

中海基金管理有限公司关于旗下三十一只基金修订基金合同及托管协议等法律文件的公告

鉴于中国证监会已于2017年8月31日发布了《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(证监会公告[2017]12号,以下简称“《流动性规定》”),且该《流动性规定》已于2017年10月1日起施行。故在2017年10月1日之前成立的产品法律文件的相关条款已不符合《流动性规定》的规定,需要根据上述法规修改。

经统计,中海基金管理有限公司(以下简称“本公司”或“本基金管理人”)已对旗下三十一只基金(具体信息见下文)根据《流动性规定》对基金合同等法律文件分别进行修改(具体请见附件对照表),前述修改已与各只基金的基金托管人协商一致,并已报监管机构备案。

三十一只基金的基本信息如下:

序号	基金名称	基金托管人
1	中海能源策略混合型证券投资基金	中国工商银行股份有限公司
2	中海稳健收益债券型证券投资基金	中国工商银行股份有限公司
3	中海量化策略混合型证券投资基金	中国工商银行股份有限公司
4	中海上证50指数增强型证券投资基金	中国工商银行股份有限公司
5	中海货币市场证券投资基金	中国工商银行股份有限公司
6	中海环保新能源主题灵活配置混合型证券投资基金	中国工商银行股份有限公司
7	中海增强收益债券型证券投资基金	中国工商银行股份有限公司
8	中海医疗保健主题股票型证券投资基金	中国工商银行股份有限公司
9	中海纯债债券型证券投资基金	中国工商银行股份有限公司
10	中海积极增利灵活配置混合型证券投资基金	中国工商银行股份有限公司
11	中海优势精选灵活配置混合型证券投资基金	中国工商银行股份有限公司
12	中海分红增利混合型证券投资基金	中国农业银行股份有限公司

13	中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金	中国农业银行股份有限公司
14	中海消费主题精选混合型证券投资基金	中国农业银行股份有限公司
15	中海可转换债券债券型证券投资基金	中国农业银行股份有限公司
16	中海积极收益灵活配置混合型证券投资基金	中国农业银行股份有限公司
17	中海惠祥分级债券型证券投资基金	中国农业银行股份有限公司
18	中海混改红利主题精选灵活配置混合型证券投资基金	中国农业银行股份有限公司
19	中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金	中国农业银行股份有限公司
20	中海魅力长三角灵活配置混合型证券投资基金	中国银行股份有限公司
21	中海添顺定期开放混合型证券投资基金	中国银行股份有限公司
22	中海优质成长证券投资基金	交通银行股份有限公司
23	中海惠利纯债分级债券型证券投资基金	招商银行股份有限公司
24	中海合鑫灵活配置混合型证券投资基金	招商银行股份有限公司
25	中海惠裕纯债债券型发起式证券投资基金(LOF)	招商银行股份有限公司
26	中海医药健康产业精选灵活配置混合型证券投资基金	上海浦东发展银行股份有限公司
27	中海策略精选灵活配置混合型证券投资基金	上海浦东发展银行股份有限公司
28	中海进取收益灵活配置混合型证券投资基金	平安银行股份有限公司
29	中海合嘉增强收益债券型证券投资基金	平安银行股份有限公司
30	中海中鑫灵活配置混合型证券投资基金	宁波银行股份有限公司
31	中海中证高铁产业指数分级证券投资基金	招商证券股份有限公司

本次法律文件的修改系因相应的法律法规发生变动而进行，不涉及基金份额持有人权利义务关系的变化，对原有基金份额持有人的利益无实质性不利影响，且本基金管理人已履行适当程序。

重要提示：

1、上述修改自本公告发布之日起生效，但为不影响原有基金份额持有人的利益，短期赎回费的条款将于2018年3月31日起正式实施，本

公司已于2018年3月24日发布了《中海基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金修改基金合同、托管协议并收取短期赎回费的提示性公告》。

2、本公司将在本公告发布当日，将修改后的基金合同和托管协议登载于本公司网站，招募说明书届时将在最新一期的版本中予以更新。

3、投资者可登录本公司网站（www.zhfund.com）或者拨打本公司客服电话（400-888-9788）获取相关信息。

特此公告。

附件：中海基金管理有限公司旗下三十一只基金基金合同和托管协议修订对照表

中海基金管理有限公司

2018年3月27日

中海能源策略混合型证券投资基金基金合同和托管协议修订对照表

一、基金合同修改前后文对照表

章节	修改前	修改后
第一部分 前言和 释义 前言	<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，规范中海能源策略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》、《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6号《基金合同的内容与格式》及其他有关规定，在平等自愿、诚实信用、充分保护基金投资者及相关当事人的合法权益的原则基础上，特订立《中海能源策略混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“本合同”或“《基金合同》”）。</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，规范中海能源策略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》、《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》）、<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>、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，在平等自愿、诚实信用、充分保护基金投资者及相关当事人的合法权益的原则基础上，特订立《中海能源策略混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“本合同”或“《基金合同》”）。</p>
第一部分 前言和 释义 前言		<p>新增： <u>本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超</u></p>

<p>第一部分 前言和 释义 释义</p>		<p>过 50%的除外。</p> <p>新增：</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> <p><u>摆动定价机制指当本基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待</u></p>
<p>第五部分 基金份额的申购与赎回 五、申购与赎回的数额限制</p>		<p>新增：</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</u></p>

		<u>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。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告。</u>
第五部分 基金份额的申购与赎回 六、申购费用和赎回费用	2、投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取，扣除用于市场推广、注册登记费和其他手续费后的余额归基金财产，赎回费归入基金财产的比例不得低于法律法规或中国证监会规定的比例下限。	2、投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取。 <u>其中对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费将全额计入基金财产；对持续持有期不少于 7 日的投资者收取的赎回费，</u> 扣除用于市场推广、注册登记费和其他手续费后的余额归基金财产，赎回费归入基金财产的比例不得低于法律法规或中国证监会规定的比例下限。
第五部分 基金份额的申购与赎回 六、申购费用和赎回费用	3、本基金申购费率最高不超过 5%，赎回费率最高不超过 5%。	3、本基金申购费率最高不超过 5%，赎回费率最高不超过 5%， <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。</u>
第五部分 基金份额的申购与赎回 六、申购费用和赎回费用		新增： <u>5、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，摆动定价机制的处理原则与操作规范参见法律法规和自律组织的规定，具体见基金管理人届时的相关公告。</u>
第五部分 基金份额的申购与赎回		新增： <u>6、基金管理人接受某笔或者某些申</u>

<p>九、拒绝或暂停申购的情形及处理方式</p>		<p><u>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>7、申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单个投资人单日或单笔申购金额上限的；</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，基金管理人应当暂停接受申购申请。</u></p>
<p>第五部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>九、拒绝或暂停申购的情形</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>发生上述情形之一的，申购款项将<u>相应</u>退还投资者。发生上述 1 到 4 项<u>及第 8 项</u>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>第五部分 基金份额的申购与赎回</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>除非出现如下情形，基金管理人不得拒绝接受或暂停基金份额持有人的赎回申请或者延缓支付赎回款项：</p>	<p>除非出现如下情形，基金管理人不得拒绝接受或暂停基金份额持有人的赎回申请或者延缓支付赎回款项：</p> <p>新增：</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，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受</u></p>

		<u>基金赎回申请；</u>
第五部分 基金份额的申购与赎回 十一、巨额赎回的情形及处理方式	2、巨额赎回的处理方式	2、巨额赎回的处理方式 新增： <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%，基金管理人有权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%）的赎回申请与其他投资者的赎回申请按前述条款处理，具体见招募说明书或相关公告。</u>
第十一部分 基金的投资 二、投资范围	本基金投资组合的资产配置：股票资产 30%—95%，债券资产(含短期融资券和资产证券化产品) 0%—65%，权证投资 0%—3%，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。	本基金投资组合的资产配置：股票资产 30%—95%，债券资产(含短期融资券和资产证券化产品) 0%—65%，权证投资 0%—3%，本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券， <u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</u>
第十一部分 基金的投资 五、投资限制 (二)、投资组合限制	2、本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；	2、本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%； <u>本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不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，</u>

		不得超过该上市公司可流通股票的 30%；
第十一部分 基金的投资 五、投资限制 （二）、投资组合限制	6、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；	6、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， 前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；
第十一部分 基金的投资 五、投资限制 （二）、投资组合限制		新增： 9、本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 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前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资； 10、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；
第十一部分 基金的投资 五、投资限制 （二）、投资组合限制	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。	除上述第 6、9、10 项另有规定外， 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。
第十三部分 基金资产估值		新增： 7、当本基金发生大额申购或赎回情

五、估值方法		形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。
第十三部分 基金资产估值 七、暂停估值的情形		新增： <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>
第十七部分 基金的信息披露 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	(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 新增： <u>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者利益，基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告文件中“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>
第十七部分 基金的信息披露 五、公开披露的基金	(七) 临时报告	(七) 临时报告 新增： <u>26、发生涉及基金申购、赎回事项</u>

信息		<u>调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；</u> <u>27、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；</u>
----	--	--

二、托管协议修改前后文对照表

章节	修改前	修改后
二、基金托管协议的依据、目的和原则	（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）》、《中海能源策略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》）、 <u>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</u> 、《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）》、《中海能源策略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。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查 （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 30%-95%，债券资产(含短期融资券和资产证券化产品) 0%-95%，权证投资 0%-3%，本基金保持不低于基金资产净值 5%的现	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 30%-95%，债券资产(含短期融资券和资产证券化产品) 0%-95%，权证投资 0%-3%，本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金

	金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金 80%以上的非现金基金资产投资于能源主题类股票、债券、权证等资产。	或者到期日在一年以内的政府债券， <u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u> 。本基金 80%以上的非现金基金资产投资于能源主题类股票、债券、权证等资产。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查 （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： （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本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；	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： （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本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%； <u>本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不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>
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查 （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： （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： ⑥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；	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： （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： ⑥本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券， <u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</u>

<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</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>(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>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：</p> <p>新增：</p> <p>⑨本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 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前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>⑩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；</p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</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>(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>.....</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</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>(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>.....</p> <p>除上述第⑥、⑨、⑩项另有规定外，</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</p>

	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。	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。
八、基金资产净值计算和会计核算 (二) 基金资产估值方法	2、估值方法	2、估值方法 新增： <u>(6) 当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。</u>
十、信息披露 (三) 暂停或延迟信息披露的情形		新增： <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后，基金管理人暂停基金估值的；</u>

中海稳健收益债券型证券投资基金基金合同和托管协议修订对照表

一、基金合同修改前后文对照表

章节	修改前	修改后
第一部分 前言和 释义 前言	<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，规范中海稳健收益债券型证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）运作，依照《中华人民共和国合同法》、《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6号《基金合同的内容与格式》及其他有关规定，在平等自愿、诚实信用、充分保护基金投资者及相关当事人的合法权益的原则基础上，特订立《中海稳健收益债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“本合同”或“《基金合同》”）。</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，规范中海稳健收益债券型证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）运作，依照《中华人民共和国合同法》、《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》）、<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>）、《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，在平等自愿、诚实信用、充分保护基金投资者及相关当事人的合法权益的原则基础上，特订立《中海稳健收益债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“本合同”或“《基金合同》”）。</p>
第一部分 前言和 释义 前言		<p>新增： <u>本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过</u></p>

		50%的除外。
第一部分 前言和 释义 释义		<p>新增：</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> <p><u>摆动定价机制指当本基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待</u></p>
第五部分 基金份额的申购与赎回 五、申购与赎回的数额限制		<p>新增：</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。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采</u></p>

		取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告。
第五部分 基金份额的申购与赎回 六、申购费用和赎回费用	2、投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取，扣除用于市场推广、注册登记费和其他手续费后的余额归基金财产，赎回费归入基金财产的比例不得低于法律法规或中国证监会规定的比例下限。	2、投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取。 <u>其中对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费将全额计入基金财产；对持续持有期不少于 7 日的投资者收取的赎回费</u> ，扣除用于市场推广、注册登记费和其他手续费后的余额归基金财产，赎回费归入基金财产的比例不得低于法律法规或中国证监会规定的比例下限。
第五部分 基金份额的申购与赎回 六、申购费用和赎回费用	3、本基金赎回费率最高不超过 5%。	3、本基金赎回费率最高不超过 5%， <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。</u>
第五部分 基金份额的申购与赎回 六、申购费用和赎回费用		新增： <u>5、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，摆动定价机制的处理原则与操作规范参见法律法规和自律组织的规定，具体见基金管理人届时的相关公告。</u>
第五部分 基金份额的申购与赎回 九、拒绝或暂停申购的情形及处理方式		新增： <u>(6) 基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有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><u>(7) 申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单个投资人单日或单笔申购金额上限的。</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，基金管理人应当暂停接受申购申请。</u></p>
<p>第五部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>九、拒绝或暂停申购的情形</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>发生上述情形之一的，申购款项将<u>相应</u>退还投资者。发生上述（1）到（4）项<u>及第8项</u>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>第五部分 基金份额的申购与赎回</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>除非出现如下情形，基金管理人不得拒绝接受或暂停基金份额持有人的赎回申请或者延缓支付赎回款项：</p>	<p>除非出现如下情形，基金管理人不得拒绝接受或暂停基金份额持有人的赎回申请或者延缓支付赎回款项：</p> <p>新增：</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，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请；</u></p>
<p>第五部分 基金份额的申购与赎回</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>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>新增：</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10%，基金管</u></p>

		<p><u>理人有权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%）的赎回申请与其他投资者的赎回申请按前述条款处理，具体见招募说明书或相关公告。</u></p>
<p>第十一部分 基金的投资 二、投资范围</p>	<p>本基金主要投资于固定收益类金融工具，包括国内依法公开发行、上市的国债、金融债、企业债、公司债、可转债、可分离债，以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金可以通过参与新股、可转债、可分离转债首发的投资方式来获取收益，提高基金收益水平。</p> <p>本基金投资组合的资产配置：债券资产(含短期融资券和资产证券化产品) 不低于基金资产的 80%，股票、权证类资产不超过基金资产的 20%，权证资产占基金资产净值的 0—3%。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。本基金 80%以上的基金资产投资于债券类金融工具。</p>	<p>本基金主要投资于固定收益类金融工具，包括国内依法公开发行、上市的国债、金融债、企业债、公司债、可转债、可分离债，以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金可以通过参与新股、可转债、可分离转债首发的投资方式来获取收益，提高基金收益水平。</p> <p>本基金投资组合的资产配置：债券资产(含短期融资券和资产证券化产品) 不低于基金资产的 80%，股票、权证类资产不超过基金资产的 20%，权证资产占基金资产净值的 0—3%。本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，<u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>。本基金 80%以上的基金资产投资于债券类金融工具。</p>
<p>第十一部分 基金的投资 五、投资限制</p>	<p>(二) 投资组合限制</p> <p>2、本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；</p>	<p>(二) 投资组合限制</p> <p>2、本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；<u>本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定</u></p>

		<p><u>期开放基金)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>第十一部分 基金的投资</p> <p>五、投资限制</p>	<p>(二) 投资组合限制</p> <p>5、现金和到期日不超过 1 年的政府债券不低于 5%。</p>	<p>(二) 投资组合限制</p> <p>5、现金和到期日不超过 1 年的政府债券不低于 5%，<u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</u></p>
<p>第十一部分 基金的投资</p> <p>五、投资限制</p>	<p>(二) 投资组合限制</p>	<p>(二) 投资组合限制</p> <p>新增：</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本基金资产净值的 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前款所规定比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u></p> <p><u>14、本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的,可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；</u></p>
<p>第十一部分 基金的投资</p> <p>五、投资限制</p>	<p>(二) 投资组合限制</p> <p>……</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</p>	<p>(二) 投资组合限制</p> <p>……</p> <p><u>除上述第 5、13、14 项另有规定外,</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</p>

	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。其中因交易品种存在锁定期的原因，当通过发行市场申购、可转债转股所形成的股票资产合计超过基金净值的 20%，基金管理人将在相关交易品种锁定期满后 10 个交易日内调整，以达到标准。法律法规、监管部门另有规定的从其规定。	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。其中因交易品种存在锁定期的原因，当通过发行市场申购、可转债转股所形成的股票资产合计超过基金净值的 20%，基金管理人将在相关交易品种锁定期满后 10 个交易日内调整，以达到标准。法律法规、监管部门另有规定的从其规定。
第十三部分 基金资产估值 五、估值方法		新增： <u>7、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。</u>
第十三部分 基金资产估值 七、暂停估值的情形		新增： <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>
第十七部分 基金的信息披露 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	（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 新增： <u>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者利益，基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告文件</u>

		中“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。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。
第十七部分 基金的信息披露 五、公开披露的基金信息	(七) 临时报告	(七) 临时报告 新增： 26、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时； 27、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；

二、托管协议修改前后文对照表

章节	修改前	修改后
二、基金托管协议的依据、目的和原则	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〉》、《中海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》）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》）、 <u>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</u> 、《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〉》、《中海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》）

		及其他有关规定。
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</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>本基金投资组合的资产配置：债券资产(含短期融资券和资产证券化产品) 不低于基金资产的 80%，股票、权证类资产不超过基金资产的 20%，权证资产占基金资产净值的 0—3%。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。本基金 80%以上的基金资产投资于债券类金融工具。</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>本基金投资组合的资产配置：债券资产(含短期融资券和资产证券化产品) 不低于基金资产的 80%，股票、权证类资产不超过基金资产的 20%，权证资产占基金资产净值的 0—3%。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，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金 80%以上的基金资产投资于债券类金融工具。</p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</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>(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、本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；</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>(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、本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管</p>

		<u>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>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</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>(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 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>(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 5%, <u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;</u></p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</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>(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>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:</p> <p>新增:</p> <p><u>m、本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 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前款所规定比例限制的, 基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;</u></p> <p><u>n、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</u></p>

		<u>的投资范围保持一致；</u>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</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>(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>.....</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。其中因交易品种存在锁定期的原因，当通过发行市场申购、可转债转股所形成的股票资产合计超过基金净值的 20%，基金管理人将在相关交易品种锁定期满后 10 个交易日内调整，以达到标准。法律法规、监管部门另有规定的从其规定。</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>(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>.....</p> <p><u>除上述第 e、m、n 项另有规定外，</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，以达到规定的投资比例限制要求。其中因交易品种存在锁定期的原因，当通过发行市场申购、可转债转股所形成的股票资产合计超过基金净值的 20%，基金管理人将在相关交易品种锁定期满后 10 个交易日内调整，以达到标准。法律法规、监管部门另有规定的从其规定。</p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</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>7、基金托管人对基金投资流通受限证券的监督</p> <p>(2) 流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购</p>	<p>7、基金托管人对基金投资流通受限证券的监督</p> <p>(2) 流通受限证券<u>与上文所述的流动性受限资产并不完全一致</u>，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停</p>

	交易中的质押券等流通受限证券。	牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。
八、基金资产净值计算和会计核算 (二) 基金资产估值方法	2、估值方法	2、估值方法 新增： <u>(7) 当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。</u>
十、信息披露 (三) 暂停或延迟信息披露的情形		新增： <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后，基金管理人暂停基金估值的；</u>

中海量化策略混合型证券投资基金基金合同和托管协议修订对照表

一、基金合同修改前后文对照表

章节	修改前	修改后
第一部分 前言和 释义 前言	<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，规范中海量化策略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》、《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6号《基金合同的内容与格式》及其他有关规定，在平等自愿、诚实信用、充分保护基金投资者及相关当事人的合法权益的原则基础上，特订立《中海量化策略混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“本合同”或“《基金合同》”）。</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，规范中海量化策略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》、《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》）、<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>、<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，在平等自愿、诚实信用、充分保护基金投资者及相关当事人的合法权益的原则基础上，特订立《中海量化策略混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“本合同”或“《基金合同》”）。</u></p>
第一部分 前言和 释义 前言		<p>新增：</p> <p><u>本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的除外。</u></p>

<p>第二部分 前言和 释义 释义</p>		<p>新增： <u>《流动性风险管理规定》 《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</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><u>摆动定价机制</u> 指当本基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待</p>
<p>第五部分 基金份额的申购与赎回 五、申购与赎回的数额限制</p>		<p>新增： <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。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采</u></p>

		取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告；
第五部分 基金份额的申购与赎回 六、申购费用和赎回费用	2、投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取，部分归入基金财产，其余用于市场推广、支付注册登记费和其他手续费，赎回费归入基金财产的比例不得低于法律法规或中国证监会规定的比例下限。	2、投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取。 <u>其中对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费将全额计入基金财产；对持续持有期不少于 7 日的投资者收取的赎回费</u> ，部分归入基金财产，其余用于市场推广、支付注册登记费和其他手续费，赎回费归入基金财产的比例不得低于法律法规或中国证监会规定的比例下限。
第五部分 基金份额的申购与赎回 六、申购费用和赎回费用	3、本基金申购费率最高不超过 5%，赎回费率最高不超过 5%。	3、本基金申购费率最高不超过 5%，赎回费率最高不超过 5%， <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。</u>
第五部分 基金份额的申购与赎回 六、申购费用和赎回费用		新增： <u>5、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，摆动定价机制的处理原则与操作规范参见法律法规和自律组织的规定，具体见基金管理人届时的相关公告。</u>
第五部分 基金份额的申购与赎回 九、拒绝或暂停申购的情形及处理方式		新增： <u>(7) 基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有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><u>(8) 申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单个投资人单日或单笔申购金额上限的；</u></p> <p><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，基金管理人应当暂停接受申购申请。</u></p>
<p>第五部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>九、拒绝或暂停申购的情形拒绝或暂停申购的情形</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，基金管理人应当在指定媒体刊登暂停申购公告。</p>	<p>发生上述情形之一的，申购款项将<u>相应</u>退还投资者。发生上述（1）到（5）项<u>以及第（9）项</u>暂停申购情形时，基金管理人应当在指定媒体刊登暂停申购公告。</p>
<p>第五部分 基金份额的申购与赎回</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>新增：</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，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请；</u></p>
<p>第五部分 基金份额的申购与赎回</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>新增：</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10%，基金管理人有权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%）的赎回申请与其</u></p>

		<u>他投资者的赎回申请按前述条款处理，具体见招募说明书或相关公告。</u>
第十一部分 基金的投资 二、投资范围	本基金投资组合的资产配置：股票资产的比例为基金资产的 60%—95%，债券资产(含短期融资券和资产证券化产品) 为基金资产的 0%—40%，权证投资的比例为基金资产净值的 0%—3%，本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。	本基金投资组合的资产配置：股票资产的比例为基金资产的 60%—95%，债券资产(含短期融资券和资产证券化产品) 为基金资产的 0%—40%，权证投资的比例为基金资产净值的 0%—3%，本基金持有的现金或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>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</u>
第十一部分 基金的投资 五、投资限制	(二) 投资组合限制 本基金的投资组合将遵循以下限制： 2、本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；	(二) 投资组合限制 本基金的投资组合将遵循以下限制： 2、本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券，不得超过该证券的 10%； <u>本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不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>
第十一部分 基金的投资 五、投资限制	(二) 投资组合限制 本基金的投资组合将遵循以下限制： 5、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%；	(二) 投资组合限制 本基金的投资组合将遵循以下限制： 5、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%， <u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</u>

<p>第十一部分 基金的投资</p> <p>五、投资限制</p>	<p>(二) 投资组合限制</p> <p>本基金的投资组合将遵循以下限制:</p>	<p>(二) 投资组合限制</p> <p>本基金的投资组合将遵循以下限制:</p> <p>新增:</p> <p>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本基金资产净值的 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前款所规定比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;</p> <p>13、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;</p>
<p>第十一部分 基金的投资</p> <p>五、投资限制</p>	<p>(二) 投资组合限制</p> <p>本基金的投资组合将遵循以下限制:</p> <p>.....</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>(二) 投资组合限制</p> <p>本基金的投资组合将遵循以下限制:</p> <p>.....</p> <p>除上述第 5、6、12、13 项另有规定外,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>第十三部分 基金资产估值</p> <p>五、估值方法</p>		<p>新增:</p> <p>7、当本基金发生大额申购或赎回情形时,基金管理人可以在履行适当程</p>

		序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。
第十三部分 基金资产估值 七、暂停估值的情形		新增： 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；
第十七部分 基金的信息披露 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	(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 新增： 报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者利益，基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告文件中“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。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。
第十七部分 基金的信息披露 五、公开披露的基金信息	(七) 临时报告	(七) 临时报告 新增： 26、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；

		27、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；
--	--	------------------------------

二、托管协议修改前后文对照表

章节	修改前	修改后
二、基金托管协议的依据、目的、原则	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〉》、《中海量化策略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》）、 《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》 、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第7号〈托管协议的内容与格式〉》、《中海量化策略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。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查 (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： 本基金投资组合的资产配置：股票资产的比例为基金资产的60%—95%，债券资产(含短期融资券和资产证券化产品)为基金资产的0%—40%，权证投资的比例为基金资	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： 本基金投资组合的资产配置：股票资产的比例为基金资产的60%—95%，债券资产(含短期融资券和资产证券化产品)为基金资产的0%—40%，权证投资的比例为基金资产净值的0%

	产净值的 0%—3%，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。	—3%，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%， <u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</u>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</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>(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、本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；</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>(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、本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；<u>本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不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>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</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>(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、现金或到期日不超过 1 年的政府债券不低于基金资产净值的 5%；</p>	<p>2、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：</p> <p>e、现金或到期日不超过 1 年的政府债券不低于基金资产净值的 5%，<u>前述现金不包括结算备付金、存出保证</u></p>

	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。	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。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查 （一）基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权	7、基金托管人对基金投资流通受限证券的监督 （2）流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。	7、基金托管人对基金投资流通受限证券的监督 （2）流通受限证券 <u>与上文所述的流动性受限资产并不完全一致</u> ，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。
八、基金资产净值计算和会计核算 （二）基金资产估值方法	2、估值方法	2、估值方法 新增： <u>（7）当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。</u>
十、信息披露 （三）暂停或延迟信息披露的情形		新增： <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后，基金管理人暂停基金估值的；</u>

中海上证 50 指数增强型证券投资基金基金合同和托管协议修订对照表
一、基金合同修改前后文对照表

章节	修改前	修改后
<p>第一部分 前言和 释义 前言</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，规范中海上证 50 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）运作，依照《中华人民共和国合同法》、《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 6 号《基金合同的内容与格式》及其他有关规定，在平等自愿、诚实信用、充分保护基金投资者及相关当事人的合法权益的原则基础上，特订立《中海上证 50 指数增强型证券投资基金基金合同》（以下简称“本合同”或“《基金合同》”）。</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，规范中海上证 50 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）运作，依照《中华人民共和国合同法》、《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》）、<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>、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，在平等自愿、诚实信用、充分保护基金投资者及相关当事人的合法权益的原则基础上，特订立《中海上证 50 指数增强型证券投资基金基金合同》（以下简称“本合同”或“《基金合同》”）。</p>
<p>第一部分 前言和 释义 前言</p>		<p>新增： <u>本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的 50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过</u></p>

		50%的除外。
第一部分 前言和 释义 释义		<p>新增：</p> <p><u>《流动性风险管理规定》 《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</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><u>摆动定价机制</u> 指当本基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待</p>
第五部分 基金份额的申购与赎回 五、申购与赎回的 数额限制		<p>新增：</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</u></p>

		<u>额持有人的合法权益。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要,可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告。</u>
第五部分 基金份额的申购与赎回 六、申购费用和赎回费用	2、基金份额持有人可将其持有的全部或部分基金份额赎回。本基金的赎回费用在基金份额持有人赎回本基金份额时收取,扣除用于市场推广、注册登记费和其他手续费后的余额归基金财产,赎回费归入基金财产的比例不得低于法律法规或中国证监会规定的比例下限。	2、基金份额持有人可将其持有的全部或部分基金份额赎回。本基金的赎回费用在基金份额持有人赎回本基金份额时收取。 <u>其中对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费将全额计入基金财产;对持续持有期不少于 7 日的投资者收取的赎回费</u> ,扣除用于市场推广、注册登记费和其他手续费后的余额归基金财产,赎回费归入基金财产的比例不得低于法律法规或中国证监会规定的比例下限。
第五部分 基金份额的申购与赎回 六、申购费用和赎回费用	3、本基金申购费率最高不超过 5%,赎回费率最高不超过 5%。	3、本基金申购费率最高不超过 5%,赎回费率最高不超过 5%, <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。</u>
第五部分 基金份额的申购与赎回 六、申购费用和赎回费用		新增: <u>6、当本基金发生大额申购或赎回情形时,基金管理人可以在履行适当程序后,采用摆动定价机制,以确保基金估值的公平性,摆动定价机制的处理原则与操作规范参见法律法规和自律组织的规定,具体见基金管理人届时的相关公告。</u>
第五部分 基金份额的申购与赎回 九、拒绝或暂停申购的情形及处理方		新增: <u>(6) 基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过</u>

式		<p><u>50%，或者变相规避 50%集中度的情形时。</u></p> <p><u>(7) 申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单个投资人单日或单笔申购金额上限的。</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，基金管理人应当暂停接受申购申请。</u></p>
<p>第五部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>九、拒绝或暂停申购的情形</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，基金管理人应当在指定媒体刊登暂停申购公告。</p>	<p>发生上述情形之一的，申购款项将<u>相应</u>退还投资者。发生上述（1）到（4）项<u>及第（8）项</u>暂停申购情形时，基金管理人应当在指定媒体刊登暂停申购公告。</p>
<p>第五部分 基金份额的申购与赎回</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>若出现如下情形时，基金管理人可以拒绝接受或暂停基金份额持有人的赎回申请或者延缓支付赎回款项：</p>	<p>若出现如下情形时，基金管理人可以拒绝接受或暂停基金份额持有人的赎回申请或者延缓支付赎回款项：</p> <p>新增：</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，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请；</u></p>
<p>第五部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>十一、巨额赎回的</p>	<p>2、巨额赎回的处理方式</p>	<p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>新增：</p> <p><u>(3) 若本基金发生巨额赎回且单个</u></p>

