

上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金基金合 同和托管协议的修改对照表

一、 基金合同主要修订内容、依据

章节	修订内容	修订依据
前言	<p>“一、订立本基金合同的目的、依据和原则”之第2项增加：</p> <p>“<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>《流动性规定》</u>”）”</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》纳入基金合同制订依据</p>
释义	<p>增加：</p> <p>“<u>57、《流动性规定》</u>：指中国证监会2017年8月31日颁布、同年10月1日起实施的<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”</p>	<p>根据《流动性风险管理规定》补充相关释义</p>
释义	<p>增加</p> <p>“<u>58、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）、<u>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>根据《流动性风险管理规定》补充相关释义</p>
基金份额的申购与赎回	<p>“五、申购和赎回的数量限制”中，增加：</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</u></p>	<p>《流动性风险管理规定》第十九条</p>

	<p><u>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。”</u></p>	
<p>基金份额的申购与赎回</p>	<p>“七、拒绝或暂停申购、赎回的情形”中，增加：</p> <p><u>“10、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、赎回申请或延缓支付赎回对价。”</u></p> <p>在发生暂停申购或赎回的情形之一时，本基金的申购和赎回可能同时暂停。</p> <p>发生上述 1、2、3、4、5、8、9、10、11 项情形之一且基金管理人决定暂停申购或赎回时，基金管理人应根据有关规定在指定媒介刊登暂停申购或赎回公告。</p>	<p>《流动性风险管理规定》第二十四条</p> <p>根据上述修改调整序号</p>
<p>基金合同当事人及权利义务</p>	<p>“二、基金托管人”之“（一）基金托管人简况”“法定代表人”及“注册资本”修订为：</p> <p>“法定代表人：<u>陈四清</u></p> <p>注册资本：<u>人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整”</u></p>	<p>根据托管人最新披露信息修改</p>

<p>基金的投资</p>	<p>“四、投资限制” 之“1、组合限制” 之“基金的投资组合应遵循以下限制： ” 中，增加：</p> <p><u>“（11）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本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；</u></p> <p><u>（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本基金合同约定的投资范围保持一致；”</u></p> <p>除第（8）、（11）、（12）项情形外，因证券、期货市场波动、标的指数成份债券调整、标的指数成份债券流动性限制、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。</p>	<p>《流动性风险管理规定》第十六条、第十七条、第四十条</p> <p>根据上述修改调整序号</p>
<p>基金资产估值</p>	<p>“六、暂停估值的情形” 中，增加：</p> <p><u>“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确</u></p>	<p>《流动性风险管理规定》第二十四条</p>

	<p>认后，基金管理人应当暂停基金估值；</p>	
基金的信息披露	<p>“一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他有关规定。”中，增加： <u>“《流动性规定》”</u></p> <p>“五、公开披露的基金信息”之“（八）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”中，增加： <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><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，为保障其他投资者权益，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>将《流动性风险管理规定》纳入信息披露的依据。</p> <p>《流动性风险管理规定》第二十六条、第二十七条</p>
基金的信息披露	<p>“五、公开披露的基金信息”之“（九）临时报告”中，增加： <u>“30、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；”</u></p>	<p>《流动性风险管理规定》第二十六条</p>

二、对基金托管协议主要修订内容、依据

章节	修订内容	修订依据
托管协议当事人	<p>“（二）基金托管人（或简称“托管人”）” “法定代表人”和“注册资本”修订为：</p> <p>法定代表人：<u>陈四清</u></p> <p>注册资本：<u>人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整</u></p>	<p>根据托管人最新披露信息修改</p>
托管协议的依据、目的、原则和解释	<p>“（一）依据”中，增加：</p> <p>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</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》纳入托管协议制订依据</p>
基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	<p>“（一）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面：”之</p> <p>“2、对基金投融资比例进行监督；”中，增加：</p> <p>“<u>（11）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本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；</u></p> <p><u>（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本基金合同约定的投资范围保持一致；</u> 本基金管理人承诺本基金</p>	<p>《流动性风险管理规定》第十六条、第十七条、第四十条</p>

	<p><u>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与本基金合同约定的投资范围保持一致，并承担由于不一致所导致的风险或损失；”</u></p> <p>除上述第<u>（8）、（11）、（12）</u>项情形另有约定外，因证券、期货市场波动、标的指数成份券调整、标的指数成份债券流动性限制、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。</p>	<p>根据上述修改调整 序号</p>
--	--	------------------------