

关于新疆前海联合基金管理有限公司旗下 11 只基金修改基金合同等法律文件的公告

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》”），《流动性规定》于 2017 年 10 月 1 日起施行。2017 年 10 月 1 日之前成立的产品法律文件的相关条款不符合《流动性规定》的规定，需要根据《流动性规定》修改。新疆前海联合基金管理有限公司（以下简称“本公司”）旗下 11 只基金（具体信息见下文）已根据《流动性规定》对基金合同分别进行修改（具体请见附件：11 只基金基金合同修改前后对照表），基金产品的其他法律文件也同步进行了相应修改。前述修改已与各只基金的基金托管人协商一致。

11 只基金的基本信息如下：

序号 基金名称（全称） 托管行

1 新疆前海联合海盈货币市场基金 中国工商银行股份有限公司

2

新疆前海联合添利债券型发起式证券投资基金

中国工商银行股份有限公司

3

新疆前海联合新思路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

4 新疆前海联合沪深 300 指数型证券投资基金 中国工商银行股份有限公司

5 新疆前海联合添和纯债债券型证券投资基金 中国工商银行股份有限公司

6

新疆前海联合国民健康产业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 新疆前海联合添鑫债券型证券投资基金 浙商银行股份有限公司

8 新疆前海联合永兴纯债债券型证券投资基金 浙商银行股份有限公司

9 新疆前海联合汇盈货币市场基金 中国邮政储蓄银行股份有限公司

10 新疆前海联合泳隆灵活配置混合型证券投资基金 宁波银行股份有限公司

11 新疆前海联合泳涛灵活配置混合型证券投资基金 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，根据基金合同的规定，因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改不需召开基金份额持有人大会，因此，本次对基金合同修订无需经基金份额持有人

大会审议，由基金管理人和基金托管人协商一致后修改，基金管理人已根据相关法规的要求及《基金合同》的约定，履行适当的《基金合同》修改程序，并将报监管机构备案。

上述修改自本公告发布之日起生效，但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 4 月 1 日起正式实施。

本公司将在网站公布修改后的基金合同对照表，各基金的招募说明书也将同步予以更新。

3

投资者若希望了解基金信息详情，请参阅本基金的基金合同、招募说明书及相关法律文件。投资者可登录本公司网站（www.qhlfund.com）或者拨打本公司客服电话：400-6400-099。

本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资者投资于本公司旗下基金时应认真阅读各基金的基金合同、招募说明书。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

新疆前海联合基金管理有限公司

二〇一八年三月二十四日

附件：

11 只基金基金合同修改前后对照表

4

1、《新疆前海联合海盈货币市场基金基金合同》修改前后对照表
章节 修改前 修改后 修改理由

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》”)、《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〉》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》”)、《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》”)、《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〉》和其他有关法律法规。

根据《流动性风险管理规定》增加。

释义 新增：根据《流动性风险管理规定》相应内容

5

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

60、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增加有关释义。

基金份额的申购、

赎回与转换

五、申购和赎回的

数量限制

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。具体见基金根据《流动性风险管理规定》19 条增加。

6

管理人相关公告。

基金份额的申购、

赎回与转换

六、申购和赎回的

价格、费用及其用

途

1、本基金一般不收取申购费用和赎回费用，但为确保基金平稳运作，避免诱发系统性风险而征收的强制赎回费用除外。

在满足相关流动性风险管理要求的前提下，当本基金持有的现金、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，基金管理人应当对当日单个基金份额持有人申请赎回基金份额超过基金总份额 1% 以上的赎回申请（超过 1% 的部分）征收 1% 的强制赎回费用，并将上述赎回费用全额计入基金财产。基金管理人与基金托管人协商确认上述做法无益于基金利益最大化的情形除外。

1、本基金一般不收取申购费用和赎回费用，但当出现以下情形之一时，为确保基金平稳运作，避免诱发系统性风险，基金管理人应当对当日单个基金份额持有人申请赎回基金份额超过基金总份额 1% 以上的赎回申请（超过 1% 的部分）征收 1% 的强制赎回费用，并将上述赎回费用全额计入基金财产。基金管理人与基金托管人协商确认上述做法无益于基金利益最大化的情形除外：

（1）在满足相关流动性风险管理要求的前提下，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；

(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%的，且本基金投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融根据《流动性风险管理规定》31 条修改。

7

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。

基金份额的申购、

赎回与转换

七、拒绝或暂停申

购的情形

新增：

10、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。

11、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。

根据《流动性风险管理规定》第 24 条补

充。

基金份额的申购、

赎回与转换

七、拒绝或暂停申

购的情形

发生上述第 1、2、3、5、6、8、9、10、11 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

发生上述第 1、2、3、5、6、8、9、11、12 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全部或部分拒绝的，被拒绝的申购款项将退还给投资根据上述增加情形调整序号。

8

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。

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。

基金份额的申购、

赎回与转换

八、暂停赎回或延

缓支付赎回款项的

情形

新增：

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。

根据《流动性风险管理规定》第 24 条修改。

基金份额的申购、
赎回与转换

九、巨额赎回的情
形及处理方式

新增：

（4）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 30%（“大额赎回申请人”），基金管理人可对大额赎回申请人的赎回申请延期处理，即按照保护其他赎回申请人（“小额赎回申请人”）利益的原则，基金管理人优先确认小额赎回申请人的赎回申请，具体为：如小额赎回申请人的赎回申请在当日被全部确认，则基金管理人在当日接受赎回根据《流动性风险管理规定》第 21 条

（二）增加。

9

比例不低于上一开放日基金总份额的 10%的前提下，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；如小额赎回申请人的赎回申请在当日未被全部确认，则对全部未确认的赎回申请（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。延期办理的具体程序，按照本条规定的延期赎回或取消赎回的方式办理。

具体见相关公告。

基金合同当事人及
权利义务

二、基金托管人

法定代表人：姜建清 法定代表人：易会满 基金托管人信息更新。

基金的投资

四、投资限制

（二）投资组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天，平均剩余存续期不

（二）投资组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计不超过基金总份额的 20%时，本基金投资组合根据《流动性风险管理规定》第 30、33、34、16、17 条修改、补充。

10

得超过 240 天；

（12）现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及五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% 的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天，平均剩余存续期不得超过 240 天；

（12）当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计不超过基金总份额的 20%时，现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及五个交易日

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%；

新增：

（14）本基金管理人管理的全部货币市场基金投资于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%；

（15）当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 50%时，本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

11

合计不得低于 30%；

（16）当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 20%时，本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%；

（17）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；

（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

12

除上述第（1）、（8）、（11）项另有约定外，因市场波动、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。

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；

（19）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该基金资产净值的 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；

.....