情形及处理方式		<u>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%，基金管理人有权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%）的赎回申请与其他投资者的赎回申请按前述条款处理，具体见招募说明书或相关公告。</u>
第十一部分 基金的投资 二、投资范围	本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 90%-95%，投资于上证 50 指数成份股、备选成份股的资产占基金资产的比例不低于 80%，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%。	本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 90%-95%，投资于上证 50 指数成份股、备选成份股的资产占基金资产的比例不低于 80%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%， <u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</u>
第十一部分 基金的投资 五、投资限制	（二）投资组合限制 本基金的投资组合将遵循以下限制： b、本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；	（二）投资组合限制 本基金的投资组合将遵循以下限制： b、本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%； <u>本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家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%；本基金指数化投资部分不受本条限制；</u>
第十一部分 基金	（二）投资组合限制	（二）投资组合限制

<p>的投资</p> <p>五、投资限制</p>	<p>本基金的投资组合将遵循以下限制：</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>本基金的投资组合将遵循以下限制：</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%；<u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</u></p>
<p>第十一部分 基金的投资</p> <p>五、投资限制</p>	<p>（二）投资组合限制</p> <p>本基金的投资组合将遵循以下限制：</p>	<p>（二）投资组合限制</p> <p>本基金的投资组合将遵循以下限制： 新增：</p> <p><u>j、本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 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前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u></p> <p><u>k、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>第十一部分 基金的投资</p> <p>五、投资限制</p>	<p>（二）投资组合限制</p> <p>本基金的投资组合将遵循以下限制：</p> <p>……</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 个工作日内进行调整，以达到标准。法律法规另有规</p>	<p>（二）投资组合限制</p> <p>本基金的投资组合将遵循以下限制：</p> <p>……</p> <p><u>除上述第 e、j、k 项外，</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 个工作日内进行调整，以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。</p>

	定的从其规定。	
第十三部分 基金 资产估值 五、估值方法		新增： <u>7、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。</u>
第十三部分 基金 资产估值 七、暂停估值的情形		新增： <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>
第十七部分 基金 的信息披露 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	(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 新增： <u>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者利益，基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告文件中“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。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>
第十七部分 基金	(七) 临时报告	(七) 临时报告

<p>的信息披露</p> <p>五、公开披露的基金信息</p>		<p>新增：</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时；</u></p> <p><u>27、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；</u></p>
---------------------------------	--	---

二、托管协议修改前后文对照表

章节	修改前	修改后
<p>二、基金托管协议的依据、目的和原则</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〉》、《中海上证50指数增强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》）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）、<u>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</u>、《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〉》、《中海上证50指数增强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>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</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>本基金投资于股票资产占基金资产的比例为90%-95%，投资于上证50</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>本基金投资于股票资产占基金资产的比例为90%-95%，投资于上证50</p>

	指数成份股、备选成份股的资产占基金资产的比例不低于 80%，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%。	指数成份股、备选成份股的资产占基金资产的比例不低于 80%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%， <u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</u>
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查 (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： (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： b、本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；	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： (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： b、本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%； <u>本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不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%；本基金指数化投资部分不受本条限制；</u>
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查 (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： (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： 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%；	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： (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： 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%； <u>前</u>

		<u>述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</u>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</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>(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>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：</p> <p>新增：</p> <p><u>j、本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 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前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u></p> <p><u>k、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>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</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>(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>.....</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</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>(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>.....</p> <p><u>除上述第 e、j、k 项外，</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</p>

	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，以达到上述投资比例限制要求。法律法规另有规定的从其规定。	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，以达到上述投资比例限制要求。法律法规另有规定的从其规定。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查 （一）基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权	7、基金托管人对基金投资流通受限证券的监督 (2) 流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。	7、基金托管人对基金投资流通受限证券的监督 (2) <u>流通受限证券与上文所述的流动性受限资产并不完全一致</u> ，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。
八、基金资产净值计算和会计核算 （二）基金资产估值方法	2、估值方法	2、估值方法 新增： <u>(7) 当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。</u>
十、信息披露 （三）暂停或延迟信息披露的情形		新增： <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后，基金管理人暂停基金估值的；</u>

中海货币市场证券投资基金基金合同和托管协议修订对照表

一、基金合同修改前后文对照表

章节	修改前	修改后
第一部分 前言和释义 前言	<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，规范中海货币市场证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）运作，依照《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《货币市场基金监督管理办法》、《关于实施〈货币市场基金监督管理办法〉有关问题的规定》、《证券投资基金信息披露编报规则第 5 号〈货币市场基金信息披露特别规定〉》（以下简称“《信息披露特别规定》”）、《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，在平等自愿、诚实信用、充分保护基金投资者及相关当事人的合法权益的原则基础上，特订立《中海货币市场证券投资基金基金合同》（以下简称“本合同”或“《基金合同》”）。</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，规范中海货币市场证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）运作，依照《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、<u>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</u>（以下简称“<u>《流动性风险管理规定》</u>”）、《货币市场基金监督管理办法》、《关于实施〈货币市场基金监督管理办法〉有关问题的规定》、《证券投资基金信息披露编报规则第 5 号〈货币市场基金信息披露特别规定〉》（以下简称“《信息披露特别规定》”）、《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，在平等自愿、诚实信用、充分保护基金投资者及相关当事人的合法权益的原则基础上，特订立《中海货币市场证券投资基金基金合同》（以下简称“本合同”或“《基金合</p>

		同》”）。
第一部分 前言和 释义 前言		<p>新增：</p> <p><u>本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的除外。</u></p>
第一部分 前言和 释义 释义		<p>新增：</p> <p><u>《流动性风险管理规定》 《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）、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>
第六部分 基金份额的申购与赎回 五、申购和赎回的数额限制		<p>新增：</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。具体请参见相关规定；</u></p>
第六部分 基金份额的申购与赎回	本基金在一般情况下不收取申购费用和赎回费用，但当基金持有的现	本基金在一般情况下不收取申购费用和赎回费用，但出现以下情形之

<p>六、申购费用和赎回费用</p>	<p>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，……</p>	<p>一： <u>(1) 在满足相关流动性风险管理要求的前提下</u>，当基金持有的现金、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； 新增： <u>(2) 当本基金前 10 名基金份额持有人的持有份额合计超过基金总份额 50%，且本基金投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计低于 10%且偏离度为负时；</u></p>
<p>第六部分 基金份额的申购与赎回 九、拒绝或暂停申购的情形及处理方式</p>		<p>新增： <u>(7) 基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有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>(8) 申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单个投资人单日或单笔申购金额上限的；</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，基金管理人应当暂停接受投资人的申购申请。</u></p>

<p>第六部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>九、拒绝或暂停申购的情形及处理方式</p>	<p>发生上述情形之一的，基金管理人决定暂停申购的，申购款项将全额退还投资者。发生上述（1）到（7）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。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。</p>	<p>发生上述情形之一的，基金管理人决定暂停申购的，申购款项将全额退还投资者。发生上述（1）到<u>（6）、（9）、（10）</u>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。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。</p>
<p>第六部分 基金份额的申购与赎回</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>出现如下情形时，基金管理人可以拒绝接受或暂停基金份额持有人的赎回申请或者延缓支付赎回款项：</p>	<p>出现如下情形时，基金管理人可以拒绝接受或暂停基金份额持有人的赎回申请或者延缓支付赎回款项：</p> <p>新增：</p> <p><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，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请；</u></p>
<p>第六部分 基金份额的申购与赎回</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>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>新增：</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10%，基金管理人有权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%）的赎回申请与其他投资者的赎回申请按前述条款处理，具体见招募说明书或相关公告。</u></p>
<p>第十二部分 基金</p>	<p>（二）投资组合限制</p>	<p>（二）投资组合限制</p>

<p>的投资</p> <p>五、投资限制</p>	<p>2、本基金的投资组合将遵循以下比例限制：</p> <p>（1）本基金投资组合的平均剩余期限不得超过 120 天，平均剩余存续期不得超过 240 天；</p> <p>.....</p>	<p>2、本基金的投资组合将遵循以下比例限制：</p> <p><u>（1）当货币市场基金前10名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的50%时，货币市场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%；当货币市场基金前10名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的20%时，货币市场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>（2）本基金投资组合的平均剩余期限不得超过120天，平均剩余存续期不得超过240天，<u>但上述第（1）项另有约定的除外；</u></p> <p>.....</p> <p>新增：</p> <p><u>（4）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>.....</p> <p>(8) 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>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；且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>新增：</p> <p><u>(8) 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>.....</p> <p>(11) 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%，<u>但上述第 (1) 项另有约定的除外；</u></p>
<p>第十二部分 基金的投资</p> <p>五、投资限制</p>	<p>(二) 投资组合限制</p> <p>2、本基金的投资组合将遵循以下比例限制：</p>	<p>(二) 投资组合限制</p> <p>2、本基金的投资组合将遵循以下比例限制：</p> <p>新增：</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 10%，因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限</u></p>

		<p>制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</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>第十二部分 基金的投资</p> <p>五、投资限制</p>	<p>(二) 投资组合限制</p> <p>2、本基金的投资组合将遵循以下比例限制：</p> <p>.....</p> <p>由于市场波动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，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) 投资组合限制</p> <p>2、本基金的投资组合将遵循以下比例限制：</p> <p>.....</p> <p><u>除上述第 (2)、(10)、(13)、(16)、(17) 项另有规定外</u>，由于市场波动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，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>第十四部分 基金资产估值</p> <p>七、暂停估值的情形</p>		<p>新增：</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估值；</u></p>
<p>第十八部分 基金的信息披露</p> <p>五、公开披露的基金信息</p>	<p>(五) 基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告</p>	<p>(五) 基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告</p> <p>新增：</p>

		<p><u>基金管理人应在半年度报告、年度报告等文件中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。</u></p> <p><u>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 名份额持有人的类别、持有份额及占总份额的比例等信息。</u></p> <p><u>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>第十八部分 基金的信息披露</p> <p>五、公开披露的基金信息</p>	<p>(六) 临时报告</p> <p>26、当“摊余成本法”计算的基金资产净值与“影子定价”确定的基金资产净值的负偏离度绝对值达到 0.25% 或正负偏离度绝对值达到 0.5% 时的情形；</p>	<p>(六) 临时报告</p> <p>26、当“摊余成本法”计算的基金资产净值与“影子定价”确定的基金资产净值的正负偏离度绝对值达到 0.5% 时的情形；</p>
<p>第十八部分 基金的信息披露</p> <p>五、公开披露的基金信息</p>	<p>(六) 临时报告</p>	<p>(六) 临时报告</p> <p>新增：</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时；</u></p>
<p>第十八部分 基金的信息披露</p> <p>八、暂停或延迟信息披露的情形：</p>		<p>新增：</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</u></p>

		托管人协商一致后，基金管理人暂停估值的；
--	--	----------------------

二、托管协议修改前后文对照表

章节	修改前	修改后
二、基金托管协议的依据、目的和原则	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》）、《货币市场基金监督管理办法》、《关于实施〈货币市场基金监督管理办法〉有关问题的规定》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第7号〈托管协议的内容与格式〉》、《中海货币市场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》）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）、 <u>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</u> 、《货币市场基金监督管理办法》、《关于实施〈货币市场基金监督管理办法〉有关问题的规定》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第7号〈托管协议的内容与格式〉》、《中海货币市场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。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查 (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： (2)本基金的投资组合将遵循以下比例限制： 1) 本基金投资组合的平均剩余期限不得超过 120 天，平均剩余存续期不得超过 240 天；	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： (2)本基金的投资组合将遵循以下比例限制： <u>1) 当货币市场基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 50%时，货币市场基金投资组合的平均剩余期限不得超过 60 天，平均</u>

		<p><u>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%；当货币市场基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 20%时，货币市场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>2) 本基金投资组合的平均剩余期限不得超过 120 天，平均剩余存续期不得超过 240 天，<u>但上述第 1) 项另有约定的除外；</u></p> <p>新增：</p> <p>4) <u>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；且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的，应当经基金管理人</u></p>
--	--	---

	<p>.....</p> <p>8) 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>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><u>8) 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>.....</p> <p><u>11) 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%, 但上述第 1) 项另有约定的除外;</u></p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</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>(2)本基金的投资组合将遵循以下比例限制:</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>(2)本基金的投资组合将遵循以下比例限制:</p> <p>新增:</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 10%, 因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的, 基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;</u></p> <p><u>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</u></p>

		<u>的投资范围保持一致；</u>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</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>(2)本基金的投资组合将遵循以下比例限制：</p> <p>……</p> <p>由于市场波动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，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、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)本基金的投资组合将遵循以下比例限制：</p> <p>……</p> <p><u>除上述第 2)、10)、13)、16)、17) 项另有规定外</u>，由于市场波动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，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>十、信息披露</p> <p>(三) 暂停或延迟信息披露的情形</p>		<p>新增：</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后，基金管理人暂停估值的；</u></p>

中海环保新能源主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同和托管协议修订对照表

一、基金合同修改前后文对照表

章节	修改前	修改后
第一部分 前言和 释义 前言	<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，规范中海环保新能源主题灵活配置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》、《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6号《基金合同的内容与格式》及其他有关规定，在平等自愿、诚实信用、充分保护基金投资者及相关当事人的合法权益的原则基础上，特订立《中海环保新能源主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“本合同”或“《基金合同》”)。</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，规范中海环保新能源主题灵活配置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》、《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》)、<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>、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，在平等自愿、诚实信用、充分保护基金投资者及相关当事人的合法权益的原则基础上，特订立《中海环保新能源主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“本合同”或“《基金合同》”)。</p>
第一部分 前言和 释义 前言		<p>新增： <u>本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%，但在基金运作过程中因基金份</u></p>

		<p>额赎回等情形导致被动达到或超过50%的除外。</p>
<p>第一部分 前言和 释义 释义</p>		<p>新增：</p> <p><u>《流动性风险管理规定》 《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> <p><u>摆动定价机制 指当本基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待</u></p>
<p>第五部分 基金份额的申购与赎回 五、申购与赎回的数额限制</p>		<p>新增：</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</u></p>

		<u>金申购等措施,切实保护存量基金份额持有人的合法权益。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要,可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告。</u>
第五部分 基金份额的申购与赎回 六、申购费用和赎回费用	2、投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取,扣除用于市场推广、注册登记费和其他手续费后的余额归基金财产,赎回费归入基金财产的比例不得低于法律法规或中国证监会规定的比例下限。	2、投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取。 <u>其中对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费将全额计入基金财产;对持续持有期不少于 7 日的投资者收取的赎回费,</u> 扣除用于市场推广、注册登记费和其他手续费后的余额归基金财产,赎回费归入基金财产的比例不得低于法律法规或中国证监会规定的比例下限。
第五部分 基金份额的申购与赎回 六、申购费用和赎回费用	3、本基金申购费率最高不超过 5%,赎回费率最高不超过 5%。	3、本基金申购费率最高不超过 5%,赎回费率最高不超过 5%, <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。</u>
第五部分 基金份额的申购与赎回 六、申购费用和赎回费用		新增: <u>4、当本基金发生大额申购或赎回情形时,基金管理人可以在履行适当程序后,采用摆动定价机制,以确保基金估值的公平性,摆动定价机制的处理原则与操作规范参见法律法规和自律组织的规定,具体见基金管理人届时的相关公告。</u>
第五部分 基金份额的申购与赎回 九、拒绝或暂停申		新增: <u>(6) 基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持</u>

<p>购的情形及处理方式</p>		<p><u>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>(7) 申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单个投资人单日或单笔申购金额上限的。</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，基金管理人应当暂停接受申购申请。</u></p>
<p>第五部分 基金份额的申购与赎回 九、拒绝或暂停申购的情形</p>	<p>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（4）项暂停申购情形时，基金管理人应当按照《信息披露办法》在指定媒体刊登暂停申购公告。</p>	<p>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<u>相应</u>退还投资者。发生上述（1）到（4）项<u>以及第（8）项</u>暂停申购情形时，基金管理人应当按照《信息披露办法》在指定媒体刊登暂停申购公告。</p>
<p>第五部分 基金份额的申购与赎回 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>若出现如下情形时，基金管理人可以拒绝接受或暂停基金份额持有人的赎回申请或者延缓支付赎回款项：</p>	<p>若出现如下情形时，基金管理人可以拒绝接受或暂停基金份额持有人的赎回申请或者延缓支付赎回款项：</p> <p>新增：</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，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请；</u></p>

<p>第五部分 基金份额的申购与赎回</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>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>新增：</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 10%，基金管理人有权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%）的赎回申请与其他投资者的赎回申请按前述条款处理，具体见招募说明书或相关公告。</u></p>
<p>第十一部分 基金的投资</p> <p>二、投资范围</p>	<p>本基金投资组合的资产配置：股票资产占基金资产的 30%—80%，债券资产(含短期融资券和资产证券化产品) 占基金资产的 20%—70%，权证投资占基金资产净值的 0%—3%，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。本基金 80%以上的股票资产投资于环保与新能源主题类股票。</p>	<p>本基金投资组合的资产配置：股票资产占基金资产的 30%—80%，债券资产(含短期融资券和资产证券化产品) 占基金资产的 20%—70%，权证投资占基金资产净值的 0%—3%，本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，<u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>。本基金 80%以上的股票资产投资于环保与新能源主题类股票。</p>
<p>第十一部分 基金的投资</p> <p>五、投资限制</p>	<p>(二) 投资组合限制</p> <p>本基金的投资组合将遵循以下限制：</p> <p>b、本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的发行的证券，不得超过该证券的 10%；</p>	<p>(二) 投资组合限制</p> <p>本基金的投资组合将遵循以下限制：</p> <p>b、本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的发行的证券，不得超过该证券的 10%；<u>本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司</u></p>

		<u>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>
第十一部分 基金的投资 五、投资限制	(二) 投资组合限制 本基金的投资组合将遵循以下限制： e、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；	(二) 投资组合限制 本基金的投资组合将遵循以下限制： e、保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券， <u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</u>
第十一部分 基金的投资 五、投资限制	(二) 投资组合限制 本基金的投资组合将遵循以下限制：	(二) 投资组合限制 本基金的投资组合将遵循以下限制： 新增： <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本基金资产净值的 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前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u> <u>1、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>
第十一部分 基金的投资 五、投资限制	(二) 投资组合限制 本基金的投资组合将遵循以下限制： …… 由于证券市场波动、上市公司合并	(二) 投资组合限制 本基金的投资组合将遵循以下限制： …… <u>除上述第 e、i、k、l 项外，</u> 由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模

	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。	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。
第十三部分 基金 资产估值 五、估值方法		新增： <u>7、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。</u>
第十三部分 基金 资产估值 七、暂停估值的情形		新增： <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>
第十七部分 基金 的信息披露 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	(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 新增： <u>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者利益，基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告文件中“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>
第十七部分 基金的信息披露 五、公开披露的基金信息	(七) 临时报告	(七) 临时报告 新增: <u>26、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时;</u> <u>27、基金管理人采用摆动定价机制进行估值;</u>

二、托管协议修改前后文对照表

章节	修改前	修改后
二、基金托管协议的依据、目的和原则	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〉》、《中海环保新能源主题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。	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》)、 <u>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</u> 、《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〉》、《中海环保新能源主题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。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	2、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投融资比例进行监督:	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>(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) 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>本基金投资组合的资产配置: 股票资产占基金资产的 30%—80%, 债券资产(含短期融资券和资产证券化产品) 占基金资产的 20%—70%, 权证投资占基金资产净值的 0%—3%, 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。本基金 80%以上的股票资产投资于环保与新能源主题类股票。</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>本基金投资组合的资产配置: 股票资产占基金资产的 30%—80%, 债券资产(含短期融资券和资产证券化产品) 占基金资产的 20%—70%, 权证投资占基金资产净值的 0%—3%, 本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券, <u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>。本基金 80%以上的股票资产投资于环保与新能源主题类股票。</p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</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>(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、本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券, 不得超过该证券的 10%;</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>(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、本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券, 不得超过该证券的 10%; <u>本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票, 不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>三、基金托管人对</p>	<p>2、基金托管人根据有关法律法规的</p>	<p>2、基金托管人根据有关法律法规的</p>

<p>基金管理人的业务监督和核查</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>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：</p> <p>e、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>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：</p> <p>e、保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，<u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</u></p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</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>(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>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：</p> <p>新增：</p> <p><u>l、本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 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前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u></p> <p><u>m、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>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</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>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</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>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>(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>除上述第 e、i、l、m 项外, 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>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</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>7、基金托管人对基金投资流通受限证券的监督</p> <p>(2) 流通受限证券, 包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期可交易的证券, 不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>	<p>7、基金托管人对基金投资流通受限证券的监督</p> <p>(2) 流通受限证券与上文所述的流动性受限资产并不完全一致, 包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期可交易的证券, 不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>
<p>八、基金资产净值计算和会计核算</p> <p>(二) 基金资产估值方法</p>	<p>2、估值方法</p>	<p>2、估值方法</p> <p>新增:</p> <p>(7) 当本基金发生大额申购或赎回情形时, 基金管理人可以在履行适当程序后, 采用摆动定价机制, 以确保基金估值的公平性。</p>
<p>十、信息披露</p> <p>(三) 暂停或延迟信息披露的情形</p>		<p>新增:</p> <p>3、当前一估值日基金资产净值 50% 以上的资产出现无可参考的活跃市</p>

		<u>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后，基金管理人暂停基金估值的；</u>
--	--	--

		<p><u>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><u>摆动定价机制</u> 当本基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待</p>
<p>第五部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>五、申购与赎回的数额限制</p>		<p>新增：</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。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告。</u></p>
<p>第五部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>六、申购费用和赎回费用</p>	<p>3、投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取，扣除用于市场推广、注册登记费和</p>	<p>3、投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取。<u>其中对持续持有期少于 7 日的投资者收</u></p>

	其他手续费后的余额归基金财产，赎回费余额归入基金财产的比例不得低于法律法规或中国证监会规定的比例下限。	<u>取的赎回费将全额计入基金财产；对持续持有期不少于 7 日的投资者收取的赎回费</u> ，扣除用于市场推广、注册登记费和其他手续费后的余额归基金财产，赎回费余额归入基金财产的比例不得低于法律法规或中国证监会规定的比例下限。
第五部分 基金份额的申购与赎回 六、申购费用和赎回费用	4、本基金申购费率最高不超过 5%，赎回费率最高不超过 5%。	4、本基金申购费率最高不超过 5%，赎回费率最高不超过 5%， <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。</u>
第五部分 基金份额的申购与赎回 六、申购费用和赎回费用		新增： <u>6、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，摆动定价机制的处理原则与操作规范参见法律法规和自律组织的规定，具体见基金管理人届时的相关公告。</u>
第五部分 基金份额的申购与赎回 九、拒绝或暂停申购的情形及处理方式		新增： <u>(6) 基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有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>(7) 申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单个投资人单日或单笔申购金额上限的；</u> <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</u>

		<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，基金管理人应当暂停接受申购申请；</u>
第五部分 基金份额的申购与赎回 九、拒绝或暂停申购的情形	发生上述情形之一的，基金管理人决定暂停申购的，申购款项将全额退还投资者。发生上述（1）到（6）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。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。	发生上述情形之一的，基金管理人决定暂停申购的，申购款项将 <u>相应</u> 退还投资者。发生上述（1）到 <u>（5）项以及第（8）、（9）项</u> 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。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。
第五部分 基金份额的申购与赎回 十、暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式	出现如下情形，基金管理人可以拒绝接受或暂停基金份额持有人的赎回申请或者延缓支付赎回款项：	出现如下情形，基金管理人可以拒绝接受或暂停基金份额持有人的赎回申请或者延缓支付赎回款项： 新增： <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，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请；</u>
第五部分 基金份额的申购与赎回 十一、巨额赎回的情形及处理方式	2、巨额赎回的处理方式	2、巨额赎回的处理方式 新增： <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%，基金管理人有权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</u>

		<u>办理，而对该单个基金份额持有人10%以内（含10%）的赎回申请与其他投资者的赎回申请按前述条款处理，具体见招募说明书或相关公告。</u>
第十一部分 基金的投资 二、投资范围	本基金固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的80%，权益类资产的投资比例不高于基金资产的20%，持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。	本基金固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的80%，权益类资产的投资比例不高于基金资产的20%，持有的现金或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>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</u>
第十一部分 基金的投资 五、投资限制	（二）投资组合限制 本基金的投资组合将遵循以下限制： 2、本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的百分之十；	（二）投资组合限制 本基金的投资组合将遵循以下限制： 2、本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的百分之十； <u>本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不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>
第十一部分 基金的投资 五、投资限制	（二）投资组合限制 本基金的投资组合将遵循以下限制：	（二）投资组合限制 本基金的投资组合将遵循以下限制： 新增： <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本基金资产净值的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</u>

		<p><u>管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;</u></p> <p><u>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>第十一部分 基金的投资</p> <p>五、投资限制</p>	<p>(二) 投资组合限制</p> <p>本基金的投资组合将遵循以下限制:</p> <p>.....</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>(二) 投资组合限制</p> <p>本基金的投资组合将遵循以下限制:</p> <p>.....</p> <p><u>除上述第 8、10、11 项另有规定外,</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。法律法规另有规定的从其规定。</p>
<p>第十三部分 基金资产估值</p> <p>五、估值方法</p>		<p>新增:</p> <p><u>7、当本基金发生大额申购或赎回情形时,基金管理人可以在履行适当程序后,采用摆动定价机制,以确保基金估值的公平性。</u></p>
<p>第十三部分 基金资产估值</p> <p>七、暂停估值的情形</p>		<p>新增:</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</u></p>

		<u>暂停基金估值；</u>
第十七部分 基金的信息披露 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	（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 新增： <u>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额20%的情形，为保障其他投资者利益，基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告文件中“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。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>
第十七部分 基金的信息披露 五、公开披露的基金信息	（七）临时报告	（七）临时报告 新增： <u>26、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；</u> <u>27、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；</u>
第十七部分 基金的信息披露 八、暂停或延迟信息披露的情形		增加： <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后，基金管理人暂停</u>

		<u>基金估值的；</u>
--	--	---------------

二、托管协议修改前后文对照表

章节	修改前	修改后
二、基金托管协议的依据、目的和原则	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〉》、《中海增强收益债券型证券投资基金基金合同》（以下简称《基金合同》）及其他有关规定。	订立本协议的依据是《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》）、 <u>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</u> 、《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〉》、《中海增强收益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。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查 （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： 本基金固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的 80%，权益类资产的投资比例不高于基金资产的 20%，持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。	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： 本基金固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的 80%，权益类资产的投资比例不高于基金资产的 20%，持有的现金或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>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</u>

<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</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>(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、本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的百分之十；</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>(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、本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的百分之十；<u>本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不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>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</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>(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>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：</p> <p>新增：</p> <p><u>i、本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的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前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u></p>

		<u>k、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>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</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>(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>.....</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>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:</p> <p>.....</p> <p><u>除上述第 h、j、k 项另有规定外,</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>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</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>7、基金托管人对基金投资流通受限证券的监督</p> <p>(2) 流通受限证券, 包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券, 不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>	<p>7、基金托管人对基金投资流通受限证券的监督</p> <p>(2) 流通受限证券与上文所述的流动性受限资产并不完全一致, 包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券, 不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购</p>

		交易中的质押券等流通受限证券。
八、基金资产净值 计算和会计核算 (二) 基金资产估值方法	2、估值方法	2、估值方法 新增： <u>(7) 当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。</u>
十、信息披露 (三) 暂停或延迟信息披露的情形		新增： <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后，基金管理人暂停基金估值的；</u>

中海医疗保健主题股票型证券投资基金基金合同和托管协议修订对照表

一、基金合同修改前后文对照表

章节	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	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)和其他有关法律法规。	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、 <u>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)</u> 和其他有关法律法规。
第一部分 前言		新增： <u>六、本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的除外。</u>
第二部分 释义		新增： <u>12、《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日起实施的《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>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</u>

		<p>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>49、摆动定价机制：指当本基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待</p>
<p>第六部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>五、申购与赎回的数额限制</p>		<p>新增：</p> <p>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。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告。</p>
<p>第六部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>六、申购和赎回的价格、费用及其用</p>	<p>5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用应根据法律法规规定的比例归入基</p>	<p>5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用应根据法律法规规定的比例归入基金财</p>

途	金财产，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。	产，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。 <u>其中对于持续持有期少于 7 日的投资者收取不少于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产。</u>
第六部分 基金份额的申购与赎回 六、申购和赎回的价格、费用及其用途		新增： <u>7、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，摆动定价机制的处理原则与操作规范参见法律法规和自律组织的规定，具体见基金管理人届时的相关公告。</u>
第六部分 基金份额的申购与赎回 七、拒绝或暂停申购的情形		新增： <u>7、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有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>8、申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单个投资人单日或单笔申购金额上限的。</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，基金管理人应当暂停接受申购申请。</u>
第六部分 基金份额的申购与赎回 七、拒绝或暂停申购的情形	发生上述第 1、2、3、5、6、7 项之一的情形且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公	发生上述第 1、2、3、5、6、 9、10 项之一的情形且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公

