东方基金管理有限责任公司关于旗下部分基金根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修订基金合同及托管协议的公告

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》”）的相关要求，经与相关基金托管人协商一致，并报监管部门备案后，东方基金管理有限责任公司（以下简称“我公司”）对旗下以下 40 只基金的基金合同及托管协议进行了修订（具体修改内容详见附件）：

基金名称	托管机构	成立时间
东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金	广发证券	2015-04-15
东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金	邮储银行	2011-12-28
东方强化收益债券型证券投资基金	邮储银行	2012-10-09
东方安心收益保本混合型证券投资基金	邮储银行	2013-07-03
东方多策略灵活配置混合型证券投资基金	中国工商银行	2014-05-21
东方主题精选混合型证券投资基金	中国工商银行	2015-03-23
东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金	中国工商银行	2015-04-21
东方区域发展混合型证券投资基金	中国工商银行	2016-09-07
东方新策略灵活配置混合型证券投资基金	中国光大银行	2015-05-26
东方龙混合型开放式证券投资基金	中国建设银行	2004-11-25
东方策略成长混合型开放式证券投资基金	中国建设银行	2008-06-03
东方稳健回报债券型证券投资基金	中国建设银行	2008-12-10
东方惠新灵活配置混合型证券投资基金	中国建设银行	2015-04-21
东方创新科技混合型证券投资基金	中国建设银行	2015-09-08
东方合家保本混合型证券投资基金	中国建设银行	2016-06-16
东方臻享纯债债券型证券投资基金	中国建设银行	2016-11-28
东方支柱产业灵活配置混合型证券投资基金	中国建设银行	2017-05-24
东方精选混合型开放式证券投资基金	中国民生银行	2006-01-11
东方金账簿货币市场证券投资基金	中国民生银行	2006-08-02
东方双债添利债券型证券投资基金	中国民生银行	2014-09-24
东方永润债券型证券投资基金	中国民生银行	2015-05-04

东方新思路灵活配置混合型证券投资基金	中国民生银行	2015-06-25
东方金元宝货币市场基金	中国民生银行	2015-11-23
东方金证通货币市场基金	中国民生银行	2016-03-18
东方盛世灵活配置混合型证券投资基金	中国民生银行	2016-04-15
东方永兴 18 个月定期开放债券型证券投资基金	中国民生银行	2016-11-02
东方民丰回报赢安混合型证券投资基金	中国民生银行	2017-03-09
东方价值挖掘灵活配置混合型证券投资基金	中国民生银行	2017-05-17
东方利群混合型发起式证券投资基金	中国农业银行	2013-07-17
东方新兴成长混合型证券投资基金	中国农业银行	2014-09-03
东方添益债券型证券投资基金	中国农业银行	2014-12-15
东方新价值混合型证券投资基金	中国农业银行	2015-07-03
东方稳定增利债券型证券投资基金	中国农业银行	2015-09-30
东方启明量化先锋混合型证券投资基金	中国农业银行	2015-12-03
东方大健康混合型证券投资基金	中国农业银行	2016-02-04
东方互联网嘉混合型证券投资基金	中国农业银行	2016-04-06
东方岳灵活配置混合型证券投资基金	中国农业银行	2016-09-22
东方永熙 18 个月定期开放债券型证券投资基金	中国农业银行	2016-12-27
东方周期优选灵活配置混合型证券投资基金	中国农业银行	2017-03-15
东方核心动力混合型证券投资基金	中国银行	2009-06-24

注：我公司东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金、东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金的基金合同和托管协议等法律文件已根据相关法律法规调整完毕；东方荣家保本混合型证券投资基金、东方臻馨债券型证券投资基金、东方臻悦纯债债券型证券投资基金将于近期保本到期清盘或拟召开基金份额持有人大会终止基金合同并清算，相关公告请参阅我公司网站或其他指定媒介，本次不对上述基金的基金合同和托管协议等法律文件进行修订。

此次修订系因相关法律法规发生变动对基金合同进行的修改，且其修改未对原有基金份额持有人的利益形成任何实质性不利影响，可由基金管理人和基金托管人协商一致后修改基金合同，无需召开基金份额持有人大会。

注意事项：

1、我公司于公告日在网站上同时公布修改后的基金合同及托管协议，招募说明书（更新）

中相关内容将随后在定期更新时进行相应修改；本次修订后的基金合同及托管协议自本公告发布之日起生效。

2、投资者也可通过以下渠道咨询相关详情：

（1）我公司网站：www.orient-fund.com或www.df5888.com；

（2）我公司客户服务电话：400-628-5888；

3、本公告的解释权归我公司所有。

特此公告。

附：我公司旗下40只基金根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改法律文件的情况说明

东方基金管理有限责任公司

2018 年 3 月 31 日

东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》

修改法律文件的情况说明

（一）《东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金基金合同》修改对照表

章节	原《基金合同》	修订后《基金合同》
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》”）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》”）、《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》”）和其他有关法律法规。
第二部分 释义		…… 13、《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 …… 50、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 基金份额的申购与赎回	五、申购和赎回的数量限制	五、申购和赎回的数量限制 …… 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。具体规定请参见相关公告。 ……

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 …… 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。 ……	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 …… 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于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 日的投资者收取不低于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产**。 ……
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人的申购申请： …… ~~6、~~法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、5、~~6、~~项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，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。	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人的申购申请： …… 6、**接受某一投资者申购申请后导致其持有基金份额达到或超过基金总份额 50%的。** **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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。** 8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、5、**7、8** 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，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。
第六部分 基金份额的申购与赎回	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… ……	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… **6、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。** ……
第六部分 基金份额的申购与赎回	九、巨额赎回的情形及处理方式 …… 2、巨额赎回的处理方式 当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎	九、巨额赎回的情形及处理方式 …… 2、巨额赎回的处理方式 当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。

	回。 ……	…… （3）在出现巨额赎回且单个基金份额持有人当日的赎回申请超过上一开放日基金总份额 20%以上的情形时，对于该基金份额持有人当日申请赎回的超过上一开放日基金总份额 20%以上的基金份额，基金管理人有权全部自动进行延期办理；对于该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人可以根据前段“（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。但是，如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理部分的赎回申请将被撤销。
第七部分 基金合同 当事人及 权利义务	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 …… 注册资本：~~贰~~亿元人民币 ~~存续期限：50 年~~ ……	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 …… 注册资本：叁亿元人民币 营业期限：2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日 ……
第七部分 基金合同 当事人及 权利义务	二、基金托管人 （一）基金托管人简况 名称：广发证券股份有限公司 住所：~~广州市天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼（4301-4316 房）~~ …… 注册资本：人民币 ~~5,919,291,464.00~~ 元 ……	二、基金托管人 （一）基金托管人简况 名称：广发证券股份有限公司 住所：广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室 …… 注册资本：人民币 7,621,087,664 元 ……
第十二部 分基金的 投资	二、投资范围 …… 基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%-95%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例按照法律法规或监管机构的规定执行；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，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%，投资于本基金定义的热点证券的比例不低于非现金基金资产的 80%。 ……	二、投资范围 …… 基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%-95%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例按照法律法规或监管机构的规定执行；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，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、应收申购款等。投资于本基金定义的热点证券的比例不低于非现金基金资产的 80%。 ……
第十二部 分基金的 投资	四、投资限制 …… （2）本基金每个交易日日终在扣除股指期货合	四、投资限制 …… （2）本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约

	约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券； …… ~~（18）~~法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 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，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。	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、应收申购款等**； …… **（18）本基金管理人管理的全部开放式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）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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，本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；** **（21）**法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 **除第（2）、（12）、（19）、（20）项外，**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。
第十四部分基金资产估值	六、暂停估值的情形 …… **~~3、~~**中国证监会和基金合同认定的其它情形。	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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的；** **4、**中国证监会和基金合同认定的其它情形。
第十八部分基金的信息披露	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。 …… 五、公开披露的基金信息 …… （六）基金定期报告，包括基金年度报告、基金	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》、**《流动性风险管理规定》、**《基金合同》及其他有关规定。 …… 五、公开披露的基金信息 …… （六）基金定期报告，包括基金年度报告、基金半

	半年度报告和基金季度报告 …… （七）临时报告 …… ~~27、~~中国证监会规定的其他事项。	年度报告和基金季度报告 …… **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。** **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基金定期报告“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。** （七）临时报告 …… **27、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；** 28、中国证监会规定的其他事项。

（二）《东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金托管协议》修改对照表

章节	原《托管协议》	修订后《托管协议》
一、基金托管协议当事人	（一）基金管理人 ~~注册地址~~：北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层…… 注册资本：~~贰~~亿元人民币 ~~存续期限：50 年~~ 经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。 ……	（一）基金管理人 **住所**：北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层 …… 注册资本：**叁**亿元人民币 **营业期限：2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日** 经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、**从事境外证券投资管理业务**和中国证监会许可的其他业务。 ……
一、基金托管协议当事人	（二）基金托管人 名称：广发证券股份有限公司 ~~注册地址：广州市天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼（4301-4316 房）~~ 办公地址：~~广州市天河区天河北路 183-187 号大都会广场 5 楼、7 楼、18 楼、19 楼、36 楼、38 楼、39 楼、41 楼、42 楼、43 楼和 44 楼~~ 注册资本：人民币 ~~5,919,291,464.00~~ 元 …… 经营范围：~~证券经纪；证券投资咨询；与证券交~~	（二）基金托管人 名称：广发证券股份有限公司 **住所：广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室** 办公地址：**广州市天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼** 注册资本：人民币 **7,621,087,664** 元 …… 经营范围：**证券经纪；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券承销与保荐；**

	~~易、证券投资活动有关的财务顾问，证券承销与保荐，证券自营；融资融券；证券投资基金代销；证券投资基金托管；为期货公司提供中间介绍业务；代销金融产品；经中国证券监督管理委员会批准的其他业务。~~	**证券自营；融资融券；证券投资基金代销；证券投资基金托管；为期货公司提供中间介绍业务；代销金融产品；股票期权做市。（依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动。）**
二、基金托管协议的依据、目的和原则	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”等有关法律、法规（以下简称“法律法规”）、基金合同及其他有关规定制订。	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）**、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》**等有关法律、法规（以下简称“法律法规”）、基金合同及其他有关规定制订。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	（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， 对基金投资范围、投资对象进行监督。 …… 本基金的配置比例为:股票资产占基金资产的比例为 0%-95%； 权证、股指期货及其他金融工具的投资比例按照法律法规或监管机构的规定执行；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，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%，投资于本基金定义的热点证券的比例不低于非现金基金资产的 80%。 ……	（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，对基金投资范围、投资对象进行监督。 …… 本基金的配置比例为:股票资产占基金资产的比例为 0%-95%； 权证、股指期货及其他金融工具的投资比例按照法律法规或监管机构的规定执行；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，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、应收申购款等。**投资于本基金定义的热点证券的比例不低于非现金基金资产的 80%。 ……
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定， 对基金投资、融资、融券比例进行监督。基金托管人按下述比例和和调整期限进行监督： …… 2、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，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； ……	（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定， 对基金投资、融资、融券比例进行监督。基金托管人按下述比例和和调整期限进行监督： …… 2、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，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、应收申购款等；** …… **15、本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部开放式基金（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且由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%；** **16、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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资； 17、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； 18、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制； 19、本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资策略、投资比例的规定。 除第 2、9、16、17 项外，因证券、期货市场波动、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的投资比例的，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。法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。 …… （七）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定， 对基金投资流通受限证券进行监督。 1、基金投资流通受限证券，应遵守《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。 2、流通受限证券与上文所述的流动性受限资产并不完全一致，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、……
	15、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制； 16、本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资策略、投资比例的规定。 因证券、期货市场波动、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的投资比例的，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。法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。 …… （七）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资流通受限证券进行监督。 1、基金投资流通受限证券，应遵守~~《关于规范基金投资非公开发行证券行为的紧急通知》~~、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。 2、流通受限证券包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、……	
八、基金资产净值计算和会计核算	（四）暂停估值与公告基金份额净值的情形 …… 3、中国证监会和基金合同认定的其他情形。	（四）暂停估值与公告基金份额净值的情形 …… 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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的； 4.中国证监会和基金合同认定的其他情形。

