

《华安沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》修改前后对照表

章节	修改前	修改后
<p>一、前言</p> <p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</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》”)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“<u>《流动性风险管理规定》</u>”)和其他有关法律法规。</p>
<p>第二部分 释义</p>		<p>新增:</p> <p><u>14.《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><u>15.流动性受限资产:指由于法律法规、监管、合同或操作障</u></p>

		<p><u>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>八、华安沪深 300 份额的申购与赎回</p> <p>(五) 申购和赎回的数额和金额限制</p>		<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华安沪深 300 份额的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，可采取上述措施对华安沪深 300 份额的规模予以控制。具体规定请参见相关公告。</u></p>
<p>八、华安沪深 300 份额的申购与赎回</p> <p>(六) 申购和赎回的价</p>	<p>5. 赎回费用由赎回华安沪深 300 份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回华安沪深 300 份额时收取。不高于赎回费总额的 25% 应归基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。</p>	<p>5. 赎回费用由赎回华安沪深 300 份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回华安沪深 300 份额时收取。<u>对于持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产，对于持续持有期不少于 7 日的投资者收取的赎回费</u>，不低</p>

<p>格、费用及其用途</p>	<p>6. 华安沪深 300 份额的申购费率最高不超过申购金额的 5%，赎回费率最高不超过赎回金额的 5%。华安沪深 300 份额的申购费率、申购份额具体的计算方法、赎回费率、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，并在招募说明书中列示。基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。</p>	<p>于赎回费总额的 25%应归基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。</p> <p>6. 华安沪深 300 份额的申购费率最高不超过申购金额的 5%，赎回费率最高不超过赎回金额的 5%，<u>对于持续持有期少于 7 日的投资者收取不少于 1.5%的赎回费</u>。华安沪深 300 份额的申购费率、申购份额具体的计算方法、赎回费率、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，并在招募说明书中列示。基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。</p>
<p>八、华安沪深 300 份额的申购与赎回</p> <p>(七)拒绝或暂停申购的情形</p>		<p>新增：</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华安沪深 300 份额的申购申请；</u></p> <p><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</u></p>

		<u>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>
八、华安沪深 300 份额的申购与赎回 (七)拒绝或暂停申购的情形	发生上述暂停申购情形(第 4 项除外)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体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，基金管理人或基金管理人指定的代销机构不承担由此产生的利息等任何损失。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。	发生上述暂停申购情形(第 4、 <u>8</u> 项除外)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体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被 <u>全部或部分</u> 拒绝的，被拒绝的申购款项将退还给投资人，基金管理人或基金管理人指定的代销机构不承担由此产生的利息等任何损失。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。
八、华安沪深 300 份额的申购与赎回 (八)暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形		新增： <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，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受华安沪深 300 份额的赎回申请；</u>
八、华安沪深 300 份额的申购与赎回		新增： <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</u>

<p>(九)巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>(2) 部分延期赎回</p>		<p><u>过上一日基金总份额（包括华安沪深 300 份额、华安沪深 300A 份额和华安沪深 300B 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></p>
<p>十一、基金合同当事人及权利义务</p> <p>(二)基金托管人</p>	<p>法定代表人：<u>王洪章</u></p>	<p>法定代表人：<u>田国立</u></p>
<p>十六、基金的投资</p> <p>(二)投资范围</p>	<p>本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的市值加上买入、卖出股指期货合约的轧差合计值不低于基金资产的 90%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的市值不低于基金资产的 85%；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；投资于权证的比例不得超过基金资产净值的 3%；其他金融工具的投资比例符合法律法规和中国证监会的规定。</p>	<p>本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的市值加上买入、卖出股指期货合约的轧差合计值不低于基金资产的 90%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的市值不低于基金资产的 85%；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，<u>其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等</u>；投资于权证的比例不得超过基金资产净值的 3%；其他金融工具的投资比例符</p>

		合法律法规和中国证监会的规定。
<p>十六、基金的投资</p> <p>(八)投资限制与禁止行为</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>(8)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；</p> <p>……</p>	<p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>……</p> <p>(8)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，<u>其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</u></p> <p>……</p> <p>新增：</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、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><u>(12) 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；</u></p>

	<p>因证券市场波动、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，以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。</p>	<p>.....</p> <p><u>除上述第（8）、（11）、（12）项外</u>，因证券市场波动、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，以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。</p>
<p>十八、基金资产的估值 (七)暂停估值的情形</p>		<p>新增： <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，基金管理人应当暂停估值；</u></p>
<p>二十四、基金的信息披露 (八)基金年度报告、基金半年度报告、基金季度报告</p>		<p>新增： <u>6.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（包括华安沪深 300 份额、华安沪深 300A 份额和华安沪深 300B 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</u></p>

		<p><u>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>二十四、基金的信息披露</p> <p>(九)临时报告与公告</p>		<p>新增：</p> <p><u>34.发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资人赎回等重大事项时；</u></p>