

## 华泰柏瑞基金管理有限公司

### 关于旗下 54 只证券投资基金修改基金合同和托管协议的公告

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》”）以及相关基金合同和托管协议的有关规定，经与基金托管人协商一致，并报上海证监局备案，华泰柏瑞基金管理有限公司（以下简称“本公司”）决定对本公司旗下的54只证券投资基金的基金合同和托管协议进行修订。本次修订内容自2018年3月31日起生效。本次修订系因相应的法律法规发生变动而应当进行的必要修改，且对基金份额持有人的利益无实质性不利影响，不需召开基金份额持有人大会。现将有关修订内容进行公告。

一、为确保本公司旗下的54只证券投资基金的基金合同符合《流动性风险规定》的规定，本公司根据《流动性风险规定》对基金的申购与赎回、基金的投资范围和投资限制、基金资产估值、基金的信息披露等方面的内容进行了修订。54只证券投资基金的托管协议涉及前述修改内容的亦作相应修改。基金合同和托管协议的修订详见附件《华泰柏瑞基金管理有限公司旗下54只证券投资基金基金合同和托管协议修改对照表》。本次修订涉及的54只证券投资基金如下：

	基金全称		基金全称
1	华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金	28	华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金
2	华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金	29	华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金
3	华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金	30	华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金
4	华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金	31	华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金
5	华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金	32	华泰柏瑞睿利灵活配置混合型证券投资基金
6	华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金	33	华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金
7	华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金	34	华泰柏瑞生物医药灵活配置混合型证券投资基金

	基金全称		基金全称
8	华泰柏瑞富利灵活配置混合型证券投资基金	35	华泰柏瑞盛利灵活配置混合型证券投资基金
9	华泰柏瑞行业竞争优势灵活配置混合型证券投资基金	36	华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金
10	华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金	37	华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金
11	华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	38	华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金
12	华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金	39	华泰柏瑞享利灵活配置混合型证券投资基金
13	华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金	40	华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金
14	华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金	41	华泰柏瑞新经济沪港深灵活配置混合型证券投资基金
15	华泰柏瑞激励动力灵活配置混合型证券投资基金	42	华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金
16	华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金	43	华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金
17	华泰柏瑞价值精选 30 灵活配置混合型证券投资基金	44	华泰柏瑞兴利灵活配置混合型证券投资基金
18	华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金	45	华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金
19	华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金	46	华泰柏瑞中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金
20	华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金	47	华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金
21	华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金	48	华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金
22	华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金	49	华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
23	华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金	50	华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
24	华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金	51	华泰柏瑞上证红利交易型开放式指数证券投资基金
25	华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金	52	华泰柏瑞货币市场证券投资基金
26	华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金	53	华泰柏瑞天添宝货币市场基金
27	华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金	54	华泰柏瑞交易型货币市场基金

二、其中，《流动性风险规定》中规定“对除货币市场基金与交易型开放式指数基金以外的开放式基金，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，并将上述赎回费全额计入基金财产”，因而本次修订的部分基金的赎回费率及赎回费计入基金财产比例将进行相应调整。本公司将从2018年3月31日起对以下基金持有期少于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，即2018年3月30日15:00之前的赎回申请，适用调整前的赎回费规则，2018年3月30日15:00之后的赎回申请，适用调整后的赎回费规则。转换业务涉及的转出基金赎回费率等事项按上述规则进行调整。

	基金全称		基金全称
1	华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金	25	华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金
2	华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金	26	华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金
3	华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金	27	华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金
4	华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金	28	华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金
5	华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金	29	华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金
6	华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金	30	华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金
7	华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金	31	华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金
8	华泰柏瑞富利灵活配置混合型证券投资基金	32	华泰柏瑞睿利灵活配置混合型证券投资基金
9	华泰柏瑞行业竞争优势灵活配置混合型证券投资基金	33	华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金
10	华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金	34	华泰柏瑞生物医药灵活配置混合型证券投资基金
11	华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	35	华泰柏瑞盛利灵活配置混合型证券投资基金
12	华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金	36	华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金
13	华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金	37	华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金
14	华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金	38	华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金
15	华泰柏瑞激励动力灵活配置混合型证券投资基金	39	华泰柏瑞享利灵活配置混合型证券投资基金
16	华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金	40	华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金
17	华泰柏瑞价值精选 30 灵活配置混合型证券投资基金	41	华泰柏瑞新经济沪港深灵活配置混合型证券投资基金
18	华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金	42	华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金
19	华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金	43	华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金
20	华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金	44	华泰柏瑞兴利灵活配置混合型证券投资基金
21	华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金	45	华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金
22	华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金	46	华泰柏瑞中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金

	基金全称		基金全称
23	华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金	47	华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金
24	华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金		

### 重要提示

本公司将于公告当日，将修改后的 54 只证券投资基金的《基金合同》、《托管协议》登载于公司网站。

本公告构成 54 只证券投资基金《招募说明书》的补充，基金管理人将在届时更新招募说明书时一并更新以上内容。

投资者可通过本基金管理人的网站：[www.huatai-pb.com](http://www.huatai-pb.com) 或客户服务电话：400-888-0001、（021）38784638 了解详情。

风险提示：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。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。基金管理人提醒投资者，投资者投资于基金前应认真阅读基金合同、招募说明书等文件。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

华泰柏瑞基金管理有限公司

2018 年 3 月 23 日

## 《华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>第一部分 前言</b>	
<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》”)……《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》”)……《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。</p>
<b>第二部分 释义</b>	
无	<p><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></p> <p><u>50、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>
<b>第六部分 基金份额的申购与赎回</b>	
<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>无</p>	<p>五、申购和赎回的数量限制</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，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</u></p>

<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用……</p>	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示，<u>其中对持续持有期少于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</u>。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用……</p>
<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>……</p> <p>发生上述第1、2、3、<del>5</del>、6、7项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时……</p>	<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>……</p> <p><u>5、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><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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。</u></p> <p>发生上述第1、2、3、6、7、<u>8、9</u>项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时……</p>
<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>……</p> <p>发生上述1、2、3、5、6、7项情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时……</p>	<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>……</p> <p><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>发生上述1、2、3、5、6、7、<u>8</u>项情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时……</p>
<p>九、巨额赎回的情形及处理方式</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 无</p>	<p>2、巨额赎回的处理方式 <u>(3) 若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 20%，基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出 20%的赎回申请实施延期办理。而对该单个基金份额持有人 20%以内（含 20%）的赎回申请，基金管理人根据前述“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。如下一开放日，该单一基金份额持有人剩余未赎回部分仍旧超出前述比例约定的，继续按前述规则处理，直至该单一基金份额持有人单个开放日内申请赎回的基金份额占上一开放日基金总份额的比例低于前述比例。</u></p>
<p><b>第七部分 基金合同当事人及权利义务</b></p>	
<p>一、基金管理人 (一) 基金管理人简况 住所：<del>上海浦东新区</del>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层-<del>(200135)</del> 法定代表人：<b>齐亮</b> 二、基金托管人 (一) 基金托管人简况 住所：<del>上海市浦东新区</del>银城中路 168 号 注册资本：人民币 <del>54.04</del> 亿元</p>	<p>一、基金管理人 (一) 基金管理人简况 住所：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 法定代表人：<u>贾波</u> 二、基金托管人 (一) 基金托管人简况 住所：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>银城中路 168 号 注册资本：人民币 <u>78.06</u> 亿元</p>
<p><b>第十二部分 基金的投资</b></p>	
<p>二、投资范围 ..... 本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规</p>	<p>二、投资范围 ..... 本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；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，现金<u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；权证、股指期货及其他</p>

定执行。	金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。
<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p>	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(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，现金（<u>不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>）和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p> <p><u>(18) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；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，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；</u></p> <p><u>(19) 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，本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>(20) 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>
因证券、期货市场波动、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。	<u>除上述第（2）、（12）、（19）、（20）项外</u> ，因证券、期货市场波动、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。
<b>第十四部分 基金资产估值</b>	
<p>六、暂停估值的情形</p> <p>无</p>	<p>六、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的，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) 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>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>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></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>(七) 临时报告</p> <p>无</p>	<p>(七) 临时报告</p> <p><u>27、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></p>

注：基金合同内容摘要涉及上述内容的一并修改。

## 《华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金托管协议》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>一、基金托管协议当事人</b>	
<p>(一) 基金管理人 住所：<del>上海浦东新区</del>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 办公地址：<del>上海浦东新区</del>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 法定代表人：<b>齐亮</b></p> <p>(二) 基金托管人 住所：<del>上海市浦东新区</del>银城中路 168 号 办公地址：<del>上海市浦东新区</del>银城中路 168 号 注册资本：人民币 <del>54.04</del> 亿元</p>	<p>(一) 基金管理人 住所：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 办公地址：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 法定代表人：<u>贾波</u></p> <p>(二) 基金托管人 住所：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>银城中路 168 号 办公地址：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>银城中路 168 号 注册资本：人民币 <u>78.06</u> 亿元</p>
<b>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</b>	
<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。…… 本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。</p>	<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。…… 本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；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，现金（<u>不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>）和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。</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</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</p>

<p>限进行监督： 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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p> <p>因证券、期货市场波动、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>限进行监督： 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，现金（<u>不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>）和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%； <u>18. 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；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，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；</u> <u>19. 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，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u> <u>20. 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><u>除上述第 2、12、19、20 项外</u>，因证券、期货市场波动、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>八、基金资产净值计算和会计核算</b></p>	
<p>（四）暂停估值与公告基金份额净值的情形 无</p>	<p>（四）暂停估值与公告基金份额净值的情形 <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，</u></p>

经与基金托管人协商一致的，基金管理人应当暂停基金估值；

## 《华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>第一部分 前言</b>	
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》”）……《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》”）……《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>《流动性风险规定》</u> ”）和其他有关法律法规。
<b>第二部分 释义</b>	
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> <u>50、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>
<b>第六部分 基金份额的申购与赎回</b>	
五、申购和赎回的数量限制	七、申购和赎回的数量限制

<p>无</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，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</u></p>
<p>八、申购和赎回的价格、费用及其用途 3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书，赎回金额单位为元。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用……</p>	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途 3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书，赎回金额单位为元。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示，<u>其中对持续持有期少于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。</u>赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用……</p>
<p>七、拒绝或暂停申购的情形 …… 6、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术保障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。 发生上述第1、2、3、<del>5</del>、6、7项暂停申购情形且基金管理人决定暂停申购时……</p>	<p>七、拒绝或暂停申购的情形 …… <u>5、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> <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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。</u> 8、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。 发生上述第1、2、3、6、7、<u>8、9</u>项暂停申购情形且基金管理人决定暂停申购时……</p>

<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 .....</p> <p>发生上述 1、2、3、5、6、7 项暂停赎回情形且基金管理人决定暂停赎回时.....</p>	<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 .....</p> <p><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>发生上述 1、2、3、5、6、7、<u>8</u> 项暂停赎回情形且基金管理人决定暂停赎回时.....</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>无</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><u>(3) 若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 20%，基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出 20%的赎回申请实施延期办理。而对该单个基金份额持有人 20%以内（含 20%）的赎回申请，基金管理人根据前述“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。如下一开放日，该单一基金份额持有人剩余未赎回部分仍旧超出前述比例约定的，继续按前述规则处理，直至该单一基金份额持有人单个开放日内申请赎回的基金份额占上一开放日基金总份额的比例低于前述比例。</u></p>
<p><b>第七部分 基金合同当事人及权利义务</b></p>	
<p>一、基金管理人</p> <p>（一）基金管理人简况</p> <p>住所：<del>上海浦东新区</del>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层<del>（200135）</del></p>	<p>一、基金管理人</p> <p>（一）基金管理人简况</p> <p>住所：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层</p>

<p>法定代表人：<b>齐亮</b></p> <p>二、基金托管人</p> <p>（一）基金托管人简况</p> <p>法定代表人：<b>田国立</b></p> <p>注册资本：人民币<b>贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟捌佰肆拾捌万壹仟玖佰叁拾捌元整</b></p>	<p>法定代表人：<b>贾波</b></p> <p>二、基金托管人</p> <p>（一）基金托管人简况</p> <p>法定代表人：<b>陈四清</b></p> <p>注册资本：人民币<b>贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整</b></p>
<p><b>第十二部分 基金的投资</b></p>	
<p>二、投资范围</p> <p>.....</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金持有的股票占基金资产的比例为0%-95%，其中投资于创新动力主题相关的证券资产不低于非现金基金资产的80%；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，本基金保留的现金或者到期日在1年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值5%。</p>	<p>二、投资范围</p> <p>.....</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金持有的股票占基金资产的比例为0%-95%，其中投资于创新动力主题相关的证券资产不低于非现金基金资产的80%；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，本基金保留的现金（<u>不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>）或者到期日在1年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值5%。</p>
<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>（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，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；</p>	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>（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，本基金保持不低于基金资产净值5%的现金（<u>不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>）或者到期日在一年以内的政府债券；</p> <p><u>（21）本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的15%；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，不得超过该上市公司可流通股票的30%；</u></p> <p><u>（22）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</u></p>

	<p><u>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，本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>(23)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>因证券、期货市场波动、上市公司合并、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。法律法规另有规定的，从其规定。</p>	<p><u>除上述第（2）、（12）、（22）、（23）项外，</u>因证券、期货市场波动、上市公司合并、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。法律法规另有规定的，从其规定。</p>
<p><b>第十四部分 基金资产估值</b></p>	
<p>六、暂停估值的情形</p> <p>无</p>	<p>六、暂停估值的情形</p> <p><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一致的，基金管理人应当暂停基金估值；</u></p>
<p><b>第十八部分 基金的信息披露</b></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>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>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</u></p>



	<u>特有风险。</u> <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>
(七) 临时报告 无	(七) 临时报告 <u>27、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>

注：基金合同内容摘要涉及上述内容的一并修改。

## 《华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金托管协议》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>一、托管协议当事人</b>	
<p>(一) 基金管理人（或简称“管理人”） 住所：<del>上海浦东新区</del>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号<del>楼</del>17 层 法定代表人：<b>齐亮</b></p> <p>(二) 基金托管人（或简称“托管人”） 法定代表人：<del>田国立</del> 注册资本：人民币<del>贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟捌佰肆拾捌万壹仟玖佰叁拾捌</del>元整</p>	<p>(一) 基金管理人（或简称“管理人”） 住所：<b>中国（上海）自由贸易试验区</b>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 法定代表人：<b>贾波</b></p> <p>(二) 基金托管人（或简称“托管人”） 法定代表人：<b>陈四清</b> 注册资本：人民币<del>贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟捌佰肆拾捌万壹仟玖佰叁拾捌</del><b>肆拾壹</b>元整</p>
<b>二、托管协议的依据、目的、原则和解释</b>	
<p>(一) 依据 本协议依据《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》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）及其他有关法律法规与《华泰柏瑞创新动力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》”）订立。</p>	<p>(一) 依据 本协议依据《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>及其他有关法律法规与《华泰柏瑞创新动力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》”）订立。</p>
<b>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</b>	
<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包</p>	<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包</p>

<p>括以下方面：</p> <p>1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。……</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金持有的股票占基金资产的比例为0%-95%，其中投资于创新动力主题相关的证券资产不低于非现金基金资产的80%；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，本基金保留的现金或者到期日在1年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值5%。</p>	<p>括以下方面：</p> <p>1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。……</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金持有的股票占基金资产的比例为0%-95%，其中投资于创新动力主题相关的证券资产不低于非现金基金资产的80%；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，本基金保留的现金<u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>或者到期日在1年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值5%。</p>
<p>2、对基金投融资比例进行监督：</p> <p>（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，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；</p> <p>因证券、期货市场波动、上市公司合并、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。法律法规另有规定的，从其规定。</p>	<p>2、对基金投融资比例进行监督：</p> <p>（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，本基金保持不低于基金资产净值5%的现金<u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>或者到期日在一年以内的政府债券；</p> <p><u>（21）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持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的15%；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，不得超过该上市公司可流通股票的30%；</u></p> <p><u>（22）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，本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>（23）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；本基金管理人承诺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</u></p>

	<p><u>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,并承担由于不一致所导致的风险和损失;</u></p> <p><u>除上述第(2)、(12)、(22)、(23)项外,</u>因证券、期货市场波动、上市公司合并、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。法律法规另有规定的,从其规定。</p>
--	---

## 《华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金基金合同》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>第一部分 前言</b>	
<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》”)……《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》”)……《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。</p>
<b>第二部分 释义</b>	
无	<p><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></p>

	<p><u>50、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>
<p><b>第六部分 基金份额的申购与赎回</b></p>	
<p>五、申购和赎回的数量限制 无</p>	<p>九、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，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</u></p>
<p>十、申购和赎回的价格、费用及其用途 3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书，赎回金额单位为元。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用……</p>	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途 3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书，赎回金额单位为元。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示，<u>其中对持续持有期少于 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</u>。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用……</p>
<p>七、拒绝或暂停申购的情形 …… 发生上述第 1、2、3、<del>5</del>—6、7 项暂停申购情形且基金管理人决定暂停申购时……</p>	<p>七、拒绝或暂停申购的情形 …… <u>5、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> <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，基金管理人应当采取暂停接受基金申</u></p>

	<p><u>购申请的措施。</u></p> <p>发生上述第 1、2、3、6、7、<u>8、9</u> 项暂停申购情形且基金管理人决定暂停申购时……</p>
八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 ……	<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 ……</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>
九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 无	<p>九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式</p> <p><u>(3) 若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 20%，基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出 20%的赎回申请实施延期办理。而对该单个基金份额持有人 20%以内（含 20%）的赎回申请，基金管理人根据前述“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。如下一开放日，该单一基金份额持有人剩余未赎回部分仍旧超出前述比例约定的，继续按前述规则处理，直至该单一基金份额持有人单个开放日内申请赎回的基金份额占上一开放日基金总份额的比例低于前述比例。</u></p>
<b>第七部分 基金合同当事人及权利义务</b>	
一、基金管理人 (一) 基金管理人简况 住所： <u>上海浦东新区</u> 民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17	一、基金管理人 (一) 基金管理人简况 住所： <u>中国（上海）自由贸易试验区</u> 民生路 1199 弄上海证大五道

<p><del>层(200135)</del>          法定代表人: <b>齐亮</b>          二、基金托管人          (一) 基金托管人简况          法定代表人: <b>田国立</b>          注册资本: 人民币<b>贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟捌佰肆拾捌万壹仟玖佰叁拾捌</b>元整</p>	<p>口广场 1 号 17 层          法定代表人: <b>贾波</b>          二、基金托管人          (一) 基金托管人简况          法定代表人: <b>陈四清</b>          注册资本: 人民币<b>贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹</b>元整</p>
<p><b>第十二部分 基金的投资</b></p>	
<p>二、投资范围          .....          基金的投资组合比例为: 本基金持有的股票占基金资产的比例为 30%-95%, 其中投资于创新升级主题相关的上市公司股票不低于非现金基金资产的 80%; 债券、权证、货币市场工具以及证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5%-70%, 其中, 每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后, 本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在 1 年以内的政府债券。</p>	<p>二、投资范围          .....          基金的投资组合比例为: 本基金持有的股票占基金资产的比例为 30%-95%, 其中投资于创新升级主题相关的上市公司股票不低于非现金基金资产的 80%; 债券、权证、货币市场工具以及证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5%-70%, 其中, 每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后, 本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金(<u>不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>)或者到期日在 1 年以内的政府债券。</p>
<p>四、投资限制          1、组合限制          (3) 每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后, 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;</p>	<p>四、投资限制          1、组合限制          (3) 每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后, 本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金(<u>不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>)或者到期日在一年以内的政府债券;  <u>(21) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票, 不得超过该上市公司可流通股票的 15%; 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</u></p>

	<p><u>得超过该上市公司可流通股票的 30%；</u></p> <p><u>(22)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，本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>(23)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>
因证券、期货市场波动、上市公司合并、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。法律法规另有规定的，从其规定。	<u>除上述第 (3)、(13)、(22)、(23) 项外，</u> 因证券、期货市场波动、上市公司合并、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。法律法规另有规定的，从其规定。
<b>第十四部分 基金资产估值</b>	
六、暂停估值的情形 无	<p>六、暂停估值的情形</p> <p><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一致的，基金管理人应当暂停基金估值；</u></p>
<b>第十八部分 基金的信息披露</b>	
<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>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>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</u></p>



	<p>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。</p> <p>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。</p>
<p>(七) 临时报告</p> <p>无</p>	<p>(七) 临时报告</p> <p>27、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;</p>

注：基金合同内容摘要涉及上述内容的一并修改。

## 《华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金托管协议》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>一、托管协议当事人</b>	
<p>(一) 基金管理人(或简称“管理人”)</p> <p>住所: <del>上海浦东新区</del>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号楼 17 层</p> <p>法定代表人: <del>齐亮</del></p> <p>(二) 基金托管人(或简称“托管人”)</p> <p>法定代表人: <del>田国立</del></p> <p>注册资本: 人民币<del>贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟捌佰肆拾捌万壹仟玖佰叁拾捌</del>元整</p>	<p>(一) 基金管理人(或简称“管理人”)</p> <p>住所: <u>中国(上海)自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层</p> <p>法定代表人: <u>贾波</u></p> <p>(二) 基金托管人(或简称“托管人”)</p> <p>法定代表人: <u>陈四清</u></p> <p>注册资本: 人民币<del>贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹</del>元整</p>
<b>二、托管协议的依据、目的、原则和解释</b>	

<p>(一) 依据 本协议依据《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》”）、《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》”）及其他有关法律法规与《华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）订立。</p>	<p>(一) 依据 本协议依据《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》”）、《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》</u>及其他有关法律法规与《华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）订立。</p>
<p><b>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</b></p>	
<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面： 1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。…… 本基金持有的股票占基金资产的比例为 30%-95%，其中投资于创新升级主题相关的上市公司股票不低于非现金基金资产的 80%；债券、权证、货币市场工具以及证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5%-70%，其中，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后，本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在 1 年以内的政府债券。</p>	<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面： 1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。…… 本基金持有的股票占基金资产的比例为 30%-95%，其中投资于创新升级主题相关的上市公司股票不低于非现金基金资产的 80%；债券、权证、货币市场工具以及证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5%-70%，其中，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后，本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金<u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>或者到期日在 1 年以内的政府债券。</p>
<p>2、对基金投融资比例进行监督： (3) 每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后，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；</p>	<p>2、对基金投融资比例进行监督： (3) 每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后，本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金<u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>或者到期日在一年以内的政府债券； <u>(21) 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</u></p>

基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在十个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。

持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；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，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

(22)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，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(23)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；本基金管理人承诺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，并承担由于不一致所导致的风险和损失；

除上述第（3）、（13）、（22）、（23）项外，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在十个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。

## 《华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>第一部分 前言</b>	
<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》”)……《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》”)……《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>《流动性风险规定》</u>”)和其他有关法律法规。</p>
<b>第二部分 释义</b>	
无	<p><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></p> <p><u>52、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，因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等</u></p>
<b>第六部分 基金份额的申购与赎回</b>	
<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>无</p>	<p>十一、申购和赎回的数量限制</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</u></p>

	<u>保护存量基金份额持有人的合法权益,具体规定请参见招募说明书或相关公告。</u>
<p>十二、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>3、赎回金额的计算及处理方式:本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定,并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额的基金份额净值并扣除相应的费用……</p>	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>3、赎回金额的计算及处理方式:本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定,并在招募说明书中列示,<u>其中对持续持有期少于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。</u>赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额的基金份额净值并扣除相应的费用……</p>
<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>……</p> <p>发生上述第1、2、3、<del>5</del>、6、7项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时……</p>	<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>……</p> <p><u>5、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><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,基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。</u></p> <p>发生上述第1、2、3、6、7、<u>8、9</u>项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时……</p>
<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>……</p> <p>发生上述1、2、3、5、6项情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时……</p>	<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>……</p> <p><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>

	发生上述 1、2、3、5、6、7 项情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时……
九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 无	九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 <u>(3) 若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 20%，基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出 20% 的赎回申请实施延期办理。而对该单个基金份额持有人 20% 以内（含 20%）的赎回申请，基金管理人根据前述“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。如下一开放日，该单一基金份额持有人剩余未赎回部分仍旧超出前述比例约定的，继续按前述规则处理，直至该单一基金份额持有人单个开放日内申请赎回的基金份额占上一开放日基金总份额的比例低于前述比例。</u>
<b>第七部分 基金合同当事人及权利义务</b>	
一、基金管理人 (一) 基金管理人简况 住所： <del>上海浦东新区</del> 民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层- <del>(200135)</del> 法定代表人： <b>齐亮</b> 二、基金托管人 (一) 基金托管人简况 注册资本： <del>190.52</del> 亿元人民币	一、基金管理人 (一) 基金管理人简况 住所： <u>中国（上海）自由贸易试验区</u> 民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 法定代表人： <u>贾波</u> 二、基金托管人 (一) 基金托管人简况 注册资本： <u>207.74</u> 亿元人民币
<b>第十二部分 基金的投资</b>	
二、投资范围	二、投资范围

<p>.....</p> <p>本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>.....</p> <p>本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；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，现金<u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>
<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p>	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(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，现金<u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p> <p><u>(13)本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；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，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；</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 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，本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基金合同约定的投资范围保持一致；</u></p>
<p>因证券、期货市场波动、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>除上述第（2）、（14）、（15）项外</u>，因证券、期货市场波动、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</p>

	有规定的，从其规定。
<b>第十四部分 基金资产估值</b>	
六、暂停估值的情形 无	六、暂停估值的情形 <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的，基金管理人应当暂停基金估值；</u>
<b>第十八部分 基金的信息披露</b>	
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 ..... <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有风险。</u> <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>
(七) 临时报告 无	(七) 临时报告 <u>28、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>

注：基金合同内容摘要涉及上述内容的一并修改。



## 《华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金托管协议》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>一、基金托管协议当事人</b>	
<p>(一) 基金管理人            注册地址：<u>上海浦东新区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层            办公地址：<u>上海浦东新区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层            法定代表人：<b>齐亮</b></p> <p>(二) 基金托管人            注册资本：<del>190.52</del>亿元人民币</p>	<p>(一) 基金管理人            注册地址：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层            办公地址：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层            法定代表人：<b>贾波</b></p> <p>(二) 基金托管人            注册资本：<u>207.74</u>亿元人民币</p>
<b>二、基金托管协议的依据、目的和原则</b>	
<p>(一) 订立托管协议的依据            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》”）、《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》”）等有关法律法规、《华泰柏瑞鼎利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》”）及其他有关规定制订。</p>	<p>(一) 订立托管协议的依据            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》”）、《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》</u>等有关法律法规、《华泰柏瑞鼎利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》”）及其他有关规定制订。</p>
<b>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</b>	
<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>(一) 基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权            ……</p>

<p>本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；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，现金<u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>和到期日在一年以内的政府债券的投资比例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股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p> <p>因证券、期货市场波动、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>（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>（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，现金<u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p> <p><u>（13）本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；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，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；</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 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，本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基金合同约定的投资范围保持一致；</u></p> <p><u>除上述第（2）、（14）、（15）项外，</u>因证券、期货市场波动、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</p>

	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。
<b>八、基金资产净值计算和会计核算</b>	
(四) 暂停估值与公告的情形 无	(四) 暂停估值与公告的情形 <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的，基金管理人应当暂停基金估值；</u>

## 《华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>第一部分 前言</b>	
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》”)……《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》”)……《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。
<b>第二部分 释义</b>	
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> <u>50、流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等</u>

	<u>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>
<b>第六部分 基金份额的申购与赎回</b>	
五、申购和赎回的数量限制 无	十三、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，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</u>
十四、申购和赎回的价格、费用及其用途 3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用……	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示， <u>其中对持续持有期少于 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。</u> 赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用……
七、拒绝或暂停申购的情形 …… 6、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术保障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。  发生上述第 1、2、3、 <del>5</del> 、6、7 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时……	七、拒绝或暂停申购的情形 …… <u>5、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> <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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。</u>

	<p><u>8</u>、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术<b>故障</b>等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。</p> <p>发生上述第 1、2、3、6、7、<u>8</u>、<u>9</u> 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时……</p>
<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 ……</p> <p>发生上述 1、2、3、5、6 项情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时……</p>	<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 ……</p> <p><u>6</u>、<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>发生上述 1、2、3、5、6、<u>7</u> 项情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时……</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 无</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</p> <p><u>(3) 若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 20%，基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出 20%的赎回申请实施延期办理。而对该单个基金份额持有人 20%以内（含 20%）的赎回申请，基金管理人根据前述“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。如下一开放日，该单一基金份额持有人剩余未赎回部分仍旧超出前述比例约定的，继续按前述规则处理，直至该单一基金份额持有人单个开放日内申请赎回的基金</u></p>

	<u>份额占上一开放日基金总份额的比例低于前述比例。</u>
<b>第七部分 基金合同当事人及权利义务</b>	
<p>一、基金管理人  (一) 基金管理人简况  住所：<del>上海浦东新区</del>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 <del>(200135)</del>  法定代表人：<b>齐亮</b></p> <p>二、基金托管人  (一) 基金托管人简况  法定代表人：<b>王洪章</b></p>	<p>一、基金管理人  (一) 基金管理人简况  住所：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层  法定代表人：<b>贾波</b></p> <p>二、基金托管人  (一) 基金托管人简况  法定代表人：<b>田国立</b></p>
<b>第十二部分 基金的投资</b>	
<p>二、投资范围  .....  本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%；其中，基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>二、投资范围  .....  本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%；其中，基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；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，现金 <u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>
<p>四、投资限制  1、组合限制  (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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p>	<p>四、投资限制  1、组合限制  (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，现金 <u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；  <u>(19) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管</u></p>

	<p>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,不得超过该上市公司可流通股票的 30%;</p> <p><u>(20)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,本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>(21)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>因证券、期货市场波动、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>除上述第(2)、(12)、(20)、(21)项外</u>,因证券、期货市场波动、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>第十四部分 基金资产估值</b></p>	
<p>六、暂停估值的情形</p> <p>无</p>	<p>六、暂停估值的情形</p> <p><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一致的,基金管理人应当暂停基金估值;</u></p>
<p><b>第十八部分 基金的信息披露</b></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>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>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</u></p>

	<p><u>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></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>(七) 临时报告 无</p>	<p>(七) 临时报告 <u>27、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></p>

注：基金合同内容摘要涉及上述内容的一并修改。

## 《华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金托管协议》条款修改对照表

修改前	修改后
<p><b>一、基金托管协议当事人</b></p>	
<p>(一) 基金管理人 注册地址：<del>上海浦东新区</del>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 办公地址：<del>上海浦东新区</del>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 法定代表人：<b>齐亮</b></p>	<p>(一) 基金管理人 注册地址：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 办公地址：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 法定代表人：<u>贾波</u></p>



<p>(二) 基金托管人 法定代表人: <u>王洪章</u></p>	<p>(二) 基金托管人 法定代表人: <u>田国立</u></p>
<p><b>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</b></p>	
<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定,对基金投资范围、投资对象进行监督。…… 本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%; 其中, 基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%; 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, 现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定,对基金投资范围、投资对象进行监督。…… 本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%; 其中, 基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%; 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, 现金 <u>(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)</u> 和到期日在一年以内的政府债券的投资比例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: 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, 现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%; 16. 本基金持有的所有流通受限证券, 其公允价值不得超过本基金资产净值的 <b>20%</b>; 本基金持有的同一流通受限证券, 其公允价值不得超过本基金资产净值的 10%;  因证券、期货市场波动、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>(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: 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, 现金 <u>(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)</u> 和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%; 16. 本基金持有的所有流通受限证券, 其公允价值不得超过本基金资产净值的 <b>15%</b>; 本基金持有的同一流通受限证券, 其公允价值不得超过本基金资产净值的 10%; <u>19. 本基金管理人管理的且由本托管人托管的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票, 不得超过该上市公司可流通股票的 15%; 本基金管理人管理的且由本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, 不得超过该上市公司可流通股票的 30%;</u> <u>20. 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</u></p>

	<p>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，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p><u>21. 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><u>除上述第 2、12、20、21 项外</u>，因证券、期货市场波动、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>
八、基金资产净值计算和会计核算	
（四）暂停估值与公告基金份额净值的情形 无	<p>（四）暂停估值与公告基金份额净值的情形</p> <p><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一致的，基金管理人应当暂停基金估值；</u></p>

## 《华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金基金合同》条款修改对照表

修改前	修改后
第一部分 前言	
一、订立本基金合同的目的、依据和原则	一、订立本基金合同的目的、依据和原则

<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》”)……《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>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》”)……《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>《流动性风险规定》</u>”)和其他有关法律法规。</p>
<p><b>第二部分 释义</b></p>	
<p>无</p>	<p>13、<u>《流动性风险规定》</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</p> <p>50、<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)、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</p>
<p><b>第六部分 基金份额的申购与赎回</b></p>	
<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>无</p>	<p>五、申购和赎回的数量限制</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，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</u></p>
<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书，赎回金额单位为元。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘</p>	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书，赎回金额单位为元。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示，<u>其中对持续持有期少于 7 日的投资者收取</u></p>

<p>以当日该类份额的基金份额净值并扣除相应的费用……</p>	<p><u>不低于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产</u>。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类份额的基金份额净值并扣除相应的费用……</p>
<p>七、拒绝或暂停申购的情形 ……</p> <p><b>6</b>、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术保障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。</p> <p>发生上述第 1、2、3、<del>5</del>、6、7 项暂停申购情形且基金管理人决定暂停申购时……</p>	<p>七、拒绝或暂停申购的情形 ……</p> <p><u>5、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><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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。</u></p> <p><b>8</b>、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。</p> <p>发生上述第 1、2、3、6、7、<u>8、9</u> 项暂停申购情形且基金管理人决定暂停申购时……</p>
<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 ……</p> <p><b>5</b>、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术保障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。</p>	<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 ……</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><b>6</b>、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无</p>

	法正常运行。
九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 无	九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 <u>(3) 若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 20%，基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出 20%的赎回申请实施延期办理。而对该单个基金份额持有人 20%以内（含 20%）的赎回申请，基金管理人根据前述“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。如下一开放日，该单一基金份额持有人剩余未赎回部分仍旧超出前述比例约定的，继续按前述规则处理，直至该单一基金份额持有人单个开放日内申请赎回的基金份额占上一开放日基金总份额的比例低于前述比例。</u>
<b>第七部分 基金合同当事人及权利义务</b>	
一、基金管理人 (一) 基金管理人简况 住所： <del>上海浦东新区</del> 民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 法定代表人： <b>齐亮</b> 二、基金托管人 (一) 基金托管人简况 法定代表人： <b>田国立</b> 注册资本：人民币 <b>贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍</b> 元整	一、基金管理人 (一) 基金管理人简况 住所： <u>中国（上海）自由贸易试验区</u> 民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 法定代表人： <b>贾波</b> 二、基金托管人 (一) 基金托管人简况 法定代表人： <b>陈四清</b> 注册资本：人民币 <b>贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹</b> 元整
<b>第十二部分 基金的投资</b>	
二、投资范围	二、投资范围

<p>.....</p> <p>本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，股票等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，现金或到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>.....</p> <p>本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，股票等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，现金<u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>或到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。</p>
<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(3) 现金或到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；</p>	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(3) 现金<u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>或到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；</p> <p><u>(15) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；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，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；</u></p> <p><u>(16) 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，本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>(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></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，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规另有规定的，从其规定。</p>	<p><u>除上述第 (3)、(11)、(16)、(17) 项外</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。法律法规另有规定的，从其规定。</p>
<p><b>第十四部分 基金资产估值</b></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一致的，基金管理人应当暂停基金估值；</u></p>
<p><b>第十八部分 基金的信息披露</b></p>	
<p>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 .....</p>	<p>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 ..... <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有风险。</u> <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>(七) 临时报告 无</p>	<p>(七) 临时报告 <u>28、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></p>

注：基金合同内容摘要涉及上述内容的一并修改。

## 《华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金托管协议》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>一、托管协议当事人</b>	
<p>(一) 基金管理人（或简称“管理人”） 住所：<u>上海浦东新区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 法定代表人：<u>齐亮</u></p> <p>(二) 基金托管人（或简称“托管人”） 法定代表人：<u>田国立</u> 注册资本：人民币<u>贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍</u>元整</p>	<p>(一) 基金管理人（或简称“管理人”） 住所：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 法定代表人：<u>贾波</u></p> <p>(二) 基金托管人（或简称“托管人”） 法定代表人：<u>陈四清</u> 注册资本：人民币<u>贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹</u>元整</p>
<b>二、托管协议的依据、目的、原则和解释</b>	
<p>(一) 依据 本协议依据《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》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）及其他有关法律法规与《华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）订立。</p>	<p>(一) 依据 本协议依据《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>及其他有关法律法规与《华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）订立。</p>
<b>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</b>	
<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包</p>	<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包</p>



<p>括以下方面： 1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。 ..... 本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，股票等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，现金或到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>括以下方面： 1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。 ..... 本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，股票等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，现金<u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>或到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。</p>
<p>2、对基金投融资比例进行监督： (3) 现金或到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；  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。法律法规另有规定的，从其规定。</p>	<p>2、对基金投融资比例进行监督： (3) 现金<u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>或到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%； <u>(15) 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持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；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，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；</u> <u>(16) 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，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u> <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；本基金管理人承诺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，并承担由于不一致所导致的风险和损失；</u></p>

	除上述第（3）、（11）、（16）、（17）项外，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。法律法规另有规定的，从其规定。
<b>八、基金资产净值计算和会计核算</b>	
（一）基金资产净值的计算和复核 9、暂停估值的情形 无	（一）基金资产净值的计算和复核 9、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一致的，基金管理人应当暂停基金估值；</u>

## 《华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金基金合同》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>第一部分 前言</b>	
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》”）……《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》”）……《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“《流动性风险规定》”）和其他有关法律法规。
<b>第二部分 释义</b>	

<p>无</p>	<p>13、<u>《流动性风险规定》</u>：指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《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</p> <p>50、<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)、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</p>
<p><b>第六部分 基金份额的申购与赎回</b></p>	
<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>无</p>	<p>十五、申购和赎回的数量限制</p> <p>4、<u>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，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</u></p>
<p>十六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>3、<u>赎回金额的计算及处理方式</u>：本基金赎回金额的计算详见《招募说明书》，赎回金额单位为元。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用……</p>	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>3、<u>赎回金额的计算及处理方式</u>：本基金赎回金额的计算详见《招募说明书》，赎回金额单位为元。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示，<u>其中对持续持有期少于 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</u>。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用……</p>
<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>……</p>	<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>……</p> <p>5、<u>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</u></p>

