
新沃基金管理有限公司关于修订旗下基金基金合同、托管协议及招募说明书等法律文件的公告

根据中国证券监督管理委员会 2017 年 8 月 31 日发布并于同年 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》（以下简称“《规定》”），新沃基金管理有限公司（以下简称“本公司”）经与各基金托管人协商一致，修订本公司旗下新沃通宝货币市场基金、新沃通利纯债债券型证券投资基金及新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金的《基金合同》、《托管协议》、《招募说明书》等相关法律文件，修订后的法律文件自 2018 年 3 月 29 日起生效；前述按照《规定》修改《基金合同》系因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改，不需召开基金份额持有人大会。另外本公司经与各基金托管人协商一致，还对《基金合同》做了其他修改，该等修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响，不需召开基金份额持有人大会。相关法律文件的修订内容详见附件。

一、重要提示

1. 本公司旗下基金《基金合同》等法律文件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。

2. 投资者可以通过《上海证券报》及本公司网站查阅修订后的《基金合同》等法律文件，并可以通过以下途径咨询有关详情：

- 1) 本公司客户服务热线：400-698-9988；
- 2) 本公司网址：<http://www.sinvofund.com>。

二、风险提示：

本公司提醒广大投资者：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。投资人应当认真阅读《基金合同》、《托管协议》、《招募说明书》等基金法律文件，了解基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金风险类型是否和投资人的风险承受能力相适应。敬请投资者留意投资风险。

特此公告。

-
- 附件 1:《新沃通宝货币市场基金基金合同修改前后文对照表》
- 附件 2:《新沃通宝货币市场基金托管协议修改前后文对照表》
- 附件 3:《新沃通宝货币市场基金招募说明书更新修改前后文对照表》
- 附件 4:《新沃通利纯债债券型证券投资基金基金合同修改前后文对照表》
- 附件 5:《新沃通利纯债债券型证券投资基金托管协议修改前后文对照表》
- 附件 6:《新沃通利纯债债券型证券投资基金招募说明书更新修改前后文对照表》
- 附件 7:《新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同修改前后文对照表》
- 附件 8:《新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金托管协议修改前后文对照表》
- 附件 9:《新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新修改前后文对照表》

新沃基金管理有限公司

2018 年 3 月 22 日

附件 1 《新沃通宝货币市场基金基金合同修改前后文对照表》

章节	基金合同修改前版本	基金合同修改后版本	修改理由
封面	二零一六年十一月	二零一八年三月	
第一部分 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《中华人民共和国合同法》(以下简称“《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》”)、《货币市场基金监督管理办法》、《关于实施〈货币市场基金监督管理办法〉有关问题的规定》、《证券投资基金信息披露编报规则第 5 号〈货币市场基金信息披露特别规定〉》和其他有关法律法规。</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《中华人民共和国合同法》(以下简称“《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》”)、《货币市场基金监督管理办法》、《关于实施〈货币市场基金监督管理办法〉有关问题的规定》、《证券投资基金信息披露编报规则第 5 号〈货币市场基金信息披露特别规定〉》、<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>《流动性风险管理规定》</u>”)和其他有关法律法规。</p>	补充本基金适用的法律依据。
第二部分 释义	无	<u>13、《流动性风险管理规定》：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</u>	补充本基金适用的法律依据。
	无	<u>59、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</u>	根据《流动性风险管理规定》第 40 条，补充流动性受限资产定义。

		<u>款)、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；就本基金而言，指货币市场基金依法可投资的符合前述条件的资产，但中国证监会认可的特殊情形除外</u>	
第六部分 基金份额的 申购与赎回	五、 申购和赎回的数量限制 无	五、 申购和赎回的数量限制 <u>7、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>	根据《流动性风险规定》第 19 条的规定补充。
	六、 申购和赎回的价格、费用及其用途 2、发生本基金持有的现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计低于 5%且偏离度为负的情形时，基金管理人应当对当日单个基金份额持有人申请赎回基金份额超过基金总份额 1%以上的赎回申请征收 1%的强制赎回费用，并将上述赎回费用全额计入基金财产。基金管理人与基金托管人协商确认上述做法无益于基金利益最大化的情形除外。	六、 申购和赎回的价格、费用及其用途 2、 <u>本基金在一般情况下不收取申购费用和赎回费用，但是出现以下情形之一：</u> <u>(1) 发生本基金持有的现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计低于 5%且偏离度为负；</u> <u>(2) 本基金前 10 名基金份额持有人的持有份额合计超过基金总份额 50%，且本基金投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计低于 10%且偏离度为负；</u> <u>为确保基金平稳运作，避免诱发系统性风险，基金管理人应当对当日单个基金份额持有人申请赎回基金份额超过基金总份额 1%以上的赎回申请征收 1%的强制赎回费用，并将上述赎回费用全额计入基金财</u>	根据《流动性风险规定》第 31 条补充强制赎回费的规定。

		产。基金管理人与基金托管人协商确认上述做法无益于基金利益最大化的情形除外。	
七、拒绝或暂停申购的情形 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。	七、拒绝或暂停申购的情形 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。 <u>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，基金管理人应当暂停接受基金申购申请。</u>		根据《流动性风险规定》第 24 条补充应当暂停申购的情形。
4、基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。	4、基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益 <u>或对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时。</u>		根据《流动性风险规定》第 19 条补充应当暂停申购的情形。
无 …… 发生上述第 1、2、3、5、6、7、8、10 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。对于上述第 9 项拒绝申购的情形，基金管理人将于每一开放日在基金管理人网站上公布相关申购上限设定。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。	<u>10、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本基金基金份额的比例达到或者超过本基金总份额的 50%，或者变相规避前述 50%集中度的情形时。</u> …… 发生上述第 1、2、3、5、6、7、8、 11 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。对于上述第 9 项拒绝申购的情形，基金管理人将于每一开放日在基金管理人网站上公布相关申购上限设定。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。		根据《流动性风险规定》第 19 条补充应当暂停申购的情形。

<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。</p>	<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。<u>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，基金管理人应当暂停接受基金赎回申请。</u></p>	<p>根据《流动性风险规定》第 24 条的规定补充应当暂停赎回的情形。</p>
<p>九、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>(2) 部分延期赎回：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，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。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，以此类推，直到全部赎回为止。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。</p>	<p>九、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>(2) 部分延期赎回：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，可对其余赎回申请延期办理。<u>若进行上述延期办理，对于单个基金份额持有人当日赎回申请超过上一开放日基金总份额 10%以上的部分，将自动进行延期办理。对于其余当日非自动延期办理的赎回申请，应当按单个账户非自动延期办理的赎回申请量占非自动延期办理的赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；</u>对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先</p>	<p>根据《流动性风险规定》第 21 条第 2 款的规定修改。</p>

		权，以此类推，直到全部赎回为止。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。	
第七部分 基金合同当事人及权利义务	一、基金管理人 (一) 基金管理人简况 ... 电话: 010-58290600 联系人: 周虹	一、基金管理人 (一) 基金管理人简况 ... 电话: 010-58290600 联系人: 周恒	依管理人实际情况修改。
	二、基金托管人 (一) 基金托管人简况 ... 组织形式: 股份有限公司 ...	二、基金托管人 (一) 基金托管人简况 ... 组织形式: 其他 股份有限公司 (上市) ...	依托管人实际情况修改。
第十二部分 基金的投资	四、投资限制 (一) 本基金不得投资于以下金融工具: ... 法律法规或监管部门取消上述限制后, 本基金不受上述限制。	四、投资限制 (一) 本基金不得投资于以下金融工具: ... 本基金拟投资于主体信用评级低于 AA+ 的商业银行的银行存款与同业存单的, 应当经基金管理人董事会审议批准, 相关交易应当事先征得基金托管人的同意, 并作为重大事项履行信息披露程序。 法律法规或监管部门取消上述限制后, 本基金不受上述限制。	根据《流动性风险规定》第 33 条修改。
	(二) 投资组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制: (1) 本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天, 平均剩余存续期不得超过 240 天;	(二) 投资组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制: (1) 除基金合同另有约定外 , 本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天, 平均剩	明确条文表述。

<p>(9) 现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及五个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 10%；</p> <p>(10) 到期日在 10 个交易日以上的逆回购、银行定期存款等流动性受限资产投资占基金资产净值的比例合计不得超过 30%；</p> <p>(11) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；本基金应投资于信用级别评级为 AAA 以上(含 AAA)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；</p> <p>(12) 本基金的基金总资产不得超过基金资产净值的 140%；</p> <p>(13) 中国证监会规定的其他比例限制。</p> <p>除法律法规另有规定或上述另有约定外，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，</p>	<p>余存续期不得超过 240 天；</p> <p>(9) 现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及五个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 10%；</p> <p><u>(10) 本基金管理人管理的全部货币市场基金投资于同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券，不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的 10%；</u></p> <p><u>(11) 当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 50%时，本基金投资组合的平均剩余期限不得超过 60 天，平均剩余存续期不得超过 120 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 30%；</u></p> <p><u>(12) 当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 20%时，本基金投资组合的平均剩余期限不得超过 90 天，平均剩余存续期不得超过 180 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 20%；</u></p> <p><u>(13) 本基金投资于主体信用评级低于 AAA 的机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 10%，其中单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 2%；前述金融工具包括债券、非金融企业债务融资工具、银行存款、同业存单、相关机构作为原始权益人的资产支持证券及中国证</u></p>	<p>根据《流动性风险规定》第 35、34、30、33、32、17 条第二款增加投资限制并明确条文表述。</p>
--	---	--

