公允价值的,应对最近交易日的收盘价进行调整,确定公允价值进行估值。

2)未上市债券的估价:

①首次发行的股票,采用估值技术确定公允价值进行估值,在估值技术难以可靠计量的情况下,应采用在证券交易所上市交易的同一股票的以第1条确定的估值价格高于非公开发行股票的初始取得成本,应采用在证券交易所上市交易的同一股票的以第1条确定的估值价格;

②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,按估值日其所在证券交易所上市的第一股票的以第1条确定的估值价格进行估值;

③送股、转增股、配股和公开增发新股等发行的股票,按估值日该上市公司在证券交易所挂牌的同一股票的第1条确定的估值价格进行估值;

④非公开发行并明确锁定期的股票,按估值日进行估值;

A.估值日在证券交易所上市交易的同一股票的以第1条确定的估值价格低于非公开发行股票的初始取得成本,应采用在证券交易所上市交易的同一股票的以第1条确定的估值价格;

B.估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价,即为该非公开发行股票的市价;

C=F+C-(P-C)/(D1-D)/PV(其中D1为估值日之前非公开发售股票的市价,C为该非公开发行股票的初始取得成本(因该业务导致上市股票价格除权时,股票市价为B,D为该非公开发行股票锁定期的股票的市价,即为该非公开发行股票的市价)。D为估值日剩余锁定期,即估值日至锁定日期所含的交易天数,不含估值日当天);

D.估值日为最近交易日的收盘价,即为该非公开发行股票的市价;

⑤国家有最新规定的,按其规定进行估值。

(4)债券估价方法

1)在证券交易所挂牌交易的实行净价交易的债券按估值日收盘价估值,估值日无交易的,但最近交易日经济环境未发生重大变化的,以最近交易日的收盘价估值;估值日无交易,且最近交易日后经济环境发生了重大变化的,将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易日收盘价,确定公允价值进行估值。如无充分证据表明最近交易日收盘价不能真实地反映公允价值的,应对最近交易日的收盘价进行调整,确定公允价值进行估值。

2)未上市债券的估价:

①首次发行的股票,采用估值技术确定公允价值进行估值,在估值技术难以可靠计量的情况下,应采用在证券交易所上市交易的同一股票的以第1条确定的估值价格高于非公开发行股票的初始取得成本,应采用在证券交易所上市交易的同一股票的以第1条确定的估值价格;

②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,按估值日其所在证券交易所上市的第一股票的以第1条确定的估值价格进行估值;

③送股、转增股、配股和公开增发新股等发行的股票,按估值日该上市公司在证券交易所挂牌的同一股票的第1条确定的估值价格进行估值;

④非公开发行并明确锁定期的股票,按估值日进行估值;

A.估值日在证券交易所上市交易的同一股票的以第1条确定的估值价格低于非公开发行股票的初始取得成本,应采用在证券交易所上市交易的同一股票的以第1条确定的估值价格;

B.估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价,即为该非公开发行股票的市价;

C=F+C-(P-C)/(D1-D)/PV(其中D1为估值日之前非公开发售股票的市价,C为该非公开发行股票的初始取得成本(因该业务导致上市股票价格除权时,股票市价为B,D为该非公开发行股票锁定期的股票的市价,即为该非公开发行股票的市价)。D为估值日剩余锁定期,即估值日至锁定日期所含的交易天数,不含估值日当天);

D.估值日为最近交易日的收盘价,即为该非公开发行股票的市价;

⑤国家有最新规定的,按其规定进行估值。

(5)货币市场基金的估值方法

1)股票估值方法

2)债券估值方法

3)货币市场基金的估值方法

4)基金资产净值的计算

5)基金资产净值的确认

6)基金资产净值的计算

7)基金资产净值的确认

8)基金资产净值的确认

9)基金资产净值的确认

10)基金资产净值的确认

11)基金资产净值的确认

12)基金资产净值的确认

13)基金资产净值的确认

14)基金资产净值的确认

15)基金资产净值的确认

16)基金资产净值的确认

17)基金资产净值的确认

18)基金资产净值的确认

19)基金资产净值的确认

20)基金资产净值的确认

21)基金资产净值的确认

22)基金资产净值的确认

23)基金资产净值的确认

24)基金资产净值的确认

25)基金资产净值的确认

26)基金资产净值的确认

27)基金资产净值的确认

28)基金资产净值的确认

29)基金资产净值的确认

30)基金资产净值的确认

31)基金资产净值的确认

32)基金资产净值的确认

33)基金资产净值的确认

34)基金资产净值的确认

35)基金资产净值的确认

36)基金资产净值的确认

37)基金资产净值的确认

38)基金资产净值的确认

39)基金资产净值的确认

40)基金资产净值的确认

41)基金资产净值的确认

42)基金资产净值的确认

43)基金资产净值的确认

44)基金资产净值的确认

45)基金资产净值的确认

46)基金资产净值的确认

47)基金资产净值的确认

48)基金资产净值的确认

49)基金资产净值的确认

50)基金资产净值的确认

51)基金资产净值的确认

52)基金资产净值的确认

53)基金资产净值的确认

54)基金资产净值的确认

55)基金资产净值的确认

56)基金资产净值的确认

57)基金资产净值的确认

58)基金资产净值的确认

59)基金资产净值的确认

60)基金资产净值的确认

61)基金资产净值的确认

62)基金资产净值的确认

63)基金资产净值的确认

64)基金资产净值的确认

65)基金资产净值的确认

66)基金资产净值的确认

67)基金资产净值的确认

68)基金资产净值的确认

69)基金资产净值的确认

70)基金资产净值的确认

71)基金资产净值的确认

72)基金资产净值的确认

73)基金资产净值的确认

74)基金资产净值的确认

75)基金资产净值的确认

76)基金资产净值的确认

77)基金资产净值的确认

78)基金资产净值的确认

79)基金资产净值的确认

80)基金资产净值的确认

81)基金资产净值的确认

82)基金资产净值的确认

83)基金资产净值的确认

84)基金资产净值的确认

85)基金资产净值的确认

86)基金资产净值的确认