关于东海基金管理有限责任公司旗下基金 修改基金合同和托管协议的公告

根据中国证监会 2017 年 10 月 1 日起施行的《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"《规定》"),对已经存续的开放式基金,原基金合同内容不符合该《规定》的,应当在《规定》施行之日起 6 个月内进行修改。

东海基金管理有限责任公司(以下简称"本公司")经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致,对旗下东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金、东海中证社会发展安全产业主题指数型证券投资基金、东海祥瑞债券型证券投资基金、东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金的基金合同相关条款进行了修改,基金托管协议相应部分也一并进行修改,具体修改内容见附件。修改后的基金合同和托管协议均已报监管机构备案。本公司将在上述基金的招募说明书(更新)中,对相应部分进行修改。

上述基金基金合同修订的内容系因相应的法律法规发生变动而应当进行的必要修改,对原有基金份额持有人的利益无实质不利影响。上述基金合同和托管协议的修订已经履行了规定的程序,符合相关法律法规及基金合同的规定。修改后的基金合同和托管协议将于 2018 年 3 月 31 日起生效。

投资者可以登录本基金管理人网站(www.donghaifunds.com)查询或者拨打本基金管理人的客户服务电话(40095 95531)垂询相关事宜。

风险提示:本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。敬请投资者留意投资风险,投资前认真阅读本基金的基金合同和招募说明书。

特此公告。

- 附件 1: 《东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金基金合同》修改前后 文对照表
- 附件 2: 《东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金托管协议》修改前后 文对照表

附件 3: 《东海中证社会发展安全产业主题指数型证券投资基金基金合同》 修改前后文对照表

附件 4: 《东海中证社会发展安全产业主题指数型证券投资基金托管协议》 修改前后文对照表

附件 5: 《东海祥瑞债券型证券投资基金基金合同》修改前后文对照表

附件 6: 《东海祥瑞债券型证券投资基金托管协议》修改前后文对照表

附件 7: 《东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同》修改前后 文对照表

附件 8: 《东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金托管协议》修改前后 文对照表

> 东海基金管理有限责任公司 二〇一八年三月二十三日

附件 1:《东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金基金合同》修改前后文对照表

节	原《基金合同》条款	修改后的《基金合同》条款
第一部分 前言	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共
一、订立本基金合同的目	同法》(以下简称"《合同法》")、《中华人民共和	和国合同法》(以下简称"《合同法》")、
的、依据和原则	国证券投资基金法》(以下简称"《基金法》")、	《中华人民共和国证券投资基金法》(以下
	《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简	简称"《基金法》")、《公开募集证券投资基
	称"《运作办法》")、《证券投资基金销售管理办	金运作管理办法》(以下简称"《运作办
	法》(以下简称"《销售办法》")、《证券投资基金	法》")、《证券投资基金销售管理办法》(以
	信息披露管理办法》(以下简称"《信息披露办	下简称"《销售办法》")、《证券投资基金信
	法》")和其他有关法律法规。	息披露管理办法》(以下简称"《信息披露办
		法》")、《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》")和其他有关法律法规。
第二部分 释义		新增:
		13、《流动性规定》: 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
第二部分 释义		新增:
		51、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
第六部分 基金份额的申购		新增:
与赎回		4、当接受申购申请对存量基金份额持有人
五、申购和赎回的数量限制		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。
	15、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承	
与赎回	担,在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎	
)	回费用应根据相关规定按照比例归入基金财产,	
	未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必	
用及其用途		支付登记费和其他必要的手续费。其中,对
		持续持有期少于7日的基金份额持有人收取
		不低于 1.5%的赎回费并全额计入基金财

	T	产。
第六部分 基金份额的申购		/_。 新增 :
与赎回		6、当前一估值日基金资产净值 50%以上的
 七、拒绝或暂停申购的情形		资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估
10、12/20以首片中州印用//		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
		人应当暂停接受基金申购申请。
		7、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
		超过 50%,或者变相规避 50%集中度的情
	发生上述第 1、2、3、5、6 项暂停申购情形之一	形。法律法规或中国证监会另有规定的除
	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。	
		发生上述第 1、2、3、5、6 <u>、8</u> 项暂停申购
	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。	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。
第六部分 基金份额的申购		新增:
与赎回		6、当前一估值日基金资产净值 50%以上的
八、暂停赎回或延缓支付赎		资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估
回款项的情形		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
		人应当暂停接受基金赎回申请或延缓支付赎
		回款项。
第六部分 基金份额的申购	2、巨额赎回的处理方式	2、巨额赎回的处理方式
与赎回		新增:
九、巨额赎回的情形及处理		若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有
方式		人的赎回申请超过上一日基金总份额 20%,
		则基金管理人可以对该基金份额持有人当日
		赎回申请超过上一日基金总份额 20%以上的
		部分自动进行延期办理;对于该基金份额持
		有人当日赎回申请未超过上述比例的部分,
		根据前述"(1)全额赎回"或"(2)部分延
		期赎回"的约定方式与其他基金份额持有人
		的赎回申请一并办理。对于未能赎回部分,
		如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择
		取消赎回,则该部分赎回申请将被撤销。
		在不违反法律法规的前提下,基金管理人在
		履行适当程序后,有权根据当时市场环境调
L	ı	

		整前述比例及处理规则,并在指定媒介上进
		行公告。
第十二部分 基金的投资	基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产净	
二、投资范围	值的比例为 0%—95%; 权证资产占基金资产净值	金资产净值的比例为 0%—95%; 权证资产
	的比例为 0%—3%;任何交易日日终,持有的买	
	入股指期货合约价值不得超过基金资产净值的	
	10%,持有的卖出期货合约价值不得超过基金持	
	有的股票总市值的 20%; 任何交易日日终, 持有	,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,
	的买入期货合约价值与有价证券市值之和,不得	
	超过基金资产净值的 95%; 任何交易日日终在扣	
	除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或	
	到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净	
	值的5%。	金或到期日在一年以内的政府债券不低于基
	HH 1 2 700	金资产净值的 5%, 其中现金不包括结算备
		付金、存出保证金和应收申购款等。
第十二部分 基金的投资	1、组合限制	1、组合限制
四、投资限制	(2)每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳	
口、汉英怀啊	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:	产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的
	间光亚岛有四州百世 干奶门间欧洲 灰沙,	政府债券,其中现金不包括结算备付金、存
		出保证金和应收申购款等;
第十二部分 基金的投资		新增:
四、投资限制		(22) 本基金管理人管理的全部开放式基金
四、1次次体型		(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%;
		(23) 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
		符合该比例限制的,基金管理人不得主动新
		增流动性受限资产的投资;
		(24) 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。可接受原理只的资质要求应求上
		购交易的,可接受质押品的资质要求应当与
		基金合同约定的投资范围保持一致;
	因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规	
	模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人	陈工处弗(2)、(12)、(23)、(24)坝外, 因证
	以入为,从以为且从于1人口内内与在亚百年八	一