	<p>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><u>监会认定的其他品种；</u></p> <p><u>(14)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 10%；因证券市场波动、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；</u></p> <p><u>(15)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本基金合同约定的投资范围保持一致；</u></p> <p><u>(16)本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；</u></p> <p><u>(17)本基金应投资于信用级别评级为 AAA 以上(含 AAA)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；</u></p> <p><u>(18)本基金的基金总资产不得超过基金资产净值的 140%；</u></p> <p><u>(19)中国证监会规定的其他比例限制。</u></p> <p>除上述第 (1)、(8)、(14)、(15)、(17) 项另有约定</p>	
--	--	--	--

		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。	
第十四部分基金资产估值	<p>六、暂停估值的情形</p> <p>...</p> <p>3、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，基金管理人为保障投资人的利益，决定延迟估值；</p> <p>4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。</p>	<p>六、暂停估值的情形</p> <p>...</p> <p>3、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，基金管理人为保障投资人的利益，决定延迟估值；</p> <p>4、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，基金管理人应当暂停基金估值；</p> <p>5、中国证监会和基金合同认定的其它情形。</p>	根据《流动性风险规定》第 24 条补充。
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>（五）基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告</p> <p>...</p> <p>基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。</p>	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>（五）基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告</p> <p>...</p> <p>基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。</p> <p>基金运作期间，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，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在基金定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该</p>	根据《流动性风险规定》第 26 条、第 27 条、第 36 条补充定期报告的内容。

		<p><u>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。</u></p> <p><u>本基金应在年度报告、半年度报告中至少披露报告期末基金前 10 名份额持有人的类别、持有份额及占总份额的比例等信息。</u></p> <p><u>本基金持续运作过程中，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。</u></p>	
<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>(六) 临时报告</p> <p>26、当“影子定价”确定的基金资产净值与“摊余成本法”计算的基金资产净值的负偏离度绝对值达到 0.25%或正负偏离度绝对值达到 0.5%的情形；当“影子定价”确定的基金资产净值与“摊余成本法”计算的基金资产净值连续 2 个交易日出现负偏离度绝对值超过 0.5%的情形；</p> <p>27、中国证监会规定的其他事项。</p>	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>(六) 临时报告</p> <p>26、当“影子定价”确定的基金资产净值与“摊余成本法”计算的基金资产净值的负偏离度绝对值达到 0.25%或正负偏离度绝对值达到 0.5%的情形；当“影子定价”确定的基金资产净值与“摊余成本法”计算的基金资产净值连续 2 个交易日出现负偏离度绝对值超过 0.5%的情形；</p> <p><u>27、在发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；</u></p> <p><u>28、本基金投资于主体信用评级低于 AA+的商业银行的银行存款与同业存单；</u></p> <p><u>29、</u>中国证监会规定的其他事项。</p>	<p>根据《流动性风险管理规定》第 26、33 条补充临时报告的内容。</p>	

附件 2 《新沃通宝货币市场基金托管协议修改前后文对照表》

章节	修改前版本	修改后版本	修改理由
一、 基金 托管 协议 当事 人	<p>(二) 基金托管人</p> <p>...</p> <p>组织形式：股份有限公司</p> <p>...</p> <p>经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现、发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事结汇、售汇业务；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项；保险兼业代理业务（有效期至 2017 年 02 月 18 日）；提供保管箱服务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。</p>	<p>(二) 基金托管人</p> <p>...</p> <p>组织形式：其他股份有限公司<u>（上市）</u></p> <p>...</p> <p>经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现、发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事结汇、售汇业务；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项；保险兼业代理业务（有效期至 2020 年 02 月 18 日）；提供保管箱服务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。</p>	根据基金托管人实际情况修改。
二、 基金 托管 协议 的依 据、 目的 和原 则	<p>(一) 订立托管协议的依据</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》”)、《证券投资基金托管业务管理办法》、《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》”)、《货币市场基金监督管理办法》、《关于实施〈货币市场基金监督管理办法〉有关问题的规定》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 7 号〈托管协议的内容与格式〉》等有关法律法规、基金合同及其他有关规</p>	<p>(一) 订立托管协议的依据</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》”)、《证券投资基金托管业务管理办法》、《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》”)、《货币市场基金监督管理办法》、《关于实施〈货币市场基金监督管理办法〉有关问题的规定》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 7 号〈托管协议的内容与格式〉》、<u>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险</u></p>	补充本基金适用的法律依据。

	定制订。	<u>管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)等</u> 有关法律法规、基金合同及其他有关规定制订。	
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	<p>(二)基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金投资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督:</p> <p>本基金为货币市场基金,基金的投资组合应遵循以下限制:</p> <p>(1)本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天,平均剩余续期不得超过240天;</p>	<p>(二)基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金投资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督:</p> <p>本基金为货币市场基金,基金的投资组合应遵循以下限制:</p> <p>(1) <u>除基金合同另有约定外</u>,本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天,平均剩余续期不得超过240天;</p>	明确条文表述。
	<p>(9) 现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及五个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于10%;</p> <p>(10) 到期日在10个交易日以上的逆回购、银行定期存款等流动性受限资产投资占基金资产净值的比例合计不得超过30%;</p> <p>(11) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过基金资产净值的10%;本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的20%;本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的10%;本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%;本基金应投资于信用级别评级为AAA以上(含AAA)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间,如果其信用等级下降、不再符</p>	<p>(9) 现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及五个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于10%;</p> <p><u>(10)本基金管理人管理的全部货币市场基金投资于同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券,不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的10%;</u></p> <p><u>(11) 当本基金前10名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的50%时,本基金投资组合的平均剩余期限不得超过60天,平均剩余存续期不得超过120天;投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于30%;</u></p> <p><u>(12) 当本基金前10名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的20%时,本基金投资组合的平均剩余期限不得超过90天,平均剩余存续期不得超过</u></p>	根据《流动性风险管理规定》第35、34、30、33、32、17条第二款增加投资限制并明确条文表述。

<p>合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；</p> <p>(12) 本基金的基金总资产不得超过基金资产净值的140%；</p> <p>(13) 中国证监会规定的其他比例限制。</p> <p>除法律法规另有规定或上述另有约定外，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><u>180天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于20%；</u></p> <p><u>(13) 本基金投资于主体信用评级低于AAA的机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过10%，其中单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过2%；前述金融工具包括债券、非金融企业债务融资工具、银行存款、同业存单、相关机构作为原始权益人的资产支持证券及中国证监会认定的其他品种；</u></p> <p><u>(14) 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10%；因证券市场波动、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；</u></p> <p><u>(15) 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本基金合同约定的投资范围保持一致；</u></p> <p><u>(16) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的10%；本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产</u></p>	
--	---	--

		<p>支持证券合计规模的 10%；</p> <p>(17) 本基金应投资于信用级别评级为 AAA 以上(含 AAA)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；</p> <p>(18) 本基金的基金总资产不得超过基金资产净值的 140%；</p> <p>(19) 中国证监会规定的其他比例限制。</p> <p>除上述第 (1)、(8)、(14)、(15)、(17) 项另有约定外，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>八、 基金 资产 净值 计算 和会 计核 算</p>	<p>(四) 暂停估值与公告基金份额净值的情形</p> <p>...</p> <p>3. 占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，基金管理人为保障基金份额持有人的利益，决定延迟估值；</p> <p>4. 中国证监会和基金合同认定的其他情形。</p>	<p>(四) 暂停估值与公告基金份额净值的情形</p> <p>...</p> <p>3. 占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，基金管理人为保障基金份额持有人的利益，决定延迟估值；</p> <p>4. 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，基金应当暂停估值；</p> <p>5. 中国证监会和基金合同认定的其他情形。</p>	<p>根据《流动性风险管理规定》第 24 条补充暂停估值情形。</p>

<p>十、基金信息披露</p>	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>(五) 基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告</p> <p>...</p> <p>基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。</p>	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>(五) 基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告</p> <p>...</p> <p>基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。</p> <p><u>基金运作期间，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，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在基金定期报告“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产品的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。</u></p> <p><u>本基金应在年度报告、半年度报告中至少披露报告期末基金前 10 名份额持有人的类别、持有份额及占总份额的比例等信息。</u></p> <p><u>本基金持续运作过程中，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。</u></p>	<p>根据《流动性风险管理规定》第 26 条、第 27 条、第 36 条补充定期报告的内容。</p>
-----------------	---	---	--

	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>(六) 临时报告</p> <p>26、当“影子定价”确定的基金资产净值与“摊余成本法”计算的基金资产净值的负偏离度绝对值达到0.25%或正负偏离度绝对值达到0.5%的情形；当“影子定价”确定的基金资产净值与“摊余成本法”计算的基金资产净值连续2个交易日出现负偏离度绝对值超过0.5%的情形；</p> <p>27、中国证监会规定的其他事项。</p>	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>(六) 临时报告</p> <p>26、当“影子定价”确定的基金资产净值与“摊余成本法”计算的基金资产净值的负偏离度绝对值达到0.25%或正负偏离度绝对值达到0.5%的情形；当“影子定价”确定的基金资产净值与“摊余成本法”计算的基金资产净值连续2个交易日出现负偏离度绝对值超过0.5%的情形；</p> <p><u>27、在发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；</u></p> <p><u>28、本基金投资于主体信用评级低于 AA+的商业银行的银行存款与同业存单；</u></p> <p><u>29、</u>中国证监会规定的其他事项。</p>	<p>根据《流动性风险管理规定》第 26、33 条补充临时报告的内容。</p>
--	---	--	---

