

## 东兴量化多策略灵活配置混合型证券投资基金托管协议 修改对照表

章节	原条款	新条款	修改理由
基金托管协议的依据、目的和原则	订立本协议的依据是《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《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》）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第7号〈托管协议的内容与格式〉》、《东兴量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》（以下简称《基金合同》）及其他有关规定。	订立本协议的依据是《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、 <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> ”）、《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》）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第7号〈托管协议的内容与格式〉》、《东兴量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》（以下简称《基金合同》）及其他有关规定。	增加《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》作为托管协议的依据
基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	（一）基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权 2、（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，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；	（一）基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权 2、（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，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， <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>  增加： <u>（5）本基金管理人管理且由本基金托管人托管的全部</u>	增加现金的定义   增加流通股投资比

章节	原条款	新条款	修改理由
	<p>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不符合上述规定的投资比例的，基金管理人应当在十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><u>开放式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%；</u></p> <p><u>(6) 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%；</u></p> <p>除上述第（2）、（6）、（11）项外，<u>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不符合上述规定的投资比例的，基金管理人应当在十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。</u></p>	<p>例限制、流动性受限资产投资限制、逆回购交易风险管理</p>
<p><b>基金资产净值计算和会计核算</b></p>	<p>（二）基金资产估值方法 2、估值方法</p>	<p>（（二）基金资产估值方法 2、估值方法 增加： <u>（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。</u></p>	<p>增加采用摆动定价机制估值的情况</p>