		株本二 III 47 / III 47 / II 47 /
	之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资出版。 其人符册人 京火东 10人东西日本进行	
	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	
		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。
第十四部分 基金资产估值		新增:
六、暂停估值的情形		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认后,基金管理
		人应当暂停估值;
第十八部分 基金的信息披	一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作	一、本基金的信息披露应符合《基金法》、
露	办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他有	《运作办法》、《信息披露办法》、 <u>《流动性</u>
	关规定。	规定》、《基金合同》及其他有关规定。
第十八部分 基金的信息披	(六)基金定期报告,包括基金年度报告、基金	(六)基金定期报告,包括基金年度报告、
露	半年度报告和基金季度报告	基金半年度报告和基金季度报告
		新增:
五、公开披露的基金信息		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
		他投资者的权益,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。
		基金管理人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。
第十八部分 基金的信息披		(七) 临时报告
露		新增:
		26、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜
五、公开披露的基金信息		在影响投资者赎回等重大事项时;
摘要	,	
,,,,,		

章节

原《托管协议》条款

修改后的《托管协议》条款

二、基金托管协议的依据、 目的和原则

基金法》(以下简称《基金法》)、《公开募集证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、《公开 投资基金运作管理办法》(以下简称《运作办募集证券投资基金运作管理办法》(以下简 法》)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称称《运作办法》)、《证券投资基金销售管理 《销售办法》)、《证券投资基金信息披露管理办办法》(以下简称《销售办法》)、《证券投资 法》(以下简称《信息披露办法》)、《证券投资基基金信息披露管理办法》(以下简称《信息 金信息披露内容与格式准则第 7 号〈托管协议的披露办法》)、《公开募集开放式证券投资基 内容与格式〉》、《东海美丽中国灵活配置混合型证金流动性风险管理规定》、《证券投资基金 券投资基金基金合同》(以下简称《基金合同》) |信息披露内容与格式准则第 7 号〈托管协议 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订立本协议的依据是《中华人民共和国证券 的内容与格式〉》、《东海美丽中国灵活配置 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。

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

合同》的约定对下述基金投融资比例进行监督:

(1) 按法律法规的规定及《基金合同》的约定, 本基金的投资资产配置比例为:

|股票资产占基金资产净值的比例为 0%—95%; 权 证资产占基金资产净值的比例为 0%-3%; 任何交 易日日终,持有的买入股指期货合约价值不得超 过基金资产净值的 10%,持有的卖出期货合约价 Ю%-3%;任何交易日日终,持有的买入股指 值不得超过基金持有的股票总市值的 20%:任何 交易日日终,持有的买入期货合约价值与有价证 10%,持有的卖出期货合约价值不得超过基 券市值之和, 不得超过基金资产净值的 95%;任何 |金持有的股票总市值的 20%;任何交易日日 交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保 |终,持有的买入期货合约价值与有价证券市 |证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券不 ||值之和, 不得超过基金资产净值的 95%;任 低于基金资产净值的5%。

三、基金托管人对基金管理2、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金2、基金托管人根据有关法律法规的规定及 《基金合同》的约定对下述基金投融资比例 进行监督:

> (1) 按法律法规的规定及《基金合同》的 约定,本基金的投资资产配置比例为: 股票资产占基金资产净值的比例为 0%— 95%; 权证资产占基金资产净值的比例为 期货合约价值不得超过基金资产净值的 何交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的 交易保证金后,现金或到期日在一年以内的 政府债券不低于基金资产净值的 5%, 其中 现金不包括结算备付金、存出保证金和应收 申购款等。

人的业务监督和核查

三、基金托管人对基金管理(2)根据法律法规的规定及《基金合同》的约(2)根据法律法规的规定及《基金合同》 定, 本基金投资组合遵循以下投资限制:

(一)基金托管人对基金管B、每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳制: 理人的投资行为行使监督权的交易保证金后,保持不低于基金资产净值 5%B、每个交易日日终在扣除股指期货合约需 的现金或者到期日在一年以内的政府债券;

的约定,本基金投资组合遵循以下投资限

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,其中现金不包括结算备付金、存出 保证金和应收申购款等; 三、基金托管人对基金管理O、本基金投资流通受限证券,其公允价值不得O、本基金投资流通受限证券,其公允价值 人的业务监督和核查 超过本基金资产净值的 20%; 本基金持有的同一不得超过本基金资产净值的2015%; 本基金 (一) 基金托管人对基金管流通受限证券, 其公允价值不得超过本基金资产持有的同一流通受限证券, 其公允价值不得 理人的投资行为行使监督权|净值的 10%;经基金管理人和基金托管人协商,|超过本基金资产净值的 10%;经基金管理人 可对以上比例进行调整。基金管理人应制定严格和基金托管人协商,可对以上比例进行调 的投资决策流程和风险控制制度,防范流动性风整。基金管理人应制定严格的投资决策流程 险、法律风险和操作风险等各种风险; 和风险控制制度,防范流动性风险、法律风 险和操作风险等各种风险; 三、基金托管人对基金管理 新增: 人的业务监督和核查 V、本基金管理人管理的且由本协议项下托 (一)基金托管人对基金管 管人托管的全部开放式基金(包括开放式基 理人的投资行为行使监督权 金以及处于开放期的定期开放基金)持有-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 管理的且由本协议项下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%: W、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 合该比例限制的,基金管理人不得主动新增 流动性受限资产的投资: X、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基 金合同约定的投资范围保持一致。 三、基金托管人对基金管理(3)法规允许的基金投资比例调整期限 (3) 法规允许的基金投资比例调整期限 人的业务监督和核查 |由于证券、期货市场波动、上市公司合并、基金|除上述第(2)项中第B、L、W、X目外, 规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理由于证券、期货市场波动、上市公司合并、 人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的基金规模变动、股权分置改革中支付对价等 比例,不在限制之内,但基金管理人应在 10 个交基金管理人之外的原因导致的投资组合不符 易日内进行调整,以达到规定的投资比例限制要合上述约定的比例,不在限制之内,但基金 求,但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法管理人应在 10 个交易日内进行调整,以达 规另有规定的从其规定。 到规定的投资比例限制要求,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。