<p>发生上述第 1、2、3、<del>5</del>、6 项暂停申购情形时……</p>	<p><u>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>  <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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。</u></p> <p>发生上述第 1、2、3、6、7、8 项暂停申购情形时……</p>
<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形        ……</p>	<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形        ……</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>九、巨额赎回的情形及处理方式        2、巨额赎回的处理方式        无</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</p> <p><u>(3) 若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 20%，基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出 20%的赎回申请实施延期办理。而对该单个基金份额持有人 20%以内（含 20%）的赎回申请，基金管理人根据前述“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。如下一开放日，该单一基金份额持有人剩余未赎回部分仍旧超出前述比例约定的，继续按前述规则处理，直至该单一基金份额持有人单个开放日内申请赎回的基金份额占上一开放日基金总份额的比例低于前述比例。</u></p>
<p>第七部分 基金合同当事人及权利义务</p>	

<p>一、基金管理人  (一) 基金管理人简况  住所：<u>上海浦东新区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层  法定代表人：<u>齐亮</u></p> <p>二、基金托管人  (一) 基金托管人简况  法定代表人：<u>姜建清</u>  注册资本：人民币 <u>349,018,545,827</u> 元</p>	<p>一、基金管理人  (一) 基金管理人简况  住所：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层  法定代表人：<u>贾波</u></p> <p>二、基金托管人  (一) 基金托管人简况  法定代表人：<u>易会满</u>  注册资本：人民币 <u>349,321,234,600</u> 元</p>
<p><b>第十二部分 基金的投资</b></p>	
<p>二、投资范围  .....  基金的投资组合比例为：债券资产占基金资产的比例不低于 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，本基金持有的现金及到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%。</p>	<p>二、投资范围  .....  基金的投资组合比例为：债券资产占基金资产的比例不低于 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，本基金持有的现金 <u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u> 及到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%。</p>
<p>四、投资限制  1、组合限制  (2) 本基金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，应当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  (2) 本基金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，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金 <u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u> 或者到期日在一年以内的政府债券；  <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 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本款所规定比例限制的，本基金管理人</u></p>

	<p><u>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基金合同约定的投资范围保持一致；</u></p>
因证券、期货市场波动、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。法律法规另有规定的,从其规定。	<u>除上述第(2)、(8)、(14)、(15)项外,</u> 因证券、期货市场波动、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。法律法规另有规定的,从其规定。
<b>第十四部分 基金资产估值</b>	
六、暂停估值的情形 无	<p>六、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的,基金管理人应当暂停基金估值；</u></p>
<b>第十八部分 基金的信息披露</b>	
<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>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>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></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>(七) 临时报告 无</p>	<p>(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；</u></p>
-----------------------	---

注：基金合同内容摘要涉及上述内容的一并修改。

## 《华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金托管协议》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>一、基金托管协议当事人</b>	
<p>(一) 基金管理人 住所：<del>上海浦东新区</del>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 <del>(200135)</del> 法定代表人：<b>齐亮</b></p> <p>(二) 基金托管人 法定代表人：<b>姜建清</b> 注册资本：人民币 <del>349,018,545,827</del> 元</p>	<p>(一) 基金管理人 住所：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 法定代表人：<b>贾波</b></p> <p>(二) 基金托管人 法定代表人：<b>易会满</b> 注册资本：人民币 <u>349,321,234,600</u> 元</p>
<b>二、基金托管协议的依据、目的和原则</b>	
<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</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</p>

<p>《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〉》、《华泰柏瑞丰盛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。</p>	<p>《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〉》、<u>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</u>、《华泰柏瑞丰盛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。</p>
<p><b>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</b></p>	
<p>(一) 基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权 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融资比例进行监督： (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：债券资产占基金资产的比例不低于 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，本基金持有的现金及到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 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 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融资比例进行监督： (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：债券资产占基金资产的比例不低于 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，本基金持有的现金<u>(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)</u>及到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%。</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： 2) 本基金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，应当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>(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： 2) 本基金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，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金<u>(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)</u>或者到期日在一年以内的政府债券； <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 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本款所规定比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u> <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基金</u></p>



	<u>合同约定的投资范围保持一致。</u>
(3) 法规允许的基金投资比例调整期限 由于证券、期货市场波动、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，以达到规定的投资比例限制要求。法律法规另有规定的从其规定。	(3) 法规允许的基金投资比例调整期限 <u>除上述第 2)、8)、14)、15) 项外</u> ，由于证券、期货市场波动、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，以达到规定的投资比例限制要求。法律法规另有规定的从其规定。

## 《华泰柏瑞富利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>第一部分 前言</b>	
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》”）……《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》”）……《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>《流动性风险规定》</u> ”）和其他有关法律法规。
<b>第二部分 释义</b>	
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> <u>50、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</u>

	<p>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</p>
<p><b>第六部分 基金份额的申购与赎回</b></p>	
<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>无</p>	<p>十七、申购和赎回的数量限制</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，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</u></p>
<p>十八、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用……</p>	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示，<u>其中对持续持有期少于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。</u>赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用……</p>
<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>……</p> <p>发生上述第1、2、3、<del>5</del>、6、7项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时……</p>	<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>……</p> <p><u>5、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><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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。</u></p>

	发生上述第 1、2、3、6、7、 <u>8、9</u> 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时……
八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… 发生上述 1、2、3、5、6 项情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时……	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>  发生上述 1、2、3、5、6、 <u>7</u> 项情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时……
九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 无	九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 <u>(3) 若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 20%，基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出 20%的赎回申请实施延期办理。而对该单个基金份额持有人 20%以内（含 20%）的赎回申请，基金管理人根据前述“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。如下一开放日，该单一基金份额持有人剩余未赎回部分仍旧超出前述比例约定的，继续按前述规则处理，直至该单一基金份额持有人单个开放日内申请赎回的基金份额占上一开放日基金总份额的比例低于前述比例。</u>
<b>第七部分 基金合同当事人及权利义务</b>	
二、基金托管人 (一) 基金托管人简况	二、基金托管人 (一) 基金托管人简况

法定代表人： <u>王洪章</u>	法定代表人： <u>田国立</u>
<b>第十二部分 基金的投资</b>	
<p>二、投资范围</p> <p>.....</p> <p>本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>二、投资范围</p> <p>.....</p> <p>本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；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，现金（<u>不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>）和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>
<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>（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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p>	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>（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，现金（<u>不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>）和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p> <p><u>（18）本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；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，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；</u></p> <p><u>（19）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，本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>（20）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>
因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管	<u>除上述第（2）、（12）、（19）、（20）项外</u> ，因证券、期货市

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。	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。
<b>第十四部分 基金资产估值</b>	
六、暂停估值的情形 无	六、暂停估值的情形 <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的，基金管理人应当暂停基金估值；</u>
<b>第十八部分 基金的信息披露</b>	
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 ..... <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有风险。</u> <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>
(七) 临时报告 无	(七) 临时报告 <u>27、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>

注：基金合同内容摘要涉及上述内容的一并修改。

## 《华泰柏瑞富利灵活配置混合型证券投资基金托管协议》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>一、基金托管协议当事人</b>	
(二) 基金托管人 法定代表人： <b>王洪章</b>	(二) 基金托管人 法定代表人： <b>田国立</b>
<b>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</b>	
<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。……</p> <p>本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。……</p> <p>本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；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，现金<b>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</b>和到期日在一年以内的政府债券的投资比例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股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p> <p>(12) 本基金持有的所有流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的 <b>20%</b>；本基金持有的同一流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的 10%；</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>(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，现金<b>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</b>和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p> <p>(12) 本基金持有的所有流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的 <b>15%</b>；本基金持有的同一流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的 10%；</p> <p><b><u>(15) 本基金管理人管理的且由本托管人托管的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股</u></b></p>
因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管	

<p>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>票的 15%；本基金管理人管理的且由本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，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；</u></p> <p><u>(16)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，本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>(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></p> <p><u>除上述第（2）、（9）、（16）、（17）项外，</u>因证券、期货市场波动、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>八、基金资产净值计算和会计核算</b></p>	
<p>（四）暂停估值与公告基金份额净值的情形 无</p>	<p>（四）暂停估值与公告基金份额净值的情形 <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的，基金管理人应当暂停基金估值；</u></p>

## 《华泰柏瑞行业竞争优势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>第一部分 前言</b>	
<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》”)……《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》”)……《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。</p>
<b>第二部分 释义</b>	
无	<p><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></p> <p><u>50、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>
<b>第六部分 基金份额的申购与赎回</b>	
<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>无</p>	<p>十九、申购和赎回的数量限制</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，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</u></p>



<p>二十、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用……</p>	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示，<u>其中对持续持有期少于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</u>。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用……</p>
<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>……</p> <p>6、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术保障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。</p> <p>发生上述第1、2、3、<del>5</del>、6、7项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时……</p>	<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>……</p> <p><u>5、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><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、基金托管人、销售机构或登记机构的技术故障</u>等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。</p> <p>发生上述第1、2、3、6、7、<u>8、9</u>项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时……</p>
<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>……</p> <p>发生上述1、2、3、5、6、7项情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时……</p>	<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>……</p> <p><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，基金管理人应当采取延缓支付赎回款</u></p>

	<p><u>项或暂停接受基金赎回申请的措施。</u></p> <p>发生上述 1、2、3、5、6、7、<u>8</u> 项情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时……</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>无</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><u>(3) 若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 20%，基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出 20%的赎回申请实施延期办理。而对该单个基金份额持有人 20%以内（含 20%）的赎回申请，基金管理人根据前述“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。如下一开放日，该单一基金份额持有人剩余未赎回部分仍旧超出前述比例约定的，继续按前述规则处理，直至该单一基金份额持有人单个开放日内申请赎回的基金份额占上一开放日基金总份额的比例低于前述比例。</u></p>
<p><b>第七部分 基金合同当事人及权利义务</b></p>	
<p>一、基金管理人</p> <p>（一）基金管理人简况</p> <p>住所：<del>上海浦东新区</del>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层-<del>(200135)</del></p> <p>法定代表人：<b>齐亮</b></p> <p>二、基金托管人</p> <p>（一）基金托管人简况</p> <p>法定代表人：<b>田国立</b></p> <p>注册资本：人民币<b>贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖</b></p>	<p>一、基金管理人</p> <p>（一）基金管理人简况</p> <p>住所：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层</p> <p>法定代表人：<b>贾波</b></p> <p>二、基金托管人</p> <p>（一）基金托管人简况</p> <p>法定代表人：<b>陈四清</b></p> <p>注册资本：人民币<b>贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆</b></p>

拾伍元整	拾壹元整
<b>第十二部分 基金的投资</b>	
<p>二、投资范围</p> <p>.....</p> <p>本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%，投资于具有行业竞争优势的公司发行的证券占非现金基金资产的比例不低于 80%；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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>二、投资范围</p> <p>.....</p> <p>本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%，投资于具有行业竞争优势的公司发行的证券占非现金基金资产的比例不低于 80%；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，现金 <u>(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)</u> 和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>
<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p>	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(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，现金 <u>(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)</u> 和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p> <p><u>(22) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；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，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；</u></p> <p><u>(23) 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，本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>(24) 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>因证券、期货市场波动、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>除上述第（2）、（12）、（23）、（24）项外</u>，因证券、期货市场波动、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>第十四部分 基金资产估值</b></p>	
<p>六、暂停估值的情形 无</p>	<p>六、暂停估值的情形 <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的，基金管理人应当暂停基金估值；</u></p>
<p><b>第十八部分 基金的信息披露</b></p>	
<p>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 .....</p>	<p>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 ..... <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> <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>（七）临时报告 无</p>	<p>（七）临时报告 <u>27、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></p>

注：基金合同内容摘要涉及上述内容的一并修改。

## 《华泰柏瑞行业竞争优势灵活配置混合型证券投资基金托管协议》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>一、托管协议当事人</b>	
<p>(一) 基金管理人（或简称“管理人”） 住所：<del>上海浦东新区</del>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号楼 17 层 法定代表人：<b>齐亮</b></p> <p>(二) 基金托管人（或简称“托管人”） 法定代表人：<del>田国立</del> 注册资本：人民币<b>贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍</b>元整</p>	<p>(一) 基金管理人（或简称“管理人”） 住所：<b>中国（上海）自由贸易试验区</b>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 法定代表人：<b>贾波</b></p> <p>(二) 基金托管人（或简称“托管人”） 法定代表人：<b>陈四清</b> 注册资本：人民币<b>贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹</b>元整</p>
<b>二、托管协议的依据、目的、原则和解释</b>	
<p>(一) 依据 本协议依据《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》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）及其他有关法律法规与《华泰柏瑞行业竞争优势灵活配置混合型证券投资</p>	<p>(一) 依据 本协议依据《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>及其他有关法律</p>

<p>基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）订立。</p>	<p>法规与《华泰柏瑞行业竞争优势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》”）订立。</p>
<p><b>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</b></p>	
<p>（一）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面：</p> <p>1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。……</p> <p>本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%，投资于具有行业竞争优势的公司发行的证券占非现金基金资产的比例不低于 80%；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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>（一）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面：</p> <p>1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。……</p> <p>本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%，投资于具有行业竞争优势的公司发行的证券占非现金基金资产的比例不低于 80%；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，现金 <u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>
<p>2、对基金投融资比例进行监督：</p> <p>（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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p> <p>因证券、期货市场波动、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>2、对基金投融资比例进行监督：</p> <p>（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，现金 <u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p> <p><u>（22）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持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；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，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；</u></p> <p><u>（23）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，本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>(24)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;本基金管理人承诺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,并承担由于不一致所导致的风险和损失;</u></p> <p><u>除上述第(2)、(12)、(23)、(24)项外,</u>因证券、期货市场波动、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>
--	--

## 《华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金基金合同》条款修改对照表

修改前	修改后
<p><b>第一部分 前言和释义</b></p> <p><b>前 言</b> 为保护基金投资者合法权益,明确《基金合同》当事人的权利与义务,规范华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金(以下简称“本基金”或“基金”)运作,依照《中华人民共和国合同法》……《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>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</u></p>	<p><b>前 言</b> 为保护基金投资者合法权益,明确《基金合同》当事人的权利与义务,规范华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金(以下简称“本基金”或“基金”)运作,依照《中华人民共和国合同法》……《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</u></p>

格式》及其他有关规定……。	“《 <u>流动性风险规定</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</p> <p>无</p>	<p>释 义</p> <p><u>《流动性风险规定》</u> 指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《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</p> <p><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)、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</p>
<p><b>第五部分 基金份额的申购与赎回</b></p>	
<p>五、申购与赎回的数额限制</p> <p>无</p>	<p>二十一、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，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</u></p>
<p>二十二、申购费用和赎回费用</p> <p>4、本基金的申购费率、赎回费率和收费方式由基金管理人根据《基金合同》的规定确定并在招募说明书中列示。基金管理人可以根据《基金合同》的相关约定调整费率或收费方式……</p>	<p>六、申购费用和赎回费用</p> <p>4、本基金的申购费率、赎回费率和收费方式由基金管理人根据《基金合同》的规定确定并在招募说明书中列示，<u>其中对持续持有期少于 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。</u>基金管理人可以根据《基金合同》的相关约定调整费率或收费方式……</p>
<p>九、拒绝或暂停申购的情形及处理方式</p>	<p>九、拒绝或暂停申购的情形及处理方式</p>



<p>.....</p> <p>发生上述情形之一的，申购款项将全额退还投资者。发生上述（1）到（4）项暂停申购情形时，基金管理人应当在至少一家指定媒体及基金管理人网站刊登暂停申购公告。</p>	<p>.....</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暂停接受基金申购申请的措施；</u></p> <p><u>（7）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>发生上述情形之一的，申购款项将全额退还投资者。发生上述（1）到（5）项暂停申购情形时，基金管理人应当在至少一家指定媒体及基金管理人网站刊登暂停申购公告。</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>.....</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>.....</p> <p><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、巨额赎回的处理方式</p> <p>无</p>	<p>十一、 巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p><u>（3）若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 20%，基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出 20%的赎回申请实施延期办理。而对该单个基金份额持有人 20%以内（含 20%）的赎回申请，基金管理人根据前述“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。如下一开放日，该单一基金份</u></p>

	<p>额持有人剩余未赎回部分仍旧超出前述比例约定的,继续按前述规则处理,直至该单一基金份额持有人单个开放日内申请赎回的基金份额占上一开放日基金总份额的比例低于前述比例。</p>
<p><b>第六部分 基金合同当事人及权利义务</b></p>	
<p>一、基金管理人  (一) 基金管理人简况  住所: <u>上海浦东</u>民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号 17 层  法定代表人: <u>齐亮</u>  二、基金托管人  (一) 基金托管人简况  法定代表人: <u>姜建清</u>  注册资本: 人民币 <u>349,018,850,026</u> 元</p>	<p>一、基金管理人  (一) 基金管理人简况  住所: <u>中国(上海)自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄<u>上海</u>证大五道口广场 1 号 17 层  法定代表人: <u>贾波</u>  二、基金托管人  (一) 基金托管人简况  法定代表人: <u>易会满</u>  注册资本: 人民币 <u>349,321,234,600</u> 元</p>
<p><b>第十一部分 基金的投资</b></p>	
<p>二、投资范围  .....  本基金的投资组合比例为: 股票资产占基金资产的 60%—95%; 债券资产、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 5%—40%, 其中, 基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%, 基金保留的现金以及投资于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>二、投资范围  .....  本基金的投资组合比例为: 股票资产占基金资产的 60%—95%; 债券资产、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 5%—40%, 其中, 基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%, 基金保留的现金 <u>(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)</u> 以及投资于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>八、投资限制  (二) 投资组合限制</p>	<p>八、投资限制  (二) 投资组合限制</p>

<p>e、现金和到期日不超过 1 年的政府债券不低于基金资产净值的 5%；</p>	<p>e、<u>现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>和到期日不超过 1 年的政府债券不低于基金资产净值的 5%；  j、<u>本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；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，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；</u>  k、<u>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，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u>  l、<u>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>基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。由于证券市场波动、上市公司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>基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。由于证券市场波动、上市公司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，<u>上述第 e、k、l 项除外</u>。法律法规另有规定的从其规定。</p>
<p><b>第十三部分 基金资产估值</b></p>	
<p>七、暂停估值的情形 无</p>	<p>七、暂停估值的情形 <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的，基金管理人应当暂停基金估值；</u></p>
<p><b>第十七部分 基金的信息披露</b></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>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>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有风险。</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>(七) 临时报告</p> <p>无</p>	<p>(七) 临时报告</p> <p><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；</u></p>

注：基金合同内容摘要涉及上述内容的一并修改。

## 《华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金托管协议》条款修改对照表

修改前	修改后
<p>一、基金托管协议当事人</p>	
<p>(一) 基金管理人</p>	<p>(一) 基金管理人</p>

住所： <u>上海浦东新区</u> 民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 法定代表人： <u>齐亮</u> （二）基金托管人 法定代表人： <u>姜建清</u> 注册资本：人民币 <u>349,018,850,026</u> 元	住所： <u>中国（上海）自由贸易试验区</u> 民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 法定代表人： <u>贾波</u> （二）基金托管人 法定代表人： <u>易会满</u> 注册资本：人民币 <u>349,321,234,600</u> 元
<b>二、基金托管协议的依据、目的和原则</b>	
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》）、《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〉》、《华泰柏瑞行业领先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。	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》）、《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〉》、 <u>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</u> 、《华泰柏瑞行业领先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。
<b>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</b>	
（一）基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权 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融资比例进行监督： （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： 股票资产占基金资产的 60%—95%；债券资产、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 5%—40%，其中，基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%，基金保留的现金以及投资于到期日	（一）基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权 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融资比例进行监督： （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： 股票资产占基金资产的 60%—95%；债券资产、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 5%—40%，其中，基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%，基金保留的现金 <u>（不包括结算备付</u>

<p>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><u>金、存出保证金、应收申购款等</u>)以及投资于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>(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>e、现金和到期日不超过 1 年的政府债券不低于基金资产净值的 5%;</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>e、现金(不包括<u>结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>)和到期日不超过 1 年的政府债券不低于基金资产净值的 5%;</p> <p><u>j、本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票, 不得超过该上市公司可流通股票的 15%; 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, 不得超过该上市公司可流通股票的 30%;</u></p> <p><u>k、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, 本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>l、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>(3) 法规允许的基金投资比例调整期限</p> <p>基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。由于证券市场波动、上市公司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>(3) 法规允许的基金投资比例调整期限</p> <p>基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。由于证券市场波动、上市公司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, 以达到规定的投资比例限制要求, <u>上述第 e、k、l 项除外</u>。法律法规另有规定的从其规定。</p>

## 《华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>第一部分 前言和释义</b>	
<p><b>前 言</b>                      为保护基金投资者合法权益，明确《基金合同》当事人的权利与义务，规范华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下简称“本基金”或“基金”）运作，依照《中华人民共和国合同法》……《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》……。</p>	<p><b>前 言</b>                      为保护基金投资者合法权益，明确《基金合同》当事人的权利与义务，规范华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下简称“本基金”或“基金”）运作，依照《中华人民共和国合同法》……《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>、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》……。</p>
<p><b>释 义</b>                      无</p>	<p><b>释 义</b>  <u>《流动性风险规定》</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  <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）、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</p>
<b>第五部分 基金份额的申购、赎回与转换</b>	
<p>五、申购与赎回的数额限制                      无</p>	<p>二十三、申购与赎回的数额限制  <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</u></p>

	<u>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,具体规定请参见招募说明书或相关公告;</u>
二十四、申购费用和赎回费用 4、本基金的申购费率、赎回费率和收费方式由基金管理人根据《基金合同》的规定确定并在招募说明书中列示。基金管理人可以根据《基金合同》的相关约定调整费率或收费方式……	六、申购费用和赎回费用 4、本基金的申购费率、赎回费率和收费方式由基金管理人根据《基金合同》的规定确定并在招募说明书中列示,其中对持续持有期少于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。基金管理人可以根据《基金合同》的相关约定调整费率或收费方式……
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暂停或拒绝基金投资者的申购申请的,申购款项将全额退还投资者。发生上述(1)到(9)项暂停申购情形时,基金管理人应当在至少一家指定媒体刊登暂停申购公告。……	九、拒绝或暂停申购的情形及处理方式 …… <u>(9)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> 发生上述情形之一且基金管理人决定暂停或拒绝基金投资者的申购申请的,申购款项将全额退还投资者。发生上述(1)到(10)项暂停申购情形时,基金管理人应当在至少一家指定媒体刊登暂停申购公告。……
十、暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式 ……	十、暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式 …… <u>(9)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</u>



	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;
十一、 巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 无	十一、 巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 <u>(3) 若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 20%, 基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出 20%的赎回申请实施延期办理。而对该单个基金份额持有人 20%以内 (含 20%) 的赎回申请, 基金管理人根据前述“ (1) 全额赎回” 或“ (2) 部分延期赎回” 的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。如下一开放日, 该单一基金份额持有人剩余未赎回部分仍旧超出前述比例约定的, 继续按前述规则处理, 直至该单一基金份额持有人单个开放日内申请赎回的基金份额占上一开放日基金总份额的比例低于前述比例。</u>
<b>第六部分 基金合同当事人及权利义务</b>	
一、基金管理人 (一) 基金管理人简况 住所: <u>上海浦东新区</u> 民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层- <del>(200135)</del> 法定代表人: <u>齐亮</u> 二、基金托管人 (一) 基金托管人简况 法定代表人: <u>姜建清</u> 注册资本: 人民币 <del>349, 018, 545, 827</del> 元	一、基金管理人 (一) 基金管理人简况 住所: <u>中国 (上海) 自由贸易试验区</u> 民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 法定代表人: <u>贾波</u> 二、基金托管人 (一) 基金托管人简况 法定代表人: <u>易会满</u> 注册资本: 人民币 <u>349, 321, 234, 600</u> 元
<b>第十一部分 基金的投资</b>	
二、投资范围	二、投资范围

<p>.....</p> <p>正常情况下，本基金资产中投资于沪深 300ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；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%；股指期货以套期保值为目的，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。</p>	<p>.....</p> <p>正常情况下，本基金资产中投资于沪深 300ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；现金<u>(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)</u>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%；股指期货以套期保值为目的，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。</p>
<p>八、投资限制</p> <p>(二) 投资组合限制</p> <p>5、在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%，其中，有价证券指股票、目标 ETF、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票和目标 ETF 总市值的 20%；在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；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，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券；</p>	<p>八、投资限制</p> <p>(二) 投资组合限制</p> <p>5、在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%，其中，有价证券指股票、目标 ETF、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票和目标 ETF 总市值的 20%；在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；</p> <p><u>6、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，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或到期日在一年以内的政府债券；</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，本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</u></p>

	<u>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>
由于证券市场波动、上市公司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。	由于证券市场波动、上市公司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, <u>上述第 6、8、9 项除外</u> 。法律法规另有规定的从其规定。
<b>第十三部分 基金资产估值</b>	
七、暂停估值的情形 无	七、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一致的,基金管理人应当暂停基金估值;</u>
<b>第十七部分 基金的信息披露</b>	
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 ..... <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有风险。</u> <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>
(七) 临时报告 无	(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</u>

	<u>大事项:</u>
--	-------------

注：基金合同内容摘要涉及上述内容的一并修改。

## 《华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>一、基金托管协议当事人</b>	
(一) 基金管理人 住所： <del>上海浦东新区</del> 民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 <del>(200135)</del> 法定代表人： <b>齐亮</b> (二) 基金托管人 法定代表人： <b>姜建清</b> 注册资本：人民币 <b>349,018,545,827</b> 元	(一) 基金管理人 住所： <u>中国(上海)自由贸易试验区</u> 民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 法定代表人： <b>贾波</b> (二) 基金托管人 法定代表人： <b>易会满</b> 注册资本：人民币 <u>349,321,234,600</u> 元
<b>二、基金托管协议的依据、目的和原则</b>	
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》）、《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〉》、《交易型开放式指数证券投资基金（ETF）	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》）、《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〉》、《交易型开放式指数证券投资基金（ETF）

<p>联接基金审核指引》（以下简称《审核指引》）、《华泰柏瑞沪深300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》（以下简称《基金合同》）及其他有关规定。</p>	<p>联接基金审核指引》（以下简称《审核指引》）、<u>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</u>、《华泰柏瑞沪深300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》（以下简称《基金合同》）及其他有关规定。</p>
<p><b>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</b></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、基金托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，对下述基金投资范围、投资对象进行监督。</p> <p>.....</p> <p>正常情况下，本基金资产中投资于沪深 300ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；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%；股指期货以套期保值为目的，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。</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、基金托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，对下述基金投资范围、投资对象进行监督。</p> <p>.....</p> <p>正常情况下，本基金资产中投资于沪深 300ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；现金<u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>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%；股指期货以套期保值为目的，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。</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融资比例进行监督：</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：</p> <p>正常情况下，本基金资产中投资于沪深 300ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；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>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融资比例进行监督：</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：</p> <p>正常情况下，本基金资产中投资于沪深 300ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；现金<u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>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>（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>e、在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过</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>e、在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过</p>

<p>基金资产净值的 10%；在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%，其中，有价证券指股票、目标 ETF、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票和目标 ETF 总市值的 20%；在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；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，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券；</p> <p>由于证券市场波动、上市公司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>基金资产净值的 10%；在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%，其中，有价证券指股票、目标 ETF、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票和目标 ETF 总市值的 20%；在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；</p> <p><u>f、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，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券；</u></p> <p><u>h、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，本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>i、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>由于证券市场波动、上市公司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，<u>上述第 f、h、i 项除外</u>。法律法规另有规定的从其规定。</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、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之</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、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之</p>

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，以达到规定的投资比例限制要求。法律法规另有规定的从其规定。	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，以达到规定的投资比例限制要求， <u>上述第 f、h、i 项除外</u> 。法律法规另有规定的从其规定。
--	---

## 《华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>第一部分 前言</b>	
<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》”)……《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》”)……《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。</p>
<b>第二部分 释义</b>	
无	<p><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></p> <p><u>52、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、</u></p>

	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
<b>第六部分 基金份额的申购与赎回</b>	
五、申购和赎回的数量限制 无	二十五、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，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</u>
二十六、申购和赎回的价格、费用及其用途 3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额的基金份额净值并扣除相应的费用……	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示， <u>其中对持续持有期少于 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。</u> 赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额的基金份额净值并扣除相应的费用……
七、拒绝或暂停申购的情形 …… 6、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术保障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。  发生上述第 1、2、3、 <del>5</del> 、6、7 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时……	七、拒绝或暂停申购的情形 …… <u>5、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> <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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。</u> <u>8、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。</u>



	发生上述第 1、2、3、6、7、 <b>8、9</b> 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时……
八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… 发生上述 1、2、3、5、6、7 项情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时……	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… <b>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，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。</b>  发生上述 1、2、3、5、6、7、 <b>8</b> 项情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时……
九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 无	九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 <b><u>(3) 若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 20%，基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出 20%的赎回申请实施延期办理。而对该单个基金份额持有人 20%以内（含 20%）的赎回申请，基金管理人根据前述“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。如下一开放日，该单一基金份额持有人剩余未赎回部分仍旧超出前述比例约定的，继续按前述规则处理，直至该单一基金份额持有人单个开放日内申请赎回的基金份额占上一开放日基金总份额的比例低于前述比例。</u></b>
<b>第七部分 基金合同当事人及权利义务</b>	
一、基金管理人	一、基金管理人

<p>(一) 基金管理人简况 住所：<del>上海浦东新区</del>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层-<del>(200135)</del> 法定代表人：<del>齐亮</del></p> <p>二、基金托管人 (一) 基金托管人简况 法定代表人：<del>姜建清</del> 注册资本：人民币 <del>349,018,545,827</del> 元</p>	<p>(一) 基金管理人简况 住所：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 法定代表人：<u>贾波</u></p> <p>二、基金托管人 (一) 基金托管人简况 法定代表人：<u>易会满</u> 注册资本：人民币 <u>349,321,234,600</u> 元</p>
<p><b>第十二部分 基金的投资</b></p>	
<p>二、投资范围 ..... 本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>二、投资范围 ..... 本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；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，现金<u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>
<p>四、投资限制 1、组合限制 (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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p>	<p>四、投资限制 1、组合限制 (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，现金<u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%； <u>(18) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；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，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；</u> <u>(19) 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</u></p>

	<p><u>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，本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>(20)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>因证券、期货市场波动、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>除上述第（2）、（12）、（19）、（20）项外，</u>因证券、期货市场波动、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>第十四部分 基金资产估值</b></p>	
<p>六、暂停估值的情形</p> <p>无</p>	<p>六、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的，基金管理人应当暂停基金估值；</u></p>
<p><b>第十八部分 基金的信息披露</b></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>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>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</u></p>

	<u>特有风险。</u> <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>
(七) 临时报告 无	(七) 临时报告 <u>28、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>

注：基金合同内容摘要涉及上述内容的一并修改。

## 《华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金托管协议》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>一、基金托管协议当事人</b>	
(一) 基金管理人 住所： <del>上海浦东新区</del> 民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 <del>(200135)</del> 法定代表人： <b>齐亮</b> (二) 基金托管人 法定代表人： <b>姜建清</b> 注册资本：人民币 <del>349,018,545,827</del> 元	(一) 基金管理人 住所： <u>中国（上海）自由贸易试验区</u> 民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 法定代表人： <b>贾波</b> (二) 基金托管人 法定代表人： <b>易会满</b> 注册资本：人民币 <u>349,321,234,600</u> 元
<b>二、基金托管协议的依据、目的和原则</b>	
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	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

<p>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〉》、《华泰柏瑞惠利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>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〉》、<u>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</u>、《华泰柏瑞惠利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><b>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</b></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>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融资比例进行监督:</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:</p> <p>本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%; 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, 现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例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>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融资比例进行监督:</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:</p> <p>本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%; 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, 现金<u>(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)</u>和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</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>b、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, 现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%;</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>b、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, 现金<u>(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)</u>和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%;</p> <p><u>r、本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票, 不得超过该上市公司可流通股票的 15%; 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, 不得</u></p>

	<p><u>超过该上市公司可流通股票的 30%；</u>  <u>s、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，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u>  <u>t、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>(3) 法规允许的基金投资比例调整期限  因证券、期货市场波动、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>(3) 法规允许的基金投资比例调整期限  <u>除上述第 b、l、s、t 项外</u>，因证券、期货市场波动、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>

## 《华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金基金合同》条款修改对照表

修改前	修改后
<p>一、前言</p> <p>(一) 订立《华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“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</p> <p>订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法通则》……《证券</p>	<p>(一) 订立《华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“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</p> <p>订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法通则》……《证券</p>

<p>投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）<b>和</b>《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）及其他法律法规的有关规定。</p>	<p>投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、<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>”）及其他法律法规的有关规定。</p>
<p><b>二、释义</b></p>	
<p>无</p>	<p><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《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>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）、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；</p>
<p><b>六、基金份额的申购、赎回与转换</b></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 <u>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，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</u></p>
<p>（七）申购和赎回的费用及其用途 3、本基金 A 类份额的赎回费率按照持有时间递减，即相关基金份额持有时间越长，所适用的赎回费率越低，赎回费用等于赎回金额乘以所适用的赎回费率。实际执行的赎回费率在招募说明书中载明。H 类份额的赎回费率在招募说明书或其他相关公告中载明。</p>	<p>（七）申购和赎回的费用及其用途 3、本基金 A 类份额的赎回费率按照持有时间递减，即相关基金份额持有时间越长，所适用的赎回费率越低，赎回费用等于赎回金额乘以所适用的赎回费率。实际执行的赎回费率在招募说明书中载明，<u>其中对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5%的赎回</u></p>

	<p><u>费并全额计入基金财产</u>。H类份额的赎回费率在招募说明书或其他相关公告中载明。</p>
<p>(九) 巨额赎回的认定及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 无</p>	<p>(九) 巨额赎回的认定及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 <u>(3) 若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 20%，基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出 20%的赎回申请实施延期办理。而对该单个基金份额持有人 20%以内（含 20%）的赎回申请，基金管理人根据前述“（1）接受全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。如下一开放日，该单一基金份额持有人剩余未赎回部分仍旧超出前述比例约定的，继续按前述规则处理，直至该单一基金份额持有人单个开放日内申请赎回的基金份额占上一开放日基金总份额的比例低于前述比例。</u></p>
<p>(十) 拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理 1、在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请： .....  基金管理人决定拒绝或暂停接受某些投资者的申购申请时，申购款项将退回投资者账户。基金管理人决定暂停接受申购申请时，应当依法公告。在暂停申购的情形消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理并予以公告。</p>	<p>(十) 拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理 1、在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请： ..... <u>(8) 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> <u>(9) 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>  基金管理人决定拒绝或暂停接受某些投资者的申购申请时，申购款</p>



	项将退回投资者账户。 <u>发生上述第（1）、（2）、（3）、（4）、（6）、（7）、（9）、（10）项情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，应当依法公告。在暂停申购的情形消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理并予以公告。</u>
2、在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请或延缓支付赎回款项： — .....	2、在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请或延缓支付赎回款项： ..... <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>
<b>八、基金合同当事人及其权利义务</b>	
<p>（一）基金管理人</p> <p>1、基金管理人基本情况</p> <p>住所：<del>上海浦东新区</del>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 <del>（200135）</del></p> <p>法定代表人：<b>齐亮</b></p> <p>（二）基金托管人</p> <p>1、基金托管人基本情况</p> <p>法定代表人：<b>肖钢</b></p> <p>注册资本：人民币<b>贰仟壹佰柒拾玖亿肆仟壹佰柒拾柒万捌仟零玖元</b></p>	<p>（一）基金管理人</p> <p>1、基金管理人基本情况</p> <p>住所：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层</p> <p>法定代表人：<b>贾波</b></p> <p>（二）基金托管人</p> <p>1、基金托管人基本情况</p> <p>法定代表人：<b>陈四清</b></p> <p>注册资本：人民币<b>贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整</b></p>
<b>十四、基金的投资</b>	
（二）投资范围 .....	（二）投资范围 .....