	告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。	告。如果投资人的申购申请被 <u>全部或部分拒绝的</u> ，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。
第六部分 基金份额的申购与赎回 八、暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形	发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：	发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项： 新增： <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，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。</u>
第六部分 基金份额的申购与赎回 九、巨额赎回的情形及处理方式	2、巨额赎回的处理方式	2、巨额赎回的处理方式 新增： <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%，基金管理人有权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%）的赎回申请与其他投资者的赎回申请按前述条款处理，具体见招募说明书或相关公告。</u>
第十二部分 基金的投资 二、投资范围	基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的比例不低于基金资产的 80%，本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金	基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的比例不低于基金资产的 80%，本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资

	资产净值的 5%。本基金投资于医疗保健主题类证券的资产不低于非现金基金资产的 80%。	产净值的 5%， <u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</u> 本基金投资于医疗保健主题类证券的资产不低于非现金基金资产的 80%。
第十二部分 基金的投资 四、投资限制	（一）组合限制 本基金的投资组合将遵循以下限制： 2、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；	（一）组合限制 本基金的投资组合将遵循以下限制： 2、保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券， <u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</u>
第十二部分 基金的投资 四、投资限制	（一）组合限制 本基金的投资组合将遵循以下限制： 4、本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；	（一）组合限制 本基金的投资组合将遵循以下限制： 4、本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%； <u>本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家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>
第十二部分 基金的投资 四、投资限制	（一）组合限制 本基金的投资组合将遵循以下限制：	（一）组合限制 本基金的投资组合将遵循以下限制： 新增： <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本基金资产净值的 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</u>

		<p><u>管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;</u></p> <p><u>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>第十二部分 基金的投资</p> <p>四、投资限制</p>	<p>(一) 组合限制</p> <p>本基金的投资组合将遵循以下限制:</p> <p>.....</p> <p>因证券市场波动、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,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>(一) 组合限制</p> <p>本基金的投资组合将遵循以下限制:</p> <p>.....</p> <p><u>除上述第 2、12、16、17 项外,</u>因证券市场波动、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,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>第十四部分 基金资产估值</p> <p>三、估值方法</p>		<p>新增:</p> <p><u>7、当本基金发生大额申购或赎回情形时,基金管理人可以在履行适当程序后,采用摆动定价机制,以确保基金估值的公平性。</u></p>
<p>第十四部分 基金资产估值</p> <p>六、暂停估值的情形</p>		<p>新增:</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</u></p>

		<u>托管人协商一致的，基金管理人应当暂停基金估值；</u>
第十八部分 基金的信息披露 五、公开披露的基金信息	(四) 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	(四) 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 新增： <u>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额20%的情形，为保障其他投资者利益，基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告文件中“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。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>
第十八部分 基金的信息披露 五、公开披露的基金信息	(五) 临时报告	(五) 临时报告 新增： <u>25、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；</u> <u>26、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；</u>

二、托管协议修改前后文对照表

章节	修改前	修改后
(二) 基金托管协议的依据、目的和原	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	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

<p>则</p>	<p>“《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〉》、《中海医疗保健主题股票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>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>、《中海医疗保健主题股票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>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</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>本基金投资于股票的比例不低于基金资产的 80%，本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金投资于医疗保健主题类证券的资产不低于非现金基金资产的 80%。</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>本基金投资于股票的比例不低于基金资产的 80%，本基金持有的现金或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>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>。本基金投资于医疗保健主题类证券的资产不低于非现金基金资产的 80%。</p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p> <p>(一) 基金托管人</p>	<p>2) 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) 保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，<u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</u></p>

对基金管理人的投资行为行使监督权		
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</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>(2)</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>(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>4) 本基金管理人管理的且由本协议项下基金托管人托管的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；</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>(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>4) 本基金管理人管理的且由本协议项下基金托管人托管的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；<u>本基金管理人管理的且由本协议项下基金托管人托管的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家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由本协议项下基金托管人托管的全部投资组合持有一家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>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</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>(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>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：</p> <p>新增：</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本基金资产</u></p>

		<p><u>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前款所规定比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;</u></p> <p><u>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>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</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>(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>.....</p> <p>由于证券市场波动、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原因导致的投资比例不符合上述约定的比例,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。法律法规另有规定的,从其规定。</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>(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>.....</p> <p><u>除上述第 2)、12)、16)、17) 项外,</u></p> <p>由于证券市场波动、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原因导致的投资比例不符合上述约定的比例,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。法律法规另有规定的,从其规定。</p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p> <p>(一) 基金托管人</p>	<p>7、基金托管人对基金投资流通受限证券的监督</p> <p>(2) 流通受限证券,包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非</p>	<p>7、基金托管人对基金投资流通受限证券的监督</p> <p>(2) 流通受限证券<u>与上文所述的流动性受限资产并不完全一致</u>,包括由</p>

对基金管理人的投资行为行使监督权	公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。	《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。
八、基金资产净值计算和会计核算 (二) 基金资产估值方法 2、估值方法		<p>新增:</p> <p><u>(7) 当本基金发生大额申购或赎回情形时,基金管理人可以在履行适当程序后,采用摆动定价机制,以确保基金估值的公平性。</u></p>
十、信息披露 (三) 暂停或延迟信息披露的情形		<p>新增:</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后,基金管理人暂停基金估值的;</u></p>

中海纯债债券型证券投资基金基金合同和托管协议修订对照表
一、基金合同修改前后文对照表

章节	修改前	修改后
第一部分 前言	<p>2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)和其他有关法律法规。</p>	<p>2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、<u>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)</u>和其他有关法律法规。</p>
第二部分 释义		<p>新增：</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作出的修订</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</u></p>

		<p>等</p> <p><u>52、摆动定价机制：指当本基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待</u></p>
<p>第六部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>五、申购和赎回的数量限制</p>		<p>新增：</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。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告。</u></p>
<p>第六部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p>	<p>5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对于 A 类基金份额所收取的赎回费用不低于赎回费总额的 25%应归基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费；对于持有期限少于 30 日的 C 类基金份额所收取的赎回费用全额计入基金财产。</p>	<p>5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。<u>其中对持续持有期少于 7 日的 A 类基金份额收取不低于 1.5% 的赎回费并全额计入基金财产；对于持续持有期不少于 7 日的 A 类基金份额所收取的赎回费用不低于赎回费总额的 25%应归基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费；对于持有期限少于 30 日的 C 类基金份额所收取的赎回费用全额</u></p>

		计入基金财产。
<p>第六部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p>		<p>新增：</p> <p>7、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，摆动定价机制的处理原则与操作规范参见法律法规和自律组织的规定，具体见基金管理人届时的相关公告。</p>
<p>第六部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>七、拒绝或暂停申购的情形</p>		<p>新增：</p> <p>6、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有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。</p> <p>7、申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单个投资人单日或单笔申购金额上限的。</p> <p>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，基金管理人应当暂停接受申购申请。</p>
<p>第六部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>七、拒绝或暂停申购的情形</p>	<p>发生上述第 1、2、3、5、6 项暂停申购情形时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。</p>	<p>发生上述第 1、2、3、5、8、9 项暂停申购情形时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。</p>

<p>第六部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p>		<p>新增：</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，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。</u></p>
<p>第六部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>九、巨额赎回的情形及处理方式</p>	<p>2、巨额赎回的处理方式</p>	<p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>新增：</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 10%，基金管理人有权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%）的赎回申请与其他投资者的赎回申请按前述条款处理，具体见招募说明书或相关公告。</u></p>
<p>第十二部分 基金的投资</p> <p>二、投资范围</p>	<p>基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%，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>基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%，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%，<u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</u></p>
<p>第十二部分 基金的投资</p> <p>四、投资限制</p>	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>（2）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>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>（2）保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，<u>前述现金不包括结算备付</u></p>

		金、存出保证金、应收申购款等；
第十二部分 基金的投资 四、投资限制	四、投资限制 1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制：	四、投资限制 1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： 新增： <u>(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本基金资产净值的 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前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u> <u>(13)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>
第十二部分 基金的投资 四、投资限制	四、投资限制 1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： 因证券市场波动、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。	四、投资限制 1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： <u>除上述第（2）、（8）、（12）、（13）项外</u> ，因证券市场波动、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。
第十四部分 基金资产估值		新增： 6、当本基金发生大额申购或赎回情

三、估值方法		形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。
第十四部分 基金资产估值 六、暂停估值的情形		新增： <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>
第十八部分 基金的信息披露 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	(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 新增： <u>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者利益，基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告文件中“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。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>
第十八部分 基金的信息披露 五、公开披露的基金信息	(七) 临时报告	(七) 临时报告 新增： <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</u>

		<p>项时；</p> <p>29、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；</p>
--	--	--

二、托管协议修改前后文对照表

章节	修改前	修改后
二、基金托管协议的依据、目的、原则	<p>订立本协议的依据是《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《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〉》、《中海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>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〉》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》、《中海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>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</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>本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%，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>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>本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%，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%，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收</p>

		<u>申购款等。</u>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</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>(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>2) 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、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：</p> <p>2) 保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，<u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</u></p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</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>(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>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：</p> <p>新增：</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本基金资产净值的 15%。因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u></p> <p><u>14) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致。</u></p>
<p>三、基金托管人对</p>	<p>2、基金托管人根据有关法律法规的</p>	<p>2、基金托管人根据有关法律法规的</p>

<p>基金管理人的业务监督和核查</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>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：</p> <p>……</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>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：</p> <p>……</p> <p><u>除上述第(2)、(8)、(13)、(14)项外</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>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</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>6、基金托管人对基金投资流通受限证券的监督</p> <p>(2) 流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>	<p>6、基金托管人对基金投资流通受限证券的监督</p> <p>(2) 流通受限证券<u>与上文所述的流动性受限资产并不完全一致</u>，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>
<p>八、基金资产净值计算和会计核算</p> <p>(二) 基金资产估值方法</p>	<p>2、估值方法</p>	<p>2、估值方法</p> <p>新增：</p> <p><u>(8) 当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。</u></p>

<p>十、信息披露</p> <p>(三) 暂停或延迟信息披露的情形</p>		<p>新增：</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一致后，基金管理人暂停基金估值的；</u></p>
---------------------------------------	--	--

中海积极增利灵活配置混合型证券投资基金基金合同和托管协议修订对照表

一、基金合同修改前后文对照表

章节	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	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)和其他有关法律法规。	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、 <u>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</u> (以下简称“ <u>《流动性风险管理规定》</u> ”)和其他有关法律法规。
第一部分 前言		新增： <u>六、本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的除外。</u>
第二部分 释义		新增： <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日起实施的《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>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</u>

		<p>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>52、摆动定价机制：指当本基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待</p>
<p>第六部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>五、申购和赎回的数量限制</p>		<p>新增：</p> <p>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。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告。</p>
<p>第六部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>六、申购和赎回的价格、费用及其用</p>	<p>5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用应根据法律法规规定的比例归入基</p>	<p>5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用应根据法律法规规定的比例归入基金财</p>

途	金财产，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。	产，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。 <u>其中对于持续持有期少于 7 日的投资者收取不少于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产。</u>
第六部分 基金份额的申购与赎回 六、申购和赎回的价格、费用及其用途		新增： <u>7、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，摆动定价机制的处理原则与操作规范参见法律法规和自律组织的规定，具体见基金管理人届时的相关公告。</u>
第六部分 基金份额的申购与赎回 七、拒绝或暂停申购的情形		新增： <u>7、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有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>8、申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单个投资人单日或单笔申购金额上限的。</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，基金管理人应当暂停接受申购申请。</u>
第六部分 基金份额的申购与赎回 七、拒绝或暂停申购的情形	发生上述第 1、2、3、5、6、7 项之一的情形且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公	发生上述第 1、2、3、5、6、 9、10 项之一的情形且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公

	告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。	告。如果投资人的申购申请被 <u>全部或部分拒绝的</u> ，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。
第六部分 基金份额的申购与赎回 八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形	发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：	发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项： 新增： <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，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。</u>
第六部分 基金份额的申购与赎回 九、巨额赎回的情形及处理方式	2、巨额赎回的处理方式	2、巨额赎回的处理方式 新增： <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%，基金管理人有权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%）的赎回申请与其他投资者的赎回申请按前述条款处理，具体见招募说明书或相关公告。</u>
第十二部分 基金的投资 二、投资范围	基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的比例占基金资产的 0-95%，基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资	基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的比例占基金资产的 0-95%，基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值

	产净值的 5%。	的 5%， <u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</u>
第十二部分 基金的投资 四、投资限制	四、投资限制 1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： （2）保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券；	四、投资限制 1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： （2）保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券， <u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</u>
第十二部分 基金的投资 四、投资限制	四、投资限制 1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： （4）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；	四、投资限制 1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： （4）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%； <u>本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不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>
第十二部分 基金的投资 四、投资限制	四、投资限制 1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制：	四、投资限制 1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： 新增： <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本基金资产净值的 15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基</u>

		<p><u>金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;</u></p> <p><u>(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>第十二部分 基金的投资</p> <p>四、投资限制</p>	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制:</p> <p>.....</p> <p>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。</p>	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制:</p> <p>.....</p> <p><u>除上述第(2)、(12)、(16)、(17)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。</p>
<p>第十四部分 基金资产估值</p> <p>三、估值方法</p>		<p>新增:</p> <p><u>7、当本基金发生大额申购或赎回情形时,基金管理人可以在履行适当程序后,采用摆动定价机制,以确保基金估值的公平性。</u></p>
<p>第十四部分 基金资产估值</p> <p>六、暂停估值的情形</p>		<p>新增:</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</u></p>

		<u>暂停基金估值；</u>
第十八部分 基金的信息披露 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	(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 新增： <u>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额20%的情形，为保障其他投资者利益，基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告文件中“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。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>
第十八部分 基金的信息披露 五、公开披露的基金信息	(七) 临时报告	(七) 临时报告 新增： <u>26、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；</u> <u>27、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；</u>

二、托管协议修改前后文对照表

章节	修改前	修改后
二、基金托管协议的依据、目的和原则	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	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

	<p>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〉》、《中海积极增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>作管理办法》(以下简称《运作办法》)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称《销售办法》)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称《信息披露办法》)、<u>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</u>、《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〉》、《中海积极增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>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</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: 本基金投资于股票的比例占基金资产的 0-95%, 本基金持有的现金或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: 本基金投资于股票的比例占基金资产的 0-95%, 本基金持有的现金或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>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</u></p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</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>(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、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</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>(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、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>

	券；	券， <u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</u>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</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>(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>d、本基金管理人管理的且由基金托管人托管的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%；</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>(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>d、本基金管理人管理的且由基金托管人托管的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%； <u>本基金管理人管理的且由基金托管人托管的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不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>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</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>(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>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：</p> <p>新增：</p> <p><u>p、本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的15%。因证券市场波动、上市</u></p>

		<p><u>公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u></p> <p><u>q、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>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</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>（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>……</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>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：</p> <p>……</p> <p><u>除上述第 b、l、p、q 项外，</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>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p> <p>（一）基金托管人对基金管理人的投</p>	<p>6、基金托管人对基金投资流通受限证券的监督</p> <p>（2）流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下</p>	<p>6、基金托管人对基金投资流通受限证券的监督</p> <p>（2）流通受限证券<u>与上文所述的流动性受限资产并不完全一致</u>，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范</p>

<p>资行为行使监督权</p>	<p>配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>	<p>的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>
<p>八、基金资产净值计算和会计核算 (二) 基金资产估值方法和特殊情形的处理</p>	<p>2、估值方法</p>	<p>2、估值方法 新增： <u>(7) 当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。</u></p>
<p>十、信息披露 (三) 暂停估值与公告基金份额净值的情形</p>		<p>新增： <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后，基金管理人暂停基金估值的；</u></p>

中海优势精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同和托管协议修订对照表

一、基金合同修改前后文对照表

章节	修改前	修改后
第一部分 前言和 释义 前言	<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，规范中海优势精选灵活配置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》、《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 6 号《基金合同的内容与格式》及其他有关规定，在平等自愿、诚实信用、充分保护基金投资者及相关当事人的合法权益的原则基础上，特订立《中海优势精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“本合同”或“《基金合同》”）。</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，规范中海优势精选灵活配置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》、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）、<u>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</u>（以下简称<u>《流动性风险管理规定》</u>）、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，在平等自愿、诚实信用、充分保护基金投资者及相关当事人的合法权益的原则基础上，特订立《中海优势精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“本合同”或“《基金合同》”）。</p>
第一部分 前言和 释义 前言		<p>新增： <u>本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%，但在基金运作过程中因基金份</u></p>

		<p>额赎回等情形导致被动达到或超过50%的除外。</p>
<p>第一部分 前言和 释义 释义</p>		<p>新增：</p> <p><u>《流动性风险管理规定》 《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</u> 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><u>摆动定价机制</u> 当本基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待</p>
<p>第五部分 基金份额的申购与赎回 五、 申购与赎回的 数额限制</p>		<p>新增：</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</u></p>

		<u>额持有人的合法权益。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要,可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告;</u>
第五部分 基金份额的申购与赎回 六、申购费用和赎回费用	2、投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取,扣除用于市场推广、注册登记费和其他手续费后的余额归基金财产,赎回费归入基金财产的比例不得低于法律法规或中国证监会规定的比例下限。	2、投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取。 <u>其中对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费将全额计入基金财产;对持续持有期不少于 7 日的投资者收取的赎回费,</u> 扣除用于市场推广、注册登记费和其他手续费后的余额归基金财产,赎回费归入基金财产的比例不得低于法律法规或中国证监会规定的比例下限。
第五部分 基金份额的申购与赎回 六、申购费用和赎回费用	3、本基金申购费率最高不超过 5%,赎回费率最高不超过 5%。	3、本基金申购费率最高不超过 5%,赎回费率最高不超过 5%, <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。</u>
第五部分 基金份额的申购与赎回 六、申购费用和赎回费用		新增: <u>5、当本基金发生大额申购或赎回情形时,基金管理人可以在履行适当程序后,采用摆动定价机制,以确保基金估值的公平性,摆动定价机制的处理原则与操作规范参见法律法规和自律组织的规定,具体见基金管理人届时的相关公告。</u>
第五部分 基金份额的申购与赎回 九、拒绝或暂停申购的情形及处理方		新增: <u>(7) 基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过</u>

式		<p><u>50%，或者变相规避 50%集中度的情形时。</u></p> <p><u>(8) 申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单个投资人单日或单笔申购金额上限的。</u></p> <p><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，基金管理人应当暂停接受申购申请。</u></p>
<p>第五部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>九、拒绝或暂停申购的情形及处理方式</p>	<p>发生上述情形之一且的，申购款项将全额退还投资者。发生上述（1）到（5）项暂停申购情形且基金管理人决定暂停或拒绝基金投资者的申购申请时，基金管理人应当在至少一家指定媒介刊登暂停申购公告。</p>	<p>发生上述情形之一的，申购款项将<u>相应</u>退还投资者。发生上述（1）到（5）项<u>以及第（9）项</u>暂停申购情形且基金管理人决定暂停或拒绝基金投资者的申购申请时，基金管理人应当在至少一家指定媒介刊登暂停申购公告。</p>
<p>第五部分 基金份额的申购与赎回</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>除非出现如下情形，基金管理人不得拒绝接受或暂停基金份额持有人的赎回申请或者延缓支付赎回款项：</p>	<p>除非出现如下情形，基金管理人不得拒绝接受或暂停基金份额持有人的赎回申请或者延缓支付赎回款项：</p> <p>新增：</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，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请；</u></p>
<p>第五部分 基金份额</p>	<p>2、巨额赎回的处理方式</p>	<p>2、巨额赎回的处理方式</p>

<p>额的申购与赎回</p> <p>十一、巨额赎回的情形及处理方式</p>		<p>新增：</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 10%，基金管理人有权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%）的赎回申请与其他投资者的赎回申请按前述条款处理，具体见招募说明书或相关公告。</u></p>
<p>第十一部分 基金的投资</p> <p>二、投资范围</p>	<p>本基金投资组合的资产配置：股票资产占基金资产的 30%—80%，债券资产占基金资产的 20%—70%，权证投资占基金资产净值的 0%—3%，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>本基金投资组合的资产配置：股票资产占基金资产的 30%—80%，债券资产占基金资产的 20%—70%，权证投资占基金资产净值的 0%—3%，本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，<u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</u></p>
<p>第十一部分 基金的投资</p> <p>五、投资限制</p>	<p>(2) 投资组合限制</p> <p>本基金的投资组合将遵循以下限制：</p> <p>2) 本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；</p>	<p>(2) 投资组合限制</p> <p>本基金的投资组合将遵循以下限制：</p> <p>2) 本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；<u>本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不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>第十一部分 基金的投资</p> <p>五、投资限制</p>	<p>(2) 投资组合限制</p> <p>本基金的投资组合将遵循以下限制：</p> <p>5) 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) 投资组合限制</p> <p>本基金的投资组合将遵循以下限制：</p> <p>5) 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%，<u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</u></p>
<p>第十一部分 基金的投资</p> <p>五、投资限制</p>	<p>(2) 投资组合限制</p> <p>本基金的投资组合将遵循以下限制：</p>	<p>(2) 投资组合限制</p> <p>本基金的投资组合将遵循以下限制：</p> <p>新增：</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本基金资产净值的 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前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u></p> <p><u>14) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；</u></p>
<p>第十一部分 基金的投资</p> <p>五、投资限制</p>	<p>(2) 投资组合限制</p> <p>本基金的投资组合将遵循以下限制：</p> <p>……</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</p>	<p>(2) 投资组合限制</p> <p>本基金的投资组合将遵循以下限制：</p> <p>……</p> <p><u>除上述第 5)、6)、13)、14) 项另有规定外，</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</p>

	整，以达到标准，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。	调整，以达到标准，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的从其规定。
第十三部分 基金 资产估值 五、估值方法		新增： <u>7、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。</u>
第十三部分 基金 资产估值 七、暂停估值的情形		新增： <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>
第十七部分 基金 的信息披露 五、公开披露的基金信息	（四）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	（四）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 新增： <u>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者利益，基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告文件中“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。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</u>

		等。
第十七部分 基金的信息披露 五、公开披露的基金信息	(五) 临时报告	(五) 临时报告 新增： 25、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时； 26、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；

二、托管协议修改前后文对照表

章节	修改前	修改后
二、基金托管协议的依据、目的和原则	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〉》、《中海优势精选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。	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》）、 <u>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</u> 、《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〉》、《中海优势精选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。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查 (一) 基金托管人对基金管理人的投	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	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

<p>资行为行使监督权</p>	<p>置比例为： 股票资产占基金资产的 30%—80%， 债券资产占基金资产的 20%—70%， 权证投资占基金资产净值的 0%—3%， 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>比例为： 股票资产占基金资产的 30%—80%， 债券资产占基金资产的 20%—70%， 权证投资占基金资产净值的 0%—3%， 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，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查 (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： (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) 本基金与由本基金管理人管理且由本基金托管人托管的全部基金持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；</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： (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) 本基金与由本基金管理人管理且由本基金托管人托管的全部基金持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 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(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不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%；</p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查 (一) 基金托管人</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： (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</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： (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</p>

<p>对基金管理人的投资行为行使监督权</p>	<p>循以下投资限制： 5) 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>以下投资限制： 5) 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%，<u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</u></p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查 (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： (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>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： (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： 新增： <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本基金资产净值的 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前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u> <u>14) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；</u></p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查 (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： (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>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： (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>.....</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，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 5)、6)、13)、14) 项另有规定外</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，以达到规定的投资比例限制要求，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>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</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>6、基金托管人对基金投资流通受限证券的监督</p> <p>(2) 流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>	<p>6、基金托管人对基金投资流通受限证券的监督</p> <p>(2) 流通受限证券与上文所述的流动性受限资产并不完全一致，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>
<p>八、基金资产净值计算和会计核算</p> <p>(二) 基金资产估值方法</p>	<p>2、估值方法</p>	<p>2、估值方法</p> <p>新增:</p> <p><u>(7) 当本基金发生大额申购或赎回情形时, 基金管理人可以在履行适当程序后, 采用摆动定价机制, 以确保基金估值的公平性。</u></p>
<p>十、信息披露</p> <p>(三) 暂停或延迟基金净值信息披露的情形</p>		<p>新增:</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</u></p>

		<u>价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商一致后，基金管理人暂停基金估值的；</u>
--	--	---

中海分红增利混合型证券投资基金基金合同和托管协议修订对照表

一、基金合同修改前后对照表

章节	修改前	修改后
第一部分 前言和释义 前言	<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，规范基金运作，依照《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《证券投资基金法》”）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《基金运作管理办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露管理办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《基金销售管理办法》”）、2000年10月8日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）发布的《开放式证券投资基金试点办法》（以下简称“《试点办法》”）及其他有关规定，在平等自愿、诚实信用、充分保护基金投资者合法权益的原则基础上，特订立《中海分红增利混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“本合同”或“《基金合同》”）。</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，规范基金运作，依照《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《证券投资基金法》”）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《基金运作管理办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露管理办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《基金销售管理办法》”）、<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>”）及其他有关规定，在平等自愿、诚实信用、充分保护基金投资者合法权益的原则基础上，特订立《中海分红增利混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“本合同”或“《基金合同》”）。</p>
第一部分 前言和释义 前言		<p>新增： <u>本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的除外。</u></p>
第一部分 前言和释义 释义		<p>新增： <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作出的修订</u> <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、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等</u> <u>摆动定价机制：指当本基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，</u></p>

		确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待																		
第二部分 中海分红增利混合型证券投资基金基金基本情况 七、基金认购、申购和赎回费用	3、赎回费用 <table border="1" style="margin-left: 20px;"> <thead> <tr> <th>持有时间 Y</th> <th>费率</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>不满 1 年</td> <td>0.5%</td> </tr> <tr> <td>满 1 年不满 3 年</td> <td>0.3%</td> </tr> <tr> <td>满 3 年</td> <td>0</td> </tr> </tbody> </table>	持有时间 Y	费率	不满 1 年	0.5%	满 1 年不满 3 年	0.3%	满 3 年	0	3、赎回费用 <table border="1" style="margin-left: 20px;"> <thead> <tr> <th>持有时间 Y</th> <th>费率</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>不满 7 日</td> <td>1.5%</td> </tr> <tr> <td>满 7 日不满 1 年</td> <td>0.5%</td> </tr> <tr> <td>满 1 年不满 3 年</td> <td>0.3%</td> </tr> <tr> <td>满 3 年</td> <td>0</td> </tr> </tbody> </table>	持有时间 Y	费率	不满 7 日	1.5%	满 7 日不满 1 年	0.5%	满 1 年不满 3 年	0.3%	满 3 年	0
持有时间 Y	费率																			
不满 1 年	0.5%																			
满 1 年不满 3 年	0.3%																			
满 3 年	0																			
持有时间 Y	费率																			
不满 7 日	1.5%																			
满 7 日不满 1 年	0.5%																			
满 1 年不满 3 年	0.3%																			
满 3 年	0																			
第五部分 基金份额的申购和赎回 四、申购与赎回的程序		新增： 7、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告。																		
第五部分 基金份额的申购与赎回 六、申购和赎回的价格、费用及其用途	3、赎回的费用 赎回费用由赎回人承担。赎回费的 25% 归入基金财产，其余 75% 用于支付注册登记费和相关手续费。 4、本基金的申购费率最高不超过 1.7%、赎回费率最高不超过 0.5%。具体申购、赎回费率见招募说明书及有关公告。基金管理人可以依法调整申购费率、赎回费率，最新的申购费率、赎回费率最迟于新的费率开始实施前 3 个工作日在指定媒体上公告，并在定期更新的招募说明书中列示。费率如发生变更，基金管理人最迟将于新的费率开始实施前 2 个工作日在指定媒体上公告。	3、赎回的费用 赎回费用由赎回人承担。 其中，对于持续持有期少于 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；对于持续持有期不少于 7 日的投资者收取的赎回费， 赎回费的 25% 归入基金财产，其余 75% 用于支付注册登记费和相关手续费。 4、本基金的申购费率最高不超过 1.7%、赎回费率最高不超过 1.5% 。具体申购、赎回费率见招募说明书及有关公告。基金管理人可以依法调整申购费率、赎回费率，最新的申购费率、赎回费率最迟于新的费率开始实施前 3 个工作日在指定媒体上公告，并在定期更新的招募说明书中列示。费率如发生变更，基金管理人最迟将于新的费率开始实施前 2 个工作日在指定媒体上公告。																		
第五部分 基金份额的申购与赎回 六、申购和赎回的价格、费		新增： 5、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，摆动定价机制的处理原则与操作规范参见法律法规和自律组织的规定，具体见基金管理人届时的相关公告。																		

用及其用途		
第五部分 基金份额的申购与赎回 七、拒绝或暂停申购的情形	<p>.....</p> <p>发生上述 1 到 3 项暂停申购情形时，基金管理人应当在指定媒体上刊登暂停申购公告。</p>	<p>新增：</p> <p>3、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有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；</p> <p>4、申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单个投资人单日或单笔申购金额上限的；</p> <p>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，基金管理人应当暂停接受申购申请；</p> <p>.....</p> <p>发生上述 1、2、5、6 项暂停申购情形时，基金管理人应当在指定媒体上刊登暂停申购公告。</p>
第五部分 基金份额的申购与赎回 八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形	<p>如果出现如下情形，基金管理人可以拒绝接受或暂停基金投资者的赎回申请：</p> <p>.....</p>	<p>如果出现如下情形，基金管理人可以拒绝接受或暂停基金投资者的赎回申请：</p> <p>新增：</p> <p>3、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请；</p>
第五部分 基金份额的申购与赎回 九、巨额赎回的情形及处理方式	<p>2、巨额赎回的处理方式</p>	<p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>新增：</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 10%，基金管理人有权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%）的赎回申请与其他投资者的赎回申请按前述条款处理，具体见招募说明书或相关公告。</p>
第六部分 基金的转换 九、拒绝或暂停基金转换的情形及处理	<p>1、在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受全部或部分投资者的基金转换申请：</p>	<p>1、在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受全部或部分投资者的基金转换申请：</p> <p>新增：</p> <p>4) 当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停基金份额的转换</p>