附件 3 《新沃通宝货币市场基金招募说明书更新修改前后文对照表》

章节	修改前条款	修改后条款	修改理由
封面	2017 年第 2 号	2018 年第 1 号	
一、 绪言	<p>一、绪言</p> <p>本招募说明书依据《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》”）、《货币市场基金监督管理办法》、《关于实施〈货币市场基金监督管理办法〉有关问题的规定》、《证券投资基金信息披露编报规则第 5 号〈货币市场基金信息披露特别规定〉》以及《新沃通宝货币市场基金基金合同》编写。</p>	<p>一、绪言</p> <p>本招募说明书依据《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》”）、《货币市场基金监督管理办法》、《关于实施〈货币市场基金监督管理办法〉有关问题的规定》、《证券投资基金信息披露编报规则第 5 号〈货币市场基金信息披露特别规定〉》、<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“《流动性风险管理规定》”）以及《新沃通宝货币市场基金基金合同》编写。</p>	补充本基金适用的法律依据。
二、 释义	无	13、<u>《流动性风险管理规定》</u> ：指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的 <u>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</u> 及颁布机关对其不时做出的修订	补充本基金适用的法律依据。
	无	59、<u>流动性受限资产</u> ：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）、 <u>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> ；就本基金而言，指货币市场基金依法可投资的	根据《流动性风险规定》第 40 条，补充定义。

		<u>符合前述条件的资产，但中国证监会认可的特殊情形除外</u>	
四、基金托管人	<p>一、基金托管人概况</p> <p>3、基金托管业务经营情况</p> <p>...</p> <p>中国民生银行坚持以客户需求为导向，秉承“诚信、严谨、高效、务实”的经营理念，依托丰富的资产托管经验、专业的托管业务服务和先进的托管业务平台，为境内外客户提供安全、准确、及时、高效的专业托管服务。截至 2017 年 9 月 30 日，中国民生银行已托管 179 只证券投资基金，托管的证券投资基金总净值达到 4100.94 亿元。...</p>	<p>一、基金托管人概况</p> <p>3、基金托管业务经营情况</p> <p>...</p> <p>中国民生银行坚持以客户需求为导向，秉承“诚信、严谨、高效、务实”的经营理念，依托丰富的资产托管经验、专业的托管业务服务和先进的托管业务平台，为境内外客户提供安全、准确、及时、高效的专业托管服务。<u>截至 2017 年 12 月 31 日，中国民生银行已托管 182 只证券投资基金，托管的证券投资基金总净值达到 3417.86 亿元。...</u></p>	根据托管人实际情况修改。
九、基金份额的申购、赎回	<p>五、申购、赎回的数额限制</p> <p>无。</p>	<p>五、申购、赎回的数额限制</p> <p><u>7、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>	根据《流动性风险规定》第 19 条的规定补充。
	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>2、发生本基金持有的现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计低于 5%且偏离度为负的情形时，基金管理人应当对当日单个基金份额持有人申请赎回基金份额超过基金总份额 1%以上的赎回申请征收 1%的强制赎回费用，并将上述赎回费用全额计入基金财产。基金管理人与基金托管人协商确认上述做法无益于基金利</p>	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>2、<u>本基金在一般情况下不收取申购费用和赎回费用，但是出现以下情形之一：</u></p> <p><u>(1) 发生本基金持有的现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计低于 5%且偏离度为负；</u></p> <p><u>(2) 本基金前 10 名基金份额持有人的持有份额合计超过基金总份额 50%，且本基金投资组合中现金、国债、</u></p>	根据《流动性风险规定》第 31 条补充强制赎回费的规定。

	<p>益最大化的情形除外。</p>	<p><u>中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计低于 10% 且偏离度为负；</u> <u>为确保基金平稳运作，避免诱发系统性风险，</u>基金管理人应当对当日单个基金份额持有人申请赎回基金份额超过基金总份额 1% 以上的赎回申请征收 1% 的强制赎回费用，并将上述赎回费用全额计入基金财产。基金管理人与基金托管人协商确认上述做法无益于基金利益最大化的情形除外。</p>	
	<p>七、拒绝或暂停申购的情形 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。</p>	<p>七、拒绝或暂停申购的情形 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。<u>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，基金管理人应当暂停接受基金申购申请。</u></p>	<p>根据《流动性风险管理规定》第 24 条补充暂停申购的情形。</p>
	<p>4、基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。</p>	<p>4、基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益<u>或对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响</u>时。</p>	<p>根据《流动性风险管理规定》第 19 条补充暂停申购的情形。</p>

<p>9、当日达到或超出基金管理人规定的基金总规模限制。 10、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、5、6、7、8、10 项暂停申购情形之一...</p>	<p>9、当日达到或超出基金管理人规定的基金总规模限制。 10、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本基金基金份额的比例达到或者超过本基金总份额的 50%，或者变相规避前述 50%集中度的情形时。 11、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、5、6、7、8、11 项暂停申购情形之一...</p>	<p>根据《流动性风险管理规定》第 19 条补充暂停申购的情形。</p>
<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。</p>	<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。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，基金管理人应当暂停接受基金赎回申请。</p>	<p>根据《流动性风险管理规定》第 24 条的规定补充暂停赎回的情形。</p>
<p>九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 (2) 部分延期赎回：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，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日</p>	<p>九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 (2) 部分延期赎回：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，可对其余赎回申请延期办理。若进行上述延期办理，对于单个基金份额持有人当日赎回申请超过上一开放日基金总份额 10%以上的部分，将自动进行延期办理。对于其余当日非自动延期办理的赎回申请，应当按单个账户非自动延期办理的赎回</p>	<p>根据《流动性风险管理规定》第 21 条第 2 款的规定修改。</p>

	<p>继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。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，以此类推，直到全部赎回为止。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。</p>	<p><u>申请量占非自动延期办理的赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；</u>对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。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，以此类推，直到全部赎回为止。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。</p>	
<p>十、基金的投资</p>	<p>四、投资限制 （一）本基金不得投资于以下金融工具： ... 法律法规或监管部门取消上述限制后，本基金不受上述限制。</p>	<p>四、投资限制 （一）本基金不得投资于以下金融工具： ... <u>本基金拟投资于主体信用评级低于 AA+ 的商业银行的银行存款与同业存单的，应当经基金管理人董事会审议批准，相关交易应当事先征得基金托管人的同意，并作为重大事项履行信息披露程序。</u> 法律法规或监管部门取消上述限制后，本基金不受上述限制。</p>	<p>根据《流动性风险规定》第 33 条修改。</p>
	<p>（二）投资组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： （1）本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天，平均剩余存续期不得超过 240 天；</p>	<p>（二）投资组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： （1）<u>除基金合同另有约定外，</u>本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天，平均剩余存续期不得超过 240 天；</p>	<p>明确条文表述。</p>

<p>(9) 现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及五个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 10%；</p> <p>(10) 到期日在 10 个交易日以上的逆回购、银行定期存款等流动性受限资产投资占基金资产净值的比例合计不得超过 30%；</p> <p>(11) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；本基金应投资于信用级别评级为 AAA 以上(含 AAA)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；</p> <p>(12) 本基金的基金总资产不得超过基金资产净值的 140%；</p> <p>(13) 中国证监会规定的其他比例限制。</p> <p>除法律法规另有规定或上述另有约定外，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>(9) 现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及五个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 10%；</p> <p><u>(10) 本基金管理人管理的全部货币市场基金投资于同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券，不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的 10%；</u></p> <p><u>(11) 当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 50%时，本基金投资组合的平均剩余期限不得超过 60 天，平均剩余存续期不得超过 120 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 30%；</u></p> <p><u>(12) 当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 20%时，本基金投资组合的平均剩余期限不得超过 90 天，平均剩余存续期不得超过 180 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 20%；</u></p> <p><u>(13) 本基金投资于主体信用评级低于 AAA 的机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 10%，其中单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 2%；前述金融工具包括债券、非金融企业债务融资工具、银行存款、同业存单、相关机构作为原始权益人的资产支持证券及中国证监会认定的其他品种；</u></p> <p><u>(14) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不</u></p>	<p>根据《流动性风险规定》第 35、34、30、33、32、17 条第二款增加投资限制并明确条文表述。</p>
---	---	--

		<p><u>得超过基金资产净值的 10%；因证券市场波动、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；</u></p> <p><u>(15) 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本基金合同约定的投资范围保持一致；</u></p> <p><u>(16) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；</u></p> <p><u>(17) 本基金应投资于信用级别评级为 AAA 以上(含 AAA)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；</u></p> <p><u>(18) 本基金的基金总资产不得超过基金资产净值的 140%；</u></p> <p><u>(19) 中国证监会规定的其他比例限制。</u></p> <p><u>除上述第 (1)、(8)、(14)、(15)、(17) 项另有约定外，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</u></p>	
--	--	---	--

		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。	
十四、基金资产估值	<p>六、暂停估值的情形</p> <p>3、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，基金管理人为保障投资人的利益，决定延迟估值；</p> <p>4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。</p>	<p>六、暂停估值的情形</p> <p>3、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，基金管理人为保障投资人的利益，决定延迟估值；</p> <p>4、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确认后，基金管理人应当暂停基金估值；</p> <p>5、中国证监会和基金合同认定的其它情形。</p>	根据《流动性风险规定》第 24 条补充。
十八、基金的信息披露	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>（五）基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告</p> <p>...</p> <p>基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。</p>	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>（五）基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告</p> <p>...</p> <p>基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。</p> <p>基金运作期间，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，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在基金定期报告“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产品的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除</p>	根据《流动性风险规定》第 26 条、第 27 条、第 36 条补充定期报告的内容。

