

## 《大成海外中国机会混合型证券投资基金（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>	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》”）、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》（以下简称“《试行办法》”）、《关于实施〈合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法〉有关问题的通知》（以下简称“《通知》”）、《沪港股票市场交易互联互通机制试点若干规定》、《公开募集证券投资基金参与沪港通交易指引》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》”）、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》（以下简称“《试行办法》”）、《关于实施〈合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法〉有关问题的通知》（以下简称“《通知》”）、《沪港股票市场交易互联互通机制试点若干规定》、《公开募集证券投资基金参与沪港通交易指引》、 <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“《流动性风险管理规定》”）纳入基金合同制订依据
<b>第二部分 释义</b>	新增	16、 <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 <u>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</u> 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
<b>第二部分 释义</b>	新增	68、 <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	《流动性风险管理规定》第四十条第（一）款

		或交易的债券等	
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	新增	4、 <u>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。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。</u>	《流动性风险管理规定》第十九条
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。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。	..... 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》，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。 <u>本基金对持续持有期少于7日的投资者收取不低于1.5%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。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。</u>	《流动性风险管理规定》第二十三条
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	发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资者的申购申请：  .....	发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资者的申购申请：  ..... 9、 <u>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> 10、 <u>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> 11、 <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</u>	《流动性风险管理规定》第二十二、 二十四条

	<p>9、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述除第 6、8 项以外的情形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。</p>	<p>允价值存在重大不确定性时，<u>经与基金托管人协商确认后，基金管理人暂停基金估值并暂停接受基金申购申请的措施。</u></p> <p>12、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述除第 5、9、10 项以外的情形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。<u>发生上述第 9、10 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 10 项内容取消或变更的，基金管理人在履行适当程序后，可修改上述内容，不需召开基金份额持有人大会。</u>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>第六部分 基金份额的申购与赎回</b></p> <p><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>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，<u>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</b></p> <p><b>九、巨额赎回的情形及处理方式</b></p>	<p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>……</p> <p>(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，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，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回</p>	<p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>……</p> <p>(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，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，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回</p>	<p>《流动性风险管理规定》第二十一条</p>

	<p>回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。</p>	<p>申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。</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><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>第十三部分 基金的投资</b> <b>二、投资范围</b></p>	<p>……</p> <p>基金的投资组合比例为：股票等权益类资产市值不低于基金资产净值的 40%，其中，投资于海外中国机会概念的资产比例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</p>	<p>……</p> <p>基金的投资组合比例为：股票等权益类资产市值不低于基金资产净值的 40%，其中，投资于海外中国机会概念的资产比例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保证金以后，</p>	<p>《流动性风险管理规定》第十八条</p>

	<p>约需缴纳的保证金以后，现金或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%。</p>	<p>现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或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%。</p>	
<p><b>第十三部分 基金的投资</b></p> <p><b>四、投资限制</b></p>	<p>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>.....</p> <p><del>（4）本基金持有非流动性资产市值不得超过基金资产净值的10%。此项非流动性资产是指法律或基金合同规定的流通受限证券以及中国证监会认定的其他资产；</del></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>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>.....</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，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、应收申购款等）或者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10%；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><del>（7）本基金持有非流动性资产市值不得超过基金资产净值的10%；此项非流动性资产是指法律或基金合同规定的流通受限证券以及中国证监会认定的其他资产；</del></p> <p>.....</p> <p><u>（20）本基金与私募类证券资管产品及中国证监</u></p>	<p>《流动性风险管理规定》第十五、十六、十七、十八条</p>

		<p>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（2）、（6）、（17）项第5）条、（20）项外，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>第十五部分 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公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商一</p>	<p>《流动性风险管理规定》二十四条</p>

六、暂停估值的情形		<u>致</u> 的；	
<b>第十九部分 基金的信息披露</b> <b>五、公开披露的基金信息</b>	<p>(七) 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</p> <p>.....</p> <p>新增</p>	<p>(七) 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</p> <p>.....</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></p> <p><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。</u></p>	<p>《流动性风险管理规定》第二十六、二十七条</p>
<b>第十九部分 基金的信息披露</b> <b>五、公开披露的基金信息</b>	<p>(八) 临时报告</p> <p>新增</p>	<p>(八) 临时报告</p> <p><u>26、开放期内发生涉及基金申购、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>