<p>第十二部分 基金的投资 一、基金的投资</p>	<p>(四) 投资范围 投资范围为股票的投资比例为35%—95%；债券及现金的投资比例为5%—65%，其中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5%。</p>	<p><u>申请：</u> (四) 投资范围 投资范围为股票的投资比例为35%—95%；债券及现金的投资比例为5%—65%，其中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5%，<u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</u></p>
<p>第十二部分 基金的投资 一、基金的投资</p>	<p>(七) 投资限制 2、本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的10%； 3、基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不得超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；股票的投资比例为35%-95%；债券及现金的投资比例为5%-65%，其中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5%。 本基金建仓时间为基金合同生效之日起6个月内，建仓期完成后应达到上述比例限制。由于基金规模或市场的变化</p>	<p>(七) 投资限制 2、本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的10%；<u>本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不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> 3、基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不得超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量； 4、股票的投资比例为35%-95%；债券及现金的投资比例为5%-65%； <u>5、本基金保持的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值5%，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</u> <u>新增：</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本基金资产净值的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前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u> <u>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> 本基金建仓时间为基金合同生效之日起6个月内，建仓期完成后应达到上述比例限制。<u>除上述第5、7、8项外</u>，由于基金规模或市场的变化导致的投资组合超过上</p>

	导致的投资组合超过上述约定的比例不在限制之内，但基金管理人应在合理期限内进行调整，以达到标准。法律法规或监管部门对上述比例另有规定时从其规定。	述约定的比例不在限制之内，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，以达到标准，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规或监管部门对上述比例另有规定时从其规定。
第十四部分 基金资产的估值 (四) 估值方法		新增： <u>4、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。</u>
第十四部分 基金资产的估值 (七) 暂停估值的情形		新增： <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>
第十八部分 基金的信息披露 八、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		新增： <u>4、报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20%的情形，为保障其他投资者利益，基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告文件中“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>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>
第十八部分 基金的信息披露 九、临时报告和公告		新增： <u>26、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；</u> <u>27、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；</u>

二、托管协议修改前后对照表

章节	修改前	修改后
一、托管协议当事人	名称：中海基金管理有限公司 注册地址：上海市陆家嘴东路 166	名称：中海基金管理有限公司 注册地址：中国（上海）自由贸易试

<p>(一) 基金管理人: 中海基金管理有限公司</p>	<p>号中国保险大厦 34 楼 办公地址: 上海市陆家嘴东路 166 号中国保险大厦 34 楼 法定代表人: 华伟荣 成立时间: 2004 年 3 月 18 日 组织形式: 有限责任公司 注册资本: 1 亿元人民币 存续期间: 持续经营</p>	<p><u>验区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层</u> 办公地址: <u>上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层</u> 法定代表人: <u>杨皓鹏</u> 成立时间: 2004 年 3 月 18 日 组织形式: 有限责任公司(中外合资) 注册资本: <u>1.466667 亿元人民币</u> 存续期间: 持续经营</p>
<p>一、托管协议当事人 (一) 基金托管人</p>	<p>(二) 基金托管人: 农业银行 名称: 中国农业银行 注册地址: 北京市复兴路甲 23 号 办公地址: 北京市复兴路甲 23 号 法定代表人: 杨明生 成立时间: 1979 年 2 月 (恢复) 组织形式: 国有独资 注册资本: 1338.65 亿元人民币 存续期间: 持续经营 经营范围: 吸收人民币存款; 发放短期、中期和长期贷款; 办理结算; 办理票据贴现; 发行金融债券; 代理发行、代理兑付、承销政府债券; 买卖政府债券; 从事同业拆借; 提供信用证服务及担保; 代理收付款项及代理保险业务; 提供保管箱服务; 外汇存款; 外汇贷款; 外汇汇款; 结汇; 售汇; 发行和代理发行股票以外的外币有价证券; 买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券; 自营外汇买卖; 代理外汇买卖; 资信调查、咨询、见证业务; 组织或参加银团贷款; 国际贵金属买卖; 海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务; 经中国人民银行批准的其他业务。</p>	<p>(二) 基金托管人 名称: 中国农业银行股份有限公司 注册地址: <u>北京市东城区建国门内大街 69 号</u> 办公地址: <u>北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座九层</u> <u>邮政编码: 100031</u> 法定代表人: <u>周慕冰</u> 成立时间: <u>2009 年 1 月 15 日</u> <u>基金托管资格批准文号: 中国证监会证监基字[1998]23 号</u> 注册资本: <u>32,479,411.7 万元人民币</u> 存续期间: 持续经营 经营范围: <u>吸收公众存款; 发放短期、中期、长期贷款; 办理国内外结算; 办理票据承兑与贴现; 发行金融债券; 代理发行、代理兑付、承销政府债券; 买卖政府债券、金融债券; 从事同业拆借; 买卖、代理买卖外汇; 结汇、售汇; 从事银行卡业务; 提供信用证服务及担保; 代理收付款项及代理保险业务; 提供保管箱服务; 代理资金清算; 各类汇兑业务; 代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务; 贷款承诺; 组织或参加银团贷款; 外汇存款; 外汇贷款; 外汇汇款; 外汇借款; 发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券; 外汇票据承兑和贴现; 自营、代客外汇买卖; 外币兑换; 外汇担保; 资信调查、咨询、见证业务; 企业、个人财务顾问服务; 证券公司客户交易结算资金存管业务; 证券投资基金托管业务; 企业年金托管业务; 产业投资基金托管业务; 合格境外机构投资者境内证券投资托管业务; 代理开放式基金业务; 电话银行、手机银行、网上银行业务; 金融衍生产品交</u></p>

		易业务；经国务院银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务。
二、基金托管协议的依据、目的、原则和解释 (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》”)、《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》)、《中海分红增利混合型证券投资基金合同》(以下简称《基金合同》)及其它有关规定制定。	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》)、 《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》 、《中海分红增利混合型证券投资基金合同》(以下简称《基金合同》)及其它有关规定制定。
九、基金资产净值计算与会计核算 (二) 估值方法		新增： 4、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。
十二、信息披露 (三) 基金托管人和基金管理人在信息披露中的职责和信息披露程序	4、暂停公告净值的情形	4、暂停公告净值的情形 新增： (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后暂停基金估值的。

中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金合同和托管协议修订对照表

一、基金合同修改前后对照表

章节	修改前	修改后
一、 前言 (一) 订立本基金合同的目的、依据和原则	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《中华人民共和国合同法》、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)和其他有关法律法规。	2、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》”)、《中华人民共和国合同法》、《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》”)、 <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。
一、 前言		新增： <u>(五)、本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的 50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过 50%的除外。</u>
二、 释义		新增： <u>(十三) 《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 日起实施的《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><u>(五十五) 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><u>(五十六) 摆动定价机制：指当本基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待</u></p>
<p>六、基金份额的申购与赎回</p> <p>(五) 申购和赎回的金额</p>		<p>新增：</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。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告。</u></p>
<p>六、基金份额的申</p>	<p>5、本基金的申购费用应在投资人申</p>	<p>5、本基金的申购费用应在投资人申</p>

<p>购与赎回</p> <p>(六) 申购和赎回的价格、费用及其用途</p>	<p>购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，赎回费总额的 25%归基金财产，75%用于支付注册登记费和其他必要的手续费。</p>	<p>购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，<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；对于持续持有期不少于 7 日的投资者收取的赎回费</u>，赎回费总额的 25%归基金财产，75%用于支付注册登记费和其他必要的手续费。</p>
<p>六、基金份额的申购与赎回</p> <p>(六) 申购和赎回的价格、费用及其用途</p>		<p>新增：</p> <p><u>7、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，摆动定价机制的处理原则与操作规范参见法律法规和自律组织的规定，具体见基金管理人届时的相关公告。</u></p>
<p>六、基金份额的申购与赎回</p> <p>(七) 拒绝或暂停申购的情形</p>	<p>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>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>新增：</p> <p><u>6、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有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>7、申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单个投资人单日或单笔申购金额上限的。</u></p> <p><u>8、当前一估值日基金资产净值 50%</u></p>

	<p>.....</p> <p>发生上述暂停申购情形时,基金管理人应当根据有关规定在指定媒体和基金管理人网站上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝,被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时,基金管理人应及时恢复申购业务的办理。</p>	<p><u>以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时,经与基金托管人协商确认后,基金管理人应当暂停接受申购申请。</u></p> <p>.....</p> <p>发生上述暂停申购情形时<u>(第 6、7 项除外)</u>,基金管理人应当根据有关规定在指定媒体和基金管理人网站上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被<u>全部或部分拒绝的</u>,被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时,基金管理人应及时恢复申购业务的办理。</p>
<p>六、基金份额的申购与赎回</p> <p>(八) 暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p>	<p>发生下列情形时,基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项:</p> <p>.....</p>	<p>发生下列情形时,基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项:</p> <p>.....</p> <p>新增:</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,基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。</u></p>
<p>六、基金份额的申购与赎回</p> <p>(九) 巨额赎回的情形及处理方式</p>	<p>2、巨额赎回的处理方式</p>	<p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>新增:</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</u></p>

		<p><u>一开放日基金总份额的 10%，基金管理人有权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%）的赎回申请与其他投资者的赎回申请按前述条款处理，具体见招募说明书或相关公告。</u></p>
<p>七、基金合同当事人及权利义务 (一) 基金管理人</p>	<p>1、基金管理人简况</p> <p>住所：上海市浦东新区陆家嘴东路 166 号中国保险大厦 34 楼</p> <p>办公地址：上海市浦东新区陆家嘴东路 166 号中国保险大厦 34 楼</p> <p>法定代表人：储晓明</p> <p>组织形式：有限责任公司</p> <p>注册资本：壹亿叁仟万元人民币</p>	<p>1、基金管理人简况</p> <p>住所：<u>中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层</u></p> <p>办公地址：<u>上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层</u></p> <p>法定代表人：<u>杨皓鹏</u></p> <p>组织形式：<u>有限责任公司（中外合资）</u></p> <p>注册资本：<u>1.466667 亿元人民币</u></p>
<p>七、基金合同当事人及权利义务 (二) 基金托管人</p>	<p>1、基金托管人简况</p> <p>名称：中国农业银行</p> <p>住所：北京市复兴路甲 23 号</p> <p>办公地址：北京市西三环北路 100 号金玉大厦</p> <p>法定代表人：杨明生</p> <p>成立时间：1979 年 2 月 23 日</p> <p>注册资金：361 亿元人民币</p> <p>存续期间：持续经营</p> <p>组织形式：国有独资</p> <p>批准设立机关和批准设立文号：国发（1979）056 号</p>	<p>1、基金托管人简况</p> <p>名称：<u>中国农业银行股份有限公司</u></p> <p>住所：<u>北京市东城区建国门内大街 69 号</u></p> <p>法定代表人：<u>周慕冰</u></p> <p>成立时间：<u>2009 年 1 月 15 日</u></p> <p>批准设立机关和批准设立文号：<u>中国银监会银监复[2009]13 号</u></p> <p>组织形式：<u>股份有限公司</u></p> <p>注册资本：<u>32,479,411.7 万元人民币</u></p> <p>存续期间：持续经营</p> <p>基金托管资格批文及文号：<u>中国证</u></p>

		监会证监基字[1998]23号
<p>十二、 基金的投</p> <p>资</p> <p>(三) 投资范围</p>	<p>本基金投资组合的资产配置: 股票资产占基金资产的 30%—80%, 债券资产占基金资产的 20%—70%, 权证资产占基金资产净值的 0—3%, 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>本基金投资组合的资产配置: 股票资产占基金资产的 30%—80%, 债券资产占基金资产的 20%—70%, 权证资产占基金资产净值的 0—3%, 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, 前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</p>
<p>十二、 基金的投</p> <p>资</p> <p>(七) 投资限制</p>	<p>本基金的投资组合将遵循以下限制:</p> <p>.....</p> <p>2、本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券, 不超过该证券的 10%。</p> <p>.....</p> <p>5、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>.....</p>	<p>本基金的投资组合将遵循以下限制:</p> <p>.....</p> <p>2、本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券, 不超过该证券的 10%; 本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股, 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, 不得超过该上市公司可流通股票的 30%。</p> <p>.....</p> <p>5、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, 前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;</p> <p>.....</p> <p>新增:</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。在符合相关法律法规规定的前提下，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等非本基金管理人的因素致使基金的投资组合不符合上述 1-3 项以及 5-8 项规定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。</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本基金资产净值的 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前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资。</u></p> <p><u>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交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致。</u></p> <p>.....</p> <p>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。在符合相关法律法规规定的前提下，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等非本基金管理人的因素致使基金的投资组合不符合上述 1-3 项以及 <u>6-7、10</u> 项规定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。</p>
<p>十四、 基金资产的估值</p> <p>(二) 估值方法</p>		<p>新增：</p> <p><u>4、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。</u></p>
<p>十四、 基金资产</p>		<p>新增：</p>

<p>的估值</p> <p>(六) 暂停估值的情形</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一致的，基金管理人应当暂停基金估值；</u></p>
<p>十八、基金的信息披露</p> <p>(五) 公开披露的基金信息</p>	<p>6、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>6、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>新增：</p> <p><u>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者利益，基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告文件中“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>十八、基金的信息披露</p> <p>(五) 公开披露的基金信息</p>	<p>7、临时报告</p>	<p>7、临时报告</p> <p>新增：</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时；</u></p> <p><u>27、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；</u></p>

二、托管协议修改前后对照表

章节	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>注册地址：上海市浦东新区陆家嘴东路 166 号中国保险大厦 34 楼</p> <p>办公地址：上海市浦东新区陆家嘴东路 166 号中国保险大厦 34 楼</p> <p>法定代表人：储晓明</p> <p>组织形式：有限责任公司</p> <p>注册资本：1 亿元人民币</p> <p>经营范围：基金管理业务、发起设立基金及中国证券监督管理委员会批准的其他业务。</p>	<p>注册地址：<u>中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层</u></p> <p>办公地址：<u>上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层</u></p> <p>法定代表人：<u>杨皓鹏</u></p> <p>组织形式：<u>有限责任公司(中外合资)</u></p> <p>注册资本：<u>1.466667 亿元人民币</u></p> <p>经营范围：<u>基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其它业务</u> 【依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动】</p>
<p>一、基金托管协议当事人</p> <p>(二) 基金托管人</p>	<p>名称：中国农业银行</p> <p>住所：北京市复兴路甲 23 号</p> <p>办公地址：北京市西三环北路 100 号金玉大厦</p> <p>邮政编码：100036</p> <p>法定代表人：杨明生</p> <p>成立时间：1979 年 2 月 23 日</p> <p>批准设立机关及批准设立文号：国发（1979）056 号</p> <p>组织形式：国有独资</p> <p>注册资金：361 亿元人民币</p> <p>存续期间：持续经营</p> <p>经营范围：人民币存款、贷款、结算业务；居民储蓄业务；信托贷款、投资业务；金融租赁业务；外汇存款；外汇汇款；外汇投资；在境内、</p>	<p>名称：<u>中国农业银行股份有限公司</u></p> <p>注册地址：<u>北京市东城区建国门内大街 69 号</u></p> <p>办公地址：<u>北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座九层</u></p> <p>邮政编码：<u>100031</u></p> <p>法定代表人：<u>周慕冰</u></p> <p>成立时间：<u>2009 年 1 月 15 日</u></p> <p><u>基金托管资格批准文号：中国证监会证监基字[1998]23 号</u></p> <p>注册资本：<u>32,479,411.7 万元人民币</u></p> <p>存续期间：持续经营</p> <p>经营范围：<u>吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府</u></p>

	<p>外发行或代理发行外币有价证券；贸易、非贸易结算；外币票据贴现；外汇放款；买卖或代理买卖外汇及外币有价证券；境内、外外汇借款；外汇及外币票据兑换；外汇担保；保管箱业务；征信调查、咨询服务；证券投资基金托管；社保基金托管；企业年金托管；委托资产托管；信托资产托管；基本养老保险个人账户基金托管；农村社会保障基金托管；投资连接保险产品的托管；收支账户的托管；合格境外机构投资者（QFII）境内证券投资托管。</p>	<p><u>债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；结汇、售汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；代理资金清算；各类汇兑业务；代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务；贷款承诺；组织或参加银团贷款；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇借款；发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券；外汇票据承兑和贴现；自营、代客外汇买卖；外币兑换；外汇担保；资信调查、咨询、见证业务；企业、个人财务顾问服务；证券公司客户交易结算资金存管业务；证券投资基金托管业务；企业年金托管业务；产业投资基金托管业务；合格境外机构投资者境内证券投资托管业务；代理开放式基金业务；电话银行、手机银行、网上银行业务；金融衍生产品交易业务；经国务院银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务。</u></p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查 (一)</p>	<p>本基金投资组合的资产配置：股票资产占基金资产的 30%—80%，债券资产占基金资产的 20%—70%，权证资产占基金资产净值的 0—3%，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>本基金投资组合的资产配置：股票资产占基金资产的 30%—80%，债券资产占基金资产的 20%—70%，权证资产占基金资产净值的 0—3%，本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，<u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</u></p>

<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</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、本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券, 不超过该证券的 10%。</p> <p>.....</p> <p>5、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>.....</p>	<p>2、本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券, 不超过该证券的 10%。<u>本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股股票, 不得超过该上市公司可流通股股票的 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股票, 不得超过该上市公司可流通股股票的 30%。</u></p> <p>.....</p> <p>5、保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券, <u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</u></p> <p>.....</p> <p>新增:</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本基金资产净值的 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前款所规定比例限制的, 基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资。</u></p> <p><u>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交易对手开展逆回购交易的, 可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致。</u></p>
--	--	---

	<p>.....</p> <p>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。在符合相关法律法规规定的前提下，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等非本基金管理人的因素致使基金的投资组合不符合上述 1-3 项以及 5-8 项规定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。</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。在符合相关法律法规规定的前提下，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等非本基金管理人的因素致使基金的投资组合不符合上述 1-3 项以及 6-7、10 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。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。</p>
<p>八、基金资产净值计算和会计核算</p> <p>(二) 基金资产估值方法和特殊情形的处理</p>	<p>2、估值方法</p>	<p>2、估值方法</p> <p>新增：</p> <p><u>(4) 当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。</u></p>
<p>八、基金资产净值计算和会计核算</p> <p>(四) 暂停估值与公告基金份额净值的情形</p>		<p>新增：</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一致的，基金管理人应当暂停基金估值；</u></p>
<p>十、基金信息披露</p> <p>(三) 基金托管人和基金管理人在信息披露中的职责和信息披露程序</p>	<p>1.职责</p> <p>.....</p> <p>当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金信息：</p>	<p>1.职责</p> <p>.....</p> <p>当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金信息：</p> <p>新增：</p>

		<p><u>(2) 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后暂停基金估值的;</u></p>
--	--	--

中海消费主题精选混合型证券投资基金基金合同和托管协议修订对照表

一、基金合同修改前后文对照表

章节	修改前	修改后
一、 前言 (一) 订立本基金合同的目的、依据和原则	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《中华人民共和国合同法》、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)和其他有关法律法规。	2、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》”)、《中华人民共和国合同法》、《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》”)、 <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“《流动性管理规定》”)</u> 和其他有关法律法规。
一、 前言		新增： <u>(五) 本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的 50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过 50%的除外。</u>
二、 释义		新增： <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 日起实施的《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><u>55、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><u>56、摆动定价机制：指当本基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待</u></p>
<p>六、基金份额的申购与赎回</p> <p>（五）申购和赎回的金额</p>		<p>新增：</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。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告。</u></p>
<p>六、基金份额的申</p>	<p>5、本基金的申购费用应在投资者申</p>	<p>5、本基金的申购费用应在投资者申</p>

<p>购与赎回</p> <p>(六) 申购和赎回的价格、费用及其用途</p>	<p>购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，不低于赎回费总额的 25%应归基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。</p>	<p>购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，<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；对于持续持有期不少于 7 日的投资者收取的赎回费，</u>不低于赎回费总额的 25%应归基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。</p>
<p>六、基金份额的申购与赎回</p> <p>(六) 申购和赎回的价格、费用及其用途</p>		<p>新增：</p> <p><u>7、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，摆动定价机制的处理原则与操作规范参见法律法规和自律组织的规定，具体见基金管理人届时的相关公告。</u></p>
<p>六、基金份额的申购与赎回</p> <p>(八) 拒绝或暂停申购的情形</p>		<p>新增：</p> <p><u>5、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有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、申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单个投资人单日或单笔申购金额上限的。</u></p> <p><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</u></p>

	<p>.....</p> <p>发生上述暂停申购情形时,基金管理人应当根据有关规定在指定媒体和基金管理人网站上刊登暂停申购公告。如果基金投资者的申购申请被拒绝,被拒绝的申购款项将退还给投资者。在暂停申购的情况消除时,基金管理人应及时恢复申购业务的办理。</p>	<p><u>市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时,经与基金托管人协商确认后,基金管理人应当暂停接受申购申请。</u></p> <p>.....</p> <p>发生上述暂停申购情形时 <u>(第 5、6 项除外)</u>,基金管理人应当根据有关规定在指定媒体和基金管理人网站上刊登暂停申购公告。如果基金投资者的申购申请被<u>全部或部分拒绝的</u>,被拒绝的申购款项将退还给投资者。在暂停申购的情况消除时,基金管理人应及时恢复申购业务的办理。</p>
<p>六、基金份额的申购与赎回</p> <p>(九) 暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p>	<p>发生下列情形时,基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项:</p> <p>.....</p>	<p>发生下列情形时,基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项:</p> <p>.....</p> <p>新增:</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,基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。</u></p>
<p>六、基金份额的申购与赎回</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>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>新增:</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 10%,基金</u></p>

		<p><u>管理人有权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%）的赎回申请与其他投资者的赎回申请按前述条款处理，具体见招募说明书或相关公告。</u></p>
<p>七、基金合同当事人及权利义务</p> <p>（一）基金管理人</p>	<p>1、基金管理人简况</p> <p>注册地址：上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层</p> <p>法定代表人：陈浩鸣</p> <p>组织形式：有限责任公司</p>	<p>1、基金管理人简况</p> <p>注册地址：<u>中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层</u></p> <p>法定代表人：<u>杨皓鹏</u></p> <p>组织形式：有限责任公司（<u>中外合资</u>）</p>
<p>七、基金合同当事人及权利义务</p> <p>（二）基金托管人</p>	<p>法定代表人：项俊波</p>	<p>法定代表人：<u>周慕冰</u></p>
<p>十二、 基金的投资</p> <p>（三）投资范围</p>	<p>本基金投资组合的资产配置：股票资产占基金资产的 60%—95%，债券资产占基金资产的 0%—35%，权证投资占基金资产净值的 0%—3%，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金 80%以上的股票资产投资于消费主题类股票。</p>	<p>本基金投资组合的资产配置：股票资产占基金资产的 60%—95%，债券资产占基金资产的 0%—35%，权证投资占基金资产净值的 0%—3%，现金或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>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>。本基金 80%以上的股票资产投资于消费主题类股票。</p>
<p>十二、 基金的投资</p> <p>（九）投资限制</p>	<p>本基金的投资组合将遵循以下限制： ……</p> <p>（2）本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；</p>	<p>本基金的投资组合将遵循以下限制： ……</p> <p>（2）本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证</p>

	<p>.....</p> <p>(5) 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>.....</p> <p>.....</p>	<p>券，不超过该证券的 10%；<u>本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不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>.....</p> <p>(5) 保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，<u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</u></p> <p>.....</p> <p>新增：</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本基金资产净值的 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前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u></p> <p><u>(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交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；</u></p> <p>.....</p>
--	--	---

	<p>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。在符合相关法律法规规定的前提下，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等非本基金管理人的因素致使基金的投资组合不符合上述（1）-（3）项以及（5）-（8）项规定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。</p>	<p>基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。在符合相关法律法规规定的前提下，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等非本基金管理人的因素致使基金的投资组合不符合上述 <u>（1）-（3）、（6）-（7）、（10）</u> 项规定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。</p>
<p>十四、 基金资产的估值 （四）估值方法</p>		<p>新增： <u>4、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。</u></p>
<p>十四、 基金资产的估值 （七）暂停估值的情形</p>		<p>新增： <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>十八、 基金的信息披露 （五）公开披露的基金信息</p>	<p>6、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>6、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>新增： <u>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者利益，基金管理人应当在季度报告、</u></p>

		<p>半年度报告、年度报告等定期报告中“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>十八、基金的信息披露</p> <p>(五) 公开披露的基金信息</p>	7、临时报告	<p>7、临时报告</p> <p>新增：</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时；</p> <p>28、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；</p>

二、托管协议修改前后对照表

章节	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>注册地址：上海市浦东新区银城中路68号2905-2908室及30层</p> <p>法定代表人：陈浩鸣</p> <p>组织形式：有限责任公司</p> <p>经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。</p>	<p>注册地址：<u>中国（上海）自由贸易试验区银城中路68号2905-2908室及30层</u></p> <p>法定代表人：<u>杨皓鹏</u></p> <p>组织形式：<u>有限责任公司(中外合资)</u></p> <p>经营范围：<u>基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其它业务</u> 【依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动】</p>
<p>一、基金托管协议当事人</p>	<p>法定代表人：项俊波</p> <p>经营范围：吸收公众存款；发放短</p>	<p>法定代表人：<u>周慕冰</u></p> <p>经营范围：<u>吸收公众存款；发放短期、</u></p>

<p>(二) 基金托管人</p>	<p>期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；结汇、售汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项；提供保管箱服务；代理资金清算；各类汇兑业务；代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务；贷款承诺；组织或参加银团贷款；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇借款；发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券；外币票据承兑和贴现；自营、代客外汇买卖；外币兑换；外汇担保；资信调查、咨询、见证业务；企业、个人财务顾问服务；证券公司客户交易结算资金存管业务；证券投资基金托管业务；企业年金托管业务；产业投资基金托管业务；合格境外机构投资者境内证券投资托管业务；代理开放式基金业务；电话银行、手机银行、网上银行业务；金融衍生产品交易业务；经国务院银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务；保险兼业代理业务。</p>	<p><u>中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；结汇、售汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；代理资金清算；各类汇兑业务；代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务；贷款承诺；组织或参加银团贷款；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇借款；发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券；外汇票据承兑和贴现；自营、代客外汇买卖；外币兑换；外汇担保；资信调查、咨询、见证业务；企业、个人财务顾问服务；证券公司客户交易结算资金存管业务；证券投资基金托管业务；企业年金托管业务；产业投资基金托管业务；合格境外机构投资者境内证券投资托管业务；代理开放式基金业务；电话银行、手机银行、网上银行业务；金融衍生产品交易业务；经国务院银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务。</u></p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>	<p>本基金的配置比例为：股票资产占基金资产的 60%—95%，债券资产占基金资产的 0%—35%，权证投资</p>	<p>本基金的配置比例为：股票资产占基金资产的 60%—95%，债券资产占基金资产的 0%—35%，权证投资占基金</p>

<p>(一)</p>	<p>占基金资产净值的 0%—3%，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金 80%以上的股票资产投资于消费主题类股票。</p>	<p>资产净值的 0%—3%，现金或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>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>。本基金 80%以上的股票资产投资于消费主题类股票。</p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</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、本基金与本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过该证券的 10%；</p> <p>.....</p> <p>7、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>.....</p>	<p>2、本基金与本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过该证券的 10%；<u>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(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不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>.....</p> <p>7、保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，<u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</u></p> <p>.....</p> <p>新增：</p> <p><u>9、本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 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</u></p>

	<p>.....</p> <p>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比例不符合上述 1-3 项、5-9 项规定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。</p>	<p><u>前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u></p> <p><u>10、本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；</u></p> <p>.....</p> <p>因证券市场波动、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比例不符合上述 1-3 项、<u>5-6 项、8 项以及 11 项</u>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。</p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p> <p>(七) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资流通受限证券进行监督。</p>	<p>2、流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>	<p>2、流通受限证券与上文所述的流动性受限资产并不完全一致，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>
<p>八、基金资产净值计算和会计核算</p> <p>(二) 基金资产估值方法和特殊情形的处理</p>	<p>2、估值方法</p>	<p>2、估值方法</p> <p>新增：</p> <p><u>(4) 当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。</u></p>
<p>八、基金资产净值</p>		<p>新增：</p>

<p>计算和会计核算</p> <p>(四) 暂停估值与公告基金份额净值的情形</p>		<p><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>十、基金信息披露</p> <p>(三) 基金托管人和基金管理人在信息披露中的职责和信息披露程序</p>	<p>1.职责</p> <p>.....</p> <p>当出现下述情况时, 基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金信息:</p>	<p>1.职责</p> <p>.....</p> <p>当出现下述情况时, 基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金信息:</p> <p>新增:</p> <p><u>(2) 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后暂停基金估值的;</u></p>

中海可转换债券债券型证券投资基金基金合同和托管协议修订对照表

一、基金合同修改前后对照表

章节	修改前	修改后
一、 前言 (一) 订立本基金合同的目的、依据和原则	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《中华人民共和国合同法》、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)和其他有关法律法规。	2、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》”)、《中华人民共和国合同法》、《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》”)、 <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“《流动性管理规定》”)</u> 和其他有关法律法规。
一、 前言		新增： <u>五、本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的 50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过 50%的除外。</u>
二、 释义		新增： <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 日起实施的《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>55、流动性受限资产：指由于法律</u>