		<p>外。</p> <p><u>本基金应在年度报告、半年度报告中至少披露报告期末基金前 10 名份额持有人的类别、持有份额及占总份额的比例等信息。</u></p> <p><u>本基金持续运作过程中，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。</u></p>	
	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>(六) 临时报告</p> <p>26、当“影子定价”确定的基金资产净值与“摊余成本法”计算的基金资产净值的负偏离度绝对值达到 0.25% 或正负偏离度绝对值达到 0.5% 的情形；当“影子定价”确定的基金资产净值与“摊余成本法”计算的基金资产净值连续 2 个交易日出现负偏离度绝对值超过 0.5% 的情形；</p> <p>27、中国证监会规定的其他事项。</p>	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>(六) 临时报告</p> <p>26、当“影子定价”确定的基金资产净值与“摊余成本法”计算的基金资产净值的负偏离度绝对值达到 0.25% 或正负偏离度绝对值达到 0.5% 的情形；当“影子定价”确定的基金资产净值与“摊余成本法”计算的基金资产净值连续 2 个交易日出现负偏离度绝对值超过 0.5% 的情形；</p> <p><u>27、在发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；</u></p> <p><u>28、本基金投资于主体信用评级低于 AA+ 的商业银行的银行存款与同业存单；</u></p> <p><u>29、</u>中国证监会规定的其他事项。</p>	<p>根据《流动性风险规定》第 27、33 条补充临时报告的内容。</p>
<p>二、十、风险揭示</p>	<p>一、本基金特有的风险</p> <p>3、流动性风险</p> <p>流动性风险是指投资人提交了赎回申请后，基金管理人无法及时变现基金资产，导致赎回款交收资金不足的风险；或者为应付赎回款，变现冲击成本较高，给基金资产造成较大的损失的风险。大部分债券品种的流动性较</p>	<p>一、本基金特有的风险</p> <p>3、流动性风险</p> <p><u>本基金属于开放式基金，基金份额可以在基金合同约定的时间和场所进行申购和赎回，因此会面临一定的流动性风险。所谓流动性风险是指投资人提交了赎回申请后，基金管理人无法及时变现基金资产，导致赎回款交</u></p>	<p>根据《流动性风险规定》第 26 条补充。</p>

好，也存在部分企业债、资产证券化、回购等品种流动性相对较差的情况，如果市场短时间内发生较大变化或基金赎回量较大可能会影响到流动性和投资收益。

收资金不足的风险；或者为应付赎回款，变现冲击成本较高，给基金资产造成较大的损失的风险。大部分债券品种的流动性较好，也存在部分企业债、资产证券化、回购等品种流动性相对较差的情况，如果市场短时间内发生较大变化或基金赎回量较大可能会影响到流动性和投资收益。

(1) 本基金的申购、赎回安排

①投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定暂停申购、赎回时除外。基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理申购和赎回，具体业务办理时间在相关公告中规定。

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。

③在发生本基金合同“六、基金份额的申购与赎回”中“拒绝或暂停申购的情形”时，基金管理人可以暂停接受申购申请，在发生“暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形”时，基金管理人可以暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项。

提示投资人注意本基金的申购赎回安排和相应的流动性风险，合理安排投资计划。

(2) 投资市场、行业及资产的流动性风险评估

		<p>本基金是货币市场基金，基金财产均投资于具有良好流动性的金融工具，包括现金，期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单，剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券，中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。</p> <p>在本基金的投资运作过程中，基金管理人将充分评估本基金所面临的流动性风险，并根据基金合同的约定及实际情况，合理采取控制基金份额持有人集中度，审慎确认大额申购申请设定、单一投资者申购金额上限、综合运用延期办理巨额赎回申请等各类流动性风险管理工具、降低基金资产持仓集中度、降低流动受限资产投资比例等措施，有效防范本基金所面临的流动性风险。</p> <p>（3）巨额赎回情形下的流动性风险管理措施</p> <p>在本基金发生巨额赎回的情形下，基金管理人将在与基金托管人协商一致，并在确保投资者得到公平对待的前提下，依照法律法规及基金合同的约定，综合运用各类流动性风险管理工具，对巨额赎回申请等进行适度调整，作为本基金发生巨额赎回的特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施。上述各类流动性风险管理工具包括但不限于：①延期办理巨额赎回申请；②暂停接受赎回申请；③延缓支付赎回款项；④中国证监会认定的其他措施。在采用上述流动性风险管理工具时，基金管理人严格遵守法律法规及基金合同的约定，确保相关工具实施的及时、有序、透明及公平。</p> <p>（4）备用的流动性风险管理工具的实施情形、程序及</p>	
--	--	---	--

		<p><u>对投资者的潜在影响</u></p> <p><u>①实施备用流动性风险管理工具的情形：在本基金发生巨额赎回的情形下，本基金管理人将实施备用流动性风险管理工具。</u></p> <p><u>②实施备用流动性风险管理工具的程序：本基金管理人将在与基金托管人协商一致，并在确保投资者得到公平对待的前提下，依照法律法规及基金合同的约定实施备用流动性风险管理工具，确保相关工具实施的及时、有序、透明及公平。</u></p> <p><u>③实施备用流动性风险管理工具对投资者的影响：在实施备用流动性风险管理工具的情形下，可能会导致本基金份额持有人的部分或全部赎回申请被确认失败或者被收取短期赎回费。</u></p>	
--	--	--	--

附件 4 《新沃通利纯债债券型证券投资基金基金合同修改前后文对照表》

章节	基金合同修改前版本	基金合同修改后版本	修改理由
封面	二零一六年十月	二零一八年三月	
第一部分 前言	一、订立本基金合同的目的、依据和原则 2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《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》”)和其他有关法律法规。	一、订立本基金合同的目的、依据和原则 2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《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>《流动性风险管理规定》</u> ”)和其他有关法律法规。	补充本基金适用的法律依据。
	无	<u>13、《流动性风险管理规定》：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</u>	补充本基金适用的法律依据。
	无	<u>56、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)、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>	根据《流动性风险管理规定》第 40 条，补充流动性受限资产定义。
第二部分 释义	无	<u>57、摆动定价机制：指当本基金各类份额遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调</u>	根据《流动性风险管理规定》第 40 条，

		<u>整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者,从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响,确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待</u>	补充摆动定价机制定义
第六部分 基金份额的 申购与 赎回	五、申购和赎回的数量限制 无	五、申购和赎回的数量限制 <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>	根据《流动性风险规定》第 19 条的规定补充。
	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回基金份额时收取。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额的赎回费用分别根据法律法规规定的比例归入基金财产,未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回基金份额时收取。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额的赎回费用分别根据法律法规规定的比例归入基金财产,未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。 <u>本基金对持有持续期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费并全额计入基金财产。法律法规或监管机构另有规定的从其规定。</u>	根据《流动性风险规定》第 23 条补充强制赎回费的规定。
	无	<u>8、当本基金各类份额发生大额申购或赎回情形时,基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。</u>	根据《流动性风险规定》第 25 条补充摆动定价机制的适用情形。
	七、拒绝或暂停申购的情形 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时,基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。	七、拒绝或暂停申购的情形 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时,基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。 <u>当前一估</u>	根据《流动性风险规定》第 24 条补充应当暂停申购

	<u>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，基金管理人应当暂停接受基金申购申请。</u>	的情形。
4、基金管理人接受某笔或某些申购申请会损害现有基金份额持有人利益时。	4、基金管理人接受某笔或某些申购申请会损害现有基金份额持有人利益 <u>或对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响</u> 时。	根据《流动性风险规定》第 19 条补充应当暂停赎回的情形。
无 …… 发生上述第 1、2、3、5、6、7 项暂停申购情形之一且基金管理人决定拒绝或暂停接受投资人的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。	<u>7、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本基金基金份额的比例达到或者超过本基金总份额的 50%，或者变相规避前述 50%集中度的情形时。</u> …… 发生上述第 1、2、3、5、6、 8 项暂停申购情形之一且基金管理人决定拒绝或暂停接受投资人的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。	根据《流动性风险规定》第 19 条补充应当暂停申购的情形。
八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。 <u>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</u>	根据《流动性风险规定》第 24 条的规定补充应当暂停赎回的情形。

		<u>管人协商确认后,基金管理人应当暂停接受基金赎回申请。</u>	
	<p>九、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>(2) 部分延期赎回: 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, 可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请, 应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例, 确定当日受理的赎回份额; 对于未能赎回部分, 投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的, 将自动转入下一个开放日继续赎回, 直到全部赎回为止; 选择取消赎回的, 当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。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该类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。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。</p>	<p>九、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>(2) 部分延期赎回: 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, 可对其余赎回申请延期办理。<u>若进行上述延期办理, 对于单个基金份额持有人当日赎回申请超过上一开放日基金总份额 10% 以上的部分, 将自动进行延期办理。对于其余当日非自动延期办理的赎回申请, 应当按单个账户非自动延期办理的赎回申请量占非自动延期办理的赎回申请总量的比例, 确定当日受理的赎回份额。</u>对于未能赎回部分, 投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的, 将自动转入下一个开放日继续赎回, 直到全部赎回为止; 选择取消赎回的, 当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。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该类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。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。</p>	<p>根据《流动性风险规定》第 21 条第 2 款的规定修改。</p>
第十二部	<p>二、投资范围</p> <p>……</p>	<p>二、投资范围</p> <p>……</p>	<p>根据《流动性风险规定》第 18 条修</p>

分基金的投资	基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，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%。	基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，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、应收申购款等。</u>	改。
	四、投资限制 1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： （2）每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券；	四、投资限制 1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： （2）每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券， <u>其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</u>	根据《流动性风险规定》第 18 条修改。
无 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，除第（12）项外，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。		<u>（13）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、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；</u> <u>（14）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> 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	根据《流动性风险规定》第 16、17 条修改。

		述规定投资比例的，除第 <u>(2)</u> 、(12)、 <u>(13)</u> 、 <u>(14)</u> 项外，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。	
第十四部分 基金资产估值	三、估值方法 无	三、估值方法 <u>7、当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。</u>	补充完善估值方法。
	六、暂停估值的情形 1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； 2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时； 3、中国证监会和基金合同认定的其它情形。	六、暂停估值的情形 1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； 2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时； 3、 <u>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，基金管理人应当暂停基金估值；</u> <u>4、</u> 中国证监会和基金合同认定的其它情形。	根据《流动性风险规定》第 24 条补充。
第十五部分 基金费用与税收	二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式 1、基金管理人的管理费 …… 基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月前 5 个工作日内，按照指定的账户路径从基金财产中一次性支付给基金管理人，基金管	二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式 1、基金管理人的管理费 …… 基金管理费每日 <u>计提</u> ，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月前 5 个工作日内，按照指定的账户路径从基金财产中一次性支付给基金管理人，基金管	其他