附件 3:《东海中证社会发展安全产业主题指数型证券投资基金基金合同》修改前后文对照 表

第一部分 前言 2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合2、订立本基金合同的依据是《中一、订立本基金合同的目 同法》(以下简称"《合同法》")、《中华人民共和和国合同法》(以下简称"《合同国证券投资基金法》(以下简称"《基金法》")、《中华人民共和国证券投资基金治《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简简称"《基金法》")、《公开募集证券投资基金销售管理办金运作管理办法》(以下简称"《销售办法》")、《证券投资基金销售管理方台。技》。(以下简称"《销售办法》")、《证券投资基金销售管理方台。技工工厂、发展的工厂、发展、工厂、发展、工厂、发展、工厂、发展、工厂、发展、工厂、发展、工厂、发展、工厂、发展、工厂、发展、工厂、发展、工厂、发展、工厂、发展、工厂、发展、工厂、工厂、工厂、发展、工厂、工厂、工厂、工厂、工厂、工厂、工厂、工厂、工厂、工厂、工厂、工厂、工厂、	法》")、下 去》(以资基 《法》(会 技基基 大法基 基基 资基。 资基。 资基。 资基。 资基。 资基。 资基。
的、依据和原则 国证券投资基金法》(以下简称"《基金法》")、《中华人民共和国证券投资基金经《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称"《基金法》")、《公开募集证称"《运作办法》")、《证券投资基金销售管理办金运作管理办法》(以下简称"《销售办法》")、《证券投资基金销售管理方信息披露管理办法》(以下简称"《信息披露办下简称"《销售办法》")、《证券投资基金销售管理方法》")、《证券投资基金销售管理方法》")、《公开募集开放式证券投资,为性风险管理规定》(以下简称"《定》")和其他有关法律法规。 第二部分释义 第二部分释义 第二部分释义 第二部分释义 第二部分释义	去》(以下 券投资基 《运作办 办法》(总 多基 基 资基金 资基金流
《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称"《基金法》")、《公开募集证称"《运作办法》")、《证券投资基金销售管理办金运作管理办法》(以下简称"法》(以下简称"《销售办法》")、《证券投资基金销售管理方法》")、《证券投资基金销售管理方法》")、《证券投资基金销售管理方法》"),《证券投资基金销售管理方法》")、《证券投资基金销售管理方法》"),《公开募集开放式证券投资,为相其他有关法律法规。总按属管理办法》(以下简称"《信法》")、《公开募集开放式证券投资,为性风险管理规定》(以下简称"《定》")和其他有关法律法规。第":13、《流动性规定》:指中国证监会8月31日颁布、同年10月1日实开募集开放式证券投资基金流动性规定》及颁布机关对其不时做出的第二部分释义	券投资基 《运作办 办法》(以 资基金信 息披露办 资基金流
称"《运作办法》")、《证券投资基金销售管理办金运作管理办法》(以下简称"法》(以下简称"《销售办法》")、《证券投资基金销售管理通信息披露管理办法》(以下简称"《信息披露中理办法》(以下简称"《信息披露管理办法》(以下简称"《信法》")、《公开募集开放式证券投资性风险管理规定》(以下简称"《定》")和其他有关法律法规。第二部分释义 第二部分释义 第二部分释义 第二部分释义 第二部分释义 第二部分释义 第二部分释义 第二部分释义	《运作办 办法》(以 资基金信 息披露办 资基金流
法》(以下简称"《销售办法》")、《证券投资基金法》")、《证券投资基金销售管理系信息披露管理办法》(以下简称"《销售办法》")、《证券投资法》")和其他有关法律法规。 第二部分 释义	办法》(以 资基金信 息披露办 资基金流
信息披露管理办法》(以下简称"《信息披露办下简称"《销售办法》")、《证券投法》")和其他有关法律法规。 第二部分释义 第二部分释义 第二部分释义 第二部分释义 第二部分释义 第二部分释义 第二部分释义 第二部分释义 第一次	资基金信 息披露办 资基金流
法》")和其他有关法律法规。 息披露管理办法》(以下简称"《信法》")、《公开募集开放式证券投动性风险管理规定》(以下简称"《定》")和其他有关法律法规。 第二部分释义 新增: 13、《流动性规定》:指中国证监会8月31日颁布、同年10月1日实开募集开放式证券投资基金流动性规定》及颁布机关对其不时做出的规定》及颁布机关对其不时做出的新增: 52、流动性受限资产:指由于法律管、合同或操作障碍等原因无法以	息披露办 资基金流
法》")、《公开募集开放式证券投 动性风险管理规定》(以下简称"《 定》")和其他有关法律法规。 新增: 13、《流动性规定》:指中国证监会 8月31日颁布、同年10月1日实 开募集开放式证券投资基金流动性 规定》及颁布机关对其不时做出的 第二部分释义 新增: 52、流动性受限资产:指由于法律 管、合同或操作障碍等原因无法以	资基金流
动性风险管理规定》(以下简称"《 定》")和其他有关法律法规。 新增: 13、《流动性规定》:指中国证监会 8月31日颁布、同年10月1日实 开募集开放式证券投资基金流动性 规定》及颁布机关对其不时做出的 第二部分释义 新增: 52、流动性受限资产:指由于法律 管、合同或操作障碍等原因无法以	
定》")和其他有关法律法规。 第二部分 释义 新增: 13、《流动性规定》:指中国证监会 8月31日颁布、同年10月1日实 开募集开放式证券投资基金流动性 规定》及颁布机关对其不时做出的 第二部分 释义 新增: 52、流动性受限资产:指由于法律 管、合同或操作障碍等原因无法以	海劫性扣
第二部分 释义 新增: 13、《流动性规定》: 指中国证监会 8月31日颁布、同年10月1日实 开募集开放式证券投资基金流动性 规定》及颁布机关对其不时做出的 第二部分 释义 新增: 52、流动性受限资产: 指由于法律 管、合同或操作障碍等原因无法以	1111471 1777
13、《流动性规定》: 指中国证监会 8月31日颁布、同年10月1日实 开募集开放式证券投资基金流动性 规定》及颁布机关对其不时做出的 第二部分释义 新增: 52、流动性受限资产: 指由于法律 管、合同或操作障碍等原因无法以	
8月31日颁布、同年10月1日实 开募集开放式证券投资基金流动性 规定》及颁布机关对其不时做出的 第二部分 释义 新增: 52、流动性受限资产:指由于法律 管、合同或操作障碍等原因无法以	
开募集开放式证券投资基金流动性规定》及颁布机关对其不时做出的第二部分 释义 新增: 52、流动性受限资产: 指由于法律管、合同或操作障碍等原因无法以	: 2017 年
规定》及颁布机关对其不时做出的 第二部分 释义 新增: 52、流动性受限资产:指由于法律 管、合同或操作障碍等原因无法以	施的《公
第二部分 释义 新增: 52、流动性受限资产: 指由于法律 管、合同或操作障碍等原因无法以	风险管理
52、流动性受限资产:指由于法律 管、合同或操作障碍等原因无法以	<u>修订</u>
管、合同或操作障碍等原因无法以	
	法规、监
予以变现的资产,包括但不限于	合理价格
	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	
第六部分 基金份额的申购 新增:	
与赎回 4、当接受申购申请对存量基金份	额持有人
五、申购和赎回的数量限制 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	<u> 关公告。</u>
第六部分 基金份额的申购5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承5、赎回费用由赎回基金份额的基	金份额持
与赎回 担,在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎有人承担,在基金份额持有人赎回	
回费用应根据相关规定按照比例归入基金财产,时收取。赎回费用应根据相关规定	基金份额
六、申购和赎回的价格、费其余用于支付登记费和其他必要的手续费。	
用及其用途 必要的手续费。 <u>其中,对持续持有</u>	按照比例
日的基金份额持有人收取不低于	按照比例 费和其他