东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》

修改法律文件的情况说明

（一）《东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金基金合同》修改对照表

章节	原《基金合同》	修订后《基金合同》
一、 前言	2、 订立本基金合同的依据是《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《中华人民共和国合同法》、《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。	2、 订立本基金合同的依据是《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《中华人民共和国合同法》、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）**、《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“《流动性风险管理规定》”）**、《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。
二、 释义	3、基金托管人或本基金托管人：指中国邮政储蓄银行~~有限责任公司~~ …… ……	3、基金托管人或本基金托管人：指中国邮政储蓄银行**股份有限公司** …… **13、《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** …… **55、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** ……
六、基金份额的申购与赎回	（五）申购和赎回的数额限制	（五）申购和赎回的数额限制 …… **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。 ……
六、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 …… 5、本基金的申购费用应在投资者申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，不低于赎回费总额的 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。 ……	（六）申购和赎回的价格、费用及其用途 …… 5、本基金的申购费用应在投资者申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，**其中对持续持有期少于 7 日的投资者收取不少于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产，其他情形下**不低于赎回费总额的 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。 ……
六、基金份额的申购与赎回	（八）拒绝或暂停申购的情形 ……	（八）拒绝或暂停申购的情形 …… **5、接受某一投资者申购申请后导致其持有基金份额达到或超过基金总份额 50%的；** **6、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；**
六、基金份额的申购与赎回	（九）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… ……	（九）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… **6、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。** ……
六、基金份额的申购与赎回	十、巨额赎回的情形及处理方式 …… 2、巨额赎回的处理方式 当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分顺延赎回。 ……	十、巨额赎回的情形及处理方式 …… 2、巨额赎回的处理方式 当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分顺延赎回。 …… **（3）在出现巨额赎回且单个基金份额持有人当日的赎回申请超过上一日基金总份额 20%以上的情形时，对于该基金份额持有人当日申请赎回的超过上一日基金总份额 20%以上的基金份额，基金管理人有权全部自动进行延期办理；对于该基金份额持有人未超过上述**

	……	比例的部分，基金管理人可以根据前段“（1）全额赎回”或“（2）部分顺延赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。但是，如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理部分的赎回申请将被撤销。 ……
七、基金合同当事人及权利义务	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 …… 法定代表人：~~杨树财~~ …… 注册资本：~~贰~~亿元人民币 ~~存续期限：50 年~~ …… （二）基金托管人 1、基金托管人简况 名称：中国邮政储蓄银行~~有限责任公司~~ 住所：~~北京市西城区宣武门西大街 131 号~~ …… 法定代表人：~~刘安东~~ …… 组织形式：~~有限责任公司~~ 注册资本：~~410~~亿元人民币 …… 经营范围：~~吸收本外币储蓄存款；办理汇兑；从事银行卡（借记卡）业务；代理收付款项，包括代发工资和社会保障基金、代理各项公用事业收费和代收税款等；代理发行、兑付政府债券；代理买卖外汇；代理政策性银行、商业银行及其他金融机构特定业务；办理政策性银行、中资商业银行和农村信用社大额协议存款；买卖政府债券、金融债券和中央银行票据；承销政府债券和政策性金融债券；提供个人存款证明服务；提供保险箱服务；办理网上银行业务；以非牵头行身份参与政策性银行、国有商业银行及股份制商业银行牵头组织的银团贷款业务；邮政储蓄定期存单小额质押贷款业务；开放式证券投资基金代销业务；吸收对公存款；办理国内外结算；办理票据贴现；发行金融债券；从事同行业拆借；买卖、代理买卖外汇；经银监会批准的其他业务。~~	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 …… 法定代表人：**崔伟** …… 注册资本：**叁**亿元人民币 **营业期限：2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日** …… （二）基金托管人 1、基金托管人简况 名称：中国邮政储蓄银行**股份有限公司** 住所：**北京市西城区金融大街 3 号** …… 法定代表人：**李国华** …… 组织形式：**股份有限公司** 注册资本：**810.31**亿元人民币 …… 经营范围：**吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑和贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；经中国银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务**
十二、基金的投资	（三）投资范围 ……	（三）投资范围 ……

	本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 30%-80%，其中投资于中小盘股的比例不低于本基金股票投资部分的 80%，投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%；债券资产、货币市场工具、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 20%-70%，其中，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%。	本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 30%-80%，其中投资于中小盘股的比例不低于本基金股票投资部分的 80%，投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%；债券资产、货币市场工具、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 20%-70%，其中，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投资比例不低于基金资产净值的 5%。
十二、基金的投资	（九）投资限制 …… ⑸现金和到期日不超过 1 年的政府债券不低于基金资产净值的 5%； …… ~~⑷~~相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。 …… 由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内，但基金管理人应在 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。 ……	（九）投资限制 …… ⑸现金和到期日不超过 1 年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、应收申购款等**； …… **⑿本基金管理人管理的全部开放式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%；** **⑿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、上市公司股票停牌、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；** **⑸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；** …… **⑰**相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。 …… **除第⑸、⑽、⑿、⑸项外，**由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内，但基金管理人应在 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。

		……
十四、基金资产的估值	（七）暂停估值的情形 ……	（七）暂停估值的情形 …… **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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的；**
十八、基金的信息披露	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。 …… （五）公开披露的基金信息 …… 6、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 …… 7、临时报告 ……	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。 …… （五）公开披露的基金信息 …… 6、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 …… **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。** **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基金定期报告“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。** 7、临时报告 …… **26、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；**

（二）《东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金托管协议》修改对照表

章节	原《托管协议》	修订后《托管协议》
	…… 鉴于中国邮政储蓄银行~~有限责任公司~~系一家依照中国法律合法成立并有效存续的银行，按照相关法律法规的规定具备担任基金托管人的资格和能力； 鉴于东方基金管理有限责任公司拟担任东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金的基金管理人，中国邮政储蓄银行~~有限责任公司~~拟担任东方增长中	…… 鉴于中国邮政储蓄银行**股份有限公司**系一家依照中国法律合法成立并有效存续的银行，按照相关法律法规的规定具备担任基金托管人的资格和能力； 鉴于东方基金管理有限责任公司拟担任东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金的基金管理人，中国邮政储蓄银行**股份有限公司**拟担任东方增长中小盘混

	小盘混合型开放式证券投资基金的基金托管人； ……	合型开放式证券投资基金的基金托管人； ……
一、基金托管协议当事人	（一）基金管理人 …… 法定代表人：~~杨树财~~ …… 注册资本：~~壹~~亿元人民币 ~~存续期间：50 年~~ 经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务 （二）基金托管人 名称：中国邮政储蓄银行~~有限责任公司~~ 住所：~~北京市西城区宣武门西大街 131 号~~ 法定代表人：~~刘安东~~ 注册资本：~~410~~亿元人民币 …… 经营范围：~~吸收本外币储蓄存款；办理汇兑；从事银行卡（借记卡）业务；代理收付款项，包括代发工资和社会保障基金、代理各项公用事业收费和代收税款等；代理发行、兑付政府债券；代理买卖外汇；代理政策性银行、商业银行及其他金融机构特定业务；办理政策性银行、中资商业银行和农村信用社大额协议存款；买卖政府债券、金融债券和中央银行票据；承销政府债券和政策性金融债券；提供个人存款证明服务；提供保险箱服务；办理网上银行业务；以非牵头行身份参与政策性银行、国有商业银行及股份制商业银行牵头组织的银团贷款业务；邮政储蓄定期存单小额质押贷款业务；开放式证券投资基金代销业务；吸收对公存款；办理国内外结算；办理票据贴现；发行金融债券；从事同行业拆借；买卖、代理买卖外汇；经银监会批准的其他业务。~~	（一）基金管理人 …… 法定代表人：**崔伟** …… 注册资本：**叁**亿元人民币 **营业期限：2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日** 经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、**从事境外证券投资管理业务**和中国证监会许可的其他业务 （二）基金托管人 名称：中国邮政储蓄银行**股份有限公司** 住所：**北京市西城区金融大街 3 号** 法定代表人：**李国华** 注册资本：**810.31** 亿元人民币 …… 经营范围：**吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑和贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；经中国银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务**
二、基金托管协议的依据、目的和原则	（一）订立托管协议的依据 《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》）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 7 号〈托管协议的内容与格式〉》、《东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金基金合同》（以下简称《基金合同》）及其他有关	（一）订立托管协议的依据 《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》）**、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》**、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 7 号〈托管协议的内容与格式〉》、《东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金基金合同》（以下

	规定订立。	简称《基金合同》）及其他有关规定订立。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 30%-80%，其中投资于中小盘股的比例不低于本基金股票投资部分的 80%，投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%；债券资产、货币市场工具、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 20%-70%，其中，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%。	本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 30%-80%，其中投资于中小盘股的比例不低于本基金股票投资部分的 80%，投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%；债券资产、货币市场工具、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 20%-70%，其中，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投资比例不低于基金资产净值的 5%。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资、融券比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： …… 5、现金和到期日不超过 1 年的政府债券不低于基金资产净值的 5%； …… …… 基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。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本基金投资比例不符合上述各	（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资、融券比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： …… 5、现金和到期日不超过 1 年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、应收申购款等**； …… **13、本基金管理人管理的全部开放式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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，本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；** …… 基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。**除第 5、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本基金投资比例不符合上述各项规定的投资比例，基金管理人应当在 10

	项规定的投资比例，基金管理人应当在 10 个交易日内调整完毕，以符合上述比例限定。法律法规或监管部门另有规定的从其规定。 ……	个交易日内调整完毕，以符合上述比例限定。法律法规或监管部门另有规定的从其规定。 ……
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	（七）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资流通受限证券进行监督。 1、基金投资流通受限证券，应遵守~~《关于规范基金投资非公开发行证券行为的紧急通知》~~,《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。	（七）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资流通受限证券进行监督。 1、基金投资流通受限证券，应遵守《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。
八、基金资产净值计算和会计核算	（四）暂停估值与公告基金份额净值的情形 ……	（四）暂停估值与公告基金份额净值的情形 …… **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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的；**