	<p>理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。</p> <p>.....</p> <p>2、基金托管人的托管费</p> <p>.....</p> <p>基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月前5个工作日内，按照指定的账户路径从基金财产中一次性支取，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。</p> <p>.....</p> <p>3、销售服务费</p> <p>.....</p> <p>销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月前5个工作日内从基金财产划出，经登记机构分别支付给各个基金销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。</p> <p>上述“一、基金费用的种类中第4-10项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。</p>	<p>理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。</p> <p>.....</p> <p>2、基金托管人的托管费</p> <p>.....</p> <p>基金托管费每日<u>计提</u>，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月前5个工作日内，按照指定的账户路径从基金财产中一次性支取，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。</p> <p>.....</p> <p>3、销售服务费</p> <p>.....</p> <p>销售服务费每日<u>计提</u>，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月前5个工作日内从基金财产划出，经登记机构分别支付给各个基金销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。</p> <p>上述“一、基金费用的种类中第4-10项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人<u>根据基金管理人指令并参照行业惯例</u>从基金财产中支付。</p>	
<p>第十七部分基金</p>	<p>一、基金会计政策</p> <p>7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。</p>	<p>一、基金会计政策</p> <p>7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面<u>或双方约定的其他方</u></p>	<p>其他</p>

金的 会计 与审 计		式确认。	
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)基金定期报告,包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告</p> <p>基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内,编制完成基金年度报告,并将年度报告正文登载于网站上,将年度报告摘要登载在指定媒介上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。</p> <p>基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内,编制完成基金半年度报告,并将半年度报告正文登载在网站上,将半年度报告摘要登载在指定媒介上。</p> <p>基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内,编制完成基金季度报告,并将季度报告登载在指定媒介上。</p> <p>《基金合同》生效不足 2 个月的,基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。</p> <p>基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日,分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。</p>	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>(六)基金定期报告,包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告</p> <p>基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内,编制完成基金年度报告,并将年度报告正文登载于网站上,将年度报告摘要登载在指定媒介上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。</p> <p>基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内,编制完成基金半年度报告,并将半年度报告正文登载在网站上,将半年度报告摘要登载在指定媒介上。</p> <p>基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内,编制完成基金季度报告,并将季度报告登载在指定媒介上。</p> <p>《基金合同》生效不足 2 个月的,基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。</p> <p>基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日,分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。</p> <p><u>本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。</u></p>	<p>根据《流动性风险规定》第 26 条及第 27 条补充定期报告的内容。</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，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在基金定期报告“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产品的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。</u></p>	
	<p>五、公开披露的基金信息 （七）临时报告 无</p>	<p>五、公开披露的基金信息 （七）临时报告 <u>26、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> <u>27、基金管理人采用摆动定价机制进行估值时；</u></p>	<p>根据《流动性风险管理规定》第 25、26 条补充临时报告的内容。</p>

附件 5 《新沃通利纯债债券型证券投资基金托管协议修改前后文对照表》

章节	修改前版本	修改后版本	修改理由
二、 基金 托管 协议 的依 据、 目的 和原 则	<p>(一) 订立托管协议的依据</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》)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称《销售办法》)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称《运作办法》)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称《信息披露办法》)、《新沃通利纯债债券型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>(一) 订立托管协议的依据</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》)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称《销售办法》)、《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》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)</u>、《新沃通利纯债债券型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>	补充本基金适用的法律依据。
三、 基金 托管 人对 基金 管理 人的 业务 监督 和核 查	<p>本基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，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%。</p> <p>(二) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： ……</p> <p>2) 每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或</p>	<p>本基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，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、应收申购款等。</u></p> <p>(二) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： ……</p> <p>2) 每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或</p>	<p>根据《流动性风险管理规定》第 18 条修改。</p> <p>根据《流动性风险管理规定》第 18 条修改。</p>

	<p>者到期日在一年以内的政府债券。</p>	<p>者到期日在一年以内的政府债券，<u>其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</u></p>	
	<p>无</p> <p>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，除第（12）项外，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><u>（13）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、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。</u></p> <p><u>（14）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>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，除第<u>（2）、（12）、（13）、（14）</u>项外，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>根据《流动性风险管理规定》第 16、17 条修改。</p>

八、 基金 资产 净值 计算 和会 计核 算	<p>（一）基金资产净值及基金份额净值的计算与复核 基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金管理人应每工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。估值原则应符合《基金合同》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》及其他法律、法规的规定。用于基金信息披露的基金资产净值和各类基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金资产净值，以约定方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后，将复核结果反馈给基金管理人，由基金管理人</p>	<p>（一）基金资产净值及基金份额净值的计算与复核 基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金管理人应每工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。估值原则应符合《基金合同》、<u>《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》</u>及其他法律、法规的规定。用于基金信息披露的基金资产净值和各类基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金资产净值，以约定方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后，将复核结果反馈给基金管理人，由基金管理人</p>	更新估值方法的法律依据。
	<p>（一）基金资产净值及基金份额净值的计算与复核 无</p>	<p>（一）基金资产净值及基金份额净值的计算与复核 <u>7、当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。</u></p>	补充完善估值方法。

<p>(六) 基金定期报告的编制与复核</p> <p>基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后 5 个工作日内完成。定期报告文件应按中国证监会的要求公告。季度报表的编制，应于每季度终了后 15 个工作日内完成；更新的招募说明书在基金合同生效后每 6 个月公告一次，于截止日后的 45 日内公告。半年度报告在基金会计年度前 6 个月结束后的 60 日内公告；年度报告在会计年度结束后 90 日内公告。</p> <p>基金管理人在月度报表完成当日，对报表盖章后，以传真方式将有关报表提供基金托管人；基金托管人在 2 个工作日内进行复核，并将复核结果及时书面通知基金管理人。基金管理人在季度报表完成当日，以约定方式将有关报表提供基金托管人；基金托管人在 5 个工作日内进行复核，并将复核结果反馈给基金管理人。基金管理人在更新招募说明书完成当日，将有关报告提供基金托管人，基金托管人在收到 15 日内进行复核，并将复核结果反馈给基金管理人。基金管理人在半年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人，基金托管人在收到后 20 日内进行复核，并将复核结果反馈给基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人，基金托管人在收到后 30 日内复核，并将复核结果反馈给基金管理人。基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以双方认可的账务处理方式为准。如</p>	<p>(六) 基金定期报告的编制与复核</p> <p>基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后 5 个工作日内完成。定期报告文件应按中国证监会的要求公告。季度报表的编制，应于每季度终了后 15 个工作日内完成；更新的招募说明书在基金合同生效后每 6 个月公告一次，于截止日后的 45 日内公告。半年度报告在基金会计年度前 6 个月结束后的 60 日内公告；年度报告在会计年度结束后 90 日内公告。</p> <p><u>基金管理人在月初 3 个工作日内完成上月度报表的编制，经盖章后，以传真或其他双方约定的方式将有关报表提供基金托管人；基金托管人收到后在 2 个工作日内进行复核，并将复核结果及时书面或以其他双方约定的方式通知基金管理人。对于季度报告、半年度报告、年度报告、更新招募说明书等定期报告，基金管理人和基金托管人应在上述监管部门规定的时间内完成编制、复核及公告。</u>基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以双方认可的账务处理方式为准。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日前就相关报表达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报证监会备案。</p>	<p>修改基金管理人和基金托管人关于基金定期报告的编制和复核方式。</p>
--	---	---------------------------------------

	果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日前就相关报表达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报证监会备案。		
十一、基金费用	<p>（三）基金销售服务费的计提比例和计提方法</p> <p>.....</p> <p>销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月前 5 个工作日内从基金财产划出，经登记机构分别支付给各个基金销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。</p>	<p>（三）基金销售服务费的计提比例和计提方法</p> <p>.....</p> <p>销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月前 5 个工作日内从基金财产划出，经登记机构分别支付给各个基金销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。</p>	文字表述修改。

附件 6 《新沃通利纯债债券型证券投资基金招募说明书更新修改前后文对照表》

章节	修改前条款	修改后条款	修改理由
封面	2018 年第 1 号	2018 年第 2 号	
【重要提示】	无	<u>本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定），在正常市场环境下本基金的流动性风险适中。在特殊市场条件下，如证券市场的成交量发生急剧萎缩、基金发生巨额赎回以及其他未能预见的特殊情形下，可能导致基金资产变现困难或变现对证券资产价格造成较大冲击，发生基金份额净值波动幅度较大、无法进行正常赎回业务、基金不能实现既定的投资决策等风险。</u>	补充流动性风险相关内容。
一、绪言	一、绪言 本招募说明书依据《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》”）以及《新沃通利纯债债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。	一、绪言 本招募说明书依据《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》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）</u> 以及《新沃通利纯债债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。	补充本基金适用的法律依据。
二、释义	无	<u>13、《流动性风险管理规定》：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</u>	补充本基金适用的

