

《海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金基金合同》修改前后对照表

章节	修改前	修改后
<p>一 前言</p> <p>(一) 订立本基金合同的目的、依据和原则</p>	<p>2. 订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《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》</u>(以下简称“<u>《流动性管理规定》</u>”)和其他有关法律法规。</p>
<p>二、释义</p>		<p>新增：</p> <p>13. <u>《流动性管理规定》</u>：指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募</p>

		<p>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>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</p> <p>56. 摆动定价机制：指当开放式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>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</p>

<p>(三) 申购与赎回的原则</p>		<p>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。具体请参见相关公告。</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>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，其余用于支付注册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；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；对持有期满 7 天或以上，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>新增：</p> <p>8. 当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</p>

		保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律组织的规定。
六、基金份额的申购与赎回 (七) 拒绝或暂停申购的情形	3. 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。	3. 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍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。 新增： 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。
六、基金份额的申购与赎回 (七) 拒绝或暂停申购的情形	发生上述除第 4 项的暂停申购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	发生上述第 1、2、3、5、6、8 项的暂停申购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

	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。	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。
六、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	4. 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。	4. 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍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。
六、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： 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

		<p>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。</p>
<p>七、基金合同当事人及权利义务 (一) 基金管理人</p>	<p>法定代表人：邵国有</p>	<p>法定代表人：张文伟</p>
<p>七、基金合同当事人及权利义务 (二) 基金托管人</p>	<p>法定代表人郭树清</p>	<p>法定代表人：田国立</p>
<p>十二、基金的投资</p>	<p>本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份</p>	<p>本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股</p>

(二) 投资范围	<p>股（包括中小板、创业板股票及其他经中国证监会核准上市的股票）、新股（含首次公开发行和增发）、债券、债券回购、权证、股指期货、现金、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金投资于标的指数成份股票及其备选成份股票的市值不低于基金资产净值的 90%；投资于标的指数成份股票及其备选成份股票的市值加上买入、卖出股指期货合约的轧差合计值不低于基金资产净值的 90%；任何交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或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>（包括中小板、创业板股票及其他经中国证监会核准上市的股票）、新股（含首次公开发行和增发）、债券、债券回购、权证、股指期货、现金、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金投资于标的指数成份股票及其备选成份股票的市值不低于基金资产净值的 90%；投资于标的指数成份股票及其备选成份股票的市值加上买入、卖出股指期货合约的轧差合计值不低于基金资产净值的 90%；任何交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或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、应收申购款等。</p>
<p>十二、基金的投资 (六) 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>（11）本基金每个交易日日终在扣除股指期货</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>（11）本基金每个交易日日终在扣除股指期货合</p>

	<p>合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券；</p> <p>.....</p> <p>因证券期货市场波动、上市公司合并、基金规</p>	<p>约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，<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>.....</p> <p>新增：</p> <p>（13）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。因证券市场波动、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上述比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>（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本基金合同约定的投资范围保持一致；</p> <p>.....</p>
--	---	---

	<p>模变动、股权分置改革中支付对价、新股申购、上市公司停牌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，基金管理人应当在可上市交易日起 10 个工作日内进行调整。法律法规另有规定的从其规定。</p>	<p>除上述第（11）、（13）、（14）项外，因证券期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价、新股申购、上市公司停牌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>十四、基金资产的估值 (二) 估值方法</p>		<p>新增： 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>十四、基金资产的估值 (六) 暂停估值的情形</p>		<p>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的，基金管理人应当暂停估值；</p>
<p>十八、基金的信息</p>		<p>新增：</p>

<p>披露</p> <p>(七)基金年度报告、基金半年度报告、基金季度报告</p>		<p>5. 如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20%的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特定风险，中国证监会认定的特殊情形除外；</p> <p>6. 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；</p>
<p>十八、基金的信息披露</p> <p>(八)临时报告与公告</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；</p> <p>27. 基金管理人采用摆动定价机制进行估值；</p>

《海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金托管协议》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	法定代表人：邵国有	法定代表人：张文伟
一、基金托管协议当事人 (二) 基金托管人	法定代表人：郭树清	法定代表人：田国立
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	<p>(二) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、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>(11) 本基金每个交易日日终在扣除股指期货</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>(11) 本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金</p>

	<p>合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券；</p> <p>.....</p> <p>因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变</p>	<p>资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</p> <p>.....</p> <p>增加：</p> <p>（13）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。因证券市场波动、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上述比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>（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；</p> <p>.....</p> <p>除上述第（11）、（13）、（14）项外，因证券</p>
--	---	--

	<p>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>期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资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>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，对基金管理人投资流通受限证券进行监督</p>	<p>1. 本基金投资的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>1. 此处的流通受限证券与上述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</p>	<p>2. 估值方法</p>	<p>2. 估值方法</p> <p>新增：</p>

<p>算</p> <p>(二) 基金资产估值方法和特殊情形的处理</p>		<p>g、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>八、基金资产净值计算和会计核算</p> <p>(四) 暂停估值与公告的情形</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；</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>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一致暂停估值；</p>