

关于《上银新兴价值成长性证券投资基金托管协议》

修改前后条文对照表的说明

上银新兴价值成长性证券投资基金之《上银新兴价值成长性证券投资基金托管协议》（以下简称“《托管协议》”）已根据《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》”）修改。根据基金托管人和律师事务所的意见，我公司在修改《托管协议》时对部分条款进行了增加、删除或修改，现将具体情况详细说明如下。

《托管协议》修改前后条文对照表

页码	章节	原《托管协议》条款	修改后《托管协议》条款	修改理由
P6-11	三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	<p>(一)基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定,对基金投资范围、投资对象进行监督。《基金合同》明确约定基金投资风格或证券选择标准的,基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池,以便基金托管人运用相关技术系统,对基金实际投资是否符合《基金合同》关于证券选择标准的约定进行监督,对存在疑义的事项进行核查。</p> <p>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。</p> <p>基金的投资组合比例为:本基金的股票投资比例为基金资产的0%-95%;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%;权证投资占基金资产净值的0-3%。</p> <p>本基金将重点投资于新兴产业中的优质上市公司和传统</p>	<p>(一)基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定,对基金投资范围、投资对象进行监督。《基金合同》明确约定基金投资风格或证券选择标准的,基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池,以便基金托管人运用相关技术系统,对基金实际投资是否符合《基金合同》关于证券选择标准的约定进行监督,对存在疑义的事项进行核查。</p> <p>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。</p> <p>基金的投资组合比例为:本基金的股票投资比例为基金资产的0%-95%;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%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款;权证投资占基金资产净值的0-3%。</p>	根据《流动性风险管理规定》修订基金托管人进行监督的投资范围

	<p>产业中具备成长和价值的上市公司股票，其比例将不低于非现金基金资产的 80%。</p>	<p>本基金将重点投资于新兴产业中的优质上市公司和传统产业中具备成长和价值的上市公司股票，其比例将不低于非现金基金资产的 80%。</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> <ol style="list-style-type: none"> 1. 本基金的股票投资比例为基金资产的 0%-95%，其中投资于新兴产业中的优质上市公司和传统产业中具备成长和价值的上市公司股票的比例不低于非现金基金资产的 80%； 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； 3. 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%； 4. 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%； 5. 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%； 7. 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%； 8. 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%； 	<p>(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> <ol style="list-style-type: none"> 1. 本基金的股票投资比例为基金资产的 0%-95%，其中投资于新兴产业中的优质上市公司和传统产业中具备成长和价值的上市公司股票的比例不低于非现金基金资产的 80%； 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，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款； 3. 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%； 4、本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%； 5. 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%； 6. 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%； 7. 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%； 	<p>根据《流动性风险管理规定》修订基金托管人进行监督的投资组合限制，另增合同里已有的投资限制，保持托管协议投资限制与合同一致</p>

	<p>9. 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间, 如果其信用等级下降、不再符合投资标准, 应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出;</p> <p>10. 基金财产参与股票发行申购, 本基金所申报的金额不超过本基金的总资产, 本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;</p> <p>11. 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%;</p> <p>12. 本基金持有的所有流通受限证券, 其公允价值不得超过本基金资产净值的 20%; 本基金持有的同一流通受限证券, 其公允价值不得超过本基金资产净值的 8%; 基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。如果法律法规对上述投资组合比例限制进行变更的, 以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制, 如适用于本基金, 则本基金投资不再受相关限制。</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>8. 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例, 不得超过基金资产净值的 10%;</p> <p>9. 本基金持有的全部资产支持证券, 其市值不得超过基金资产净值的 20%;</p> <p>10. 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例, 不得超过该资产支持证券规模的 10%;</p> <p>11. 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券, 不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%;</p> <p>12. 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间, 如果其信用等级下降、不再符合投资标准, 应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出;</p> <p>13. 基金财产参与股票发行申购, 本基金所申报的金额不超过本基金的总资产, 本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;</p> <p>14. 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%;</p> <p>15. 本基金持有的所有流通受限证券, 其公允价值不得超过本基金资产净值的 15%; 本基金持有的同一流通受限证券, 其公允价值不得超过本基金资产净值的 8%;</p> <p>16. 基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以</p>	
--	--	--	--

			<p>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%;托管人仅就本托管人托管的管理人全部开放式基金、全部投资组合进行监测。</p> <p>17. 本基金投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%,因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金被动超过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>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;</p> <p>19. 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。</p> <p>基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。</p> <p>如果法律法规对上述投资组合比例限制进行变更的,以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,则本基金投资不再受相关限制。</p>	
--	--	--	--	--

			除上述第 12、17、18 项另有约定外，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。	
P24-28	八、基金资产净值计算和会计核算	<p>(四) 暂停估值的情形</p> <p>1. 基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</p> <p>2. 因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；</p> <p>3. 占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障投资人的利益，已决定延迟估值；如果出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况，导致基金管理人不能出售或评估基金资产时；</p> <p>4. 中国证监会和基金合同认定的其它情形。</p>	<p>(四) 暂停估值的情形</p> <p>1. 基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</p> <p>2. 因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；</p> <p>3. 占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障投资人的利益，已决定延迟估值；如果出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况，导致基金管理人不能出售或评估基金资产时；</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，且经与基金托管人协商确认后应当暂停基金估值；</p> <p>5. 中国证监会和基金合同认定的其它情形。</p> <p>发生前述第 3 项情形时，基金管理人应采取延缓支付赎回款项的措施。</p>	根据《流动性风险管理规定》增加暂停估值的情形

P30-31	基金信息披露	<p>十、基金信息披露(二) 信息披露的内容</p> <p>基金的信息披露内容主要包括基金招募说明书、《基金合同》、托管协议、基金份额发售公告、基金募集情况、《基金合同》生效公告、基金份额上市交易公告书(LOF 和 ETF 基金适用)、基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购、赎回价格、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、临时报告、澄清公告、基金份额持有人大会决议、中国证监会规定的其他信息。基金年度报告需经具有从事证券相关业务资格的会计师事务所审计后，方可披露。</p>	<p>十、基金信息披露(二) 信息披露的内容</p> <p>基金的信息披露内容主要包括基金招募说明书、《基金合同》、托管协议、基金份额发售公告、基金募集情况、《基金合同》生效公告、基金份额上市交易公告书(LOF 和 ETF 基金适用)、基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购、赎回价格、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、临时报告、澄清公告、基金份额持有人大会决议、中国证监会规定的其他信息。基金年度报告需经具有从事证券相关业务资格的会计师事务所审计后，方可披露。</p> <p>如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20%的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在基金定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及产品的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。</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>根据《流动性风险管理规定》修改信息披露的内容</p>
--------	---------------	--	--	-------------------------------