

海富通双福分级债券型证券投资基金基金合同和托管协议 的修改对照表

一、 基金合同主要修订内容、依据

| 章节 | 修订内容 | 修订依据 |
|------------|--|--|
| 前言 | <p>“一、订立本基金合同的目的、依据和原则”中增加：</p> <p>“《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“《流动性规定》”）”</p> | <p>将《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》纳入基金合同制订依据</p> |
| 释义 | <p>增加：</p> <p>“59、<u>《流动性规定》</u>：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”</p> | <p>根据《流动性风险管理规定》补充相关释义</p> |
| 释义 | <p>增加：</p> <p>“60、<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>根据《流动性风险管理规定》补充相关释义</p> |
| 基金份额的申购与赎回 | <p>“一、每一运作周期内双福 A 的申购与赎回”中</p> <p>“（五）申购和赎回的数量限制”中，增加：</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双福 A 单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等</p> | <p>《流动性风险管理规定》第十九条</p> |

| | | |
|--------------------------|--|---|
| | <p>措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益，具体请参见相关公告。”</p> | |
| <p>基金份额的申购与赎回</p> | <p>“一、每一运作周期内双福 A 的申购与赎回”中</p> <p>“（七）拒绝或暂停申购的情形”中，增加：</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、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金申购申请。”</u></p> <p>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>《流动性风险管理规定》 第十九条、第二十四条</p> <p>根据上述修改调整序号</p> |
| <p>基金份额的申购与赎回</p> | <p>“一、每一运作周期内双福 A 的申购与赎回”中</p> <p>“（八）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形”中，增加：</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，基金管理人应当暂停接受基金赎回申请或延缓支付赎回款项。”</u></p> | <p>《流动性风险管理规定》 第二十四条</p> |
| <p>基金份额的申购与赎回</p> | <p>“一、每一运作周期内双福 A 的申购与赎回”中</p> | |

| | | |
|-------------------|---|---------------------------------|
| <p>回</p> | <p>“（九）巨额赎回的情形及处理方式”之“2、巨额赎回的处理方式”中，增加：</p> <p><u>“若在双福 A 的开放日内发生巨额赎回，当双福 A 单个基金份额持有人赎回申请超过前一工作日基金总份额（包括双福 A、双福 B，下同）30%的情形时，超过部分的赎回申请可以延期办理。延期办理部分的赎回申请将以下一工作日双福 A 的基金份额参考净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。延期办理的期限不得超过 20 个工作日。而对于双福 A 单个持有人份额赎回申请不超过前一工作日基金总份额 30%(含)的部分，基金管理人应当以赎回申请日双福 A 的基金份额净值确认全部赎回申请；若基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人可延缓支付赎回款项，延缓支付的赎回申请在基金管理人有能力支付赎回款项时一次性全额支付，但延缓支付期限最长不超过 20 个工作日。”</u></p> | <p>《流动性风险管理规定》 第二十一条（二）</p> |
| <p>基金份额的申购与赎回</p> | <p>“二、本基金转换为“海富通双福债券型证券投资基金”后的申购和赎回”中“（五）申购和赎回的数量限制”中，增加：</p> <p><u>“4、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益，具体请参见相关公告。”</u></p> | <p>《流动性风险管理规定》 第十九条</p> |

| | | |
|--|---|--|
| | <p>“二、本基金转换为“海富通双福债券型证券投资基金”后的申购和赎回”中“（六）申购和赎回的价格、费用及其用途”中的“3、赎回金额的计算及处理方式”中，增加：</p> <p>“……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> <p>“二、本基金转换为“海富通双福债券型证券投资基金”后的申购和赎回”中“（七）拒绝或暂停申购的情形”中，增加：</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、当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金申购申请。”</u></p> <p>发生上述第1、2、3、5、6、8、9项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购申请时，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>“二、本基金转换为“海富通双福债券型证券投资基金”后的申购和赎回”中“（八）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形”中，增加：</p> | <p>《流动性风险管理规定》 第二十三条</p> <p>《流动性风险管理规定》 第十九条</p> <p>《流动性风险管理规定》 第二十四条</p> <p>根据上述修改调整序号</p> <p>《流动性风险管理规定》</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，基金管理人应当暂停接受基金赎回申请或延缓支付赎回款项。</u>”</p> <p>“二、本基金转换为“海富通双福债券型证券投资基金”后的申购和赎回”中“（九）巨额赎回的情形及处理方式”之“2、巨额赎回的处理方式”中，增加：</p> <p>“<u>若基金发生巨额赎回，在出现单个基金份额持有人超过基金总份额 30%的赎回申请（简称“大额赎回申请人”）情形下，基金管理人应当延期办理赎回申请。基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额 10%的前提下，优先确认其他赎回申请人（简称“小额赎回申请人”）的赎回申请：若小额赎回申请人的赎回申请在当日予以全部确认，则基金管理人在仍可接受赎回申请的范围内对大额赎回申请人的赎回申请按比例确认，对大额赎回申请人未予确认的赎回申请延期办理；若小额赎回申请人的赎回申请在当日未予全部确认，则对未确认的赎回申请（含小额赎回申请人的其余赎回申请与大额赎回申请人的全部赎回申请）延期办理。延期办理的赎回申请适用本条规定的延期赎回或取消赎回的规则；同时，基金管理人应当对延期办理的事宜在指定媒体上刊登公告。</u>”</p> | <p>第二十四条</p> <p>《流动性风险管理规定》第二十一条（二）</p> |
| <p>基金合同当事人及权利义务</p> | <p>“二、基金托管人”之“（一）基金托管人简况”的“法定代表人”和“注册资本”修订为：</p> <p>“法定代表人：<u>陈四清</u>”</p> | |