东方强化收益债券型证券投资基金

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》

修改法律文件的情况说明

（一）《东方强化收益债券型证券投资基金基金合同》修改对照表

章节	原《基金合同》	修订后《基金合同》
一、前言	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。	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》”）、**《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》”）**和其他有关法律法规。
二、释义		…… 13、《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 …… 50、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 ……
六、基金份额的申购与赎回	（五）申购和赎回的数量限制	（五）申购和赎回的数量限制 …… 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。具体规定请参见相关公告。 ……

六、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 …… 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。不低于赎回费总额的 25%应归基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。 ……	（六）申购和赎回的价格、费用及其用途 …… 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。**对持续持有期少于 7 日的投资者收取不少于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产，其他情形下**不低于赎回费总额的 25%应归基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。 ……
六、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人的申购申请： …… ~~6、~~法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、5、~~6~~ 项暂停申购情形时，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。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。	（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人的申购申请： …… 6、**接受某一投资者申购申请后导致其持有基金份额达到或超过基金总份额 50%的。** **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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。** **8、**法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、5、**7、8** 项暂停申购情形时，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。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。
六、基金份额的申购与赎回	（八）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… ……	（八）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… **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，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。** ……
六、基金份额的申购与赎回	（九）巨额赎回的情形及处理方式 …… 2、巨额赎回的处理方式 当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。 ……	（九）巨额赎回的情形及处理方式 …… 2、巨额赎回的处理方式 当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。 …… **（3）在出现巨额赎回且单个基金份额持有人当日的赎回申请超过前一开放日基金总份额 20%以上的情形**

	……	时，对于该基金份额持有人当日申请赎回的超过前一开放日基金总份额 20%以上的基金份额，基金管理人有权全部自动进行延期办理；对于该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人可以根据前段“（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。但是，如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理部分的赎回申请将被撤销。 ……
七、基金合同当事人及权利义务	(一)基金管理人 1、基金管理人简况 …… 注册资本：~~贰~~亿元人民币 ~~存续期限：50 年~~ ……	(一)基金管理人 1、基金管理人简况 …… 注册资本：叁亿元人民币 营业期限：2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日 ……
七、基金合同当事人及权利义务	（二）基金托管人 1、基金托管人简况 …… 注册资本：~~450~~亿元人民币 ……	（二）基金托管人 1、基金托管人简况 …… 注册资本：810.31 亿元人民币 ……
十二、基金的投资	(三)投资范围 …… 本基金的投资组合比例为：现金、固定收益类资产占基金资产的比例为 80%-100%；股票、权证等权益类资产占基金资产的比例为 0%-20%，其中持有的全部权证市值不超过基金资产净值的 3%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。 ……	(三)投资范围 …… 本基金的投资组合比例为：现金、固定收益类资产占基金资产的比例为 80%-100%；股票、权证等权益类资产占基金资产的比例为 0%-20%，其中持有的全部权证市值不超过基金资产净值的 3%；现金或者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、应收申购款等。 ……
十二、基金的投资	(七)投资限制 1、组合限制 本基金的投资组合将遵循以下限制： …… （6）本基金投资于固定收益类金融工具的资产占基金资产的比例不低于 80%， 投资于股票、权证等权益类金融工具的资产占基金资产的比例不超过 20%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%； ……	(七)投资限制 1、组合限制 本基金的投资组合将遵循以下限制： …… （6）本基金投资于固定收益类金融工具的资产占基金资产的比例不低于 80%， 投资于股票、权证等权益类金融工具的资产占基金资产的比例不超过 20%；现金或者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、应收申购款等； ……

	~~（15）~~相关法律法规以及监管部门规定的其他投资限制。 …… 由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内，但基金管理人应在 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。	（15）本基金管理人管理的全部开放式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%； （16）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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资； （17）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； （18）相关法律法规以及监管部门规定的其他投资限制。 …… 除上述第(6)项中“现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%”及第(11)、(16)、(17)项外，由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内，但基金管理人应在 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。
十四、基金资产的估值	（七）暂停估值的情形 …… ~~5、~~中国证监会和基金合同认定的其它情形。	（七）暂停估值的情形 …… 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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的； 6、中国证监会和基金合同认定的其它情形。
十八、基金的信息披露	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。 …… 五、公开披露的基金信息 …… 6、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 ……	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》、《流动性风险管理规定》、《基金合同》及其他有关规定。 …… 五、公开披露的基金信息 …… 6、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 ……

	7、临时报告 …… ~~27、~~中国证监会规定的其他事项。	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。 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基金定期报告“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。 7、临时报告 …… 27、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； 28、中国证监会规定的其他事项。

（二）《东方强化收益债券型证券投资基金托管协议》修改对照表

章节	原《托管协议》	修订后《托管协议》
一、基金托管协议当事人	（一）基金管理人 …… 注册资本：~~贰~~亿元人民币 ~~存续期限：50 年~~ 经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。 ……	（一）基金管理人 …… 注册资本：叁亿元人民币 营业期限：2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日 经营范围：基金募集；基金销售；资产管理；从事境外证券投资管理业务；中国证监会许可的其他业务。 ……
一、基金托管协议当事人	（二）基金托管人 …… 注册资金：~~450~~亿元人民币 ……	（二）基金托管人 …… 注册资金：810.31 亿元人民币 ……
二、基金托管协议的依据、目的和原则	（一）订立托管协议的依据 《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》）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 7 号〈托管协议的内容与格式〉》、《东方强化收益债券型证券投资基金基金合同》（以下简称基金合同）及其他有关规定订立。	（一）订立托管协议的依据 《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》）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 7 号〈托管协议的内容与格式〉》、《东方强化收益债券型证券投资基金基金合同》（以下简称基金合同）及其他有关规定订立。
三、基金	（一）基金托管人根据有关法律法规的规定及	（一）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合

托管人对基金管理人的业务监督和核查	基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。…… 本基金的投资组合比例为：现金、固定收益类资产占基金资产的比例为 80%-100%； 股票、权证等权益类资产占基金资产的比例为 0%-20%，其中持有的全部权证市值不超过基金资产净值的 3%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。 ……	同的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。…… 本基金的投资组合比例为：现金、固定收益类资产占基金资产的比例为 80%-100%； 股票、权证等权益类资产占基金资产的比例为 0%-20%，其中持有的全部权证市值不超过基金资产净值的 3%；现金或者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、应收申购款等。** ……
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资、融券比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： …… 6、本基金投资于固定收益类金融工具的资产占基金资产的比例不低于 80%，投资于股票、权证等权益类金融工具的资产占基金资产的比例不超过 20%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%； …… ~~15、~~法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制； 基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基	（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资、融券比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： …… 6、本基金投资于固定收益类金融工具的资产占基金资产的比例不低于 80%，投资于股票、权证等权益类金融工具的资产占基金资产的比例不超过 20%；现金或者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、应收申购款等；** …… **15、本基金管理人管理的且由本托管人托管的全部开放式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%；** **16、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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；** **17、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；** 18、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制； 基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 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 6 项中“现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%”及第 11、16、17 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本基金投资比例不符合上述各项规定的投资比例，基金

	金管理人之外的因素致使本基金投资比例不符合上述各项规定的投资比例，基金管理人应当在 10 个交易日内调整完毕，以符合上述比例限定。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。	管理人应当在 10 个交易日内调整完毕，以符合上述比例限定。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	（七）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资流通受限证券进行监督。 1、基金投资流通受限证券，应遵守~~《关于规范基金投资非公开发行证券行为的紧急通知》，~~《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。	（七）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资流通受限证券进行监督。 1、基金投资流通受限证券，应遵守《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。
八、基金资产净值计算和会计核算	（四）暂停估值与公告基金份额净值的情形 …… ~~5.~~中国证监会和基金合同认定的其他情形。	（四）暂停估值与公告基金份额净值的情形 …… **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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的；** 6. 中国证监会和基金合同认定的其他情形。

东方安心收益保本混合型证券投资基金

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》

修改法律文件的情况说明

（一）《东方安心收益保本混合型证券投资基金基金合同》修改对照表

章节	原《基金合同》	修订后《基金合同》
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》”）、《关于保本基金的指导意见》（以下简称“指导意见”）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》”）、《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》”）、《关于保本基金的指导意见》（以下简称“指导意见”）和其他有关法律法规。
第二部分 释义		…… 13、《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 …… 72、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 ……
第五部分 基金份额的申购与赎回	五、申购和赎回的数量限制	五、申购和赎回的数量限制 …… 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。

		……
第五部分 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 …… 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。不低于赎回费总额的 25%应归基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。 ……	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 …… 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。**对持续持有期少于 7 日的投资者收取不少于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产，其他情形下**不低于赎回费总额的 25%应归基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。 ……
第五部分 基金份额的申购与赎回	七、拒绝或暂停申购的情形 …… ~~7、~~法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、5、6、~~7~~项暂停申购情形之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。	七、拒绝或暂停申购的情形 …… **7、接受某一投资者申购申请后导致其持有基金份额达到或超过基金总份额 50%的。** **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。** **9、**法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、5、6、**8、9** 项暂停申购情形之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。
第五部分 基金份额的申购与赎回	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… ……	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… **6、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。** ……
第五部分 基金份额的申购与赎回	九、巨额赎回的情形及处理方式 …… 2、巨额赎回的处理方式 当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。 ……	九、巨额赎回的情形及处理方式 …… 2、巨额赎回的处理方式 当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。 …… **（3）在出现巨额赎回且单个基金份额持有人当日的**

	……	赎回申请超过前一开放日基金总份额 20%以上的情形时，对于该基金份额持有人当日申请赎回的超过前一开放日基金总份额 20%以上的基金份额，基金管理人有权全部自动进行延期办理；对于该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人可以根据前段“（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。但是，如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理部分的赎回申请将被撤销。 ……
第七部分 基金合同当事人及权利义务	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 …… 注册资本：~~贰~~亿元人民币 …… 二、基金托管人 （一）基金托管人简况 …… 注册资本：~~450~~亿元人民币 ……	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 …… 注册资本：叁亿元人民币 …… 二、基金托管人 （一）基金托管人简况 …… 注册资本：810.31 亿元人民币 ……
第十三部分基金的投资	二、投资范围 …… 基金的投资组合比例为： 本基金将主要根据 CPPI 固定比例投资组合保险策略……固定收益类资产占基金资产的比例不低于 60%，其中基金保留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，投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%。	二、投资范围 …… 基金的投资组合比例为： 本基金将主要根据 CPPI 固定比例投资组合保险策略……固定收益类资产占基金资产的比例不低于 60%，其中基金保留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，投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%。
第十三部分基金的投资	四、投资限制 1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： …… （2）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； ……	四、投资限制 1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： …… （2）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、应收申购款等； …… （16）本基金管理人管理的全部开放式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%； **（17）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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；** **（18）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；** （19）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 **除第（2）、（12）、（17）、（18）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。法律法规另有规定的，从其规定。 ……
	~~（16）~~法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 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。法律法规另有规定的，从其规定。 ……	
第十三部分基金的投资	七、转型后“东方成长回报平衡混合型证券投资基金”的投资目标、投资范围、投资理念、业绩比较基准、风险收益特征、投资策略 …… （二）投资范围 本基金各类资产的投资比例为： 股票、权证等权益类资产占基金资产的 40%-80%，其中，持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；债券、货币市场工具等固定收益类资产占基金资产的 20%-60%，其中，现金或到期日不超过 1 年的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。	七、转型后“东方成长回报平衡混合型证券投资基金”的投资目标、投资范围、投资理念、业绩比较基准、风险收益特征、投资策略 …… （二）投资范围 本基金各类资产的投资比例为： 股票、权证等权益类资产占基金资产的 40%-80%，其中，持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；债券、货币市场工具等固定收益类资产占基金资产的 20%-60%，其中，现金**（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）**或到期日不超过 1 年的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。
第十五部分基金资产估值	六、暂停估值的情形 ……	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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的；**
第十九部分基金的信息披露	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。	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》、**《流动性风险管理规定》**、《基金合同》及其他有关规定。