		回费并全额计入基金财产。
第六部分 基金份额的申购		新增:
与赎回		8、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
七、拒绝或暂停申购的情形		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
		人应当暂停接受基金申购申请。
		9、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
		超过 50%,或者变相规避 50%集中度的情
		形。法律法规或中国证监会另有规定的除
		外。
第六部分 基金份额的申购	发生上述第 1、2、3、5、6、7、8 项暂停申购情	发生上述第 1、2、3、5、6、7、8、10项暂
与赎回		停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购
	人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购	时,基金管理人应当根据有关规定在指定媒
七、拒绝或暂停申购的情形	公告。如果投资人的申购申请被拒绝,被拒绝的	介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购
	 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。	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。
第六部分 基金份额的申购		新增:
与赎回		6、当前一估值日基金资产净值 50%以上的
八、暂停赎回或延缓支付赎		资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估
回款项的情形		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
		人应当暂停接受基金赎回申请或延缓支付赎
		回款项。
第六部分 基金份额的申购	2、巨额赎回的处理方式	2、巨额赎回的处理方式
与赎回		新增:
九、巨额赎回的情形及处理		若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有
方式		人的赎回申请超过上一日基金总份额 20%,
		则基金管理人可以对该基金份额持有人当日
		赎回申请超过上一日基金总份额 20%以上的
		部分自动进行延期办理;对于该基金份额持
		有人当日赎回申请未超过上述比例的部分,
		根据前述"(1)全额赎回"或"(2)部分延
		期赎回"的约定方式与其他基金份额持有人
		的赎回申请一并办理。对于未能赎回部分,
		如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择
		取消赎回,则该部分赎回申请将被撤销。
		在不违反法律法规的前提下,基金管理人在
		履行适当程序后,有权根据当时市场环境调
		整前述比例及处理规则,并在指定媒介上进

		行公告。
二二二二二二二二二二二二二二二二二二二二二二二二二二二二二二二二二二二二二	 本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的	
二、投资范围	90%。本基金投资于标的指数成份股票及其备选	
	成份股票的资产比例不低于非现金基金资产的	
	80%;任何交易日日终在扣除股指期货合约需缴	
	纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的	
	政府债券不低于基金资产净值的 5%。	到期日在一年以内的政府债券不低于基金资
	吸的 顺分小队 J 至並 贝) 伊 国的 370。	产净值的 5%, 其中现金不包括结算备付
		金、存出保证金和应收申购款等。
数 1 一	4 사기 A I/I-I A-II	
第十二部分 基金的投资	1.组合限制	1.组合限制
四、投资限制	(16) 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,应当保持不低于基金	
	资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债	
	券;	年以内的政府债券,其中现金不包括结算备
		付金、存出保证金和应收申购款等;
第十二部分 基金的投资		新增:
四、投资限制		(19) 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
		符合该比例限制的,基金管理人不得主动新
		增流动性受限资产的投资;
		(20) 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
		基金合同约定的投资范围保持一致;
第十二部分 基金的投资		除上述第(10)、(16)、(19)、(20)项外, 因证
四、投资限制	 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	变动等基金管理人之外的因素致使基金投资
	 可上市交易日起 10 个交易日内进行调整。法律法	比例不符合上述规定投资比例的,基金管理
	规另有规定的从其规定。	人应当在可上市交易日起 10 个交易日内进
	77674 117767CH477777767Cs	行调整。法律法规另有规定的从其规定。
第十四部分 基金资产估值		新增:
六、暂停估值的情形		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认后,基金管理
<u> </u>	. *甘入的伫自钟垂它然入《甘入注》 《二·//	人应当暂停估值;
	一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作	
露	办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他有	
Andre 1 of June 21 - Like A 22 23 - 11 22	关规定。	规定》、《基金合同》及其他有关规定。
第十八部分 基金的信息披	(六)基金定期报告,包括基金年度报告、基金	(六)基金定期报告,包括基金年度报告、

露	半年度报告和基金季度报告	基金半年度报告和基金季度报告
路 I	十十及1以口州至亚字及1以口	
		新增:
五、公开披露的基金信息		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
		他投资者的权益,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。_
		基金管理人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
		<u>分析等。</u>
第十八部分 基金的信息披	(七) 临时报告	(七) 临时报告
露		新增:
		29、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜
五、公开披露的基金信息		在影响投资者赎回等重大事项时;_
第二十四部分 基金合同内	同步修改	
容摘要		