除上述第（1）、（8）、（11）、（18）、（19）项另有约定外，因市场波动、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。

基金的投资（三）禁止行为 根据《流动性风险管理规定》第 33 条补

13

四、投资限制 新增：

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。

充。

基金资产的估值

六、暂停估值的情形

形

新增：

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；

基金的信息披露

(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

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，基金管理人应当至少在季度报告、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、报告期内持根据《流动性风险管理规定》第 26、27、33 条补充。

14

有份额变化情况及本基金的特有风险。

新增：

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、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。

第十八部分 基金

的信息披露

(六) 临时报告

27、当影子定价确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的负偏离度绝对值达到 0.25%、正偏离度绝对值达到 0.50%、负偏离度绝对值达到 0.50% 以及负偏离度绝对值连续两个交易日超过 0.50% 的情形；

28、当影子定价确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的正偏离度绝对值达到 0.50%、负偏离度绝对值达到 0.50% 以及负偏离度绝对值连续两个交易日超过 0.50% 的情形；

新增：

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；

30、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；

根据实际实际情况修改。

根据《流动性风险管理规定》第 26、33 条补充

15

2、《新疆前海联合国民健康产业灵活配置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 修改理由

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》”)、《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》”)和其他有关法律法规。

根据《流动性风险管理规定》

增加。

释义 新增：根据《流动性风险管理规定》

16

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

.....

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

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相应内容增加有关释义。

17

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

基金份额的申购与赎回

五、申购和赎回的数量限制

新增：

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。

根据《流动性风险管理规定》

19 条增加。

基金份额的申购与赎回

六、申购和赎回的价格

3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算方式及处理方式详见《招募说明书》。本基金的赎回费率由基金管

3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算方式及处理方式详见《招募说明书》。本基金的赎回费率由基金管理人根据《流动性风险管理规定》

23 条修改。

18

格、费用及其用途 理人决定，并在招募说明书中列示。定，并在招募说明书中列示。其中对持续持有期少于 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。

新增：

7、当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人在履行适当程序后，可以采用摆动定价机制，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及监管部门、自律组织的规定。具体见基金管理人届时的相关公告。

根据《流动性风险管理规定》

第 25 条增加。

基金份额的申购与赎回

七、拒绝或暂停申购的情形

新增：

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。

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

根据《流动性风险管理规定》

第 19 条修改、补充。

根据《流动性风险管理规定》

第 24 条补充。

19

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。

基金份额的申购与赎回

回

七、拒绝或暂停申购的

情形

发生上述第 1、2、3、5、7、8 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。

发生上述第 1、2、3、5、7、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。

根据上述增加情形调整序号。

基金份额的申购与赎回

回

八、暂停赎回或延缓支

付赎回款项的情形

新增：

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。

根据《流动性风险管理规定》

第 24 条修改。

基金份额的申购与赎回 新增： 根据《流动性风险管理规定》

20

回

九、巨额赎回的情形及

处理方式

(4) 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 30%（“大额赎回申请人”），基金管理人可对大额赎回申请人的赎回申请延期处理，即按照保护其他赎回申请人（“小额赎回申请人”）利益的原则，基金管理人优先确认小额赎回申请人的赎回申请，具体为：如小额赎回申请人的赎回申请在当日被全部确认，则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的 10%的前提下，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；如小额赎回申请人的赎回申请在当日未被全部确认，则对全部未确认的赎回申请（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。延期办理的具体程序，按照本条规定的延期第 21 条（二）增加。

21

赎回或取消赎回的方式办理。

具体见相关公告。

基金合同当事人及权

利义务

二、基金托管人

法定代表人：姜建清

二、基金托管人

法定代表人：易会满

根据托管人信息更新修改。

基金的投资

二、投资范围

基金的投资组合比例为：本基金股票投资

占基金资产的比例范围为 0-95%；

基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金以后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。

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范围为 0-95%；

基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金以后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

根据《流动性风险管理规定》

18 条修改。

基金的投资

四、投资限制

（2）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

（2）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、存出保证金及应收申购款等；

根据《流动性风险管理规定》

18、15 条修改。

22

一家公司发行的证券，不超过该证券的

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%；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%；

基金的投资

四、投资限制

新增：

(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；

(19) 本基金与私募类证券资管产品及中国根据《流动性风险管理规定》

16、17 条内容要求增加。

23

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；

基金的投资

四、投资限制

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，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。除第(2)、(12)、(18)、(19)项以外，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，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。

根据上文标号修改。

基金资产估值

三、估值方法

(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

(3) 流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等(不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票)，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

新增：

8、当本基金发生大额申购或赎回情形时，根据基金业协会《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》修改。

根据《流动性风险管理规定》

24

基金管理人在履行适当程序后，可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。

第 25 条增加。

基金资产估值

六、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；

根据《流动性风险管理规定》

第 24 条增加。

基金的信息披露

（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，基金管理人应当至少在季度报告、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

根据《流动性风险管理规定》

第 26、27 条增加。

25

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。

基金的信息披露

（七）临时报告

新增：

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；

28、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；

根据《流动性风险管理规定》

第 25、26 条增加。

26

3、《新疆前海联合新思路灵活配置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 修改理由

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》”)、《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》”)和其他有关法律法规。

根据《流动性风险管理规定》增加。

释义 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

53、流动性受限资产：指由于法律法规、监管、根据《流动性风险管理规定》相应内容增加有关释义。

27

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

54、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

基金份额的申购与赎回

回

五、申购和赎回的数量

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。

根据《流动性风险管理规定》

19 条增加第 5 点。

28

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。

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》。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该类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。本基金赎回金额的计算方式及处理方式详

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》。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。其中对持续持有期少于 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。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类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。本基金赎回金额的计算方式及处理方式详

新增：

7、当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人在履行适当程序后，可以采用摆动定价机制，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及监管部门、自律组织的规定。具体根据《流动性风险管理规定》

23 条修改。

根据《流动性风险管理规定》

第 25 条增加。

29

见基金管理人届时的相关公告。

基金份额的申购与赎回

七、拒绝或暂停申购的情形

新增：

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。

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。

根据《流动性风险管理规定》

第 19 条修改、补充。

根据《流动性风险管理规定》

第 24 条补充。

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、7、8 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。