<p>基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 30%—95%；现金、债券资产、权证以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 5%—70%，其中，基金持有全部股改权证的市值不得超过基金资产净值的 3%，基金保留的现金以及投资于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>基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 30%—95%；现金、债券资产、权证以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 5%—70%，其中，基金持有全部股改权证的市值不得超过基金资产净值的 3%，基金保留的现金<u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>以及投资于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>（十）投资禁止行为与限制 2、基金投资组合比例限制 无</p>	<p>（十）投资禁止行为与限制 2、基金投资组合比例限制 <u>（6）本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；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，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；</u> <u>（7）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，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u> <u>（8）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>（十一）投资组合比例调整 基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。由于证券市场波动、上市公司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>（十一）投资组合比例调整 基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。由于证券市场波动、上市公司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，<u>上述第（7）、（8）项除外</u>。法律法规另有</p>

	规定的从其规定。
<b>十七、基金资产估值</b>	
(六) 暂停估值的情形 无	(六) 暂停估值的情形 <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的，基金管理人应当暂停基金估值；</u>
<b>二十一、基金的信息披露</b>	
(五) 定期报告 .....	(五) 定期报告 ..... <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> <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>
(六) 临时报告与公告 无	(六) 临时报告与公告 <u>27、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>

注：基金合同内容摘要涉及上述内容的一并修改。

## 《华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金托管协议》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>一、托管协议当事人</b>	
<p>(一) 基金管理人（或简称“管理人”） 住所：<u>上海市</u>民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号<u>楼</u>17 层 法定代表人：<u>齐亮</u></p> <p>(二) 基金托管人（或简称“托管人”） 法定代表人：<u>肖钢</u> 注册资本：人民币<u>贰仟壹佰柒拾玖亿肆仟壹佰柒拾柒万捌仟零玖元</u></p>	<p>(一) 基金管理人（或简称“管理人”） 住所：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄<u>上海</u>证大五道口广场 1 号 17 层 法定代表人：<u>贾波</u></p> <p>(二) 基金托管人（或简称“托管人”） 法定代表人：<u>陈四清</u> 注册资本：人民币<u>贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整</u></p>
<b>二、托管协议的依据、目的、原则和解释</b>	
<p>(一) 依据 本协议依据《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》”）、《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》”）及其他有关法律法规与《华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）订立。</p>	<p>(一) 依据 本协议依据《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》”）、《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》</u>及其他有关法律法规与《华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）订立。</p>
<b>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</b>	
<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。……</p>	<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。……</p>

2、对基金投融资比例进行监督。……  
无

2、对基金投融资比例进行监督。……

其中，基金托管人根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》对投资组合的比例做如下监督：

1) 现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

2) 本基金管理人管理的且由本托管人托管的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的且由本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，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

3) 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，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

4) 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；本基金管理人承诺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，并承担由于不一致所导致的风险和损失；

## 《华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金基金合同》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>第一部分 前言</b>	
<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》”)……《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》”)……《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。</p>
<b>第二部分 释义</b>	
无	<p><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></p> <p><u>50、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>
<b>第六部分 基金份额的申购与赎回</b>	
<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>无</p>	<p>二十七、申购和赎回的数量限制</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</u></p>

	<u>保护存量基金份额持有人的合法权益,具体规定请参见招募说明书或相关公告。</u>
二十八、申购和赎回的价格、费用及其用途 3、赎回金额的计算及处理方式:本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定,并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用……	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 3、赎回金额的计算及处理方式:本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定,并在招募说明书中列示, <u>其中对持续持有期少于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。</u> 赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用……
七、拒绝或暂停申购的情形 …… 6、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术保障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。  发生上述第1、2、3、 <del>5</del> 、6、7项暂停申购情形且基金管理人决定暂停申购时……	七、拒绝或暂停申购的情形 …… <u>5、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> <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,基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。</u> 8、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。  发生上述第1、2、3、6、7、 <u>8、9</u> 项暂停申购情形且基金管理人决定暂停申购时……
八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 ……	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</u>

<p>发生上述 1、2、3、5、6、7 项情形且基金管理人决定暂停赎回时……</p>	<p><u>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>发生上述 1、2、3、5、6、7、8 项情形且基金管理人决定暂停赎回时……</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 无</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 <u>(3) 若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 20%，基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出 20% 的赎回申请实施延期办理。而对该单个基金份额持有人 20% 以内（含 20%）的赎回申请，基金管理人根据前述“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。如下一开放日，该单一基金份额持有人剩余未赎回部分仍旧超出前述比例约定的，继续按前述规则处理，直至该单一基金份额持有人单个开放日内申请赎回的基金份额占上一开放日基金总份额的比例低于前述比例。</u></p>
<p><b>第七部分 基金合同当事人及权利义务</b></p>	
<p>一、基金管理人 (一) 基金管理人简况 住所：<del>上海浦东新区</del>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层<del>(200135)</del> 法定代表人：<b>齐亮</b> 二、基金托管人 (一) 基金托管人简况</p>	<p>一、基金管理人 (一) 基金管理人简况 住所：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 法定代表人：<u>贾波</u> 二、基金托管人 (一) 基金托管人简况</p>



法定代表人： <u>王洪章</u>	法定代表人： <u>田国立</u>
<b>第十二部分 基金的投资</b>	
<p>二、投资范围</p> <p>.....</p> <p>本基金股票资产的投资比例占基金资产的 80-95%；在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>二、投资范围</p> <p>.....</p> <p>本基金股票资产的投资比例占基金资产的 80-95%；在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金（<u>不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>）和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>
<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>（2）在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p>	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>（2）在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金（<u>不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>）和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p> <p><u>（22）本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；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，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；</u></p> <p><u>（23）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，本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>（24）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>
因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管	<u>除上述第（2）、（12）、（23）、（24）项外</u> ，因证券、期货市

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。法律法规另有规定的，从其规定。	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。法律法规另有规定的，从其规定。
<b>第十四部分 基金资产估值</b>	
六、暂停估值的情形 无	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一致的，基金管理人应当暂停基金估值；</u>
<b>第十八部分 基金的信息披露</b>	
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 ..... <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> <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>
(七) 临时报告 无	(七) 临时报告 <u>27、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>

注：基金合同内容摘要涉及上述内容的一并修改。

## 《华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金托管协议》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>一、基金托管协议当事人</b>	
<p>(一) 基金管理人            注册地址：<u>上海浦东新区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层            办公地址：<u>上海浦东新区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层            法定代表人：<u>齐亮</u></p> <p>(二) 基金托管人            法定代表人：<u>王洪章</u></p>	<p>(一) 基金管理人            注册地址：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层            办公地址：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层            法定代表人：<u>贾波</u></p> <p>(二) 基金托管人            法定代表人：<u>田国立</u></p>
<b>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</b>	
<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。……            本基金股票资产的投资比例占基金资产的 80-95%；在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。……            本基金股票资产的投资比例占基金资产的 80-95%；在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金（<u>不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>）和到期日在一年以内的政府债券的投资比例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：            (2) 在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例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：            (2) 在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金（<u>不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>）和到期日在一年以内的</p>

<p>(12) 本基金持有的所有流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的 <b>20%</b>；本基金持有的同一流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的 10%；</p> <p>因证券、期货市场波动、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。法律法规另有规定的，从其规定。</p>	<p>政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p> <p>(12) 本基金持有的所有流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的 <b>15%</b>；本基金持有的同一流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的 10%；</p> <p><u>(19)本基金管理人管理的且由本托管人托管的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的且由本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，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；</u></p> <p><u>(20)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，本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>(21)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>除上述第 (2)、(9)、(20)、(21) 项外，因证券、期货市场波动、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。法律法规另有规定的，从其规定。</p>
<p><b>八、基金资产净值计算和会计核算</b></p>	
<p>(四) 暂停估值与公告基金份额净值的情形</p> <p>无</p>	<p>(四) 暂停估值与公告基金份额净值的情形</p> <p><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，</u></p>

经与基金托管人协商一致的，基金管理人应当暂停基金估值；

## 《华泰柏瑞激励动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>第一部分 前言</b>	
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》”）……《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》”）……《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>《流动性风险规定》</u> ”）和其他有关法律法规。
<b>第二部分 释义</b>	
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> <u>52、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>
<b>第六部分 基金份额的申购与赎回</b>	
五、申购和赎回的数量限制	二十九、申购和赎回的数量限制

<p>无</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，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</u></p>
<p>三十、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额的基金份额净值并扣除相应的费用……</p>	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示，<u>其中对持续持有期少于 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。</u>赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额的基金份额净值并扣除相应的费用……</p>
<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>……</p> <p><b>5、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术保障</b>等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。</p> <p>发生上述第 1、2、3、<del>5</del>、6、7 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时……</p>	<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>……</p> <p><u>5、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><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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。</u></p> <p><b>7、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术故障</b>等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。</p> <p>发生上述第 1、2、3、6、7、<u>8、9</u> 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时……</p>

<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 .....</p> <p>发生上述 1、2、3、5、6、7 项情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时.....</p>	<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 .....</p> <p><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>发生上述 1、2、3、5、6、7、<u>8</u> 项情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时.....</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>无</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><u>(3) 若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 20%，基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出 20%的赎回申请实施延期办理。而对该单个基金份额持有人 20%以内（含 20%）的赎回申请，基金管理人根据前述“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。如下一开放日，该单一基金份额持有人剩余未赎回部分仍旧超出前述比例约定的，继续按前述规则处理，直至该单一基金份额持有人单个开放日内申请赎回的基金份额占上一开放日基金总份额的比例低于前述比例。</u></p>
<p><b>第七部分 基金合同当事人及权利义务</b></p>	
<p>一、基金管理人</p> <p>（一）基金管理人简况</p> <p>住所：<del>上海浦东新区</del>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层<del>（200135）</del></p>	<p>一、基金管理人</p> <p>（一）基金管理人简况</p> <p>住所：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层</p>

<p>法定代表人：<b>齐亮</b></p> <p>二、基金托管人</p> <p>（一）基金托管人简况</p> <p>法定代表人：<b>田国立</b></p> <p>注册资本：人民币<b>贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟捌佰肆拾捌万壹仟玖佰叁拾捌元整</b></p>	<p>法定代表人：<b>贾波</b></p> <p>二、基金托管人</p> <p>（一）基金托管人简况</p> <p>法定代表人：<b>陈四清</b></p> <p>注册资本：人民币<b>贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整</b></p>
<p><b>第十二部分 基金的投资</b></p>	
<p>二、投资范围</p> <p>.....</p> <p>本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%，其中投资于激励动力主题相关的证券资产不低于非现金基金资产的 80%；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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>二、投资范围</p> <p>.....</p> <p>本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%，其中投资于激励动力主题相关的证券资产不低于非现金基金资产的 80%；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，现金<b>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</b>和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>
<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>（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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p>	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>（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，现金<b>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</b>和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p> <p><b>（17）本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；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，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；</b></p> <p><b>（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</b></p>



	<p><u>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，本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>(19)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>因证券、期货市场波动、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>除上述第（2）、（12）、（18）、（19）项外，</u>因证券、期货市场波动、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>第十四部分 基金资产估值</b></p>	
<p>六、暂停估值的情形</p> <p>无</p>	<p>六、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的，基金管理人应当暂停基金估值；</u></p>
<p><b>第十八部分 基金的信息披露</b></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>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>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></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>
(七) 临时报告 无	(七) 临时报告 <u>28、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>

注：基金合同内容摘要涉及上述内容的一并修改。

## 《华泰柏瑞激励动力灵活配置混合型证券投资基金托管协议》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>一、托管协议当事人</b>	
(一) 基金管理人(或简称“管理人”) 住所： <del>上海浦东新区</del> 民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号楼 17 层 法定代表人： <b>齐亮</b> (二) 基金托管人(或简称“托管人”) 法定代表人： <b>田国立</b> 注册资本：人民币 <b>贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟捌佰肆拾捌万壹仟玖佰叁拾捌</b> 元整	(一) 基金管理人(或简称“管理人”) 住所： <u>中国(上海)自由贸易试验区</u> 民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 法定代表人： <b>贾波</b> (二) 基金托管人(或简称“托管人”) 法定代表人： <b>陈四清</b> 注册资本：人民币 <b>贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹</b> 元整
<b>二、托管协议的依据、目的、原则和解释</b>	
(一) 依据	(一) 依据

<p>本协议依据《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》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）及其他有关法律法规与《华泰柏瑞激励动力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》”）订立。</p>	<p>本协议依据《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>及其他有关法律法规与《华泰柏瑞激励动力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》”）订立。</p>
<p><b>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</b></p>	
<p>（一）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面：</p> <p>1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。……</p> <p>本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%，其中投资于激励动力主题相关的证券资产不低于非现金基金资产的 80%；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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>（一）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面：</p> <p>1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。……</p> <p>本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%，其中投资于激励动力主题相关的证券资产不低于非现金基金资产的 80%；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，现金<u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>
<p>2、对基金投融资比例进行监督：</p> <p>（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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p> <p>因证券、期货市场波动、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 个工作日内进行调整，但中国证监会规定的特</p>	<p>2、对基金投融资比例进行监督：</p> <p>（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，现金<u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p> <p><u>（17）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持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；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，不得超过该上市公司可</u></p>

<p>殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。</p>	<p><u>流通股票的 30%；</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，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u>  <u>(19)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；本基金管理人承诺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，并承担由于不一致所导致的风险和损失；</u></p> <p><u>除上述第（2）、（12）、（18）、（19）项外，</u>因证券、期货市场波动、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>
------------------------------	---

## 《华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金基金合同》条款修改对照表

修改前	修改后
<p>第一部分 前言</p>	
<p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</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》”)……《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>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》”)……《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>《流动性风险规定》</u>”)和其他有关法律法规。</p>
<p><b>第二部分 释义</b></p>	
<p>无</p>	<p>13、<u>《流动性风险规定》</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</p> <p>50、<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)、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</p>
<p><b>第六部分 基金份额的申购与赎回</b></p>	
<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>无</p>	<p>三十一、申购和赎回的数量限制</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，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</u></p>
<p>三十二、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见《招募说明书》，赎回金额单位为元。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回</p>	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见《招募说明书》，赎回金额单位为元。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示，<u>其中对持续持有期少于 7 日的投资</u></p>

<p>份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用……</p>	<p><u>者收取不低于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产</u>。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用……</p>
<p>七、拒绝或暂停申购的情形 …… 发生上述第 1、2、3、<del>5</del>、6 项暂停申购情形时……</p>	<p>七、拒绝或暂停申购的情形 …… <u>5、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> <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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。</u> 发生上述第 1、2、3、6、7、8 项暂停申购情形时……</p>
<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 ……</p>	<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… <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>九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 无</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 <u>(3) 若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 20%，基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出 20%的赎回申请实施延期办理。而对该单个基金份额持有人 20%以内（含 20%）的赎回申请，基金管理人根据前述</u></p>

	<p><u>“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。如下一开放日，该单一基金份额持有人剩余未赎回部分仍旧超出前述比例约定的，继续按前述规则处理，直至该单一基金份额持有人单个开放日内申请赎回的基金份额占上一开放日基金总份额的比例低于前述比例。</u></p>
<p><b>第七部分 基金合同当事人及权利义务</b></p>	
<p>一、基金管理人 （一）基金管理人简况 住所：<u>上海浦东新区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 法定代表人：<u>齐亮</u> 二、基金托管人 （一）基金托管人简况 法定代表人：<u>王洪章</u></p>	<p>一、基金管理人 （一）基金管理人简况 住所：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 法定代表人：<u>贾波</u> 二、基金托管人 （一）基金托管人简况 法定代表人：<u>田国立</u></p>
<p><b>第十二部分 基金的投资</b></p>	
<p>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，本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；权证的投资比例不超过基金资产净值的 3%。</p>	<p>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，本基金持有的现金（<u>不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>）或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；权证的投资比例不超过基金资产净值的 3%。</p>
<p>四、投资限制 1、组合限制 （2）本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保</p>	<p>四、投资限制 1、组合限制 （2）本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保</p>

<p>证金后，应当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>证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金（<u>不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>）或者到期日在一年以内的政府债券；</p> <p><u>（16）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、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，本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>（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></p>
<p>因证券、期货市场波动、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。法律法规另有规定的，从其规定。</p>	<p><u>除上述第（2）、（10）、（16）、（17）项外，</u>因证券、期货市场波动、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。法律法规另有规定的，从其规定。</p>
<p><b>第十四部分 基金资产估值</b></p>	
<p>六、暂停估值的情形</p> <p>无</p>	<p>六、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的，基金管理人应当暂停基金估值；</u></p>
<p><b>第十八部分 基金的信息披露</b></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>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>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</u></p>



	<p><u>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></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>(七) 临时报告 无</p>	<p>(七) 临时报告</p> <p><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；</u></p>

注：基金合同内容摘要涉及上述内容的一并修改。

## 《华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金托管协议》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>一、基金托管协议当事人</b>	
<p>(一) 基金管理人 注册地址：<del>上海浦东新区</del>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 办公地址：<del>上海浦东新区</del>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 法定代表人：<b>齐亮</b></p>	<p>(一) 基金管理人 注册地址：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 办公地址：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 法定代表人：<b>贾波</b></p>

<p>(二) 基金托管人 法定代表人: <u>王洪章</u></p>	<p>(二) 基金托管人 法定代表人: <u>田国立</u></p>
<p><b>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</b></p>	
<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定,对基金投资范围、投资对象进行监督。…… 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,本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%;权证的投资比例不超过基金资产净值的 3%。</p>	<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定,对基金投资范围、投资对象进行监督。…… 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,本基金持有的现金(不包括结算备付金、存出保证金、<u>应收申购款等</u>)或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%;权证的投资比例不超过基金资产净值的 3%。</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: (2) 本基金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,应当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;  因证券、期货市场波动、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。法律法规另有规定的,从其规定。</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: (2) 本基金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,应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金(不包括<u>结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>)或者到期日在一年以内的政府债券; <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本款所规定比例限制的,本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></p>

	<u>除上述第（2）、（7）、（13）、（14）项外</u> ，因证券、期货市场波动、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。法律法规另有规定的，从其规定。
<b>八、基金资产净值计算和会计核算</b>	
（四）暂停估值与公告基金份额净值的情形 无	（四）暂停估值与公告基金份额净值的情形 <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一致的，基金管理人应当暂停基金估值；</u>

## 《华泰柏瑞价值精选 30 灵活配置混合型证券投资基金基金合同》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>第一部分 前言</b>	
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》”）……《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》”）……《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>《流动性风险规定》</u> ”）和其他有关法律法规。
<b>第二部分 释义</b>	
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</u>

	<p><u>管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订</u></p> <p><u>51、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>
<b>第六部分 基金份额的申购与赎回</b>	
<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>无</p>	<p>三十三、申购和赎回的数量限制</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，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</u></p>
<p>三十四、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用……</p>	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示，<u>其中对持续持有期少于 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。</u>赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用……</p>
<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>……</p> <p>发生上述第 1、2、3、<del>5</del>、6、7 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时……</p>	<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>……</p> <p><u>5、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><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，</u></p>

	<p><u>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>发生上述第 1、2、3、6、7、<u>8、9</u> 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时……</p>
<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 ……</p> <p>发生上述 1、2、3、5、6、7 项情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时……</p>	<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 ……</p> <p><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>发生上述 1、2、3、5、6、7、<u>8</u> 项情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时……</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>无</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><u>(3) 若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 20%,基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出 20%的赎回申请实施延期办理。而对该单个基金份额持有人 20%以内(含 20%)的赎回申请,基金管理人根据前述“ (1) 全额赎回”或“ (2) 部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。如下一开放日,该单一基金份额持有人剩余未赎回部分仍旧超出前述比例约定的,继续按前述规则处理,直至该单一基金份额持有人单个开放日内申请赎回的基金份额占上一开放日基金总份额的比例低于前述比例。</u></p>

<b>第七部分 基金合同当事人及权利义务</b>	
<p>一、基金管理人</p> <p>(一) 基金管理人简况</p> <p>住所：<del>上海浦东新区</del>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层<del>(200135)</del></p> <p>法定代表人：<del>齐亮</del></p> <p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况</p> <p>法定代表人：<del>田国立</del></p> <p>注册资本：人民币<del>贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍</del>元整</p>	<p>一、基金管理人</p> <p>(一) 基金管理人简况</p> <p>住所：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层</p> <p>法定代表人：<u>贾波</u></p> <p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况</p> <p>法定代表人：<u>陈四清</u></p> <p>注册资本：人民币<u>贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹</u>元整</p>
<b>第十二部分 基金的投资</b>	
<p>二、投资范围</p> <p>.....</p> <p>本基金的投资组合比例为：本基金所持有的股票资产占基金资产的 0-95%，其中投资于基金持仓比例最高的前 30 只价值精选主题的上市公司股票资产不低于非现金基金资产的 80%；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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>二、投资范围</p> <p>.....</p> <p>本基金的投资组合比例为：本基金所持有的股票资产占基金资产的 0-95%，其中投资于基金持仓比例最高的前 30 只价值精选主题的上市公司股票资产不低于非现金基金资产的 80%；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，现金<u>(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)</u>和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>
<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p>	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(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，现金<u>(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)</u>和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p>

	<p><u>(18)本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；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，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；</u></p> <p><u>(19)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，本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>(20)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>
因证券、期货市场波动、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。	<u>除上述第（2）、（12）、（19）、（20）项外，</u> 因证券、期货市场波动、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。
<b>第十四部分 基金资产估值</b>	
六、暂停估值的情形 无	六、暂停估值的情形 <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的，基金管理人应当暂停基金估值；</u>
<b>第十八部分 基金的信息披露</b>	
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

.....	<p>.....</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有风险。</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>
（七）临时报告 无	<p>（七）临时报告</p> <p><u>27、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></p>

注：基金合同内容摘要涉及上述内容的一并修改。

## 《华泰柏瑞价值精选 30 灵活配置混合型证券投资基金托管协议》条款修改对照表

修改前	修改后
一、托管协议当事人	
<p>（一）基金管理人（或简称“管理人”）</p> <p>住所：<del>上海浦东新区</del>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号楼-17 层</p> <p>法定代表人：齐亮</p>	<p>（一）基金管理人（或简称“管理人”）</p> <p>住所：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层</p> <p>法定代表人：<u>贾波</u></p>



<p>(二) 基金托管人 (或简称“托管人”)          法定代表人: <b>田国立</b>          注册资本: 人民币<b>贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍</b>元整</p>	<p>(二) 基金托管人 (或简称“托管人”)          法定代表人: <b>陈四清</b>          注册资本: 人民币<b>贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹</b>元整</p>
<p><b>二、托管协议的依据、目的、原则和解释</b></p>	
<p>(一) 依据          本协议依据《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》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)及其他有关法律法规与《华泰柏瑞价值精选 30 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》”)订立。</p>	<p>(一) 依据          本协议依据《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>及其他有关法律法规与《华泰柏瑞价值精选 30 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》”)订立。</p>
<p><b>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</b></p>	
<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定,对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面:          1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。……          本基金的投资组合比例为:本基金所持有的股票资产占基金资产的 0-95%,其中投资于基金持仓比例最高的前 30 只价值精选主题的上市公司股票资产不低于非现金基金资产的 80%;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,现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定,对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面:          1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。……          本基金的投资组合比例为:本基金所持有的股票资产占基金资产的 0-95%,其中投资于基金持仓比例最高的前 30 只价值精选主题的上市公司股票资产不低于非现金基金资产的 80%;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,现金<u>(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)</u>和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>
<p>2、对基金投融资比例进行监督:          (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,</p>	<p>2、对基金投融资比例进行监督:          (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,</p>

现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%;

因证券、期货市场波动、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。

现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%;

(18)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持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 15%;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,不得超过该上市公司可流通股票的 30%;

(19)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,本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;

(20)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;本基金管理人承诺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,并承担由于不一致所导致的风险和损失;

除上述第(2)、(12)、(19)、(20)项外,因证券、期货市场波动、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。

## 《华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金基金合同》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>一、前言</b>	
<p>(一) 订立《华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“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</p> <p>订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法通则》……和《证券投资基金销售管理办法》(以下简称《销售办法》)及其他法律法规的有关规定。</p>	<p>(一) 订立《华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“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</p> <p>订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法通则》……和《证券投资基金销售管理办法》(以下简称《销售办法》)、<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>及其他法律法规的有关规定。</p>
<b>二、释义</b>	
无	<p><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></p> <p><u>48、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>
<b>六、基金份额的申购、赎回与转换</b>	
<p>(五) 申购与赎回的数额限制</p> <p>无</p>	<p>(五) 申购与赎回的数额限制</p> <p><u>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</u></p>

	<u>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，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</u>
<p>(七) 申购和赎回的费用及其用途</p> <p>3、本基金的赎回费率按照持有时间递减，即相关基金份额持有时间越长、所适用的赎回费率越低。实际执行的赎回费率在招募说明书中载明。</p>	<p>(七) 申购和赎回的费用及其用途</p> <p>3、本基金的赎回费率按照持有时间递减，即相关基金份额持有时间越长、所适用的赎回费率越低。实际执行的赎回费率在招募说明书中载明，<u>其中对持续持有期少于 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。</u></p>
<p>(九) 巨额赎回的认定及处理方式</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>无</p>	<p>(九) 巨额赎回的认定及处理方式</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p><u>(3) 若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 20%，基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出 20% 的赎回申请实施延期办理。而对该单个基金份额持有人 20% 以内（含 20%）的赎回申请，基金管理人根据前述“（1）接受全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。如下一开放日，该单一基金份额持有人剩余未赎回部分仍旧超出前述比例约定的，继续按前述规则处理，直至该单一基金份额持有人单个开放日内申请赎回的基金份额占上一开放日基金总份额的比例低于前述比例。</u></p>
<p>(十) 拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理</p> <p>1、在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请： .....</p> <p>基金管理人决定拒绝或暂停接受某些投资者的申购申请时，申购款</p>	<p>(十) 拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理</p> <p>1、在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请： .....</p> <p><u>(5) 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>项将退回投资者账户。基金管理人决定暂停接受申购申请时，应当依法在至少一家指定媒体公告。在暂停申购的情形消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理并依法在至少一家指定媒体上予以公告。</p>	<p><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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施；</u></p> <p>基金管理人决定拒绝或暂停接受某些投资者的申购申请时，申购款项将退回投资者账户。<u>发生上述第 (1)、(2)、(3)、(4)、(6)、(7) 项情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，应当依法在至少一家指定媒体公告。在暂停申购的情形消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理并依法在至少一家指定媒体上予以公告。</u></p>
<p>2、在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请： .....</p>	<p>2、在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请： .....</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><b>八、基金合同当事人及其权利义务</b></p>	
<p>(一) 基金管理人 住所：<del>上海浦东新区</del>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层<del>(200135)</del> 法定代表人：<b>齐亮</b></p> <p>(二) 基金托管人 法定代表人：<b>田国立</b> 注册资本：人民币<b>贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟捌佰肆拾捌万壹仟玖佰叁</b></p>	<p>(一) 基金管理人 住所：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 法定代表人：<b>贾波</b></p> <p>(二) 基金托管人 法定代表人：<b>陈四清</b> 注册资本：人民币<b>贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆</b></p>

拾捌元整	拾壹元整
<p><b>十四、基金的投资</b></p>	
<p>(二) 投资范围</p> <p>.....</p> <p>基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 60% — 95%；现金、债券资产(含短期融资券和资产证券化产品)、权证以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的5% — 40%，其中，基金持有权证的市值不得超过基金资产净值的 3%，基金保留的现金以及投资于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>(二) 投资范围</p> <p>.....</p> <p>基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 60% — 95%；现金、债券资产(含短期融资券和资产证券化产品)、权证以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的5% — 40%，其中，基金持有权证的市值不得超过基金资产净值的 3%，基金保留的现金<u>(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)</u>以及投资于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>(十) 投资禁止行为与限制</p> <p>2、基金投资组合比例限制</p> <p>(4) 基金保留的现金以及投资于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>(十) 投资禁止行为与限制</p> <p>2、基金投资组合比例限制</p> <p>(4) 基金保留的现金<u>(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)</u>以及投资于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><u>(6) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；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，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；</u></p> <p><u>(7) 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，本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>(8) 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</u></p>

	<u>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>(十一) 投资组合比例调整</p> <p>基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的,基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规另有规定时,从其规定。</p>	<p>(十一) 投资组合比例调整</p> <p>基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。<u>除上述第(4)、(7)、(8)项外,</u>因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的,基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规另有规定时,从其规定。</p>
<b>十七、基金资产估值</b>	
<p>(六) 暂停估值的情形</p> <p>无</p>	<p>(六) 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的,基金管理人应当暂停基金估值;</u></p>
<b>二十一、基金的信息披露</b>	
<p>(五) 定期报告</p> <p>.....</p>	<p>(五) 定期报告</p> <p>.....</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。</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>(六) 临时报告与公告</p>	<p>(六) 临时报告与公告</p>

无	<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；</u>
---	---

注：基金合同内容摘要涉及上述内容的一并修改。

## 《华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金托管协议》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>一、托管协议当事人</b>	
（一）基金管理人（或简称“管理人”） 住所： <u>上海浦东新区</u> 民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层（ <del>200135</del> ） 法定代表人： <b>齐亮</b> （二）基金托管人（或简称“托管人”） 法定代表人： <b>田国立</b> 注册资本：人民币 <del>贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰仟零玖元</del>	（一）基金管理人（或简称“管理人”） 住所： <u>中国（上海）自由贸易试验区</u> 民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 法定代表人： <b>贾波</b> （二）基金托管人（或简称“托管人”） 法定代表人： <b>陈四清</b> 注册资本：人民币 <del>贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰仟零玖元</del> <u>贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整</u>
<b>二、托管协议的依据、目的、原则和解释</b>	
（一）依据 本协议依据《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》”）《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	（一）依据 本协议依据《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》”）《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



<p>理办法》”、（以下简称“《信息披露办法》）及其”他有关法律 法规与《华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金基金合同》（以 下简称“《基金合同》）订立。”</p>	<p>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>及其”他有关法律法 规与《华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金基金合同》（以 下简称“《基金合同》）订立。”</p>
<p><b>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</b></p>	
<p>2、对基金投融资比例进行监督。……</p>	<p>2、对基金投融资比例进行监督。……</p> <p><u>其中，基金托管人根据《公开募集开放式证券投资基金流动性 风险管理规定》对投资组合的比例做如下监督：</u></p> <p><u>1) 现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</u></p> <p><u>2) 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 金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流 通股票的 15%；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，不得超过该上市公司 可流通股票的 30%；</u></p> <p><u>3) 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，本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>4) 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；本基金管理人承诺本基金与私 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，并承担由于不一致所导致的风险和损失；</u></p>

## 《华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金基金合同》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>第一部分 前言</b>	
<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》”)……《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》”)……《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。</p>
<b>第二部分 释义</b>	
无	<p><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></p> <p><u>50、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>
<b>第六部分 基金份额的申购与赎回</b>	
<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>无</p>	<p>三十五、申购和赎回的数量限制</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</u></p>

	<u>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，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</u>
三十六、申购和赎回的价格、费用及其用途 3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用……	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示， <u>其中对持续持有期少于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。</u> 赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用……
七、拒绝或暂停申购的情形 …… 发生上述第1、2、3、 <del>5</del> —6、7项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时……	七、拒绝或暂停申购的情形 …… <u>5、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> <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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。</u> 发生上述第1、2、3、6、7、 <u>8、9</u> 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时……
八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… 发生上述1、2、3、4、6、7项情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时……	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，基金管理人应当采取延缓支付赎回款</u>

	<p><u>项或暂停接受基金赎回申请的措施。</u></p> <p>发生上述 1、2、3、4、6、7、<u>8</u> 项情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时……</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>无</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><u>(3) 若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 20%，基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出 20%的赎回申请实施延期办理。而对该单个基金份额持有人 20%以内（含 20%）的赎回申请，基金管理人根据前述“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。如下一开放日，该单一基金份额持有人剩余未赎回部分仍旧超出前述比例约定的，继续按前述规则处理，直至该单一基金份额持有人单个开放日内申请赎回的基金份额占上一开放日基金总份额的比例低于前述比例。</u></p>
<p><b>第七部分 基金合同当事人及权利义务</b></p>	
<p>一、基金管理人</p> <p>（一）基金管理人简况</p> <p>住所：<del>上海浦东新区</del>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 <del>（200135）</del></p> <p>法定代表人：<b>齐亮</b></p> <p>二、基金托管人</p> <p>（一）基金托管人简况</p> <p>法定代表人：<b>田国立</b></p> <p>注册资本：人民币<b>贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟捌佰肆拾捌万壹仟玖佰叁</b></p>	<p>一、基金管理人</p> <p>（一）基金管理人简况</p> <p>住所：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层</p> <p>法定代表人：<b>贾波</b></p> <p>二、基金托管人</p> <p>（一）基金托管人简况</p> <p>法定代表人：<b>陈四清</b></p> <p>注册资本：人民币<b>贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆</b></p>

拾捌元整	拾壹元整
<b>第十二部分 基金的投资</b>	
<p>二、投资范围</p> <p>.....</p> <p>本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%，其中投资于健康生活主题相关的证券资产不低于非现金基金资产的 80%；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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>二、投资范围</p> <p>.....</p> <p>本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%，其中投资于健康生活主题相关的证券资产不低于非现金基金资产的 80%；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，现金<b><u>(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)</u></b>和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>
<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p>	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(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，现金<b><u>(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)</u></b>和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p> <p><b><u>(17) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；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，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；</u></b></p> <p><b><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，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u></b></p> <p><b><u>(19) 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></b></p>

<p>因证券、期货市场波动、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>除上述第（2）、（12）、（18）、（19）项外</u>，因证券、期货市场波动、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>第十四部分 基金资产估值</b></p>	
<p>六、暂停估值的情形 无</p>	<p>六、暂停估值的情形 <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的，基金管理人应当暂停基金估值；</u></p>
<p><b>第十八部分 基金的信息披露</b></p>	
<p>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 .....</p>	<p>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 ..... <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> <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>（七）临时报告 无</p>	<p>（七）临时报告 <u>27、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></p>

注：基金合同内容摘要涉及上述内容的一并修改。

## 《华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金托管协议》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>一、托管协议当事人</b>	
<p>(一) 基金管理人（或简称“管理人”） 住所：<del>上海浦东新区</del>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号楼 17 层 法定代表人：<b>齐亮</b></p> <p>(二) 基金托管人（或简称“托管人”） 法定代表人：<del>田国立</del> 注册资本：人民币<b>贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟捌佰肆拾捌万壹仟玖佰叁拾捌</b>元整</p>	<p>(一) 基金管理人（或简称“管理人”） 住所：<b>中国（上海）自由贸易试验区</b>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 法定代表人：<b>贾波</b></p> <p>(二) 基金托管人（或简称“托管人”） 法定代表人：<b>陈四清</b> 注册资本：人民币<b>贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹</b>元整</p>
<b>二、托管协议的依据、目的、原则和解释</b>	
<p>(一) 依据 本协议依据《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》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）及其他有关法律法规与《华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金</p>	<p>(一) 依据 本协议依据《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>及其他有关法律</p>

基金合同》（以下简称“《基金合同》”）订立。	法规与《华泰柏瑞健康生活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》”）订立。
<b>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</b>	
<p>（一）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面：</p> <p>1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。……</p> <p>本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%，其中投资于健康生活主题相关的证券资产不低于非现金基金资产的 80%；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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>（一）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面：</p> <p>1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。……</p> <p>本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%，其中投资于健康生活主题相关的证券资产不低于非现金基金资产的 80%；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，现金（<u>不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>）和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>
<p>2、对基金投融资比例进行监督：</p> <p>（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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p> <p>因证券、期货市场波动、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>2、对基金投融资比例进行监督：</p> <p>（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，现金（<u>不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>）和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p> <p><u>（17）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持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；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，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；</u></p> <p><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，本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>(19)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;本基金管理人承诺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,并承担由于不一致所导致的风险和损失;</u></p> <p><u>除上述第(2)、(12)、(18)、(19)项外,因证券、期货市场波动、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。</u></p>
--	--

## 《华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金基金合同》条款修改对照表

修改前	修改后
<p>一、前言</p> <p>(一)订立华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金基金合同(以下简称“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</p> <p>订立本基金合同的依据是《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》</p>	<p>(一)订立华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金基金合同(以下简称“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</p> <p>订立本基金合同的依据是《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、</p>

和其他有关法律法规及规定。	<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及规定。
<b>二、释义</b>	
无	<u>《流动性风险管理规定》</u> ：指 <u>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</u> ； <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）、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
<b>六、基金份额的申购、赎回与转换</b>	
（五）申购与赎回的数额限制 无	（五）申购与赎回的数额限制 <u>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，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</u>
（六）申购和赎回的费用 2、赎回费用 （1）本基金份额（包括 A 类基金份额和 B 类基金份额）的赎回费用由基金赎回人承担，赎回费率最高不超过基金份额（包括 A 类基金份额和 B 类基金份额）赎回金额的 5%。 （2）投资者可将其持有的全部或部分基金份额（包括 A 类基金份额和 B 类基金份额）赎回。本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额（包括 A 类基金份额和 B 类基金份额）时收取，赎回费用总额	（六）申购和赎回的费用 2、赎回费用 （1）本基金份额（包括 A 类基金份额和 B 类基金份额）的赎回费用由基金赎回人承担， <u>其中对持续持有期少于 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。</u> 赎回费率最高不超过基金份额（包括 A 类基金份额和 B 类基金份额）赎回金额的 5%。 （2）投资者可将其持有的全部或部分基金份额（包括 A 类基金份额和 B 类基金份额）赎回。本基金的赎回费用在投资者赎回本基金

<p>的 40%归入基金财产，其余部分用于支付注册登记费和其他必要的相关手续费。</p>	<p>份额（包括 A 类基金份额和 B 类基金份额）时收取，<u>除基金合同另有约定外</u>，赎回费用总额的 40%归入基金财产，其余部分用于支付注册登记费和其他必要的相关手续费。</p>
<p>（九）巨额赎回的认定及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 无</p>	<p>（九）巨额赎回的认定及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 <u>3) 若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 20%，基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出 20%的赎回申请实施延期办理。而对该单个基金份额持有人 20%以内（含 20%）的赎回申请，基金管理人根据前述“1) 接受全额赎回”或“2) 部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。如下一开放日，该单一基金份额持有人剩余未赎回部分仍旧超出前述比例约定的，继续按前述规则处理，直至该单一基金份额持有人单个开放日内申请赎回的基金份额占上一开放日基金总份额的比例低于前述比例。</u></p>
<p>（十）拒绝或暂停申购、暂停赎回及延缓支付赎回款项的情形及处理 1、在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请： .....  基金管理人决定拒绝或暂停接受某些投资者的申购申请时，申购款项将退回投资者账户。基金管理人决定暂停接受申购申请时，应当依法公告。在暂停申购的情形消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理并予以公告。</p>	<p>（十）拒绝或暂停申购、暂停赎回及延缓支付赎回款项的情形及处理 1、在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请： ..... <u>5) 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> <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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施；</u></p>

	<p>基金管理人决定拒绝或暂停接受某些投资者的申购申请时，申购款项将退回投资者账户。<u>除上述第 4)、5) 项外</u>，基金管理人决定暂停接受申购申请时，应当依法公告。在暂停申购的情形消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理并予以公告。</p>
<p>2、在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请或延缓支付赎回款项： .....</p>	<p>2、在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请或延缓支付赎回款项： ..... <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><b>七、基金合同当事人及其权利义务</b></p>	
<p>(一) 基金管理人 1、基金管理人基本情况 注册地址：<u>上海市</u>民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层 法定代表人：<u>齐亮</u></p>	<p>(一) 基金管理人 1、基金管理人基本情况 注册地址：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄<u>上海</u>证大五道口广场 1 号楼 17 层 法定代表人：<u>贾波</u></p>
<p><b>十三、基金的投资</b></p>	
<p>(二) 投资范围 ..... 本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券（含政策性金融债、央行票据）不低于基金资产净值的 5%，本基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%。</p>	<p>(二) 投资范围 ..... 本基金持有现金<u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>或到期日在一年以内的政府债券（含政策性金融债、央行票据）不低于基金资产净值的 5%，本基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%。</p>

<p>(十) 投资禁止行为与限制 2、基金投资组合比例限制 无</p>	<p>(十) 投资禁止行为与限制 2、基金投资组合比例限制 <u>(9) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；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，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；</u> <u>(10) 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，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u> <u>(11) 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>(十一) 投资组合比例调整 基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。由于证券市场波动、上市公司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>(十一) 投资组合比例调整 基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。由于证券市场波动、上市公司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，<u>上述第 (10)、(11) 项除外</u>。法律法规另有规定的从其规定。</p>
<p><b>十六、基金财产估值</b></p>	
<p>(六) 暂停估值的情形 无</p>	<p>(六) 暂停估值的情形 <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的，基金管理人应当暂停基金估值；</u></p>

二十、基金的信息披露	
（三）定期报告 .....	（三）定期报告 ..... <u>5、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有风险。</u> <u>6、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>
（四）临时报告与公告 无	（四）临时报告与公告 <u>27、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>

## 《华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金托管协议》条款修改对照表

修改前	修改后
一、基金托管协议当事人	
（一）基金管理人 注册地址： <u>上海市</u> 民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层	（一）基金管理人 注册地址： <u>中国（上海）自由贸易试验区</u> 民生路 1199 弄 <u>上海</u> 证大