		<p>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>56、摆动定价机制：指当本基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待</p>
<p>六、基金份额的申购与赎回</p> <p>（五）申购和赎回的金额</p>		<p>新增：</p> <p>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。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告。</p>
<p>六、基金份额的申购与赎回</p>	<p>6、本基金 A 类基金份额的申购费用应在投资者申购基金份额时收取，不</p>	<p>6、本基金 A 类基金份额的申购费用应在投资者申购基金份额时收取，</p>

<p>(六) 申购和赎回的价格、费用及其用途</p>	<p>列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担,不低于赎回费总额的25%应归基金财产,其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。</p>	<p>不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担, <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,对于持续持有期不少于7日的投资者收取的赎回费,</u> 不低于赎回费总额的25%应归基金财产,其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。</p>
<p>六、基金份额的申购与赎回</p> <p>(六) 申购和赎回的价格、费用及其用途</p>		<p>新增:</p> <p><u>8、当本基金发生大额申购或赎回情形时,基金管理人可以在履行适当程序后,采用摆动定价机制,以确保基金估值的公平性,摆动定价机制的处理原则与操作规范参见法律法规和自律组织的规定,具体见基金管理人届时的相关公告。</u></p>
<p>六、基金份额的申购与赎回</p> <p>(八) 拒绝或暂停申购的情形</p>		<p>新增:</p> <p><u>6、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有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>7、申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单个投资人单日或单笔申购金额上限的。</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</u></p>

	<p>.....</p> <p>发生上述 1、2、3、4、6 暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受基金投资者的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。如果基金投资者的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资者。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。</p>	<p><u>市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受申购申请。</u></p> <p>.....</p> <p>发生上述 <u>1、2、3、4、8、9</u> 暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受基金投资者的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。如果基金投资者的申购申请被<u>全部或部分拒绝的</u>，被拒绝的申购款项将退还给投资者。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。</p>
<p>六、基金份额的申购与赎回</p> <p>(九) 暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p>	<p>发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：</p>	<p>发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：</p> <p>新增：</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，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。</u></p>
<p>六、基金份额的申购与赎回</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>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>新增：</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 10%，基金</u></p>

		<p><u>管理人有权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%）的赎回申请与其他投资者的赎回申请按前述条款处理，具体见招募说明书或相关公告。</u></p>
<p>七、基金合同当事人及权利义务</p> <p>(一) 基金管理人</p>	<p>1、基金管理人简况</p> <p>住所：上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层</p> <p>法定代表人：黄鹏</p> <p>组织形式：有限责任公司</p>	<p>1、基金管理人简况</p> <p>住所：<u>中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层</u></p> <p>法定代表人：<u>杨皓鹏</u></p> <p>组织形式：有限责任公司（<u>中外合资</u>）</p>
<p>七、基金合同当事人及权利义务</p> <p>(二) 基金托管人</p>	<p>法定代表人：蒋超良</p> <p>批准设立机关和批准设立文号：国发【1979】056 号</p>	<p>法定代表人：<u>周慕冰</u></p> <p>批准设立机关和批准设立文号：<u>中国银监会银监复【2009】13 号</u></p>
<p>十二、 基金的投资</p> <p>(三) 投资范围</p>	<p>本基金投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%，对可转换债券（含可分离交易可转换债券）的投资比例不低于基金固定收益类资产的 80%，对中小企业私募债券的投资比例不高于基金固定收益类资产的 20%；非固定收益类资产的比例合计不超过基金资产的 20%。其中现金或到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，权证的投资比例不得超过基金资产净值的 3%。</p>	<p>本基金投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%，对可转换债券（含可分离交易可转换债券）的投资比例不低于基金固定收益类资产的 80%，对中小企业私募债券的投资比例不高于基金固定收益类资产的比例合计不超过基金资产的 20%。其中现金或到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，<u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</u>权证的投资比例不得超过基金资产净值的 3%。</p>

<p>十二、 基金的投资</p> <p>(九) 投资限制</p>	<p>本基金的投资组合将遵循以下限制：</p> <p>(4) 本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；</p> <p>.....</p> <p>(7) 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>本基金的投资组合将遵循以下限制：</p> <p>(4) 本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；<u>本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不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>.....</p> <p>(7) 保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，<u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</u> 新增：</p> <p><u>(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本基金资产净值的 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前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u></p> <p><u>(13) 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>
---	--	---

	<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。在符合相关法律法规规定的前提下，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等非本基金管理人的因素致使基金的投资组合不符合上述各项规定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。</p>	<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> <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。在符合相关法律法规规定的前提下，<u>除上述第（7）、（10）、（12）、（13）项外</u>，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等非本基金管理人的因素致使基金的投资组合不符合上述各项规定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。</p>
<p>十四、 基金资产的估值</p> <p>（四）估值方法</p>		<p>新增：</p> <p><u>4、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。</u></p>
<p>十四、 基金资产的估值</p> <p>（七）暂停估值的情形</p>		<p>新增：</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>十八、 基金的信息披露</p>	<p>6、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>6、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</p>

<p>(五) 公开披露的基金信息</p>		<p>告</p> <p>新增：</p> <p><u>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额20%的情形，为保障其他投资者利益，基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告中“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>十八、基金的信息披露</p> <p>(五) 公开披露的基金信息</p>	<p>7、临时报告</p>	<p>7、临时报告</p> <p>新增：</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时；</u></p> <p><u>28、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；</u></p>

二、托管协议修改前后文对照表

章节	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>注册地址：上海市浦东新区银城中路68号2905-2908室及30层</p> <p>法定代表人：黄鹏</p> <p>组织形式：有限责任公司</p> <p>经营范围：基金管理业务、发起设</p>	<p>注册地址：<u>中国（上海）自由贸易试验区银城中路68号2905-2908室及30层</u></p> <p>法定代表人：<u>杨皓鹏</u></p> <p>组织形式：有限责任公司(<u>中外合资</u>)</p>

	立基金及中国证券监督管理委员会批准的其他业务。	经营范围： <u>基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其它业务</u> 【依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动】
一、基金托管协议当事人 (二) 基金托管人	法定代表人：蒋超良 经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；结汇、售汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项；提供保管箱服务；代理资金清算；各类汇兑业务；代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务；贷款承诺；组织或参加银团贷款；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇借款；发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券；外币票据承兑和贴现；自营、代客外汇买卖；外币兑换；外汇担保；资信调查、咨询、见证业务；企业、个人财务顾问服务；证券公司客户交易结算资金存管业务；证券投资基金托管业务；企业年金托管业务；产业投资基金托管业务；合格境外机构投资者境内证券投资托管业务；代理开放式基金业务；电话银行、手机银行、网上银行业务；金融衍生产品	法定代表人： <u>周慕冰</u> 经营范围： <u>吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结 算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；结汇、售汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；代理资金清算；各类汇兑业务；代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务；贷款承诺；组织或参加银团贷款；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇借款；发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券；外汇票据承兑和贴现；自营、代客外汇买卖；外币兑换；外汇担保；资信调查、咨询、见证业务；企业、个人财务顾问服务；证券公司客户交易结算资金存管业务；证券投资基金托管业务；企业年金托管业务；产业投资基金托管业务；合格境外机构投资者境内证 券投资托管业务；代理开放式基金业务；电话银行、手机银行、网上银行业务；金融衍生产品交易业务；经国务院银行业监督管理机</u>

	交易业务；经国务院银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务；保险兼业代理业务。	<u>构等监管部门批准的其他业务。</u>
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查 (一)	本基金的配置比例为本基金投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%，对可转换债券（含可分离交易可转换债券）的投资比例不低于基金固定收益类资产的 80%，对中小企业私募债券的投资比例不高于基金固定收益类资产的 20%；非固定收益类资产的比例合计不超过基金资产的 20%。其中现金或到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。权证的投资比例不得超过基金资产净值的 3%。	本基金的配置比例为本基金投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%，对可转换债券（含可分离交易可转换债券）的投资比例不低于基金固定收益类资产的 80%，对中小企业私募债券的投资比例不高于基金固定收益类资产的 20%；非固定收益类资产的比例合计不超过基金资产的 20%。其中现金或到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%， <u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</u> 权证的投资比例不得超过基金资产净值的 3%。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查 (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、本基金管理人管理且由基金托管人托管的全部基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过该证券的 10%； 	2、本基金管理人管理且由基金托管人托管的全部基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过该证券的 10%； <u>本基金管理人管理且由基金托管人托管的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不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>7、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>.....</p> <p>因证券市场波动、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各项规定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。</p>	<p>7、保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，<u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</u></p> <p>新增：</p> <p><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本基金资产净值的 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前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u></p> <p><u>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>.....</p> <p><u>除上述第 7、8、10、11 项外，</u>因证券市场波动、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各项规定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。</p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p> <p>(七) 基金托管人根据有关法律法规</p>	<p>2、流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发</p>	<p>2、流通受限证券<u>与上文所述的流动性受限资产并不完全一致</u>，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期</p>

<p>的规定及基金合同的约定，对基金投资流通受限证券进行监督。</p>	<p>布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>	<p>限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>
<p>八、基金资产净值计算和会计核算 (二) 基金资产估值方法和特殊情形的处理</p>	<p>2、估值方法</p>	<p>新增： <u>(6) 当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。</u></p>
<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</p>		<p>新增： <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>十、基金信息披露 (三) 基金托管人和基金管理人在信息披露中的职责和信息披露程序</p>	<p>1.职责 …… 当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金信息：</p>	<p>1.职责 …… 当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金信息： 新增： <u>(2) 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后暂停基金估值的；</u></p>

中海积极收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同和托管协议修订对照表

一、基金合同修改前后对照表

章节	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	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)和其他有关法律法规。	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、 <u>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性管理规定》”)</u> 和其他有关法律法规。
第一部分 前言		新增： <u>六、本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的 50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过 50%的除外。</u>
第二部分 释义		新增： <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 日起实施的《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><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> <p><u>52、摆动定价机制：指当本基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待</u></p>
<p>第六部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>五、申购和赎回的数量限制</p>		<p>新增：</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。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告。</u></p>
<p>第六部分 基金份</p>	<p>5、赎回费用由赎回基金份额的基金</p>	<p>5、赎回费用由赎回基金份额的基金</p>

<p>额的申购与赎回</p> <p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p>	<p>份额持有人承担,在基金份额持有人赎回基金份额时收取。</p>	<p>份额持有人承担,在基金份额持有人赎回基金份额时收取。<u>其中对于持续持有期少于 7 日的投资者收取不少于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产。</u></p>
<p>第六部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p>		<p>新增:</p> <p><u>7、当本基金发生大额申购或赎回情形时,基金管理人可以在履行适当程序后,采用摆动定价机制,以确保基金估值的公平性,摆动定价机制的处理原则与操作规范参见法律法规和自律组织的规定,具体见基金管理人届时的相关公告。</u></p>
<p>第六部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>七、拒绝或暂停申购的情形</p>		<p>新增:</p> <p><u>6、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有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>7、申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单个投资人单日或单笔申购金额上限的。</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,基金管理人应当暂停接受申购申请。</u></p>
<p>第六部分 基金份额的申购与赎回</p>	<p>发生上述第 1、2、3、5、6 项之一的情形且基金管理人决定暂停申购时,</p>	<p>发生上述第 <u>1、2、3、5、8、9</u> 项之一的情形且基金管理人决定暂停申</p>

七、拒绝或暂停申购的情形	基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝,被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时,基金管理人应及时恢复申购业务的办理。	购时,基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被 <u>全部或部分拒绝</u> 的,被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时,基金管理人应及时恢复申购业务的办理。
第六部分 基金份额的申购与赎回 八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形	发生下列情形时,基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项:	发生下列情形时,基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项: 新增: <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,基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。</u>
第六部分 基金份额的申购与赎回 九、巨额赎回的情形及处理方式	2、巨额赎回的处理方式	2、巨额赎回的处理方式 新增: <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%,基金管理人有权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%)的赎回申请与其他投资者的赎回申请按前述条款处理,具体见招募说明书或相关公告。</u>
第七部分 基金合	(一) 基金管理人简况	(一) 基金管理人简况

<p>同当事人及权利义 务</p> <p>一、基金管理人</p>	<p>住所：上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层</p> <p>法定代表人：黄鹏</p>	<p>住所：<u>中国（上海）自由贸易试验 区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层</u></p> <p>法定代表人：<u>杨皓鹏</u></p>
<p>第七部分 基金合 同当事人及权利义 务</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：蒋超良</p>	<p>（一）基金托管人简况</p> <p>法定代表人：<u>周慕冰</u></p>
<p>第十二部分 基金 的投资</p> <p>二、投资范围</p>	<p>基金的投资组合比例为：本基金投资 于股票的比例占基金资产的 0-95%， 本基金持有的现金或到期日在一年 以内的政府债券不低于基金资产净 值的 5%。</p>	<p>基金的投资组合比例为：本基金投 资于股票的比例占基金资产的 0-95%，本基金持有的现金或到期日 在一年以内的政府债券不低于基金 资产净值的 5%，<u>前述现金不包括结 算备付金、存出保证金、应收申购 款等。</u></p>
<p>第十二部分 基金 的投资</p> <p>四、投资限制</p>	<p>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制： ……</p> <p>（2）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>……</p> <p>（4）本基金管理人管理的全部基金 持有一家公司发行的证券，不超过该 证券的 10%；</p>	<p>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制： ……</p> <p>（2）保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政 府债券，<u>前述现金不包括结算备付 金、存出保证金、应收申购款等；</u></p> <p>……</p> <p>（4）本基金管理人管理的全部基金 持有一家公司发行的证券，不超过 该证券的 10%；<u>本基金管理人管理 的全部开放式基金(包括开放式基 金以及处于开放期的定期开放基 金)持有一家公司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</u></p>

	<p>.....</p> <p>因证券市场波动、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>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>新增：</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本基金资产净值的 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前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u></p> <p><u>(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>.....</p> <p>除上述第<u>(2)、(12)、(16)、(17)</u>项外，因证券市场波动、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>第十四部分 基金 资产估值 三、估值方法</p>		<p>新增：</p> <p><u>7、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。</u></p>

<p>第十四部分 基金资产估值</p> <p>六、暂停估值的情形</p>		<p>新增：</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>第十八部分 基金的信息披露</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</p> <p>新增：</p> <p><u>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者利益，基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告文件中“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>第十八部分 基金的信息披露</p> <p>(七) 临时报告</p>		<p>新增：</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时；</u></p> <p><u>27、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；</u></p>

二、托管协议修改前后对照表

章节	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：上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层 法定代表人：黄鹏 组织形式：有限责任公司 经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务（涉及行政许可的凭许可证经营）。	注册地址： <u>中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层</u> 法定代表人： <u>杨皓鹏</u> 组织形式： <u>有限责任公司(中外合资)</u> 经营范围： <u>基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其它业务</u> 【依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动】
一、基金托管协议当事人 (二) 基金托管人	法定代表人：蒋超良	法定代表人： <u>周慕冰</u>
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查 (一)	本基金的配置比例为：本基金投资于股票的比例占基金资产的 0-95%，本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，	本基金的配置比例为：本基金投资于股票的比例占基金资产的 0-95%，本基金持有的现金或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>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</u>
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查 (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、融券比例进行监督。基金托管人按下述比例	2、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 …… 4、本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；	2、保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券， <u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</u> …… 4、本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%； <u>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(包</u>

<p>和调整期限进行监督：</p>	<p>.....</p> <p>因证券市场波动、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的投资比例的，基金管理人应当在 10 个工作日内进行调整。</p>	<p><u>括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不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>新增：</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本基金资产净值的 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前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u></p> <p><u>14、本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；</u></p> <p>.....</p> <p><u>除上述第 2、8、13、14 项外，</u>因证券市场波动、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的投资比例的，基金管理人应当在 10 个工作日内进行调整。</p>
<p>三、基金托管人对</p>	<p>2、流通受限证券，包括由《上市公</p>	<p>2、流通受限证券与上文所述的流动</p>

<p>基金管理人的业务监督和核查</p> <p>(七) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定, 对基金投资流通受限证券进行监督。</p>	<p>司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期可交易的证券, 不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>	<p>性受限资产并不完全一致, 包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期可交易的证券, 不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>
<p>八、基金资产净值计算和会计核算</p> <p>(二) 基金资产估值方法和特殊情形的处理</p>	<p>2、估值方法</p>	<p>2、估值方法</p> <p>新增:</p> <p><u>(7) 当本基金发生大额申购或赎回情形时, 基金管理人可以在履行适当程序后, 采用摆动定价机制, 以确保基金估值的公平性。</u></p>
<p>八、基金资产净值计算和会计核算</p> <p>(四) 暂停估值与公告基金份额净值的情形</p>		<p>新增:</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>十、基金信息披露</p> <p>(三) 基金托管人和基金管理人在信息披露中的职责和信息披露程序</p>	<p>1. 职责</p> <p>……</p> <p>当出现下述情况时, 基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金信息:</p>	<p>1. 职责</p> <p>……</p> <p>当出现下述情况时, 基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金信息:</p> <p>新增:</p> <p><u>(2) 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</u></p>

		基金托管人协商一致后暂停基金估值的；
--	--	--------------------

中海惠祥分级债券型证券投资基金基金合同和托管协议修订对照表

一、基金合同修改前后文对照表

章节	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	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)和其他有关法律法规。	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、 <u>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</u> (以下简称“ <u>《流动性风险管理规定》</u> ”)和其他有关法律法规。
第一部分 前言		新增： <u>六、本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的 50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过 50%的除外。</u>
第二部分 释义		新增： <u>15、《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 日起实施的《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>85、流动性受限资产：指由于法律</u>

		<p>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>86、摆动定价机制：指当本基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待</p>
<p>第八部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>（五）申购和赎回的数量限制</p>		<p>新增：</p> <p>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。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告。</p>
<p>第八部分 基金份额的申购与赎回</p>	<p>5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人</p>	<p>5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有</p>

<p>(六) 申购和赎回的价格、费用及其用途</p>	<p>赎回基金份额时收取。不低于赎回费总额的 50%应归基金财产,其余用于支付登记费和其他必要的手续费。</p>	<p>人赎回基金份额时收取。<u>其中对于持续持有期少于 7 日的投资者收取不少于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产;对于持续持有期不少于 7 日的投资者,</u>不低于赎回费总额的 50%应归基金财产,其余用于支付登记费和其他必要的手续费。</p>
<p>第八部分 基金份额的申购与赎回 (六) 申购和赎回的价格、费用及其用途</p>		<p>新增: <u>7、当本基金发生大额申购或赎回情形时,基金管理人可以在履行适当程序后,采用摆动定价机制,以确保基金估值的公平性,摆动定价机制的处理原则与操作规范参见法律法规和自律组织的规定,具体见基金管理人届时的相关公告。</u></p>
<p>第八部分 基金份额的申购与赎回 (七) 拒绝或暂停申购的情形</p>		<p>新增: <u>7、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有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>8、申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单个投资人单日或单笔申购金额上限的。</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,基金管理人应当暂停接受申购申请。</u></p>

<p>第八部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>(七) 拒绝或暂停申购的情形</p>	<p>发生上述第 1、2、3、5、6、7 项暂停申购情形之一时,基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝,被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时,基金管理人应及时恢复申购业务的办理。</p>	<p>发生上述第 1、2、3、5、6、9、10 项暂停申购情形之一时,基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的,被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时,基金管理人应及时恢复申购业务的办理。</p>
<p>第八部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>(八) 暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p>	<p>发生下列情形时,基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项:</p>	<p>发生下列情形时,基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项:</p> <p>新增:</p> <p>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,基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。</p>
<p>第八部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>(八) 暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p>		<p>新增:</p> <p>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%,基金管理人有权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%)的赎回申请与其他投资者的赎回申请按前述条款处理,具体见招募说明书或相关公告。</p>
<p>第九部分 基金合同当事人及权利义</p>	<p>(一) 基金管理人简况</p> <p>住所: 上海市浦东新区银城中路 68</p>	<p>(一) 基金管理人简况</p> <p>住所: 中国(上海)自由贸易试验</p>

<p>务</p> <p>一、基金管理人</p>	<p>号 2905-2908 室及 30 层</p> <p>法定代表人：黄鹏</p>	<p><u>区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层</u></p> <p>法定代表人：<u>杨皓鹏</u></p>
<p>第九部分 基金合同当事人及权利义务</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：蒋超良</p>	<p>(一) 基金托管人简况</p> <p>法定代表人：<u>周慕冰</u></p>
<p>第十四部分 基金的投资</p> <p>二、投资范围</p>	<p>本基金的配置比例为：债券资产占基金资产的比例不低于 80%，权益类资产占基金资产的比例不超过 20%，本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%，基金持有现金或到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>本基金的配置比例为：债券资产占基金资产的比例不低于 80%，权益类资产占基金资产的比例不超过 20%，本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%，基金持有现金或到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，<u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</u></p>
<p>第十四部分 基金的投资</p> <p>五、投资限制</p>	<p>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>(3) 本基金与本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过该证券的 10%；</p>	<p>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>(3) 本基金与本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过该证券的 10%； <u>本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不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>.....</p> <p>(8) 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>.....</p> <p>.....</p> <p>因证券市场波动、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。法律另有规定的，从其规定。</p>	<p>.....</p> <p>(8) 保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，<u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</u></p> <p>.....</p> <p>新增：</p> <p><u>(14) 开放日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 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前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u></p> <p><u>(15) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；</u></p> <p>.....</p> <p><u>除上述第 (8)、(13)、(14)、(15) 项外，</u>因证券市场波动、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。法律另有规定的，从其规定。</p>
第十六部分 基金资产估值		<p>新增：</p> <p>6、当本基金发生大额申购或赎回情</p>

三、估值方法		<u>形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。</u>
第十六部分 基金资产估值 六、暂停估值的情形		新增： <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>
第二十部分 基金的信息披露 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	(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 新增： <u>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额20%的情形，为保障其他投资者利益，基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告文件中“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>
第二十部分 基金的信息披露 (七)临时报告		新增： <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</u>

		<p>事项时；</p> <p>29、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；</p>
<p>第二十三部分 分级运作周期到期</p> <p>二、过渡期</p>	<p>3、过渡期基金份额的申购与赎回原则</p>	<p>3、过渡期基金份额的申购与赎回原则</p> <p>新增：</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。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告。</u></p>
<p>第二十三部分 分级运作周期到期</p> <p>二、过渡期</p>	<p>5、过渡期申购与赎回的费用</p> <p>(2) 在过渡期的惠祥 B 份额的开放期内进行惠祥 B 份额的赎回，不收取赎回费用。</p>	<p>5、过渡期申购与赎回的费用</p> <p>(2) 在过渡期的惠祥 B 份额的开放期内进行惠祥 B 份额的赎回，<u>对于持续持有期少于 7 日的投资者收取不少于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产；但对于持续持有期不少于 7 日的投资者不收取赎回费用。</u></p> <p>新增：</p> <p><u>(4)当过渡期内本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，摆动定价机制的处理原则与操作规范参见法律法规和自律组织的规</u></p>

		定，具体见基金管理人届时的相关公告。
第二十三部分 分级运作周期到期 二、过渡期	7、申购份额与赎回金额的计算 (3) 赎回金额的计算及处理方式： 惠祥 B 份额的赎回金额的计算详见《招募说明书》。惠祥 B 份额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，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。	7、申购份额与赎回金额的计算 (3) 赎回金额的计算及处理方式： 惠祥 B 份额的赎回金额的计算详见《招募说明书》。惠祥 B 份额的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。 <u>对于持续持有期少于 7 日的投资者收取不少于 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，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。
第二十三部分 分级运作周期到期 二、过渡期	8、拒绝或暂停申购的情形	8、拒绝或暂停申购的情形 新增： <u>(7) 基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有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>(8) 申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单个投资人单日或单笔申购金额上限的。</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</u>

	<p>.....</p> <p>发生上述除第（4）项之外的暂停申购情形之一时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。过渡期相应顺延。</p>	<p><u>与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受申购申请。</u></p> <p>.....</p> <p>发生上述除第（4）、<u>（7）、（8）</u>项之外的暂停申购情形之一时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被<u>全部或部分拒绝的</u>，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。过渡期相应顺延。</p>
<p>第二十三部分 分级运作周期到期</p> <p>二、过渡期</p>	<p>9、惠祥 B 暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：</p> <p>.....</p>	<p>9、惠祥 B 暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：</p> <p>新增：</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，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。</u></p> <p>.....</p> <p><u>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%，基金管理人有权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</u></p>

		理，而对该单个基金份额持有人 <u>10%以内（含10%）的赎回申请与其他投资者的赎回申请按前述条款处理，具体见招募说明书或相关公告。</u>
--	--	--

二、托管协议修改前后文对照表

章节	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：上海市浦东新区银城中路68号2905-2908室及30层 法定代表人：黄鹏 组织形式：有限责任公司 经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务（涉及行政许可的凭许可证经营）。	注册地址： <u>中国（上海）自由贸易试验区银城中路68号2905-2908室及30层</u> 法定代表人： <u>杨皓鹏</u> 组织形式： <u>有限责任公司（中外合资）</u> 经营范围： <u>基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其它业务</u> 【依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动】
一、基金托管协议当事人 (二) 基金托管人	法定代表人：蒋超良	法定代表人： <u>周慕冰</u>
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查 (一)	本基金的配置比例为：债券资产占基金资产的比例不低于80%，权益类资产占基金资产的比例不超过20%，本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%，基金持有现金或到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。	本基金的配置比例为：债券资产占基金资产的比例不低于80%，权益类资产占基金资产的比例不超过20%，本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%，基金持有现金或到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%， <u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</u>
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	3、本基金与本基金管理人管理的、且由本基金托管人托管的其他基金持有一家公司发行的证券，其市值	3、本基金与本基金管理人管理的、且由本基金托管人托管的其他基金持有一家公司发行的证券，其市值不

<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、融券比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督:</p>	<p>不超过该证券的 10%;</p> <p>.....</p> <p>8、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>.....</p> <p>因证券市场波动、上市公司合并、</p>	<p>超过该证券的 10%; <u>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(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票, 不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>.....</p> <p>8、保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券, <u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;</u></p> <p>新增:</p> <p><u>14、开放日, 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 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前款所规定比例限制的, 基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;</u></p> <p><u>15、本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的, 可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致;</u></p> <p>.....</p> <p>因证券市场波动、上市公司合并、基</p>
---	--	--

	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 1-4 项以及 6-11 项规定的投资比例的,基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律另有规定的,从其规定。	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 1-4 项以及 6-7、9-12、16 项规定的投资比例的,基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律另有规定的,从其规定。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查 (七) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金投资流通受限证券进行监督。	2、流通受限证券,包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期可交易的证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。	2、流通受限证券与上文所述的 流动性受限资产并不完全一致 ,包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期可交易的证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。
八、基金资产净值计算和会计核算 (二) 基金资产估值方法和特殊情形的处理	2、估值方法	2、估值方法 新增: <u>(6) 当本基金发生大额申购或赎回情形时,基金管理人可以在履行适当程序后,采用摆动定价机制,以确保基金估值的公平性。</u>
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		新增: <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>
十、基金信息披露 (三) 基金托管人和基金管理人在信	1. 职责 …… 当出现下述情况时,基金管理人和	1. 职责 …… 当出现下述情况时,基金管理人和基

<p>息披露中的职责和 信息披露程序</p>	<p>基金托管人可暂停或延迟披露基金 信息：</p>	<p>金托管人可暂停或延迟披露基金信 息： 新增： <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后暂停基金估 值的；</u></p>
----------------------------	--------------------------------	---

中海混改红利主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同和托管协议修订对照表

一、基金合同修改前后对照表

章节	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	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)和其他有关法律法规。	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、 <u>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</u> (以下简称“ <u>《流动性管理规定》</u> ”)和其他有关法律法规。
第一部分 前言		新增： <u>六、本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的除外。</u>
第二部分 释义		新增： <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日起实施的《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>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</u>

		<p>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>52、摆动定价机制：指当本基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待</p>
<p>第六部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>五、申购和赎回的数量限制</p>		<p>新增：</p> <p>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。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告。</p>
<p>第六部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>六、申购和赎回的价格、费用及其用</p>	<p>5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用应根据法律法规规定的比例归入基</p>	<p>5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用应根据法律法规规定的比例归入基金财</p>

途	金财产，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。	产，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。 <u>其中对于持续持有期少于 7 日的投资者收取不少于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产。</u>
第六部分 基金份额的申购与赎回 六、申购和赎回的价格、费用及其用途		新增： <u>7、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，摆动定价机制的处理原则与操作规范参见法律法规和自律组织的规定，具体见基金管理人届时的相关公告。</u>
第六部分 基金份额的申购与赎回 七、拒绝或暂停申购的情形		新增： <u>7、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有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>8、申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单个投资人单日或单笔申购金额上限的。</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，基金管理人应当暂停接受申购申请。</u>
第六部分 基金份额的申购与赎回 七、拒绝或暂停申购的情形	发生上述第 1、2、3、5、6、7 项之一的情形且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公	发生上述第 1、2、3、5、6、 9、10 项之一的情形且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公

	告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。	告。如果投资人的申购申请被 <u>全部或部分拒绝的</u> ，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。
第六部分 基金份额的申购与赎回 八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形	发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：	发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项： 新增： <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，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。</u>
第六部分 基金份额的申购与赎回 九、巨额赎回的情形及处理方式	2、巨额赎回的处理方式	2、巨额赎回的处理方式 新增： <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%，基金管理人有权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%）的赎回申请与其他投资者的赎回申请按前述条款处理，具体见招募说明书或相关公告。</u>
第七部分 基金合同当事人及权利义务 一、基金管理人	（一）基金管理人简况 住所：上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层 法定代表人：黄鹏	（一）基金管理人简况 住所： <u>中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层</u> 法定代表人： <u>杨皓鹏</u>