发生上述第 1、2、3、5、7、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。

根据上述增加情形调整序

号。

基金份额的申购与赎回 新增：

30

回

八、暂停赎回或延缓支

付赎回款项的情形

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。

根据《流动性风险管理规定》

第 24 条修改。

基金份额的申购与赎回

回

九、巨额赎回的情形及

处理方式

新增：

（4）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 30%（“大额赎回申请人”），基金管理人可对大额赎回申请人的赎回申请延期处理，即按照保护其他赎回申请人（“小额赎回申请人”）利益的原则，基金管理人优先确认小额赎回申请人的赎回申请，具体为：如小额赎回申请人的赎回申请在当日被全部确认，则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的 10%的前提下，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；如小额赎回申请人的赎回申请在当日未根据《流动性风险管理规定》

第 21 条（二）增加。

31

被全部确认，则对全部未确认的赎回申请（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。延期办理的具体程序，按照本条规定的延期赎回或取消赎回的方式办理。具体见相关公告。

基金合同当事人及权

利义务

二、基金托管人

名称：中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号
(100032)

法定代表人：姜建清

电话：(010) 66105799

传真：(010) 66105798

联系人：洪渊

成立时间：1984 年 1 月 1 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 35,640,625.71 万元

批准设立机关和设立文号：国务院《关于
中国人民银行专门行使中央银行职能的
决定》(国发【1983】146 号)

名称：中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号 (100032)

法定代表人：易会满

电话：(010) 66105799

传真：(010) 66105798

联系人：洪渊

成立时间：1984 年 1 月 1 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 35,640,625.71 万元

批准设立机关和设立文号：国务院《关于中国人民
银行专门行使中央银行职能的决定》(国发【1983】
146 号)

存续期间：持续经营

基金托管人信息更新。

32

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证
监基字【1998】3 号

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字
【1998】3 号

基金的投资

二、投资范围

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%，投资于
债券、银行存款、货币市场工具、现金、
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证券品种等
合计占基金资产的比例为 5%-100%，其
中权证投资占基金资产净值的比例为

0% - 3%；每个交易日日终，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%

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%，投资于债券、银行存款、货
币市场工具、现金、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证券品种
等合计占基金资产的比例为 5%-100%，其中权证投
资占基金资产净值的比例为 0% - 3%；每个交易日
日终，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%，其中现金不包括结算备付

金、存出保证金及应收申购款等。

根据《流动性风险管理规定》

18 条修改。

基金的投资

四、投资限制

新增：

(2) 每个交易日日终，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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等；

根据《流动性风险管理规定》

18 条修改。

33

(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%；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%；

(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；

(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；

根据《流动性风险管理规定》

15 条修改。

根据《流动性风险管理规定》

16、17 条内容要求增加。

34

基金的投资

四、投资限制

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，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。

除第(2)、(12)、(18)、(19)项以外，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，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。

根据上文标号修改。

基金资产估值

三、估值方法

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

改为：

(3) 流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等（不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票），按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

根据基金业协会《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》修改。

基金资产估值

三、估值方法

新增：

6、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人在履行适当程序后，可以采用摆动定价机制，根据《流动性风险管理规定》第 25 条增加。

35

以确保基金估值的公平性。

基金资产估值

六、暂停估值的情形

六、暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

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；

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，决定延迟估值；

4、出现导致基金管理人不能出售或评估基金资产的紧急事故时；

5、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

六、暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

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；

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，决定延迟估值；

4、出现导致基金管理人不能出售或评估基金资产的紧急事故时；

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；

6、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

根据《流动性风险管理规定》

第 24 条修改。

基金的信息披露

(六) 基金定期报告,

新增:

报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到 根据《流动性风险管理规定》

36

包括基金年度报告、基

金半年度报告和基金

季度报告

或超过基金总份额 20%的情形,为保障其他投资者利益,基金管理人应当至少在季度报告、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。

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 26、27 条增加。

基金的信息披露

(七) 临时报告

新增:

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项时;

29、基金管理人采用摆动定价机制进行估值;

根据《流动性风险管理规定》

第 25、26 条增加。

37

4、《新疆前海联合添利债券型发起式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 修改理由

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》”)、

《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》”)和其他有关法律、法规。

根据《流动性风险管理规定》

增加。

释义 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 日根据《流动性风险管理规定》相应内容增加有关释义。

38

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

41、摆动定价机制：指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

59、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的股票、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

39

券等

基金份额的申购与赎

回

五、申购和赎回的数量

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。

具体见基金管理人相关公告。

根据《流动性风险管理规定》

19 条增加第 5 点。

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、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算方式及处理方式详见招募说明书。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。

3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算方式及处理方式详见招募说明书。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。其中对持续持有期少于 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。

根据《流动性风险管理规定》

23 条修改。

40

新增：

7、当发生大额申购或赎回情形时，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。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规及监管部门、自律组织的规定。具体见基金管理人届时的相关公告。

根据《流动性风险管理规定》

第 25 条增加。

基金份额的申购与赎

回

七、拒绝或暂停申购的

情形

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（基金管理人或其高级管理人员、基金经理作为发起资金提供方的除外）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；

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。

根据《流动性风险管理规定》

第 19 条修改、补充。

根据《流动性风险管理规定》

第 24 条补充。

41

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、8、9 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。

根据上述增加情形调整序号。

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：

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。

根据《流动性风险管理规定》

第 24 条修改。

基金份额的申购与赎

回

九、巨额赎回的情形及

新增：

(4) 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

根据《流动性风险管理规定》

第 21 条（二）增加。

42

处理方式 总份额的 30%（“大额赎回申请人”），基金

管理人可对大额赎回申请人的赎回申请延

期处理，即按照保护其他赎回申请人（“小

额赎回申请人”）利益的原则，基金管理人

优先确认小额赎回申请人的赎回申请，具体

为：如小额赎回申请人的赎回申请在当日被

全部确认，则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的 10%的

前提下，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；如小额赎回申请人的赎回申请在当日未

被全部确认，则对全部未确认的赎回申请

（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。

延期办理的具体程序，按照本条规定的延期

赎回或取消赎回的方式办理。

具体见相关公告。

43

基金合同当事人及权

利义务

二、基金托管人

法定代表人：姜建清 法定代表人：易会满 根据实际情况修改

基金的投资

二、投资范围

基金的投资组合比例为：本基金投资于债

券的比例不低于基金资产的 80%；本基金

持有现金或者到期日在一年以内的政府

债券投资比例不低于基金资产净值的 5%

基金的投资组合比例为：本基金投资于债

券的比例不低于基金资产的 80%；本基金持

有现金或者到期日在一年以内的政府债券

投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中

现金不包括结算备付金、存出保证金及应收

申购款等。

根据《流动性风险管理规定》

18 条修改。

基金的投资

四、投资限制

新增：

(3) 每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，持有的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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等；