<p>法定代表人：<b>齐亮</b>          经营范围：发起设立基金，基金管理业务，中国证监会允许的其他业务</p>	<p>五道口广场 1 号楼 17 层          法定代表人：<b>贾波</b>          经营范围：<b>基金管理业务；发起设立基金；及中国证监会批准的其他业务</b></p>
<p><b>二、基金托管协议的依据、目的和原则</b></p>	
<p>本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》……《证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金基金合同》（以下简称《基金合同》）及其他有关规定制定。……</p>	<p>本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》……《证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、<b>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</b>、《华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金基金合同》（以下简称《基金合同》）及其他有关规定制定。……</p>
<p><b>三、基金托管人对基金管理人的业务监督、核查</b></p>	
<p>（一）基金托管人应对基金管理人的投资行为进行监督和核查          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，对基金投融资比例进行监督的内容、标准和程序。          基金托管人应对基金的投资和融资比例是否符合基金合同的规定进行监督……对于因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等原因导致基金的投资不符合基金合同的约定的，基金托管人应书面通知基金管理人在 10 个工作日内进行调整以符合基金合同的约定。基金管理人在规定的调整时限内未完成整改的，基金托管人应书面报告中国证监会。</p>	<p>（一）基金托管人应对基金管理人的投资行为进行监督和核查          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，对基金投融资比例进行监督的内容、标准和程序。          基金托管人应对基金的投资和融资比例是否符合基金合同的规定进行监督……对于因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等原因导致基金的投资不符合基金合同的约定的，基金托管人应书面通知基金管理人在 10 个工作日内进行调整以符合基金合同的约定，<b>基金合同另有约定的除外</b>。基金管理人在规定的调整时限内未完成整改的，基金托管人应书面报告中国证监会。</p>
<p><b>八、资产净值计算和会计核算</b></p>	
<p>（一）基金资产净值的计算和复核          6、暂停估值的情形          无</p>	<p>（一）基金资产净值的计算和复核          6、暂停估值的情形  <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</u></p>

时，经与基金托管人协商一致的，基金管理人应当暂停基金估值；

## 《华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>第一部分 前言</b>	
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》”）……《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》”）……《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>《流动性风险规定》</u> ”）和其他有关法律法规。
<b>第二部分 释义</b>	
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> <u>52、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>
<b>第六部分 基金份额的申购与赎回</b>	
五、申购和赎回的数量限制	三十七、申购和赎回的数量限制



<p>无</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，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</u></p>
<p>三十八、申购和赎回的价格、费用及其用途 3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额的基金份额净值并扣除相应的费用……</p>	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途 3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示，<u>其中对持续持有期少于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。</u>赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额的基金份额净值并扣除相应的费用……</p>
<p>七、拒绝或暂停申购的情形 …… 发生上述第1、2、3、<del>5</del>、6、7项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时……</p>	<p>七、拒绝或暂停申购的情形 …… <u>5、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> <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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。</u> 发生上述第1、2、3、6、7、<u>8、9</u>项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时……</p>
<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 ……</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</u></p>

<p>发生上述 1、2、3、5、6 项情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时……</p>	<p><u>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>发生上述 1、2、3、5、6、7 项情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时……</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 无</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 <u>(3) 若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 20%，基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出 20% 的赎回申请实施延期办理。而对该单个基金份额持有人 20% 以内（含 20%）的赎回申请，基金管理人根据前述“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。如下一开放日，该单一基金份额持有人剩余未赎回部分仍旧超出前述比例约定的，继续按前述规则处理，直至该单一基金份额持有人单个开放日内申请赎回的基金份额占上一开放日基金总份额的比例低于前述比例。</u></p>
<p><b>第七部分 基金合同当事人及权利义务</b></p>	
<p>一、基金管理人 (一) 基金管理人简况 住所：<del>上海浦东新区</del>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层<del>(200135)</del> 二、基金托管人 (一) 基金托管人简况 注册资本：<del>190.52</del>亿元人民币</p>	<p>一、基金管理人 (一) 基金管理人简况 住所：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 二、基金托管人 (一) 基金托管人简况 注册资本：<u>207.74</u>亿元人民币</p>

第十二部分 基金的投资	
<p>二、投资范围</p> <p>.....</p> <p>本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>二、投资范围</p> <p>.....</p> <p>本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；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，现金<u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>
<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>（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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p>	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>（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，现金<u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p> <p><u>（18）本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；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，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；</u></p> <p><u>（19）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，本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>（20）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>除上述第（12）项<u>另有约定</u>外，因证券、期货市场波动、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</p>	<p>除上述第<u>（2）、（12）、（19）、（20）</u>项外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素</p>

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。	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。
<b>第十四部分 基金资产估值</b>	
六、暂停估值的情形 无	六、暂停估值的情形 <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的，基金管理人应当暂停基金估值；</u>
<b>第十八部分 基金的信息披露</b>	
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 ..... <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> <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>
(七) 临时报告 无	(七) 临时报告 <u>28、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>

注：基金合同内容摘要涉及上述内容的一并修改。

## 《华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金托管协议》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>一、基金托管协议当事人</b>	
<p>(一) 基金管理人 注册地址：<u>上海浦东新区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 办公地址：<u>上海浦东新区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层</p> <p>(二) 基金托管人 注册资本：<b>190.52</b>亿元人民币</p>	<p>(一) 基金管理人 注册地址：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 办公地址：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层</p> <p>(二) 基金托管人 注册资本：<b>207.74</b>亿元人民币</p>
<b>二、基金托管协议的依据、目的和原则</b>	
<p>(一) 订立托管协议的依据 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》”）、《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》”）等有关法律法规、《华泰柏瑞锦利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》”）及其他有关规定制订。</p>	<p>(一) 订立托管协议的依据 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》”）、《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》</u>等有关法律法规、《华泰柏瑞锦利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》”）及其他有关规定制订。</p>
<b>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</b>	
<p>(一) 基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权 …… 本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；每个交易日日终</p>	<p>(一) 基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权 …… 本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；每个交易日日终</p>

<p>在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金<u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>和到期日在一年以内的政府债券的投资比例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股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p> <p>除上述第（12）项<b>另有约定</b>外，因证券、期货市场波动、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>（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>（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，现金<u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p> <p><u>（18）本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；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，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；</u></p> <p><u>（19）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，本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>（20）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>除上述第<u>（2）、（12）、（19）、（20）</u>项外，因证券、期货市场波动、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</p>

	律法规另有规定的，从其规定。
<b>八、基金资产净值计算和会计核算</b>	
(四) 暂停估值与公告的情形 无	(四) 暂停估值与公告的情形 <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的，基金管理人应当暂停基金估值；</u>

## 《华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>第一部分 前言</b>	
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》”）……《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》”）……《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。
<b>第二部分 释义</b>	
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> <u>50、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</u>

	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
<b>第六部分 基金份额的申购与赎回</b>	
五、申购和赎回的数量限制 无	三十九、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，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</u>
四十、申购和赎回的价格、费用及其用途 3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用……	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示， <u>其中对持续持有期少于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。</u> 赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用……
七、拒绝或暂停申购的情形 …… 6、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术保障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。  发生上述第1、2、3、 <del>5</del> 、6、7项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时……	七、拒绝或暂停申购的情形 …… <u>5、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> <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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。</u> <u>8、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术故障等</u>



	<p>异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。</p> <p>发生上述第 1、2、3、6、7、<b>8、9</b> 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时……</p>
<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 ……</p> <p>发生上述 1、2、3、5、6、7 项情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时……</p>	<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 ……</p> <p><b>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，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。</b></p> <p>发生上述 1、2、3、5、6、7、<b>8</b> 项情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时……</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>无</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><b>(3) 若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 20%，基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出 20%的赎回申请实施延期办理。而对该单个基金份额持有人 20%以内（含 20%）的赎回申请，基金管理人根据前述“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。如下一开放日，该单一基金份额持有人剩余未赎回部分仍旧超出前述比例约定的，继续按前述规则处理，直至该单一基金份额持有人单个开放日内申请赎回的基金份额占上一开放日基金总份额的比例低于前述比例。</b></p>

<b>第七部分 基金合同当事人及权利义务</b>	
<p>一、基金管理人</p> <p>(一) 基金管理人简况</p> <p>住所：<del>上海浦东新区</del>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层<del>(200135)</del></p> <p>法定代表人：<del>齐亮</del></p> <p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况</p> <p>法定代表人：<del>田国立</del></p> <p>注册资本：人民币<del>贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟捌佰肆拾捌万壹仟玖佰叁拾捌</del>元整</p>	<p>一、基金管理人</p> <p>(一) 基金管理人简况</p> <p>住所：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层</p> <p>法定代表人：<u>贾波</u></p> <p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况</p> <p>法定代表人：<u>陈四清</u></p> <p>注册资本：人民币<del>贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹</del>元整</p>
<b>第十二部分 基金的投资</b>	
<p>二、投资范围</p> <p>.....</p> <p>本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%；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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>二、投资范围</p> <p>.....</p> <p>本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%；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，现金<u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>
<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p>	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(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，现金<u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p> <p><u>(18)本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管</u></p>

	<p>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,不得超过该上市公司可流通股票的 30%;</p> <p><u>(19)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,本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>(20)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>
因证券、期货市场波动、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。	<u>除上述第(2)、(12)、(19)、(20)项外</u> ,因证券、期货市场波动、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。
<b>第十四部分 基金资产估值</b>	
六、暂停估值的情形 无	六、暂停估值的情形 <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的,基金管理人应当暂停基金估值;</u>
<b>第十八部分 基金的信息披露</b>	
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 ..... <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</u>

	<p><u>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></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>(七) 临时报告 无</p>	<p>(七) 临时报告</p> <p><u>27、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></p>

注：基金合同内容摘要涉及上述内容的一并修改。

## 《华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金托管协议》条款修改对照表

修改前	修改后
<p>一、托管协议当事人</p> <p>(一) 基金管理人（或简称“管理人”） 住所：<del>上海浦东新区</del>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号楼 17 层 法定代表人：齐亮</p> <p>(二) 基金托管人（或简称“托管人”） 法定代表人：田国立</p>	<p>(一) 基金管理人（或简称“管理人”） 住所：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 法定代表人：<u>贾波</u></p> <p>(二) 基金托管人（或简称“托管人”） 法定代表人：<u>陈四清</u></p>

<p>注册资本：人民币<u>贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟捌佰肆拾捌万壹仟玖佰叁拾捌元整</u></p>	<p>注册资本：人民币<u>贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整</u></p>
<p><b>二、托管协议的依据、目的、原则和解释</b></p>	
<p>(一) 依据 本协议依据《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》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）及其他有关法律法规与《华泰柏瑞精选回报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》”）订立。</p>	<p>(一) 依据 本协议依据《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>及其他有关法律法规与《华泰柏瑞精选回报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》”）订立。</p>
<p><b>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</b></p>	
<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面： 1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。…… 本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%；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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。</p>	<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面： 1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。…… 本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%；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，现金<u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。</p>
<p>2、对基金投资比例进行监督： (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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%；  因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管</p>	<p>2、对基金投资比例进行监督： (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，现金<u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%； <u>(18) 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持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通</u></p>

<p>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>股票的 15%；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，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；</u></p> <p><u>(19)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，本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>(20)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；本基金管理人承诺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，并承担由于不一致所导致的风险和损失；</u></p> <p><u>除上述第（2）、（12）、（19）、（20）项外，</u>因证券、期货市场波动、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>
--	---

## 《华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金基金合同》条款修改对照表

修改前	修改后
-----	-----

<b>第一部分 前言</b>	
<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》”)……《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》”)……《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。</p>
<b>第二部分 释义</b>	
无	<p><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></p> <p><u>50、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>
<b>第六部分 基金份额的申购与赎回</b>	
<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>无</p>	<p>四十一、申购和赎回的数量限制</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，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</u></p>
<p>四十二、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募</p>	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募</p>

<p>说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用……</p>	<p>说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示，<u>其中对持续持有期少于 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</u>。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用……</p>
<p>七、拒绝或暂停申购的情形 ……</p> <p>发生上述第 1、2、3、6、7、8 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时……</p>	<p>七、拒绝或暂停申购的情形 ……</p> <p><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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。</u></p> <p>发生上述第 1、2、3、6、7、8、<u>9</u> 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时……</p>
<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 ……</p> <p>发生上述 1、2、3、5、6 项情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时……</p>	<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 ……</p> <p><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>发生上述 1、2、3、5、6、<u>7</u> 项情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时……</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 无</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 <u>(3) 若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超</u></p>



	<p>过上一开放日基金总份额的 20%，基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出 20% 的赎回申请实施延期办理。而对该单个基金份额持有人 20% 以内（含 20%）的赎回申请，基金管理人根据前述“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。如下一开放日，该单一基金份额持有人剩余未赎回部分仍旧超出前述比例约定的，继续按前述规则处理，直至该单一基金份额持有人单个开放日内申请赎回的基金份额占上一开放日基金总份额的比例低于前述比例。</p>
<p><b>第七部分 基金合同当事人及权利义务</b></p>	
<p>二、基金托管人 （一）基金托管人简况 法定代表人：<b>田国立</b> 注册资本：人民币<b>贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍</b>元整</p>	<p>二、基金托管人 （一）基金托管人简况 法定代表人：<b>陈四清</b> 注册资本：人民币<b>贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹</b>元整</p>
<p><b>第十二部分 基金的投资</b></p>	
<p>二、投资范围 ..... 本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%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>二、投资范围 ..... 本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%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金（<b>不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</b>）和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>
<p>四、投资限制 1、组合限制 （2）每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交</p>	<p>四、投资限制 1、组合限制 （2）每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交</p>

<p>易保证金后，本基金持有的现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p>	<p>易保证金后，本基金持有的现金<u>(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)</u>和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p> <p><u>(21)本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；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，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；</u></p> <p><u>(22)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，本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>(23)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>除上述第（12）项另有约定外，因证券、期货市场波动、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>除上述第<u>（2）、（12）、（22）、（23）</u>项另有约定外，因证券、期货市场波动、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>第十四部分 基金资产估值</b></p>	
<p>六、暂停估值的情形 无</p>	<p>六、暂停估值的情形 <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的，基金管理人应当暂停基金估值；</u></p>
<p><b>第十八部分 基金的信息披露</b></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><del>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情形，基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告文件中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。</del></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>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有风险。</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>(七) 临时报告</p> <p>无</p>	<p>(七) 临时报告</p> <p><u>27、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></p>

注：基金合同内容摘要涉及上述内容的一并修改。

## 《华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金托管协议》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>一、托管协议当事人</b>	
<p>(二) 基金托管人 (或简称“托管人”)</p> <p>法定代表人: <del>田国立</del></p> <p>注册资本: 人民币<del>贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍</del>元整</p>	<p>(二) 基金托管人 (或简称“托管人”)</p> <p>法定代表人: <b>陈四清</b></p> <p>注册资本: 人民币<del>贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹</del>元整</p>
<b>二、托管协议的依据、目的、原则和解释</b>	
<p>(一) 依据</p> <p>本协议依据《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》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)及其他有关法律法规与《华泰柏瑞量化阿尔法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》”)订立。</p>	<p>(一) 依据</p> <p>本协议依据《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>及其他有关法律法规与《华泰柏瑞量化阿尔法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》”)订立。</p>
<b>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</b>	
<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定,建立相关的技术系统,对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面:</p> <p>1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。……</p> <p>本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%;每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证</p>	<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定,建立相关的技术系统,对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面:</p> <p>1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。……</p> <p>本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%;每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证</p>

<p>金后, 现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>金后, 现金(不包括<u>结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>)和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>
<p>2、对基金投融资比例进行监督:</p> <p>(2) 每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后, 本基金持有的现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%;</p> <p>除上述第(9)项另有约定外, 因证券、期货市场波动、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>2、对基金投融资比例进行监督:</p> <p>(2) 每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后, 本基金持有的现金(不包括<u>结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>)和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%;</p> <p><u>(17)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持有一家上市公司发行的可流通股票, 不得超过该上市公司可流通股票的 15%; 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, 不得超过该上市公司可流通股票的 30%;</u></p> <p><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, 本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>(19)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; 本基金管理人承诺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, 并承担由于不一致所导致的风险和损失;</u></p> <p>除上述第<u>(2)、(9)、(18)、(19)</u>项另有约定外, 因证券、</p>

	期货市场波动、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。
--	--

## 《华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金基金合同》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>第一部分 前言</b>	
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》”）……《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》”）……《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>《流动性风险规定》</u> ”）和其他有关法律法规。
<b>第二部分 释义</b>	
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> <u>50、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、</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
<b>第六部分 基金份额的申购与赎回</b>	
五、申购和赎回的数量限制 无	四十三、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，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</u>
四十四、申购和赎回的价格、费用及其用途 3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用……	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示， <u>其中对持续持有期少于 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。</u> 赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用……
七、拒绝或暂停申购的情形 …… 6、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术保障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。  发生上述第 1、2、3、 <del>5</del> 、6、7 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时……	七、拒绝或暂停申购的情形 …… <u>5、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> <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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。</u> <u>8、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。</u>

	发生上述第 1、2、3、6、7、 <b>8、9</b> 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时……
八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… 发生上述 1、2、3、5、6、7 项情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时……	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… <b>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，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。</b>  发生上述 1、2、3、5、6、7、 <b>8</b> 项情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时……
九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 无	九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 <b><u>(3) 若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 20%，基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出 20%的赎回申请实施延期办理。而对该单个基金份额持有人 20%以内（含 20%）的赎回申请，基金管理人根据前述“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。如下一开放日，该单一基金份额持有人剩余未赎回部分仍旧超出前述比例约定的，继续按前述规则处理，直至该单一基金份额持有人单个开放日内申请赎回的基金份额占上一开放日基金总份额的比例低于前述比例。</u></b>
<b>第七部分 基金合同当事人及权利义务</b>	
二、基金托管人	二、基金托管人



<p>(一) 基金托管人简况 法定代表人: <u>王洪章</u></p>	<p>(一) 基金托管人简况 法定代表人: <u>田国立</u></p>
<p><b>第十二部分 基金的投资</b></p>	
<p>二、投资范围 ..... 本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%; 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, 现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%; 本基金参与融资业务时, 在任何交易日日终, 持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和, 不得超过基金资产净值的 95%。</p>	<p>二、投资范围 ..... 本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%; 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, 现金(<u>不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>)和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%; 本基金参与融资业务时, 在任何交易日日终, 持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和, 不得超过基金资产净值的 95%。</p>
<p>四、投资限制 1、组合限制 (1) 在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后, 现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%;</p>	<p>四、投资限制 1、组合限制 (2) 在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后, 现金(<u>不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>)和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%; <u>(19) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票, 不得超过该上市公司可流通股票的 15%; 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, 不得超过该上市公司可流通股票的 30%;</u> <u>(20) 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, 本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;</u> <u>(21) 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</u></p>

	<u>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、期货市场波动、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。	<u>除上述第(2)、(12)、(20)、(21)项外,</u> 因证券、期货市场波动、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。
<b>第十四部分 基金资产估值</b>	
六、暂停估值的情形 无	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一致的,基金管理人应当暂停基金估值;</u>
<b>第十八部分 基金的信息披露</b>	
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 ..... <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> <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>
(七) 临时报告	(七) 临时报告

无	<u>27、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>
---	---

注：基金合同内容摘要涉及上述内容的一并修改。

## 《华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金托管协议》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>一、基金托管协议当事人</b>	
(二) 基金托管人 法定代表人： <u>王洪章</u>	(二) 基金托管人 法定代表人： <u>田国立</u>
<b>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</b>	
(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。…… 本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；本基金参与融资业务时，在任何交易日日终，持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%。	(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。…… 本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；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，现金 <u>(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)</u> 和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；本基金参与融资业务时，在任何交易日日终，持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%。
(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	(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：

(2) 在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；

(12) 本基金持有的所有流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的 **20%**；本基金持有的同一流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的 10%；

因证券、期货市场波动、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。

限进行监督：

(2) 在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；

(12) 本基金持有的所有流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的 15%；本基金持有的同一流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的 10%；

(16) 本基金管理人管理的且由本托管人托管的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的且由本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，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

(17) 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，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(18) 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；

除上述第（2）、（9）、（17）、（18）项外，因证券、期货市场波动、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。

八、基金资产净值计算和会计核算	
(四) 暂停估值与公告基金份额净值的情形 无	(四) 暂停估值与公告基金份额净值的情形 4. <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一致的，基金管理人应当暂停基金估值；</u>

## 《华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》 条款修改对照表

修改前	修改后
<b>第一部分 前言</b>	
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》”)……《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》”)……《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。
<b>第二部分 释义</b>	
无	<u>14、《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> <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</u>

	<u>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>
<b>第六部分 基金份额的开放期、封闭期、申购与赎回</b>	
六、申购和赎回的数量限制 无	六、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。具体规定请参见招募说明书或相关公告。</u>
七、申购和赎回的价格、费用及其用途 3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用……	七、申购和赎回的价格、费用及其用途 3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示， <u>其中对持续持有期少于 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。</u> 赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用……
八、拒绝或暂停申购的情形 …… 6、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术保障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。  发生上述第 1、2、3、 <del>5</del> 、6、7 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时……	八、拒绝或暂停申购的情形 …… <u>5、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> <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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。</u>

	<p><u>8、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术故障</u>等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。</p> <p>发生上述第 1、2、3、6、7、<u>8、9</u> 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时……</p>
<p>九、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 ……</p> <p>发生上述第 1、2、3、4、6、7 项暂停赎回情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时……</p>	<p>九、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 ……</p> <p><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>发生上述第 1、2、3、4、6、7、<u>8</u> 项暂停赎回情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时……</p>
<p>十、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 无</p>	<p>十、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式</p> <p><u>(3) 在开放期内，当基金出现巨额赎回时，在单个基金份额持有人赎回申请超过前一工作日基金总份额 20%的情形下，基金管理人认为支付该基金份额持有人的全部赎回申请有困难或者因支付该基金份额持有人的全部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，对于该单个基金份额持有人不超过 20%（含 20%）部分的赎回申请按前述“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的方式处理，对超过 20%部分的其余赎回申请可以延期办理，但延期办理的期限不得超过 20 个工作日，如延期办</u></p>

	<p>理期限超过开放期的，在封闭期内继续办理延期赎回，即基金管理人仅为原开放期内因提交赎回申请超过前一工作日基金总份额<b>20%以上而被延期办理赎回的单个基金份额持有人办理赎回业务。</b></p>
<p><b>第七部分 基金合同当事人及权利义务</b></p>	
<p>一、基金管理人          (一) 基金管理人简况          住所：<del>上海浦东新区</del>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层<del>(200135)</del>          法定代表人：<del>齐亮</del>          二、基金托管人          (一) 基金托管人简况          法定代表人：<del>田国立</del>          注册资本：人民币<del>贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟捌佰肆拾捌万壹仟玖佰叁拾捌</del>元整</p>	<p>一、基金管理人          (一) 基金管理人简况          住所：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层          法定代表人：<u>贾波</u>          二、基金托管人          (一) 基金托管人简况          法定代表人：<u>陈四清</u>          注册资本：人民币<u>贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹</u>元整</p>
<p><b>第十二部分 基金的投资</b></p>	
<p>二、投资范围          .....          开放期内，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或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%。在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制。</p>	<p>二、投资范围          .....          开放期内，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金<u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>或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%。在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制。</p>
<p>四、投资限制          1、组合限制          (3) 开放期内，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</p>	<p>四、投资限制          1、组合限制          (3) 开放期内，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<u>（不包括结算备付金、存出保证</u></p>



<p>券。在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制；</p>	<p><u>金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券。在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制；</u>  <u>（18）开放期内，本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；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，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；</u>  <u>（19）开放期内，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，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u>  <u>（20）开放期内，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>因证券、期货市场波动、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。法律法规另有规定的，从其规定。</p>	<p><u>除上述第（3）、（14）、（19）、（20）项外，</u>因证券、期货市场波动、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。法律法规另有规定的，从其规定。</p>
<p><b>第十四部分 基金资产估值</b></p>	
<p>六、暂停估值的情形 无</p>	<p>六、暂停估值的情形 <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的，基金管理人应当暂停基金估值；</u></p>
<p><b>第十八部分 基金的信息披露</b></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>(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>(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 ..... <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有风险。</u> <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>(八) 临时报告 无</p>	<p>(八) 临时报告 <u>28、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></p>

注：基金合同内容摘要涉及上述内容的一并修改。

## 《华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金托管协议》 条款修改对照表

修改前	修改后
一、托管协议当事人	

<p>(一) 基金管理人 (或简称“管理人”) 住所: <u>上海浦东新区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号楼 17 层 法定代表人: <u>齐亮</u></p> <p>(二) 基金托管人 (或简称“托管人”) 法定代表人: <u>田国立</u> 注册资本: 人民币<u>贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟捌佰肆拾捌万壹仟玖佰叁拾捌</u>元整</p>	<p>(一) 基金管理人 (或简称“管理人”) 住所: <u>中国(上海)自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 法定代表人: <u>贾波</u></p> <p>(二) 基金托管人 (或简称“托管人”) 法定代表人: <u>陈四清</u> 注册资本: 人民币<u>贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹</u>元整</p>
<p><b>二、托管协议的依据、目的、原则和解释</b></p>	
<p>(一) 依据 本协议依据《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》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)及其他有关法律法规与《华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)订立。</p>	<p>(一) 依据 本协议依据《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>及其他有关法律法规与《华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)订立。</p>
<p><b>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</b></p>	
<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定,建立相关的技术系统,对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面: 1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。…… 开放期内,在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的现金或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%。在封闭期内,本基金不受上述 5%的限制。</p>	<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定,建立相关的技术系统,对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面: 1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。…… 开放期内,在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的现金<u>(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)</u>或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>2、对基金投融资比例进行监督：</p> <p>(3) 开放期内，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。在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制；</p> <p>因证券、期货市场波动、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>在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制。</p> <p>2、对基金投融资比例进行监督：</p> <p>(3) 开放期内，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<u>(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)</u>或者到期日在一年以内的政府债券。在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制；</p> <p><u>(18) 开放期内，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持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；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，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；</u></p> <p><u>(19) 开放期内，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，本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>(20) 开放期内，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；本基金管理人承诺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，并承担由于不一致所导致的风险和损失；</u></p> <p><u>除上述第 (3)、(14)、(19)、(20) 项外，</u>因证券、期货市</p>
--	--

	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。
--	---

## 《华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》 条款修改对照表

修改前	修改后
<b>第一部分 前言</b>	
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》”）……《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》”）……《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>《流动性风险规定》</u> ”）和其他有关法律法规。
<b>第二部分 释义</b>	
无	<u>14、《流动性风险规定》</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 <u>56、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)、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
<b>第六部分 基金份额的开放期、封闭期、申购与赎回</b>	
六、申购和赎回的数量限制 无	六、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。具体规定请参见招募说明书或相关公告。</u>
七、申购和赎回的价格、费用及其用途 3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用……	七、申购和赎回的价格、费用及其用途 3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示， <u>其中对持续持有期少于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。</u> 赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用……
八、拒绝或暂停申购的情形 …… 6、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术保障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。  发生上述第1、2、3、 <del>5</del> 、6、7项暂停申购情形且基金管理人决定暂停申购时……	八、拒绝或暂停申购的情形 …… <u>5、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> <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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。</u> <u>8、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术故障等</u>

	<p>异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。</p> <p>发生上述第 1、2、3、6、7、<u>8、9</u> 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时……</p>
<p>九、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 ……</p> <p>发生上述 1、2、3、4、6、7 项暂停赎回情形且基金管理人决定暂停赎回时……</p>	<p>九、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 ……</p> <p><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>发生上述 1、2、3、4、6、7、<u>8</u> 项暂停赎回情形且基金管理人决定暂停赎回时……</p>
<p>十、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>无</p>	<p>十、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><u>(3) 在开放期内，当基金出现巨额赎回时，在单个基金份额持有人赎回申请超过前一工作日基金总份额 20%的情形下，基金管理人认为支付该基金份额持有人的全部赎回申请有困难或者因支付该基金份额持有人的全部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，对于该单个基金份额持有人不超过 20%（含 20%）部分的赎回申请按前述“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的方式处理，对超过 20%部分的其余赎回申请可以延期办理，但延期办理的期限不得超过 20 个工作日，如延期办理期限超过开放期的，在封闭期内继续办理延期赎回，即基金管理人仅</u></p>

	<u>为原开放期内因提交赎回申请超过前一工作日基金总份额 20%以上而被延期办理赎回的单个基金份额持有人办理赎回业务。</u>
<b>第七部分 基金合同当事人及权利义务</b>	
<p>一、基金管理人</p> <p>(一) 基金管理人简况</p> <p>住所：<u>上海浦东新区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层-<del>(200135)</del></p> <p>法定代表人：<u>齐亮</u></p> <p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况</p> <p>法定代表人：<u>王洪章</u></p>	<p>一、基金管理人</p> <p>(一) 基金管理人简况</p> <p>住所：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层</p> <p>法定代表人：<u>贾波</u></p> <p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况</p> <p>法定代表人：<u>田国立</u></p>
<b>第十二部分 基金的投资</b>	
<p>二、投资范围</p> <p>.....</p> <p>开放期内，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或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%。在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制。</p>	<p>二、投资范围</p> <p>.....</p> <p>开放期内，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金（<u>不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>）或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%。在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制。</p>
<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(3) 开放期内，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。在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制；</p>	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(3) 开放期内，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（<u>不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>）或者到期日在一年以内的政府债券。在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制；</p> <p><u>(19) 开放期内，本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上</u></p>



	<p>市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的15%；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，不得超过该上市公司可流通股票的30%；</p> <p><u>(20) 开放期内，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，本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>(21) 开放期内，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>因证券、期货市场波动、上市公司合并、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。法律法规另有规定的，从其规定。</p>	<p><u>除上述第(3)、(14)、(20)、(21)项外，</u>因证券、期货市场波动、上市公司合并、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。法律法规另有规定的，从其规定。</p>
<p><b>第十四部分 基金资产估值</b></p>	
<p>六、暂停估值的情形</p> <p>无</p>	<p>六、暂停估值的情形</p> <p><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一致的，基金管理人应当暂停基金估值；</u></p>
<p><b>第十八部分 基金的信息披露</b></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>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>.....</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有风险。</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>(八) 临时报告 无</p>	<p>(八) 临时报告 <u>28、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></p>

注：基金合同内容摘要涉及上述内容的一并修改。

# 《华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金托管协议》

## 条款修改对照表

修改前	修改后
<b>一、基金托管协议当事人</b>	
<p>(一) 基金管理人            注册地址：<u>上海浦东新区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层            办公地址：<u>上海浦东新区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层            法定代表人：<u>齐亮</u></p> <p>(二) 基金托管人            法定代表人：<u>王洪章</u></p>	<p>(一) 基金管理人            注册地址：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层            办公地址：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层            法定代表人：<u>贾波</u></p> <p>(二) 基金托管人            法定代表人：<u>田国立</u></p>
<b>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</b>	
<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。……            开放期内，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或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%。在封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制。</p>	<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。……            开放期内，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金（<u>不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>）或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%。在封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制。</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>(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>

3. 开放期内，在扣除估值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。在封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制；

14. 本基金持有的所有流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的 **20%**；本基金持有的同一流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的 10%；

因证券、期货市场波动、上市公司合并、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。法律法规另有规定的，从其规定。

3. 开放期内，在扣除估值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 (不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等) 或者到期日在一年以内的政府债券。在封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制；

14. 本基金持有的所有流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的 15%；本基金持有的同一流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的 10%；

16. 开放期内，本基金管理人管理的且由本托管人托管的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的且由本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，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

17. 开放期内，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，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

18. 开放期内，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；

除上述第 3、11、17、18 项外，因证券、期货市场波动、上市公司合并、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。法律法规另有规定的，从其规定。

八、基金资产净值计算和会计核算	
(四) 暂停估值与公告基金份额净值的情形 无	(四) 暂停估值与公告基金份额净值的情形 <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一致的，基金管理人应当暂停基金估值；</u>

## 《华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金基金合同》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>第一部分 前言</b>	
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》”)……《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》”)……《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。
<b>第二部分 释义</b>	
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> <u>50、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</u>

	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
<b>第六部分 基金份额的申购与赎回</b>	
五、申购和赎回的数量限制 无	四十五、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,具体规定请参见招募说明书或相关公告。</u>
四十六、申购和赎回的价格、费用及其用途 3、赎回金额的计算及处理方式:本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定,并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用……	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 3、赎回金额的计算及处理方式:本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定,并在招募说明书中列示, <u>其中对持续持有期少于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。</u> 赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用……
七、拒绝或暂停申购的情形 …… 6、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术保障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。  发生上述第1、2、3、 <del>5</del> 、6、7项暂停申购情形且基金管理人决定暂停申购时……	七、拒绝或暂停申购的情形 …… <u>5、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> <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,基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。</u> 8、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无

	<p>法正常运行。</p> <p>发生上述第 1、2、3、6、7、<u>8、9</u> 项暂停申购情形且基金管理人决定暂停申购时……</p>
<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 ……</p> <p>发生上述 1、2、3、5、6、7 项情形且基金管理人决定暂停赎回时……</p>	<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 ……</p> <p><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>发生上述 1、2、3、5、6、7、<u>8</u> 项情形且基金管理人决定暂停赎回时……</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>无</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><u>(3) 若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 20%，基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出 20%的赎回申请实施延期办理。而对该单个基金份额持有人 20%以内（含 20%）的赎回申请，基金管理人根据前述“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。如下一开放日，该单一基金份额持有人剩余未赎回部分仍旧超出前述比例约定的，继续按前述规则处理，直至该单一基金份额持有人单个开放日内申请赎回的基金份额占上一开放日基金总份额的比例低于前述比例。</u></p>
第七部分 基金合同当事人及权利义务	

<p>一、基金管理人  (一) 基金管理人简况  住所：<del>上海浦东新区</del>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 <del>(200135)</del>  法定代表人：<b>齐亮</b></p> <p>二、基金托管人  (一) 基金托管人简况  法定代表人：<del>田国立</del>  注册资本：人民币<b>贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟捌佰肆拾捌万壹仟玖佰叁拾捌元整</b></p>	<p>一、基金管理人  (一) 基金管理人简况  住所：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层  法定代表人：<b>贾波</b></p> <p>二、基金托管人  (一) 基金托管人简况  法定代表人：<b>陈四清</b>  注册资本：人民币<b>贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整</b></p>
<b>第十二部分 基金的投资</b>	
<p>二、投资范围  .....  本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>二、投资范围  .....  本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金 <u>(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)</u> 和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>
<p>四、投资限制  1、组合限制  (2) 在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p>	<p>四、投资限制  1、组合限制  (2) 在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金 <u>(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)</u> 和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；  <u>(22) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；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</u></p>



	<p><u>得超过该上市公司可流通股票的 30%；</u></p> <p><u>(23)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，本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>(24)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>
因证券、期货市场波动、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。法律法规另有规定的，从其规定。	<u>除上述第（2）、（12）、（23）、（24）项外，</u> 因证券、期货市场波动、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。法律法规另有规定的，从其规定。
<b>第十四部分 基金资产估值</b>	
六、暂停估值的情形 无	<p>六、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的，基金管理人应当暂停基金估值；</u></p>
<b>第十八部分 基金的信息披露</b>	
<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>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>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、</u></p>

	<p>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<u>特有</u>风险。</p> <p>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。</p>
<p>(七) 临时报告</p> <p>无</p>	<p>(七) 临时报告</p> <p>27、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；</p>

注：基金合同内容摘要涉及上述内容的一并修改。

## 《华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金托管协议》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>一、托管协议当事人</b>	
<p>(一) 基金管理人（或简称“管理人”）</p> <p>住所：<del>上海浦东新区</del>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号楼-17 层</p> <p>法定代表人：<b>齐亮</b></p> <p>(二) 基金托管人（或简称“托管人”）</p> <p>法定代表人：<b>田国立</b></p> <p>注册资本：人民币<b>贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟捌佰肆拾捌万壹仟玖佰叁拾捌</b>元整</p>	<p>(一) 基金管理人（或简称“管理人”）</p> <p>住所：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层</p> <p>法定代表人：<b>贾波</b></p> <p>(二) 基金托管人（或简称“托管人”）</p> <p>法定代表人：<b>陈四清</b></p> <p>注册资本：人民币<b>贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹</b>元整</p>

<b>二、托管协议的依据、目的、原则和解释</b>	
<p>(一) 依据</p> <p>本协议依据《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》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）及其他有关法律法规与《华泰柏瑞量化驱动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》”）订立。</p>	<p>(一) 依据</p> <p>本协议依据《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>及其他有关法律法规与《华泰柏瑞量化驱动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》”）订立。</p>
<b>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</b>	
<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面：</p> <p>1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。……</p> <p>本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面：</p> <p>1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。……</p> <p>本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金（<u>不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>）和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>
<p>2、对基金投融资比例进行监督：</p> <p>(2) 在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p> <p>因证券、期货市场波动、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 个工作日内进行调整。法律法规另有规定的，</p>	<p>2、对基金投融资比例进行监督：</p> <p>(2) 在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金（<u>不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>）和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p> <p><u>(22) 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持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理且由本基金托管人托管的全部投资</u></p>

<p>从其规定。</p>	<p><u>组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 30%;</u></p> <p><u>(23)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,本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>(24)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;本基金管理人承诺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,并承担由于不一致所导致的风险和损失;</u></p> <p><u>除上述第(2)、(12)、(23)、(24)项外,因证券、期货市场波动、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。法律法规另有规定的,从其规定。</u></p>
--------------	--

## 《华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金基金合同》条款修改对照表

修改前	修改后
<p>一、前言</p> <p>(一)订立《华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金基金合同》(以</p>	<p>(一)订立《华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金基金合同》(以</p>

<p>下简称“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</p> <p>订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法通则》……和《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）及其他法律法规的有关规定。</p>	<p>下简称“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</p> <p>订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法通则》……和《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、<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>”）及其他法律法规的有关规定。</p>
<p>二、释义</p>	
<p>无</p>	<p><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；</p> <p><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）、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；</p>
<p>六、基金份额的申购、赎回与转换</p>	
<p>（五）申购与赎回的数额限制</p> <p>无</p>	<p>（五）申购与赎回的数额限制</p> <p><u>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，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</u></p>
<p>（七）申购和赎回的费用及其用途</p> <p>3、本基金的赎回费率按照持有时间递减，即相关基金份额持有时间越长，所适用的赎回费率越低，实际执行的赎回费率在招募说明</p>	<p>（七）申购和赎回的费用及其用途</p> <p>3、本基金的赎回费率按照持有时间递减，即相关基金份额持有时间越长、所适用的赎回费率越低。实际执行的赎回费率在招募说明</p>