<p>第七部分 基金合同当事人及权利义务</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：刘士余</p>	<p>(一) 基金托管人简况</p> <p>法定代表人：<u>周慕冰</u></p>
<p>第十二部分 基金的投资</p> <p>二、投资范围</p>	<p>基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的比例占基金资产的0-95%，对于受益于混合所有制改革相关证券的投资比例不低于非现金基金资产的80%，本基金持有的现金或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>基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的比例占基金资产的0-95%，对于受益于混合所有制改革相关证券的投资比例不低于非现金基金资产的80%，本基金持有的现金或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>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</u></p>
<p>第十二部分 基金的投资</p> <p>四、投资限制</p>	<p>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>(2) 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>.....</p> <p>(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%；</p>	<p>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>(2) 保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，<u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</u></p> <p>.....</p> <p>(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%；<u>本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不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>.....</p> <p>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。</p>	<p>新增：</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本基金资产净值的 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前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u></p> <p><u>(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；</u></p> <p>.....</p> <p>除上述第 (2)、(12)、(17)、(18) 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。</p>
<p>第十四部分 基金资产估值</p> <p>三、估值方法</p>		<p>新增：</p> <p>6、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。</p>
<p>第十四部分 基金资产估值</p> <p>六、暂停估值的情形</p>		<p>新增：</p> <p>3、当前一估值日基金资产净值 50% 以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允</p>

		<u>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>
第十八部分 基金的信息披露 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	(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 新增： <u>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额20%的情形，为保障其他投资者利益，基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告文件中“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。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>
第十八部分 基金的信息披露 五、公开披露的基金信息	(七) 临时报告	(七) 临时报告 新增： <u>26、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；</u> <u>27、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；</u>

二、托管协议修改前后对照表

章节	修改前	修改后
一、基金托管协议	注册地址：上海市浦东新区银城中	注册地址： <u>中国（上海）自由贸易试</u>

<p>当事人</p> <p>(一) 基金管理人</p>	<p>路 68 号 2905-2908 室及 30 层</p> <p>法定代表人：黄鹏</p> <p>组织形式：有限责任公司</p> <p>经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务（涉及行政许可的凭许可证经营）。</p>	<p><u>验区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层</u></p> <p>法定代表人：杨皓鹏</p> <p>组织形式：有限责任公司(中外合资)</p> <p>经营范围：<u>基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其它业务</u></p> <p>【依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动】</p>
<p>一、基金托管协议当事人</p> <p>(二) 基金托管人</p>	<p>法定代表人：蒋超良</p>	<p>法定代表人：周慕冰</p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p> <p>(一)</p>	<p>本基金的配置比例为:本基金投资于股票的比例占基金资产的 0-95%，对于受益于混合所有制改革相关证券的投资比例不低于非现金基金资产的 80%，本基金持有的现金或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>本基金的配置比例为:本基金投资于股票的比例占基金资产的 0-95%，对于受益于混合所有制改革相关证券的投资比例不低于非现金基金资产的 80%，本基金持有的现金或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>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</u></p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</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>3、本基金与本基金管理人管理的、且由本基金托管人托管的其他基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过该证券的 10%；</p>	<p>3、本基金与本基金管理人管理的、且由本基金托管人托管的其他基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过该证券的 10%；<u>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(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家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</u></p>

	<p>.....</p> <p>8、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>.....</p> <p>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>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>.....</p> <p>8、保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，<u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</u></p> <p>新增：</p> <p><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本基金资产净值的 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前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u></p> <p><u>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>.....</p> <p><u>除上述第 8、10、11 项另有约定及第 7 项中另有约定外，</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>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p> <p>(七) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金投资流通受限证券进行监督。</p>	<p>2、流通受限证券,包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>	<p>2、流通受限证券<u>与上文所述的流动性受限资产并不完全一致</u>,包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>
<p>八、基金资产净值计算和会计核算</p> <p>(二) 基金资产估值方法和特殊情形的处理</p>	<p>2、估值方法</p>	<p>2、估值方法</p> <p>新增:</p> <p><u>(6) 当本基金发生大额申购或赎回情形时,基金管理人可以在履行适当程序后,采用摆动定价机制,以确保基金估值的公平性。</u></p>
<p>八、基金资产净值计算和会计核算</p> <p>(四) 暂停估值与公告基金份额净值的情形</p>		<p>新增:</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>

中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同和托管协议修订对照表

一、基金合同修改前后对照表

章节	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	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)和其他有关法律法规。	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、 <u>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</u> (以下简称“ <u>《流动性管理规定》</u> ”)和其他有关法律法规。
第一部分 前言		新增： <u>七、本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的除外。</u>
第二部分 释义		新增： <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日起实施的《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</u>

		<p>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>53、摆动定价机制:指当本基金遭遇大额申购赎回时,通过调整基金份额净值的方式,将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者,从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响,确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待</p>
<p>第六部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>五、申购和赎回的数量限制</p>		<p>新增:</p> <p>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。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要,可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告。</p>
<p>第六部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>六、申购和赎回的价格、费用及其用</p>	<p>5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用应根据法律法规规定的比例归入基</p>	<p>5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用应根据法律法规规定的比例归入基金财</p>

途	金财产，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。	产，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。 <u>其中对于持续持有期少于 7 日的投资者收取不少于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产。</u>
第六部分 基金份额的申购与赎回 六、申购和赎回的价格、费用及其用途		新增： <u>7、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，摆动定价机制的处理原则与操作规范参见法律法规和自律组织的规定，具体见基金管理人届时的相关公告。</u>
第六部分 基金份额的申购与赎回 七、拒绝或暂停申购的情形		新增： <u>7、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有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>8、申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单个投资人单日或单笔申购金额上限的。</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，基金管理人应当暂停接受申购申请。</u>
第六部分 基金份额的申购与赎回 七、拒绝或暂停申购的情形	发生上述第 1、2、3、5、6、7 项之一的情形且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公	发生上述第 1、2、3、5、6、 9、10 项之一的情形且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公

	告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。	告。如果投资人的申购申请被 <u>全部或部分拒绝的</u> ，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。
第六部分 基金份额的申购与赎回 八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形	发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：	发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项： 新增： <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，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。</u>
第六部分 基金份额的申购与赎回 九、巨额赎回的情形及处理方式	2、巨额赎回的处理方式	2、巨额赎回的处理方式 新增： <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%，基金管理人有权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%）的赎回申请与其他投资者的赎回申请按前述条款处理，具体见招募说明书或相关公告。</u>
第十二部分 基金的投资 二、投资范围	基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的比例占基金资产的 0-95%（其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的	基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的比例占基金资产的 0-95%（其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 0-95%，投

	<p>0-95%，投资于港股通标的股票的比例占基金资产的 0-95%)，本基金持有的现金或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>资于港股通标的股票的比例占基金资产的 0-95%)，本基金持有的现金或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>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</u></p>
<p>第十二部分 基金的投资 四、投资限制</p>	<p>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>(2) 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>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>(2) 保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，<u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</u></p> <p>新增：</p> <p><u>(17) 本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不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>(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本基金资产净值的 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前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u></p> <p><u>(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</u></p>

	<p>.....</p> <p>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。</p>	<p><u>易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；</u></p> <p>.....</p> <p><u>除上述第（2）、（12）、（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。</p>
<p>第十四部分 基金资产估值</p> <p>三、估值方法</p>		<p>新增：</p> <p><u>7、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。</u></p>
<p>第十四部分 基金资产估值</p> <p>六、暂停估值的情形</p>		<p>新增：</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>第十八部分 基金的信息披露</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</p> <p>新增：</p> <p><u>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者利益，基金管理人应当在季度报告、半</u></p>

		<p>年度报告、年度报告等定期报告文件中“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>第十八部分 基金的信息披露</p> <p>五、公开披露的基金信息</p>	(七) 临时报告	<p>(七) 临时报告</p> <p>新增:</p> <p>26、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时;</p> <p>27、基金管理人采用摆动定价机制进行估值;</p>

二、托管协议修改前后对照表

章节	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>注册地址: 上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层</p> <p>法定代表人: 黄鹏</p> <p>组织形式: 有限责任公司</p> <p>经营范围: 基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务(涉及行政许可的凭许可证经营)。</p>	<p>注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层</p> <p>法定代表人: 杨皓鹏</p> <p>组织形式: 有限责任公司(中外合资)</p> <p>经营范围: 基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其它业务</p> <p>【依法须经批准的项目,经相关部门批准后方可开展经营活动】</p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>	<p>本基金的配置比例为:本基金投资于股票的比例占基金资产的 0-95% (其中投资于国内依法发行上市的股票</p>	<p>本基金的配置比例为:本基金投资于股票的比例占基金资产的 0-95% (其中投资于国内依法发行上市的股票</p>

<p>(一)</p>	<p>股票的比例占基金资产的 0-95%，投资于港股通标的股票的比例占基金资产的 0-95%)，本基金持有的现金或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>的比例占基金资产的 0-95%，投资于港股通标的股票的比例占基金资产的 0-95%)，本基金持有的现金或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>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</u></p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</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>9、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>9、保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，<u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</u></p> <p>新增：</p> <p><u>11、本基金管理人管理且由本基金托管人托管的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不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>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本基金资产净值的 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前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u></p> <p><u>13、本基金与私募类证券资管产品及</u></p>

	<p>.....</p> <p>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>中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；</u></p> <p>.....</p> <p><u>除上述第 9、12、13 项另有约定及第 8 项中另有约定外</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>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p> <p>(七) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资流通受限证券进行监督。</p>	<p>2、流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>	<p>2、流通受限证券与上文所述的流动性受限资产并不完全一致，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>
<p>八、基金资产净值计算和会计核算</p> <p>(二) 基金资产估值方法和特殊情形的处理</p>	<p>2、估值方法</p>	<p>2、估值方法</p> <p>新增：</p> <p><u>(7) 当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。</u></p>
<p>八、基金资产净值计算和会计核算</p>		<p>新增：</p> <p><u>(3) 当前一估值日基金资产净值</u></p>

<p>(四) 暂停估值与公告基金份额净值的情形</p>		<p><u>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>
-----------------------------	--	--

中海魅力长三角灵活配置混合型证券投资基金基金合同和托管协议修订对照表

一、 基金合同修改前后对照表

章节	修改前	修订后
第一部分 前言	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》（以下简称“《合同法》”）、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）和其他有关法律法规。	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》（以下简称“《合同法》”）、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、 <u>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</u> （以下简称“ <u>《流动性风险管理规定》</u> ”）和其他有关法律法规。
第二部分 释义		新增： <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>
第二部分 释义		新增： <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</u>

		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。
第二部分 释义		<p>新增：</p> <p>52、摆动定价机制：指当本基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待</p>
第六部分 基金份额的申购与赎回 五、申购和赎回的数量限制		<p>新增：</p> <p>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。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告。</p>
第六部分 基金份额的申购与赎回 六、申购和赎回的价格、费用及其用途	5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用应根据法律法规规定的比例归入基金财产，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。	5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用应根据法律法规规定的比例归入基金财产，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。其中对于持续持有期少于 7 日的投资者收

		取不少于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产。
<p>第六部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p>		<p>新增：</p> <p>7、当发生大额申购或赎回情形时，按照法律法规及监管要求，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。</p>
<p>第六部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>七、拒绝或暂停申购的情形</p>		<p>新增：</p> <p>7、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有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。</p> <p>8、申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单个投资人单日或单笔申购金额上限的。</p> <p>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，基金管理人应当暂停接受申购申请。</p>
<p>第六部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>七、拒绝或暂停申购的情形</p>	<p>发生上述第 1、2、3、5、6、7 项之一的情形且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。</p>	<p>发生上述第 1、2、3、5、6、9、10 项之一的情形且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。</p>

<p>第六部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p>	<p>发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：</p>	<p>发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：</p> <p>新增：</p> <p>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，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。</p>
<p>第六部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>九、巨额赎回的情形及处理方式</p>	<p>2、巨额赎回的处理方式</p>	<p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>新增：</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个开放日基金总份额的 10%，基金管理人有权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%）的赎回申请与其他投资者的赎回申请按前述条款处理，具体见招募说明书或相关公告。</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</p>	<p>（一）基金管理人简况</p> <p>法定代表人：黄鹏</p>	<p>（一）基金管理人简况</p> <p>法定代表人：杨皓鹏</p>
<p>第七部分 基金合同当事人及权利义务</p> <p>二、基金托管人</p>	<p>法定代表人：田国立</p> <p>注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整</p>	<p>法定代表人：陈四清</p> <p>注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整</p>
<p>第十二部分 基金</p>	<p>基金的投资组合比例为：本基金投</p>	<p>基金的投资组合比例为：本基金投资</p>

<p>的投资</p> <p>二、投资范围</p>	<p>投资于股票的比例占基金资产的0-95%，对于注册地在长江三角洲地区或直接受益于长江三角洲地区经济发展的上市公司股票的投资比例不低于非现金基金资产的80%，本基金持有的现金或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>于股票的比例占基金资产的0-95%，对于注册地在长江三角洲地区或直接受益于长江三角洲地区经济发展的上市公司股票的投资比例不低于非现金基金资产的80%，本基金持有的现金或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>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</u></p>
<p>第十二部分 基金的投资</p> <p>四、投资限制</p>	<p>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>（2）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>（4）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%；</p>	<p>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>（2）保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，<u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</u></p> <p>（4）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%；<u>本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的15%；</u><u>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>新增：</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该基金资产净值的15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基</u></p>

	<p>.....</p> <p>因证券市场波动、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，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>金管理人之外的因素致使基金不符合前述所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u></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>.....</p> <p><u>除上述第 (2) (12)、(16)、(17) 项外</u>，因证券市场波动、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，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>第十四部分 基金资产估值</p> <p>三、估值方法</p>		<p>新增：</p> <p><u>6、当发生大额申购或赎回情形时，按照法律法规及监管要求，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。</u></p>
<p>第十四部分 基金资产估值</p> <p>六、暂停估值的情形</p>		<p>新增：</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</u></p>

		<u>暂停基金估值；</u>
第十八部分 基金的信息披露 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	(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 新增： <u>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者利益，基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告文件中“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>
第十八部分 基金的信息披露 五、公开披露的基金信息	(七) 临时报告	(七) 临时报告 新增： <u>26、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；</u> <u>27、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；</u>

二、 托管协议修改前后对照表

章节	修改前	修改后
一、托管协议当事人 (一) 基金管理人 (或简称“管理人”)	法定代表人：黄鹏	法定代表人：杨皓鹏
一、托管协议当事人	法定代表人：田国立	法定代表人：陈四清

<p>(二) 基金托管人 (或简称“托管人”)</p>	<p>注册资本：人民币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</p>	<p>注册资本：<u>人民币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</u></p>
<p>二、托管协议的依据、目的、原则和解释</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》”)及其他有关法律法规与《中海魅力长三角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《中海魅力长三角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>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p> <p>(一)基金托管人根据有关法律法规的规定对基金管理人的下列投资运作进行监督：</p>	<p>基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的比例占基金资产的 0-95%，对于注册地在长江三角洲地区或直接受益于长江三角洲地区经济发展的上市公司股票的投资比例不低于非现金基金资产的 80%，本基金持有的现金或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>基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的比例占基金资产的 0-95%，对于注册地在长江三角洲地区或直接受益于长江三角洲地区经济发展的上市公司股票的投资比例不低于非现金基金资产的 80%，本基金持有的现金或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>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</u></p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p> <p>(一)基金托管人根据有关法律法规的规定对基金管理人的下列投资运作进行监督：</p>	<p>2、对基金投资比例进行监督：</p> <p>(1) 组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>2) 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>4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证</p>	<p>2、对基金投资比例进行监督：</p> <p>(1) 组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>2) 保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，<u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</u></p> <p>4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；<u>本基金管理人管理的且由本托</u></p>

	<p>券的 10%；</p> <p>.....</p> <p>因证券市场波动、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</p>	<p><u>管人托管的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不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>新增：</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该基金资产净值的 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前述所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u></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。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与本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或损失。</u></p> <p>.....</p> <p><u>除上述第 2)、12)、16)、17) 项外，</u></p> <p>因证券市场波动、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</p>
--	---	---

	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。	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。
--	--	---

中海添顺定期开放混合型证券投资基金基金合同和托管协议修订对照表

三、基金合同修改前后对照表

章节		修订内容
第一部分 前言 一、订立本基金合同的目的、依据和原则	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》（以下简称“《合同法》”）、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）和其他有关法律、法规。	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》（以下简称“《合同法》”）、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、 <u>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</u> （以下简称“ <u>《流动性风险管理规定》</u> ”）和其他有关法律、法规。
第一部分 前言		新增： <u>六、本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的 50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过 50%的除外。</u>
第二部分 释义		新增： <u>13、《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》及颁布机关对其不时做出的修订</u>
第二部分 释义		新增： <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</u>

		<u>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>
第二部分 释义		<p>新增：</p> <p>54、<u>摆动定价机制：指当本基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待</u></p>
第六部分 基金份额的申购与赎回 五、申购和赎回的数量限制		<p>新增：</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。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告。</u></p>
第六部分 基金份额的申购与赎回 六、申购和赎回的价格、费用及其用途	5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用应根据法律法规规定的比例归入基金财产，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。	5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用应根据法律法规规定的比例归入基金财产，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。 <u>其中对于持续持有期少于7日的投资者收取不少于1.5%的赎回费并全额计入基金财产。</u>
第六部分 基金		新增：

<p>份额的申购与赎回</p> <p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p>		<p><u>7、当发生大额申购或赎回情形时，按照法律法规及监管要求，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。</u></p>
<p>第六部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>七、拒绝或暂停申购的情形</p>		<p>新增：</p> <p><u>7、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有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、申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单个投资人单日或单笔申购金额上限的。</u></p> <p><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，基金管理人应当暂停接受申购申请。</u></p>
<p>第六部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>七、拒绝或暂停申购的情形</p>	<p>发生上述第 1、2、3、5、6、7 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。开放期内因发生不可抗力等原因而发生暂停申购情形的，开放期将按因不可抗力而暂停申购的时间相应延长。</p>	<p>发生上述第 1、2、3、5、6、<u>9、10</u> 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被<u>全部或部分</u>拒绝的，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。开放期内因发生不可抗力等原因而发生暂停申购情形的，开放期将按因不可抗力而暂停申购的时间相应延长。</p>
<p>第六部分 基金份额的申购与赎回</p>	<p>在开放期内发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：</p>	<p>在开放期内发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：</p>

<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p>		<p>新增：</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，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。</u></p>
<p>第六部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>九、巨额赎回的情形及处理方式</p>	<p>当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或延缓支付赎回款项。</p> <p>.....</p> <p>当发生延缓支付赎回款项时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同</p>	<p>当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回、<u>延缓支付赎回款项或部分延期赎回。</u></p> <p>新增：</p> <p><u>(3) 在开放期内，若本基金发生巨额赎回且在单个基金份额持有人的赎回申请超过上一个开放日基金总份额的 10%，基金管理人有权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%）的赎回申请与其他投资者的赎回申请按前述条款处理，具体见招募说明书或相关公告。如开放期最后一个工作日，仍出现前述情形，开放期相应延长，延长的开放期内不办理申购，亦不接受新的赎回申请，即基金管理人仅为原开放期内因提交赎回申请超过基金总份额 10%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></p> <p>.....</p> <p>当发生延缓支付赎回款项<u>或延期办理</u>时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关</p>

	时在指定媒介上刊登公告。	处理方法，同时在指定媒介上刊登公告。
第七部分 基金合同当事人及权益义务 一、基金管理人	法定代表人：黄鹏	法定代表人： 杨皓鹏
第七部分 基金合同当事人及权益义务 二、基金托管人	法定代表人：田国立 注册资本：人民币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	法定代表人： 陈四清 注册资本： 人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整
第十二部分 基金的投资 二、投资范围	基金的投资组合比例为：本基金投资于股票等权益类资产的比例不超过基金资产的 30%，投资于债券等固定收益类金融工具的比例不低于基金资产的 70%。开放期内，每个交易日日终在扣除股指期货合约所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%，在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制，但每个交易日日终在扣除股指期货需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。	基金的投资组合比例为：本基金投资于股票等权益类资产的比例不超过基金资产的 30%，投资于债券等固定收益类金融工具的比例不低于基金资产的 70%。开放期内，每个交易日日终在扣除股指期货合约所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%，在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制，但每个交易日日终在扣除股指期货需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金， 前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。
第十二部分 基金的投资 四、投资限制	1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： （2）开放期内，每个交易日日终在扣除股指期货合约所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%，在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制，但每个交易日日终在扣除股指期货需缴纳的交易保证金后，应当保	1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： （2）开放期内，每个交易日日终在扣除股指期货合约所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%，在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制，但每个交易日日终在扣除股指期货需缴纳的交易保证金后，应

	<p>持不低于交易保证金一倍的现金；</p> <p>(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；</p> <p>.....</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，除上述第(12)项约定外，基金管理人应当在 10 个交易日内</p>	<p>当保持不低于交易保证金一倍的现金； <u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</u></p> <p>(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；<u>本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不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>新增：</p> <p><u>(18) 在开放期内，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 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前述所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u></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>.....</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，除上述第<u>(2)</u>、(12)、<u>(18)</u>、<u>(19)</u>项约定外，基金管理人应</p>
--	---	---

	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。	当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。
第十四部分 基金资产估值 三、估值方法		新增： <u>8、当发生大额申购或赎回情形时，按照法律法规及监管要求，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。</u>
第十四部分 基金资产估值 六、暂停估值的情形		新增： <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>
第十八部分 基金的信息披露 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	(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 新增： <u>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20%的情形，为保障其他投资者利益，基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告文件中“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>
第十八部分 基金的信息披露 五、公开披露的	(七) 临时报告	(七) 临时报告 新增： <u>25、发生涉及基金申购、赎回事项调整</u>

基金信息		<u>或潜在影响投资者赎回等重大事项时；</u> <u>26、基金管理人采用摆动定价机制进行</u> <u>估值；</u>
------	--	---

四、 基金合同修改前后对照表

章节	修改前	修改后
一、托管协议当事人 (一) 基金管理人(或简称“管理人”)	法定代表人：黄鹏	法定代表人： <u>杨皓鹏</u>
一、托管协议当事人 (二) 基金托管人(或简称“托管人”)	法定代表人：田国立 注册资本：人民币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	法定代表人： <u>陈四清</u> 注册资本： <u>人民币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>
二、托管协议的依据、目的、原则和解释 (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《中海添顺定期开放混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)订立。	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《中海添顺定期开放混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)订立。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查 (一) 基金托管人根据有关法律法规的规定对基	1、对基金的投资范围、投资对象进行监督： …… 基金的投资组合比例为：本基金投资于股票等权益类资产的比例不超过基金资产的 30%，投资于债券等固定收益类	1、对基金的投资范围、投资对象进行监督： …… 基金的投资组合比例为：本基金投资于股票等权益类资产的比例不超过基金资产的 30%，投资于债券等固定收益类

<p>基金管理人的下列投资运作进行监督：</p>	<p>金融工具的比例不低于基金资产的70%。开放期内，每个交易日日终在扣除股指期货合约所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%，在封闭期内，本基金不受上述5%的限制，但每个交易日日终在扣除股指期货需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。</p>	<p>金融工具的比例不低于基金资产的70%。开放期内，每个交易日日终在扣除股指期货合约所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%，在封闭期内，本基金不受上述5%的限制，但每个交易日日终在扣除股指期货需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。<u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</u></p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p> <p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定对基金管理人的下列投资运作进行监督：</p>	<p>2、对基金投资比例进行监督：</p> <p>(1) 组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>2) 开放期内，每个交易日日终在扣除股指期货合约所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%，在封闭期内，本基金不受上述5%的限制，但每个交易日日终在扣除股指期货需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；</p>	<p>2、对基金投资比例进行监督：</p> <p>(1) 组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>2) 开放期内，每个交易日日终在扣除股指期货合约所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%，在封闭期内，本基金不受上述5%的限制，但每个交易日日终在扣除股指期货需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；<u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</u></p> <p>新增：</p> <p><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(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的15%；</u> <u>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</u></p>

	<p>.....</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，除上述第 9) 项约定外，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。</p>	<p><u>司可流通股票的 30%；</u></p> <p><u>16) 在开放期内，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 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前述所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u></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；。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与本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或损失。</u></p> <p>.....</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，除上述第 9) 项约定外，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。”</p>
--	---	---

中海优质成长证券投资基金基金合同和托管协议修订对照表

一、基金合同修改前后文对照表

章节	修改前	修改后
释义		<p>新增： <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、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等。</u></p> <p><u>摆动定价机制指当本基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待。</u></p>
前言		<p>新增： <u>本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的 50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过 50%的除外。</u></p>
第五部分 基金成立后的申购与赎回 五、申购与赎回的程序		<p>新增： <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。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告。</u></p>

<p>第五部分 基金成立后的申购与赎回 七、申购与赎回的费率</p>	<p>2、赎回费用 投资者可将其持有的全部或部分基金单位赎回，但要缴纳一定的赎回费用。本基金的赎回费率随赎回基金份额持有年份的增加而递减，赎回费率最高不超过 0.5%。具体费用安排见下表：</p> <p>表二：中海优质成长证券投资基金赎回费用一览表</p> <table border="1" data-bbox="451 583 841 886"> <thead> <tr> <th>费率名称 费率 (%)</th> <th>费率 (%)</th> <th>持有期限</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td rowspan="3">日常赎回费</td> <td>0.5</td> <td>持有期 < 1</td> </tr> <tr> <td>0.3</td> <td>1 ≤ 持有期 < 3</td> </tr> <tr> <td>0</td> <td>持有期 ≥ 3</td> </tr> </tbody> </table> <p>赎回费用由赎回人承担。赎回费的 25% 归基金资产，75% 用于支付注册登记费和其他必要的手续费。</p>	费率名称 费率 (%)	费率 (%)	持有期限	日常赎回费	0.5	持有期 < 1	0.3	1 ≤ 持有期 < 3	0	持有期 ≥ 3	<p>2、赎回费用 投资者可将其持有的全部或部分基金单位赎回，但要缴纳一定的赎回费用。本基金的赎回费率随赎回基金份额持有年份的增加而递减，<u>对于持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费；对于持续持有期不少于 7 日的投资者收取的赎回费率最高不超过 0.5%。</u>具体费用安排见下表：</p> <p>表二：中海优质成长证券投资基金赎回费用一览表</p> <table border="1" data-bbox="933 583 1383 919"> <thead> <tr> <th>费率名称 费率 (%)</th> <th>费率 (%)</th> <th>持有期限</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td rowspan="4">日常赎回费</td> <td>1.5</td> <td>持有期限 < 7 天</td> </tr> <tr> <td>0.5</td> <td>7 天 ≤ 持有期 < 1 年</td> </tr> <tr> <td>0.3</td> <td>1 年 ≤ 持有期 < 3 年</td> </tr> <tr> <td>0</td> <td>持有期 ≥ 3 年</td> </tr> </tbody> </table> <p>赎回费用由赎回人承担。其中，<u>对于持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费并全额计入基金财产；对于持续持有期不少于 7 日的投资者收取的赎回费，</u>赎回费的 25% 归基金资产，75% 用于支付注册登记费和其他必要的手续费。</p>	费率名称 费率 (%)	费率 (%)	持有期限	日常赎回费	1.5	持有期限 < 7 天	0.5	7 天 ≤ 持有期 < 1 年	0.3	1 年 ≤ 持有期 < 3 年	0	持有期 ≥ 3 年
费率名称 费率 (%)	费率 (%)	持有期限																						
日常赎回费	0.5	持有期 < 1																						
	0.3	1 ≤ 持有期 < 3																						
	0	持有期 ≥ 3																						
费率名称 费率 (%)	费率 (%)	持有期限																						
日常赎回费	1.5	持有期限 < 7 天																						
	0.5	7 天 ≤ 持有期 < 1 年																						
	0.3	1 年 ≤ 持有期 < 3 年																						
	0	持有期 ≥ 3 年																						
<p>第五部分 基金成立后的申购与赎回 七、申购与赎回的费率</p>		<p>新增： <u>4、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，摆动定价机制的处理原则与操作规范参见法律法规和自律组织的规定，具体见基金管理人届时的相关公告。</u></p>																						
<p>第五部分 基金成立后的申购与赎回 九、拒绝或暂停申购、赎回的情形及处理方式</p>	<p>1、拒绝或暂停申购</p>	<p>1、拒绝或暂停申购 新增： <u>(6) 基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有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>(7) 申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单个投资人单日或单笔申购金额上限的；</u> <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</u></p>																						

	<p>.....</p> <p>发生上述（1）至（4）项或（6）项情形时，基金管理人应立即报中国证监会备案，并在指定媒体上刊登暂停申购的公告。</p> <p>发生上述（5）项情形时，基金管理人应将申购款项全额退还给基金投资者。</p>	<p><u>价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受申购申请；</u></p> <p>.....</p> <p>发生上述（1）至（4）项或（8）、（9）项情形时，基金管理人应立即报中国证监会备案，并在指定媒体上刊登暂停申购的公告。</p> <p>发生上述（5）、（6）、（7）项情形时，基金管理人应将申购款项<u>相应</u>退还给基金投资者。</p>
<p>第五部分</p> <p>基金成立后的申购与赎回</p> <p>九、拒绝或暂停申购、赎回的情形及处理方式</p>	2、暂停赎回	<p>2、暂停赎回</p> <p>新增：</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，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请；</u></p>
<p>第五部分</p> <p>基金成立后的申购与赎回</p> <p>十、巨额赎回的情形及处理方式</p>	2、巨额赎回的处理方式	<p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>新增：</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 10%，基金管理人有权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%）的赎回申请与其他投资者的赎回申请按前述条款处理，具体见招募说明书或相关公告。</u></p>
<p>第九部分</p> <p>基金的投资</p> <p>七、投资组合限制</p>	<p>2、本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；</p> <p>.....</p>	<p>2、本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；<u>本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不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>.....</p> <p>新增：</p> <p><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本基金资产净值</u></p>