(5) 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%，本基金管理人管理的全部开放式基金（包括根据《流动性风险管理规定》

18、15 条修改。

44

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%；

(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；

(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、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；

根据《流动性风险管理规定》

16、17 条内容要求增加。

基金的投资

四、投资限制

除“投资限制”第（13）条款以外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金除“投资限制”第（3）、（13）、（14）、（15）条款以外，因证券、期货市场波动、证券发

根据上文标号修改。

45

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。

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，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。

基金资产估值

三、估值方法

(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业

协会有关规定确定公允价值。

(3) 流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等（不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票），按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

新增：

8、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人在履行适当程序后，可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。

根据基金业协会《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》修改。

根据《流动性风险管理规定》

第 25 条增加。

基金资产估值

六、暂停估值的情形

六、暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法

六、暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定 根据《流动性风险管理规定》

46

定节假日或因其他原因暂停营业时；

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；

3、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

节假日或因其他原因暂停营业时；

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；

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；

4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

第 24 条修改。

基金的信息披露

(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，基金管理人应当至少在季度报告、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

根据《流动性风险管理规定》

第 26、27 条增加。

47

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。

基金的信息披露

(七) 临时报告

新增：

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项时；

29、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；

根据《流动性风险管理规定》

第 25、26 条增加。

48

5、《新疆前海联合沪深 300 指数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 修改理由

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》”)、《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》”)和其他有关法律法

规。
根据《流动性风险管理规定》

增加。

释义 新增： 根据《流动性风险管理规定》

49

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

.....

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

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相应内容增加有关释义。

50

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

基金份额的申购与赎回

五、申购和赎回的数量

限制

新增：

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。

根据《流动性风险管理规定》

19 条增加。

基金份额的申购与赎回

回

六、申购和赎回的价格

3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算方式及处理方式详见《招募说明书》。本基金的赎回费率由基金管

3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算方式及处理方式详见《招募说明书》。本基金的赎回费率由基金管理人决定根据《流动性风险管理规定》

23 条修改。

51

格、费用及其用途 理人决定，并在招募说明书中列示。定，并在招募说明书中列示。其中对持续持有期少于 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。

新增：

7、当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人在履行适当程序后，可以采用摆动定价机制，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及监管部门、自律组织的规定。具体见基金管理人届时的相关公告。

根据《流动性风险管理规定》

第 25 条增加。

基金份额的申购与赎回

回

七、拒绝或暂停申购的情形

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。

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。

根据《流动性风险管理规定》

第 19 条修改、补充。

根据《流动性风险管理规定》

第 24 条补充。

52

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。

基金份额的申购与赎回

回

七、拒绝或暂停申购的情形

情形

发生上述第 1、2、3、5、7、8 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。

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。

根据上述增加情形调整序号。

基金份额的申购与赎回

回

八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

新增：

新增：

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。

根据《流动性风险管理规定》

第 24 条修改。

基金份额的申购与赎回 新增： 根据《流动性风险管理规定》

53

回

九、巨额赎回的情形及

处理方式

(4) 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 30% (“大额赎回申请人”)，基金

管理人可对大额赎回申请人的赎回申请延期处理，即按照保护其他赎回申请人（“小额赎回申请人”）利益的原则，基金管理人优先确认小额赎回申请人的赎回申请，具体为：如小额赎回申请人的赎回申请在当日被全部确认，则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的 10%的前提下，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；如小额赎回申请人的赎回申请在当日未被全部确认，则对全部未确认的赎回申请（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。延期办理的具体程序，按照本条规定的延期第 21 条（二）增加。

54

赎回或取消赎回的方式办理。

具体见相关公告。

基金合同当事人及权

利义务

二、基金托管人

法定代表人：姜建清

二、基金托管人

法定代表人：易会满

根据托管人信息更新修改。

基金的投资

二、投资范围

基金的投资组合比例为：本基金持有的股票资产占基金资产的比例不低于 90%，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 80%，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资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。

基金的投资组合比例为：本基金持有的股票资产占基金资产的比例不低于 90%，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 80%，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、存出保证金及应收申购款等。

根据《流动性风险管理规定》

18 条修改。

基金的投资

四、投资限制

（2）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资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券；

（2）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、存出保证金及应收申购款等；

根据《流动性风险管理规定》

18 条修改。

55

基金的投资

四、投资限制

新增：

(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；

(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；

根据《流动性风险管理规定》

16、17 条内容要求增加。

基金的投资

四、投资限制

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，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。

除第 (2)、(12)、(17)、(18)项以外，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，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

根据上文标号修改。

56

规另有规定的，从其规定。

基金资产估值

三、估值方法

(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

(3) 流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等（不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票），按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

新增：

7、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人在履行适当程序后，可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。

根据基金业协会《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》修改。

根据《流动性风险管理规定》第 25 条增加。

基金资产估值

六、暂停估值的情形

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的，基金管理人应当暂停基金估值；

根据《流动性风险管理规定》

第 24 条增加。

基金的信息披露 新增： 根据《流动性风险管理规定》

57

（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

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，基金管理人应当至少在季度报告、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。

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 26、27 条增加。

基金的信息披露

（七）临时报告

新增：

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；

28、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；

根据《流动性风险管理规定》

第 25、26 条增加。

58

6、《新疆前海联合添和纯债债券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 修改理由

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》”)、《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》”)和其他有关法律法规。

根据《流动性风险管理规定》

增加。

释义 13、《流动性风险管理规定》：指中国证监会根据《流动性风险管理规定》

59

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

41、摆动定价机制：指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

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

相应内容增加有关释义。

60

基金份额的申购与赎回

回

五、申购和赎回的数量

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。

具体见基金管理人相关公告。

根据《流动性风险管理规定》

19 条增加第 5 点。

基金份额的申购与赎回

回

六、申购和赎回的价

格、费用及其用途

3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算方式及处理方式详见招募说明书。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。

3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算方式及处理方式详见招募说明书。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。其中对持续持有期少于 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。

新增：

根据《流动性风险管理规定》

23 条修改。

61

7、当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人在履行适当程序后，可以采用摆动定价机制，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及监管部门、自律组织的规定。具体见基金管理人届时的相关公告。