<p>书中载明。</p>	<p>书中载明，其中对持续持有期少于 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。</p>
<p>(九) 巨额赎回的认定及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 无</p>	<p>(九) 巨额赎回的认定及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 <u>(3) 若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 20%，基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出 20% 的赎回申请实施延期办理。而对该单个基金份额持有人 20% 以内（含 20%）的赎回申请，基金管理人根据前述“（1）接受全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。如下一开放日，该单一基金份额持有人剩余未赎回部分仍旧超出前述比例约定的，继续按前述规则处理，直至该单一基金份额持有人单个开放日内申请赎回的基金份额占上一开放日基金总份额的比例低于前述比例。</u></p>
<p>(十) 拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理 1、在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请： ……  基金管理人决定拒绝或暂停接受某些投资者的申购申请时，申购款项将退回投资者账户。基金管理人决定暂停接受申购申请时，应当依法公告。在暂停申购的情形消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理并依法公告。</p>	<p>(十) 拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理 1、在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请： …… <u>(5) 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> <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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施；</u>  基金管理人决定拒绝或暂停接受某些投资者的申购申请时，申购款</p>

	项将退回投资者账户。 <u>发生上述第（1）、（2）、（3）、（4）、（6）、（7）项情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，应当依法公告。在暂停申购的情形消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理并依法公告。</u>
2、在以下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请： .....	2、在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请： ..... <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>
<b>八、基金合同当事人及其权利义务</b>	
（一）基金管理人 住所： <u>上海浦东新区</u> 民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号楼 17 层 （二）基金托管人 注册资本：人民币 <u>贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍</u> 元整	（一）基金管理人 住所： <u>中国（上海）自由贸易试验区</u> 民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 （二）基金托管人 注册资本：人民币 <u>贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹</u> 元整
<b>十四、基金的投资</b>	
（二）投资范围 ..... 本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 60%—95%；债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 5%—40%。其中，基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%，基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于	（二）投资范围 ..... 本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 60%—95%；债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 5%—40%。其中，基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%，基金保留的现金 <u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u> 以及投资

基金资产净值的 5%。	于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>(九) 投资禁止行为与限制</p> <p>2、基金投资组合比例限制</p> <p>(5) 现金和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>(九) 投资禁止行为与限制</p> <p>2、基金投资组合比例限制</p> <p>(5) 现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)和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><u>(10)本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 15%;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,不得超过该上市公司可流通股票的 30%;</u></p> <p><u>(11)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,本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>(12)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>(十) 投资组合比例调整</p> <p>基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的,基金管理人应当在十个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定时,从其规定。</p>	<p>(十) 投资组合比例调整</p> <p>基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。<u>除上述第(5)、(11)、(12)项外</u>,因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的,基金管理人应当在十个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定时,从其规定。</p>
<p><b>十七、基金资产估值</b></p>	



<p>(六) 暂停估值的情形 无</p>	<p>(六) 暂停估值的情形 <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的，基金管理人应当暂停基金估值；</u></p>
<p><b>二十一、基金的信息披露</b></p>	
<p>(五) 定期报告 .....</p>	<p>(五) 定期报告 ..... <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> <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>(六) 临时报告与公告 无</p>	<p>(六) 临时报告与公告 <u>28、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></p>

注：基金合同内容摘要涉及上述内容的一并修改。

## 《华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金托管协议》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>一、托管协议当事人</b>	
<p>(一) 基金管理人（或简称“管理人”） 住所：<del>上海浦东新区</del>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号<del>楼</del>17 层</p> <p>(二) 基金托管人（或简称“托管人”） 注册资本：人民币<del>贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍</del>元整</p>	<p>(一) 基金管理人（或简称“管理人”） 住所：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层</p> <p>(二) 基金托管人（或简称“托管人”） 注册资本：人民币<del>贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹</del>元整</p>
<b>二、托管协议的依据、目的、原则和解释</b>	
<p>(一) 依据 本协议依据《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》”）、《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》”）及其他有关法律、法规与《华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）订立。</p>	<p>(一) 依据 本协议依据《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》”）、《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》</u>及其他有关法律、法规与《华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）订立。</p>
<b>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</b>	
<p>2、对基金投融资比例进行监督。……</p>	<p>2、对基金投融资比例进行监督。…… 其中，基金托管人根据<u>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</u>对投资组合的比例做如下监督： 1) <u>现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</u></p>

	<p>2) <u>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持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 15%; 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,不得超过该上市公司可流通股票的 30%;</u></p> <p>3) <u>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, 本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;</u></p> <p>4) <u>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; 本基金管理人承诺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, 并承担由于不一致所导致的风险和损失;</u></p>
--	--

## 《华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》条款修改对照表

修改前	修改后
<p>第一部分 前言</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》”)……《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简</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》”)……《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简</p>

称“《信息披露办法》”)和其他有关法律法规。	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。
<b>第二部分 释义</b>	
无	<p><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></p> <p><u>50、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>
<b>第六部分 基金份额的申购与赎回</b>	
<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>无</p>	<p>四十七、申购和赎回的数量限制</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，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</u></p>
<p>四十八、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用……</p>	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示，<u>其中对持续持有期少于 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</u>。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用……</p>

<p>七、拒绝或暂停申购的情形 .....</p> <p>6、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术保障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。</p> <p>发生上述第 1、2、3、<del>5</del>、6、7 项暂停申购情形且基金管理人决定暂停申购时.....</p>	<p>七、拒绝或暂停申购的情形 .....</p> <p><u>5、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><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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。</u></p> <p>8、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。</p> <p>发生上述第 1、2、3、6、7、<u>8、9</u> 项暂停申购情形且基金管理人决定暂停申购时.....</p>
<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 .....</p> <p>发生上述 1、2、3、5、6、7 项情形且基金管理人决定暂停赎回时.....</p>	<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 .....</p> <p><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>发生上述 1、2、3、5、6、7、<u>8</u> 项情形且基金管理人决定暂停赎回时.....</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</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</p>

<p>无</p>	<p><u>(3) 若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 20%，基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出 20%的赎回申请实施延期办理。而对该单个基金份额持有人 20%以内（含 20%）的赎回申请，基金管理人根据前述“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。如下一开放日，该单一基金份额持有人剩余未赎回部分仍旧超出前述比例约定的，继续按前述规则处理，直至该单一基金份额持有人单个开放日内申请赎回的基金份额占上一开放日基金总份额的比例低于前述比例。</u></p>
<p><b>第七部分 基金合同当事人及权利义务</b></p>	
<p>一、基金管理人        （一）基金管理人简况        住所：<del>上海浦东新区</del>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 <del>（200135）</del>        法定代表人：<b>齐亮</b></p> <p>二、基金托管人        （一）基金托管人简况        法定代表人：<b>王洪章</b></p>	<p>一、基金管理人        （一）基金管理人简况        住所：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层        法定代表人：<b>贾波</b></p> <p>二、基金托管人        （一）基金托管人简况        法定代表人：<b>田国立</b></p>
<p><b>第十二部分 基金的投资</b></p>	
<p>二、投资范围        ……        本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>二、投资范围        ……        本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金 <u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>

<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(2) 在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p>	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(2) 在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金<u>(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)</u>和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p> <p>(22)<u>本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；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，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；</u></p> <p>(23)<u>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，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u></p> <p>(24)<u>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>因证券、期货市场波动、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。法律法规另有规定的，从其规定。</p>	<p><u>除上述第 (2)、(12)、(23)、(24) 项外</u>，因证券、期货市场波动、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。法律法规另有规定的，从其规定。</p>
<p><b>第十四部分 基金资产估值</b></p>	
<p>六、暂停估值的情形</p> <p>无</p>	<p>六、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的，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) 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>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>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></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>(七) 临时报告</p> <p>无</p>	<p>(七) 临时报告</p> <p><u>27、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></p>

注：基金合同内容摘要涉及上述内容的一并修改。



## 《华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>一、基金托管协议当事人</b>	
<p>(一) 基金管理人            注册地址：<u>上海浦东新区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层            办公地址：<u>上海浦东新区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层            法定代表人：<u>齐亮</u></p> <p>(二) 基金托管人            法定代表人：<u>王洪章</u></p>	<p>(一) 基金管理人            注册地址：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层            办公地址：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层            法定代表人：<u>贾波</u></p> <p>(二) 基金托管人            法定代表人：<u>田国立</u></p>
<b>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</b>	
<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。……            本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。……            本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金（<u>不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>）和到期日在一年以内的政府债券的投资比例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：            2. 在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例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：            2. 在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金（<u>不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>）和到期日在一年以内的政府</p>

<p>12. 本基金持有的所有流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的 <b>20%</b>；本基金持有的同一流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的 10%；</p> <p>因证券、期货市场波动、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。法律法规另有规定的，从其规定。</p>	<p>债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p> <p>12. 本基金持有的所有流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的 <b>15%</b>；本基金持有的同一流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的 10%；</p> <p><b><u>19. 本基金管理人管理的且由本托管人托管的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的且由本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，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；</u></b></p> <p><b><u>20. 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，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u></b></p> <p><b><u>21. 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></b></p> <p><u>除上述第 2、9、20、21 项外，</u>因证券、期货市场波动、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。法律法规另有规定的，从其规定。</p>
<p><b>八、基金资产净值计算和会计核算</b></p>	
<p>(四) 暂停估值与公告基金份额净值的情形</p> <p>无</p>	<p>(四) 暂停估值与公告基金份额净值的情形</p> <p><b><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，</u></b></p>

经与基金托管人协商一致的，基金管理人应当暂停基金估值；

## 《华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金基金合同》条款修改对照表

修改前	修改后
<p>一、前言</p> <p>(一) 订立《华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“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</p> <p>订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法通则》……《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《证券投资基金销售管理办法》(以下简称《销售办法》)及其他法律法规的有关规定。</p>	<p>(一) 订立《华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“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</p> <p>订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法通则》……《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称《信息披露办法》)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称《销售办法》)、<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>及其他法律法规的有关规定。</p>
<p>二、释义</p> <p>无</p>	<p><u>《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></p> <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>

六、基金份额的申购、赎回与转换	
<p>(五) 申购与赎回的数额限制</p> <p>无</p>	<p>(五) 申购与赎回的数额限制</p> <p><u>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,具体规定请参见招募说明书或相关公告。</u></p>
<p>(七) 申购和赎回的费用及其用途</p> <p>3、本基金 A 类份额的赎回费率按照持有时间递减,即相关基金份额持有时间越长,所适用的赎回费率越低,赎回费用等于赎回金额乘以所适用的赎回费率(见前述计算公式)。实际执行的赎回费率在招募说明书中载明。H 类份额的赎回费率在招募说明书或其他相关公告中载明。</p>	<p>(七) 申购和赎回的费用及其用途</p> <p>3、本基金 A 类份额的赎回费率按照持有时间递减,即相关基金份额持有时间越长,所适用的赎回费率越低,赎回费用等于赎回金额乘以所适用的赎回费率(见前述计算公式)。实际执行的赎回费率在招募说明书中载明,<u>其中对持续持有期少于 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。</u>H 类份额的赎回费率在招募说明书或其他相关公告中载明。</p>
<p>(九) 巨额赎回的认定及处理方式</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>无</p>	<p>(九) 巨额赎回的认定及处理方式</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p><u>(3) 若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 20%,基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出 20%的赎回申请实施延期办理。而对该单个基金份额持有人 20%以内(含 20%)的赎回申请,基金管理人根据前述“ (1) 接受全额赎回”或“ (2) 部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。如下一开放日,该单一基金份额持有人剩余未赎回部分仍旧超出前述比例约定的,继续按前述规则处理,直至该单一基金份额持有人单个开放日内申请赎回的基金份额占上一开放日基金总份额的比例低于前述比例。</u></p>

<p>(十) 拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理</p> <p>1、在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请： .....</p> <p>基金管理人决定拒绝或暂停接受某些投资者的申购申请时，申购款项将退回投资者账户。基金管理人决定暂停接受申购申请时，应当依法公告。在暂停申购的情形消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理并依法公告。</p>	<p>(十) 拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理</p> <p>1、在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请： .....</p> <p><u>(7) 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><u>(8) 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>基金管理人决定拒绝或暂停接受某些投资者的申购申请时，申购款项将退回投资者账户。<u>发生上述第（1）、（2）、（3）、（4）、（5）、（6）、（8）、（9）项情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，应当依法公告。在暂停申购的情形消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理并依法公告。</u></p>
<p>2、在以下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请： .....</p>	<p>2、在以下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请： .....</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><b>八、基金合同当事人及其权利义务</b></p>	
<p>(一) 基金管理人</p> <p>1、基金管理人基本情况</p>	<p>(一) 基金管理人</p> <p>1、基金管理人基本情况</p>

<p>住所：<del>上海浦东新区</del>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号楼 17 层          法定代表人：<b>齐亮</b>          （二）基金托管人          1、基金托管人基本情况          法定代表人：<b>田国立</b>          注册资本：人民币<b>贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟捌佰肆拾捌万壹仟玖佰叁拾捌</b>元整</p>	<p>住所：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层          法定代表人：<b>贾波</b>          （二）基金托管人          1、基金托管人基本情况          法定代表人：<b>陈四清</b>          注册资本：人民币<b>贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹</b>元整</p>
<p><b>十四、基金的投资</b></p>	
<p>（二）投资范围          ……          本基金股票资产投资比例不低于基金资产的 60%；现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比率不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>（二）投资范围          ……          本基金股票资产投资比例不低于基金资产的 60%；现金<u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>和到期日在一年以内的政府债券的投资比率不低于基金资产净值的 5%。</p>
<p>（九）投资禁止行为与限制          2、基金投资组合比例限制          （7）现金和到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；          （16）本基金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，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。</p>	<p>（九）投资禁止行为与限制          2、基金投资组合比例限制          （7）现金<u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>和到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；          （16）本基金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，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金<u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>或到期日在一年以内的政府债券。  <u>（17）本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；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</u></p>

	<p><u>得超过该上市公司可流通股票的 30%。</u></p> <p><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，本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>(19)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>(十) 投资组合比例调整</p> <p>基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在十个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。</p>	<p>(十) 投资组合比例调整</p> <p>基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。<u>除上述第(7)、(18)、(19)项外</u>，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在十个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。</p>
<p><b>十七、基金资产的估值</b></p>	
<p>(六) 暂停估值的情形</p> <p>无</p>	<p>(六) 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的，基金管理人应当暂停基金估值；</u></p>
<p><b>二十一、基金的信息披露</b></p>	
<p>(五) 定期报告</p> <p>.....</p>	<p>(五) 定期报告</p> <p>.....</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</u></p>

	<p>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有风险。</p> <p>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。</p>
<p>(六) 临时报告与公告</p> <p>无</p>	<p>(六) 临时报告与公告</p> <p>28、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;</p>

注：基金合同内容摘要涉及上述内容的一并修改。

## 《华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金托管协议》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>一、托管协议当事人</b>	
<p>(一) 基金管理人(或简称“管理人”)</p> <p>住所: <del>上海浦东新区</del>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号楼 17 层</p> <p>法定代表人: <del>齐亮</del></p> <p>(二) 基金托管人(或简称“托管人”)</p> <p>法定代表人: <del>田国立</del></p> <p>注册资本: 人民币 <del>贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟捌佰肆拾捌万壹仟玖佰叁</del></p>	<p>(一) 基金管理人(或简称“管理人”)</p> <p>住所: <u>中国(上海)自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层</p> <p>法定代表人: <u>贾波</u></p> <p>(二) 基金托管人(或简称“托管人”)</p> <p>法定代表人: <u>陈四清</u></p> <p>注册资本: 人民币 <u>贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆</u></p>



拾捌元整	拾壹元整
<b>二、托管协议的依据、目的、原则和解释</b>	
<p>(一) 依据</p> <p>本协议依据《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》”）、《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》”）及其他有关法律法规与《华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）订立。</p>	<p>(一) 依据</p> <p>本协议依据《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》”）、《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》</u>及其他有关法律法规与《华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）订立。</p>
<b>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</b>	
<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面：</p> <p>1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。……</p> <p>本基金股票资产投资比例不低于基金资产的 60%；现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比率不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面：</p> <p>1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。……</p> <p>本基金股票资产投资比例不低于基金资产的 60%；现金<u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>和到期日在一年以内的政府债券的投资比率不低于基金资产净值的 5%。</p>
<p>2、对基金投融资比例进行监督：</p> <p>(7) 现金和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>(16) 本基金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，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。</p>	<p>2、对基金投融资比例进行监督：</p> <p>(7) 现金<u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>和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>(16) 本基金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，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金<u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>或到期日在一年以内的政府债券。</p>

基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在十个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。

(17)本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%（资产托管人项下义务仅限于监管由其担任资产托管人的资产管理人所管理全部基金财产的投资符合上述比例限制）；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，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（资产托管人项下义务仅限于监管由其担任资产托管人的资产管理人所管理全部基金财产的投资符合上述比例限制）；

(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，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(19)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；本基金管理人承诺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，并承担由于不一致所导致的风险和损失。

基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。除上述第（7）、（18）、（19）项外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在十个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。

## 《华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金基金合同》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>第一部分 前言</b>	
<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》”)……《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》”)……《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。</p>
<b>第二部分 释义</b>	
无	<p><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></p> <p><u>50、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>
<b>第六部分 基金份额的申购与赎回</b>	
<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>无</p>	<p>四十九、申购和赎回的数量限制</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</u></p>

	<u>保护存量基金份额持有人的合法权益,具体规定请参见招募说明书或相关公告。</u>
五十、申购和赎回的价格、费用及其用途 3、赎回金额的计算及处理方式:本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定,并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用……	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 3、赎回金额的计算及处理方式:本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定,并在招募说明书中列示, <u>其中对持续持有期少于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。</u> 赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用……
七、拒绝或暂停申购的情形 …… 6、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术保障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。  发生上述第1、2、3、 <del>5</del> 、6、7项暂停申购情形且基金管理人决定暂停申购时……	七、拒绝或暂停申购的情形 …… <u>5、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> <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,基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。</u> 8、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。  发生上述第1、2、3、6、7、 <u>8、9</u> 项暂停申购情形且基金管理人决定暂停申购时……
八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 ……	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</u>

<p>发生上述 1、2、3、5、6、7 项情形且基金管理人决定暂停赎回时……</p>	<p><u>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>发生上述 1、2、3、5、6、7、8 项情形且基金管理人决定暂停赎回时……</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 无</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 <u>(3) 若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 20%，基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出 20%的赎回申请实施延期办理。而对该单个基金份额持有人 20%以内（含 20%）的赎回申请，基金管理人根据前述“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。如下一开放日，该单一基金份额持有人剩余未赎回部分仍旧超出前述比例约定的，继续按前述规则处理，直至该单一基金份额持有人单个开放日内申请赎回的基金份额占上一开放日基金总份额的比例低于前述比例。</u></p>
<p><b>第七部分 基金合同当事人及权利义务</b></p>	
<p>一、基金管理人 (一) 基金管理人简况 住所：<del>上海浦东新区</del>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层<del>(200135)</del> 法定代表人：<b>齐亮</b> 二、基金托管人 (一) 基金托管人简况</p>	<p>一、基金管理人 (一) 基金管理人简况 住所：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 法定代表人：<u>贾波</u> 二、基金托管人 (一) 基金托管人简况</p>

<p>法定代表人：<b>姜建清</b>          注册资本：人民币 <b>349,018,545,827</b> 元</p>	<p>法定代表人：<b>易会满</b>          注册资本：人民币 <b>349,321,234,600</b> 元</p>
<p><b>第十二部分 基金的投资</b></p>	
<p>二、投资范围          ……          本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>二、投资范围          ……          本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金（<b>不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</b>）和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>
<p>四、投资限制          1、组合限制          （2）在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p>	<p>四、投资限制          1、组合限制          （2）在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金（<b>不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</b>）和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；  <u>（22）本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；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，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；</u>  <u>（23）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，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u>  <u>（24）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>因证券、期货市场波动、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。法律法规另有规定的，从其规定。</p>	<p><u>除上述第（2）、（12）、（23）、（24）项外</u>，因证券、期货市场波动、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。法律法规另有规定的，从其规定。</p>
<p><b>第十四部分 基金资产估值</b></p>	
<p>六、暂停估值的情形 无</p>	<p>六、暂停估值的情形 <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一致的，基金管理人应当暂停基金估值；</u></p>
<p><b>第十八部分 基金的信息披露</b></p>	
<p>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 ……</p>	<p>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 …… <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有风险。</u> <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>（七）临时报告 无</p>	<p>（七）临时报告 <u>27、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></p>

注：基金合同内容摘要涉及上述内容的一并修改。

## 《华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金托管协议》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>一、基金托管协议当事人</b>	
<p>(一) 基金管理人 住所：<del>上海浦东新区</del>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层<del>(200135)</del> 法定代表人：<b>齐亮</b> 联系人：<b>陈培</b></p> <p>(二) 基金托管人 法定代表人：<b>姜建清</b> 注册资本：人民币 <b>349,018,545,827</b> 元</p>	<p>(一) 基金管理人 住所：<b>中国（上海）自由贸易试验区</b>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 法定代表人：<b>贾波</b> 联系人：<b>赵景云</b></p> <p>(二) 基金托管人 法定代表人：<b>易会满</b> 注册资本：人民币 <b>349,321,234,600</b> 元</p>
<b>二、基金托管协议的依据、目的和原则</b>	
<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〉》、《华泰柏瑞量化智慧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〉》、<b>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</b>、《华泰柏瑞量化智慧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>
<b>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</b>	
<p>(一) 基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权 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</p>	<p>(一) 基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权 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</p>



<p>下述基金投融资比例进行监督：</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：</p> <p>本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>下述基金投融资比例进行监督：</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：</p> <p>本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金（<u>不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>）和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</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>b、在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</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>b、在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金（<u>不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>）和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p> <p><u>v、本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；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，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；</u></p> <p><u>w、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，本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>x、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>(3) 法规允许的基金投资比例调整期限</p> <p>由于证券、期货市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管</p>	<p>(3) 法规允许的基金投资比例调整期限</p> <p><u>除上述第 b、l、w、x 项外</u>，由于证券、期货市场波动、上市公司</p>

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，以达到规定的投资比例限制要求。法律法规另有规定的从其规定。	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，以达到规定的投资比例限制要求。法律法规另有规定的从其规定。
---	--

## 《华泰柏瑞睿利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>第一部分 前言</b>	
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》”）……《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》”）……《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>《流动性风险规定》</u> ”）和其他有关法律法规。
<b>第二部分 释义</b>	
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> <u>52、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、</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
<b>第六部分 基金份额的申购与赎回</b>	
五、申购和赎回的数量限制 无	五十一、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，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</u>
五十二、申购和赎回的价格、费用及其用途 3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额的基金份额净值并扣除相应的费用……	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示， <u>其中对持续持有期少于 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。</u> 赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额的基金份额净值并扣除相应的费用……
七、拒绝或暂停申购的情形 …… 发生上述第 1、2、3、 <del>5</del> 、6、7 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时……	七、拒绝或暂停申购的情形 …… <u>5、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> <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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。</u>  发生上述第 1、2、3、6、7、 <u>8、9</u> 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时……

<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 .....</p> <p>发生上述 1、2、3、5、6、7 项情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时.....</p>	<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 .....</p> <p><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>发生上述 1、2、3、5、6、7、<u>8</u> 项情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时.....</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>无</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><u>(3) 若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 20%，基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出 20%的赎回申请实施延期办理。而对该单个基金份额持有人 20%以内（含 20%）的赎回申请，基金管理人根据前述“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。如下一开放日，该单一基金份额持有人剩余未赎回部分仍旧超出前述比例约定的，继续按前述规则处理，直至该单一基金份额持有人单个开放日内申请赎回的基金份额占上一开放日基金总份额的比例低于前述比例。</u></p>
<p><b>第七部分 基金合同当事人及权利义务</b></p>	
<p>一、基金管理人</p> <p>（一）基金管理人简况</p> <p>住所：<del>上海浦东新区</del>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层<del>（200135）</del></p>	<p>一、基金管理人</p> <p>（一）基金管理人简况</p> <p>住所：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层</p>

<p>法定代表人：<b>齐亮</b></p> <p>二、基金托管人</p> <p>（一）基金托管人简况</p> <p>注册资本：<del>190.52</del>亿元人民币</p>	<p>法定代表人：<b>贾波</b></p> <p>二、基金托管人</p> <p>（一）基金托管人简况</p> <p>注册资本：<u>207.74</u>亿元人民币</p>
<p><b>第十二部分 基金的投资</b></p>	
<p>二、投资范围</p> <p>.....</p> <p>本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>二、投资范围</p> <p>.....</p> <p>本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；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，现金<u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>
<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>（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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p>	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>（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，现金<u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p> <p><u>（18）本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；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，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；</u></p> <p><u>（19）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，本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>（20）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</u></p>

	<u>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、期货市场波动、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。	<u>除上述第(2)、(12)、(19)、(20)项外,</u> 因证券、期货市场波动、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。
<b>第十四部分 基金资产估值</b>	
六、暂停估值的情形 无	六、暂停估值的情形 <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的,基金管理人应当暂停基金估值;</u>
<b>第十八部分 基金的信息披露</b>	
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 ..... <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> <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>
(七) 临时报告	(七) 临时报告

无	<u>28、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>
---	---

注：基金合同内容摘要涉及上述内容的一并修改。

## 《华泰柏瑞睿利灵活配置混合型证券投资基金托管协议》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>一、基金托管协议当事人</b>	
（一）基金管理人 注册地址： <u>上海浦东新区</u> 民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 办公地址： <u>上海浦东新区</u> 民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 法定代表人： <b>齐亮</b>	（一）基金管理人 注册地址： <u>中国（上海）自由贸易试验区</u> 民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 办公地址： <u>中国（上海）自由贸易试验区</u> 民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 法定代表人： <b>贾波</b>
（二）基金托管人 注册资本： <b>190.52</b> 亿元人民币	（二）基金托管人 注册资本： <b>207.74</b> 亿元人民币
<b>二、基金托管协议的依据、目的和原则</b>	
（一）订立托管协议的依据 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》”）、《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	（一）订立托管协议的依据 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》”）、《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

<p>简称“《信息披露办法》”)等有关法律法规、《华泰柏瑞睿利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》”)及其他有关规定制订。</p>	<p>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>等有关法律法规、《华泰柏瑞睿利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》”)及其他有关规定制订。</p>
<p><b>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</b></p>	
<p>(一) 基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权 ..... 本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%; 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, 现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例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 ..... 本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%; 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, 现金<u>(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)</u>和到期日在一年以内的政府债券的投资比例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: (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, 现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%;  因证券、期货市场波动、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 个工作日内进行调整, 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>(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: (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, 现金<u>(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)</u>和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%; <u>(18) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票, 不得超过该上市公司可流通股票的 15%; 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, 不得超过该上市公司可流通股票的 30%;</u> <u>(19) 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, 本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>(20)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><u>除上述第(2)、(12)、(19)、(20)项外,因证券、期货市场波动、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。</u></p>
<b>八、基金资产净值计算和会计核算</b>	
<p>(四) 暂停估值与公告的情形</p> <p>无</p>	<p>(四) 暂停估值与公告的情形</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的,基金管理人应当暂停基金估值;</u></p>

## 《华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》

### 条款修改对照表

修改前	修改后
<b>一、前言</b>	
<p>(一) 订立《华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》(以下简称“本基金合同”)的目的、依据和</p>	<p>(一) 订立《华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》(以下简称“本基金合同”)的目的、依据和</p>

<p>原则</p> <p>2、订立本基金合同的依据</p> <p>订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法通则》……《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《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《交易型开放式指数证券投资基金（ETF）联接基金审核指引》（以下简称《审核指引》）及其他法律法规的有关规定。</p>	<p>原则</p> <p>2、订立本基金合同的依据</p> <p>订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法通则》……《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《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《交易型开放式指数证券投资基金（ETF）联接基金审核指引》（以下简称《审核指引》）及其他法律法规的有关规定。</p>
<p>二、释义</p>	
<p>无</p>	<p><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；</p> <p><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）、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；</p>
<p>六、基金份额的申购、赎回与转换</p>	
<p>（五）申购与赎回的数额限制</p> <p>无</p>	<p>（五）申购与赎回的数额限制</p> <p><u>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，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</u></p>

<p>(七) 申购和赎回的费用及其用途</p> <p>3、本基金的赎回费率按照持有时间递减，即相关基金份额持有时间越长，所适用的赎回费率越低，赎回费用等于赎回金额乘以所适用的赎回费率。实际执行的赎回费率在招募说明书中载明。</p>	<p>(七) 申购和赎回的费用及其用途</p> <p>3、本基金的赎回费率按照持有时间递减，即相关基金份额持有时间越长，所适用的赎回费率越低，赎回费用等于赎回金额乘以所适用的赎回费率。实际执行的赎回费率在招募说明书中载明，<u>其中对持续持有期少于 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。</u></p>
<p>(九) 巨额赎回的认定及处理方式</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>无</p>	<p>(九) 巨额赎回的认定及处理方式</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p><u>(3) 若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 20%，基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出 20%的赎回申请实施延期办理。而对该单个基金份额持有人 20%以内（含 20%）的赎回申请，基金管理人根据前述“（1）接受全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。如下一开放日，该单一基金份额持有人剩余未赎回部分仍旧超出前述比例约定的，继续按前述规则处理，直至该单一基金份额持有人单个开放日内申请赎回的基金份额占上一开放日基金总份额的比例低于前述比例。</u></p>
<p>(十) 拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理</p> <p>1、在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请：</p> <p>……</p> <p>基金管理人决定拒绝或暂停接受某些投资者的申购申请时，申购款项将退回投资者账户。发生上述（1）到（6）项及第（8）项情形，基金管理人决定暂停接受申购申请时，应当依法公告。……</p>	<p>(十) 拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理</p> <p>1、在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请：</p> <p>……</p> <p><u>(8) 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>

	基金管理人决定拒绝或暂停接受某些投资者的申购申请时,申购款项将退回投资者账户。发生上述(1)到(6)项及第(8)、(9)项情形,基金管理人决定暂停接受申购申请时,应当依法公告。……
2、在以下情况下,基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请: ……	2、在以下情况下,基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请: …… <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延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施;</u>
<b>八、基金合同当事人及权利义务</b>	
<p>(一) 基金管理人</p> <p>1、基金管理人基本情况</p> <p>住所: <u>上海市浦东新区</u>民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号 17 层 (200135)</p> <p>法定代表人: <u>齐亮</u></p> <p>(二) 基金托管人</p> <p>1、基金托管人基本情况</p> <p>住所: 北京市复兴门内大街 1 号</p> <p>法定代表人: <u>肖钢</u></p> <p>注册资本: 人民币<u>贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰仟零玖元</u></p>	<p>(一) 基金管理人</p> <p>1、基金管理人基本情况</p> <p>住所: <u>中国(上海)自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄<u>上海</u>证大五道口广场 1 号 17 层 (200135)</p> <p>法定代表人: <u>贾波</u></p> <p>(二) 基金托管人</p> <p>1、基金托管人基本情况</p> <p>住所: 北京市<u>西城区</u>复兴门内大街 1 号</p> <p>法定代表人: <u>陈四清</u></p> <p>注册资本: 人民币<u>贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整</u></p>
<b>十四、基金的投资</b>	
(二) 投资范围 ……	(二) 投资范围 ……

<p>正常情况下,本基金资产中投资于华泰柏瑞上证中小盘 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%; 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%; 股指期货以套期保值为目的, 权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。</p>	<p>正常情况下,本基金资产中投资于华泰柏瑞上证中小盘 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%; 现金 <u>(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)</u> 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%; 股指期货以套期保值为目的, 权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。</p>
<p>(九) 投资禁止行为与限制 2、基金投资组合比例限制 (3) 在任何交易日日终, 持有的买入股指期货合约价值, 不得超过基金资产净值的 10%; 在任何交易日日终, 持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和, 不得超过基金资产净值的 100%, 其中, 有价证券指股票、目标 ETF、债券 (不含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产 (不含质押式回购) 等; 在任何交易日日终, 持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票和目标 ETF 总市值的 20%; 在任何交易日内交易 (不包括平仓) 的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%; 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, 应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。</p>	<p>(九) 投资禁止行为与限制 2、基金投资组合比例限制 (3) 在任何交易日日终, 持有的买入股指期货合约价值, 不得超过基金资产净值的 10%; 在任何交易日日终, 持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和, 不得超过基金资产净值的 100%, 其中, 有价证券指股票、目标 ETF、债券 (不含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产 (不含质押式回购) 等; 在任何交易日日终, 持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票和目标 ETF 总市值的 20%; 在任何交易日内交易 (不包括平仓) 的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%; <u>(4) 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, 应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金 (不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等) 或到期日在一年以内的政府债券;</u> <u>(5) 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, 本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;</u> <u>(6) 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</u></p>

	<u>金合同约定的投资范围保持一致；</u>
<p>(十) 投资组合比例调整</p> <p>基金管理人应当自基金合同生效之日起三个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。因证券期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在十个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。</p>	<p>(十) 投资组合比例调整</p> <p>基金管理人应当自基金合同生效之日起三个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。<u>除上述第(4)、(5)、(6)项外</u>，因证券期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在十个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。</p>
<b>十七、基金财产的估值</b>	
<p>(六) 暂停估值的情形</p> <p>无</p>	<p>(六) 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的，基金管理人应当暂停基金估值；</u></p>
<b>二十一、基金的信息披露</b>	
<p>(五) 定期报告</p> <p>.....</p>	<p>(五) 定期报告</p> <p>.....</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有风险。</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>(六) 临时报告与公告</p> <p>无</p>	<p>(六) 临时报告与公告</p> <p><u>27、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</u></p>

	<u>大事项;</u>
--	-------------

注：基金合同内容摘要涉及上述内容的一并修改。

## 《华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》 条款修改对照表

修改前	修改后
<b>一、托管协议当事人</b>	
（一）基金管理人（或简称“管理人”） 住所： <u>上海市浦东新区</u> 民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层（200135） 法定代表人： <u>齐亮</u> （二）基金托管人（或简称“托管人”） 法定代表人： <u>肖钢</u> 注册资本：人民币 <u>贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰仟零玖元</u>	（一）基金管理人（或简称“管理人”） 住所： <u>中国（上海）自由贸易试验区</u> 民生路 1199 弄 <u>上海</u> 证大五道口广场 1 号楼 17 层（200135） 法定代表人： <u>贾波</u> （二）基金托管人（或简称“托管人”） 法定代表人： <u>陈四清</u> 注册资本：人民币 <u>贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整</u>
<b>二、托管协议的依据、目的、原则和解释</b>	
（一）依据 本协议依据《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》”）、《证券投资基金运作管	（一）依据 本协议依据《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》”）、《证券投资基金运作管

<p>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》”）及其他有关法律法规与《华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）订立。</p>	<p>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》</u>及其他有关法律法规与《华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）订立。</p>
<p><b>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</b></p>	
<p>（一）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面：</p> <p>2、对基金投融资比例进行监督；</p>	<p>（一）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面：</p> <p>2、对基金投融资比例进行监督；  <u>其中，基金托管人根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》对投资组合的比例做如下监督：</u></p> <p><u>1) 现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</u></p> <p><u>2) 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，本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>3) 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；本基金管理人承诺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，并承担由于不一致所导致的风险和损失；</u></p>



## 《华泰柏瑞生物医药灵活配置混合型证券投资基金基金合同》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>第一部分 前言</b>	
<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》”)……《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》”)……《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。</p>
<b>第二部分 释义</b>	
无	<p><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></p> <p><u>50、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>
<b>第六部分 基金份额的申购与赎回</b>	
<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>无</p>	<p>五十三、申购和赎回的数量限制</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</u></p>

	<u>保护存量基金份额持有人的合法权益,具体规定请参见招募说明书或相关公告。</u>
五十四、申购和赎回的价格、费用及其用途 3、赎回金额的计算及处理方式:本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定,并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用……	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 3、赎回金额的计算及处理方式:本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定,并在招募说明书中列示, <u>其中对持续持有期少于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。</u> 赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用……
七、拒绝或暂停申购的情形 …… 发生上述第1、2、3、 <del>5</del> 、6、7、8项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时……	七、拒绝或暂停申购的情形 …… <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,基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。</u> 发生上述第1、2、3、6、7、8、 <u>9</u> 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时……
八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… 发生上述1、2、3、5、6项情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时……	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> 发生上述1、2、3、5、6、 <u>7</u> 项情形之一且基金管理人决定暂停赎

	回或延缓支付赎回款项时……
九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 无	九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 <u>(3) 若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 20%，基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出 20%的赎回申请实施延期办理。而对该单个基金份额持有人 20%以内（含 20%）的赎回申请，基金管理人根据前述“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。如下一开放日，该单一基金份额持有人剩余未赎回部分仍旧超出前述比例约定的，继续按前述规则处理，直至该单一基金份额持有人单个开放日内申请赎回的基金份额占上一开放日基金总份额的比例低于前述比例。</u>
<b>第七部分 基金合同当事人及权利义务</b>	
二、基金托管人 (一) 基金托管人简况 法定代表人： <u>田国立</u> 注册资本：人民币 <u>贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍</u> 元整	二、基金托管人 (一) 基金托管人简况 法定代表人： <u>陈四清</u> 注册资本：人民币 <u>贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹</u> 元整
<b>第十二部分 基金的投资</b>	
二、投资范围 …… 本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；投资于生物医药行业相关上市公司发行股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值	二、投资范围 …… 本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；投资于生物医药行业相关上市公司发行股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；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，现金 <u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u> 和到期日在一

的 5%。	年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。
<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p>	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(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，现金（<u>不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>）和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p> <p><u>(13) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；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，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；</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 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，本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基金合同约定的投资范围保持一致；</u></p>
<p>因证券、期货市场波动、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>除上述第（2）、（14）、（15）项外</u>，因证券、期货市场波动、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>
<b>第十四部分 基金资产估值</b>	
<p>六、暂停估值的情形</p> <p>无</p>	<p>六、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</u></p>

	<u>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，基金管理人应当暂停基金估值；</u>
<b>第十八部分 基金的信息披露</b>	
<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><del>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情形，基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告文件中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。</del></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>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有风险。</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>(七) 临时报告</p> <p>无</p>	<p>(七) 临时报告</p> <p><u>27、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></p>