	…… 五、公开披露的基金信息 …… （六）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 …… （七）临时报告 ……	…… 五、公开披露的基金信息 …… （六）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 …… **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。** **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基金定期报告“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。** （七）临时报告 …… **26、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；**

（二）《东方安心收益保本混合型证券投资基金托管协议》修改对照表

章节	原《托管协议》	修订后《托管协议》
一、基金托管协议当事人	（一）基金管理人 名称：东方基金管理有限责任公司 …… 注册资本：~~贰~~亿元人民币 …… （二）基金托管人 …… 注册资金：~~450~~亿元人民币 ……	（一）基金管理人 名称：东方基金管理有限责任公司 …… 注册资本：**叁**亿元人民币 …… （二）基金托管人 …… 注册资金：**810.31** 亿元人民币 ……
二、基金托管协议的依据、目的和原则	（一）订立托管协议的依据 《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》）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 7 号〈托管协议的内容与格式〉》、《东方安心收益保	（一）订立托管协议的依据 《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》）、**《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》**、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 7 号〈托管协议的内容与格式〉》、

	本混合型证券投资基金基金合同》（以下简称基金合同）及其他有关规定订立。	《东方安心收益保本混合型证券投资基金基金合同》（以下简称基金合同）及其他有关规定订立。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	基金的投资组合比例为： 本基金将主要根据 CPPI 固定比例投资组合保险策略……固定收益类资产占基金资产的比例不低于 60%，其中基金保留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，投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%。	基金的投资组合比例为： 本基金将主要根据 CPPI 固定比例投资组合保险策略……固定收益类资产占基金资产的比例不低于 60%，其中基金保留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，投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： …… （2）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； …… ~~（16）~~法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 …… 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本基金投资比例不符合上述各项规定的投资比例，基金管理人应当在 10 个交易日内调整完毕，以符合上述比例限定，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。	（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： …… （2）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、应收申购款等**； …… **（16）本基金管理人管理的且由本托管人托管的全部开放式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%；** **（17）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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；** **（18）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；** **（19）**法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 …… 基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。**除第（2）、（12）、（17）、（18）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本基金投资比例不符合上述各项规定的投资比例，基金管理人应当在 10 个交易日内调整完毕，以符合上述比例限定，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。 ……

三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	（七）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资流通受限证券进行监督。 1、基金投资流通受限证券，应遵守~~《关于规范基金投资非公开发行证券行为的紧急通知》、~~《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。	（七）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资流通受限证券进行监督。 1、基金投资流通受限证券，应遵守《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。
八、基金资产净值计算和会计核算	6、暂停估值的情形 ……	6、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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的；** ……

东方多策略灵活配置混合型证券投资基金

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》

修改法律文件的情况说明

（一）《东方多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》修改对照表

章节	原《基金合同》	修订后《基金合同》
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。	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》”）、**《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》”）**和其他有关法律法规。
第二部分 释义		…… 13、《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 …… 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 基金份额的申购与赎回	五、申购和赎回的数量限制	五、申购和赎回的数量限制 …… 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。具体规定请参见相关公告。 ……

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 …… 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。 ……	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 …… 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于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日的投资者收取不低于1.5%的赎回费并全额计入基金财产。** ……
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 …… ~~6、~~法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第1、2、3、5、~~6~~项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，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。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。	七、拒绝或暂停申购的情形 …… **6、接受某一投资者申购申请后导致其持有基金份额达到或超过基金总份额50%的。** **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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。** 8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第1、2、3、5、**7、8**项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，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。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 基金份额的申购与赎回	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… ……	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… **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，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。** ……
第六部分 基金份额的申购与赎回	九、巨额赎回的情形及处理方式 …… 2、巨额赎回的处理方式 当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。 ……	九、巨额赎回的情形及处理方式 …… 2、巨额赎回的处理方式 当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。 …… **（3）在出现巨额赎回且单个基金份额持有人当日的赎回申请超过前一开放日基金总份额20%以上的情形**

	……	**时，对于该基金份额持有人当日申请赎回的超过前一开放日基金总份额 20%以上的基金份额，基金管理人有权全部自动进行延期办理；对于该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人可以根据前段“（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。但是，如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理部分的赎回申请将被撤销。** ……
第七部分 基金合同当事人及权利义务	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 …… 注册资本：~~贰亿~~元人民币 ~~存续期限：五十年~~ …… 二、基金托管人 （一）基金托管人简况 …… 法定代表人：~~姜建清~~ …… 注册资本：人民币 ~~349,018,545,827~~ 元 ……	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 …… 注册资本：**叁亿**元人民币 **营业期限：2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日** …… 二、基金托管人 （一）基金托管人简况 …… 法定代表人：**易会满** …… 注册资本：人民币 **35,640,625.71 万**元 ……
第十二部分基金的投资	二、投资范围 …… 基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%-95%，投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%；本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过本基金资产净值的 10%；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，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%。 ……	二、投资范围 …… 基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%-95%，投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%；本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过本基金资产净值的 10%；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，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、应收申购款等。** ……
第十二部分基金的投资	四、投资限制 …… （2）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，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； ……	四、投资限制 …… （2）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，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、应收申购款等；** ……

	~~（17）~~法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 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。法律法规另有规定的，从其规定。 ……	（17）本基金管理人管理的全部开放式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%； （18）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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资； （19）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； （20）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 除第（2）、（12）、（18）、（19）项外，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。法律法规另有规定的，从其规定。
第十四部分基金资产估值	六、暂停估值的情形 ……	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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的； ……
第十八部分基金的信息披露	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。 …… 五、公开披露的基金信息 …… （六）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 ……	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》、《流动性风险管理规定》、《基金合同》及其他有关规定。 …… 五、公开披露的基金信息 …… （六）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 …… 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

	（七）临时报告 …… ~~27、~~中国证监会规定的其他事项。	等。 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基金定期报告“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。 （七）临时报告 …… 27、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； 28、中国证监会规定的其他事项。

（二）《东方多策略灵活配置混合型证券投资基金托管协议》修改对照表

章节	原《托管协议》	修订后《托管协议》
一、基金托管协议当事人	（一）基金管理人 名称：东方基金管理有限责任公司 …… 注册资本：~~贰亿元~~人民币 经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务 ~~存续期间：50 年~~	（一）基金管理人 名称：东方基金管理有限责任公司 …… 注册资本：叁亿元人民币 经营范围：基金募集；基金销售；资产管理；从事境外证券投资管理业务；中国证监会许可的其他业务 营业期限：2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日
一、基金托管协议当事人	（二）基金托管人 …… 法定代表人：~~姜建清~~ …… 注册资本：人民币 ~~349,018,545,827~~ 元	（二）基金托管人 …… 法定代表人：易会满 …… 注册资本：人民币 35,640,625.71 万元
二、基金托管协议的依据、目的和原则	（一）订立托管协议的依据 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》）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 7 号〈托管协议的内容与格式〉》、《东方多策略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。	（一）订立托管协议的依据 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》）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 7 号〈托管协议的内容与格式〉》、《东方多策略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	（一）基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权	（一）基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

基金管理人的业务监督和核查	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的比例为 0%-95%，投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%；本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过本基金资产净值的 10%；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，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%。 （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制： …… b）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，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； …… 由于证券、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之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例，不在限制之内，但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，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。	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的比例为 0%-95%，投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%；本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过本基金资产净值的 10%；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，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、应收申购款等。** （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制： …… b)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，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、应收申购款等**； …… **q)本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部开放式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%；** **r)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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；** **s)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。。** …… **除第 b)、l)、r)、s）项外**，由于证券、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之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例，不在限制之内，但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，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。

	……	对于因法律法规变化导致本基金投资范围及投资限制调整的，基金管理人应提前通知基金托管人，经基金托管人书面同意后方可纳入投资监督范围。基金管理人知晓基金托管人投资监督职责的履行受外部数据来源或系统开发等因素影响，基金管理人应为托管人系统调整预留所需的合理必要时间。 ……

东方主题精选混合型证券投资基金

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》

修改法律文件的情况说明

（一）《东方主题精选混合型证券投资基金基金合同》修改对照表

章节	原《基金合同》	修订后《基金合同》
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》”）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》”）、《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》”）和其他有关法律法规。
第二部分 释义		…… 13、《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 …… 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 基金份额的申购与赎回	五、申购和赎回的数量限制	五、申购和赎回的数量限制 …… 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 基金份额的申购与赎回	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 …… 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。 ……	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 …… 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于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日的投资者收取不低于1.5%的赎回费并全额计入基金财产**。 ……
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 …… 5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或出现其他损害现有基金份额持有人利益的情形。 ~~6、~~法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第1、2、3、5、~~6~~项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，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。	七、拒绝或暂停申购的情形 …… 5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或出现其他损害现有基金份额持有人利益的情形。 **6、接受某一投资者申购申请后导致其持有基金份额达到或超过基金总份额50%的。** **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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。** 8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第1、2、3、5、**7、8**项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，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。
第六部分 基金份额的申购与赎回	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… ……	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… **6、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。** ……
第六部分 基金份额的申购与赎回	九、巨额赎回的情形及处理方式 …… 2、巨额赎回的处理方式 当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延	九、巨额赎回的情形及处理方式 …… 2、巨额赎回的处理方式 当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。

	期赎回。 …… …… ……	…… **（3）在出现巨额赎回且单个基金份额持有人当日的赎回申请超过上一开放日基金总份额 20%以上的情形时，对于该基金份额持有人当日申请赎回的超过上一开放日基金总份额 20%以上的基金份额，基金管理人有权全部自动进行延期办理；对于该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人可以根据前段“（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。但是，如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理部分的赎回申请将被撤销。** ……
第七部分 基金合同当事人及权利义务	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 …… 注册资本：~~贰~~亿元人民币 ~~存续期限：50 年~~ …… 二、基金托管人 （一）基金托管人简况 …… 法定代表人：~~姜建清~~ 注册资本：~~349,018,545,827 元人民币~~	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 …… 注册资本：**叁**亿元人民币 **营业期限：2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日** …… 二、基金托管人 （一）基金托管人简况 …… 法定代表人：**易会满** 注册资本：**人民币 35,640,625.71 万元**
第十二部分基金的投资	二、投资范围 …… 基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 40%-95%，其中， 投资于本基金定义的主题行业股票的资产不低于非现金基金资产的 80%，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例按照法律法规或监管机构的规定执行；本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过本基金资产净值的 10%；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，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%。	二、投资范围 …… 基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 40%-95%，其中， 投资于本基金定义的主题行业股票的资产不低于非现金基金资产的 80%，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例按照法律法规或监管机构的规定执行；本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过本基金资产净值的 10%；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，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、应收申购款等**。
第十二部分基金的投资	四、投资限制 1、组合限制 …… （2）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，保持不低于基金资产	四、投资限制 1、组合限制 …… （2）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，保持不低于基金资产净值 5%的现