根据《流动性风险管理规定》

第 25 条增加。

基金份额的申购与赎

回

七、拒绝或暂停申购的

情形

新增：

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。

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。

根据《流动性风险管理规定》

第 19 条修改、补充。

根据《流动性风险管理规定》

第 24 条补充。

基金份额的申购与赎 发生上述第 1、2、3、5、7、8 项暂停申 发生上述第 1、2、3、5、7、9、10 项暂停

根据上述增加情形调整序号。

62

回

七、拒绝或暂停申购的

情形

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。

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。

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：

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。

根据《流动性风险管理规定》第 24 条修改。

基金份额的申购与赎回

九、巨额赎回的情形及处理方式

新增：

（4）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 30%（“大额赎回申请人”），基金根据《流动性风险管理规定》第 21 条（二）增加。

63

管理人可对大额赎回申请人的赎回申请延期处理，即按照保护其他赎回申请人（“小额赎回申请人”）利益的原则，基金管理人优先确认小额赎回申请人的赎回申请，具体为：如小额赎回申请人的赎回申请在当日被全部确认，则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的 10%的前提下，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；如小额赎回申请人的赎回申请在当日未被全部确认，则对全部未确认的赎回申请（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。延期办理的具体程序，按照本条规定的延期赎回或取消赎回的方式办理。

具体见相关公告。

基金合同当事人及权 （一） 基金托管人简况 （一） 基金托管人简况 基金托管人信息更新。

64

利义务

二、基金托管人

名称：中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号（100032）

法定代表人：姜建清

成立时间：1984 年 1 月 1 日

批准设立机关和批准设立文号：国务院
《关于中国人民银行专门行使中央银行
职能的决定》（国发【1983】146号）
组织形式：股份有限公司
注册资本：人民币 35,640,625.71 万元
存续期间：持续经营
基金托管资格批文及文号：中国证监会证
监基字【1998】3号
名称：中国工商银行股份有限公司
住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号
（100032）

法定代表人：易会满
成立时间：1984 年 1 月 1 日
批准设立机关和批准设立文号：国务院《关
于中国人民银行专门行使中央银行职能的
决定》（国发【1983】146号）
组织形式：股份有限公司
注册资本：人民币 35,640,625.71 万元
存续期间：持续经营
基金托管资格批文及文号：中国证监会证监
基字【1998】3号

基金的投资

二、投资范围

基金的投资组合比例为：本基金投资于债
券的比例不低于基金资产的 80%；本基金
持有现金或者到期日在一年以内的政府
债券投资比例不低于基金资产净值的 5%
基金的投资组合比例为：本基金投资于债券
的比例不低于基金资产的 80%；本基金持
有现金或者到期日在一年以内的政府债券
投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中
现金不包括结算备付金、存出保证金及应收
根据《流动性风险管理规定》

18 条修改。

65

申购款等。

基金的投资

四、投资限制

新增：

（2）本基金持有现金或者到期日在一年以
内的政府债券投资比例合计不低于基金资
产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、
存出保证金及应收申购款等；

（12）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；

（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；

根据《流动性风险管理规定》

18 条修改。

根据《流动性风险管理规定》

16、17 条内容要求增加。

基金的投资

四、投资限制

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根据上文标号修改。

66

基金投资比例不符合上述规定投资比例的，除上述组合限制（9）的约定外，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。

投资比例不符合上述规定投资比例的，除上述组合限制（2）、（9）、（12）（13）的约定外，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。

基金资产估值

三、估值方法

新增：

7、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人在履行适当程序后，可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。

根据《流动性风险管理规定》

第 25 条增加。

基金资产估值

六、暂停估值的情形

六、暂停估值的情形

- 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；
- 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；
- 3、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

六、暂停估值的情形

- 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；
 - 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；
 - 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
- 根据《流动性风险管理规定》

第 24 条修改。

67

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；

- 4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

基金的信息披露

（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,基金管理人应当至少在季度报告、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。

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。

根据《流动性风险管理规定》

第 26、27 条增加。

基金的信息披露

(七) 临时报告

新增:

27、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在 根据《流动性风险管理规定》
68

在影响投资者赎回等重大事项时;

28、基金管理人采用摆动定价机制进行估值;

第 25、26 条增加。

69

7、《新疆前海联合添鑫债券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 修改理由

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》”)、《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》”)和其他有关法律、法规。

根据《流动性风险管理规定》

增加。

释义 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

根据《流动性风险管理规定》

相应内容增加有关释义。

70

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

41、摆动定价机制：指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

56、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的股票、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

71

券等

基金份额的申购与赎

回

五、申购和赎回的数量

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。

具体见基金管理人相关公告。

根据《流动性风险管理规定》

19 条增加第 5 点。

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

4、本基金 A 类基金份额在申购时收取申购费用，C 类基金份额不收取申购费用。

A 类基金份额申购费用由申购 A 类基金份额的投资者承担，不列入基金财产。

4、本基金 A 类基金份额在申购时收取申购费用，C 类基金份额不收取申购费用。A 类基金份额申购费用由申购 A 类基金份额的投资者承担，不列入基金财产。其中对持续持有期少于 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。

根据《流动性风险管理规定》

23 条修改。

72

新增：

7、当发生大额申购或赎回情形时，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。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规及监管部门、自律组织的规定。具体见基金管理人届时的相关公告。

根据《流动性风险管理规定》

第 25 条增加。

基金份额的申购与赎

回

七、拒绝或暂停申购的

情形

新增：

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（基金管理人或其高级管理人员、基金经理作为发起资金提供方的除外）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；

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。

根据《流动性风险管理规定》

第 19 条修改、补充。

根据《流动性风险管理规定》

第 24 条补充。

73

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、7、8 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。

发生上述第 1、2、3、5、7、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。

根据上述增加情形调整序号。

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：

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。

根据《流动性风险管理规定》

第 24 条修改。

基金份额的申购与赎回

九、巨额赎回的情形及

新增：

（4）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

根据《流动性风险管理规定》

第 21 条（二）增加。

74

处理方式 总份额的 30%（“大额赎回申请人”），基金

管理人可对大额赎回申请人的赎回申请延

期处理，即按照保护其他赎回申请人（“小

额赎回申请人”）利益的原则，基金管理人

优先确认小额赎回申请人的赎回申请，具体

为：如小额赎回申请人的赎回申请在当日被

全部确认，则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的 10%的

前提下，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；如小额赎回申请人的赎回申请在当日未

被全部确认，则对全部未确认的赎回申请

（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。

延期办理的具体程序，按照本条规定的延期

赎回或取消赎回的方式办理。

具体见相关公告。

75

基金合同当事人及权

利义务

二、基金托管人

注册资本：人民币 115 亿元 注册资本：：人民币 17,959,696,778 元 根据实际情况修改

基金的投资

二、投资范围

基金的投资组合比例为：本基金投资于债

券的比例不低于基金资产的 80%；本基金

持有现金或者到期日在一年以内的政府

债券投资比例不低于基金资产净值的 5%

基金的投资组合比例为：本基金投资于债

券的比例不低于基金资产的 80%；本基金持

有现金或者到期日在一年以内的政府债券

投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中

现金不包括结算备付金、存出保证金及应收

申购款等。

根据《流动性风险管理规定》

18 条修改。

基金的投资

四、投资限制

新增：

（3）每个交易日日终在扣除国债期货合约

需缴纳的交易保证金后，持有的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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等；

