

华安中证银行指数分级证券投资基金基金合同修改对照表

章节	修订前	修订内容
前言		<u>增加：</u> <u>“《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</u> <u>（以下简称“《流动性风险管理规定》”）”的表述</u>
释义		<u>增加：</u> <u>“《流动性风险管理规定》：指中国证监会 2017 年 8 月 31</u> <u>日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集开放式证券投资基</u> <u>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>
释义		<u>增加：</u> <u>“流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作</u> <u>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> <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</u> <u>约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新</u> <u>股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无</u> <u>法进行转让或交易的债券等。”</u>

基金份额的申购、赎回与转换	“五、申购与赎回的数额限制”	<u>增加：</u> <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，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>
基金份额的申购、赎回与转换	“六、申购和赎回的费用及其用途”	<u>增加：</u> <u>“基金管理人持续持有期少于 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。”</u>
基金份额的申购、赎回与转换	“九、巨额赎回的认定及处理方式”之“2、巨额赎回的处理方式”	<u>增加：</u> <u>“若基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额（包括华安中证银行份额、华安中证银行 A 份额和华安中证银行 B 份额）的 20%，基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出 20% 的赎回申请实施延期办理，而对该单个基金份额持有人 20% 以内（含 20%）的赎回申请与其他投资者的赎回申请按前述条款处理，具体见招募说明书或相关公告。”</u>

基金份额的申购、赎回与转换	“七、拒绝或暂停申购的情形”	<u>增加：</u> <u>“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达到或者超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形时；</u> <u>9、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暂停接受基金申购申请的措施。”</u>
基金份额的申购、赎回与转换	“八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形”	<u>增加：</u> <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>
基金合同当事人及其权利义务	“（一）基金管理人”中住所和法定代表人	<u>更新为：</u> <u>住所：中国（上海）自由贸易试验区，世纪大道 8 号上海国金中心二期 31、32 层</u> <u>法定代表人：朱学华</u>

基金合同当事人及其权利义务	“（二）基金托管人”中法定代表人和注册资本	<u>更新为：</u> <u>法定代表人：陈四清</u> <u>注册资本：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>
基金的投资	“二、投资范围和投资比例” “五、投资限制”之“1、基金投资组合比例限制”	<u>增加：</u> <u>“.....现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等”</u> <u>增加：</u> <u>“（4）.....现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</u> <u>（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本基金资产净值的 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>（15）基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的</u>

		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； 基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。除上述第（2）、（10）、（14）、（15）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不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在十个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。”
基金资产估值	“（六）暂停估值的情形”	增加： “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一致的；”
基金的信息披露	“（七）定期报告”	增加： “报告期内出现单一投资者持有基金份额比例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季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告文件中“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投

		<u>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> <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>
基金的信息披露	“(七) 临时报告与公告”	<u>增加:</u> <u>“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时。”</u>