

《海富通强化回报混合型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》(以下简称“《流动性规定》”)和其他有关法律法规。</p>
<p>一、前言</p>		<p>新增：</p> <p>(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。</p>

## 二、释义

新增：

《流动性规定》：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

.....

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

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，确保投资人的合法权益不受损害并得到公平对待
<b>六、基金份额的申购与赎回</b> (五)申购和赎回的限制		新增： 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。具体请参见相关公告。
<b>六、基金份额的申购与赎回</b> (六)申购和赎回的价格、费用及其用途	6.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。 7.本基金的申购费率最高不超过 5%，赎回费率最高不超过 5%。本基金的申购费率、赎回费率和收费方式由基金管理人根据基金合同的规定确定，并在招募说明书中列示。基金管理人可以在基金合同约定的范围内	6.赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，对于持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费全额归入基金财产，其他情况赎回费总额的 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。 7.本基金的申购费率最高不超过 5%，赎回费率最高不超过 5%，其中对持续持有期少于 7 日的投资者收

	<p>调整费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前 3 个工作日前在至少一种指定媒体公告。</p>	<p>取不低于 1.5%的赎回费。本基金的申购费率、赎回费率和收费方式由基金管理人根据基金合同的规定确定，并在招募说明书中列示。基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前 3 个工作日前在至少一种指定媒体公告。</p> <p>新增： 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。</p>
<p><b>六、基金份额的申购与赎回</b> <b>(七)拒绝或暂停申购的情形</b></p>	<p>3.发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。</p>	<p>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。</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><b>六、基金份额的申购与赎回</b></p> <p>(七)拒绝或暂停申购的情形</p>	<p>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>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><b>六、基金份额的申购与赎回</b></p> <p>(八)暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p>	<p>4.发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。</p>	<p>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，基金管理人应当暂停接受基金赎回申请或延缓支付赎回款项。</p>
<p><b>六、基金份额的申购</b></p>		<p>新增：</p>

<p><b>与赎回</b></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>式</p>		<p>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介上刊登公告。</p>
<p><b>七、基金合同当事人</b></p>	<p>住所：上海浦东新区世纪大道 88 号金茂大厦 37 楼</p>	<p>住所：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚</p>

<p><b>及权利义务</b></p> <p>(一)基金管理人</p>	<p>办公地址：上海浦东新区世纪大道 88 号金茂大厦 37 楼</p> <p>邮政编码：200121</p> <p>法定代表人：邵国有</p>	<p>银行金融大厦 36-37 层</p> <p>办公地址：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 36-37 层</p> <p>邮政编码：200120</p> <p>法定代表人：张文伟</p>
<p><b>七、基金合同当事人及权利义务</b></p> <p>(二)基金托管人</p>	<p>法定代表人：秦晓</p>	<p>法定代表人：李建红</p>
<p><b>十二、基金的投资</b></p> <p>(二) 投资方向和范围</p>	<p>本基金投资范围限于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、债券及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合的资产配置：股票资产 0%-95%，权证投资 0-3%，债券 5%—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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他产品，基金管理人在履行适当的程序后，可以将其纳入投资范围。</p>	<p>本基金投资范围限于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、债券及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合的资产配置：股票资产 0%-95%，权证投资 0-3%，债券 5%—95%；本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金（不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他产品，基金管理人在履行适当的程序后，可以</p>

		将其纳入投资范围。
<p><b>十二、基金的投资</b></p> <p>(七)投资限制</p>	<p>1、组合限制</p> <p>(6)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>1、组合限制</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，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；</p> <p>.....</p> <p>新增：</p> <p>(2)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%；</p> <p>.....</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</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(1)一(4)、(7)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>外的因素致使基金不符合该比例限制的，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本基金合同约定的投资范围保持一致；</p> <p>……</p> <p>除上述第(7)、(9)、(10)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>十四、基金资产的估值</p> <p>(三)估值方法</p>		<p>新增：</p> <p>5.当本基金发生大额申购或赎回情形时，本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</p>		<p>新增：</p>