注：基金合同内容摘要涉及上述内容的一并修改。

## 《华泰柏瑞生物医药灵活配置混合型证券投资基金托管协议》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>一、托管协议当事人</b>	
<p>(二) 基金托管人（或简称“托管人”）                      法定代表人：<del>田国立</del>                      注册资本：人民币<del>贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍</del>元整</p>	<p>(二) 基金托管人（或简称“托管人”）                      法定代表人：<u>陈四清</u>                      注册资本：人民币<del>贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹</del>元整</p>
<b>二、托管协议的依据、目的、原则和解释</b>	
<p>(一) 依据                      本协议依据《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》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）及其他有关法律法规与《华泰柏瑞生物医药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》”）订立。</p>	<p>(一) 依据                      本协议依据《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>及其他有关法律法规与《华泰柏瑞生物医药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》”）订立。</p>
<b>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</b>	
<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面：                      1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。……                      本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；投资于生物医药行业相关上市公司发行股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；                      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，现金</p>	<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面：                      1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。……                      本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；投资于生物医药行业相关上市公司发行股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；                      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，现金</p>

<p>和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p><u>(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)</u>和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>
<p>2、对基金投资比例进行监督：</p> <p>(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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p> <p>因证券、期货市场波动、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>2、对基金投资比例进行监督：</p> <p>(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，现金<u>(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)</u>和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p> <p><u>(10) 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持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；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，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；</u></p> <p><u>(11) 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，本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>(12) 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；本基金管理人承诺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，并承担由于不一致所导致的风险和损失；</u></p> <p><u>除上述第 (2)、(11)、(12) 项外，</u>因证券、期货市场波动、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</p>

	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。
--	---

## 《华泰柏瑞盛利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>第一部分 前言</b>	
<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》”）……《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》”）……《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>
<b>第二部分 释义</b>	
无	<p><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></p> <p><u>52、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>
<b>第六部分 基金份额的申购与赎回</b>	



<p>五、申购和赎回的数量限制 无</p>	<p>五十五、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，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</u></p>
<p>五十六、申购和赎回的价格、费用及其用途 3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额的基金份额净值并扣除相应的费用……</p>	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途 3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示，<u>其中对持续持有期少于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。</u>赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额的基金份额净值并扣除相应的费用……</p>
<p>七、拒绝或暂停申购的情形 …… 发生上述第1、2、3、<del>5</del>、6、7项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时……</p>	<p>七、拒绝或暂停申购的情形 …… <u>5、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> <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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。</u> 发生上述第1、2、3、6、7、<u>8、9</u>项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时……</p>
<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 ……</p>	<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 ……</p>

<p>发生上述 1、2、3、5、6、7 项情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时……</p>	<p><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>发生上述 1、2、3、5、6、7、<u>8</u> 项情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时……</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 无</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 <u>(3) 若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 20%，基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出 20%的赎回申请实施延期办理。而对该单个基金份额持有人 20%以内（含 20%）的赎回申请，基金管理人根据前述“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。如下一开放日，该单一基金份额持有人剩余未赎回部分仍旧超出前述比例约定的，继续按前述规则处理，直至该单一基金份额持有人单个开放日内申请赎回的基金份额占上一开放日基金总份额的比例低于前述比例。</u></p>
<p><b>第七部分 基金合同当事人及权利义务</b></p>	
<p>二、基金托管人 (一) 基金托管人简况 法定代表人：<u>田国立</u> 注册资本：人民币<u>贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟捌佰肆拾捌万壹仟玖佰叁拾捌</u>元整</p>	<p>二、基金托管人 (一) 基金托管人简况 法定代表人：<u>陈四清</u> 注册资本：人民币<u>贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹</u>元整</p>
<p><b>第十二部分 基金的投资</b></p>	

<p>二、投资范围</p> <p>.....</p> <p>本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>二、投资范围</p> <p>.....</p> <p>本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；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，现金<u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>
<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p>	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(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，现金<u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p> <p><u>(21)本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；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，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；</u></p> <p><u>(22)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，本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>(23)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>因证券、期货市场波动、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</p>	<p><u>除上述第（2）、（12）、（22）、（23）项外</u>，因证券、期货市场波动、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</p>

殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。	10 个工作日内进行调整，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。
<b>第十四部分 基金资产估值</b>	
六、暂停估值的情形 无	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一致的，基金管理人应当暂停基金估值；</u>
<b>第十八部分 基金的信息披露</b>	
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 ..... <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> <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>
(七) 临时报告 无	(七) 临时报告 <u>28、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>

注：基金合同内容摘要涉及上述内容的一并修改。

## 《华泰柏瑞盛利灵活配置混合型证券投资基金托管协议》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>一、托管协议当事人</b>	
<p>(二) 基金托管人（或简称“托管人”）                      法定代表人：<b>田国立</b>                      注册资本：人民币<b>贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟捌佰肆拾捌万壹仟玖佰叁拾捌</b>元整</p>	<p>(二) 基金托管人（或简称“托管人”）                      法定代表人：<b>陈四清</b>                      注册资本：人民币<b>贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹</b>元整</p>
<b>二、托管协议的依据、目的、原则和解释</b>	
<p>(一) 依据                      本协议依据《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》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）及其他有关法律法规与《华泰柏瑞盛利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》”）订立。</p>	<p>(一) 依据                      本协议依据《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>及其他有关法律法规与《华泰柏瑞盛利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》”）订立。</p>
<b>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</b>	
<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面：                      1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。……                      本基金股票资产的投资比例占基金资产的0-95%；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，现金和到期日在一年</p>	<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面：                      1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。……                      本基金股票资产的投资比例占基金资产的0-95%；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，现金<u>（不包括结算备</u></p>

<p>以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p><u>付金、存出保证金、应收申购款等</u>)和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>
<p>2、对基金投资比例进行监督：  (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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p> <p>因证券、期货市场波动、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>2、对基金投资比例进行监督：  (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，现金<u>(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)</u>和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p> <p><u>(21)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持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；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，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；</u></p> <p><u>(22)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，本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>(23)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；本基金管理人承诺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，并承担由于不一致所导致的风险和损失；</u></p> <p><u>除上述第 (2)、(12)、(22)、(23) 项外</u>，因证券、期货市场波动、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</p>

	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。
--	--

## 《华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金基金合同》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>一、前言</b>	
<p>(一) 订立华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金基金合同（以下简称“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</p> <p>订立本基金合同的依据是《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》和其他有关法律法规及规定。</p>	<p>(一) 订立华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金基金合同（以下简称“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</p> <p>订立本基金合同的依据是《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、<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>《流动性风险规定》</u>”）和其他有关法律法规及规定。</p>
<b>二、释义</b>	
无	<p><u>《流动性风险规定》</u>：指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《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；</p> <p><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）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产</p>

	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；
<b>六、基金份额的申购、赎回与转换</b>	
<p>(五) 申购与赎回的数额限制</p> <p>无</p>	<p>(五) 申购与赎回的数额限制</p> <p><u>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，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</u></p>
<p>(七) 申购和赎回的费用及其用途</p> <p>1、本基金申购费率最高不超过申购金额的 1.5%，<del>赎回费率最高不超过赎回金额的 0.5%。</del></p> <p>3、本基金的赎回费率按照持有时间递减，即相关基金份额持有时间越长，所适用的赎回费率越低，赎回费用等于赎回金额乘以所适用的赎回费率。实际执行的赎回费率在招募说明书中载明。</p>	<p>(七) 申购和赎回的费用及其用途</p> <p>1、本基金申购费率最高不超过申购金额的 1.5%。</p> <p>3、本基金的赎回费率按照持有时间递减，即相关基金份额持有时间越长，所适用的赎回费率越低，赎回费用等于赎回金额乘以所适用的赎回费率。实际执行的赎回费率在招募说明书中载明，<u>其中对持续持有期少于 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。</u></p>
<p>(九) 巨额赎回的认定及处理方式</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>无</p>	<p>(九) 巨额赎回的认定及处理方式</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p><u>3) 若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 20%，基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出 20% 的赎回申请实施延期办理。而对该单个基金份额持有人 20% 以内 (含 20%) 的赎回申请，基金管理人根据前述“1) 接受全额赎回”或“2) 部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。如下一开放日，该单一基金份额持有人剩余未赎回部分仍旧超出前述比例约定的，继续按前述规则处理，直至该单一基金份额持有人单个开放日内申请赎回的基金份额</u></p>



	<u>占上一开放日基金总份额的比例低于前述比例。</u>
<p>(十) 拒绝或暂停申购、暂停赎回及延缓支付赎回款项的情形及处理</p> <p>1、在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资人的申购申请： .....</p>	<p>(十) 拒绝或暂停申购、暂停赎回及延缓支付赎回款项的情形及处理</p> <p>1、在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请： .....</p> <p><u>5) 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><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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施；</u></p>
<p>2、在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项： .....</p>	<p>2、在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项： .....</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>
<b>七、基金合同当事人及其权利义务</b>	
<p>(一) 基金管理人</p> <p>1、基金管理人基本情况</p> <p>住所：<del>上海浦东新区</del>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 <del>(200135)</del></p> <p>法定代表人：<b>齐亮</b></p>	<p>(一) 基金管理人</p> <p>1、基金管理人基本情况</p> <p>住所：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层</p> <p>法定代表人：<u>贾波</u></p>

<p>注册资本：<b>壹</b>亿元人民币  (二) 基金托管人  1、基金托管人基本情况  法定代表人：<b>田国立</b>  注册资本：人民币<b>贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟捌佰肆拾捌万壹仟玖佰叁拾捌</b>元整</p>	<p>注册资本：<b>贰</b>亿元人民币  (二) 基金托管人  1、基金托管人基本情况  法定代表人：<b>陈四清</b>  注册资本：人民币<b>贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹</b>元整</p>
<p><b>十三、基金的投资</b></p>	
<p>(二) 投资范围  .....  此外，本基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的资产比例合计不低于基金净资产 5%，如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的该部分投资范围将相应调整。</p>	<p>(二) 投资范围  .....  此外，本基金保留的现金（<u>不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>）或者投资于到期日在一年以内的政府债券的资产比例合计不低于基金净资产 5%，如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的该部分投资范围将相应调整。</p>
<p>(七) 投资禁止行为与限制  2、基金投资限制  .....</p>	<p>(七) 投资禁止行为与限制  2、基金投资限制  .....  <u>5) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；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，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；</u>  <u>6) 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，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u>  <u>7) 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</u></p>

	<u>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>(八) 投资组合比例调整</p> <p>基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的,基金管理人应当在十个交易日内进行调整。</p>	<p>(八) 投资组合比例调整</p> <p>基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。<u>除上述第 6)、7) 项外,</u>因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的,基金管理人应当在十个交易日内进行调整。</p>
<b>十六、基金财产估值</b>	
<p>(六) 暂停估值的情形</p> <p>无</p>	<p>(六) 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的,基金管理人应当暂停基金估值;</u></p>
<b>二十、基金的信息披露</b>	
<p>(三) 定期报告</p> <p>.....</p>	<p>(三) 定期报告</p> <p>.....</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有风险。</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>(四) 临时报告与公告</p> <p>无</p>	<p>(四) 临时报告与公告</p> <p><u>27、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</u></p>

大事项；

## 《华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金托管协议》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>一、托管协议当事人</b>	
(一) 基金管理人（或简称“管理人”） 住所： <del>上海浦东新区</del> 民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 <del>（200135）</del> 法定代表人： <del>齐亮</del> 注册资本： <del>壹</del> 亿元人民币	(一) 基金管理人（或简称“管理人”） 住所： <u>中国（上海）自由贸易试验区</u> 民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 法定代表人： <u>贾波</u> 注册资本： <u>贰</u> 亿元人民币
(二) 基金托管人（或简称“托管人”） 法定代表人： <del>田国立</del> 注册资本：人民币 <del>壹仟捌佰陆拾叁亿零叁拾伍万贰仟肆佰玖拾柒元捌角</del>	(二) 基金托管人（或简称“托管人”） 法定代表人： <u>陈四清</u> 注册资本：人民币 <u>贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整</u>
<b>二、托管协议的依据、目的、原则和解释</b>	
(一) 依据 本协议依据《中华人民共和国民法通则》《中华人民共和国证券投资基金法》、（以下称“《基金法》）”《中华人民共和国信托法》《中华人民共和国合同法》《证券投资基金运作管理办法》（以下	(一) 依据 本协议依据《中华人民共和国民法通则》《中华人民共和国证券投资基金法》、（以下称“《基金法》）”《中华人民共和国信托法》《中华人民共和国合同法》《证券投资基金运作管理办法》（以下

<p>称“《运作管理办法》)及其他有关法律、法规与《华泰柏瑞盛世中国混合型”证券投资基金基金合同》制订(以下称“《基金合同》)”。</p>	<p>称“《运作管理办法》)、<u>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</u>及其他有关法律、法规与《华泰柏瑞盛世中国混合型”证券投资基金基金合同》制订(以下称“《基金合同》)”。</p>
<p><b>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</b></p>	
<p>无</p>	<p><b>5. 基金托管人根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》对投资组合的比例做如下监督:</b></p> <p><u>1) 现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;</u></p> <p><u>2) 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持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 15%;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,不得超过该上市公司可流通股票的 30%;</u></p> <p><u>3) 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,本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>4) 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;本基金管理人承诺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,并承担由于不一致所导致的风险和损失;</u></p>

## 《华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>第一部分 前言</b>	
<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》”)……《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》”)……《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。</p>
<b>第二部分 释义</b>	
无	<p><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></p> <p><u>52、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>
<b>第六部分 基金份额的申购与赎回</b>	
<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>无</p>	<p>五十七、申购和赎回的数量限制</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</u></p>

	<u>保护存量基金份额持有人的合法权益,具体规定请参见招募说明书或相关公告。</u>
五十八、申购和赎回的价格、费用及其用途 3、赎回金额的计算及处理方式:本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定,并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额的基金份额净值并扣除相应的费用……	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 3、赎回金额的计算及处理方式:本基金赎回金额的计算详见招募说明书,本基金的赎回费率由基金管理人决定,并在招募说明书中列示, <u>其中对持续持有期少于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。</u> 赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额的基金份额净值并扣除相应的费用……
七、拒绝或暂停申购的情形 …… 发生上述第1、2、3、 <del>5</del> 、6、7项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时……	七、拒绝或暂停申购的情形 …… <u>5、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> <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,基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。</u> 发生上述第1、2、3、6、7、 <u>8、9</u> 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时……
八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… 发生上述1、2、3、5、6、7项情形之一基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时……	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>

	发生上述 1、2、3、5、6、7、8 项情形之一基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时……
九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 无	九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 <u>(3) 若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 20%，基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出 20% 的赎回申请实施延期办理。而对该单个基金份额持有人 20% 以内（含 20%）的赎回申请，基金管理人根据前述“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。如下一开放日，该单一基金份额持有人剩余未赎回部分仍旧超出前述比例约定的，继续按前述规则处理，直至该单一基金份额持有人单个开放日内申请赎回的基金份额占上一开放日基金总份额的比例低于前述比例。</u>
<b>第七部分 基金合同当事人及权利义务</b>	
一、基金管理人 (一) 基金管理人简况 住所： <del>上海浦东新区</del> 民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层- <del>(200135)</del>	一、基金管理人 (一) 基金管理人简况 住所： <u>中国（上海）自由贸易试验区</u> 民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层
<b>第十二部分 基金的投资</b>	
二、投资范围 …… 基金的投资组合比例为：股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值	二、投资范围 …… 基金的投资组合比例为：股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；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，现金 <u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u> 和到期日在一年



的 5%。	年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。
<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p>	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(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，现金（<u>不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>）和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p> <p><u>(19) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；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，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；</u></p> <p><u>(20) 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，本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>(21) 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>因证券、期货市场波动、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>除上述第（2）、（12）、（20）、（21）项外</u>，因证券、期货市场波动、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>
<b>第十四部分 基金资产估值</b>	
<p>六、暂停估值的情形</p> <p>无</p>	<p>六、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</u></p>

	<u>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，基金管理人应当暂停基金估值；</u>
<b>第十八部分 基金的信息披露</b>	
<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>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>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></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>(七) 临时报告</p> <p>无</p>	<p>(七) 临时报告</p> <p><u>28、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></p>

注：基金合同内容摘要涉及上述内容的一并修改。

## 《华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金托管协议》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>一、基金托管协议当事人</b>	
<p>(一) 基金管理人            注册地址：<u>上海浦东新区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层            办公地址：<u>上海浦东新区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层</p>	<p>(一) 基金管理人            注册地址：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层            办公地址：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层</p>
<b>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</b>	
<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。……            本基金的投资组合比例为股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。……            本基金的投资组合比例为股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；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，现金（<u>不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>）和到期日在一年以内的政府债券的投资比例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：            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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；             因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管</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：            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，现金（<u>不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>）和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；  <u>19、本基金管理人管理的、且由本基金托管人托管的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流</u></p>

<p>理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定的投资比例的，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>通股票的 15%；本基金管理人管理的、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，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；</u></p> <p><u>20、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，本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>21、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><u>除上述第 2、12、20、21 项外，</u>因证券、期货市场波动、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的投资比例的，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>八、基金资产净值计算和会计核算</b></p>	
<p>(四) 暂停估值与公告基金份额净值的情形 无</p>	<p>(四) 暂停估值与公告基金份额净值的情形 <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的，基金管理人应当暂停基金估值；</u></p>

## 《华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金基金合同》条款修改对照表

修改前	修改后
<p><b>第一部分 前言</b></p> <p>(一) 订立《华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“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</p> <p>订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》……《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《证券投资基金销售管理办法》(以下简称《销售办法》)及其他法律法规的有关规定。</p>	<p>(一) 订立《华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“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</p> <p>订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》……《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>《证券投资基金销售管理办法》(以下简称《销售办法》)和《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>及其他法律法规的有关规定。</p>
<p><b>第二部分 释义</b></p> <p>无</p>	<p><u>《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></p> <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)、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><b>第六部分 基金份额的申购、赎回与转换</b></p> <p>(五) 申购与赎回的数额限制</p> <p>无</p>	<p>(五) 申购与赎回的数额限制</p> <p><u>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</u></p>

	<u>保护存量基金份额持有人的合法权益,具体规定请参见招募说明书或相关公告。</u>
<p>(七) 申购和赎回的费用及其用途</p> <p>2、本基金的赎回费率按照持有时间递减,即同类基金份额持有时间越长,所适用的赎回费率越低,赎回费用等于赎回金额乘以所适用的赎回费率(见前述计算公式)。实际执行的赎回费率在招募说明书中载明。</p>	<p>(七) 申购和赎回的费用及其用途</p> <p>2、本基金的赎回费率按照持有时间递减,即同类基金份额持有时间越长,所适用的赎回费率越低,赎回费用等于赎回金额乘以所适用的赎回费率(见前述计算公式)。实际执行的赎回费率在招募说明书中载明,<u>其中对持续持有期少于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。</u></p>
<p>(九) 巨额赎回的认定及处理方式</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>无</p>	<p>(九) 巨额赎回的认定及处理方式</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p><u>(3) 若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的20%,基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出20%的赎回申请实施延期办理。而对该单个基金份额持有人20%以内(含20%)的赎回申请,基金管理人根据前述“ (1) 接受全额赎回”或“ (2) 部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。如下一开放日,该单一基金份额持有人剩余未赎回部分仍旧超出前述比例约定的,继续按前述规则处理,直至该单一基金份额持有人单个开放日内申请赎回的基金份额占上一开放日基金总份额的比例低于前述比例。</u></p>
<p>(十) 拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理</p> <p>1、在如下情况下,基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请:</p> <p>.....</p> <p>发生上述第1、2、3、<del>5</del>-6项暂停申购情形.....</p>	<p>(十) 拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理</p> <p>1、在如下情况下,基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请:</p> <p>.....</p> <p><u>(5) 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><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, 基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。</u></p> <p>发生上述第<u>(1)</u>、<u>(2)</u>、<u>(3)</u>、<u>(6)</u>、<u>(7)</u>、<u>(8)</u>、<u>(9)</u>项暂停申购情形……</p>
<p>2、在以下情况下, 基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请: ……</p>	<p>2、在以下情况下, 基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请: ……</p> <p><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><b>第七部分 基金合同当事人及其权利义务</b></p>	
<p>(一) 基金管理人</p> <p>1、基金管理人基本情况</p> <p>住所: <u>上海浦东新区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层</p> <p>法定代表人: <u>齐亮</u></p> <p>(二) 基金托管人</p> <p>1、基金托管人基本情况</p> <p>法定代表人: <u>田国立</u></p> <p>注册资本: 人民币<u>贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍</u>元整</p>	<p>(一) 基金管理人</p> <p>1、基金管理人基本情况</p> <p>住所: <u>中国(上海)自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层</p> <p>法定代表人: <u>贾波</u></p> <p>(二) 基金托管人</p> <p>1、基金托管人基本情况</p> <p>法定代表人: <u>陈四清</u></p> <p>注册资本: 人民币<u>贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹</u>元整</p>
<p><b>第十二部分 基金的投资</b></p>	

<p>(二) 投资范围</p> <p>.....</p> <p>本基金投资组合资产配置比例：债券等固定收益类资产占基金资产的比例不低于 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，本基金持有的现金及到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%。</p>	<p>(二) 投资范围</p> <p>.....</p> <p>本基金投资组合资产配置比例：债券等固定收益类资产占基金资产的比例不低于 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，本基金持有的现金<u>(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)</u>及到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%。</p>
<p>(九) 投资禁止行为与限制</p> <p>2、基金投资组合比例限制</p> <p>(6) 本基金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，应当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>(九) 投资禁止行为与限制</p> <p>2、基金投资组合比例限制</p> <p>(6) 本基金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，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金<u>(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)</u>或者到期日在一年以内的政府债券；</p> <p><u>(11) 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、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，本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>(12) 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>因证券、期货市场波动、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。法律、法规另有规定时，从其规定。</p>	<p><u>除上述第 (5)、(6)、(11)、(12) 项外</u>，因证券、期货市场波动、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。法律、法规另有规定时，从其规定。</p>
<p><b>第十四部分 基金资产的估值</b></p>	



<p>(六) 暂停估值的情形 无</p>	<p>(六) 暂停估值的情形 <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的，基金管理人应当暂停基金估值；</u></p>
<p><b>第十八部分 基金的信息披露</b></p>	
<p>(五) 定期报告 .....</p>	<p>(五) 定期报告 ..... <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> <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>(六) 临时报告与公告 无</p>	<p>(六) 临时报告与公告 <u>28、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></p>

注：基金合同内容摘要涉及上述内容的一并修改。

## 《华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金托管协议》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>一、托管协议当事人</b>	
<p>(一) 基金管理人（或简称“管理人”） 住所：<u>上海浦东新区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 法定代表人：<u>齐亮</u></p> <p>(二) 基金托管人（或简称“托管人”） 法定代表人：<u>田国立</u> 注册资本：人民币<u>贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍</u>元整</p>	<p>(一) 基金管理人（或简称“管理人”） 住所：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 法定代表人：<u>贾波</u></p> <p>(二) 基金托管人（或简称“托管人”） 法定代表人：<u>陈四清</u> 注册资本：人民币<u>贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹</u>元整</p>
<b>二、托管协议的依据、目的、原则和解释</b>	
<p>(一) 依据 本协议依据《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》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）及其他有关法律法规与《华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）订立。</p>	<p>(一) 依据 本协议依据《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>及其他有关法律法规与《华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）订立。</p>
<b>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</b>	
<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包</p>	<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包</p>

括以下方面：

2、对基金投融资比例进行监督：

（5）本基金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，应当保持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；

因证券、期货市场波动、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。法律、法规另有规定时，从其规定。

括以下方面：

2、对基金投融资比例进行监督：

（5）本基金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，应当保持保持不低于基金资产净值 5%的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券；

（10）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、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，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

（11）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；本基金管理人承诺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，并承担由于不一致所导致的风险和损失；

除上述第（4）、（5）、（10）、（11）项外，因证券、期货市场波动、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。法律、法规另有规定时，从其规定。

## 《华泰柏瑞享利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>第一部分 前言</b>	
<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》”)……《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》”)……《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。</p>
<b>第二部分 释义</b>	
无	<p><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></p> <p><u>52、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>
<b>第六部分 基金份额的申购与赎回</b>	
<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>无</p>	<p>五十九、申购和赎回的数量限制</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</u></p>

	<u>保护存量基金份额持有人的合法权益,具体规定请参见招募说明书或相关公告。</u>
六十、申购和赎回的价格、费用及其用途 3、赎回金额的计算及处理方式:本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定,并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额的基金份额净值并扣除相应的费用……	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 3、赎回金额的计算及处理方式:本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定,并在招募说明书中列示, <u>其中对持续持有期少于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。</u> 赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额的基金份额净值并扣除相应的费用……
七、拒绝或暂停申购的情形 …… 6、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术保障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。  发生上述第1、2、3、 <del>5</del> 、6、7项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时……	七、拒绝或暂停申购的情形 …… <u>5、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> <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,基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。</u> 8、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。  发生上述第1、2、3、6、7、 <u>8、9</u> 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时……
八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 ……	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</u>

<p>发生上述 1、2、3、5、6、7 项情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时……</p>	<p><u>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>发生上述 1、2、3、5、6、7、8 项情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时……</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 无</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 <u>(3) 若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 20%，基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出 20% 的赎回申请实施延期办理。而对该单个基金份额持有人 20% 以内（含 20%）的赎回申请，基金管理人根据前述“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。如下一开放日，该单一基金份额持有人剩余未赎回部分仍旧超出前述比例约定的，继续按前述规则处理，直至该单一基金份额持有人单个开放日内申请赎回的基金份额占上一开放日基金总份额的比例低于前述比例。</u></p>
<p><b>第七部分 基金合同当事人及权利义务</b></p>	
<p>一、基金管理人 (一) 基金管理人简况 住所：<del>上海浦东新区</del>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层<del>-(200135)-</del> 法定代表人：<b>齐亮</b> 二、基金托管人 (一) 基金托管人简况</p>	<p>一、基金管理人 (一) 基金管理人简况 住所：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 法定代表人：<u>贾波</u> 二、基金托管人 (一) 基金托管人简况</p>

<p>法定代表人：<u>孙建一</u>          注册资本：人民币<u>伍拾壹亿贰仟叁百叁拾伍万零肆佰壹拾陆元整</u></p>	<p>法定代表人：<u>谢永林</u>          注册资本：人民币<u>11,424,894,787元</u></p>
<p><b>第十二部分 基金的投资</b></p>	
<p>二、投资范围          ……          本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>二、投资范围          ……          本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；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，现金<u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>
<p>四、投资限制          1、组合限制          （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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p>	<p>四、投资限制          1、组合限制          （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，现金<u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；  <u>（21）本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；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，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；</u>  <u>（22）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，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u>  <u>（23）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>因证券、期货市场波动、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>除上述第（2）、（12）、（22）、（23）项外</u>，因证券、期货市场波动、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>第十四部分 基金资产估值</b></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一致的，基金管理人应当暂停基金估值；</u></p>
<p><b>第十八部分 基金的信息披露</b></p>	
<p>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 .....</p>	<p>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 ..... <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> <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>（七）临时报告 无</p>	<p>（七）临时报告 <u>28、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></p>



注：基金合同内容摘要涉及上述内容的一并修改。

## 《华泰柏瑞享利灵活配置混合型证券投资基金托管协议》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>一、基金托管协议当事人</b>	
<p>(一) 基金管理人 住所：<del>上海浦东新区</del>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号楼 17 层 办公地址：<del>上海浦东新区</del>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号楼 17 层 法定代表人：<b>齐亮</b></p> <p>(二) 基金托管人 法定代表人：<b>孙建一</b> 注册资本：人民币<b>伍拾壹亿贰仟叁百叁拾伍万零肆佰壹拾陆元整</b></p>	<p>(一) 基金管理人 住所：<b>中国（上海）自由贸易试验区</b>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号楼 17 层 办公地址：<b>中国（上海）自由贸易试验区</b>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号楼 17 层 法定代表人：<b>贾波</b></p> <p>(二) 基金托管人 法定代表人：<b>谢永林</b> 注册资本：人民币 <b>11,424,894,787 元</b></p>
<b>二、基金托管协议的依据、目的、原则和解释</b>	
<p>(一) 订立托管协议的依据 本协议依据《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》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《华泰</p>	<p>(一) 订立托管协议的依据 本协议依据《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》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、<b>《公</b></p>

<p>柏瑞亨利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》”)及其他有关规定制订。</p>	<p><u>《<b>开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定</b>》</u>、《华泰柏瑞亨利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》”)及其他有关规定制订。</p>
<p><b>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</b></p>	
<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金投资范围、投资对象进行监督。 ..... 本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0% - 95%; 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, 现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金投资范围、投资对象进行监督。 ..... 本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0% - 95%; 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, 现金<u>(不包括<b>结算备付金、存出保证金、应收申购款等</b>)</u>和到期日在一年以内的政府债券的投资比例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: 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, 现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%;  因证券、期货市场波动、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>(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: 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, 现金<u>(不包括<b>结算备付金、存出保证金、应收申购款等</b>)</u>和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%; <u>(21) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票, 不得超过该上市公司可流通股票的 15%; 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, 不得超过该上市公司可流通股票的 30%;</u> <u>(22) 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, 本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>(23)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><u>除上述第(2)、(12)、(22)、(23)项外,因证券、期货市场波动、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。</u></p>
--	--

## 《华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>第一部分 前言</b>	
<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》”)……《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》”)……《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。</p>
<b>第二部分 释义</b>	
无	<p><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</u></p>

	<p><u>管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订</u></p> <p><u>50、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>
<b>第六部分 基金份额的申购与赎回</b>	
<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>无</p>	<p>六十一、申购和赎回的数量限制</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，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</u></p>
<p>六十二、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书，赎回金额单位为元。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用……</p>	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书，赎回金额单位为元。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示，<u>其中对持续持有期少于 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</u>。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用……</p>
<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>……</p> <p>6、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术保障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。</p>	<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>……</p> <p><u>5、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><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，</u></p>

<p>发生上述第 1、2、3、<del>5</del>、6、7 项暂停申购情形且基金管理人决定暂停申购时……</p>	<p><u>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>8、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。</p> <p>发生上述第 1、2、3、6、7、8、9 项暂停申购情形且基金管理人决定暂停申购时……</p>
<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 ……</p>	<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 ……</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>九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 无</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</p> <p><u>(3) 若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 20%,基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出 20%的赎回申请实施延期办理。而对该单个基金份额持有人 20%以内(含 20%)的赎回申请,基金管理人根据前述“(1) 全额赎回”或“(2) 部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。如下一开放日,该单一基金份额持有人剩余未赎回部分仍旧超出前述比例约定的,继续按前述规则处理,直至该单一基金份额持有人单个开放日内申请赎回的基金份额占上一开放日基金总份额的比例低于前述比例。</u></p>

<b>第七部分 基金合同当事人及权利义务</b>	
<p>一、基金管理人</p> <p>(一) 基金管理人简况</p> <p>住所：<del>上海浦东新区</del>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层<del>(200135)</del></p> <p>法定代表人：<b>齐亮</b></p> <p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况</p> <p>法定代表人：<b>王洪章</b></p>	<p>一、基金管理人</p> <p>(一) 基金管理人简况</p> <p>住所：<b>中国（上海）自由贸易试验区</b>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层</p> <p>法定代表人：<b>贾波</b></p> <p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况</p> <p>法定代表人：<b>田国立</b></p>
<b>第十二部分 基金的投资</b>	
<p>二、投资范围</p> <p>.....</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金持有的股票占基金资产的比例为 0%-95%，投资于消费相关行业的证券资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后，本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在 1 年以内的政府债券。</p>	<p>二、投资范围</p> <p>.....</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金持有的股票占基金资产的比例为 0%-95%，投资于消费相关行业的证券资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后，本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金<b>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</b>或者到期日在 1 年以内的政府债券。</p>
<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(2) 每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后，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；</p>	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(2) 每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后，本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金<b>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</b>或者到期日在一年以内的政府债券；</p> <p><b>(22) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；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</b></p>

	<p><u>得超过该上市公司可流通股票的 30%；</u></p> <p><u>(23)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，本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>(24)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>
因证券、期货市场波动、上市公司合并、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。法律法规或基金合同另有规定的，从其规定。	<u>除上述第（2）、（12）、（23）、（24）项外，</u> 因证券、期货市场波动、上市公司合并、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。法律法规或基金合同另有规定的，从其规定。
<b>第十四部分 基金资产估值</b>	
六、暂停估值的情形 无	<p>六、暂停估值的情形</p> <p><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一致的，基金管理人应当暂停基金估值；</u></p>
<b>第十八部分 基金的信息披露</b>	
<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>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>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</u></p>

	<p>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有风险。</p> <p>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。</p>
<p>(七) 临时报告</p> <p>无</p>	<p>(七) 临时报告</p> <p>27、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;</p>

注：基金合同内容摘要涉及上述内容的一并修改。

## 《华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金托管协议》条款修改对照表

修改前	修改后
<p><b>一、基金托管协议当事人</b></p>	
<p>(一) 基金管理人</p> <p>注册地址：<del>上海浦东新区</del>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层</p> <p>办公地址：<del>上海浦东新区</del>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层</p> <p>法定代表人：<b>齐亮</b></p>	<p>(一) 基金管理人</p> <p>注册地址：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层</p> <p>办公地址：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层</p> <p>法定代表人：<b>贾波</b></p>
<p>(二) 基金托管人</p>	<p>(二) 基金托管人</p>



法定代表人： <u>王洪章</u>	法定代表人： <u>田国立</u>
<b>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</b>	
<p>(一)基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定,对基金投资范围、投资对象进行监督。……</p> <p>基金的投资组合比例为:本基金持有的股票占基金资产的比例为0%-95%,投资于消费相关行业的证券资产不低于非现金基金资产的80%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后,本基金保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在1年以内的政府债券。</p>	<p>(一)基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定,对基金投资范围、投资对象进行监督。……</p> <p>基金的投资组合比例为:本基金持有的股票占基金资产的比例为0%-95%,投资于消费相关行业的证券资产不低于非现金基金资产的80%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后,本基金保持不低于基金资产净值5%的现金(<u>不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>)或者到期日在1年以内的政府债券。</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股指期货合约需缴纳的保证金后,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;</p> <p>(12) 本基金持有的所有流通受限证券,其公允价值不得超过本基金资产净值的<b>20%</b>;本基金持有的同一流通受限证券,其公允价值不得超过本基金资产净值的10%;</p> <p>因证券、期货市场波动、上市公司合并、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。法律法规另有规定的,从其规定。</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股指期货合约需缴纳的保证金后,本基金保持不低于基金资产净值5%的现金(<u>不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>)或者到期日在一年以内的政府债券;</p> <p>(12) 本基金持有的所有流通受限证券,其公允价值不得超过本基金资产净值的<b>15%</b>;本基金持有的同一流通受限证券,其公允价值不得超过本基金资产净值的10%;</p> <p><u>(19)本基金管理人管理的且由本托管人托管的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的15%;本基金管理人管理的且由本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,不得超过该上市公司可流通股票的30%;</u></p> <p><u>(20)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</u></p>

	<p><u>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，本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>(21)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>除上述第(2)、(9)、(20)、(21)项外，因证券、期货市场波动、上市公司合并、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。法律法规另有规定的，从其规定。</p>
<b>八、基金资产净值计算和会计核算</b>	
<p>(四) 暂停估值与公告基金份额净值的情形</p> <p>无</p>	<p>(四) 暂停估值与公告基金份额净值的情形</p> <p><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一致的，基金管理人应当暂停基金估值；</u></p>

## 《华泰柏瑞新经济沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金合同》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>第一部分 前言</b>	
<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</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</p>

<p>“《合同法》”)……《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>“《合同法》”)……《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>和其他有关法律法规。</p>
<p><b>第二部分 释义</b></p>	
<p>无</p>	<p><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>  <u>53、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>
<p><b>第六部分 基金份额的申购与赎回</b></p>	
<p>五、申购和赎回的数量限制 无</p>	<p>六十三、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，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</u></p>
<p>六十四、申购和赎回的价格、费用及其用途  3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用……</p>	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途  3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示，<u>其中对持续持有期少于 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。</u>赎回金额为按实际确认的有效赎回份额</p>

	乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用……
七、拒绝或暂停申购的情形 …… 发生上述第 1、2、3、 <del>5</del> 、6、7 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时……	七、拒绝或暂停申购的情形 …… <u>5、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> <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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。</u> 发生上述第 1、2、3、6、7、 <u>8、9</u> 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时……
八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… 发生上述 1、2、3、5、6 项情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时……	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> 发生上述 1、2、3、5、6、 <u>7</u> 项情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时……
九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 无	九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 <u>(3) 若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 20%，基金管理人可以先行对该单个基</u>

	<p>基金份额持有人超出 20%的赎回申请实施延期办理。而对该单个基金份额持有人 20%以内（含 20%）的赎回申请，基金管理人根据前述“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。如下一开放日，该单一基金份额持有人剩余未赎回部分仍旧超出前述比例约定的，继续按前述规则处理，直至该单一基金份额持有人单个开放日内申请赎回的基金份额占上一开放日基金总份额的比例低于前述比例。</p>
<p><b>第七部分 基金合同当事人及权利义务</b></p>	
<p>一、基金管理人 （一）基金管理人简况 住所：<del>上海浦东新区</del>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层-<del>(200135)</del> 法定代表人：<del>齐亮</del></p> <p>二、基金托管人 （一）基金托管人简况 法定代表人：<del>田国立</del> 注册资本：人民币<del>贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍</del>元整</p>	<p>一、基金管理人 （一）基金管理人简况 住所：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 法定代表人：<u>贾波</u></p> <p>二、基金托管人 （一）基金托管人简况 法定代表人：<u>陈四清</u> 注册资本：人民币<u>贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹</u>元整</p>
<p><b>第十二部分 基金的投资</b></p>	
<p>二、投资范围 ..... 本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%（投资于国内依法发行上市的股票及投资于港股通标的股票的总和占基金资产的 0-95%），其中投资于本基金界定的新经济主题相关证券比例不低于非现金基金资产的 80%；其中，基金持有全部权证的</p>	<p>二、投资范围 ..... 本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%（投资于国内依法发行上市的股票及投资于港股通标的股票的总和占基金资产的 0-95%），其中投资于本基金界定的新经济主题相关证券比例不低于非现金基金资产的 80%；其中，基金持有全部权证的</p>

<p>市值不得超过基金资产净值的 3%；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，现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>市值不得超过基金资产净值的 3%；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，现金（<u>不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>）或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>
<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p>	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(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，现金（<u>不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>）和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p> <p><u>(19) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；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，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；</u></p> <p><u>(20) 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，本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>(21) 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>因证券、期货市场波动、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>除上述第（2）、（12）、（20）、（21）项外</u>，因证券、期货市场波动、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>