(5) 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%，本基金管理人管理的全部开放式基金（包括根据《流动性风险管理规定》

18、15 条修改。

76

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%；

(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；

(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；

根据《流动性风险管理规定》

16、17 条内容要求增加。

基金的投资 因证券、期货市场波动、证券发行人合并、 除第 (3)、(13)、(14)、(15) 项以外，因根据上文标号修改。

77

四、投资限制 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。

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，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。

基金资产估值

三、估值方法

(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

(3) 流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等（不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票），按监管机构

或行业协会有关规定确定公允价值。

新增：

9、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人在履行适当程序后，可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。

根据基金业协会《证券投资基金投资流通受限股票估值指引

（试行）》修改。

根据《流动性风险管理规定》

第 25 条增加。

基金资产估值 六、暂停估值的情形 六、暂停估值的情形

78

六、暂停估值的情形 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；

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；

3、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

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；

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；

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；

4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

根据《流动性风险管理规定》

第 24 条修改。

基金的信息披露

（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，基金管理人应当至少在季度报告、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

根据《流动性风险管理规定》

第 26、27 条增加。

79

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。

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。

基金的信息披露

（七）临时报告

新增：

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项时；

29、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；

根据《流动性风险管理规定》

第 25、26 条增加。

80

8、《新疆前海联合永兴纯债债券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 修改理由

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》”)。

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》”)、《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》”)和其他有关法律法规。

根据《流动性风险管理规定》

增加。

释义 新增： 根据《流动性风险管理规定》

81

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

...

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的股票、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

54、摆动定价机制：指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相应内容增加有关释义。

82

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

基金份额的申购与赎回

五、申购和赎回的数量限制

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。

根据《流动性风险管理规定》

19 条增加第 5 点。

基金份额的申购与赎回

回

六、申购和赎回的价格、费用及其用途

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》。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

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》。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。其中对持续持有期少于 7 日的根据《流动性风险管理规定》

23 条修改。

83

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。

投资者收取不少于 1.5% 的赎回费并全额计入基金财产。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。

新增：

8、当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人在履行适当程序后，可以采用摆动定价机制，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及监管部门、自律组织的规定。具体见基金管理人届时的相关公告。

根据《流动性风险管理规定》

第 25 条增加。

基金份额的申购与赎回

回

七、拒绝或暂停申购的

情形

新增：

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% 根据《流动性风险管理规定》

第 19 条修改、补充。

84

集中度的情形时；

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。

根据《流动性风险管理规定》

第 24 条补充。

基金份额的申购与赎回

回

七、拒绝或暂停申购的

情形

发生上述第 1、2、3、5、7、8 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介上公告。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、7、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介上公告。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。

根据上述增加情形调整序号。

基金份额的申购与赎回

回

八、暂停赎回或延缓支

付赎回款项的情形

新增：

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，基金管根据《流动性风险管理规定》

第 24 条修改。

85

理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。

基金份额的申购与赎回

回

九、巨额赎回的情形及

处理方式

新增：

(4) 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 30% (“大额赎回申请人”), 基金管理人可对大额赎回申请人的赎回申请延期处理, 即按照保护其他赎回申请人 (“小额赎回申请人”) 利益的原则, 基金管理人优先确认小额赎回申请人的赎回申请, 具体为: 如小额赎回申请人的赎回申请在当日被全部确认, 则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的 10% 的前提下, 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; 如小额赎回申请人的赎回申请在当日未被全部确认, 则对全部未确认的赎回申请根据《流动性风险管理规定》第 21 条 (二) 增加。

86

(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。延期办理的具体程序, 按照本条规定的延期赎回或取消赎回的方式办理。具体见相关公告。

基金的投资

二、投资范围

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%; 本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5% 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%; 本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%, 其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

根据《流动性风险管理规定》

18 条修改。

基金的投资

四、投资限制

(2) 本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%;

(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家发行的证券, 不超过该证券发行总量的 10%;

(2) 本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%, 其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等;

(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家发行的证券, 不超过该证券发行总量的 10%; 本基金管理人管理的全部开放式

根据《流动性风险管理规定》

18 条、15 条修改。

87

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%;

新增:

(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该基金资产净值的 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;

(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;

根据《流动性风险管理规定》

16、17 条内容要求增加。

88

基金的投资

四、投资限制

除(10)项以外因证券市场波动、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,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。

除(2)、(10)、(12)、(13)项以外因证券市场波动、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,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。

根据上文标号修改。

基金资产估值

三、估值方法

(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票,同一股票在交易所上市后,按交易所上市的同一股票的估值方法估值;非公开发行有明确锁定期的股票,按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

(3) 流通受限的股票,包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等(不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票),按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

新增:

7、当本基金发生大额申购或赎回情形时,基金管理人可以采用摆动定价机制,以确保基金估值的公平性。

根据基金业协会《证券投资基

金投资流通受限股票估值指引
(试行)》修改。

根据《流动性风险管理规定》

第 25 条增加。

基金资产估值 新增:

89

六、暂停估值的情形 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;

根据《流动性风险管理规定》

第 24 条修改。

基金的信息披露

(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,基金管理人应当至少在季度报告、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。

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。

根据《流动性风险管理规定》

第 26、27 条增加。

90

基金的信息披露

(七)临时报告

新增:

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;

28、基金管理人采用摆动定价机制进行估值;

根据《流动性风险管理规定》

第 25、26 条增加。

91

9、《新疆前海联合汇盈货币市场托管协议》修改前后对照表
章节 修改前 修改后 修改理由

一、基金托管协议

当事人

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》”)、《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》”）、《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〉》和其他有关法律法规。

