

《大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》修订前后对照表

章节	原《基金合同》条款	《基金合同》修订后条款	修订依据
一、前言 (一) 订立《大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》(以下简称“本基金合同”)的目的、依据和原则	2、订立本基金合同的依据 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 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》”)、 <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>《流动性风险管理规定》</u> ”)和其他有关法律、法规。	将《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“ <u>《流动性风险管理规定》</u> ”)纳入基金合同制订依据
二、释义	新增	<u>《流动性风险管理规定》</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	补充《流动性风险管理规定》释义
二、释义	新增	<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 <u>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</u>	《流动性风险管理规定》第四十条第(一)款
八、基金份额的申购与赎回与非交易过户 (五) 申购与赎回的数额限制	新增	2、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成 <u>潜在重大不利影响时,基金管理人应当采取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>	《流动性风险管理规定》第十九条
八、基金份额的申购与	新增	(8) 当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出	《流动性风险管理

<p>赎回与非交易过户 (七) 拒绝或暂停申购、 暂停赎回的情形及处理</p>		<p>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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购、赎回申请的措施。</p>	<p>规定》第二十二、 二十四条</p>
<p>十五、基金的投资 (八) 投资禁止行为与 限制</p>	<p>2、基金投资组合比例限制 本基金的投资组合将遵循以下限制： 基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。在符合相关法律法规规定的前提下，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、基金申购或赎回带来现金等非本基金管理人的因素致使基金的投资组合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。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。</p>	<p>2、基金投资组合比例限制 本基金的投资组合将遵循以下限制： <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款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资。</u> <u>(7) 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；</u> 基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。在符合相关法律法规规定的前提下，除上述第(6)、(7)项外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、基金申购或赎回带来现金等非本基金管理人的因素致使基金的投资组合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。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。</p>	<p>《流动性风险管理 规定》第十六、十七 条</p>
<p>十八、基金资产的估值</p>	<p>1、基金投资所涉及的证券或期货交易市</p>	<p>1、基金投资所涉及的证券或期货市场遇法定节</p>	<p>《流动性风险管理</p>

<p>(六) 暂停估值的情形</p>	<p>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。</p>	<p>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、<u>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；</u> 4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。</p>	<p>规定》二十四条</p>
<p>二十二、基金的信息披露 (九) 定期报告</p>	<p>新增</p>	<p><u>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，为保障其他投资者利益，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有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。</u> 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。</p>	<p>《流动性风险管理规定》第二十六、二十七条</p>
<p>二十二、基金的信息披露 (十) 临时报告与公告</p>	<p>新增</p>	<p><u>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其他重大事项；</u></p>	<p>《流动性风险管理规定》第二十六条</p>