		<p><u>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</u></p>	<p>法律依据。</p>											
	<p>无</p>	<p><u>56、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）、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> <p><u>57、摆动定价机制：指本基金各类份额遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待</u></p>	<p>根据《流动性风险规定》第 40 条，补充定义。</p>											
<p>八、基金份额的申购、赎回</p>	<p>五、申购与赎回的数额限制 无。</p>	<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>	<p>根据《流动性风险规定》第 19 条的规定补充。</p>											
	<p>六、申购和赎回的价格、费用及用途</p> <p>2、本基金的赎回费率如下：</p> <p style="text-align: center;">表 3：本基金的赎回费率</p> <table border="1" style="margin-left: auto; margin-right: auto;"> <thead> <tr> <th>持有期间 (N)</th> <th>费率</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>N < 1 年</td> <td>0.10%</td> </tr> <tr> <td>1 年 ≤ N < 2 年</td> <td>0.05%</td> </tr> </tbody> </table>	持有期间 (N)	费率	N < 1 年	0.10%	1 年 ≤ N < 2 年	0.05%	<p>六、申购和赎回的价格、费用及用途</p> <p>2、本基金的赎回费率如：</p> <p style="text-align: center;">表 3：本基金的赎回费率</p> <table border="1" style="margin-left: auto; margin-right: auto;"> <thead> <tr> <th>持有期间 (N)</th> <th>费率</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>N < 7 日</td> <td>1.50%</td> </tr> <tr> <td>7 日 ≤ N < 1 年</td> <td>0.10%</td> </tr> </tbody> </table>	持有期间 (N)	费率	N < 7 日	1.50%	7 日 ≤ N < 1 年	0.10%
持有期间 (N)	费率													
N < 1 年	0.10%													
1 年 ≤ N < 2 年	0.05%													
持有期间 (N)	费率													
N < 7 日	1.50%													
7 日 ≤ N < 1 年	0.10%													

<table border="1" style="margin-left: auto; margin-right: auto;"> <tr> <td style="text-align: center;">N ≥ 2 年</td> <td style="text-align: center;">0%</td> </tr> </table> <p>A 类基金份额和 C 类基金份额实行相同的赎回费率。</p> <p>本基金的赎回费用由基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。基金管理人应当将不低于赎回费总额的 25% 计入基金财产。赎回费中计入基金财产之余的费用用于支付注册登记费和其他必要的手续费。</p>	N ≥ 2 年	0%	<table border="1" style="margin-left: auto; margin-right: auto;"> <tr> <td style="text-align: center;">1 年 ≤ N < 2 年</td> <td style="text-align: center;">0.05%</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">N ≥ 2 年</td> <td style="text-align: center;">0%</td> </tr> </table> <p>A 类基金份额和 C 类基金份额实行相同的赎回费率。</p> <p>本基金的赎回费用由基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。基金管理人应当将持续持有期少于 7 日的投资人收取的赎回费全额计入基金财产；对持续持有期不少于 7 日的投资人收取的不低于赎回费总额的 25% 计入基金财产。赎回费中计入基金财产之余的费用用于支付注册登记费和其他必要的手续费。</p>	1 年 ≤ N < 2 年	0.05%	N ≥ 2 年	0%	
N ≥ 2 年	0%							
1 年 ≤ N < 2 年	0.05%							
N ≥ 2 年	0%							
<p>六、申购和赎回的价格、费用及用途</p> <p>无</p>	<p>六、申购和赎回的价格、费用及用途</p> <p><u>5、当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。</u></p>	<p>根据《流动性风险规定》第 25 条补充摆动定价机制的适用情形。</p>						
<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。</p> <p>.....</p> <p>4、基金管理人接受某笔或某些申购申请会损害现有基金份额持有人利益时。</p> <p>.....</p> <p>7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p>	<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。<u>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，基金管理人应当暂停接受基金申购申请。</u></p> <p>.....</p>	<p>根据《流动性风险规定》第 19 条补充应当暂停申购的情形。</p>						

	<p>发生上述第 1、2、3、5、6、7 项暂停申购情形之一且基金管理人决定拒绝或暂停接受投资人的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。</p>	<p>4、基金管理人接受某笔或某些申购申请会损害现有基金份额持有人利益<u>或对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响</u>时。 …… 7、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本基金基金份额的比例达到或者超过本基金总份额的 50%，或者变相规避前述 50%集中度的情形时。 8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、5、6、8 项暂停申购情形之一且基金管理人决定拒绝或暂停接受投资人的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。</p>	
	<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项： 1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。</p>	<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项： 1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。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，基金管理人应当暂停接受基金赎回申请。</p>	<p>根据《流动性风险规定》第 20 条的规定补充暂停赎回的情形。</p>

	<p>九、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>(2) 部分延期赎回：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，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。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该类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。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。</p>	<p>九、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>(2) 部分延期赎回：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，可对其余赎回申请延期办理。<u>若进行上述延期办理，对于单个基金份额持有人当日赎回申请超过上一开放日基金总份额 10%以上的部分，将自动进行延期办理。对于其余当日非自动延期办理的赎回申请，应当按单个账户非自动延期办理的赎回申请量占非自动延期办理的赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；</u>对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。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该类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。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。</p>	<p>根据《流动性风险规定》第 21 条第 2 款的规定修改。</p>
<p>九、基金的投资</p>	<p>二、投资范围</p> <p>……</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，持有的现金或者到期日</p>	<p>二、投资范围</p> <p>……</p> <p>基金的投资组合比例为：基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金</p>	<p>根据《流动性风险规定》第 18 条修改。</p>

	<p>在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>后，持有的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、应收申购款等。</u></p>	
	<p>四、投资限制 1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： (2) 每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券；</p>	<p>四、投资限制 1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： (2) 每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券；<u>其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</u></p>	<p>根据《流动性风险规定》第 18 条修改。</p>
	<p>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，除第（12）项外，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><u>(13) 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、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述所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u> <u>(14) 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> …… 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，除第 (2)、(12)、(13)、(14) 项外，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>根据《流动性风险规定》第 16、17 条修改。</p>

	<p>三、估值方法</p> <p>无</p>	<p>三、估值方法</p> <p>7、当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。</p>	<p>补充完善估值方法。</p>
<p>十三、基金资产估值</p>	<p>六、暂停估值的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</p> <p>2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；</p> <p>3、中国证监会和基金合同认定的其它情形。</p>	<p>六、暂停估值的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</p> <p>2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；</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确认后，基金管理人应当暂停基金估值；</p> <p>4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。</p>	<p>根据《流动性风险规定》第 24 条修改。</p>
<p>十五、基金费用与税收</p>	<p>二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>1、基金管理人的管理费</p> <p>.....</p> <p>基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月前 5 个工作日内，按照指定的账户路径从基金财产中一次性支付给基金管理人，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。</p> <p>2、基金托管人的托管费</p> <p>.....</p>	<p>二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>1、基金管理人的管理费</p> <p>.....</p> <p>基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月前 5 个工作日内，按照指定的账户路径从基金财产中一次性支付给基金管理人，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。</p> <p>2、基金托管人的托管费</p> <p>.....</p>	<p>其他</p>

	<p>基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月前 5 个工作日内，按照指定的账户路径从基金财产中一次性支取，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。</p> <p>3、销售服务费</p> <p>销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月前 5 个工作日内从基金财产划出，经登记机构分别支付给各个基金销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。</p> <p>上述“一、基金费用的种类中第 4—10 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。</p>	<p>基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月前 5 个工作日内，按照指定的账户路径从基金财产中一次性支取，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。</p> <p>3、销售服务费</p> <p>销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月前 5 个工作日内从基金财产划出，经登记机构分别支付给各个基金销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。</p> <p>上述“一、基金费用的种类中第 4—10 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人根据基金管理人指令并参照行业惯例从基金财产中支付。</p>	
十六、基金的会计与审计	<p>一、基金会计政策</p> <p>7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。</p>	<p>一、基金会计政策</p> <p>7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面或双方约定的其他方式确认。</p>	其他
十七、基金	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>(六) 基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告</p>	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>(六) 基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告</p>	根据《流动性风险规定》第 26

<p>的信息披露</p>	<p>基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定媒介上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。</p> <p>基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定媒介上。</p> <p>基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定媒介上。</p> <p>《基金合同》生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。</p> <p>基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。</p>	<p>基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定媒介上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。</p> <p>基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定媒介上。</p> <p>基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定媒介上。</p> <p>《基金合同》生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。</p> <p>基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。</p> <p><u>本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。</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>	<p>条及第 27 条补充定期报告的内容。</p>
	<p>五、公开披露的基金信息</p>	<p>五、公开披露的基金信息</p>	<p>根据《流动</p>

	<p>(七) 临时报告 无</p>	<p>(七) 临时报告 <u>26、本基金发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；</u> <u>27、基金管理人采用摆动定价机制进行估值时；</u></p>	<p>性风险规定》第 25、26 条补充临时报告的内容</p>
<p>十九、 风险揭示</p>	<p>一、投资于本基金的主要风险 无</p>	<p>一、投资于本基金的主要风险 <u>五、流动性风险</u> <u>本基金属于开放式基金，基金份额可以在基金合同约定的时间和场所进行申购和赎回，因此会面临一定的流动性风险。所谓流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。在基金交易过程中，可能会发生巨额赎回的情形，从而导致基金仓位调整的困难，引发流动性风险，甚至影响基金份额净值。</u> <u>1、本基金投资市场、行业及资产的流动性风险评估</u> <u>本基金主要投资于债券、货币市场工具等具有良好流动性的金融工具，资本市场成交活跃程度、基金持仓资产的变现能力以及投资者的申购、赎回行为将对本基金所面临的流动性风险产生直接影响。资本市场成交量低迷、基金持仓集中度过高、基金资产变现能力下降、单一基金份额持有人持有基金份额比例过高等因素，将使得本基金面临流动性风险。</u> <u>在本基金的投资运作过程中，基金管理人将充分评估本基金所面临的流动性风险，并根据基金合同的约定及实际情况，合理采取控制基金份额持有人集中度，审慎确认大额申购申请设定、单一投资者申购金额上限、综</u></p>	<p>根据《流动性风险规定》第 26 条修改。</p>