	净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券； ……

	……	……
	（七）临时报告 ……	**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。** **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基金定期报告“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。** （七）临时报告 …… **26、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；**

（二）《东方主题精选混合型证券投资基金托管协议》修改对照表

章节	原《托管协议》	修订后《托管协议》
一、基金托管协议当事人	（一）基金管理人 名称：东方基金管理有限责任公司 …… 注册资本：~~贰~~亿元人民币 经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务 ~~存续期限：50 年~~ …… （二）基金托管人 法定代表人：~~姜建清~~ 注册资本：人民币 ~~349,018,545,827~~元	（一）基金管理人 名称：东方基金管理有限责任公司 …… 注册资本：**叁**亿元人民币 经营范围：基金募集；基金销售；资产管理；**从事境外证券投资管理业务；**中国证监会许可的其他业务 **营业期限：2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日** …… （二）基金托管人 法定代表人：**易会满** 注册资本：人民币 **35,640,625.71 万**元
二、基金托管协议的依据、目的和原则	（一）订立托管协议的依据 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》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 7 号〈托管协议的内容与格式〉》、《东方主题精选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。	（一）订立托管协议的依据 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》”）、**《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》、**《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 7 号〈托管协议的内容与格式〉》、《东方主题精选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人的业务监督和核查	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的比例为 40%-95%，其中，投资于本基金定义的主题行业股票的资产不低于非现金基金资产的 80%，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例按照法律法规或监管机构的规定执行；本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过本基金资产净值的 10%；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，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%。 （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制： …… b)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，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； …… （3）法规允许的基金投资比例调整期限 由于证券、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之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例，不在限制之内，但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，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。法律法规	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的比例为 40%-95%，其中，投资于本基金定义的主题行业股票的资产不低于非现金基金资产的 80%，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例按照法律法规或监管机构的规定执行；本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过本基金资产净值的 10%；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，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、应收申购款等**。 （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制： …… b)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，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、应收申购款等**； …… **r）本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部开放式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%；** **s）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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前款所规定比例限制的，本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。** …… （3）法规允许的基金投资比例调整期限 **除第 b)、l)、s)、t）项外，**由于证券、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之外的原因导致的投资组合不

	另有规定的从其规定。 ……	符合上述约定的比例，不在限制之内，但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，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。法律法规另有规定的从其规定。 **对于因法律法规变化导致本基金投资范围及投资限制调整的，基金管理人应提前通知基金托管人，经基金托管人书面同意后方可纳入投资监督范围。基金管理人知晓基金托管人投资监督职责的履行受外部数据来源或系统开发等因素影响，基金管理人应为托管人系统调整预留所需的合理必要时间。** ……

东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》

修改法律文件的情况说明

（一）《东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金基金合同》修改对照表

章节	原《基金合同》	修订后《基金合同》
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》”）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》”）、**《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》”）**和其他有关法律法规。
第二部分 释义		…… 13、《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 …… 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 基金份额的申购与赎回	五、申购和赎回的数量限制	五、申购和赎回的数量限制 …… 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。具体规定请参见相关公告。 ……

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 …… 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。 ……	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 …… 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于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 日的投资者收取不低于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产。** ……
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 …… ~~6、~~法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、5、~~6~~项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，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。	七、拒绝或暂停申购的情形 …… **6、接受某一投资者申购申请后导致其持有基金份额达到或超过基金总份额 50%的。** **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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。** 8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、5、**7、8** 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，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。
第六部分 基金份额的申购与赎回	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… ……	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… **6、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。** ……
第六部分 基金份额的申购与赎回	九、巨额赎回的情形及处理方式 …… 2、巨额赎回的处理方式 当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。	九、巨额赎回的情形及处理方式 …… 2、巨额赎回的处理方式 当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。 ……

	…… ……

		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%； （18）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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资； （19）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； ……
	~~（17）~~法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 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，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。	（20）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 除第（2）、（12）、（18）、（19）项外，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，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	六、暂停估值的情形 …… ~~3、~~中国证监会和基金合同认定的其它情形。	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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的； 4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。
第十八部分基金的信息披露	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。 …… 五、公开披露的基金信息 …… （六）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 ……	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》、《流动性风险管理规定》、《基金合同》及其他有关规定。 …… 五、公开披露的基金信息 …… （六）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 …… 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。 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基金定期报告“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

	（七）临时报告 …… ~~27、~~中国证监会规定的其他事项。	**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。** （七）临时报告 …… **27、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；** 28、中国证监会规定的其他事项。

（二）《东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金托管协议》修改对照表

章节	原《托管协议》	修订后《托管协议》
一、基金托管协议当事人	（一）基金管理人 名称：东方基金管理有限责任公司 …… 注册资本：~~贰~~亿元人民币 ~~存续期间：50 年~~ 经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务	（一）基金管理人 名称：东方基金管理有限责任公司 …… 注册资本：**叁**亿元人民币 **营业期限：2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日** 经营范围：基金募集；基金销售；资产管理；**从事境外证券投资管理业务**；中国证监会许可的其他业务
一、基金托管协议当事人	（二）基金托管人 …… 法定代表人：~~姜建清~~ …… 注册资本：人民币 ~~349,018,545,827~~ 元	（二）基金托管人 …… 法定代表人：**易会满** …… 注册资本：人民币 **35,640,625.71 万**元
二、基金托管协议的依据、目的和原则	（一）订立托管协议的依据 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》）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 7 号〈托管协议的内容与格式〉》、《东方鼎新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。	（一）订立托管协议的依据 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》）、**《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》**、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 7 号〈托管协议的内容与格式〉》、《东方鼎新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人的业务监督和核	（一）基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权 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：	（一）基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权 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

查	（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的比例为 0%-95%，投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%；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%。 （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制： …… b)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； …… …… （3）法规允许的基金投资比例调整期限 由于证券市场波动、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原因导致的投资组合不符合上述约定的比例，不在限制之内，但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，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。法律法规另有规定的从其规定。	基金的投资资产配置比例为： 股票资产占基金资产的比例为 0%-95%，投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%；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、应收申购款等。** （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制： …… b）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、应收申购款等**; …… **q）本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部开放式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%；** **r）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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；** **s）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。** …… （3）法规允许的基金投资比例调整期限 **除第 b）、l）、r）、s）项外**，由于证券市场波动、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原因导致的投资组合不符合上述约定的比例，不在限制之内，但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，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。法律法规另有规定的从其规定。 **对于因法律法规变化导致本基金投资范围及投资限制调整的，基金管理人应提前通知基金托管人，经基金托管人书面同意后方可纳入投资监督范围。基金管理人知晓基金托管人投资监督职责的履行受外部数据来源或系统**

	……	开发等因素影响，基金管理人应为托管人系统调整预留所需的合理必要时间。 ……

东方区域发展混合型证券投资基金

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》

修改法律文件的情况说明

（一）《东方区域发展混合型证券投资基金基金合同》修改对照表

章节	原《基金合同》	修订后《基金合同》
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》”）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》”）、《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》”）和其他有关法律法规。
第二部分 释义		…… 13、《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 …… 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 基金份额的申购与赎回	五、申购和赎回的数量限制	五、申购和赎回的数量限制 …… 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。具体规定请参见相关公告。 ……

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 …… 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。 ……	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 …… 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于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 日的投资者收取不低于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产**。 ……
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人的申购申请： …… ~~6、~~法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、5~~、6~~项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，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。	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人的申购申请： …… 6、**接受某一投资者申购申请后导致其持有基金份额达到或超过基金总份额 50%的。** **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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。** 8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、5、**7、8** 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，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。
第六部分 基金份额的申购与赎回	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 ……	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… **6、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。** ……
第六部分 基金份额的申购与赎回	九、巨额赎回的情形及处理方式 …… 2、巨额赎回的处理方式 当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根	九、巨额赎回的情形及处理方式 …… 2、巨额赎回的处理方式 当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当

	据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。 …… ……	时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。 …… **（3）在出现巨额赎回且单个基金份额持有人当日的赎回申请超过上一开放日基金总份额 20%以上的情形时，对于该基金份额持有人当日申请赎回的超过上一开放日基金总份额 20%以上的基金份额，基金管理人有权全部自动进行延期办理；对于该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人可以根据前段“（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。但是，如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理部分的赎回申请将被撤销。** ……
第七部分 基金合同当事人及权利义务	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 …… 注册资本：~~贰~~亿元人民币 ~~存续期限：50 年~~ ……	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 …… 注册资本：**叁**亿元人民币 **营业期限：2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日** ……
第七部分 基金合同当事人及权利义务	二、基金托管人 （一）基金托管人简况 …… 法定代表人~~：姜建清~~ …… 注册资本：人民币 ~~349,018,545,827~~元 ……	二、基金托管人 （一）基金托管人简况 …… 法定代表人**：易会满** …… 注册资本：人民币 **35,640,625.71 万**元 ……
第十二部分基金的投资	二、投资范围 …… 基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 30%-95%；投资于受益于国家区域发展战略的地区及相关行业的上市公司的股票占非现金基金资产的比例不低于 80%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。 ……	二、投资范围 …… 基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 30%-95%；投资于受益于国家区域发展战略的地区及相关行业的上市公司的股票占非现金基金资产的比例不低于 80%；现金或者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、应收申购款等。** ……
第十二部分基金的投资	四、投资限制 …… （2）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； ……	四、投资限制 …… （2）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、应收申购款等**； ……

	……	……
		（16）本基金管理人管理的全部开放式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%；
		（17）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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；
		（18）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；
	……	
	~~（16）~~法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。	（19）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。
	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，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。	除第（2）、（12）、（17）、（18）项外，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，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	六、暂停估值的情形 ……	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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的；
	~~3、~~中国证监会和基金合同认定的其它情形。	4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。
第十八部分基金的信息披露	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。相关法律法规关于信息披露的披露方式、登载媒介、报备方式等规定发生变化时，本基金从其最新规定。	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》、《流动性风险管理规定》、《基金合同》及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的披露方式、登载媒介、报备方式等规定发生变化时，本基金从其最新规定。
	……	……
	五、公开披露的基金信息	五、公开披露的基金信息
	……	……
	（六）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	（六）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
	……	

	（五）临时报告 …… ~~26、~~中国证监会规定的其他事项。	…… 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。 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基金定期报告“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。 （五）临时报告 …… 26、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； 27、中国证监会规定的其他事项。

