

## 《大成产业升级股票型证券投资基金（LOF）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
<b>第一部分 前言</b> <b>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</b>	<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“《流动性风险管理规定》”）和其他有关法律法规。</p>	<p>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“《流动性规定》”）纳入基金合同制订依据</p>
<b>第二部分 释义</b>	<p>新增</p>	<p><u>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</u></p>	<p>补充《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》释义</p>
<b>第二部分 释义</b>	<p>新增</p>	<p><u>58、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</u></p>	<p>《流动性风险管理规定》第四十条“（一）”</p>
<b>第六部分 基金份额的申购与赎回和上市交易</b> <b>五、申购和赎回的数量限制</b>	<p>新增</p>	<p><u>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。具体请参见相关公告。</u></p>	<p>《流动性风险管理规定》第十九条</p>
<b>第六部分 基金份额的申购与赎回和上市交易</b> <b>七、拒绝或暂停申购的情形</b>	<p>新增</p>	<p><u>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。</u></p> <p><u>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</u></p>	<p>《流动性风险管理规定》第十九、二十二、二十四条</p>

		<p>值存在重大不确定性时，<u>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申请的措施。</u></p> <p><u>8、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、单个投资者单日或单笔申购金额上限的。</u></p> <p>.....</p> <p><u>发生上述第 1、2、3、5、7、9 项暂停申购情形时，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 6、8 项情形时，基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的申购申请进行限制，基金管理人有权拒绝该等全部或者部分申购申请。如果法律法规、监管要求调整导致上述第 6 项内容取消或变更的，基金管理人履行适当程序后，可修改上述内容，不需召开基金份额持有人大会。</u></p>	
<p><b>第六部分 基金份额的申购与赎回和上市交易</b> <b>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</b></p>	<p>新增</p>	<p><u>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确认后，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。</u></p>	<p>《流动性风险管理规定》第二十四条</p>
<p><b>第六部分 基金份额的申购与赎回和上市交易</b> <b>九、巨额赎回的情形及处理方式</b> <b>2、巨额赎回的处理方式</b> <b>(2) 部分延期赎回：</b></p>	<p>新增</p>	<p><u>若本基金发生巨额赎回且发生单个开放日内单个基金份额持有人申请赎回的基金份额占前一开放日基金总份额的比例超过 10%时，本基金管理人有权对该单个基金份额持有人超过前一开放日基金总份额 10%的赎回申请实施延期赎回；对该单个基金份额持有人占前一开放日基金总份额 10%的赎回申请，与当日其他赎回申请一起，按上述（1）或（2）方式处理。如下一开放日，该单一基金份额持有人剩余未赎回部分仍旧超出前一开放日基金总份额 10%的，继续按前述规则处理，直至该单一基金份额持有人单个开放日内申请赎回的基金份额占前一开放日基金总份额的比例低于 10%。</u></p>	<p>《流动性风险管理规定》第二十一、二十二条</p>

		<p><u>基金管理人在履行适当程序后，有权根据当时市场环境调整前述比例和办理措施，并在指定媒介上进行公告。</u></p>	
<p><b>第十二部分 基金的投资</b> <b>二、投资范围</b></p>	<p>基金的投资组合比例为：本基金的股票资产投资比例为基金资产的 80%—95%，投资于本基金合同界定的产业升级相关的股票资产不低于非现金基金资产的 80%。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%。</p>	<p>基金的投资组合比例为：本基金的股票资产投资比例为基金资产的 80%—95%，投资于本基金合同界定的产业升级相关的股票资产不低于非现金基金资产的 80%。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，应当保持现金（不包括结算备付金、存出保证金、<u>应收申购款等</u>）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%。</p>	<p>《流动性风险管理规定》第十八条</p>
<p><b>第十二部分 基金的投资</b> <b>四、投资限制</b> <b>1、组合限制</b></p>	<p>（2）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的 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。</p> <p>修改并新增</p>	<p>（2）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的 5%的现金（不包括结算备付金、存出保证金、<u>应收申购款等</u>）或到期日在一年以内的政府债券；</p> <p>……</p> <p><u>（5）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%；</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></p> <p>……</p> <p><u>（17）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></p> <p>……</p> <p>除上述第（2）、（6）、（14）、（17）项外，因</p>	<p>《流动性风险管理规定》第十五、十六、十七、十八、四十条</p>

		证券市场波动、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。	
第十四部分 基金资产估值 七、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， <u>经与基金托管人协商一致的；</u>	《流动性风险管理规定》第二十四条
第十八部分 基金的信息披露 五、公开披露的基金信息 (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	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， <u>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定风险，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， <u>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。</u>	《流动性风险管理规定》第二十六条、第二十七条
第十八部分 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其他重大事项； <u></u>	《流动性风险管理规定》第二十六条
	序号	<u>文中序号相应修改</u>	