附件 4:《东海中证社会发展安全产业主题指数型证券投资基金托管协议》修改前后文对照 表

章节	原《托管协议》条款	修改后的《托管协议》条款
二、基金托管协议的依据、	订立本协议的依据是《中华人民共和国证券投资	订立本协议的依据是《中华人民共和国证券
目的和原则	基金法》(以下简称《基金法》)、《证券投资基金	投资基金法》(以下简称《基金法》)、《证券
	运作管理办法》(以下简称《运作办法》)、《证券	投资基金运作管理办法》(以下简称《运作
	投资基金销售管理办法》(以下简称《销售办	办法》)、《证券投资基金销售管理办法》(以
	法》)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下	下简称《销售办法》)、《证券投资基金信息
	简称《信息披露办法》)、《证券投资基金信息披露	披露管理办法》(以下简称《信息披露办
	内容与格式准则第 7 号〈托管协议的内容与格	法》)、《公开募集开放式证券投资基金流动
	式〉》、《东海中证社会发展安全产业主题指数型证	性风险管理规定》、《证券投资基金信息披
	券投资基金基金合同》(以下简称《基金合同》)	露内容与格式准则第7号〈托管协议的内容
	及其他有关规定。	与格式〉》、《东海中证社会发展安全产业主
		题指数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。
三、基金托管人对基金管理	2、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金	2、基金托管人根据有关法律法规的规定及
人的业务监督和核查	合同》的约定对下述基金投融资比例进行监督:	《基金合同》的约定对下述基金投融资比例
(一) 基金托管人对基金管	(1) 按法律法规的规定及《基金合同》的约定,	进行监督:
理人的投资行为行使监督权	本基金的投资资产配置比例为: 本基金 股票投资	(1) 按法律法规的规定及《基金合同》的
	占基金资产的比例为 0% 90%, 权证投资占基金	约定,本基金的投资资产配置比例为:本基
	资产净值的比例为 0%-3%, 每个交易日日终在扣	金投资于股票的资产比例不低于基金资产的
	除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或	90%。本基金投资于标的指数成份股票及其
	者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不	备选成份股票的资产比例不低于非现金基金
	低于基金资产净值的 5%。	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,现金或者到
		期日在一年以内的政府债券投资比例合计不
		低于基金资产净值的 5%, 其中现金不包括
		结算备付金、存出保证金和应收申购款等。
三、基金托管人对基金管理	(2) 根据法律法规的规定及《基金合同》的约	(2) 根据法律法规的规定及《基金合同》
人的业务监督和核查		的约定,本基金投资组合遵循以下投资限
(一)基金托管人对基金管	购纳的万具程证券上 应当程序人作士其今次至	制:
理人的投资行为行使监督权	净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券;	p. 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,应当保持不低于
		基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以
		内的政府债券,其中现金不包括结算备付
		金、存出保证金和应收申购款等;
三、基金托管人对基金管理		新增:
人的业务监督和核查		s.本基金主动投资于流动性受限资产的市值
(一) 基金托管人对基金管		合计不得超过基金资产净值的 15%; 因证券
理人的投资行为行使监督权		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

		该比例限制的,基金管理人不得主动新增流
		动性受限资产的投资;
		t.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基金
		合同约定的投资范围保持一致。
三、基金托管人对基金管理	(3) 法规允许的基金投资比例调整期限	(3) 法规允许的基金投资比例调整期限
人的业务监督和核查	由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变	除上述第(2)项中第j、p、s、t目外,由于
(一) 基金托管人对基金管	动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符	证券市场波动、上市公司合并或基金规模变
理人的投资行为行使监督权	合上述约定的比例,不在限制之内,但基金管理	动等基金管理人之外的原因导致的投资组合
	人应在 10 个交易日内进行调整,以达到规定的投	不符合上述约定的比例,不在限制之内,但
	资比例限制要求。法律法规另有规定的从其规	基金管理人应在 10 个交易日内进行调整,
	定。	以达到规定的投资比例限制要求。法律法规
		另有规定的从其规定。

章节	原《基金合同》条款	修改后的《基金合同》条款
第一部分 前言	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共
一、订立本基金合同的目	同法》(以下简称"《合同法》")、《中华人民共和	和国合同法》(以下简称"《合同法》")、
的、依据和原则	国证券投资基金法》(以下简称"《基金法》")、	《中华人民共和国证券投资基金法》(以下
	《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简	简称"《基金法》")、《公开募集证券投资基
	称"《运作办法》")、《证券投资基金销售管理办	金运作管理办法》(以下简称"《运作办
	法》(以下简称"《销售办法》")、《证券投资基金	法》")、《证券投资基金销售管理办法》(以
	信息披露管理办法》(以下简称"《信息披露办	下简称"《销售办法》")、《证券投资基金信
	法》")和其他有关法律法规。	息披露管理办法》(以下简称"《信息披露办
		法》")、《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》")和其他有关法律法规。
第二部分 释义		新增:
		13、《流动性规定》: 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
第二部分 释义	48、C类基金份额: 在投资者认购、申购基金份	49、C类基金份额:在投资者认购、申购基
	额时不收取认购 、申购费用, 在赎回时亦不收取	金份额时不收取认购、申购费用, 在赎回时
	赎回费,而从本类别基金资产中计提销售服务费	收取赎回费,并从本类别基金资产中计提销
	的基金份额	售服务费的基金份额
第二部分 释义		新增:
		56、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
	本基金根据认购费、申购费、赎回费、销售服务	
八、基金份额类别的设置	费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类	
	别。在投资者认购、申购时收取认购、申购费	
	用,在投资者赎回时根据持有期限收取赎回费	
	用,而不计提销售服务费的基金份额,称为A类	
	基金份额;在投资者认购、申购基金份额时不收	
	取认购、申购费用,在赎回时亦不收取赎回费,	
	而从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份	
	额 ,称为 C类基金份额。 	资产中计提销售服务费的基金份额, 称为 C
		类基金份额。

公子 如八 甘人小菊的中叶		次广. 4.64
第六部分 基金份额的申购		新增:
与赎回		4、当接受申购申请对存量基金份额持有人
五、申购和赎回的数量限制 		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。
第六部分 基金份额的申购	3、赎回金额的计算及处理方式:本基金赎回金额	3、赎回金额的计算及处理方式:本基金赎
与赎回	的计算方式和余额的处理方式详见《招募说明	回金额的计算方式和余额的处理方式详见
	书》, 赎回金额单位为元。本基金的 A 类基金份	·《招募说明书》, 赎回金额单位为元。本基
六、申购和赎回的价格、费	额赎回费率由基金管理人决定,并在招募说明书	金的A类基金份额和C类基金份额的赎回费
用及其用途	中列示。	率由基金管理人决定,并在招募说明书中列
		示。
	↓ □5、A类基金份额赎回费用由赎回基金份额的基金	·
与赎回	份额持有人承担,在基金份额持有人赎回基金份	
	额时收取。赎回费用应根据相关规定按照比例归	
 六、申购和赎回的价格、费	入基金财产,其余用于支付登记费和其他必要的	
用及其用途	手续费。 C类基金份额不收取赎回费用。	基金财产,其余用于支付登记费和其他必要
/1/2//1/2	丁续页。 C大型並仿颐个校址然回页//1。	
		的手续费。其中,对持续持有期少于7日的
		基金份额持有人收取不低于 1.5%的赎回费
	 6、本基金A类基金份额的申购费率、A 类基金份	并全额计入基金财产。
	额和C类基金份额的申购份额具体的计算方法、A	
	类基金份额的赎回费率、 A类基金份额和C类基金	
	份额的赎回金额具体的计算方法和收费方式由基	
	金管理人根据基金合同的规定确定,并在招募说	赎回费率、赎回金额具体的计算方法和收费
	明书中列示。基金管理人可以在基金合同约定的	定,并在招募说明书中列示。基金管理人可
	他国的侧面以平 以权贝刀式,开取心应了别的贝	以在基金合同约定的范围内调整费率 或收
	率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的	费方式,并最迟应于新的费率或收费方式实
	有关规定在指定媒介上公告。	施日前依照《信息披露办法》的 有关规定
		在指定媒介上公告。
第六部分 基金份额的申购		新增:
与赎回		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
 七、拒绝或暂停申购的情形		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
		人应当暂停接受基金申购申请。
		8、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
		超过 50%,或者变相规避 50%集中度的情
		形。法律法规或中国证监会另有规定的除
		外。