（二）《东方区域发展混合型证券投资基金托管协议》修改对照表

章节	原《托管协议》	修订后《托管协议》
一、基金托管协议当事人	（一）基金管理人 …… 注册资本：~~贰~~亿元人民币 ~~存续期限：50 年~~ 经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。 ……	（一）基金管理人 …… 注册资本：叁亿元人民币 营业期限：2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日 经营范围：基金募集；基金销售；资产管理；从事境外证券投资管理业务；中国证监会许可的其他业务。 ……
一、基金托管协议当事人	二、基金托管人 …… 法定代表人：~~姜建清~~ …… 注册资本：人民币 ~~349,018,545,827~~元 ……	二、基金托管人 …… 法定代表人：易会满 …… 注册资本：人民币 35,640,625.71 万元 ……
二、基金托管协议的依据、目的和原则	订立本协议的依据是《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》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 7 号〈托管协议的内容与格式〉》、《东方区域发展混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）	订立本协议的依据是《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》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 7 号〈托管协议的内容与格式〉》、《东方区域发展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

	及其他有关规定。	定。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	（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，对基金投资范围、投资对象进行监督。 …… 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的比例为 30%-95%;现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。 …… （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制： …… b)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； …… （3）法规允许的基金投资比例调整期限 由于证券市场波动、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	（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，对基金投资范围、投资对象进行监督。 …… 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的比例为 30%-95%；现金或者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、应收申购款等。** …… （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制： …… b）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、应收申购款等；** …… **p）本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部开放式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%；** **q）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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；** **r）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。** …… （3）法规允许的基金投资比例调整期限 **除第 b)、l)、q)、r）项外，**由于证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等

	之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例，基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，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。法律法规另有规定的从其规定。 …… ……	基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例，基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，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。法律法规另有规定的从其规定。 **对于因法律法规变化导致本基金投资范围及投资限制调整的，基金管理人应提前通知基金托管人，经基金托管人书面同意后方可纳入投资监督范围。基金管理人知晓基金托管人投资监督职责的履行受外部数据来源或系统开发等因素影响，基金管理人应为托管人系统调整预留所需的合理必要时间。** ……

东方新策略灵活配置混合型证券投资基金

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》

修改法律文件的情况说明

（一）《东方新策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》修改对照表

章节	原《基金合同》	修订后《基金合同》
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》”）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》”）、**《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》”）**和其他有关法律法规。
第二部分 释义		…… 13、《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 …… 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 基金份额的申购与赎回	五、申购和赎回的数量限制	五、申购和赎回的数量限制 …… 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。具体规定请参见相关公告。 ……
第六部分	六、申购和赎回的价格、费用及其用途	六、申购和赎回的价格、费用及其用途

基金份额的申购与赎回	…… 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。 ……	…… 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于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 日的投资者收取不低于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产。** ……
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人的申购申请： …… ~~6、~~法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、5、~~6、~~项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，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。	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人的申购申请： …… 6、**接受某一投资者申购申请后导致其持有基金份额达到或超过基金总份额 50%的。** **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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。** 8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、5、**7、8** 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，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。
第六部分 基金份额的申购与赎回	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… ……	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… **6、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。** ……
第六部分 基金份额的申购与赎回	九、巨额赎回的情形及处理方式 …… 2、巨额赎回的处理方式 当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分	九、巨额赎回的情形及处理方式 …… 2、巨额赎回的处理方式 当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。

	延期赎回。 …… …… ……	…… **（3）在出现巨额赎回且单个基金份额持有人当日的赎回申请超过上一开放日基金总份额 20%以上的情形时，对于该基金份额持有人当日申请赎回的超过上一开放日基金总份额 20%以上的基金份额，基金管理人有权全部自动进行延期办理；对于该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人可以根据前段“（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。但是，如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理部分的赎回申请将被撤销。** ……
第七部分 基金合同当事人及权利义务	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 …… 注册资本：~~贰~~亿元人民币 ~~存续期限：50 年~~ ……	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 …… 注册资本：**叁**亿元人民币 **营业期限：2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日** ……
第七部分 基金合同当事人及权利义务	二、基金托管人 （一）基金托管人简况 名称：中国光大银行股份有限公司 住所：北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心 …… 注册资本：~~404.3479~~ 亿元人民币 ……	二、基金托管人 （一）基金托管人简况 名称：中国光大银行股份有限公司 住所：北京市西城区太平桥大街 25 号、**甲 25 号**中国光大中心 …… 注册资本：**466.79095** 亿元人民币 ……
第十二部分基金的投资	二、投资范围 …… 基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%-95%，投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%；本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过本基金资产净值的 10%；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，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%。 ……	二、投资范围 …… 基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%-95%，投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%；本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过本基金资产净值的 10%；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，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、应收申购款等。** ……
第十二部分基金的投资	四、投资限制 1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： （1）本基金股票投资占基金资产的比例为	四、投资限制 1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： （1）本基金股票投资占基金资产的比例为 0%—95%；

	0%—95%； （2）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，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； …… ~~（18）~~法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 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。	（2）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，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、应收申购款等；** …… **（18）本基金管理人管理的全部开放式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）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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，本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；** **（21）**法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 **除第（2）、（12）、（19）、（20）项外，**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。
第十四部分基金资产估值	六、暂停估值的情形 …… **3、**中国证监会和基金合同认定的其它情形。	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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的；** **4、**中国证监会和基金合同认定的其它情形。
第十八部分基金的信息披露	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。 …… 五、公开披露的基金信息 …… （六）基金定期报告，包括基金年度报告、	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》、**《流动性风险管理规定》、**《基金合同》及其他有关规定。 …… 五、公开披露的基金信息 …… （六）基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年

	基金半年度报告和基金季度报告 …… （七）临时报告 …… ~~27、~~中国证监会规定的其他事项。	度报告和基金季度报告 …… **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。** **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基金定期报告“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。** （七）临时报告 …… **27、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；** **28、**中国证监会规定的其他事项。

（二）《东方新策略灵活配置混合型证券投资基金托管协议》修改对照表

章节	原《托管协议》	修订后《托管协议》
一、基金托管协议当事人	（一）基金管理人 名称：东方基金管理有限责任公司 …… 注册资本：~~贰~~亿元人民币 ~~存续期限：50 年~~ ……	（一）基金管理人 名称：东方基金管理有限责任公司 …… 注册资本：**叁**亿元人民币 **营业期限：2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日** ……
一、基金托管协议当事人	（二）基金托管人 名称：中国光大银行股份有限公司 住所：北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心 …… 注册资本：~~404.3479~~ 亿元人民币 …… ~~联系人：林迈~~	（二）基金托管人 名称：中国光大银行股份有限公司 住所：北京市西城区太平桥大街 25 号**、甲 25 号**中国光大中心 …… 注册资本：**466.79095** 亿元人民币 ……
二、基金托管协议的依据、目的、原则和解释	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国合同法》、《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》（以下称“《运作办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下称“《信息披露办法》”）、等有关法律法规、《东方新策略灵活配置混合型证券投	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国合同法》、《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》（以下称“《运作办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下称“《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》**等有关法律法规、《东方新策略灵活配置混

	资基金基金合同》（以下称“基金合同”）及其他有关规定制订。	合型证券投资基金基金合同》（以下称“基金合同”）及其他有关规定制订。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	（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，对基金投资范围、投资比例进行监督。 …… 基金的投资组合比例为：股票资产比例为基金资产的 0%～95%，投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%；本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过本基金资产净值的 10%；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，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%。	（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，对基金投资范围、投资比例进行监督。 …… 基金的投资组合比例为：股票资产比例为基金资产的 0%～95%，投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%；本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过本基金资产净值的 10%；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，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、应收申购款等**。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： …… b、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，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%； …… ~~r、~~法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 ……	（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： …… b、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，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、应收申购款等；** …… r、**本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部开放式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%；** **s、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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，本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；** u、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 …… **除第 b、l、s、t 项外**，因证券、期货市场波动、上

	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。	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，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。
八、基金资产净值计算和会计核算	（四）暂停估值的情形 …… ~~3.~~中国证监会和基金合同认定的其他情形。	（四）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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的；** **4.**中国证监会和基金合同认定的其他情形。

东方龙混合型开放式证券投资基金

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》

修改法律文件的情况说明

（一）《东方龙混合型开放式证券投资基金基金合同》修改对照表

章节	原《基金合同》	修订后《基金合同》
一、前言	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）和中国证监会的有关规定；	2、订立本基金合同的依据是《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》”）和中国证监会的有关规定；
二、释义		…… 《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 …… 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 ……
四、基金合同当事人及权利义务	（一）基金管理人 名称：东方基金管理有限责任公司 ~~注册地址：北京市西城区金融大街 28 号盈泰商务中心 2 号楼 16 层~~ 办公地址：~~北京市西城区金融大街 28 号盈泰商务中心 2 号楼 16 层~~ 邮政编码：~~100032~~ 法定代表人：~~李维雄~~ 注册资本：~~1 亿~~元人民币 …… 营业期限：~~50 年~~ 经营范围：基金募集；基金销售；资产管理；中国证监会许可的其他业务	（一）基金管理人 名称：东方基金管理有限责任公司 住所：北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层 办公地址：北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层 邮政编码：100033 法定代表人：崔伟 …… 注册资本：叁亿元人民币 营业期限：2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日 …… 经营范围：基金募集；基金销售；资产管理；从事境外证券投资管理业务；中国证监会许可的其他业务

四、基金合同当事人及权利义务	（三）基金托管人 基金托管人名称：中国建设银行 ~~注册地址：~~北京市西城区金融大街 25 号 …… 邮政编码：~~100032~~ 法定代表人：~~郭树清~~ 注册资本：~~851 亿元~~人民币 成立时间：~~1954 年 10 月 1 日~~ …… 组织形式：~~国有独资~~ ~~营业期限~~：持续经营 ~~经营范围：吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外币兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；外汇信用卡的发行；代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；经中国人民银行批准的委托代理业务及其他业务（包括工程造价咨询业务）~~	（三）基金托管人 名称：中国建设银行**股份有限公司（简称：中国建设银行）** **住所：**北京市西城区金融大街 25 号 …… 邮政编码：**100033** 法定代表人：**田国立** 成立日期：**2004 年 09 月 17 日** …… 组织形式：**股份有限公司** 注册资本：**贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整** **存续期间**：持续经营 **经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务。**
九、基金份额的申购与赎回	五、申购和赎回的数额	五、申购和赎回的数额 …… **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。具体规定请参见相关公告。** ……
九、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 …… 本基金的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，赎回费用的 75%用于注册登记费及相关手续费，25%归基金财产。本基金管理人认为需要调整申购费率或赎回费率时，如果属于提高申购费率、赎回费率且超过本基金合同规定最高限额的，必须召	（六）申购和赎回的价格、费用及其用途 …… 本基金的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，**其中对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产，其他情形下**赎回费用的 75%用于注册登记费及相关手续费，25%归基金财产。本基金管理人认为需要调整申购费率或赎