| | | |
|---------------------|---|---|
| | <p>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>”</p> | <p>根据托管人最新披露信息修改</p> |
| <p>基金的投资</p> | <p>“二、投资范围”之“基金的投资组合比例为：”中，增加：</p> <p>“……<u>其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。</u>”</p> <p>“四、投资限制”之“1、组合限制”之“基金的投资组合应遵循以下限制：”中，增加：</p> <p>“（2）……<u>其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等；</u></p> <p><u>（5）本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%；</u></p> <p><u>（14）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的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本基金投资于流动性受限资产的市值合计超过本基金资产净值的15%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><u>除上述第（2）、（11）、（14）、（15）</u></p> | <p>《流动性风险管理规定》第十八条</p> <p>《流动性风险管理规定》第十五条、第十六条、第十七条、第十八条、第四十条</p> <p>根据上述修改调整序号</p> |

| | | |
|--------|---|--|
| | <p>项外，因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规另有规定的，从其规定。</p> | |
| 基金资产估值 | <p>“六、暂停估值的情形”中，增加： “4、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停基金估值；”</p> | <p>《流动性风险管理规定》 第二十四条</p> |
| 运作周期到期 | <p>“二、过渡期”中“3、过渡期基金份额的申购与赎回原则”中，增加： “（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、单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益，具体请参见相关公告。”</p> <p>“二、过渡期”中“6、申购份额与赎回金额的计算”的（3）赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见《招募说明书》，赎回金额单位为元。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示，赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用，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。”中，</p> | <p>《流动性风险管理规定》 第十九条</p> <p>《流动性风险管理规定》 第二十三条</p> |

| | | |
|----------------------|--|--|
| | <p>增加：</p> <p><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><u>“二、过渡期”中“7、拒绝或暂停申购的情形”</u></p> <p>中，增加：</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）当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金申购申请。”</u></p> <p><u>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。</u></p> | <p>《流动性风险管理规定》 第十九条</p> <p>《流动性风险管理规定》 第二十四条</p> <p>根据上述修改调整序号</p> |
| <p>运作周期到期</p> | <p><u>“二、过渡期”中“8、暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式”中，增加：</u></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，基金管理人应当暂停接受双</u></p> | <p>《流动性风险管理规定》 第二十四条</p> |

| | | |
|-----------------------|--|------------------------------|
| | <p>福 B 赎回申请或延缓支付赎回款项。”</p> <p>“二、过渡期”中“9、巨额赎回的情形及处理方式”中，增加：</p> <p>“若过渡期内，本基金单个开放日，当双福 B 单个基金份额持有人赎回申请超过前一工作日基金总份额（包括双福 A、双福 B，下同）30%的情形时，超过部分的赎回申请可以延期办理。延期办理部分的赎回申请将与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日双福 B 的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。延期办理的期限不得超过 20 个工作日，如延期办理期限超过开放期的，开放期相应延长，延长的开放期内不办理双福 B 的申购，亦不接受新的赎回申请，即基金管理人仅为原开放期内因延期赎回涉及的单个基金份额持有人办理赎回业务。而对于双福 A 单个持有人份额赎回申请不超过前一工作日基金总份额 30%(含)的部分，基金管理人应当以赎回申请日的基金份额净值确认全部赎回申请；若基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人可延缓支付赎回款项，延缓支付的赎回申请在基金管理人有能力支付赎回款项时一次性全额支付，但延缓支付期限最长不超过 20 个工作日。”</p> | <p>《流动性风险管理规定》第二十一条（二）</p> |
| <p>基金的信息披露</p> | <p>“一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他有关规定。”中，增加：</p> | <p>将《流动性风险管理规定》纳入信息披露的依据</p> |

| | | |
|---------|---|------------------------|
| | “《流动性规定》” | |
| 基金的信息披露 | <p>“五、公开披露的基金信息”之“（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”中，增加：</p> <p>“<u>基金管理人应当在基金年度报告和半年度报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。</u></p> <p><u>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（包括双福A、双福B）20%的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人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。</u>”</p> | 《流动性风险管理规定》第二十六条、第二十七条 |
| 基金的信息披露 | <p>“五、公开披露的基金信息”之“（七）临时报告”中，增加：</p> <p>“<u>27、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项；</u>”</p> | 《流动性风险管理规定》第二十六条 |

二、对基金托管协议主要修订内容、依据

| 章节 | 修订内容 | 修订依据 |
|------------------|---|--------------------------------------|
| 托管协议当事人 | <p>（二）基金托管人（或简称“托管人”）“法定代表人”和“注册资本”修订为：</p> <p>“法定代表人：<u>陈四清</u></p> <p>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>”</p> | 根据托管人最新披露信息修改 |
| 托管协议的依据、目的、原则和解释 | <p>“（一）依据”中，增加：</p> <p>“<u>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</u>”</p> | 将《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》作为制定托管协议的依据 |

| | | |
|----------------------------------|---|--|
| <p>基金托管人对基金管理人业务监督和核查</p> | <p>在“（一）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面：”之“2、对基金投融资比例进行监督：”中，增加：</p> <p>“（2）……<u>其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等；</u></p> <p><u>（5）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%；本基金管理人管理的且由本托管人托管的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%；</u></p> <p><u>（14）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的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本基金投资于流动性受限资产的市值合计超过本基金资产净值的15%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；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>《流动性风险管理规定》第十五条、第十六条、第十七条、第十八条、第四十条</p> <p>根据上述修改调整序号</p> |
|----------------------------------|---|--|

| | | |
|--|---|--|
| | <p>除上述第（2）、（11）、（14）、（15）项外，因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规另有规定的，从其规定。</p> | |
|--|---|--|