第六部分 基金份额的申购	发生上述第 1、2、3、5、6、7 项暂停申购情形之	发生上述第 1、2、3、5、6、7 <u>、9</u> 项暂停申
与赎回	一旦基金管理人决定暂停申购时,基金管理人应	购情形之一且基金管理人决定暂停申购时,
	当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公	基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上
七、拒绝或暂停申购的情形	告。如果投资人的申购申请被拒绝,被拒绝的申	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
	 时,基金管理人应及时恢复申购业务的办理。	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。
第六部分 基金份额的申购		新增:
与赎回		6、当前一估值日基金资产净值 50%以上的
八、暂停赎回或延缓支付赎		资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估
回款项的情形		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
		人应当暂停接受基金赎回申请或延缓支付赎
		回款项。
第六部分 基金份额的申购	2、巨额赎回的处理方式	2、巨额赎回的处理方式
与赎回		新增:
九、巨额赎回的情形及处理		 若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有
方式		人的赎回申请超过上一日基金总份额 20%,
		则基金管理人可以对该基金份额持有人当日
		赎回申请超过上一日基金总份额 20%以上的
		部分自动进行延期办理;对于该基金份额持
		有人当日赎回申请未超过上述比例的部分,
		根据前述"(1)全额赎回"或"(2)部分延
		期赎回"的约定方式与其他基金份额持有人
		的赎回申请一并办理。对于未能赎回部分,
		如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择
		取消赎回,则该部分赎回申请将被撤销。
		在不违反法律法规的前提下,基金管理人在
		履行适当程序后,有权根据当时市场环境调
		整前述比例及处理规则,并在指定媒介上进
		行公告。
第十二部分 基金的投资	基金的投资组合比例为:本基金对债券的投资比	基金的投资组合比例为: 本基金对债券的投
二、投资范围	例不低于基金资产的 80%, 持有的现金或到期日	资比例不低于基金资产的80%,持有的现金
	在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资	或到期日在一年以内的政府债券的投资比例
	产净值的 5%。	不低于基金资产净值的 5%, 其中现金不包
		括结算备付金、存出保证金和应收申购款
		等。
第十二部分 基金的投资	1、组合限制	1、组合限制
四、投资限制	(2) 保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到	(2) 保持不低于基金资产净值 5%的现金
	期日在一年以内的政府债券;	或者到期日在一年以内的政府债券, 其中现
		金不包括结算备付金、存出保证金和应收申
		购款等;

第十二部分 基金的投资		新增:
四、投资限制		(13) 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%;
		(14) 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
		符合该比例限制的,基金管理人不得主动新
		增流动性受限资产的投资;
		(15) 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
		基金合同约定的投资范围保持一致;
第十二部分 基金的投资	因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变	除上述第 (2)、(9)、(14)、(15) 项外,因
四、投资限制	动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不	证券市场波动、证券发行人合并、基金规模
	符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在 10	变动等基金管理人之外的因素致使基金投资
	个交易日内进行调整,但中国证监会规定的特殊	比例不符合上述规定投资比例的,基金管理
	情形除外。	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		新增:
六、暂停估值的情形		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认后,基金管理
		人应当暂停估值;
L	一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作	
露	办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他有	
μ· H		规定》、《基金合同》及其他有关规定。
第十八部分 基全的信息披	(六)基金定期报告,包括基金年度报告、基金	
露露		基金半年度报告和基金季度报告
严 苷		新增:
 五、公开披露的基金信息		如报告期内出现单一投资者持有基金份额达
五、 4 7 7 7 7 7 7 7 7 7 7 7 7 7 7 7 7 7 7		到或超过基金总份额 20%的情形,为保障其
		他投资者的权益,基金管理人至少应当在定期投生"影响机体"表决策的基础系更信息"
		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。
		基金管理人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。
第十八部分 基金的信息披	(七) 临时报告	(七) 临时报告
露		新增:
		26、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜
五、公开披露的基金信息		在影响投资者赎回等重大事项时;
第二十四部分 基金合同内	同步修改	
容摘要		

附件 6:《东海祥瑞债券型证券投资基金托管协议》修改前后文对照表

章节	原《托管协议》条款	修改后的《托管协议》条款
全文	本基金合同	基金合同
二、基金托管协议的依据、	订立本协议的依据是《中华人民共和国证券投资	订立本协议的依据是《中华人民共和国证券
目的和原则	基金法》(以下简称《基金法》)、《公开募集证券	投资基金法》(以下简称《基金法》)、《公开
	投资基金运作管理办法》(以下简称《运作办	募集证券投资基金运作管理办法》(以下简
	法》)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称	称《运作办法》)、《证券投资基金销售管理
	《销售办法》)、《证券投资基金信息披露管理办	办法》(以下简称《销售办法》)、《证券投资
	法》(以下简称《信息披露办法》)、《证券投资基	基金信息披露管理办法》(以下简称《信息
	金信息披露内容与格式准则第 7 号〈托管协议的	披露办法》)、《公开募集开放式证券投资基
	内容与格式〉》、《东海中证社会发展安全产业主题	金流动性风险管理规定》、《证券投资基金
	指数型证券投资基金基金合同》(以下简称《基金	信息披露内容与格式准则第7号〈托管协议
	合同》)及其他有关规定。	的内容与格式〉》、《东海祥瑞债券型证券投
		资基金基金合同》(以下简称《基金合同》)
		及其他有关规定。
三、基金托管人对基金管理	2、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金	2、基金托管人根据有关法律法规的规定及
人的业务监督和核查	合同》的约定对下述基金投融资比例进行监督:	《基金合同》的约定对下述基金投融资比例
(一) 基金托管人对基金管	(1) 按法律法规的规定及《基金合同》的约定,	进行监督:
理人的投资行为行使监督权	本基金的投资资产配置比例为: 本基金对债券的	(1) 按法律法规的规定及《基金合同》的
	投资比例不低于基金资产的 80%,持有的现金或	约定,本基金的投资资产配置比例为:本基
	到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于	金对债券的投资比例不低于基金资产的
	基金资产净值的 5%。	80%,持有的现金或到期日在一年以内的政
		府债券的投资比例不低于基金资产净值的
		5%, 其中现金不包括结算备付金、存出保
		证金和应收申购款等。
三、基金托管人对基金管理	(2)根据法律法规的规定及《基金合同》的约	(2) 根据法律法规的规定及《基金合同》
[····		的约定,本基金投资组合遵循以下投资限
	b.保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日	
理人的投资行为行使监督权	在一年以内的政府债券;	或者到期日在一年以内的政府债券,其中现
		金不包括结算备付金、存出保证金和应收申
		购款等;
三、基金托管人对基金管理		新增:
人的业务监督和核查		m.本基金管理人管理的且由本协议项下本基
(一) 基金托管人对基金管		金托管人托管的全部开放式基金(包括开放
理人的投资行为行使监督权		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
		理人管理的且由本协议项下本基金托管人托
		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%;