	开基金份额持有人大会；其他情况，本基金管理人可在报中国证监会备案后予以调整。本基金管理人必须于新的申购费率、赎回费率开始实施前的 3 个工作日内在至少一种中国证监会指定的媒体上刊登公告。 ……	回费率时，如果属于提高申购费率、赎回费率且超过本基金合同规定最高限额的，必须召开基金份额持有人大会；其他情况，本基金管理人可在报中国证监会备案后予以调整。本基金管理人必须于新的申购费率、赎回费率开始实施前的 3 个工作日内在至少一种中国证监会指定的媒体上刊登公告。 ……
九、基金份额的申购与赎回	（七）拒绝或暂停申购与赎回的情况 1、拒绝或暂停申购的条件 …… ~~（6）~~本基金管理人认为会影响其他基金份额持有人利益的申购申请。 上述（1）到（5）、~~（7）~~项为暂停申购情形，发生时本基金管理人立即在指定媒体上刊登暂停公告； 上述（6）、~~（8）~~项为拒绝申购情形，发生时申购款项将全额退还基金投资者。	（七）拒绝或暂停申购与赎回的情况 1、拒绝或暂停申购的条件 …… **（6）接受某一投资者申购申请后导致其持有基金份额达到或超过基金总份额 50%的；** **（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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施；** （8）本基金管理人认为会影响其他基金份额持有人利益的申购申请。 上述（1）到（5）、（7）项为暂停申购情形，发生时本基金管理人立即在指定媒体上刊登暂停公告； 上述（6）、（8）项为拒绝申购情形，发生时申购款项将全额退还基金投资者。
九、基金份额的申购与赎回	（七）拒绝或暂停申购与赎回的情况 2.暂停赎回的条件 …… ~~（4）~~法律法规规定或经中国证监会批准的其他情形。第（1）项规定的情形消失后，本基金管理人应当及时支付赎回款项。 ……	（七）拒绝或暂停申购与赎回的情况 2.暂停赎回的条件 …… **（4）、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。** （5）法律法规规定或经中国证监会批准的其他情形。第（1）项规定的情形消失后，本基金管理人应当及时支付赎回款项。 ……
九、基金份额的申购与赎回	（八）巨额赎回的情形及处理方式 …… 2、巨额赎回的处理方式 ……	（八）巨额赎回的情形及处理方式 …… 2、巨额赎回的处理方式 …… **（2）尽管有上述约定，在出现巨额赎回且单个基**

	……	金份额持有人当日的赎回申请超过上一开放日基金总份额 20%以上的情形时，对于该基金份额持有人当日申请赎回的超过上一开放日基金总份额 20%以上的基金份额，基金管理人有权全部自动进行延期办理；对于该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人可以根据上文第（1）项的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。但是，如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理部分的赎回申请将被撤销。 ……
十五、基金的投资	（五）投资限制 …… 2、本基金投资组合比例限制 …… ~~（5）~~法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。 基金的投资组合应在基金合同生效之日起 6 个月内达到规定的标准，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上述规定的比例或者基金合同约定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。	（五）投资限制 …… 2、本基金投资组合比例限制 …… （5）本基金管理人管理的全部开放式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%； （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 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资； （7）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； （8）法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。 基金的投资组合应在基金合同生效之日起 6 个月内达到规定的标准。除第（6）、（7）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上述规定的比例或者基金合同约定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。
十七、基金资产的估值	（六）暂停估值的情形 ……	（六）暂停估值的情形 …… 4、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出

	~~4、~~中国证监会和基金合同认定的其它情形。	**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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的；** **5、**中国证监会和基金合同认定的其它情形。
二十一、基金的信息披露	（一）本基金的信息披露应符合《基金法》、现时有效的法律法规、本基金合同及其他有关规定； …… （二）公开披露的基金信息包括： …… 8、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； …… 9、临时报告； ……	（一）本基金的信息披露应符合《基金法》、**《流动性风险管理规定》、**现时有效的法律法规、本基金合同及其他有关规定； …… （二）公开披露的基金信息包括： …… 8、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； …… **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；** **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基金定期报告“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。** 9、临时报告； …… **（26）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；** ……

（二）《东方龙混合型开放式证券投资基金托管协议》修改对照表

章节	原《托管协议》	修订后《托管协议》
一、托管协议当事人	1、基金管理人 名称：东方基金管理有限责任公司 ~~注册地址：西城区金融大街 28 号盈泰商务中心 2 号楼 16 层~~ 办公地址：~~西城区金融大街 28 号盈泰商务中心 2 号楼 16 层~~ 邮政编码：~~100032~~ 法定代表人：~~李维雄~~ 注册资本：~~1 亿元~~人民币	1、基金管理人 名称：东方基金管理有限责任公司 住所：**北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层** 办公地址：**北京市西城区锦什坊街**28 号 1-4 **层** 邮政编码：**100033** 法定代表人：**崔伟** …… 注册资本：**叁亿元**人民币

	…… 营业期限：~~50 年~~ 经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务	营业期限：2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日 经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、从事境外证券投资管理业务和中国证监会许可的其他业务。
一、托管协议当事人	2、基金托管人 ~~基金托管人名称：~~中国建设银行 ~~注册地址：~~北京市西城区金融大街 25 号 …… 邮政编码：~~100032~~ 法定代表人：~~郭树清~~ 注册资本：~~851 亿元人民币~~ 成立时间：~~1954 年 10 月 1 日~~ …… 组织形式：~~国有独资~~ ~~营业期限：~~持续经营 ~~经营范围：吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；外汇存款；经中国人民银行批准的委托代理业务及其他业务（包括工程造价咨询业务）~~	2、基金托管人 名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行) 住所：北京市西城区金融大街 25 号 …… 邮政编码：100033 法定代表人：田国立 成立日期：2004 年 09 月 17 日 …… 组织形式：股份有限公司 注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整 存续期间：持续经营 经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务。
二、托管协议的依据、目的和原则	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）等有关法律、法规（以下简称“法律法规”）、基金合同及其他有关规定制订。	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法律、法规（以下简称“法律法规”）、基金合同及其他有关规定制订。
九、投资组合比例监控	…… （二）本基金与本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%； …… ~~（五）~~法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。	…… （二）本基金与本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的其他基金持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%； …… （五）本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部开放式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

	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本基金投资不符合上述规定的比例或者基金合同约定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。 ……	的 30%； （六）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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资； （七）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； （八）法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。 除第（六）、（七）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本基金投资不符合上述规定的比例或者基金合同约定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。 ……
十二、基金的信息披露	4.暂停公告净值的情形 ……	4.暂停公告净值的情形 …… （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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的； ……

东方策略成长混合型开放式证券投资基金

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》

修改法律文件的情况说明

（一）《东方策略成长混合型开放式证券投资基金基金合同》修改对照表

章节	原《基金合同》	修订后《基金合同》
一、前言	2.订立本基金合同的依据是《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。	2.订立本基金合同的依据是《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》”）、《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》”）和其他有关法律法规。
二、释义		…… 13、《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 …… 57、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 ……
六、基金份额的申购与赎回	（五）申购和赎回的金额	（五）申购和赎回的金额 …… 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。 ……
六、基金	六、申购和赎回的价格、费用及其用途	六、申购和赎回的价格、费用及其用途

份额的申购与赎回	…… 8.赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，赎回费总额的25%归基金财产，75%用于支付注册登记费和其他必要的手续费。 ……	…… 8.赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，**其中对持续持有期少于 7 日的投资者收取不少于1.5%的赎回费并全额计入基金财产，其他情形下**赎回费总额的25%归基金财产，75%用于支付注册登记费和其他必要的手续费。 ……
六、基金份额的申购与赎回	（七）拒绝或暂停申购的情形 ……	（七）拒绝或暂停申购的情形 …… **6.接受某一投资者申购申请后导致其持有基金份额达到或超过基金总份额50%的。** **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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。**
六、基金份额的申购与赎回	(八)暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… ……	(八)暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… **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，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。** ……
六、基金份额的申购与赎回	九、巨额赎回的情形及处理方式 …… 2.巨额赎回的处理方式 当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分顺延赎回。 …… ……	九、巨额赎回的情形及处理方式 …… 2.巨额赎回的处理方式 当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分顺延赎回。 …… **(3)在出现巨额赎回且单个基金份额持有人当日的赎回申请超过前一日基金总份额 20%以上的情形时，对于该基金份额持有人当日申请赎回的超过前一日基金总份额 20%以上的基金份额，基金管理人有权全部自动进行延期办理；对于该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人可以根据前段“(1)全额赎回”或“(2)部分顺延赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。但是，如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理部分的赎回申请将被撤销。** ……

七、基金合同当事人及权利义务	（一）基金管理人 …… 住所：~~北京市西城区金融大街 28 号盈泰商务中心 2 号楼 16 层~~ 办公地址：~~北京市西城区金融大街 28 号盈泰商务中心 2 号楼 16 层~~ …… 邮政编码：~~100032~~ 法定代表人：~~李维雄~~ 注册资本：~~壹亿~~元人民币 ~~存续期间：50 年~~ …… (二)基金托管人 …… 邮政编码：~~100032~~ 法定代表人：~~郭树清~~ …… 注册资本：~~贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元人民币~~ ……	（一）基金管理人 …… 住所：**北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层** 办公地址：**北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层** …… 邮政编码：**100033** 法定代表人：**崔伟** 注册资本：**叁亿**元人民币 **营业期限：2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日** **经营范围：基金募集；基金销售；资产管理；从事境外证券投资管理业务；中国证监会许可的其他业务** …… （二)基金托管人 …… 邮政编码：**100033** 法定代表人：**田国立** …… 注册资本：**贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整** ……
十二、基金的投资	（二）投资范围 …… 本基金投资于股票资产的比例为基金资产的 60%－95%（其中投资于权证的比例为基金净资产的 0%－3%），投资于债券资产的比例为基金资产的 5%－40%~~（~~其中投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例大于等于基金净资产的 5%~~）~~。	（二）投资范围 …… 本基金投资于股票资产的比例为基金资产的 60%－95%（其中投资于权证的比例为基金净资产的 0%－3%），投资于债券资产的比例为基金资产的 5%－40%**。**其中投资于现金**（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的比例大于等于基金净资产的 5%**。**
十二、基金的投资	（八）投资限制 1、组合限制 …… （10）本基金投资于股票资产的比例为基金资产的 60%－95%（其中投资于权证的比例为基金净资产的 0%－3%），投资于债券资产的比例为基金资产的 5%－40%~~（~~其中投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例大于等于基金净资产的 5%~~）~~； ……	（八）投资限制 1、组合限制 …… （10）本基金投资于股票资产的比例为基金资产的 60%－95%（其中投资于权证的比例为基金净资产的 0%－3%），投资于债券资产的比例为基金资产的 5%－40%**。**其中投资于现金**（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的比例大于等于基金净资产的 5%； …… **（14）本基金管理人管理的全部开放式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%； （15）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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资； （16）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； （17）法律法规及中国证监会规定的其他限制。 除第（10）项中“投资于现金（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的比例大于等于基金净资产的 5%”及第（11）、（15）、（16）项外，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的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。 ……
	~~（14）~~法律法规及中国证监会规定的其他限制。 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~~（1）—（10）~~项规定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。 ……	
第十四部分基金资产的估值	（六）暂停估值的情形 ……	（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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的；
第十八部分基金的信息披露	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。基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应当依法披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。 …… （八）基金年度报告、基金半年度报告、基金季度报告 ……	基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》、基金合同及其他有关规定。基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应当依法披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。 …… （八）基金年度报告、基金半年度报告、基金季度报告 …… 6.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。 7.如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或

	(九)临时报告与公告 ……	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基金定期报告“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。 (九)临时报告与公告 …… 26、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； ……