<b>第十四部分 基金资产估值</b>	
六、暂停估值的情形 无	六、暂停估值的情形 <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的，基金管理人应当暂停基金估值；</u>
<b>第十八部分 基金的信息披露</b>	
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 ..... <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> <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>
(七) 临时报告 无	(七) 临时报告 <u>27、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>

注：基金合同内容摘要涉及上述内容的一并修改。

## 《华泰柏瑞新经济沪港深灵活配置混合型证券投资基金托管协议》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>一、托管协议当事人</b>	
<p>(一) 基金管理人（或简称“管理人”） 住所：<del>上海浦东新区</del>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号<del>楼</del>17 层 法定代表人：<b>齐亮</b></p> <p>(二) 基金托管人（或简称“托管人”） 法定代表人：<del>田国立</del> 注册资本：人民币<del>贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍</del>元整</p>	<p>(一) 基金管理人（或简称“管理人”） 住所：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 法定代表人：<b>贾波</b></p> <p>(二) 基金托管人（或简称“托管人”） 法定代表人：<b>陈四清</b> 注册资本：人民币<del>贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍</del><u>贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹</u>元整</p>
<b>二、托管协议的依据、目的、原则和解释</b>	
<p>(一) 依据 本协议依据《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》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）及其他有关法律法规与《华泰柏瑞新经济沪港深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》”）订立。</p>	<p>(一) 依据 本协议依据《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>及其他有关法律法规与《华泰柏瑞新经济沪港深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》”）订立。</p>
<b>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</b>	
<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包</p>	<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包</p>



<p>括以下方面：</p> <p>1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。……</p> <p>本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%(投资于国内依法发行上市的股票及投资于港股通标的股票的总和占基金资产的 0-95%)，其中投资于本基金界定的新经济主题相关证券比例不低于非现金基金资产的 80%；其中，基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；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，现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>括以下方面：</p> <p>1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。……</p> <p>本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%(投资于国内依法发行上市的股票及投资于港股通标的股票的总和占基金资产的 0-95%)，其中投资于本基金界定的新经济主题相关证券比例不低于非现金基金资产的 80%；其中，基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；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，现金<u>(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)</u>或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>
<p>2、对基金投融资比例进行监督：</p> <p>(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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p> <p>因证券、期货市场波动、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>2、对基金投融资比例进行监督：</p> <p>(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，现金<u>(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)</u>和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p> <p><u>(16)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持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；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，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；</u></p> <p><u>(17)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，本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>(18)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</u></p>

	<p><u>金合同约定的投资范围保持一致；本基金管理人承诺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，并承担由于不一致所导致的风险和损失；</u></p> <p><u>除上述第（2）、（9）、（17）、（18）项外，</u>因证券、期货市场波动、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>
--	--

## 《华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>第一部分 前言</b>	
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》”）……《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》”）……《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>《流动性风险规定》</u> ”）和其他有关法律法规。
<b>第二部分 释义</b>	
无	<b>13、《流动性风险规定》：</b> 指中国证监会2017年8月31日颁布、

	<p>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</p> <p><u>52、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>
<b>第六部分 基金份额的申购与赎回</b>	
<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>无</p>	<p>六十五、申购和赎回的数量限制</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，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</u></p>
<p>六十六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额的基金份额净值并扣除相应的费用……</p>	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示，<u>其中对持续持有期少于 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。</u>赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额的基金份额净值并扣除相应的费用……</p>
<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>……</p> <p>6、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术保障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。</p>	<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>……</p> <p><u>5、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><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</u></p>

<p>发生上述第 1、2、3、<del>5</del>、6、7 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时……</p>	<p><u>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>8、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。</p> <p>发生上述第 1、2、3、6、7、<u>8、9</u> 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时……</p>
<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 ……</p> <p>发生上述 1、2、3、5、6、7 项情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时……</p>	<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 ……</p> <p><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>发生上述 1、2、3、5、6、7、<u>8</u> 项情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时……</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 无</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</p> <p><u>(3) 若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 20%，基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出 20%的赎回申请实施延期办理。而对该单个基金份额持有人 20%以内（含 20%）的赎回申请，基金管理人根据前述“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基</u></p>

	<p>金份额持有人的赎回申请一并办理。如下一开放日，该单一基金份额持有人剩余未赎回部分仍旧超出前述比例约定的，继续按前述规则处理，直至该单一基金份额持有人单个开放日内申请赎回的基金份额占上一开放日基金总份额的比例低于前述比例。</p>
<p><b>第七部分 基金合同当事人及权利义务</b></p>	
<p>一、基金管理人  (一) 基金管理人简况  住所：<del>上海浦东新区</del>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层<del>(200135)</del>  法定代表人：<del>齐亮</del></p> <p>二、基金托管人  (一) 基金托管人简况  法定代表人：<del>田国立</del>  注册资本：人民币<del>贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟捌佰肆拾捌万壹仟玖佰叁拾捌</del>元整</p>	<p>一、基金管理人  (一) 基金管理人简况  住所：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层  法定代表人：<u>贾波</u></p> <p>二、基金托管人  (一) 基金托管人简况  法定代表人：<u>陈四清</u>  注册资本：人民币<u>贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹</u>元整</p>
<p><b>第十二部分 基金的投资</b></p>	
<p>二、投资范围  .....  本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>二、投资范围  .....  本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；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，现金<u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>
<p>四、投资限制  1、组合限制  (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，</p>	<p>四、投资限制  1、组合限制  (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，</p>

<p>现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%;</p>	<p>现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%;</p> <p><u>(22)本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 15%;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,不得超过该上市公司可流通股票的 30%;</u></p> <p><u>(23)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,本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>(24)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>因证券、期货市场波动、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>除上述第(2)、(12)、(23)、(24)项外,</u>因证券、期货市场波动、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>第十四部分 基金资产估值</b></p>	
<p>六、暂停估值的情形 无</p>	<p>六、暂停估值的情形 <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的,基金管理人应当暂停基金估值;</u></p>
<p><b>第十八部分 基金的信息披露</b></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>(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>(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>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有风险。</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>(七) 临时报告</p> <p>无</p>	<p>(七) 临时报告</p> <p><u>28、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></p>

注：基金合同内容摘要涉及上述内容的一并修改。

## 《华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金托管协议》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>一、托管协议当事人</b>	
<p>(一) 基金管理人（或简称“管理人”） 住所：<del>上海浦东新区</del>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号<del>楼</del>17 层 法定代表人：<b>齐亮</b></p> <p>(二) 基金托管人（或简称“托管人”） 法定代表人：<del>田国立</del> 注册资本：人民币<del>贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟捌佰肆拾捌万壹仟玖佰叁拾捌</del>元整</p>	<p>(一) 基金管理人（或简称“管理人”） 住所：<b>中国（上海）自由贸易试验区</b>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 法定代表人：<b>贾波</b></p> <p>(二) 基金托管人（或简称“托管人”） 法定代表人：<b>陈四清</b> 注册资本：人民币<del>贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟捌佰肆拾捌万壹仟玖佰叁拾捌</del><b>肆拾壹</b>元整</p>
<b>二、托管协议的依据、目的、原则和解释</b>	
<p>(一) 依据 本协议依据《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》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）及其他有关法律法规与《华泰柏瑞新利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》”）订立。</p>	<p>(一) 依据 本协议依据《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》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、<b>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</b>及其他有关法律法规与《华泰柏瑞新利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》”）订立。</p>
<b>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</b>	
<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包</p>	<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包</p>



<p>括以下方面：</p> <p>1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。……</p> <p>本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>括以下方面：</p> <p>1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。……</p> <p>本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；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，现金<u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>
<p>2、对基金投资比例进行监督：</p> <p>（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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p> <p>因证券、期货市场波动、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>2、对基金投资比例进行监督：</p> <p>（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，现金<u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p> <p><u>（22）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持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；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，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；</u></p> <p><u>（23）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，本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>（24）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；本基金管理人承诺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，并承担由于不一致所导致的风险和损失；</u></p>

	除上述第（2）、（12）、（23）、（24）项外，因证券、期货市场波动、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。
--	---

## 《华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金基金合同》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>一、前言</b>	
（一）订立《华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“本基金合同”）的目的、依据和原则 2、订立本基金合同的依据 订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法通则》……《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）及其他法律法规的有关规定。	（一）订立《华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“本基金合同”）的目的、依据和原则 2、订立本基金合同的依据 订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法通则》……《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、 <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> ）及其他法律法规的有关规定。
<b>二、释义</b>	
无	<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《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>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

	<p>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</p>
<p><b>七、基金份额的申购、赎回与转换</b></p>	
<p>(五) 申购与赎回的数额限制</p> <p>无</p>	<p>(五) 申购与赎回的数额限制</p> <p><u>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，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</u></p>
<p>(七) 申购和赎回的费用及其用途</p> <p>3、本基金的赎回费率按照持有时间递减，即相关基金份额持有时间越长，所适用的赎回费率越低，赎回费用等于赎回金额乘以所适用的赎回费率（见前述计算公式）。实际执行的赎回费率在招募说明书中载明。</p>	<p>(七) 申购和赎回的费用及其用途</p> <p>3、本基金的赎回费率按照持有时间递减，即相关基金份额持有时间越长，所适用的赎回费率越低，赎回费用等于赎回金额乘以所适用的赎回费率（见前述计算公式）。实际执行的赎回费率在招募说明书中载明，<u>其中对持续持有期少于 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。</u></p>
<p>(九) 巨额赎回的认定及处理方式</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>无</p>	<p>(九) 巨额赎回的认定及处理方式</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p><u>(3) 若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 20%，基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出 20% 的赎回申请实施延期办理。而对该单个基金份额持有人 20% 以内（含 20%）的赎回申请，基金管理人根据前述“（1）接受全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。如下一开放日，该单一基</u></p>

	<u>金份额持有人剩余未赎回部分仍旧超出前述比例约定的,继续按前述规则处理,直至该单一基金份额持有人单个开放日内申请赎回的基金份额占上一开放日基金总份额的比例低于前述比例。</u>
<p>(十) 拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理</p> <p>1、在如下情况下,基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请:</p> <p>.....</p> <p>基金管理人决定拒绝或暂停接受某些投资者的申购申请时,申购款项将退回投资者账户。基金管理人决定暂停接受申购申请时.....</p>	<p>(十) 拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理</p> <p>1、在如下情况下,基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请:</p> <p>.....</p> <p><u>(4) 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><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暂停接受基金申购申请的措施;</u></p> <p>基金管理人决定拒绝或暂停接受某些投资者的申购申请时,申购款项将退回投资者账户。<u>发生上述第(1)、(2)、(3)、(5)、(6)、(7)项情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时.....</u></p>
<p>2、在以下情况下,基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请:</p> <p>.....</p>	<p>2、在以下情况下,基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请:</p> <p>.....</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>
<b>十、基金合同当事人及其权利义务</b>	
(一) 基金管理人	(一) 基金管理人

<p>1、基金管理人基本情况 住所：<u>上海浦东新区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 办公地址：<u>上海浦东新区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 法定代表人：<u>齐亮</u> (二) 基金托管人 1、基金托管人基本情况 法定代表人：<u>田国立</u> 注册资本：人民币<u>贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰仟零玖元</u></p>	<p>1、基金管理人基本情况 住所：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 办公地址：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 法定代表人：<u>贾波</u> (二) 基金托管人 1、基金托管人基本情况 法定代表人：<u>陈四清</u> 注册资本：人民币<u>贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整</u></p>
<p><b>十六、基金的投资</b></p>	
<p>(二) 投资范围 ..... 本基金的投资组合比例为：本基金投资于固定收益类金融工具的资产占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于信用债券的资产占基金固定收益类资产的比例合计不低于 80%；投资于权益类金融工具的资产占基金资产的比例不超过 20%；基金转入开放期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) 投资范围 ..... 本基金的投资组合比例为：本基金投资于固定收益类金融工具的资产占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于信用债券的资产占基金固定收益类资产的比例合计不低于 80%；投资于权益类金融工具的资产占基金资产的比例不超过 20%；基金转入开放期后现金<u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>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>(七) 投资禁止行为与限制 2、基金投资组合比例限制 (1) 本基金投资于固定收益类金融工具的资产占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于信用债券的资产占基金固定收益类资产的比例合计不低于 80%；投资于权益类金融工具的资产占基金资产的</p>	<p>(七) 投资禁止行为与限制 2、基金投资组合比例限制 (1) 本基金投资于固定收益类金融工具的资产占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于信用债券的资产占基金固定收益类资产的比例合计不低于 80%；投资于权益类金融工具的资产占基金资产的</p>

<p>比例不超过 20%；基金转入开放期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>比例不超过 20%；  <u>(2) 基金转入开放期后现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>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>(10) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；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，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；</u>  <u>(11) 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，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u>  <u>(12) 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>(八) 投资组合比例调整  基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在十个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。</p>	<p>(八) 投资组合比例调整  基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。<u>除上述第 (2)、(8)、(11)、(12) 项外</u>，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在十个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。</p>
<p><b>十九、基金资产的估值</b></p>	
<p>(六) 暂停估值的情形  无</p>	<p>(六) 暂停估值的情形  <b>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</b></p>

	<u>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，基金管理人应当暂停基金估值；</u>
<b>二十三、基金的信息披露</b>	
(六) 定期报告 .....	(六) 定期报告 ..... <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</u> <u>特有风险。</u> <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>
(七) 临时报告与公告 无	(七) 临时报告与公告 <u>28、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>

注：基金合同内容摘要涉及上述内容的一并修改。

## 《华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金托管协议》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>一、托管协议当事人</b>	
<p>(一) 基金管理人（或简称“管理人”） 住所：<u>上海浦东新区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 办公地址：<u>上海浦东新区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 法定代表人：<b>齐亮</b></p> <p>(二) 基金托管人（或简称“托管人”） 法定代表人：<b>田国立</b> 注册资本：人民币<b>贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰仟零玖元</b></p>	<p>(一) 基金管理人（或简称“管理人”） 住所：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 办公地址：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 法定代表人：<b>贾波</b></p> <p>(二) 基金托管人（或简称“托管人”） 法定代表人：<b>陈四清</b> 注册资本：人民币<b>贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整</b></p>
<b>二、托管协议的依据、目的、原则和解释</b>	
<p>(一) 依据 本协议依据《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》”）、《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》”）及其他有关法律法规与《华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）订立。</p>	<p>(一) 依据 本协议依据《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》”）、《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》</u>及其他有关法律法规与《华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）订立。</p>
<b>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</b>	



(一)基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定,建立相关的技术系统,对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面:

2、对基金投融资比例进行监督:

(1)本基金投资于固定收益类金融工具的资产占基金资产的比例不低于80%,其中投资于信用债券的资产占基金固定收益类资产的比例合计不低于80%;投资于权益类金融工具的资产占基金资产的比例不超过20%;基金转入开放期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%;

(一)基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定,建立相关的技术系统,对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面:

2、对基金投融资比例进行监督:

(1)本基金投资于固定收益类金融工具的资产占基金资产的比例不低于80%,其中投资于信用债券的资产占基金固定收益类资产的比例合计不低于80%;投资于权益类金融工具的资产占基金资产的比例不超过20%;

(2)基金转入开放期后现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)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%;

(10)本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的15%;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,不得超过该上市公司可流通股票的30%;(资产托管人项下义务仅限于监管由其担任资产托管人的资产管理人所管理全部基金或全部投资组合的投资符合上述比例限制)

(11)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,本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;

(12)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;本基金管理人承诺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

	<p>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,并承担由于不一致所导致的风险和损失;</p> <p>.....</p> <p>基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。除上述第(2)、(8)、(11)、(12)项外,因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的,基金管理人应当在十个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定时,从其规定。</p>
--	--

## 《华泰柏瑞兴利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>第一部分 前言</b>	
<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》”)……《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》”)……《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。</p>
<b>第二部分 释义</b>	
无	<p>13、<u>《流动性风险规定》</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</u></p>

	<p><u>管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订</u></p> <p><u>52、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>
<b>第六部分 基金份额的申购与赎回</b>	
<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>无</p>	<p>六十七、申购和赎回的数量限制</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，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</u></p>
<p>六十八、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书，本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额的基金份额净值并扣除相应的费用……</p>	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示，<u>其中对持续持有期少于 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。</u>赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额的基金份额净值并扣除相应的费用……</p>
<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>……</p> <p>发生上述第 1、2、3、<del>5</del>、6、7 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时……</p>	<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>……</p> <p><u>5、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><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，</u></p>

	<p><u>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>发生上述第 1、2、3、6、7、<u>8、9</u> 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时……</p>
<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 ……</p> <p>发生上述 1、2、3、5、6 项情形之一基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时……</p>	<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 ……</p> <p><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>发生上述 1、2、3、5、6、<u>7</u> 项情形之一基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时……</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>无</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><u>(3) 若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 20%,基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出 20%的赎回申请实施延期办理。而对该单个基金份额持有人 20%以内(含 20%)的赎回申请,基金管理人根据前述“ (1) 全额赎回”或“ (2) 部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。如下一开放日,该单一基金份额持有人剩余未赎回部分仍旧超出前述比例约定的,继续按前述规则处理,直至该单一基金份额持有人单个开放日内申请赎回的基金份额占上一开放日基金总份额的比例低于前述比例。</u></p>

<b>第七部分 基金合同当事人及权利义务</b>	
<p>一、基金管理人</p> <p>(一) 基金管理人简况</p> <p>住所：<del>上海浦东新区</del>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层<del>(200135)</del></p> <p>法定代表人：<b>齐亮</b></p>	<p>一、基金管理人</p> <p>(一) 基金管理人简况</p> <p>住所：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层</p> <p>法定代表人：<b>贾波</b></p>
<b>第十二部分 基金的投资</b>	
<p>二、投资范围</p> <p>.....</p> <p>基金的投资组合比例为：股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>二、投资范围</p> <p>.....</p> <p>基金的投资组合比例为：股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；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，现金<u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>
<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p>	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(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，现金<u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p> <p><u>(19) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；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，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；</u></p> <p><u>(20) 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</u></p>

	<p>制的，<u>本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>(21)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>因证券、期货市场波动、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>除上述第（2）、（12）、（20）、（21）项外，</u>因证券、期货市场波动、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>第十四部分 基金资产估值</b></p>	
<p>六、暂停估值的情形</p> <p>无</p>	<p>六、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的，基金管理人应当暂停基金估值；</u></p>
<p><b>第十八部分 基金的信息披露</b></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>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>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></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</u></p>

	<u>基金组合资产情况及其流动性风险分析等。</u>
(七) 临时报告 无	(七) 临时报告 <u>28、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>

注：基金合同内容摘要涉及上述内容的一并修改。

## 《华泰柏瑞兴利灵活配置混合型证券投资基金托管协议》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>一、基金托管协议当事人</b>	
(一) 基金管理人 注册地址： <del>上海浦东新区</del> 民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 办公地址： <del>上海浦东新区</del> 民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 法定代表人： <b>齐亮</b>	(一) 基金管理人 注册地址： <u>中国（上海）自由贸易试验区</u> 民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 办公地址： <u>中国（上海）自由贸易试验区</u> 民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 法定代表人： <b>贾波</b>
<b>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</b>	
(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。…… 本基金的投资组合比例为股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；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	(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。…… 本基金的投资组合比例为股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；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

<p>后，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>后，现金（<u>不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>）和到期日在一年以内的政府债券的投资比例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股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p> <p>因证券、期货市场波动、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的投资比例的，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>（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股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金（<u>不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>）和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p> <p><u>19、本基金管理人管理的、且由本基金托管人托管的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的、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，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；</u></p> <p><u>20、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，本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>21、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><u>除上述第 2、12、20、21 项外</u>，因证券、期货市场波动、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的投资比例的，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</p>



	的，从其规定。
<b>八、基金资产净值计算和会计核算</b>	
(四) 暂停估值与公告基金份额净值的情形 无	(四) 暂停估值与公告基金份额净值的情形 <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的，基金管理人应当暂停基金估值；</u>

## 《华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>第一部分 前言</b>	
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》”）……《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》”）……《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。
<b>第二部分 释义</b>	
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> <u>52、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</u>

	<p>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</p>
<p><b>第六部分 基金份额的申购与赎回</b></p>	
<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>无</p>	<p>六十九、申购和赎回的数量限制</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，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</u></p>
<p>七十、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额的基金份额净值并扣除相应的费用……</p>	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示，<u>其中对持续持有期少于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。</u>赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额的基金份额净值并扣除相应的费用……</p>
<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>……</p> <p>发生上述第1、2、3、<del>5</del>、6、7项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时……</p>	<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>……</p> <p><u>5、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><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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。</u></p>

	发生上述第 1、2、3、6、7、 <u>8、9</u> 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时……
八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… 发生上述 1、2、3、5、6 项情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时……	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>  发生上述 1、2、3、5、6、 <u>7</u> 项情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时……
九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 无	九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 <u>(3) 若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 20%，基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出 20%的赎回申请实施延期办理。而对该单个基金份额持有人 20%以内（含 20%）的赎回申请，基金管理人根据前述“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。如下一开放日，该单一基金份额持有人剩余未赎回部分仍旧超出前述比例约定的，继续按前述规则处理，直至该单一基金份额持有人单个开放日内申请赎回的基金份额占上一开放日基金总份额的比例低于前述比例。</u>
<b>第七部分 基金合同当事人及权利义务</b>	
一、基金管理人 (一) 基金管理人简况	一、基金管理人 (一) 基金管理人简况

<p>住所：<del>上海浦东新区</del>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层—(200135)—</p> <p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况</p> <p>注册资本：<del>贰拾叁亿伍仟伍佰陆拾玖万玖仟贰佰元</del>人民币</p>	<p>住所：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层</p> <p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况</p> <p>注册资本：<u>36.64 亿</u>元人民币</p>
<p><b>第十二部分 基金的投资</b></p>	
<p>二、投资范围</p> <p>.....</p> <p>本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>二、投资范围</p> <p>.....</p> <p>本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；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，现金<u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>
<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p>	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(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，现金<u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p> <p><u>(19) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；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，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；</u></p> <p><u>(20) 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，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u></p>

	<u>(21)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>
除上述第(12)项 <b>另有约定</b> 外,因证券、期货市场波动、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。	除上述第 <u>(2)、(12)、(20)、(21)</u> 项外,因证券、期货市场波动、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。
<b>第十四部分 基金资产估值</b>	
六、暂停估值的情形 无	六、暂停估值的情形 <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的,基金管理人应当暂停基金估值;</u>
<b>第十八部分 基金的信息披露</b>	
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 ..... <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> <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>(七) 临时报告 无</p>	<p>(七) 临时报告 <u>28、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></p>
-----------------------	---

注：基金合同内容摘要涉及上述内容的一并修改。

## 《华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金托管协议》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>一、基金托管协议当事人</b>	
<p>(一) 基金管理人 注册地址：<del>上海浦东新区</del>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 办公地址：<del>上海浦东新区</del>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层</p> <p>(二) 基金托管人 注册资本：<del>贰拾叁亿伍仟伍佰陆拾玖万玖仟贰佰元</del>人民币</p>	<p>(一) 基金管理人 注册地址：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 办公地址：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层</p> <p>(二) 基金托管人 注册资本：<u>36.64 亿</u>元人民币</p>
<b>二、基金托管协议的依据、目的和原则</b>	
<p>(一) 订立托管协议的依据 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》”）、《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</p>	<p>(一) 订立托管协议的依据 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》”）、《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</p>

<p>简称“《信息披露办法》”)等有关法律法规、《华泰柏瑞裕利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》”)及其他有关规定制订。</p>	<p>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>等有关法律法规、《华泰柏瑞裕利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》”)及其他有关规定制订。</p>
<p><b>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</b></p>	
<p>(一) 基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权 ..... 本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%; 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, 现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例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 ..... 本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%; 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, 现金<u>(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)</u>和到期日在一年以内的政府债券的投资比例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。 (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, 现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%;  除上述第(12)项<b>另有约定</b>外, 因证券、期货市场波动、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>(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。 (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, 现金<u>(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)</u>和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%; <u>(19)本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票, 不得超过该上市公司可流通股票的 15%; 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, 不得超过该上市公司可流通股票的 30%;</u> <u>(20)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, 本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;</u> <u>(21)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</u></p>

	<p><u>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>除上述第<u>(2)</u>、<u>(12)</u>、<u>(20)</u>、<u>(21)</u>项外,因证券、期货市场波动、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>
<b>八、基金资产净值计算和会计核算</b>	
<p>(四) 暂停估值的情形</p> <p>无</p>	<p>(四) 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的,基金管理人应当暂停基金估值;</u></p>

## 《华泰柏瑞中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金基金合同》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>第一部分 前言</b>	
<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》”)……《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》”)……《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>《流动性风险规定》</u>”)和其他有关</p>



	法律法规。
<b>第二部分 释义</b>	
无	<p><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></p> <p><u>52、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>
<b>第六部分 基金份额的申购与赎回</b>	
五、申购和赎回的数量限制 无	<p>七十一、申购和赎回的数量限制</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，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</u></p>
七十二、申购和赎回的价格、费用及其用途 3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额的基金份额净值并扣除相应的费用……	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示，<u>其中对持续持有期少于 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</u>。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额的基金份额净值并扣除相应的费用……</p>
七、拒绝或暂停申购的情形 ……	七、拒绝或暂停申购的情形 ……

<p>6、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术保障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。</p> <p>发生上述第 1、2、3、<del>5</del>、6、7 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时……</p>	<p><u>5、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><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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。</u></p> <p>8、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。</p> <p>发生上述第 1、2、3、6、7、<u>8、9</u> 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时……</p>
<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 ……</p> <p>发生上述 1、2、3、5、6、7 项情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时……</p>	<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 ……</p> <p><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>发生上述 1、2、3、5、6、7、<u>8</u> 项情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时……</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>无</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><u>(3) 若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 20%，基金管理人可以先行对该单个基</u></p>

	<p>基金份额持有人超出 20%的赎回申请实施延期办理。而对该单个基金份额持有人 20%以内（含 20%）的赎回申请，基金管理人根据前述“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。如下一开放日，该单一基金份额持有人剩余未赎回部分仍旧超出前述比例约定的，继续按前述规则处理，直至该单一基金份额持有人单个开放日内申请赎回的基金份额占上一开放日基金总份额的比例低于前述比例。</p>
<p><b>第七部分 基金合同当事人及权利义务</b></p>	
<p>一、基金管理人 （一）基金管理人简况 住所：<del>上海浦东新区</del>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层<del>（200135）</del> 法定代表人：<del>齐亮</del></p> <p>二、基金托管人 （一）基金托管人简况 法定代表人：<del>田国立</del> 注册资本：人民币<del>贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整</del></p>	<p>一、基金管理人 （一）基金管理人简况 住所：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 法定代表人：<u>贾波</u></p> <p>二、基金托管人 （一）基金托管人简况 法定代表人：<u>陈四清</u> 注册资本：人民币<u>贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整</u></p>
<p><b>第十二部分 基金的投资</b></p>	
<p>二、投资范围 ..... 本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；投资于“中国制造 2025”主题相关的证券不低于非现金基金资产的 80%；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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>二、投资范围 ..... 本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；投资于“中国制造 2025”主题相关的证券不低于非现金基金资产的 80%；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，现金（<u>不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>）和到期日在一年以内的</p>

	政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。
<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p>	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(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，现金（<u>不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>）和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p> <p><u>(23) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；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，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；</u></p> <p><u>(24) 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，本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>(25) 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>因证券、期货市场波动、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>除上述第（2）、（12）、（24）、（25）项外</u>，因证券、期货市场波动、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>
<b>第十四部分 基金资产估值</b>	
<p>六、暂停估值的情形</p> <p>无</p>	<p>六、暂停估值的情形</p> <p><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</u></p>

	<u>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，基金管理人应当暂停基金估值；</u>
<b>第十八部分 基金的信息披露</b>	
<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>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>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></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>(七) 临时报告</p> <p>无</p>	<p>(七) 临时报告</p> <p><u>28、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></p>

注：基金合同内容摘要涉及上述内容的一并修改。

## 《华泰柏瑞中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金托管协议》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>一、托管协议当事人</b>	
<p>(一) 基金管理人（或简称“管理人”） 住所：<del>上海浦东新区</del>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号<del>楼</del>17 层 法定代表人：<b>齐亮</b></p> <p>(二) 基金托管人（或简称“托管人”） 法定代表人：<del>田国立</del> 注册资本：人民币<del>贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍</del>元整</p>	<p>(一) 基金管理人（或简称“管理人”） 住所：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 法定代表人：<b>贾波</b></p> <p>(二) 基金托管人（或简称“托管人”） 法定代表人：<b>陈四清</b> 注册资本：人民币<del>贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹</del>元整</p>
<b>二、托管协议的依据、目的、原则和解释</b>	
<p>(一) 依据 本协议依据《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》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）及其他有关法律法规与《华泰柏瑞中国制造 2025 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》”）订立。</p>	<p>(一) 依据 本协议依据《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>及其他有关法律法规与《华泰柏瑞中国制造 2025 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》”）订立。</p>
<b>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</b>	
<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包</p>	<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包</p>

<p>括以下方面： 1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。…… 本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；投资于“中国制造 2025”主题相关的证券不低于非现金基金资产的 80%；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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>括以下方面： 1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。…… 本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；投资于“中国制造 2025”主题相关的证券不低于非现金基金资产的 80%；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，现金（<b>不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</b>）和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>
<p>2、对基金投融资比例进行监督： （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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；  因证券、期货市场波动、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>2、对基金投融资比例进行监督： （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，现金（<b>不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</b>）和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%； <b><u>（22）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持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；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，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；</u></b> <b><u>（23）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，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u></b> <b><u>（24）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；本基金管理人承诺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</u></b></p>

范围保持一致，并承担由于不一致所导致的风险和损失；

除上述第（2）、（12）、（23）、（24）项外，因证券、期货市场波动、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。



## 《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>第一部分 前言</b>	
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》”)……《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》”)……《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。
<b>第二部分 释义</b>	
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> <u>52、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>
<b>第六部分 基金份额的申购与赎回</b>	
五、申购和赎回的数量限制 无	七十三、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</u>

	<u>保护存量基金份额持有人的合法权益,具体规定请参见招募说明书或相关公告。</u>
七十四、申购和赎回的价格、费用及其用途 3、赎回金额的计算及处理方式:本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定,并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用……	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 3、赎回金额的计算及处理方式:本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定,并在招募说明书中列示, <u>其中对持续持有期少于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。</u> 赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用……
七、拒绝或暂停申购的情形 …… 8、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术保障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。	七、拒绝或暂停申购的情形 …… <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> 9、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。
八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 ……	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… <u>8、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>
九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式	九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式

<p>无</p>	<p>(3) 若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 20%，基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出 20% 的赎回申请实施延期办理。而对该单个基金份额持有人 20% 以内（含 20%）的赎回申请，基金管理人根据前述“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。如下一开放日，该单一基金份额持有人剩余未赎回部分仍旧超出前述比例约定的，继续按前述规则处理，直至该单一基金份额持有人单个开放日内申请赎回的基金份额占上一开放日基金总份额的比例低于前述比例。</p>
<p><b>第七部分 基金合同当事人及权利义务</b></p>	
<p>一、基金管理人 （一）基金管理人简况 住所：<u>上海浦东新区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层（200135） 法定代表人：<u>齐亮</u></p> <p>二、基金托管人 （一）基金托管人简况 法定代表人：<u>田国立</u> 注册资本：人民币<u>贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟捌佰肆拾捌万壹仟玖佰叁拾捌</u>元整</p>	<p>一、基金管理人 （一）基金管理人简况 住所：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层（200135） 法定代表人：<u>贾波</u></p> <p>二、基金托管人 （一）基金托管人简况 法定代表人：<u>陈四清</u> 注册资本：人民币<u>贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹</u>元整</p>
<p><b>第十二部分 基金的投资</b></p>	
<p>二、投资范围 …… 正常情况下，本基金资产中投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者</p>	<p>二、投资范围 …… 正常情况下，本基金资产中投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金（不</p>

<p>到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。股指期货以套期保值为目的，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。</p>	<p><u>包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>）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%。股指期货以套期保值为目的，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。</p>
<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(2) 在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p>	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(2) 在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金<u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p> <p><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，本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>(19)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>因证券、期货市场波动、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。法律法规另有规定的，从其规定。</p>	<p><u>除上述第（2）、（10）、（18）、（19）项外，</u>因证券、期货市场波动、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。法律法规另有规定的，从其规定。</p>
<p><b>第十四部分 基金资产估值</b></p>	
<p>六、暂停估值的情形</p> <p>无</p>	<p>六、暂停估值的情形</p> <p><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一致的，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) 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>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>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></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>(七) 临时报告</p> <p>无</p>	<p>(七) 临时报告</p> <p><u>28、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></p>

注：基金合同内容摘要涉及上述内容的一并修改。

## 《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>一、托管协议当事人</b>	
<p>(一) 基金管理人 (或简称“管理人”)</p> <p>住所: <u>上海市浦东新区</u>民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层 (200135)</p> <p>法定代表人: <u>齐亮</u></p> <p>(二) 基金托管人 (或简称“托管人”)</p> <p>法定代表人: <u>田国立</u></p> <p>注册资本: 人民币<del>贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟捌佰肆拾捌万壹仟玖佰叁拾捌</del>元整</p>	<p>(一) 基金管理人 (或简称“管理人”)</p> <p>住所: <u>中国 (上海) 自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄<u>上海</u>证大五道口广场 1 号楼 17 层 (200135)</p> <p>法定代表人: <u>贾波</u></p> <p>(二) 基金托管人 (或简称“托管人”)</p> <p>法定代表人: <u>陈四清</u></p> <p>注册资本: 人民币<del>贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟捌佰肆拾捌万壹仟玖佰叁拾捌</del><u>贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹</u>元整</p>
<b>二、托管协议的依据、目的、原则和解释</b>	
<p>(一) 依据</p> <p>本协议依据《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》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)及其他有关法律法规与《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)订立。</p>	<p>(一) 依据</p> <p>本协议依据《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>及其他有关法律法规与《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)订立。</p>
<b>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</b>	
<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定, 建立相关的技术系统, 对基金管理人的投资运作进行监督。主要包</p>	<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定, 建立相关的技术系统, 对基金管理人的投资运作进行监督。主要包</p>

<p>括以下方面： 1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。…… 正常情况下，本基金资产中投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；扣除股指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%。股指期货以套期保值为目的，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。</p>	<p>括以下方面： 1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。…… 正常情况下，本基金资产中投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金<u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>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%。股指期货以套期保值为目的，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。</p>
<p>2、对基金投融资比例进行监督； （2）在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；  因证券、期货市场波动、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。法律法规另有规定的，从其规定。</p>	<p>2、对基金投融资比例进行监督； （2）在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金<u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%； <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，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u> <u>（19）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；本基金管理人承诺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，并承担由于不一致所导致的风险和损失；</u>  <u>除上述第（2）、（10）、（18）、（19）项外，</u>因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素</p>

	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。法律法规另有规定的，从其规定。
--	--

## 《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>一、前言</b>	
<p>(一)订立《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称“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</p> <p>订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法通则》……《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《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）及其他法律法规的有关规定。</p>	<p>(一)订立《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称“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</p> <p>订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法通则》……《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《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）及其他法律法规的有关规定。</p>
<b>二、释义</b>	
无	<p><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《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；</p> <p><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）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产</p>



	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；
<b>八、基金份额的申购、赎回</b>	
(五) 申购与赎回的数额限制  无	(五) 申购与赎回的数额限制  <u>3、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,具体规定请参见招募说明书或相关公告。</u>
(七) 暂停申购、赎回的情形  无	(七) 暂停申购、赎回的情形 <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,基金管理人应当采取延缓支付赎回对价或暂停接受基金申购赎回申请的措施;</u>
<b>十一、基金合同当事人及其权利义务</b>	
(一) 基金管理人 1、基金管理人基本情况 住所: <u>上海市浦东新区</u> 民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号 17 层 (200135) 法定代表人: <u>齐亮</u> (二) 基金托管人 1、基金托管人基本情况 住所: 北京市复兴门内大街 1 号 法定代表人: <u>肖钢</u> 注册资本: 人民币 <u>贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰仟零玖元</u>	(一) 基金管理人 1、基金管理人基本情况 住所: <u>中国(上海)自由贸易试验区</u> 民生路 1199 弄 <u>上海</u> 证大五道口广场 1 号 17 层 (200135) 法定代表人: <u>贾波</u> (二) 基金托管人 1、基金托管人基本情况 住所: 北京市 <u>西城区</u> 复兴门内大街 1 号 法定代表人: <u>陈四清</u> 注册资本: 人民币 <u>贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆</u>

	拾壹元整
<b>十七、基金的投资</b>	
(八) 投资禁止行为与限制 2、基金投资组合比例限制 无	(八) 投资禁止行为与限制 2、基金投资组合比例限制 <u>(4) 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，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u> <u>(5) 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>
由于证券期货市场波动、上市公司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。	由于证券期货市场波动、上市公司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， <u>上述第 (4)、(5) 项除外</u> 。法律法规另有规定的从其规定。
<b>二十、基金财产的估值</b>	
(六) 暂停估值的情形 无	(六) 暂停估值的情形 <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的，基金管理人应当暂停基金估值；</u>
<b>二十四、基金的信息披露</b>	
(十) 定期报告 .....	(十) 定期报告 ..... <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</u>

	<p><u>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></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>(十一) 临时报告与公告 无</p>	<p>(十一) 临时报告与公告 <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;</u></p>

注：基金合同内容摘要涉及上述内容的一并修改。

## 《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金托管协议》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>一、托管协议当事人</b>	
<p>(一) 基金管理人（或简称“管理人”） 住所：<u>上海市浦东新区</u>民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层（200135） 法定代表人：<u>齐亮</u></p> <p>(二) 基金托管人（或简称“托管人”） 法定代表人：<u>肖钢</u> 注册资本：人民币<u>贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰仟零玖元</u></p>	<p>(一) 基金管理人（或简称“管理人”） 住所：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄<u>上海</u>证大五道口广场 1 号楼 17 层（200135） 法定代表人：<u>贾波</u></p> <p>(二) 基金托管人（或简称“托管人”） 法定代表人：<u>陈四清</u> 注册资本：人民币<u>贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整</u></p>
<b>二、托管协议的依据、目的、原则和解释</b>	
<p>(一) 依据 本协议依据《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》”）、《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》”）及其他有关法律、法规与《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）订立。</p>	<p>(一) 依据 本协议依据《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》”）、《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》</u>及其他有关法律、法规与《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）订立。</p>
<b>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</b>	
<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包</p>	<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包</p>