		<p><u>合运用延期办理巨额赎回申请等各类流动性风险管理工具、降低基金资产持仓集中度、降低流动受限资产投资比例等措施，有效防范本基金所面临的流动性风险。</u></p> <p><u>2、本基金发生巨额赎回情形下的流动性风险管理措施</u> <u>在本基金发生巨额赎回的情形下，基金管理人将在与基金托管人协商一致，并在确保投资者得到公平对待的前提下，依照法律法规及基金合同的约定，综合运用各类流动性风险管理工具，对巨额赎回申请等进行适度调整，作为本基金发生巨额赎回的特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施。上述各类流动性风险管理工具包括但不限于：（1）延期办理巨额赎回申请；（2）暂停接受赎回申请；（3）延缓支付赎回款项；（4）中国证监会认定的其他措施。在采用上述流动性风险管理工具时，基金管理人严格遵守法律法规及基金合同的约定，确保相关工具实施的及时、有序、透明及公平。</u></p> <p><u>3、实施备用的流动性风险管理工具的规定</u></p> <p><u>（1）实施备用流动性风险管理工具的情形：在本基金发生巨额赎回的情形下，本基金管理人将实施备用流动性风险管理工具。</u></p> <p><u>（2）实施备用流动性风险管理工具的程序：本基金管理人将在与基金托管人协商一致，并在确保投资者得到公平对待的前提下，依照法律法规及基金合同的约定实施备用流动性风险管理工具，确保相关工具实施的及时、有序、透明及公平。</u></p> <p><u>（3）实施备用流动性风险管理工具对投资者的影响：在实施备用流动性风险管理工具的情形下，可能会导</u></p>	
--	--	---	--

		致基金份额持有人的部分或全部赎回申请被确认失败或者被收取短期赎回费。	
--	--	------------------------------------	--

附件 7 《新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同修改前后文对照表》

章节	基金合同修改前版本	基金合同修改后版本	修改理由
封面	二零一七年一月	二零一八年三月	
第一部分 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《中华人民共和国合同法》(以下简称“《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》”)和其他有关法律法规。</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《中华人民共和国合同法》(以下简称“《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>《流动性风险管理规定》</u>”)和其他有关法律法规。</p>	补充本基金适用的法律依据。
第二部分 释义	无	<u>13、《流动性风险管理规定》：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</u>	补充本基金适用的法律依据。
	无	<u>53、流动性受限资产：是指由于法律法规、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</u>	根据《流动性风险管理规定》第 40 条，补充流动性受限资产定义。

		<u>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>	
	无	<u>54、摆动定价机制：指当本基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待</u>	根据《流动性风险规定》第40条，补充摆动定价机制定义
第六部分 基金份额的申购与赎回	五、申购和赎回的数量限制 无	五、申购和赎回的数量限制 <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>	根据《流动性风险规定》第19条的规定补充。
	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。 <u>本基金对持续持有期少于7日的投资者收取不低于1.5%的赎回费并全额计入基金财产。法律法规或监管机构另有规定的从其规定。</u>	根据《流动性风险规定》第23条补充强制赎回费的规定。
	无	<u>6、当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。</u>	根据《流动性风险规定》第25条补充摆动定价机制的适用情形。
	七、拒绝或暂停申购的情形	七、拒绝或暂停申购的情形	根据《流动性风险

<p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。</p>	<p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。<u>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，基金管理人应当暂停接受基金申购申请。</u></p>	<p>规定》第 24 条补充应当暂停申购的情形。</p>
<p>无</p>	<p><u>3、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本基金基金份额的比例达到或者超过本基金总份额的 50%，或者变相规避前述 50%集中度的情形。</u></p>	<p>根据《流动性风险规定》第 19 条补充应当暂停申购的情形。</p>
<p>4、基金管理人接受某笔或某些申购申请会损害现有基金份额持有人利益时。</p>	<p>5、基金管理人接受某笔或某些申购申请会损害现有基金份额持有人利益<u>或对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时。</u></p>	<p>根据《流动性风险规定》第 19 条补充应当暂停赎回的情形。</p>
<p>..... 发生上述第 1、2、3、7 项暂停申购情形之一且基金管理人决定拒绝或暂停接受投资人的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。</p>	<p>..... 发生上述第 1、2、3、<u>6</u>、7、<u>8</u> 项暂停申购情形之一且基金管理人决定拒绝或暂停接受投资人的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。</p>	<p>完善相关表述。</p>
<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况</p>	<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，<u>基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。当前一估值日基金资产净值 50%以上的</u></p>	<p>根据《流动性风险规定》第 24 条的规定补充应当暂停赎回的情形。</p>

		<p><u>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，基金管理人应当暂停接受基金申购赎回申请。</u></p>	
	<p>九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 (2) 部分延期赎回：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，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。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该类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。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。</p>	<p>九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 (2) 部分延期赎回：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，可对其余赎回申请延期办理。<u>若进行上述延期办理，对于单个基金份额持有人当日赎回申请超过上一开放日基金总份额 10%以上的部分，将自动进行延期办理。对于其余当日非自动延期办理的赎回申请，应当按单个账户非自动延期办理的赎回申请量占非自动延期办理的赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额。</u>对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。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该类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。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。</p>	<p>根据《流动性风险规定》第 21 条第 2 款的规定修改。</p>

第七部分 基金合同当事人及权利义务	二、基金托管人 (一) 基金托管人简况 法定代表人：姜建清	二、基金托管人 (一) 基金托管人简况 法定代表人：易会满	根据托管人实际情况修改。
第十二部分 基金的投资	二、投资范围 基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，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%。	二、投资范围 基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，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、应收申购款等。</u>	根据《流动性风险规定》第 18 条修改。
	四、投资限制 1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： (2) 本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券；	四、投资限制 1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： (2) 本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券， <u>其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</u>	根据《流动性风险规定》第 18 条修改。

无		<u>(5) 本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不超过该上市公司可流通股票的 15%；</u>	根据《流动性风险规定》第 15 条修改。
无		<u>(6) 本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不超过该上市公司可流通股票的 30%；</u>	根据《流动性风险规定》第 15 条修改。
无 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。法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。		<u>(17) 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> <u>(18) 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% ；</u> <u>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。</u> <u>除第 (2)、(14)、(17)、(18)，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</u>	根据《流动性风险规定》第 16、17 条修改。

		监会规定的特殊情形除外。法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。	
第十四部分 基金资产估值	三、估值方法 无	三、估值方法 <u>7、当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。</u>	根据《流动性风险规定》第 25 条补充完善估值方法。
	六、暂停估值的情形 1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； 2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时； 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投资人的利益，决定延迟估值； 5、中国证监会和基金合同认定的其它情形。	六、暂停估值的情形 1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； 2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时； 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投资人的利益，决定延迟估值； <u>4、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，基金管理人应当暂停基金估值；</u> 5、中国证监会和基金合同认定的其它情形。	根据《流动性风险规定》第 24 条补充暂停估值的情形。
第十八部分 基金	五、公开披露的基金信息 (六) 基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告	五、公开披露的基金信息 (六) 基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告	根据《流动性风险规定》第 26 条及第 27 条补充定期

<p>基金的信息披露</p>	<p>基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定媒介上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。</p> <p>基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定媒介上。</p> <p>基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定媒介上。</p> <p>《基金合同》生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。</p> <p>基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。</p>	<p>基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定媒介上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。</p> <p>基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定媒介上。</p> <p>基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定媒介上。</p> <p>《基金合同》生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。</p> <p>基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。</p> <p><u>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流动性风险分析等。</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，为保障其他投资者的权益，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>	<p>报告的内容。</p>
	<p>五、公开披露的基金信息</p>	<p>五、公开披露的基金信息</p>	<p>根据《流动性风险</p>

	<p>(七) 临时报告 无</p>	<p>(七) 临时报告 <u>26、本基金发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项；</u> <u>27、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；</u></p>	<p>规定》第 25、26 条补充临时报告的内容。</p>
--	-----------------------	---	-------------------------------

附件 8 《新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金托管协议修改前后文对照表》

章节	托管协议修改前版本	托管协议修改后版本	修改理由
一、 基金 托管 协议 当事 人	<p>(一) 基金管理人 …… 联系人：周虹</p>	<p>(一) 基金管理人 …… 联系人：周恒</p>	根据管理人实际情况修改。
一、 基金 托管 协议 当事 人	<p>(二) 基金托管人 …… 法定代表人：姜建清</p>	<p>(二) 基金托管人 …… 法定代表人：易会满</p>	根据托管人实际情况修改。
二、 基金 托管 协议 的依 据、 目的 和原 则	<p>订立本协议的依据是《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 7 号〈托管协议的内容与格式〉》、《新沃通盈灵活配置混合型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。</p>	<p>订立本协议的依据是《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 7 号〈托管协议的内容与格式〉》、《新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》（以下简称《基金合同》）、<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>《流动性风险管理规定》</u>”）及其他有关规定。</p>	补充本基金适用的法律依据。

三、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>1、</p> <p>本基金为混合型基金，基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%-95%；持有的权证合计市值占基金资产的比例为 0%-3%；保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。</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>1、</p> <p>本基金为混合型基金，基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%-95%；持有的权证合计市值占基金资产的比例为 0%-3%；保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计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、应收申购款等。</u></p>	<p>根据《流动性风险规定》第 18 条修改。</p>
	<p>2、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投资比例进行监督：</p> <p>(1) 按法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金的投资资产配置比例为：本基金股票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投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>(1) 按法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金的投资资产配置比例为：本基金股票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投资比例合计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、应收申购款等。</u></p>	<p>根据《流动性风险规定》第 18 条修改。</p>
	<p>(2) 根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金投资组合遵循以下投资限制：</p> <p>(3) 法规允许的基金投资比例调整期限 由于证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价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</p>	<p>1) 本基金的股票资产占基金资产的比例为 0%-95%； <u>2) 本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</u> 3) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%； 4) 本基金管理人管理且由本基金托管人托管的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的</p>	<p>根据《流动性风险规定》第 18 条修改。</p>