		n.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
		该比例限制的,基金管理人不得主动新增流
		动性受限资产的投资;
		o.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基金
		合同约定的投资范围保持一致。
三、基金托管人对基金管理	(3) 法规允许的基金投资比例调整期限	(3) 法规允许的基金投资比例调整期限
人的业务监督和核查	由于证券市场波动、证券发行人合并或基金规模	除上述第(2)项中第b、i、n、o目以外,
	变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不	由于证券市场波动、证券发行人合并或基金
	符合上述约定的比例,不在限制之内,但基金管	规模变动等基金管理人之外的原因导致的投
	理人应在 10 个交易日内进行调整,以达到规定的	资组合不符合上述约定的比例,不在限制之
	投资比例限制要求。法律法规另有规定的从其规	内,但基金管理人应在 10 个交易日内进行
	定。	调整,以达到规定的投资比例限制要求。法
		律法规另有规定的从其规定。

附件 7:《东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同》修改前后文对照表

章节	原《基金合同》条款	修改后的《基金合同》条款
第一部分 前言	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共
一、订立本基金合同的目	同法》(以下简称"《合同法》")、《中华人民共和	和国合同法》(以下简称"《合同法》")、《中
的、依据和原则	国证券投资基金法》(以下简称"《基金法》")、	华人民共和国证券投资基金法》(以下简称
	《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简	"《基金法》")、《公开募集证券投资基金运
	称 "《运作办法》")、《证券投资基金销售管理办	作管理办法》(以下简称"《运作办法》")、
	法》(以下简称"《销售办法》")、《证券投资基金	《证券投资基金销售管理办法》(以下简称
	信息披露管理办法》(以下简称"《信息披露办	"《销售办法》")、《证券投资基金信息披露
	法》")和其他有关法律法规。	管理办法》(以下简称"《信息披露办
		法》") 、《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》")和其他有关法律法规。
第二部分 释义		新增:
		13、《流动性规定》: 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
第二部分 释义		新增:
		63、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
第七部分 基金份额的申购		新增:
与赎回		4、当接受申购申请对存量基金份额持有人
五、申购和赎回的数量限制		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。
第七部分 基金份额的申购	5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承	5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持
与赎回	担,在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎	有人承担,在基金份额持有人赎回基金份额
	回费用应根据法律法规规定的比例归入基金财	
	产,未归入基金财产的部分用于支付登记费和其	例归入基金财产,未归入基金财产的部分用
用及其用途	他必要的手续费。	于支付登记费和其他必要的手续费。 <u>其中</u> ,
		对持续持有期少于7日的基金份额持有人收
		取不低于 1.5%的赎回费并全额计入基金财

		产。
第七部分 基金份额的申购		新增:
与赎回		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
七、拒绝或暂停申购的情形		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
		人应当暂停接受基金申购申请。
		8、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
		超过 50%,或者变相规避 50%集中度的情
		形。法律法规或中国证监会另有规定的除
	发生上述第 1、2、3、5、6、7 项暂停申购情形之	<u>外。</u>
	一且基金管理人决定暂停接受投资人的申购申请	•••••
	时,基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上	发生上述第 1、2、3、5、6、7 <u>、9</u> 项暂停申
	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	
	II For II I word	投资人的申购申请被拒绝,被拒绝的申购款
		时,基金管理人应及时恢复申购业务的办
		理。
上 第七部分 基金份额的申购		新增:
与赎回		6、当前一估值日基金资产净值 50%以上的
八、暂停赎回或延缓支付赎		资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估
回款项的情形		值技术仍导致公允价值存在重大不确定性
H 496. MH 3 111770		时,经与基金托管人协商确认后,基金管理
		人应当暂停接受基金赎回申请或延缓支付赎
		巴款项。
上 第七部分 基金份额的申购		2、巨额赎回的处理方式
与赎回		新增:
[7]然日 九、巨额赎回的情形及处理		河 ^河 : 若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有
方式		人的赎回申请超过上一日基金总份额 20%,
77 17		则基金管理人可以对该基金份额持有人当日
		赎回申请超过上一日基金总份额 20%以上的
		部分自动进行延期办理;对于该基金份额持
		有人当日赎回申请未超过上述比例的部分,
		根据前述"(1)全额赎回"或"(2)部分延期赎回"的价户大工上基础基本价值结束人
		期赎回"的约定方式与其他基金份额持有人
		的赎回申请一并办理。对于未能赎回部分,
		如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择
		取消赎回,则该部分赎回申请将被撤销。
		在不违反法律法规的前提下,基金管理人在

		园尔·大小和克尼 - 大坂坦坦小山大区方位·河
		履行适当程序后,有权根据当时市场环境调
		整前述比例及处理规则,并在指定媒介上进
		行公告。
第十三部分 基金的投资	基金的投资组合比例为:封闭期内,股票资产占	基金的投资组合比例为:封闭期内,股票资
二、投资范围	基金资产的比例范围为 0%-100%, 非公开发行股	产占基金资产的比例范围为 0%-100%,非
	票资产占非现金基金资产的比例不低于 80%; 每	公开发行股票资产占非现金基金资产的比例
	个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需	不低于 80%;每个交易日日终在扣除国债期
	缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证	货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后,
	金一倍的现金;转换为上市开放式基金(LOF)	应当保持不低于交易保证金一倍的现金; 转
	后,股票资产占基金资产的比例范围为 0%	-换为上市开放式基金(LOF)后,股票资产
	95%,每个交易日日终在扣除国债期货和股指期	占基金资产的比例范围为 0%-95%, 每个交
	货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在	易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需
	一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资	。 像
	产净值的 5%。	以内的政府债券投资比例合计不低于基金资
		产净值的 5%, 其中现金不包括结算备付
		金、存出保证金和应收申购款等。
第十三部分 基金的投资	1、组合限制	1、组合限制
四、投资限制	(2) 在封闭期内,每个交易日日终在扣除国债期	
	货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当	
	保持不低于交易保证金一倍的现金: 转换为上市	
	开放式基金(LOF)后,每个交易日日终在扣除	
	国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金	
	后,现金或到期日在一年以内的政府债券投资出版。	
	例合计不低于基金资产净值的 5%;	一年以内的政府债券投资比例合计不低于基
		金资产净值的 5%, 其中现金不包括结算备
		付金、存出保证金和应收申购款等;
第十三部分 基金的投资	•••••	新增:
四、投资限制		(18) 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%;
		(19) 转换为上市开放式基金(LOF)后,
		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该
		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;
		(20) 本基金与私募类证券资管产品及中国
		(20) 不至亚马伯劳入亚万贝目/ 阳风节国