<p>值</p> <p>(七)暂停估值的情形</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的，基金管理人应当暂停估值；</p>
<p>十八、基金的信息披露</p>	<p>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。基金管理人、基金托管人应按规定将基金信息披露事项在规定时间内通过中国证监会指定的全国性报刊和基金管理人、基金托管人的互联网网站等媒介披露。公开披露的基金信息包括：</p>	<p>基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性规定》、基金合同及其他有关规定。基金管理人、基金托管人应按规定将基金信息披露事项在规定时间内通过中国证监会指定的全国性报刊和基金管理人、基金托管人的互联网网站等媒介披露。公开披露的基金信息包括：</p>
<p>十八、基金的信息披露</p> <p>(七)基金年度报告、基金半年度报告、基金季度报告</p>		<p>新增：</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</p>

		<p>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>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><b>十八、基金的信息披露</b></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>

《海富通强化回报混合型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
<b>一、基金托管协议当事人</b> (一) 基金管理人	注册地址：上海浦东新区世纪大道 88 号金茂大厦 37 楼 办公地址：上海浦东新区世纪大道 88 号金茂大厦 37 楼 法定代表人：邵国有	注册地址：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 36-37 层 办公地址：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 36-37 层 法定代表人：张文伟
<b>一、基金托管协议当事人</b> (二) 基金托管人	法定代表人：秦晓	法定代表人：李建红
<b>二、基金托管协议的依据、目的和原则</b>	(一) 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》）、等有关法规及《海富通强化回报混	(一) 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

	<p>合型证券投资基金基金合同》（简称“基金合同”）由基金管理人和基金托管人订立。</p>	<p>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》）等有关法规及《海富通强化回报混合型证券投资基金基金合同》（简称“基金合同”）由基金管理人和基金托管人订立。</p>
<p><b>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</b></p> <p>(二) 基金托管人对基金投融资比例进行监督和核查</p>	<p>1、本基金的组合限制：</p> <p>(6)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、本基金的组合限制：</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，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；</p> <p>新增：</p> <p>(2)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%；</p>

		<p>.....</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该比例限制的，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><b>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</b></p> <p>(二) 基金托管人对基金投融资比例进行监督和核查</p>	<p>2、基金托管人应对基金的投资和融资比例是否符合基金合同的规定进行监督。基金托管人应自基金合同生效日起，监督基金合同约定的基金投资资产配置比例、单一投资类别比例限制、融资限制、股票申购限制、基金投资比例是否符合法规规定，不符合规定的，基金托管人应书面通知基金管理人进行整改，整改的时限应符合法规允许的投资比例调整期限。因证券市</p>	<p>2、基金托管人应对基金的投资和融资比例是否符合基金合同的规定进行监督。基金托管人应自基金合同生效日起，监督基金合同约定的基金投资资产配置比例、单一投资类别比例限制、融资限制、股票申购限制、基金投资比例是否符合法规规定，不符合规定的，基金托管人应书面通知基金管理人进行整改，整改的时限应符合法规允许的投资比例调整</p>

	<p>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(1)–(4)、(7)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。基金管理人在规定的限期内未能纠正的,基金托管人应书面报告中国证监会。基金托管人发现基金管理人重大违规行为,应立即报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正。</p>	<p>期限。</p> <p>除上述第(7)、(9)、(10)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的投资比例的,基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。基金管理人在规定的限期内未能纠正的,基金托管人应书面报告中国证监会。基金托管人发现基金管理人重大违规行为,应立即报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正。</p>
<p><b>八、基金资产净值计算和会计核算</b></p> <p>(一) 基金资产估值</p>	<p>1. 估值方法</p>	<p>1. 估值方法</p> <p>新增:</p> <p>当本基金发生大额申购或赎回情形时,本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><b>八、基金资产净值计算和会计核算</b></p> <p>(一) 基金资产估值</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</p>

6、暂停估值的情形		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；
-----------	--	---