	<p>.....</p> <p>本基金建仓期完成后应达到上述比例限制。由于基金规模或市场的变化导致的投资组合超过上述约定的比例不在限制之内，但基金管理人应在合理期限内进行调整，以达到标准。法律法规或监管部门对上述比例另有规定时从其规定。</p>	<p>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前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p><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></p> <p>.....</p> <p>本基金建仓期完成后应达到上述比例限制。<u>除上述第 4、5 项外</u>，由于基金规模或市场的变化导致的投资组合超过上述约定的比例不在限制之内，但基金管理人应在合理期限内进行调整，以达到标准。法律法规或监管部门对上述比例另有规定时从其规定。</p>
第九部分 基金的投资 八、投资组合	<p>本基金投资于股票的比例为 30~95%；债券和现金的比例为 5~70%，其中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>本基金投资于股票的比例为 30~95%；债券和现金的比例为 5~70%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，<u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</u></p>
第十七部分 基金资产估值 二、基金资产估值事项	<p>(二) 估值方法</p>	<p>(二) 估值方法</p> <p>新增：</p> <p><u>4、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。</u></p>
第十七部分 基金资产的估值 二、基金资产估值事项	<p>(六) 暂停估值的情形</p>	<p>(六) 暂停估值的情形</p> <p>新增：</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一致的，基金管理人应当暂停基金估值。</u></p>
第二十一部分 基金的信息披露 三、定期报告		<p>新增：</p> <p><u>6、报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20%的情形，为保障其他投资者利益，基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告文件中“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</u></p>

		<p>情况及本基金的特定风险。</p> <p><u>7、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>第二十一部分 基金的信息披露</p> <p>四、基金的临时报告与公告</p>		<p>新增：</p> <p><u>18、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；</u></p> <p><u>19、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；</u></p>

二、托管协议修改前后文对照表

章节	修改前	修改后
七、基金资产净值计算与会计核算	<p>(一) 基金资产净值及基金份额净值的计算与复核</p> <p>……</p> <p>本基金按以下方法估值：</p>	<p>(一) 基金资产净值及基金份额净值的计算与复核</p> <p>……</p> <p>本基金按以下方法估值：</p> <p>新增：</p> <p><u>(6) 当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。</u></p>

中海惠利纯债分级债券型证券投资基金基金合同和托管协议修订对照表

一、基金合同修改前后文对照表

章节	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	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)和其他有关法律、法规和规章。	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、 <u>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</u> (以下简称“ <u>《流动性风险管理规定》</u> ”)和其他有关法律、法规和规章。
第一部分 前言		新增： <u>六、本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的除外。</u>
第二部分 释义		新增： <u>16、《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作出的修订</u> <u>85、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</u>

		<p>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>86、摆动定价机制：指当本基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待</p>
<p>第八部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>一、基金合同生效后分级运作周期内基金份额的申购与赎回</p>	<p>（五）申购和赎回的数量限制</p>	<p>（五）申购和赎回的数量限制</p> <p>新增：</p> <p>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。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告。</p>
<p>第八部分 基金份额的申购与赎回</p>	<p>（六）申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>5、赎回费用由赎回基金份额的基金份</p>	<p>（六）申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>5、赎回费用由赎回基金份额的基金</p>

<p>一、基金合同生效后分级运作周期内基金份额的申购与赎回</p>	<p>额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。不低于赎回费总额的 50%应归基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。</p> <p>6、本基金的申购费用最高不超过申购金额的 5%，赎回费用最高不超过赎回金额的 5%。本基金的申购费率、申购份额具体的计算方法、赎回费率、赎回金额具体的计算方法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。基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。</p>	<p>份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。<u>其中对于持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费将全额计入基金财产；对于持续持有期不少于 7 日的投资者</u>，不低于赎回费总额的 50%应归基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。</p> <p>6、本基金的申购费用最高不超过申购金额的 5%，赎回费用最高不超过赎回金额的 5%，<u>其中对于持续持有期少于 7 日的投资者收取不少于 1.5%的赎回费</u>。本基金的申购费率、申购份额具体的计算方法、赎回费率、赎回金额具体的计算方法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。基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。</p> <p>新增：</p> <p><u>7、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，摆动定价机制的处理原则与操作规范参见法律法规和自律组织的规定，具体见基金管理人届时的相关公告。</u></p>
<p>第八部分 基金</p>	<p>(七) 拒绝或暂停申购的情形</p>	<p>(七) 拒绝或暂停申购的情形</p>

<p>份额的申购与赎回</p> <p>一、基金合同生效后分级运作周期内基金份额的申购与赎回</p>	<p>发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人对惠利 A 份额、惠利 B 份额的申购申请：</p> <p>.....</p> <p>发生上述第 1、2、3、5、6 项暂停申购情形时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。</p>	<p>发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人对惠利 A 份额、惠利 B 份额的申购申请：</p> <p>新增：</p> <p>6、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有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。</p> <p>7、申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单个投资人单日或单笔申购金额上限的。</p> <p>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，基金管理人应当暂停接受申购申请。</p> <p>.....</p> <p>发生上述第 1、2、3、5、8、9 项暂停申购情形时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。</p>
<p>第八部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>一、基金合同生效后分级运作周</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>新增：</p> <p>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</p>

<p>期内基金份额的 申购与赎回</p>		<p><u>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，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。</u></p>
<p>第八部分 基金份额的申购与赎回 一、基金合同生效后分级运作周期内基金份额的申购与赎回</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 新增： <u>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日基金总份额的 10%，基金管理人有权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%）的赎回申请与其他投资者的赎回申请按前述条款处理，具体见招募说明书或相关公告。</u></p>
<p>第十四部分 基金的投资 二、投资范围</p>	<p>基金的投资组合比例为：本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%，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>基金的投资组合比例为：本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%，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%，<u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</u></p>
<p>第十四部分 基金的投资 四、投资限制</p>	<p>1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： …… (2) 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>1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： …… (2) 保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，<u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</u> ……</p>

<p>(4)本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；</p> <p>.....</p> <p>因证券市场波动、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。</p>	<p>(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；<u>本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不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>新增：</p> <p><u>(14) 开放日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 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前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u></p> <p><u>(15) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；</u></p> <p>.....</p> <p><u>除上述第（2）、（11）、（14）、（15）项外，</u>因证券市场波动、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</p>
---	---

		投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。
第十六部分 基金资产估值 三、估值方法		<p>新增：</p> <p><u>6、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。</u></p>
第十六部分 基金资产估值 六、暂停估值的情形		<p>新增：</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>
第二十部分 基金的信息披露 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>(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>新增：</p> <p><u>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者权益，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“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>第二十部分 基金的信息披露</p> <p>五、公开披露的基金信息</p>	<p>(七) 临时报告</p>	<p>(七) 临时报告</p> <p>新增：</p> <p>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时；</p> <p>30、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；</p>
<p>第二十三部分 分级运作周期到期</p> <p>二、每两个分级运作周期期间的过渡期</p>	<p>3、过渡期基金份额的申购与赎回原则</p>	<p>3、过渡期基金份额的申购与赎回原则</p> <p>新增：</p> <p>(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。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告。</p>
<p>第二十三部分 分级运作周期到期</p> <p>二、每两个分级运作周期期间的过渡期</p>	<p>5、过渡期申购与赎回的费用</p> <p>(2) 赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。不低于赎回费总额的 50%应归基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。</p> <p>(3) 本基金的申购费用最高不超过申购金额的 5%，赎回费用最高不超过赎</p>	<p>5、过渡期申购与赎回的费用</p> <p>(2) 赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对于持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费将全额计入基金财产；对于持续持有期不少于 7 日的投资者，不低于赎回费总额的 50%应归基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。</p> <p>(3) 本基金的申购费用最高不超过申购金额的 5%，赎回费用最高不超</p>

	<p>回金额的 5%。本基金的申购费率、申购份额具体的计算方法、赎回费率、赎回金额具体的计算方法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。基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。</p> <p>.....</p> <p>7、申购份额与赎回金额的计算</p> <p>(3) 赎回金额的计算及处理方式：惠利 B 份额的赎回金额的计算详见《招募说明书》。惠利 B 份额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，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益</p>	<p>过赎回金额的 5%，<u>其中对于持续持有期少于 7 日的投资者收取不少于 1.5%的赎回费</u>。本基金的申购费率、申购份额具体的计算方法、赎回费率、赎回金额具体的计算方法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。基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。</p> <p>新增：</p> <p><u>(4) 当过渡期内本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，摆动定价机制的处理原则与操作规范参见法律法规和自律组织的规定，具体见基金管理人届时的相关公告。</u></p> <p>.....</p> <p>7、申购份额与赎回金额的计算</p> <p>(3) 赎回金额的计算及处理方式：惠利 B 份额的赎回金额的计算详见《招募说明书》。惠利 B 份额的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。<u>其中对于持续持有期少于 7 日的惠利 B 份额投资者收取不少于 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</p>
--	--	--

	或损失由基金财产承担。	除相应的费用，赎回金额单位为元。 上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。
--	-------------	---

二、托管协议修改前后文对照表

章节	修改前	修改后
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查 (二)	本基金的投融资比例：本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%，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%。	本基金的投融资比例：本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%，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%， <u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</u>
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查 (二)	本基金投资组合遵循以下投资限制： …… 2、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； …… 4、本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；	基金的投资组合应遵循以下限制： …… 2、保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券， <u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</u> …… 4、本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%； <u>本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；</u> <u>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> <p>因证券市场波动、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。</p>	<p>新增：</p> <p><u>14、开放日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 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前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u></p> <p><u>15、本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；</u></p> <p>.....</p> <p><u>除上述第 2、11、14、15 项外，</u>因证券市场波动、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。</p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p> <p>（七）本基金投资流通受限证券，应遵守《关于规范基金投资非公开发行股票行为的紧急通</p>	<p>1、本协议所称的流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>	<p>1、本协议所称的流通受限证券<u>与上文所述的流动性受限资产并不完全一致</u>，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通</p>

<p>知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。</p>		<p>受限证券。</p>
<p>八、基金资产净值计算和会计核算</p> <p>（四）暂停估值与公告基金份额净值的情形</p>		<p>新增：</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>十、基金信息披露</p> <p>（三）基金托管人和基金管理人在信息披露中的职责和信息披露程序</p>	<p>1、职责</p> <p>.....</p> <p>当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金相关信息：</p>	<p>1、职责</p> <p>.....</p> <p>当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金相关信息：</p> <p>新增：</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后暂停基金估值的；</u></p>

中海合鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同和托管协议修订对照表

一、基金合同修改前后文对照表

章节	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	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)和其他有关法律法规。	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、 <u>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性管理规定》”)</u> 和其他有关法律法规。
第一部分 前言		新增： <u>六、本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的除外。</u>
第二部分 释义		新增： <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日起实施的《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>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</u>

		<p>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>52、摆动定价机制：指当本基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待</p>
<p>第六部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>五、申购和赎回的数量限制</p>		<p>新增：</p> <p>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。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告。</p>
<p>第六部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>六、申购和赎回</p>	<p>5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用应根据法律法规规定的比例归入基金财产，</p>	<p>5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用应根据法律法规规定的比例归入基金财</p>

<p>的价格、费用及其用途</p>	<p>未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。</p>	<p>产，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。<u>其中对于持续持有期少于7日的投资者收取不少于1.5%的赎回费并全额计入基金财产。</u></p>
<p>第六部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p>		<p>新增：</p> <p><u>7、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，摆动定价机制的处理原则与操作规范参见法律法规和自律组织的规定，具体见基金管理人届时的相关公告。</u></p>
<p>第六部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>七、拒绝或暂停申购的情形</p>		<p>新增：</p> <p><u>7、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有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、申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单个投资人单日或单笔申购金额上限的。</u></p> <p><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，基金管理人应当暂停接受申购申请。</u></p>
<p>第六部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>七、拒绝或暂停</p>	<p>发生上述第1、2、3、5、6、7项之一的情形且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果</p>	<p>发生上述第1、2、3、5、6、9、10项之一的情形且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公</p>

申购的情形	投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。	告。如果投资人的申购申请被 <u>全部或部分</u> 拒绝的，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。
第六部分 基金份额的申购与赎回 八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形		新增： <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，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。</u>
第六部分 基金份额的申购与赎回 九、巨额赎回的情形及处理方式	2、巨额赎回的处理方式	2、巨额赎回的处理方式 新增： <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%，基金管理人有权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%）的赎回申请与其他投资者的赎回申请按前述条款处理，具体见招募说明书或相关公告。</u>
第十二部分 基金的投资 二、投资范围	基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的比例占基金资产的 0-95%，本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。	基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的比例占基金资产的 0-95%，本基金持有的现金或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>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</u>
第十二部分 基	1、组合限制	1、组合限制

<p>金的投资</p> <p>四、投资限制</p>	<p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>……</p> <p>(2) 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>……</p> <p>(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；</p>	<p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>……</p> <p>(2) 保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，<u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</u></p> <p>……</p> <p>(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；<u>本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；</u><u>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>新增：</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本基金资产净值的 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前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u></p> <p><u>(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</u></p>
----------------------------------	---	--

	<p>.....</p> <p>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。</p>	<p><u>定的投资范围保持一致;</u></p> <p>.....</p> <p>除上述第 <u>(2)、(12)、(16)、(17)</u> 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。</p>
<p>第十四部分 基金资产估值</p> <p>三、估值方法</p>		<p>新增:</p> <p><u>5、当本基金发生大额申购或赎回情形时,基金管理人可以在履行适当程序后,采用摆动定价机制,以确保基金估值的公平性。</u></p>
<p>第十四部分 基金资产估值</p> <p>六、暂停估值的情形</p>		<p>新增:</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>第十八部分 基金的信息披露</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</p> <p>新增:</p> <p><u>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20%的情形,为保障其他投资者利益,基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告文件中“影响投资者决策的其他重要信息”</u></p>

		<p>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>第十八部分 基金的信息披露</p> <p>五、公开披露的基金信息</p>	(七) 临时报告	<p>(七) 临时报告</p> <p>新增：</p> <p>26、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；</p> <p>27、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；</p>

二、托管协议修改前后文对照表

章节	修改前	修改后
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p> <p>(一)</p> <p>2. 本基金各类品种的投资比例、投资限制为：</p>	<p>2. 本基金各类品种的投资比例、投资限制为：</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的比例占基金资产的 0-95%，本基金持有的现金或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. 本基金各类品种的投资比例、投资限制为：</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的比例占基金资产的 0-95%，本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p> <p>(一)</p> <p>2. 本基金各类品种的投资比例、</p>	<p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>……</p> <p>(2) 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>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>……</p> <p>(2) 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，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</p>

<p>投资限制为:</p>	<p>.....</p> <p>(4)本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券,不超过该证券的 10%;</p> <p>.....</p> <p>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</p>	<p>.....</p> <p>(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券,不超过该证券的 10%; <u>本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票,不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>新增:</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本基金资产净值的 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前款所规定比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;</u></p> <p><u>(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>.....</p> <p><u>除上述第 (2)、(12)、(16)、(17)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比例不符</p>
---------------	--	--

	的特殊情形除外。	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。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	<p>（五）本基金投资流通受限证券，应遵守《关于规范基金投资非公开发行证券行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。</p> <p>1.本协议所称的流通受限证券，包括在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>	<p>（五）本基金投资流通受限证券，应遵守《关于规范基金投资非公开发行证券行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。</p> <p>1. 本协议所称的流通受限证券<u>与上文所述的流动性受限资产并不完全一致</u>，包括在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>
十、基金信息披露 （三）基金托管人和基金管理人在信息披露中的职责和信息披露程序	<p>1.职责</p> <p>.....</p> <p>当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金相关信息：</p>	<p>1.职责</p> <p>.....</p> <p>当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金相关信息：</p> <p>新增：</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后暂停基金估值的；</u></p>

中海惠裕纯债债券型发起式证券投资基金（LOF）基金合同和托管协议修订对照表

一、基金合同修改前后文对照表

章节	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	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》（以下简称“《合同法》”）、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）和其他有关法律法规。	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》（以下简称“《合同法》”）、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、 <u>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</u> （以下简称“ <u>《流动性风险管理规定》</u> ”）和其他有关法律法规。
第一部分 前言		新增： <u>五、本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的除外。</u>
第二部分 释义		新增： <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日起实施的《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>55、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</u>

		<p>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>56、摆动定价机制：指当本基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待</p>
<p>第八部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>二、基金合同生效后 3 年期届满并进行基金转换后的申购与赎回</p>	<p>(五) 申购和赎回的数量限制</p>	<p>(五) 申购和赎回的数量限制</p> <p>新增：</p> <p>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。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告。</p>
<p>第八部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>二、基金合同生效后 3 年期届满</p>	<p>(六) 申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。不低于赎回费总</p>	<p>(六) 申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。其中对持续持</p>

<p>并进行基金转换后的申购与赎回</p>	<p>额的 25%应归基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。</p>	<p><u>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；对于持续持有期不少于 7 日的投资者收取的赎回费，不低于赎回费总额的 25%应归基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。</u></p> <p>新增：</p> <p><u>7、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，摆动定价机制的处理原则与操作规范参见法律法规和自律组织的规定，具体见基金管理人届时的相关公告。</u></p>
<p>第八部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>二、基金合同生效后 3 年期届满并进行基金转换后的申购与赎回</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>新增：</p> <p><u>6、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有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>7、申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单个投资人单日或单笔申购金额上限的。</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，基金管理人应当暂停接受申购申请。</u></p> <p>.....</p> <p>发生上述第 1、2、3、5、8、9 项暂</p>

	<p>发生上述第 1、2、3、5、6 项暂停申购情形时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。</p>	<p>停申购情形时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被<u>全部或部分拒绝的</u>，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。</p>
<p>第八部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>二、基金合同生效后 3 年期届满并进行基金转换后的申购与赎回</p>	<p>(八) 暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：</p>	<p>(八) 暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：</p> <p>新增：</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，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。</u></p>
<p>第八部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>二、基金合同生效后 3 年期届满并进行基金转换后的申购与赎回</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>(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>新增：</p> <p><u>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%，基金管理人有权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%）的赎回申请与其他投资者的赎回申请按前述条款处理，具体</u></p>

		<u>见招募说明书或相关公告。</u>
第十六部分 基金的投资 二、投资范围	基金的投资组合比例为：本基金投资于固定收益类金融工具的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于中小企业私募债券的比例不高于基金资产净值的 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%。	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比例不低于基金资产的 80%，其中投资于中小企业私募债券的比例不高于基金资产净值的 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%， <u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</u>
第十六部分 基金的投资 四、投资限制	<p>(一) 组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>1、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>.....</p> <p>因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对</p>	<p>(一) 组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>1、保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，<u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</u></p> <p>新增：</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本基金资产净值的 15%。因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u></p> <p><u>14、本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；</u></p> <p>.....</p> <p><u>除上述第 1、9、13、14 项外，</u>因证券市场波动、上市公司合并、基金规</p>

	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。	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。
第十八部分 基金资产估值 三、估值方法		新增: <u>6、当本基金发生大额申购或赎回情形时,基金管理人可以在履行适当程序后,采用摆动定价机制,以确保基金估值的公平性。</u>
第十八部分 基金资产估值 六、暂停估值的情形		新增: <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>
第二十二部分 基金的信息披露 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	(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 新增: <u>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20%的情形,为保障其他投资者利益,基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告文件中“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</u>

		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。
第二十二部分 基金的信息披露 五、公开披露的 基金信息	(七) 临时报告	(七) 临时报告 新增： 31、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时； 32、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；

二、托管协议修改前后文对照表

章节	修改前	修改后
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查 (二)	本基金的投融资比例：本基金投资于固定收益类金融工具的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于中小企业私募债券的比例不高于基金资产净值的 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%。	本基金的投融资比例：本基金投资于固定收益类金融工具的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于中小企业私募债券的比例不高于基金资产净值的 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%， 前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查 (二)	本基金投资组合遵循以下投资限制： 1、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；	本基金投资组合遵循以下投资限制： 1、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， 前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等； 新增： 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本基金资产净值的 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

	<p>.....</p> <p>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><u>致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u></p> <p><u>14、本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；</u></p> <p>.....</p> <p><u>除上述第 1、9、13、14 项外，</u>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>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p> <p>(七)</p>	<p>(七) 本基金投资流通受限证券，应遵守《关于规范基金投资非公开发行证券行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。</p> <p>1、本协议所称的流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>	<p>(七) 本基金投资流通受限证券，应遵守《关于规范基金投资非公开发行证券行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。</p> <p>1、本协议所称的流通受限证券<u>与上文所述的流动性受限资产并不完全一致</u>，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通</p>

		受限证券。
八、基金资产净值计算和会计核算 (二) 基金资产估值方法和特殊情形的处理	3、具体投资品种估值方法	3、具体投资品种估值方法 新增： <u>(6) 当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。</u>
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		新增： <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>
十、基金信息披露 (三) 基金托管人和基金管理人在信息披露中的职责和信息披露程序	1.职责 当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金相关信息：	1.职责 当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金相关信息： 新增： <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后暂停基金估值的；</u>

中海医药健康产业精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同和托管协议修订对照表

一、基金合同修改前后文对照表

章节	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	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)和其他有关法律法规。	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、 <u>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</u> (以下简称“ <u>《流动性管理规定》</u> ”)和其他有关法律法规。 新增： <u>六、本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的除外。</u>
第二部分 释义		新增： <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作出的修订</u> <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</u>

		<p>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>52、摆动定价机制:指当本基金遭遇大额申购赎回时,通过调整基金份额净值的方式,将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者,从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响,确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待</p>
<p>第六部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>五、申购和赎回的数量限制</p>		<p>新增:</p> <p>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。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要,可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告。</p>
<p>第六部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>六、申购和赎回的价格、费用及其用</p>	<p>5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用应根据法律法规规定的比例归入基</p>	<p>5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用应根据法律法规规定的比例归入基金财</p>

途	金财产，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。	产，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。 <u>其中对于持续持有期少于 7 日的投资者收取不少于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产。</u>
第六部分 基金份额的申购与赎回 六、申购和赎回的价格、费用及其用途		新增： <u>7、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，摆动定价机制的处理原则与操作规范参见法律法规和自律组织的规定，具体见基金管理人届时的相关公告。</u>
第六部分 基金份额的申购与赎回 七、拒绝或暂停申购的情形		新增： <u>7、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有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>8、申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单个投资人单日或单笔申购金额上限的。</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，基金管理人应当暂停接受申购申请。</u>
第六部分 基金份额的申购与赎回 七、拒绝或暂停申购的情形	发生上述第 1、2、3、5、6、7 项之一的情形且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公	发生上述第 1、2、3、5、6、 9、10 项之一的情形且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公

	告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。	告。如果投资人的申购申请被 <u>全部或部分拒绝的</u> ，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。
第六部分 基金份额的申购与赎回 八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形	发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：	发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项： 新增： <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，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。</u>
第六部分 基金份额的申购与赎回 九、巨额赎回的情形及处理方式	2、巨额赎回的处理方式	2、巨额赎回的处理方式 新增： <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%，基金管理人有权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%）的赎回申请与其他投资者的赎回申请按前述条款处理，具体见招募说明书或相关公告。</u>
第十二部分 基金的投资 二、投资范围	基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的比例占基金资产的 0-95%，本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金	基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的比例占基金资产的 0-95%，本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净

	资产净值的 5%。本基金投资于医药健康产业证券的资产不低于非现金基金资产的 80%。	值的 5%， <u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u> 。本基金投资于医药健康产业证券的资产不低于非现金基金资产的 80%。
第十二部分 基金的投资 四、投资限制	1、组合限制 (2) 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；	1、组合限制 (2) 保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券， <u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u> ；
第十二部分 基金的投资 四、投资限制	1、组合限制 (4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；	1、组合限制 (4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%； <u>本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不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>
第十二部分 基金的投资 四、投资限制	1、组合限制	1、组合限制 新增： <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本基金资产净值的 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前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u>

		<u>(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>
第十二部分 基金的投资 四、投资限制	1、组合限制 因证券市场波动、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,但中国证监会规定的特殊情形除外。	1、组合限制 <u>除上述第(2)、(12)、(16)、(17)项外,</u> 因证券市场波动、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,但中国证监会规定的特殊情形除外。
第十四部分 基金资产估值 三、估值方法		新增: <u>7、当本基金发生大额申购或赎回情形时,基金管理人可以在履行适当程序后,采用摆动定价机制,以确保基金估值的公平性。</u>
第十四部分 基金资产估值 六、暂停估值的情形		新增: <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>
第十八部分 基金的信息披露 五、公开披露的基金信息		新增: <u>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20%的情形,为保障其他投资者利</u>

<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><u>益, 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“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。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>第十八部分 基金的信息披露 五、公开披露的基金信息 (七) 临时报告</p>		<p>新增: <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时;</u> <u>28、基金管理人采用摆动定价机制进行估值;</u></p>

二、托管协议修改前后文对照表

章节	修改前	修改后
<p>一、基金托管协议的依据、目的、原则和解释 (一) 依据</p>	<p>本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、《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》)、《证券投资基金托管业务管理办法》、《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>中海医药健康产业精选灵活配置混合型证券投</u></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》)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称《运作办法》)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称《销售办法》)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称《信息披露办法》)、<u>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</u>、《证券投资基金托管业务管理办法》、《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</p>

	资基金基金合同》(以下简称《基金合同》)及其他有关法律、法规制定。	式)》、《 <u>中海医药健康产业精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同</u> 》(以下简称《基金合同》)及其他有关法律、法规制定。
<p>二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</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>本基金投资于股票的比例占基金资产的 0-95%, 本基金持有的现金或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>本基金投资于股票的比例占基金资产的 0-95%, 本基金持有的现金或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>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</u></p>
<p>二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</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>(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>2) 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>4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券, 不超过该证券的 10%;</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>(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>2) 保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券, <u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;</u></p> <p>4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券, 不超过该证券的 10%; <u>本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一</u></p>

	<p>.....</p> <p>由于证券市场波动、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，但中国证监会规定的特殊情形除外。</p>	<p><u>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%；</u></p> <p><u>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>新增：</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本基金资产净值的 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前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u></p> <p><u>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>.....</p> <p><u>除上述第 2)、12)、16)、17) 项外，</u></p> <p>由于证券市场波动、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，但中国证监会规定的特殊情形除外。</p>
二、基金托管人对	6.基金托管人对基金投资流通受限	6.基金托管人对基金投资流通受限

<p>基金管理人的业务监督和核查</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>证券的监督</p> <p>……</p> <p>(1) 本基金投资的流通受限证券须为经中国证监会批准的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。本基金不投资有锁定期但锁定期不明确的证券。</p>	<p>证券的监督</p> <p>……</p> <p>(1) 本基金投资的流通受限证券与<u>上文所述的流动性受限资产并不完全一致</u>,须为经中国证监会批准的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。本基金不投资有锁定期但锁定期不明确的证券。</p>
<p>七、基金资产净值计算和会计核算</p> <p>(二) 基金资产估值方法</p>	<p>2.估值方法</p> <p>本基金的估值方法为:</p>	<p>2.估值方法</p> <p>本基金的估值方法为:</p> <p>新增:</p> <p><u>(7) 当本基金发生大额申购或赎回情形时,基金管理人可以在履行适当程序后,采用摆动定价机制,以确保基金估值的公平性。</u></p>
<p>七、基金资产净值计算和会计核算</p> <p>(四) 暂停估值与公告基金份额净值的情形</p>		<p>新增:</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>九、信息披露</p> <p>(三) 基金管理人和基金托管人在信息披露中的职责和</p>	<p>4、暂停或延迟披露基金相关信息的情形</p>	<p>4、暂停或延迟披露基金相关信息的情形</p> <p>新增:</p> <p><u>(3) 当前一估值日基金资产净值</u></p>

信息披露程序		<u>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后暂停基金估值的；</u>
--------	--	--

中海策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同和托管协议修订对照表

一、基金合同修改前后文对照表

章节	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	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)和其他有关法律法规。	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、 <u>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</u> (以下简称“ <u>《流动性管理规定》</u> ”)和其他有关法律法规。
第二部分 释义		新增： <u>12、《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作出的修订</u> <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</u>

		<p>务违约无法进行转让或交易的债券等</p> <p>49、摆动定价机制：指当本基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待</p>
<p>第六部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>五、申购和赎回的数量限制</p>		<p>新增：</p> <p>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。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告。</p>
<p>第六部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p>	<p>5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。不低于赎回费总额的 25%应归基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。</p> <p>6、本基金的申购费用最高不超过申</p>	<p>5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。其中对于持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费将全额计入基金财产；对于持续持有期少于 7 日的投资者，不低于赎回费总额的 25%应归基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。</p> <p>6、本基金的申购费用最高不超过申</p>

	<p>购金额的 5%，赎回费用最高不超过赎回金额的 5%。本基金的申购费率、申购份额具体的计算方法、赎回费率、赎回金额具体的计算方法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。基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。</p>	<p>购金额的 5%，赎回费用最高不超过赎回金额的 5%，<u>其中对于持续持有期少于 7 日的投资者收取不少于 1.5%的赎回费。</u>本基金的申购费率、申购份额具体的计算方法、赎回费率、赎回金额具体的计算方法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。基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。</p>
<p>第六部分 基金份额的申购与赎回 六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p>		<p>新增： <u>7、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，摆动定价机制的处理原则与操作规范参见法律法规和自律组织的规定，具体见基金管理人届时的相关公告。</u></p>
<p>第六部分 基金份额的申购与赎回 七、拒绝或暂停申购的情形</p>		<p>新增： <u>7、申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单个投资人单日或单笔申购金额上限的。</u> <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，基金管理人应当暂停接受申购申请。</u></p>