		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
		基金合同约定的投资范围保持一致;
	 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	M L 4 体 (2) (12) (10) (20) 項 目 日 I
	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	一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一
	的特殊情形除外。法律法规另有规定的,从其规 定。	
	<i>د</i> •	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。
第十五部分 基金资产估值		新增:
六、暂停估值的情形		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认后,基金管理
		人应当暂停估值;
第十九部分 基金的信息披	一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作	一、本基金的信息披露应符合《基金法》、
露	办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他有	《运作办法》、《信息披露办法》、_《流动性
	, 关规定。	规定》、《基金合同》及其他有关规定。
第十九部分 基金的信息披	(七)基金定期报告,包括基金年度报告、基金	(七)基金定期报告,包括基金年度报告、
露	半年度报告和基金季度报告	基金半年度报告和基金季度报告
		新增:
五、公开披露的基金信息		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
		他投资者的权益,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。
		基金管理人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。
第十九部分 基金的信息披	(八) 临时报告	(八) 临时报告
露露		新增:
ьн		28、转换为上市开放式基金(LOF)后发生
五、公开披露的基金信息 五、公开披露的基金信息		涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投
五、 4/1% 城市4天 平 旧 (n)		资者赎回等重大事项时;
第二十五部分 基金合同内	同步修订	
容摘要		

章节 原《托管协议》条款 修改后的《托管协议》条款 二、基金托管协议的依据、 订立本协议的依据是《中华人民共和国证券投资订立本协议的依据是《中华人民共和国证券 目的和原则 基金法》(以下简称《基金法》)、《证券投资基金投资基金法》(以下简称《基金法》)、《证券 运作管理办法》(以下简称《运作办法》)、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称《运作 投资基金销售管理办法》(以下简称《销售办办法》)、《证券投资基金销售管理办法》(以 法》)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下下简称《销售办法》)、《证券投资基金信息 简称《信息披露办法》)、《证券投资基金信息披露披露管 理办法》(以下简称《信息披露办 内容与格式准则第 7 号〈托管协议的内容与格法》)、《公开募集开放式证券投资基金流动 式〉》、《东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基性风险管理规定》、《证券投资基金信息披 金基金合同》(以下简称《基金合同》)及其他有露内容与格式准则第7号〈托管协议的内容 关规定。 与格式〉》、《东海祥龙定增灵活配置混合型 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。 三、基金托管人对基金管理2、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金2、基金托管人根据有关法律法规的规定及 人的业务监督和核查 合同》的约定对下述基金投融资比例进行监督: 《基金合同》的约定对下述基金投融资比例 (一) 基金托管人对基金管 (1) 按法律法规的规定及《基金合同》的约定,进行监督: 理人的投资行为行使监督权本基金的投资资产配置比例为:封闭期内,股票(1)按法律法规的规定及《基金合同》的 资产占基金资产的比例范围为 0%-100%,非公开约定,本基金的投资资产配置比例为: 封闭 发行股票资产占非现金基金资产的比例不低于期内,股票资产占基金资产的比例范围为 80%:每个交易日日终在扣除国债期货和股指期0%-100%,非公开发行股票资产占非现金基 货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于金资产的比例不低于 80%:每个交易日日终 交易保证金一倍的现金;转换为上市开放式基金在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交 (LOF) 后,股票资产占基金资产的比例范围为易保证金后,应当保持不低于交易保证金-0%-95%。转换为上市开放式基金(LOF)后,每倍的现金;转换为上市开放式基金(LOF) 个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需后,股票资产占基金资产的比例范围为 0% 缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内95%。转换为上市开放式基金(LOF)后, 的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货 5%。 合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日 在一年以内的政府债券投资比例合计不低于 基金资产净值的 5%, 其中现金不包括结算 备付金、存出保证金和应收申购款等。 三、基金托管人对基金管理(2)根据法律法规的规定及《基金合同》的约 (2) 根据法律法规的规定及《基金合同》 定, 本基金投资组合遵循以下投资限制: 人的业务监督和核查 的约定,本基金投资组合遵循以下投资限 (一)基金托管人对基金管2)在封闭期内,每个交易日日终在扣除国债期货 制: 和股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保 2) 在封闭期内,每个交易日日终在扣除国 理人的投资行为行使监督权 持不低于交易保证金一倍的现金; 转换为上市开 债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金 放式基金(LOF)后,每个交易日日终在扣除国 后,应当保持不低于交易保证金一倍的现 债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后, 现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例合 金:转换为上市开放式基金(LOF)后,每 计不低于基金资产净值的 5%: 个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合 约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在

		一年以内的政府债券投资比例合计不低于基
		金资产净值的 5%, 其中现金不包括结算备
		付金、存出保证金和应收申购款等;
三、基金托管人对基金管理		新增:
人的业务监督和核查		18) 本基金管理人管理的且由本协议项下本
(一) 基金托管人对基金管		基金托管人托管的全部开放式基金(包括开
理人的投资行为行使监督权		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
		管理人管理的且由本协议项下本基金托管人
		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%;
		19)转换为上市开放式基金(LOF)后,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该比
		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;_
		20) 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基
		金合同约定的投资范围保持一致。
三、基金托管人对基金管理	(3) 法规允许的基金投资比例调整期限	(3) 法规允许的基金投资比例调整期限
人的业务监督和核查	除上述第 1)项 以外,由于证券、期货市场波动、	除上述第2项中2)、12)、19)、20)目以外,
(一) 基金托管人对基金管	证券发行人合并或基金规模变动等基金管理人之	由于证券、期货市场波动、证券发行人合并
理人的投资行为行使监督权	外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比	或基金规模变动等基金管理人之外的原因导
	例,不在限制之内,但基金管理人应在 10 个交易	致的投资组合不符合上述约定的比例,不在
	日内进行调整,以达到规定的投资比例限制要	
	求,但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法	内进行调整,以达到规定的投资比例限制要
	规另有规定的从其规定。	求,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。