根据《流动性风险管理规定》增加。

92

释义 新增：

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

60、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

根据《流动性风险管理规定》相应内容

增加有关释义。

基金份额的申购、

赎回与转换

五、申购和赎回的

数量限制

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，可根据《流动性风险管理规定》19 条增加。

93

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。

基金份额的申购、

赎回与转换

六、申购和赎回的

价格、费用及其用

途

1、本基金一般不收取申购费用和赎回费用，但为确保基金平稳运作，避免诱发系统性风险而征收的强制赎回费用除外。

在满足相关流动性风险管理要求的前提下，当本基金持有的现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个工作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，基金管理人应当对当日单个基金份额持有人申请赎回基金份额超过基金总份额 1% 以上的赎回申请（超过 1% 的部分）征收 1% 的强制赎回费用，并将上述赎回费用全额计入基金财产。基金管理人与基金托管人协商确认上述做法无益于基金利益最大化的情形除外。

1、本基金一般不收取申购费用和赎回费用，但当出现以下情形之一时，为确保基金平稳运作，避免诱发系统性风险，基金管理人应当对当日单个基金份额持有人申请赎回基金份额超过基金总份额 1%以上的赎回申请（超过 1%的部分）征收 1%的强制赎回费用，并将上述赎回费用全额计入基金财产。基金管理人与基金托管人协商确认上述做法无益于基金利益最大化的情形除外：

（1）在满足相关流动性风险管理要求的前提下，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；

（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%的，且本基金投资根据《流动性风险管理规定》31 条修改。

94

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。

基金份额的申购、赎回与转换

七、拒绝或暂停申购的情形

新增：

13、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。

根据《流动性风险管理规定》第 24 条补充。

基金份额的申购、赎回与转换

七、拒绝或暂停申购的情形

发生上述第 1、2、3、5、6、10、11、13 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。

发生上述第 1、2、3、5、6、10、11、13、14 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。

根据上述增加情形调整序号。

95

基金份额的申购、

赎回与转换

八、暂停赎回或延

缓支付赎回款项的

情形

新增：

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。

根据《流动性风险管理规定》第 24 条修

改。

基金份额的申购、

赎回与转换

九、巨额赎回的情

形及处理方式

新增：

（4）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 30%（“大额赎回申请人”），基金管理人可对大额赎回申请人的赎回申请延期处理，即按照保护其他赎回申请人（“小额赎回申请人”）利益的原则，基金管理人优先确认小额赎回申请人的赎回申请，具体为：如小额赎回申请人的赎回申请在当日被全部确认，则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的 10%的前提下，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，对大额赎回申请根据《流动性风险管理规定》第 21 条

（二）增加。

96

人未予确认的赎回申请延期办理；如小额赎回申请人的赎回申请在当日未被全部确认，则对全部未确认的赎回申请（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。延期办理的具体程序，按照本条规定的延期赎回或取消赎回的方式办理。

具体见相关公告。

基金合同当事人及

权利义务

二、基金托管人

注册资本：686.04 亿元人民币 注册资本：810.31 亿元人民币 根据实际情况修改

基金的投资

四、投资限制

（二）投资组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天，平均剩余存续期不得超过 240 天；

（12）现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及五个交易日内到期的其他金融工

（二）投资组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计不超过基金总份额的 20%时，本基金投资组

合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天，平均剩余存续期不得超过 240 天；

(12) 当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计不超过基金总份额的 20%时，现金、国债、根据《流动性风险管理规定》第 30、33、34、16、17 条修改、补充。

97

具占基金资产净值的比例合计不得低于 10% 中央银行票据、政策性金融债券以及五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%；

新增：

(14) 本基金管理人管理的全部货币市场基金投资于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%；

(15) 当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 50%时，本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 个交易日内的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 30%；

(16) 当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 20%时，本基金投资组合的平均剩余期限不得超过 90 天，平均剩余存

98

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 个交易日内的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 20%；

(17) 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；

(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；

(19) 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该基金资产净值的 10%。因证

99

除上述第 (1)、(8)、(11) 项另有约定外，因市场波动、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。

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；

.....

除上述第（1）、（8）、（11）、（18）、（19）项另有约定外，因市场波动、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。

基金的投资

四、投资限制

（三）禁止行为

新增：

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根据《流动性风险管理规定》第 33 条补充。

100

管人的同意，并作为重大事项履行信息披露程序。

基金资产的估值

六、暂停估值的情形

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的，基金管理人应当暂停基金估值；

基金的信息披露

（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

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。

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，基金管理人应当至少在季度报告、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。

新增：

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根据《流动性风险管理规定》第 26、27、33 条补充。

101

性风险分析等、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。

第十八部分 基金
的信息披露

(六) 临时报告

27、当影子定价确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的负偏离度绝对值达到 0.25%、正偏离度绝对值达到 0.50%、负偏离度绝对值达到 0.50%以及负偏离度绝对值连续两个交易日超过 0.50%的情形；

27、当影子定价确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的正偏离度绝对值达到 0.50%、负偏离度绝对值达到 0.50%以及负偏离度绝对值连续两个交易日超过 0.50%的情形；

新增：

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项时；

29、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；

根据实际情况修改。

根据《流动性风险管理规定》第 26、33 条补充

102

10、《新疆前海联合泳隆灵活配置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 修改理由

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》”)、

《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》”)和其他有关法律、法规。

根据《流动性风险管理规定》

增加。

第二部分 释义 13、《流动性风险管理规定》：指中国证监会根据《流动性风险管理规定》

103

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

.....

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

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，从而减相应内容增加有关释义。

104

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

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

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。

根据《流动性风险管理规定》

19 条增加。

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

3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算方式及处理方式详见招募说明书，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。

3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算方式及处理方式详见《招募说明书》。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。其中对持续持有期少于 7 日的投资者收取不少于 1.5% 的根据《流动性风险管理规定》

23 条修改。

105

赎回费并全额计入基金财产。

新增：

7、当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人在履行适当程序后，可以采用摆动定价机制，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及监管

部门、自律组织的规定。具体见基金管理人届时的相关公告。

根据《流动性风险管理规定》

第 25 条增加。

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：

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。

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。

根据《流动性风险管理规定》

第 19 条修改、补充。

根据《流动性风险管理规定》

第 24 条补充。

106

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、7、8 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。

发生上述第 1、2、3、5、7、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。

根据上述增加情形调整序号。

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：

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。

根据《流动性风险管理规定》

第 24 条修改。

第六部分 基金份额的
申购与赎回

九、巨额赎回的情形及

新增：

（4）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根据《流动性风险管理规定》

第 21 条（二）增加。

107

处理方式 总份额的 30%（“大额赎回申请人”），基金管理人可对大额赎回申请人的赎回申请延期处理，即按照保护其他赎回申请人（“小额赎回申请人”）利益的原则，基金管理人优先确认小额赎回申请人的赎回申请，具体为：如小额赎回申请人的赎回申请在当日被全部确认，则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的 10%的前提下，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；如小额赎回申请人的赎回申请在当日未被全部确认，则对全部未确认的赎回申请（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。延期办理的具体程序，按照本条规定的延期赎回或取消赎回的方式办理。