	<p>内，但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到规定的投资比例限制要求。法律法规另有规定的从其规定。</p>	<p>10%；</p> <p>5) 本基金管理人管理且由本基金托管人托管的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不超过该上市公司可流通股票的 15%；</p> <p>6) 本基金管理人管理且由本基金托管人托管的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不超过该上市公司可流通股票的 30%；</p> <p>7) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；</p> <p>8) 本基金管理人管理且由本基金托管人托管的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；</p> <p>9) 本基金管理人管理且由本基金托管人托管的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；</p> <p>10) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；</p> <p>11) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；</p> <p>12) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；</p> <p>13) 本基金财产参与股票发行申购，所申报的金额不超过本基金的总资产，所申报的股票数量不超过拟发</p>	<p>根据《流动性风险规定》第 15 条修改。</p> <p>根据业务实际情况修改。</p>
--	--	---	--

		<p>行股票公司本次发行股票的总量； <u>14) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不展期；</u> <u>15) 本基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；</u> (3) 法规允许的基金投资比例调整期限 <u>除 2)、12) 项外</u>，由于证券市场波动、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，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，以达到规定的投资比例限制要求外。法律法规另有规定的，从其规定。</p>	完善表述。
八、基金资产净值计算和会计核算	(二) 基金资产估值方法 无	(一) 基金资产估值方法 <u>(7) 当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。</u>	根据《流动性风险规定》第 25 条补充完善估值方法。
	(五) 基金定期报告的编制和复核 无	(五) 基金定期报告的编制和复核 <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。</u>	根据《流动性风险规定》第 26、27 条修改。

		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流动性风险分析等。	
--	--	---	--

附件 9 《新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新修改前后文对照表》

章节	修改前条款	修改后条款	修改理由
封面	2017 年第 2 号	2018 年第 1 号	
第一部分 前言	<p>一、序言</p> <p>本招募说明书依据《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》”）和其他有关法律、法规的规定，以及《新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。</p>	<p>一、序言</p> <p>本招募说明书依据《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》（以下简称“《流动性风险规定》”）</u>和其他有关法律、法规的规定，以及《新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。</p>	补充本基金适用的法律依据。
第二部分 释义	无	<u>13、《流动性风险规定》：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</u>	补充本基金适用的法律依据。
	无	<u>53、流动性受限资产：是指由于法律法规、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> <u>54、摆动定价机制：指当开放式基金遭遇大额申购赎回</u>	根据《流动性风险规定》第四十条，补充定义。

		<u>时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待</u>																									
第七部分 基金份额的 申购与 赎回	五、申购与赎回的数额限制 无。	三、申购与赎回的数额限制 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。	根据《流动性风险规定》第 19 条的规定补充。																								
	六、申购和赎回的价格、费用及用途 2、本基金的赎回费率如下： <table border="1" data-bbox="297 746 1079 1007"> <thead> <tr> <th>持续持有期</th> <th>赎回费率</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>1 日~7 日（含）</td> <td>1.50%</td> </tr> <tr> <td>8 日~30 日（含）</td> <td>0.75%</td> </tr> <tr> <td>31 日~365 日（含）</td> <td>0.50%</td> </tr> <tr> <td>366 日~730 日（含）</td> <td>0.25%</td> </tr> <tr> <td>731 日以上（含）</td> <td>0.00%</td> </tr> </tbody> </table> <p>赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对持有期内的投资人收取的赎回费全额计入基金财产。</p>	持续持有期	赎回费率	1 日~7 日（含）	1.50%	8 日~30 日（含）	0.75%	31 日~365 日（含）	0.50%	366 日~730 日（含）	0.25%	731 日以上（含）	0.00%	六、申购和赎回的价格、费用及用途 2、本基金的赎回费率如下： <table border="1" data-bbox="1108 746 1872 1007"> <thead> <tr> <th>持续持有期</th> <th>赎回费率</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>1 日~7 日（含）</td> <td>1.50%</td> </tr> <tr> <td>8 日~30 日（含）</td> <td>0.75%</td> </tr> <tr> <td>31 日~365 日（含）</td> <td>0.50%</td> </tr> <tr> <td>366 日~730 日（含）</td> <td>0.25%</td> </tr> <tr> <td>731 日以上（含）</td> <td>0.00%</td> </tr> </tbody> </table> <p>赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对持有期内的投资人收取的赎回费全额计入基金财产。本基金对持续持有期少于7日的投资者收取不低于1.5%的赎回费并全额计入基金财产。法律法规或监管机构另有规定的从其规定。</p>	持续持有期	赎回费率	1 日~7 日（含）	1.50%	8 日~30 日（含）	0.75%	31 日~365 日（含）	0.50%	366 日~730 日（含）	0.25%	731 日以上（含）	0.00%	根据《流动性风险规定》第 23 条补充强制赎回费的规定。
	持续持有期	赎回费率																									
1 日~7 日（含）	1.50%																										
8 日~30 日（含）	0.75%																										
31 日~365 日（含）	0.50%																										
366 日~730 日（含）	0.25%																										
731 日以上（含）	0.00%																										
持续持有期	赎回费率																										
1 日~7 日（含）	1.50%																										
8 日~30 日（含）	0.75%																										
31 日~365 日（含）	0.50%																										
366 日~730 日（含）	0.25%																										
731 日以上（含）	0.00%																										
六、申购和赎回的价格、费用及用途 无	六、申购和赎回的价格、费用及用途 9、当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采	根据《流动性风险规																									

		<p><u>用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。</u></p>	<p>定》第 25 条补充摆动定价机制的适用情形。</p>
	<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。</p> <p>……</p> <p>无</p> <p>……</p> <p>发生上述第 1、2、3、5、6、7 项暂停申购情形之一且基金管理人决定拒绝或暂停接受投资人的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。</p>	<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。<u>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，基金管理人应当暂停接受基金申购申请。</u></p> <p><u>3、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本基金基金份额的比例达到或者超过本基金总份额的 50%，或者变相规避前述 50%集中度的情形。</u></p> <p>……</p> <p>5、基金管理人接受某笔或某些申购申请会损害现有基金份额持有人利益<u>或对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响。</u></p> <p>……</p> <p>发生上述第 1、2、3、<u>4</u>、6、7、<u>8</u>项暂停申购情形之一且基金管理人决定拒绝或暂停接受投资人的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。在暂停申购的情况消除</p>	<p>根据《流动性风险规定》第 24、19 条补充应当暂停申购的情形。</p>

	<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 无</p>	<p>时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。</p> <p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 <u>6、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，基金管理人应当暂停接受基金申购赎回申请。</u></p>	<p>根据《流动性风险规定》第 24 条的规定补充暂停赎回的情形。</p>
	<p>九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 (2) 部分延期赎回：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，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。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。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。部分延期赎回不受单笔赎回最低份额的限制。</p>	<p>九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 (2) 部分延期赎回：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，可对其余赎回申请延期办理。<u>若进行上述延期办理，对于单个基金份额持有人当日的赎回申请超过上一开放日基金总份额 10%以上的部分，将自动进行延期办理。对于其余当日非自动延期办理的赎回申请，应当按单个账户非自动延期办理的赎回申请量占非自动延期赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。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</u></p>	<p>根据《流动性风险规定》第 21 条第 2 款的规定修改。</p>

		计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。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。部分延期赎回不受单笔赎回最低份额的限制。	
第八部分 基金的投资	二、投资范围 本基金为混合型基金，基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%-95%；持有的权证合计市值占基金资产的比例为 0%-3%；保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。	二、投资范围 本基金为混合型基金，基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%-95%；持有的权证合计市值占基金资产的比例为 0%-3%；保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计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、应收申购款等。</u>	根据《流动性风险规定》第 18 条修改。
	五、投资限制 1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： （2）本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；	五、投资限制 1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： （2）本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券； <u>其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</u>	根据《流动性风险规定》第 18 条修改。
	无	<u>（5）本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不超过该上市公司可流通股票的 15%；</u>	根据《流动性风险规定》第 15 条修改。
	无	<u>（6）本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不超过该上市公司可流通股票的 30%；</u>	根据《流动性风险规定》第 15 条修改。

	<p>因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、股权分置改革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。法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。</p>	<p><u>(17) 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> <u>(18) 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% ；</u> <u>除第 (2)、(14)、(17)、(18)，</u>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。法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。</p>	<p>根据《流动性风险规定》第 16、17 条修改。</p>
<p>第十一部分 基金资产估值</p>	<p>三、估值方法 无</p>	<p>三、估值方法 <u>7、当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。</u></p>	<p>根据《流动性风险规定》第 25 条补充完善估值方法。</p>
	<p>六、暂停估值的情形 无</p>	<p>六、暂停估值的情形 <u>4、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，基金管理人应当暂停基金估值；</u></p>	<p>根据《流动性风险规定》第 24 条补充暂停估值的情形。</p>

第十五部分基金的信息披露	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>(六) 基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告</p> <p>.....</p> <p>无</p>	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>(六) 基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告</p> <p>.....</p> <p><u>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流动性风险分析等。</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，为保障其他投资者的权益，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>	<p>根据《流动性风险规定》第 26 条及第 27 条补充定期报告的内容。</p>
	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>(七) 临时报告</p> <p>无</p>	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>(七) 临时报告</p> <p><u>26、本基金发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；</u></p> <p><u>27、基金管理人采用摆动定价机制进行估值时；</u></p>	<p>根据《流动性风险规定》第 25、26 条补充临时报告的内容</p>