<p>第六部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>七、拒绝或暂停申购的情形</p>	<p>发生上述第 1、2、3、5、7 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或拒绝的，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。</p>	<p>发生上述第 1、2、3、5、8、9 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或拒绝的，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。</p>
<p>第六部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p>	<p>发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：</p>	<p>发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：</p> <p>新增：</p> <p>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，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。</p>
<p>第六部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>九、巨额赎回的情形及处理方式</p>	<p>2、巨额赎回的处理方式</p>	<p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>新增：</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 10%，基金管理人有权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%）的赎回申请与其他投资者的赎回申请按前述条款处理，具体见招募说明书或相关公告。</p>

<p>第十二部分 基金的投资</p> <p>二、投资范围</p>	<p>基金的投资组合比例为：股票、权证等权益类资产占基金资产的比例为 0—50%，债券等固定收益类资产占基金资产的比例不低于 50%，权证投资占基金资产净值的比例为 0—3%，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>基金的投资组合比例为：股票、权证等权益类资产占基金资产的比例为 0—50%，债券等固定收益类资产占基金资产的比例不低于 50%，权证投资占基金资产净值的比例为 0—3%，本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，<u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</u></p>
<p>第十二部分 基金的投资</p> <p>四、投资限制</p>	<p>1、组合限制</p> <p>(2) 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>1、组合限制</p> <p>(2) 保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，<u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</u></p>
<p>第十二部分 基金的投资</p> <p>四、投资限制</p>	<p>1、组合限制</p> <p>(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；</p>	<p>1、组合限制</p> <p>(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；<u>本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不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>第十二部分 基金的投资</p> <p>四、投资限制</p>	<p>1、组合限制</p>	<p>1、组合限制</p> <p>新增：</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本基金资产净值的 15%。因证券市场波动、上</u></p>

		<p><u>上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u></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>第十二部分 基金的投资</p> <p>四、投资限制</p>	<p>1、组合限制</p> <p>.....</p> <p>因证券市场波动、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，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>1、组合限制</p> <p>.....</p> <p><u>除上述第 (2)、(12)、(16)、(17) 项外</u>，因证券市场波动、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，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>第十四部分 基金资产估值</p> <p>三、估值方法</p>		<p>新增：</p> <p><u>7、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。</u></p>
<p>第十四部分 基金资产估值</p> <p>六、暂停估值的情形</p>		<p>新增：</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</u></p>

		<u>托管人协商一致的,基金管理人应当暂停基金估值;</u>
第十八部分 基金的信息披露 五、公开披露的基金信息	(四) 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 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。	(四) 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 报告期内出现单一投资者持有基金份额比例 <u>达到或</u> 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“ <u>影响投资者决策的其他重要信息</u> ”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及产品的特有风险。 <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>
第十八部分 基金的信息披露 五、公开披露的基金信息	(五) 临时报告	(五) 临时报告 新增: <u>25、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时;</u> <u>26、基金管理人采用摆动定价机制进行估值;</u>

二、托管协议修改前后文对照表

章节	修改前	修改后
二、基金托管协议的依据、目的和原则	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	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

<p>(一) 订立基金托管协议的依据</p>	<p>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〉》、《中海策略精选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>办法》(以下简称《运作办法》)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称《销售办法》)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称《信息披露办法》)、<u>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</u>、《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〉》、《中海策略精选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>三、基金托管人对基金管理人的业务监督与核查</p> <p>(一) 基金托管人对基金投资范围、投资对象的监督</p>	<p>……</p> <p>基金的投资组合比例为：股票、权证等权益类资产占基金资产的比例为 0—50%，债券等固定收益类资产占基金资产的比例不低于 50%，权证投资占基金资产净值的比例为 0—3%，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>……</p> <p>基金的投资组合比例为：股票、权证等权益类资产占基金资产的比例为 0—50%，债券等固定收益类资产占基金资产的比例不低于 50%，权证投资占基金资产净值的比例为 0—3%，本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，<u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</u></p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督与核查</p> <p>(二) 基金托管人对投融资比例的监督</p>	<p>本基金投资组合应遵循以下限制：</p> <p>(2) 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>(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；</p>	<p>本基金投资组合应遵循以下限制：</p> <p>(2) 保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，<u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</u></p> <p>(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；<u>本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以</u></p>

	<p>.....</p> <p>因证券市场波动、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><u>及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不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>新增：</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本基金资产净值的 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前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u></p> <p><u>(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>.....</p> <p><u>除上述第 (2)、(12)、(16)、(17) 项外，</u>因证券市场波动、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>三、基金托管人对基金管理人的业务监督与核查</p> <p>(六) 对基金投资流通受限证券的监督</p>	<p>2、流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>	<p>2、流通受限证券与上文所述的流动性受限资产并不完全一致，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>
<p>八、基金资产净值计算和会计核算</p> <p>(二) 基金资产估值和特殊情形的处理</p>	<p>2.估值方法</p>	<p>2.估值方法</p> <p>新增：</p> <p><u>(7) 当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。</u></p>
<p>八、基金资产净值计算和会计核算</p> <p>(四) 暂停估值与公告基金份额净值的情形</p>		<p>新增：</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>十、基金的信息披露</p> <p>(三) 基金托管人和基金管理人在信息披露中的职责和信息披露程序</p>	<p>4、暂停或延迟披露基金相关信息的情形</p>	<p>4、暂停或延迟披露基金相关信息的情形</p> <p>新增：</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后暂停基金估值的；</u></p>

中海进取收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同和托管协议修订对照表

一、基金合同修改前后文对照表

章节	修改前	修改后
第一部分 前言	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)和其他有关法律法规。	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、 <u>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</u> (以下简称“ <u>《流动性管理规定》</u> ”)和其他有关法律法规。
第一部分 前言		新增： <u>六、本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的除外。</u>
第二部分 释义		新增： <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日起实施的《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>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</u>

		<p>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>52、摆动定价机制:指当本基金遭遇大额申购赎回时,通过调整基金份额净值的方式,将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者,从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响,确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待</p>
<p>第六部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>五、申购和赎回的数量限制</p>		<p>新增:</p> <p>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。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要,可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告。</p>
<p>第六部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>六、申购和赎回的价格、费用及其用</p>	<p>5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用应根据法律法规规定的比例归入基</p>	<p>5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用应根据法律法规规定的比例归入基金财</p>

途	金财产，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。	产，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。 <u>其中对于持续持有期少于 7 日的投资者收取不少于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产。</u>
第六部分 基金份额的申购与赎回 六、申购和赎回的价格、费用及其用途		新增： <u>7、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，摆动定价机制的处理原则与操作规范参见法律法规和自律组织的规定，具体见基金管理人届时的相关公告。</u>
第六部分 基金份额的申购与赎回 七、拒绝或暂停申购的情形		新增： <u>7、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有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>8、申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单个投资人单日或单笔申购金额上限的。</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，基金管理人应当暂停接受申购申请。</u>
第六部分 基金份额的申购与赎回 七、拒绝或暂停申购的情形	发生上述第 1、2、3、5、6、7 项之一的情形且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公	发生上述第 1、2、3、5、6、 9、10 项之一的情形且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公

	告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。	告。如果投资人的申购申请被 <u>全部或部分拒绝的</u> ，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。
第六部分 基金份额的申购与赎回 八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形		新增： <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，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。</u>
第六部分 基金份额的申购与赎回 九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式		新增： <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%，基金管理人有权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%）的赎回申请与其他投资者的赎回申请按前述条款处理，具体见招募说明书或相关公告。</u>
第七部分 基金合同当事人及权利义务 一、基金管理人	(一) 基金管理人简况 …… 法定代表人：黄鹏	(一) 基金管理人简况 …… 法定代表人： <u>杨皓鹏</u>
第七部分 基金合同当事人及权利义务 二、基金托管人	(一) 基金托管人简况 …… 法定代表人：孙建一 注册资本：5,123,350,416 元人民币	(一) 基金托管人简况 …… 法定代表人： <u>谢永林</u> 注册资本： <u>17,170,411,366 元人民币</u>

<p>第十二部分 基金的投资</p> <p>二、投资范围</p>	<p>基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的比例占基金资产的0-95%，本基金持有的现金或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>基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的比例占基金资产的0-95%，本基金持有的现金或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>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</u></p>
<p>第十二部分 基金的投资</p> <p>四、投资限制</p>	<p>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>（2）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>.....</p> <p>（4）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%；</p>	<p>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>（2）保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，<u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</u></p> <p>.....</p> <p>（4）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%；<u>本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不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>新增：</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本基金资产净值的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前款所规定比例限制的，基金管理</u></p>

	<p>.....</p> <p>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。</p>	<p><u>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>.....</p> <p><u>除上述第(2)、(12)、(16)、(17)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。</p>
<p>第十四部分 基金资产估值</p> <p>三、估值方法</p>		<p>新增：</p> <p><u>6、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。</u></p>
<p>第十四部分 基金资产估值</p> <p>六、暂停估值的情形</p>		<p>新增：</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>第十八部分 基金的信息披露</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</p> <p>新增：</p>

		<p><u>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额20%的情形，为保障其他投资者利益，基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告文件中“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。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>第十八部分 基金的信息披露</p> <p>五、公开披露的基金信息</p>	<p>(七) 临时报告</p>	<p>(七) 临时报告</p> <p>新增：</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时；</u></p> <p><u>27、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；</u></p>

二、托管协议修改前后文对照表

章节	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>法定代表人：黄鹏</p> <p>经营范围：基金募集；基金销售；资产管理以及中国证监会许可的其它业务。</p>	<p>法定代表人：杨皓鹏</p> <p>经营范围：<u>基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其它业务</u> 【依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动】</p>
<p>一、基金托管协议当事人</p> <p>(二) 基金托管人</p>	<p>法定代表人：孙建一</p> <p>注册资本：5,123,350,416 元人民币</p>	<p>法定代表人：谢永林</p> <p>注册资本：<u>17,170,411,366 元人民币</u></p>

<p>二、基金托管协议的依据、目的、原则和解释</p> <p>(一) 订立托管协议的依据</p>	<p>本协议依据《中华人民共和国合同法》、《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》”)、《中海进取收益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>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>、《中海进取收益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>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p> <p>(一)</p>	<p>本基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例为 0 - 95%，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>本基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例为 0 - 95%，本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，<u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</u></p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</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) 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>……</p> <p>(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；</p>	<p>(2) 保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，<u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</u></p> <p>……</p> <p>(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；<u>本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不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</u></p>

	<p>.....</p> <p>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>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>新增：</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本基金资产净值的 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前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u></p> <p><u>(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>.....</p> <p><u>除上述第 (2)、(12)、(16)、(17) 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>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p> <p>(六) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同</p>	<p>2、流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌</p>	<p>2、流通受限证券与上文所述的流动性受限资产并不完全一致，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期可交易证券，不包括由于</p>

<p>的约定，对基金投资流通受限证券进行监督。</p>	<p>的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>	<p>发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>
<p>八、基金资产净值计算和会计核算 （二）基金资产估值方法和特殊情形的处理</p>	<p>2、估值方法</p>	<p>2、估值方法 新增： <u>（6）当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。</u></p>
<p>八、基金资产净值计算和会计核算 （四）暂停估值的情形</p>		<p>新增： <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>

中海合嘉增强收益债券型证券投资基金基金合同和托管协议修订对照表

一、基金合同修改前后文对照表

章节	修改前	修改后
第一部分 前言	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)和其他有关法律法规。	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、 <u>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</u> (以下简称“ <u>《流动性管理规定》</u> ”)和其他有关法律法规。
第一部分 前言		新增： <u>六、本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的除外。</u>
第二部分 释义		新增： <u>13、《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》及颁布机关对其不时做出的修订</u> <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</u>

		<p>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>52、摆动定价机制：指当本基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待</p>
<p>第六部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>五、申购和赎回的数量限制</p>		<p>新增：</p> <p>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。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告。</p>
<p>第六部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p>	<p>6、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用应根据法律法规规定的比例归入基金财产，具体比例详见招募说明书，</p>	<p>6、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用应根据法律法规规定的比例归入基金财产，具体比例详见招募说明书，其余</p>

	其余用于支付登记费和其他必要的手续费。	用于支付登记费和其他必要的手续费。 <u>其中对于持续持有期少于 7 日的投资者收取不少于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产。</u>
第六部分 基金份额的申购与赎回 六、申购和赎回的价格、费用及其用途		新增： <u>8、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，摆动定价机制的处理原则与操作规范参见法律法规和自律组织的规定，具体见基金管理人届时的相关公告。</u>
第六部分 基金份额的申购与赎回 七、拒绝或暂停申购的情形		新增： <u>7、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有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>8、申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单个投资人单日或单笔申购金额上限的。</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，基金管理人应当暂停接受申购申请。</u>
第六部分 基金份额的申购与赎回 七、拒绝或暂停申购的情形	发生上述第 1、2、3、5、6、7 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被	发生上述第 1、2、3、5、6、 9、10 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被

	拒绝，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。	<u>全部或部分</u> 拒绝的，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。
第六部分 基金份额的申购与赎回 八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形		新增： <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，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。</u>
第六部分 基金份额的申购与赎回 九、巨额赎回的情形及处理方式	2、巨额赎回的处理方式	2、巨额赎回的处理方式 新增： <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%，基金管理人有权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%）的赎回申请与其他投资者的赎回申请按前述条款处理，具体见招募说明书或相关公告。</u>
第七部分 基金合同当事人及权利义务 一、基金管理人	(一) 基金管理人简况 …… 法定代表人：黄鹏	(一) 基金管理人简况 …… 法定代表人： <u>杨皓鹏</u>
第七部分 基金合同当事人及权利义务 二、基金托管人	(一) 基金托管人简况 …… 法定代表人：孙建一 注册资本：5,123,350,416 元人民币	(一) 基金托管人简况 …… 法定代表人： <u>谢永林</u> 注册资本： <u>17,170,411,366 元人民币</u>

<p>第十二部分 基金的投资</p> <p>二、投资范围</p>	<p>基金的投资组合比例为：本基金投资于债券的比例不低于基金资产的80%，投资于权益类资产的比例不超过基金资产的20%，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>基金的投资组合比例为：本基金投资于债券的比例不低于基金资产的80%，投资于权益类资产的比例不超过基金资产的20%，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%，<u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</u></p>
<p>第十二部分 基金的投资</p> <p>四、投资限制</p>	<p>1、组合限制</p> <p>本基金的投资组合将遵循以下限制：</p> <p>（1）本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的20%，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>……</p> <p>（3）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%；</p>	<p>1、组合限制</p> <p>本基金的投资组合将遵循以下限制：</p> <p>（1）本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的20%；</p> <p><u>（2）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，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</u></p> <p>……</p> <p>（4）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%；<u>本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不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>新增：</p>

	<p>.....</p> <p>因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，除上述第（11）项约定外，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，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>（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本基金资产净值的 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前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u></p> <p><u>（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>.....</p> <p>因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，除上述第<u>（2）、（12）、（16）、（17）</u>项约定外，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，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>第十四部分 基金资产估值</p> <p>三、估值方法</p>		<p>新增：</p> <p><u>6、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。</u></p>
<p>第十四部分 基金资产估值</p> <p>六、暂停估值的情形</p>		<p>新增：</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</u></p>

		<u>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>
第十八部分 基金的信息披露 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	(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 新增： <u>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额20%的情形，为保障其他投资者利益，基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告文件中“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。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>
第十八部分 基金的信息披露 五、公开披露的基金信息	(七) 临时报告	(七) 临时报告 新增： <u>26、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；</u> <u>27、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；</u>

二、托管协议修改前后文对照表

章节	修改前	修改后
一、基金托管协议	法定代表人：黄鹏	法定代表人：杨皓鹏

<p>当事人</p> <p>(一) 基金管理人</p>	<p>经营范围：基金募集；基金销售；资产管理以及中国证监会许可的其它业务（涉及行政许可的凭许可证经营）。</p>	<p>经营范围：<u>基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其它业务</u> 【依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动】</p>
<p>一、基金托管协议当事人</p> <p>(二) 基金托管人</p>	<p>法定代表人：孙建一</p> <p>注册资本：5,123,350,416 元人民币</p> <p>联系人：李玉彬</p> <p>联系电话：(0755) 22168677</p>	<p>法定代表人：<u>谢永林</u></p> <p>注册资本：<u>17,170,411,366 元人民币</u></p> <p>联系人：<u>高希泉</u></p> <p>联系电话：<u>(0755) 22197701</u></p>
<p>二、基金托管协议的依据、目的、原则和原则</p> <p>(一) 订立托管协议的依据</p>	<p>本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)《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〉》、《中海合嘉增强收益债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)等有关法律法规规定制订。</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》”)《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、<u>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</u>、《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〉》、《中海合嘉增强收益债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)等有关法律法规规定制订。</p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p> <p>(一)</p>	<p>本基金为债券型基金，投资组合比例为：本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%，投资于权益类资产的比例不超过基金资产的 20%，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>本基金为债券型基金，投资组合比例为：本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%，投资于权益类资产的比例不超过基金资产的 20%，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%，<u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</u></p>

<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</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、融券比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督:</p>	<p>1、组合限制:</p> <p>本基金的投资组合将遵循以下限制:</p> <p>(1) 本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%; 股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%, 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>(3) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券, 不超过该证券的 10%;</p>	<p>1、组合限制:</p> <p>本基金的投资组合将遵循以下限制:</p> <p>(1) 本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%; 股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%;</p> <p>(2) 保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券, <u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;</u></p> <p>(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券, 不超过该证券的 10%; <u>本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票, 不得超过该上市公司可流通股票的 15%;</u> <u>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>新增:</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本基金资产净值的 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前款所规定比例限制的, 基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;</u></p> <p><u>(17) 本基金与私募类证券资管产品</u></p>
--	---	---

	<p>.....</p> <p>因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，除上述第（11）项约定外，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，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>及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；</u></p> <p>.....</p> <p>因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，除上述第<u>（2）、（12）、（16）、（17）</u>项约定外，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。</p>
<p>八、基金资产净值计算和会计核算</p> <p>（二）基金资产估值方法和特殊情形的处理</p>	<p>2、估值方法</p>	<p>2、估值方法</p> <p>新增：</p> <p><u>（6）当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。</u></p>
<p>八、基金资产净值计算和会计核算</p> <p>（四）暂停估值与公告基金份额净值的情形</p>		<p>新增：</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>

中海中鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同和托管协议修订对照表

一、基金合同修改前后文对照表

章节	修改前	修改后
第一部分 前言	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)和其他有关法律法规。	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、 <u>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</u> (以下简称“ <u>《流动性管理规定》</u> ”)和其他有关法律法规。
第二部分 释义		<p>新增：</p> <p>13、《流动性风险管理规定》：指中国证监局 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作出的修订</p> <p>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</p>

		<p>务违约无法进行转让或交易的债券等</p> <p>52、摆动定价机制：指当本基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待</p>
<p>第六部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>五、申购和赎回的数量限制</p>		<p>新增：</p> <p>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。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告。</p>
<p>第六部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p>	<p>5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用应根据法律法规规定的比例归入基金财产，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。</p>	<p>5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用应根据法律法规规定的比例归入基金财产，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。其中对于持续持有期少于 7 日的投资者收取不少于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产。</p>
第六部分 基金份额		<p>新增：</p>

<p>额的申购与赎回</p> <p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p>		<p><u>7、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，摆动定价机制的处理原则与操作规范参见法律法规和自律组织的规定，具体见基金管理人届时的相关公告。</u></p>
<p>第六部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>七、拒绝或暂停申购的情形</p>		<p>新增：</p> <p><u>7、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有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、申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单个投资人单日或单笔申购金额上限的。</u></p> <p><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，基金管理人应当暂停接受申购申请。</u></p>
<p>第六部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>七、拒绝或暂停申购的情形</p>	<p>发生上述第 1、2、3、5、6、7 项之一的情形且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。</p>	<p>发生上述第 <u>1、2、3、5、6、9、10</u> 项之一的情形且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被<u>全部或部分拒绝的</u>，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。</p>
<p>第六部分 基金份额</p>		<p>新增：</p>

<p>额的申购与赎回</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，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。</u></p>
<p>第六部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>九、巨额赎回的情形及处理方式</p>	<p>2、巨额赎回的处理方式</p>	<p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>新增：</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 10%，基金管理人有权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%）的赎回申请与其他投资者的赎回申请按前述条款处理，具体见招募说明书或相关公告。</u></p>
<p>第十二部分 基金的投资</p> <p>二、投资范围</p>	<p>基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的比例占基金资产的 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，本基金持有的现金或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>基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的比例占基金资产的 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，本基金持有的现金或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>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</u></p>
<p>第十二部分 基金的投资</p> <p>四、投资限制</p>	<p>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>(2) 每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金</p>	<p>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>(2) 每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或者</p>

<p>或者到期日在一年以内的政府债券；</p> <p>.....</p> <p>(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；</p> <p>.....</p> <p>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</p>	<p>到期日在一年以内的政府债券，<u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>；</p> <p>.....</p> <p>(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；<u>本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不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>新增：</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本基金资产净值的 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前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u></p> <p><u>(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；</u></p> <p>.....</p> <p><u>除上述第 (2)、(12)、(17)、(18)</u></p>	<p>到期日在一年以内的政府债券，<u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>；</p> <p>.....</p> <p>(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；<u>本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不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>新增：</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本基金资产净值的 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前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u></p> <p><u>(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；</u></p> <p>.....</p> <p><u>除上述第 (2)、(12)、(17)、(18)</u></p>
--	---	---

	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。	<u>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。
第十四部分 基金 资产估值 三、估值方法		新增： <u>7、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。</u>
第十四部分 基金 资产估值 六、暂停估值的情形		新增： <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>
第十八部分 基金 的信息披露 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	(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 新增： <u>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者利益，基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告中“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>
第十八部分 基金的信息披露 五、公开披露的基金信息	(七) 临时报告	(七) 临时报告 新增: <u>26、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时;</u> <u>27、基金管理人采用摆动定价机制进行估值;</u>

二、托管协议修改前后文对照表

章节	修改前	修改后
二、基金托管协议的依据、目的、原则和解释 (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》”)、《中海中鑫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。	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> 、《中海中鑫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。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查 (一)	本基金的投资组合比例为: 本基金股票投资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, 本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净	本基金的投资组合比例为: 本基金股票投资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, 本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的

	值的 5%。	5%， <u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</u>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</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) 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>……</p> <p>(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；</p>	<p>(2) 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，<u>前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</u></p> <p>……</p> <p>(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；<u>本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不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>新增：</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本基金资产净值的 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前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u></p> <p><u>(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</u></p>

	<p>.....</p> <p>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。</p>	<p><u>定的投资范围保持一致；</u></p> <p>.....</p> <p><u>除上述第（2）、（12）、（16）、（17）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。</p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p> <p>（六）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资流通受限证券进行监督。</p>	<p>2. 流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>	<p>2. 流通受限证券<u>与上文所述的流动性受限资产并不完全一致</u>，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>
<p>八、基金资产净值计算和会计核算</p> <p>（二）基金资产估值方法和特殊情形的处理</p>	<p>2、估值方法</p>	<p>2、估值方法</p> <p>新增：</p> <p><u>（7）当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。</u></p>
<p>八、基金资产净值计算和会计核算</p> <p>（四）暂停估值的情形</p>		<p>新增：</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>

中海中证高铁产业指数分级证券投资基金基金合同和托管协议修订对照表

一、基金合同修改前后文对照表

章节	修改前	修改后
第一部分 前言	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》（以下简称“《合同法》”）、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）和其他有关法律法	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》（以下简称“《合同法》”）、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、 <u>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</u> （以下简称“ <u>《流动性风险管理规定》</u> ”）和其他有关法律法规。
第一部分 前言		新增： <u>六、本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回、基金上市交易、基金管理人委托的登记机构技术条件不允许等情形导致被动达到或超过50%的除外。</u>
第二部分 释义		新增： <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》</u>

		<p>及颁布机关对其不时作出的修订</p> <p><u>76、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><u>77、摆动定价机制：指当本基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待</u></p>
<p>第七部分 中海中证高铁份额的申购与赎回</p> <p>五、 申购和赎回的数量限制</p>		<p>新增：</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中海中证高铁份额的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。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告。</u></p>

<p>第七部分 中海中证高铁份额的申购与赎回</p> <p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p>	<p>5、中海中证高铁份额的赎回费用由赎回中海中证高铁份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回中海中证高铁份额时收取。赎回费用应根据法律法规规定的比例归入基金财产，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。</p>	<p>5、中海中证高铁份额的赎回费用由赎回中海中证高铁份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回中海中证高铁份额时收取。赎回费用应根据法律法规规定的比例归入基金财产，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。<u>其中对于持续持有期少于 7 日的投资者收取不少于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产。</u></p>
<p>第七部分 中海中证高铁份额的申购与赎回</p> <p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p>		<p>新增：</p> <p><u>9、当中海中证高铁份额发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，摆动定价机制的处理原则与操作规范参见法律法规和自律组织的规定，具体见基金管理人届时的相关公告。</u></p>
<p>第七部分 中海中证高铁份额的申购与赎回</p> <p>七、拒绝或暂停申购的情形</p>		<p>新增：</p> <p><u>8、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有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>9、申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单个投资人单日或单笔申购金额上限的。</u></p> <p><u>10、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</u></p>

		<u>暂停接受申购申请。</u>
第七部分 中海中证高铁份额的申购与赎回 七、拒绝或暂停申购的情形	发生上述第 1、2、3、5、6、7、8 项之一的情形且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。	发生上述第 1、2、3、5、6、7、 <u>10、11</u> 项之一的情形且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被 <u>全部或部分</u> 拒绝的，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。
第六部分 基金份额的申购与赎回 八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形		新增： <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，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受中海中证高铁份额的赎回申请。</u>
第六部分 基金份额的申购与赎回 九、巨额赎回的情形及处理方式	2、巨额赎回的处理方式	2、巨额赎回的处理方式 新增： <u>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（包括中海中证高铁份额、中海中证高铁 A 份额、中海中证高铁 B 份额，下同）的 10%，基金管理人有权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%）的赎回申请与其他投资者的赎回申请按前述条款处理，具体见招募说明书或相关公告。</u>

<p>第十六部分 基金的投资</p> <p>二、投资范围</p>	<p>基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的资产不低于基金资产的85%，投资于中证高铁产业指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的90%，且不低于非现金基金资产的80%；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；本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%。</p>	<p>基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的资产不低于基金资产的85%，投资于中证高铁产业指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的90%，且不低于非现金基金资产的80%；保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，<u>其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>；本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%。</p>
<p>第十六部分 基金的投资</p> <p>四、投资限制</p>	<p>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>（2）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>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>（2）保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，<u>其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>；</p> <p>新增：</p> <p><u>（15）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的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前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u></p> <p><u>（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>.....</p> <p>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。</p>	<p>.....</p> <p><u>除上述第（2）、（11）、（15）、（16）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。</p>
<p>第十八部分 基金资产估值</p> <p>三、估值方法</p>		<p>新增：</p> <p><u>7、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。</u></p>
<p>第十八部分 基金资产估值</p> <p>六、暂停估值的情形</p>		<p>新增：</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>第二十三部分 基金的信息披露</p> <p>五、公开披露的基金信息</p>	<p>（八）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>（八）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>新增：</p> <p><u>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额（包括中海中证高铁份额、中海中证高铁 A 份额、中海中证高铁 B 份额）20% 的情形，为保障其他投资者利益，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“影</u></p>

		<p><u>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>第二十三部分 基金的信息披露</p> <p>五、公开披露的基金信息</p>	(九) 临时报告	<p>(九) 临时报告</p> <p>新增:</p> <p><u>31、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时;</u></p> <p><u>32、基金管理人采用摆动定价机制进行估值;</u></p>

二、托管协议修改前后文对照表

章节	修改前	修改后
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p> <p>(一)</p>	<p>基金的投资组合比例为: 本基金投资于股票的资产不低于基金资产的 85%, 投资于中证高铁产业指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%, 且不低于非现金基金资产的 80%; 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; 本基金持有的全部权证, 其市值不得超过基金资产净值的 3%。</p>	<p>基金的投资组合比例为: 本基金投资于股票的资产不低于基金资产的 85%, 投资于中证高铁产业指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%, 且不低于非现金基金资产的 80%; 保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券, <u>其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>; 本基金持有的全部权证, 其市值不得超过基金资产净值的 3%。</p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务</p>	<p>2.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</p>	<p>2.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>监督和核查</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>债券;</p> <p>.....</p> <p>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。</p>	<p>券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;</p> <p>新增:</p> <p>15.本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 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前款所规定比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;</p> <p>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;</p> <p>.....</p> <p>除上述第 2、11、15、16 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。</p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p> <p>(五) 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</p>	<p>1.本基金投资的流通受限证券须为经中国证监会批准的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的</p>	<p>1.本基金投资的流通受限证券与上文所述的流动性受限资产并不完全一致,须为经中国证监会批准的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证</p>

<p>金管理人投资流通受限证券进行监督。</p>	<p>质押券等流通受限证券。本基金不投资有锁定期但锁定期不明确的证券。</p>	<p>券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。本基金不投资有锁定期但锁定期不明确的证券。</p>
<p>八、基金资产净值计算和会计核算 （二）基金资产估值方法和特殊情形的处理</p>	<p>2、估值方法</p>	<p>2、估值方法 新增： <u>（7）当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。</u></p>
<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（参考）净值的情形</p>		<p>新增： <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>