<p>括以下方面： 2、对基金投融资比例进行监督；</p>	<p>括以下方面： 2、对基金投融资比例进行监督； <u>其中，基金托管人根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》对投资组合的比例做如下监督：</u> <u>1) 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，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u> <u>2) 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；本基金管理人承诺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，并承担由于不一致所导致的风险和损失；</u></p>
-----------------------------------	--

## 《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>第一部分 前言</b>	
<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》”)……《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》”)……《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。</p>
<b>第二部分 释义</b>	
无	<p><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></p> <p><u>67、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>
<b>第八部分 基金份额的申购与赎回</b>	
<p>六、场内申购和赎回的数量限制</p> <p>无</p>	<p>六、场内申购和赎回的数量限制</p> <p><u>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</u></p>

	<u>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，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</u>
七、场外申购和赎回的数额限制 无	七、场外申购和赎回的数额限制 <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，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</u>
十、拒绝或暂停申购的情形 ..... 6、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术保障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。	十、拒绝或暂停申购的情形 ..... <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暂停接受基金申购申请的措施。</u> 7、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。
十一、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 .....	十一、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 ..... <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>
十二、场外巨额赎回的情形及处理方式	十二、场外巨额赎回的情形及处理方式

<p>2、场外巨额赎回的处理方式 无</p>	<p>2、场外巨额赎回的处理方式 <u>(3) 若本基金发生场外巨额赎回且单个基金份额持有人的场外赎回申请超过上一开放日基金总份额的 20%，基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出 20% 的场外赎回申请实施延期办理。而对该单个基金份额持有人 20% 以内（含 20%）的场外赎回申请，基金管理人根据前述“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的场外赎回申请一并办理。如下一开放日，该单一基金份额持有人剩余的场外未赎回部分仍旧超出前述比例约定的，继续按前述规则处理，直至该单一基金份额持有人单个开放日内申请场外赎回的基金份额占上一开放日基金总份额的比例低于前述比例。</u></p>
<p><b>第九部分 基金合同当事人及权利义务</b></p>	
<p>一、基金管理人 (一) 基金管理人简况 住所：<del>上海浦东新区</del>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层<del>（200135）</del> 法定代表人：<b>齐亮</b></p> <p>二、基金托管人 (一) 基金托管人简况 法定代表人：<b>田国立</b> 注册资本：人民币<b>贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟捌佰肆拾捌万壹仟玖佰叁拾捌</b>元整</p>	<p>一、基金管理人 (一) 基金管理人简况 住所：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 法定代表人：<u>贾波</u></p> <p>二、基金托管人 (一) 基金托管人简况 法定代表人：<u>陈四清</u> 注册资本：人民币<b>贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹</b>元整</p>
<p><b>第十四部分 基金的投资</b></p>	
<p>四、投资限制 1、组合限制</p>	<p>四、投资限制 1、组合限制</p>



<p>(17) 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，本基金应当保持不低于交易保证金一倍的现金；</p>	<p>(17) 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，本基金应当保持不低于交易保证金一倍的现金；</p> <p><u>(19)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，本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>(20)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>因证券、期货市场波动、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。法律法规另有规定的，从其规定。</p>	<p><u>除上述第（9）、（19）、（20）项外</u>，因证券、期货市场波动、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。法律法规另有规定的，从其规定。</p>
<p><b>第十六部分 基金资产估值</b></p>	
<p>六、暂停估值的情形</p> <p>无</p>	<p>六、暂停估值的情形</p> <p><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一致的，基金管理人应当暂停基金估值；</u></p>
<p><b>第二十部分 基金的信息披露</b></p>	
<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>(九) 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>五、公开披露的基金信息</p> <p>(九) 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>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</u></p>

	<p>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有风险。</p> <p>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。</p>
<p>(十) 临时报告</p> <p>无</p>	<p>(十) 临时报告</p> <p>27、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;</p>

注：基金合同内容摘要涉及上述内容的一并修改。

## 《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》条款修改对照表

修改前	修改后
<p><b>一、托管协议当事人</b></p>	
<p>(一) 基金管理人（或简称“管理人”）</p> <p>住所：<del>上海市浦东新区</del>民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层（200135）</p> <p>法定代表人：齐亮</p> <p>(二) 基金托管人（或简称“托管人”）</p> <p>法定代表人：田国立</p> <p>注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟捌佰肆拾捌万壹仟玖佰叁</p>	<p>(一) 基金管理人（或简称“管理人”）</p> <p>住所：中国（上海）自由贸易试验区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层</p> <p>法定代表人：贾波</p> <p>(二) 基金托管人（或简称“托管人”）</p> <p>法定代表人：陈四清</p> <p>注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆</p>

拾捌元整	拾壹元整
<b>二、托管协议的依据、目的、原则和解释</b>	
<p>(一) 依据</p> <p>本协议依据《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》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）及其他有关法律法规与《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）订立。</p>	<p>(一) 依据</p> <p>本协议依据《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>及其他有关法律法规与《华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）订立。</p>
<b>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</b>	
<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面：</p> <p>2、对基金投融资比例进行监督：</p> <p>(17) 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，本基金应当保持不低于交易保证金一倍的现金；</p> <p>因证券、期货市场波动、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。法律法规另有规定的，从其规定。</p>	<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面：</p> <p>2、对基金投融资比例进行监督：</p> <p>(17) 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，本基金应当保持不低于交易保证金一倍的现金；</p> <p><u>(19) 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，本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>(20) 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；本基金管理人承诺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</u></p>

	<p><u>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,并承担由于不一致所导致的风险和损失;</u></p> <p><u>除上述第(9)、(19)、(20)项外,</u>因证券、期货市场波动、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。法律法规另有规定的,从其规定。</p>
--	---

## 《华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>第一部分 前言和释义</b>	
<p><b>前 言</b></p> <p>为保护基金投资者合法权益,明确《基金合同》当事人的权利与义务,规范华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”或“基金”)运作,依照《中华人民共和国合同法》……《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><b>前 言</b></p> <p>为保护基金投资者合法权益,明确《基金合同》当事人的权利与义务,规范华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”或“基金”)运作,依照《中华人民共和国合同法》……《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>、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>释 义 无</p>	<p>释 义 <u>《流动性风险规定》</u> 指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《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>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)、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</p>
<p><b>第七部分 基金份额的申购与赎回</b></p>	
<p>七、暂停申购、赎回的情形 .....</p>	<p>七、暂停申购、赎回的情形 ..... <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确认后，基金管理人应当采取延缓支付赎回对价或暂停接受基金申购赎回申请的措施；</u></p>
<p><b>第八部分 基金合同当事人及权利义务</b></p>	
<p>一、基金管理人 (一) 基金管理人简况 住所：<u>上海浦东新区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层(200135) 法定代表人：<u>齐亮</u> 二、基金托管人 (一) 基金托管人简况 法定代表人：<u>姜建清</u></p>	<p>一、基金管理人 (一) 基金管理人简况 住所：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 法定代表人：<u>贾波</u> 二、基金托管人 (一) 基金托管人简况 法定代表人：<u>易会满</u></p>

注册资本：人民币 <b>349,018,545,827</b> 元	注册资本：人民币 <b>349,321,234,600</b> 元
<b>第十三部分 基金的投资</b>	
九、投资限制 (二) 投资组合限制 无	九、投资限制 (二) 投资组合限制 <u>6、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，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u> <u>7、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>
由于证券市场波动、上市公司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。	由于证券市场波动、上市公司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， <u>上述第 6、7 项除外</u> 。法律法规另有规定的从其规定。
<b>第十五部分 基金资产估值</b>	
七、暂停估值的情形 无	七、暂停估值的情形 <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的，基金管理人应当暂停基金估值；</u>
<b>第十九部分 基金的信息披露</b>	
五、公开披露的基金信息 (十) 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 (十) 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><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></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>(十一) 临时报告 无</p>	<p>(十一) 临时报告</p> <p><u>24、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></p>

注：基金合同内容摘要涉及上述内容的一并修改。

## 《华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>一、基金托管协议当事人</b>	
<p>(一) 基金管理人 住所：<del>上海浦东新区</del>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层<del>(200135)</del> 法定代表人：<b>齐亮</b></p> <p>(二) 基金托管人 法定代表人：<b>姜建清</b> 注册资本：人民币 <del>349,018,545,827</del>元</p>	<p>(一) 基金管理人 住所：<b>中国（上海）自由贸易试验区</b>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 法定代表人：<b>贾波</b></p> <p>(二) 基金托管人 法定代表人：<b>易会满</b> 注册资本：人民币 <b>349,321,234,600</b>元</p>
<b>二、基金托管协议的依据、目的和原则</b>	
<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》）、《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〉》、《华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数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》）、《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〉》、<b>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</b>、《华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数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>
<b>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</b>	
<p>(一) 基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权 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融资比例进行监督：</p>	<p>(一) 基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权 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融资比例进行监督：</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: 无</p> <p>由于证券市场波动、上市公司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>(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: <u>VI、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, 本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;</u> <u>VII、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>由于证券市场波动、上市公司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, <u>上述第 VI、VII 项除外</u>。法律法规另有规定的从其规定。</p>
<p>(3) 法规允许的基金投资比例调整期限</p> <p>由于证券市场波动、上市公司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>(3) 法规允许的基金投资比例调整期限</p> <p>由于证券市场波动、上市公司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, 以达到规定的投资比例限制要求, <u>上述第 VI、VII 项除外</u>。法律法规另有规定的从其规定。</p>

## 《上证红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>一、前言</b>	
<p>(一) 订立上证红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同（以下简称“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</p> <p>订立本基金合同的依据是《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》和其他有关法律法规及规定。</p>	<p>(一) 订立上证红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同（以下简称“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</p> <p>订立本基金合同的依据是《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、<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及规定。</p>
<b>二、释义</b>	
<p>基金管理人：指友邦华泰基金管理有限公司</p>	<p>基金管理人：指<u>华泰柏瑞</u>基金管理有限公司</p> <p><u>《流动性风险管理规定》：指《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》；</u></p> <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>
<b>八、基金份额的申购、赎回</b>	
<p>(七) 暂停申购、赎回的情形</p> <p>.....</p>	<p>(七) 暂停申购、赎回的情形</p> <p>.....</p>

	<p><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，基金管理人应当采取延缓支付赎回对价或暂停接受基金申购赎回申请的措施；</u></p>
<p><b>十一、基金合同当事人及其权利义务</b></p>	
<p>(一) 基金管理人</p> <p>1、基金管理人基本情况</p> <p>名称：<del>友邦华泰</del>基金管理有限公司</p> <p>注册地址：<del>上海市浦东新区世纪大道 88 号金茂大厦 40 楼</del></p> <p>法定代表人：<del>齐亮</del></p> <p>(二) 基金托管人</p> <p>1、基金托管人基本情况</p> <p>法定代表人：<del>秦晓</del></p> <p>行长：<del>马蔚华</del></p> <p>注册资本：人民币 <del>122.79</del> 亿元</p>	<p>(一) 基金管理人</p> <p>1、基金管理人基本情况</p> <p>名称：<u>华泰柏瑞</u>基金管理有限公司</p> <p>注册地址：<u>中国（上海）自由贸易试验区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层</u></p> <p>法定代表人：<u>贾波</u></p> <p>(二) 基金托管人</p> <p>1、基金托管人基本情况</p> <p>法定代表人：<u>李建红</u></p> <p>行长：<u>田惠宇</u></p> <p>注册资本：人民币 <u>252.20</u> 亿元</p>
<p><b>十六、基金的投资</b></p>	
<p>(十) 投资限制</p> <p>无</p>	<p>(十) 投资限制</p> <p><u>2、本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计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超过本款所规定比例限制的，本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>3、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与基金合同约定的投资范围不一致；</u></p>

<b>十八、基金财产估值</b>	
(六) 暂停估值的情形 无	(六) 暂停估值的情形 <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的，基金管理人应当暂停基金估值；</u>
<b>二十二、基金的信息披露</b>	
(十) 基金年度报告、基金半年度报告、基金季度报告 .....	(十) 基金年度报告、基金半年度报告、基金季度报告 ..... <u>4、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有风险。</u> <u>5、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>
(十一) 临时报告与公告 无	(十一) 临时报告与公告 <u>21、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>

## 《上证红利交易型开放式指数证券投资基金托管协议》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>一、基金托管协议当事人</b>	
<p>(一) 基金管理人            注册地址：<u>上海市浦东新区</u>民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层            法定代表人：<u>齐亮</u></p>	<p>(一) 基金管理人            注册地址：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄<u>上海</u>证大五道口广场 1 号楼 17 层            法定代表人：<u>贾波</u></p>
<b>二、基金托管协议的依据、目的和原则</b>	
<p>(一) 依据            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》）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《上证红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称《基金合同》）及其他有关规定制定。</p>	<p>(一) 依据            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》）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、<u>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</u>、《上证红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称《基金合同》）及其他有关规定制定。</p>
<b>三、基金托管人对基金管理人的业务监督、核查</b>	
<p>(一) 基金托管人应对基金管理人的投资行为进行监督和核查            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，对基金投融资比例进行监督的内容、标准和程序。            基金托管人应对基金的投资和融资比例是否符合基金合同的规定进行监督……对于因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等原因导致基金的投资不符合基金合同的约定的，基金托管人应书面通知基金管理人在 10 个工作日内进行调整以符合基金合同的约</p>	<p>(一) 基金托管人应对基金管理人的投资行为进行监督和核查            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，对基金投融资比例进行监督的内容、标准和程序。            基金托管人应对基金的投资和融资比例是否符合基金合同的规定进行监督……对于因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等原因导致基金的投资不符合基金合同的约定的，基金托管人应书面通知基金管理人在 10 个工作日内进行调整以符合基金合同的约</p>

定。基金管理人在规定的调整时限内未完成整改的，基金托管人应书面报告中国证监会。	定， <u>基金合同另有约定的除外</u> 。基金管理人在规定的调整时限内未完成整改的，基金托管人应书面报告中国证监会。
---	--

## 《华泰柏瑞货币市场证券投资基金基金合同》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>第一部分 前言</b>	
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》”)……《货币市场基金监督管理办法》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》”)……《货币市场基金监督管理办法》、 <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。
<b>第二部分 释义</b>	
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> <u>57、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>
<b>第六部分 基金份额的申购与赎回</b>	

<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>无</p>	<p>七十五、申购和赎回的数量限制</p> <p><u>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，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</u></p>
<p>七十六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>1. 本基金通常情况下不收取申购费用和赎回费用，但在满足相关流动性风险管理要求的前提下，当本基金持有的现金、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%且偏离度为负时，为确保基金平稳运作，避免诱发系统性风险，基金管理人将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。</p>	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>1. 本基金通常情况下不收取申购费用和赎回费用，但<u>发生以下任一情形时除外：</u></p> <p><u>(1) 在满足相关流动性风险管理要求的前提下，当本基金持有的现金、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%且偏离度为负时，为确保基金平稳运作，避免诱发系统性风险，基金管理人将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。</u></p> <p><u>(2)如本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额 50%，当投资组合中现金、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%且偏离度为负时，基金管理人应当对当日单个基金份额持有人超过基金总份额 1%以上的赎回申请征收 1%的强制赎回费用。</u></p>
<p>八、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>(一) 发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：</p>	<p>八、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>(一) 发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：</p>

<p>.....</p> <p>发生上述第 1、2、3、<del>5</del>、6、7 项暂停申购情形时.....</p>	<p>.....</p> <p><u>5、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>发生上述第 1、2、3、6、7、<u>8</u> 项暂停申购情形时.....</p>
<p>无</p>	<p><u>(三) 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>九、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>无</p>	<p>九、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p><u>(三) 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><b>第十二部分 基金的投资</b></p>	
<p>五、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(1) 本基金不得投资于以下金融工具： .....</p>	<p>五、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(1) 本基金不得投资于以下金融工具： .....</p> <p><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></p>
<p>(2) 本基金的投资组合将遵循以下比例限制：</p> <p><del>7</del>) 本基金投资于现金、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</p>	<p>(2) 本基金的投资组合将遵循以下比例限制：</p> <p><u>2</u>) 本基金投资于现金、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</p>



<p>不得低于 10%;</p> <p>4) 本基金投资于具有基金托管资格的同一商业银行的存款、同业存单, 合计不得超过基金资产净值的 20%; 投资于不具有基金托管资格的同一商业银行的存款、同业存单, 合计不得超过基金资产净值的 5%;</p> <p>6) 本基金投资于现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券占基金资产净值的比例合计不得低于 5%;</p> <p>8) 本基金投资于到期日在 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>不得低于 10%;</p> <p>3) <u>根据本基金的基金份额持有人集中度情况, 对上述第 1)、2) 项投资组合实施如下调整:</u></p> <p><u>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>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>6) 本基金投资于具有基金托管资格的同一商业银行的存款、同业存单, 合计不得超过基金资产净值的 20%; 投资于不具有基金托管资格的同一商业银行的存款、同业存单, 合计不得超过基金资产净值的 5%; <u>本基金管理人管理的全部货币市场基金投资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>8) 本基金投资于现金 (不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)、国债、中央银行票据、政策性金融债券占基金资产净值的比例合计不得低于 5%;</p> <p>13) <u>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%;</u></p> <p><u>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</u></p>
--	---

	<p><u>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>14) 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%;</u></p> <p><u>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>16) 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>
除上述第 11)、12) 条另有约定以及第 6) 条外,因基金规模或市场变化导致本基金投资组合不符合以上比例限制的,基金管理人应在 10 个交易日内进行调整,以达到上述标准。法律法规另有规定时,从其规定。	除上述第 1)、8)、11)、12)、13)、16) 条外,因 <b>基金份额持有人赎回</b> 、基金规模或市场变化导致本基金投资组合不符合以上比例限制的,基金管理人应在 10 个交易日内进行调整,以达到上述标准。法律法规另有规定时,从其规定。
<b>第十四部分 基金资产估值</b>	
六、暂停估值的情形 无	六、暂停估值的情形 <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的,基金管理人应当暂停基金估值;</u>
<b>第十八部分 基金的信息披露</b>	
五、公开披露的基金信息 (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 .....	五、公开披露的基金信息 (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><u>本基金应当在年度报告、半年度报告中至少披露报告期末基金前10名基金份额持有人的类别、持有份额及占总份额的比例等信息。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></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>(六) 临时报告 无</p>	<p>(六) 临时报告</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时；</u></p> <p><u>29、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></p>

注：基金合同内容摘要涉及上述内容的一并修改。

## 《华泰柏瑞货币市场证券投资基金托管协议》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>二、托管协议的依据、目的、原则和解释</b>	
<p>(一) 依据</p> <p>本协议依据《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》”）、《货币市场基金管理暂行办法》（以下简称“《管理办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》及其他有关法律法规与《华泰柏瑞货币市场证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）订立。</p>	<p>(一) 依据</p> <p>本协议依据《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》”）、《货币市场基金管理暂行办法》（以下简称“《管理办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》、<u>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</u>及其他有关法律法规与《华泰柏瑞货币市场证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）订立。</p>
<b>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</b>	
<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督，主要包括以下方面：</p> <p>2、对基金投融资比例进行监督。</p> <p><b>6)</b> 本基金投资于现金、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 10%；</p> <p><b>3)</b> 本基金投资于具有基金托管资格的同一商业银行的存款、同业存单，合计不得超过基金资产净值的 20%；投资于不具有基金托管资格的同一商业银行的存款、同业存单，合计不得超过基金资产净</p>	<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督，主要包括以下方面：</p> <p>2、对基金投融资比例进行监督。</p> <p><b>2)</b> 本基金投资于现金、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 10%；</p> <p><b>3) <u>根据本基金的基金份额持有人集中度情况，对上述第 1)、2) 项投资组合实施如下调整：</u></b> <b><u>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</u></b></p>

值的 5%;

5) 本基金投资于现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券占基金资产净值的比例合计不得低于 5%;

7) 本基金投资于到期日在 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%;—

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%;

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%;

5) 本基金投资于具有基金托管资格的同一商业银行的存款、同业存单, 合计不得超过基金资产净值的 20%; 投资于不具有基金托管资格的同一商业银行的存款、同业存单, 合计不得超过基金资产净值的 5%; 本基金管理人管理的且由本托管人托管的全部货币市场基金投资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%;

7) 本基金投资于现金 (不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)、国债、中央银行票据、政策性金融债券占基金资产净值的比例合计不得低于 5%;

12) 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;

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

	<p><u>融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 2%；</u>  <u>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>  <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基金合同约定的投资范围保持一致；</u>  <u>本基金管理人承诺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，并承担由于不一致所导致的风险和损失；</u></p>
<p>除上述第 10)、11) 条另有约定以及第 6) 条外，因基金规模或市场变化导致本基金投资组合不符合以上比例限制的，基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到上述标准。法律法规另有规定时，从其规定。</p>	<p>除上述第 1)、7)、10)、11)、12)、15) 条外，因<u>基金份额持有人赎回</u>、基金规模或市场变化导致本基金投资组合不符合以上比例限制的，基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到上述标准。法律法规另有规定时，从其规定。</p>

## 《华泰柏瑞天添宝货币市场基金基金合同》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>第一部分 前言</b>	
<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》”)……《货币市场基金监督管理办法》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》”)……《货币市场基金监督管理办法》、<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>
<b>第二部分 释义</b>	
无	<p>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</p> <p>55、<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)、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</p>
<b>第六部分 基金份额的申购与赎回</b>	
<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>无</p>	<p>七十七、申购和赎回的数量限制</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，具体规定请参见招募说明书</u></p>

<p>七十八、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>1、本基金各类基金份额不收取申购费用和赎回费用，但在满足相关流动性风险管理要求的前提下，当任一类基金份额持有的现金、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该类基金资产净值的比例合计低于5%且偏离度为负时，为确保基金平稳运作，避免诱发系统性风险，本基金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本基金利益最大化的情形除外。</p>	<p><u>或相关公告。</u></p> <p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>1、本基金各类基金份额不收取申购费用和赎回费用，但<u>发生以下任一情形时除外：</u></p> <p><u>(1) 在满足相关流动性风险管理要求的前提下，当任一类基金份额持有的现金、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该类基金资产净值的比例合计低于5%且偏离度为负时，为确保基金平稳运作，避免诱发系统性风险，本基金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本基金利益最大化的情形除外；</u></p> <p><u>(2)如本基金前10名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额50%，当投资组合中现金、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%且偏离度为负时，基金管理人应当对当日单个基金份额持有人超过基金总份额1%以上的赎回申请征收1%的强制赎回费用。</u></p>
<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>(一) 发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：</p> <p>……</p> <p>发生上述第1、2、3、<del>5</del>、6、7项暂停申购情形且基金管理人决定暂停申购时……</p>	<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>(一) 发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：</p> <p>……</p> <p><u>5、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>



	发生上述第 1、2、3、6、7、 <u>8</u> 项暂停申购情形且基金管理人决定暂停申购时……
无	<u>(三) 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>
八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 无	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 <u>(三) 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>
<b>第七部分 基金合同当事人及权利义务</b>	
一、基金管理人 (一) 基金管理人简况 住所: <del>上海浦东新区</del> 民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 <del>(200135)</del> 法定代表人: <b>齐亮</b> 二、基金托管人 (一) 基金托管人简况 住所: 中国江苏省南京市 <b>洪武北路 55 号</b> <del>(邮编 210005)</del> 注册资本: <b>103.9 亿</b>	一、基金管理人 (一) 基金管理人简况 住所: <u>中国(上海)自由贸易试验区</u> 民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 法定代表人: <b>贾波</b> 二、基金托管人 (一) 基金托管人简况 住所: 中国江苏省南京市 <u>中华路 26 号</u> 注册资本: <u>115.4 亿</u>
<b>第十二部分 基金的投资</b>	
四、投资限制 1、本基金不得投资于以下金融工具:	四、投资限制 1、本基金不得投资于以下金融工具:

<p>.....</p>	<p>.....</p> <p><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></p>
<p>2、组合限制</p> <p>(8) 本基金投资于现金、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 10%；</p> <p>(6) 本基金存放在具有基金托管资格的同一商业银行的银行存款、同业存单，合计不得超过基金资产净值的 20%；存放在不具有基金托管资格的同一商业银行的银行存款、同业存单，合计不得超过基金资产净值的 5%；</p> <p>(7) 本基金投资于现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券占基金资产净值的比例合计不得低于 5%；</p> <p><del>(9) 本基金投资于到期日在 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%；</del></p> <p>(10) 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%，中国证监会规定的特殊品种除外；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，</p>	<p>2、组合限制</p> <p>(2) 本基金投资于现金、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 10%；</p> <p><u>(3) 根据本基金的基金份额持有人集中度情况，对上述第 (1)、(2) 项投资组合实施如下调整：</u></p> <p><u>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>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>(8) 本基金存放在具有基金托管资格的同一商业银行的银行存款、同业存单，合计不得超过基金资产净值的 20%；存放在不具有基金托管资格的同一商业银行的银行存款、同业存单，合计不得超过基金资产净值的 5%；<u>本基金管理人管理的全部货币市场基金投资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</u></p>

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；

业银行最近一个季度末净资产的 10%；

(9) 本基金投资于现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）、国债、中央银行票据、政策性金融债券占基金资产净值的比例合计不得低于 5%；

(10) 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%，中国证监会规定的特殊品种除外；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%；

(11) 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；

(12) 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；

(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>(16)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>
除上述第 <del>(10)</del> 项另有约定以及第 <del>(7)</del> 项外,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。	除上述第(1)、(9)、(11)、(12)、(16)项外,因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、 <u>基金份额持有人赎回</u> 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。
<b>第十四部分 基金资产估值</b>	
六、暂停估值的情形 无	六、暂停估值的情形 <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的,基金管理人应当暂停基金估值;</u>
<b>第十八部分 基金的信息披露</b>	
五、公开披露的基金信息 (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 .....	五、公开披露的基金信息 (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 ..... <u>本基金应当在年度报告、半年度报告中至少披露报告期末基金前10名基金份额持有人的类别、持有份额及占总份额的比例等信息。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>

	<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>
(六) 临时报告 无	(六) 临时报告 <u>29、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时;</u> <u>30、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>

注：基金合同内容摘要涉及上述内容的一并修改。

## 《华泰柏瑞天添宝货币市场基金托管协议》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>一、基金托管协议当事人</b>	
<p>(一) 基金管理人 住所：<del>上海浦东新区</del>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层<del>（200135）</del> 办公地址：<del>上海浦东新区</del>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层<del>（200135）</del> 法定代表人：<b>齐亮</b></p> <p>(二) 基金托管人 住所：中国江苏省南京市<del>洪武北路 55 号（邮编 210005）</del> 办公地址：中国江苏省南京市中华路 26 号<del>（邮编 210005）</del> 注册资本：<del>103.9</del> 亿</p>	<p>(一) 基金管理人 住所：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 办公地址：<u>中国（上海）自由贸易试验区</u>民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层 法定代表人：<u>贾波</u></p> <p>(二) 基金托管人 住所：中国江苏省南京市<u>中华路 26 号</u> 办公地址：中国江苏省南京市中华路 26 号 注册资本：<u>115.4</u> 亿</p>
<b>二、基金托管协议的依据、目的和原则</b>	
<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》）、《华泰柏瑞天添宝货币市场基金基金合同》（以下简称《基金合同》）及其他有关规定订立。</p>	<p>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》</u>、《华泰柏瑞天添宝货币市场基金基金合同》（以下简称《基金合同》）及其他有关规定订立。</p>
<b>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</b>	
<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>(一) 基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权</p>

<p>(2) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》和本协议的约定,对基金投资、融资比例进行监督。</p> <p>根据《基金合同》的约定,本基金投资组合比例应符合以下规定:</p> <p>1) 本基金不得投资于以下金融工具:</p> <p>.....</p>	<p>(2) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》和本协议的约定,对基金投资、融资比例进行监督。</p> <p>根据《基金合同》的约定,本基金投资组合比例应符合以下规定:</p> <p>1) 本基金不得投资于以下金融工具:</p> <p>.....</p> <p><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></p>
<p>2) 组合限制</p> <p>④ 本基金投资于现金、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 10%;</p> <p>⑥ 本基金存放在具有基金托管资格的同一商业银行的银行存款、同业存单,合计不得超过基金资产净值的 20%;存放在不具有基金托管资格的同一商业银行的银行存款、同业存单,合计不得超过基金资产净值的 5%;</p> <p>⑦ 本基金投资于现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券占基金资产净值的比例合计不得低于 5%;</p> <p>⑨ <del>本基金投资于到期日在 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%;</del></p> <p>⑩ 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%,中国证监会规定的特殊品种除外;本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,</p>	<p>2) 组合限制</p> <p>② 本基金投资于现金、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 10%;</p> <p>③ <u>根据本基金的基金份额持有人集中度情况,对上述第①、②项投资组合实施如下调整:</u></p> <p><u>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>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>⑧ 本基金存放在具有基金托管资格的同一商业银行的银行存款、同</p>

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；

除上述第⑩项另有约定以及第⑦项外，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。

业存单，合计不得超过基金资产净值的 20%；存放在不具有基金托管资格的同一家商业银行的银行存款、同业存单，合计不得超过基金资产净值的 5%；本基金管理人管理的全部货币市场基金投资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%；

⑨本基金投资于现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）、国债、中央银行票据、政策性金融债券占基金资产净值的比例合计不得低于 5%；

⑩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%，中国证监会规定的特殊品种除外；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%；

⑪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；

⑫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；

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



	<p><u>工具占基金资产净值的比例合计不得超过 2%；</u>  <u>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>  <u>⑯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>除上述第①、⑨、⑪、⑫、⑯项外，因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、<u>基金份额持有人赎回</u>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>八、基金资产净值计算和会计核算</b></p>	
<p>(三) 暂停估值与公告的情形 无</p>	<p>(三) 暂停估值与公告的情形 <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的，基金管理人应当暂停基金估值；</u></p>

## 《华泰柏瑞交易型货币市场基金基金合同》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>第一部分 前言</b>	
<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》”)……《货币市场基金监督管理办法》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》”)……《货币市场基金监督管理办法》、<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>
<b>第二部分 释义</b>	
无	<p>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</p> <p>50、<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)、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</p>
<b>第八部分 基金份额的申购与赎回</b>	
<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>无</p>	<p>七十九、申购和赎回的数量限制</p> <p><u>5、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，具体规定请参见招募说明书</u></p>

<p>八十、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>本基金通常情况下不收取申购费用和赎回费用，但在满足相关流动性风险管理要求的前提下，当本基金持有的现金、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%且偏离度为负时，为确保基金平稳运作，避免诱发系统性风险，基金管理人将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><u>或相关公告。</u></p> <p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>本基金通常情况下不收取申购费用和赎回费用，但<u>发生以下任一情形时除外：</u></p> <p><u>(1) 在满足相关流动性风险管理要求的前提下，当本基金持有的现金、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%且偏离度为负时，为确保基金平稳运作，避免诱发系统性风险，基金管理人将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。</u></p> <p><u>(2)如本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额 50%，当投资组合中现金、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%且偏离度为负时，基金管理人应当对当日单个基金份额持有人超过基金总份额 1%以上的赎回申请征收 1%的强制赎回费用。</u></p>
<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>(一) 发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的场内或场外申购申请：</p> <p>……</p> <p>发生上述第 1、2、3、<del>5</del>、6、7 项暂停申购情形且基金管理人决定暂停申购时……</p>	<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>(一) 发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的场内或场外申购申请：</p> <p>……</p> <p><u>5、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>

	发生上述第 1、2、3、6、7、8 项暂停申购情形且基金管理人决定暂停申购时……
无	<u>(三) 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>
八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 无	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 <u>(三) 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>
九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 ……	九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 …… <u>(3) 若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 10%, 基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出 10%的赎回申请实施延期办理。而对该单个基金份额持有人 10%以内 (含 10%) 的赎回申请, 基金管理人根据前述“ (1) 全额赎回” 或“ (2) 延缓支付赎回款项” 的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。如下一开放日, 该单一基金份额持有人剩余未赎回部分仍旧超出前述比例约定的, 继续按前述规则处理, 直至该单一基金份额持有人单个开放日内申请赎回的基金份额占上一开放日基金总份额的比例低于前述比例。A 类基金份额的巨额赎回依据注册登记机构和上海证券交易所的业务规则办理。</u>

第十四部分 基金的投资	
<p>四、投资限制</p> <p>1、本基金不得投资于以下金融工具： .....</p>	<p>四、投资限制</p> <p>1、本基金不得投资于以下金融工具： .....</p> <p><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></p>
<p>2、组合限制</p> <p>(8) 本基金投资于现金、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 10%；</p> <p>(6) 本基金投资于具有基金托管资格的同一商业银行的存款、同业存单，合计不得超过基金资产净值的 20%；投资于不具有基金托管资格的同一商业银行的银行存款、同业存单，合计不得超过基金资产净值的 5%；</p> <p>(7) 本基金投资于现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券占基金资产净值的比例合计不得低于 5%；</p> <p><del>(9) 本基金投资于到期日在 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%；</del></p> <p>(10) 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%，中国证监会规定的特殊品种除外；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</p>	<p>2、组合限制</p> <p>(2) 本基金投资于现金、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 10%；</p> <p><u>(3) 根据本基金的基金份额持有人集中度情况，对上述第 (1)、(2) 项投资组合实施如下调整：</u></p> <p><u>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>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>(8) 本基金投资于具有基金托管资格的同一商业银行的存款、同业存单，合计不得超过基金资产净值的 20%；投资于不具有基金托</p>

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%；本基金投资的资产支持证券须具有评级资质的资信评级机构进行持续信用评级，且其信用评级应不低于国内信用评级机构评定的 AAA 级或相当于 AAA 级的信用级别。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；

管资格的同一商业银行的银行存款、同业存单，合计不得超过基金资产净值的 5%；本基金管理人管理的全部货币市场基金投资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%；

(9) 本基金投资于现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）、国债、中央银行票据、政策性金融债券占基金资产净值的比例合计不得低于 5%；

(10) 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%，中国证监会规定的特殊品种除外；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%；

(11) 本基金投资的资产支持证券须具有评级资质的资信评级机构进行持续信用评级，且其信用评级应不低于国内信用评级机构评定的 AAA 级或相当于 AAA 级的信用级别。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

(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；

(14) 本基金投资于主体信用评级低于 AAA 的机构发行的金融工

	<p><u>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%；</u></p> <p><u>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>(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></p>
除上述第(10)、(11)项另有约定以及第(7)项外，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。法律法规另有规定时，从其规定。	除上述第(1)、(9)、(11)、(12)、(13)、(17)项外，因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、 <u>基金份额持有人赎回</u> 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。法律法规另有规定时，从其规定。
<b>第十六部分 基金资产估值</b>	
六、暂停估值的情形 无	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一致的，基金管理人应当暂停基金估值；</u>
<b>第二十部分 基金的信息披露</b>	
五、公开披露的基金信息 (七)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 (七)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 ..... <u>本基金应当在年度报告、半年度报告中至少披露报告期末基金前 10 名基金份额持有人的类别、持有份额及占总份额的比例等信息。</u>

	<p><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></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>（八）临时报告 无</p>	<p>（八）临时报告</p> <p><u>29、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时；</u></p> <p><u>30、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></p>

注：基金合同内容摘要涉及上述内容的一并修改。



## 《华泰柏瑞交易型货币市场基金托管协议》条款修改对照表

修改前	修改后
<b>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</b>	
<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。</p> <p>(1) 本基金不得投资于以下金融工具: .....</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。</p> <p>(1) 本基金不得投资于以下金融工具: .....</p> <p><b><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></b></p>
<p>(2) 基金托管人按下述比例和调整期限进行监督:</p> <p><b>8)</b> 本基金投资于现金、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 10%;</p> <p><b>3)</b> 本基金投资于有固定期限银行存款的比例不得超过基金资产净值的 30%, 但投资于有存款期限, 根据协议可提前支取的银行存款不受上述比例限;</p> <p><b>6)</b> 本基金投资于具有基金托管资格的同一商业银行的存款、同业存单, 合计不得超过基金资产净值的 20%; 投资于不具有基金托管资格的同一商业银行的银行存款、同业存单, 合计不得超过基金资产净值的 5%;</p> <p><b>7)</b> 本基金投资于现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券占基金资产净值的比例合计不得低于 5%;</p>	<p>(2) 基金托管人按下述比例和调整期限进行监督:</p> <p><b>2)</b> 本基金投资于现金、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 10%;</p> <p><b>3) <u>根据本基金的基金份额持有人集中度情况, 对上述第 1)、2) 项投资组合实施如下调整:</u></b> <b><u>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></b> <b><u>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</u></b></p>

**9) 本基金投资于到期日在 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%；**

10) 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%，中国证监会规定的特殊品种除外；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%；本基金投资的资产支持证券须具有评级资质的资信评级机构进行持续信用评级，且其信用评级应不低于国内信用评级机构评定的 AAA 级或相当于 AAA 级的信用级别。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；

除上述第 ~~10)~~、~~11)~~ 项另有约定以及第 7) 项外，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。法律法规另有规定时，从其规定。

**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%；**

5) 本基金投资于有固定期限银行存款的比例不得超过基金资产净值的 30%，但投资于有存款期限，根据协议可提前支取的银行存款不受上述比例限制；

8) 本基金投资于具有基金托管资格的同一商业银行的存款、同业存单，合计不得超过基金资产净值的 20%；投资于不具有基金托管资格的同一商业银行的银行存款、同业存单，合计不得超过基金资产净值的 5%；**本基金管理人管理且由本基金托管人托管的全部货币市场基金投资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%；**

9) 本基金投资于现金（**不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等**）、国债、中央银行票据、政策性金融债券占基金资产净值的比例合计不得低于 5%；

10) 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%，中国证监会规定的特殊品种除外；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%；

11) 本基金投资的资产支持证券须具有评级资质的资信评级机构进行持续信用评级，且其信用评级应不低于国内信用评级机构评定的 AAA 级或相当于 AAA 级的信用级别。基金持有资产支持证券期间，

	<p>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><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基金资产净值的 10%；</u></p> <p><u>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>14) 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%；</u></p> <p><u>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>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></p> <p>除上述第 1)、9)、11)、12)、13)、17) 项外，因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、<u>基金份额持有人赎回</u>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。法律法规另有规定时，从其规定。</p>
<p><b>八、基金资产净值计算和会计核算</b></p>	
<p>(四) 暂停估值与公告基金资产净值、两类基金份额的每百份基金已实现收益和两类基金份额的七日年化收益率的情形</p>	<p>(四) 暂停估值与公告基金资产净值、两类基金份额的每百份基金已实现收益和两类基金份额的七日年化收益率的情形</p>

无	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的，基金管理人应当暂停基金估值；
---	--