具体见相关公告。

108

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：本基金股票投资占基金资产的比例范围为 0-95%；

基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除国债期货合约和股指期货合约需缴纳的保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。

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范围为 0-95%；

基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金以后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

根据《流动性风险管理规定》

18 条修改。

第十二部分 基金的投
资

四、投资限制

（2）本基金每个交易日日终在扣除股指

期货合约、国债期货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%；

(2) 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、存出保证金及应收申购款等；

(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%；
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)根据《流动性风险管理规定》

18、15 条修改。

109

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%；

第十二部分 基金的投资

四、投资限制

新增：

(19) 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；

(20) 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；
根据《流动性风险管理规定》

16、17 条内容要求增加。

第十二部分 基金的投资

资

除第(12)项以外，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除第(2)、(12)、(19)、(20)项以外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金根据上文标号修改。

110

四、投资限制 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。

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。

第十四部分 基金资产

估值

三、估值方法

(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

(3) 流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等（不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票），按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

新增：

9、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人在履行适当程序后，可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。

根据基金业协会《证券投资基金投资流通受限股票估值指引

（试行）》修改。

根据《流动性风险管理规定》

第 25 条增加。

第十四部分 基金资产

估值

六、暂停估值的情形

六、暂停估值的情形 六、暂停估值的情形

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

根据《流动性风险管理规定》

第 24 条增加。

111

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；

第十八部分 基金的信息披露

信息披露

(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，基金管理人应当至少在季度报告、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。

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。

根据《流动性风险管理规定》

第 26、27 条增加。

第十八部分 基金的信息披露 新增：根据《流动性风险管理规定》

112

信息披露

(七) 临时报告

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；

28、基金管理人采用摆动定价机制进行估

值；

第 25、26 条增加。

113

11、《新疆前海联合泳涛灵活配置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 修改理由

前言 2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同》(以下简称“《合同》”)、

《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》(以下简称“《合同》”)、《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》”)、

《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》”)和其他有关法律法

规。
根据《流动性风险管理规定》

增加。

释义 新增：根据《流动性风险管理规定》

114

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

.....

50、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

51、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相应内容增加有关释义。

115

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

基金份额的申购与赎回

五、申购和赎回的数量

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。

具体见基金管理人相关公告。

根据《流动性风险管理规定》

19 条增加。

基金份额的申购与赎回

回

六、申购和赎回的价格

3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算方式及处理方式详见《招募说明书》。本基金的赎回费率由基金管

3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算方式及处理方式详见《招募说明书》。本基金的赎回费率由基金管理人决定根据《流动性风险管理规定》

23 条修改。

116

格、费用及其用途 理人决定，并在招募说明书中列示。定，并在招募说明书中列示。其中对持续持有期少于 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。

新增：

7、当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人在履行适当程序后，可以采用摆动定价机制，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及监管部门、自律组织的规定。具体见基金管理人届时的相关公告。

根据《流动性风险管理规定》

第 25 条增加。

基金份额的申购与赎回

回

七、拒绝或暂停申购的情形

情形

新增：

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。

根据《流动性风险管理规定》

第 19 条修改、补充。

根据《流动性风险管理规定》

第 24 条补充。

基金份额的申购与赎回 发生上述第 1、2、3、5、7、8 项暂停申购 发生上述第 1、2、3、5、7、9、10 项暂停申购 根据上述增加情形调整序号。

117

回

七、拒绝或暂停申购的

情形

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。

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。

基金份额的申购与赎回

回

八、暂停赎回或延缓支

付赎回款项的情形

新增：

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。

根据《流动性风险管理规定》

第 24 条修改。

基金份额的申购与赎回

回

九、巨额赎回的情形及

处理方式

新增：

（4）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 30%（“大额赎回申请人”），基金根据《流动性风险管理规定》第 21 条（二）增加。

118

管理人可对大额赎回申请人的赎回申请延期处理，即按照保护其他赎回申请人（“小额赎回申请人”）利益的原则，基金管理人

优先确认小额赎回申请人的赎回申请，具体为：如小额赎回申请人的赎回申请在当日被全部确认，则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的 10%的前提下，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；如小额赎回申请人的赎回申请在当日未被全部确认，则对全部未确认的赎回申请（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。延期办理的具体程序，按照本条规定的延期赎回或取消赎回的方式办理。

具体见相关公告。

基金的投资 基金的投资组合比例为：本基金股票投资 基金的投资组合比例为：本基金股票投资占 根据《流动性风险管理规定》

119

二、投资范围 占基金资产的比例范围为 0-95%；基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除国债期货合约和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投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。

基金资产的比例范围为 0-95%；基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除国债期货合约和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投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

18 条修改。

基金的投资

四、投资限制

（2）本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货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上市公司发行的证券，不超过该证券的 10%；

（2）本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货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、存出保证金及应收申购款等；

（4）本基金管理人管理的全部基金持有一家上市公司发行的证券，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)根据《流动性风险管理规定》

18、15 条修改。

120

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%;

基金的投资

四、投资限制

新增:

(19) 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;

(20) 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;
根据《流动性风险管理规定》

16、17 条内容要求增加。

基金的投资

四、投资限制

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
除第(2)、(12)、(19)、(20)项以外,因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金
根据上文标号修改。

121

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。
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。

基金资产估值

三、估值方法

(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票,同一股票在交易所上市后,按交易所上市的同一股票的估值方法估值;非公开发行有明确锁定期的股票,按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

(3) 流通受限的股票,包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等(不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票),按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

新增:

9、当本基金发生大额申购或赎回情形时,基金管理人在履行适当程序后,可以采用摆动定价机制,以确保基金估值的公平性。

根据基金业协会《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》修改。

根据《流动性风险管理规定》第 25 条增加。

基金资产估值

六、暂停估值的情形

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

根据《流动性风险管理规定》

第 24 条增加。

122

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；

基金的信息披露

（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，基金管理人应当至少在季度报告、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。

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。

根据《流动性风险管理规定》

第 26、27 条增加。

基金的信息披露

（七）临时报告

新增：

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；

根据《流动性风险管理规定》

第 25、26 条增加。

123

28、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；