（二）《东方策略成长混合型开放式证券投资基金托管协议》修改对照表

章节	原《托管协议》	修订后《托管协议》
一、基金托管协议当事人	（一）基金管理人 …… ~~注册地址~~：~~北京市西城区金融大街 28 号盈泰商务中心 2 号楼 16 层~~ 办公地址：~~北京市西城区金融大街 28 号盈泰商务中心 2 号楼 16 层~~ 邮政编码:~~100032~~ 法定代表人：~~李维雄~~ 注册资本：~~壹亿~~元人民币 ~~存续期间：50 年~~ 经营范围：基金募集、基金销售、资产管理；中国证监会许可的其他业务。 （二）基金托管人 …… ~~注册地址~~：北京市西城区金融大街 25 号 …… 邮政编码：~~100032~~ 法定代表人：~~郭树清~~ 注册资本：~~贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元人民币~~	（一）基金管理人 …… 住所：北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层 办公地址：北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层 邮政编码：100033 法定代表人：崔伟 …… 注册资本：叁亿元人民币 营业期限：2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日 经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、从事境外证券投资管理业务和中国证监会许可的其他业务。 （二）基金托管人 …… 住所：北京市西城区金融大街 25 号 …… 邮政编码：100033 法定代表人：田国立 注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整
二、基金托管协议的依据、目的和原则	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)等有关法律、法规(以下简称“法律法规”)、基金合同及其他有关规定制订。	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法律、法规(以下简称“法律法规”)、基金合同及其他有关规定制订。

三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	…… 本基金投资于股票资产的比例为基金资产的60%－95%（其中投资于权证的比例为基金净资产的0%－3%），投资于债券资产的比例为基金资产的5%－40%~~（~~其中投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例大于等于基金净资产的5%~~）~~。 ……	…… 本基金投资于股票资产的比例为基金资产的60%－95%（其中投资于权证的比例为基金净资产的0%－3%），投资于债券资产的比例为基金资产的5%－40%。其中投资于现金**（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的比例大于等于基金净资产的5%。 ……
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： …… 7.本基金投资于股票资产的比例为基金资产的60%－95%（其中投资于权证的比例为基金净资产的0%－3%），投资于债券资产的比例为基金资产的5%－40%~~（~~其中投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例大于等于基金净资产的5%~~）~~； …… ~~11.~~法律法规及中国证监会规定的其他限制。 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~~1-7项~~规定的投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。 ……	（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： …… 7.本基金投资于股票资产的比例为基金资产的60%－95%（其中投资于权证的比例为基金净资产的0%－3%），投资于债券资产的比例为基金资产的5%－40%。其中投资于现金**（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的比例大于等于基金净资产的5%； …… **11.本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部开放式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%；** **12. 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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；** **13.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；** 14.法律法规及中国证监会规定的其他限制。 **除第7项中“投资于现金（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的比例大于等于基金净资产的5%”及第8、12、13项外，**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的投资比例的，基金管理人应当在10 个交易日内进行调整。 ……
八、基金	（四）暂停估值与公告基金份额净值的情形 ……	（四）暂停估值与公告基金份额净值的情形 ……

资产净值计算和会计核算		（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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的； ……

东方稳健回报债券型证券投资基金

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》

修改法律文件的情况说明

（一）《东方稳健回报债券型证券投资基金基金合同》修改对照表

章节	原《基金合同》	修订后《基金合同》
一、 前言	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。	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》”）、《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》”）和其他有关法律法规。
二、 释义		…… 13、《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 …… 54、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 ……
六、基金份额的申购与赎回	（五）申购和赎回的金额	（五）申购和赎回的金额 …… 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。具体规定请参见相关公告。

		……
六、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 …… 5.赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。不低于赎回费总额的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。 ……	（六）申购和赎回的价格、费用及其用途 …… 5.赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。**对持续持有期少于7日的投资者收取不少于1.5%的赎回费并全额计入基金财产，其他情形下**不低于赎回费总额的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。 ……
六、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人的申购申请： …… ~~6、~~法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述暂停申购情形时，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。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。	（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人的申购申请： …… 6、**接受某一投资者申购申请后导致其持有基金份额达到或超过基金总份额50%的。** **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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。** 8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述**第1、2、3、5、7、8项**暂停申购情形时，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。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。
六、基金份额的申购与赎回	（八）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 ……	（八）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… **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，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。** ……
六、基金份额的申购与赎回	（九）巨额赎回的情形及处理方式 …… 2、巨额赎回的处理方式 ……	（九）巨额赎回的情形及处理方式 …… 2、巨额赎回的处理方式 ……

	……	（3）在出现巨额赎回且单个基金份额持有人当日的赎回申请超过前一开放日基金总份额 20%以上的情形时，对于该基金份额持有人当日申请赎回的超过前一开放日基金总份额 20%以上的基金份额，基金管理人有权全部自动进行延期办理；对于该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人可以根据前段“（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。但是，如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理部分的赎回申请将被撤销。 ……
七、基金合同当事人及权利义务	(一)基金管理人 1、基金管理人简况 …… 注册资本：~~2 亿~~元人民币 ~~存续期限：50 年~~ ……	(一)基金管理人 1、基金管理人简况 …… 注册资本：叁亿元人民币 营业期限：2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日 ……
七、基金合同当事人及权利义务	（二）基金托管人 1、基金托管人简况 …… 法定代表人：~~王洪章~~ ……	（二）基金托管人 1、基金托管人简况 …… 法定代表人：田国立 ……
十二、基金的投资	(二)投资范围 …… 本基金的投资组合比例为：固定收益类资产（含可转换债券）的比例不低于基金资产的 80%，股票等权益类资产的比例不超过基金资产的 20%，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%。 ……	(二)投资范围 …… 本基金的投资组合比例为：固定收益类资产（含可转换债券）的比例不低于基金资产的 80%，股票等权益类资产的比例不超过基金资产的 20%，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不低于基金资产净值的 5%。 ……
十二、基金的投资	(六)投资限制 1、组合限制 …… （1）本基金投资于固定收益类资产（含可转换债券）的比例不低于基金资产的 80%，股票等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，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%； ……	(六)投资限制 1、组合限制 …… （1）本基金投资于固定收益类资产（含可转换债券）的比例不低于基金资产的 80%，股票等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，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不低于基金资产净值的 5%； …… （10）本基金管理人管理的全部开放式基金持有

		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%； （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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资； （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基金合同约定的投资范围保持一致； （13）如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。 除上述第（1）项中“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不低于基金资产净值的 5%”及第（8）、（11）、（12）项外，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。
	（10）如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。 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。	
十四、基金资产估值	（六）暂停估值的情形 …… 4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。	（六）暂停估值的情形 …… 4、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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的； 5、中国证监会和基金合同认定的其它情形。
十八、基金的信息披露	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。基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应当依法披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。……	基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》、基金合同及其他有关规定。基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应当依法披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。 ……
十八、基金的信息披露	（七）基金年度报告、基金半年度报告、基金季度报告 ……	（七）基金年度报告、基金半年度报告、基金季度报告 ……

		6.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。 7.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基金定期报告“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。
十八、基金的信息披露	（八）临时报告与公告 …… ~~26.~~中国证监会或本基金合同规定的其他事项。	（八）临时报告与公告 …… 26.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； 27.中国证监会或本基金合同规定的其他事项。

（二）《东方稳健回报债券型证券投资基金托管协议》修改对照表

章节	原《托管协议》	修订后《托管协议》
一、基金托管协议当事人	（一）基金管理人 …… ~~注册地址~~：北京市西城区锦什坊街28号1-4层 注册资本：~~2亿元~~人民币 ~~存续期限：50年~~ 经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。	（一）基金管理人 …… 住所：北京市西城区锦什坊街28号1-4层 注册资本：叁亿元人民币 营业期限：2004年6月11日至2054年6月10日 经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、从事境外证券投资管理业务和中国证监会许可的其他业务。
一、基金托管协议当事人	（二）基金托管人 …… 法定代表人：~~王洪章~~ ……	（二）基金托管人 …… 法定代表人：田国立 ……
二、基金托管协议的依据、目的和原则	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）等有关法律法规、基金合同及其他有关规定制订。	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法律法规、基金合同及其他有关规定制订。
三、基金托管人对基金管理	（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，对基金投资范围、投资对象进行监督。	（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，对基金投资范围、投资对象进行监督。 ……

人的业务监督和核查	…… 本基金的投资组合比例为：固定收益类资产（含可转换债券）的比例不低于基金资产的 80%，股票等权益类资产的比例不超过基金资产的 20%，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%。	本基金的投资组合比例为：固定收益类资产（含可转换债券）的比例不低于基金资产的 80%，股票等权益类资产的比例不超过基金资产的 20%，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不低于基金资产净值的 5%。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： （1）本基金投资于固定收益类资产（含可转换债券）的比例不低于基金资产的 80%，股票等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，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%； …… ~~（10）~~如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。 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。	（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： （1）本基金投资于固定收益类资产（含可转换债券）的比例不低于基金资产的 80%，股票等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，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不低于基金资产净值的 5%； …… **（10）本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部开放式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%；** **（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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；** **（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基金合同约定的投资范围保持一致；** **（13）**如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。 **除上述第（1）项中“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不低于基金资产净值的 5%”及第（8）、（11）、（12）项外，**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。

八、基金资产净值计算和会计核算	（四）暂停估值与公告基金份额净值的情形 …… ~~（4）~~中国证监会和基金合同认定的其他情形。	（四）暂停估值与公告基金份额净值的情形 …… **（4）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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的；** （5）中国证监会和基金合同认定的其他情形。

东方惠新灵活配置混合型证券投资基金

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》

修改法律文件的情况说明

（一）《东方惠新灵活配置混合型证券投资基金基金合同》修改对照表

章节	原《基金合同》	修订后《基金合同》
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》”）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》”）、《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》”）和其他有关法律法规。
第二部分 释义		…… 13、《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 …… 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 基金份额的申购与赎回	五、申购和赎回的数量限制	五、申购和赎回的数量限制 …… 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	六、申购和赎回的价格、费用及其用途	六、申购和赎回的价格、费用及其用途

基金份额的申购与赎回	…… 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。 ……	…… 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于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 日的投资者收取不低于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产**。 ……
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 …… ~~6、~~法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、5、~~6~~项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，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。	七、拒绝或暂停申购的情形 …… **6、接受某一投资者申购申请后导致其持有基金份额达到或超过基金总份额 50%的。** **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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。** 8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、5、**7、8** 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，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。
第六部分基金份额的申购与赎回	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… ……	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… **6、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。** ……
第六部分基金份额的申购与赎回	九、巨额赎回的情形及处理方式 …… 2、巨额赎回的处理方式 当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。 ……	九、巨额赎回的情形及处理方式 …… 2、巨额赎回的处理方式 当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。 …… **（3）在出现巨额赎回且单个基金份额持有人当日的赎回申请超过上一开放日基金总份额 20%以上的情形时，对于该基金份额持有人当日申请赎回的超过上一开放日**

	……	基金总份额 20%以上的基金份额，基金管理人有权全部自动进行延期办理；对于该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人可以根据前段“（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。但是，如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理部分的赎回申请将被撤销。 ……
第七部分 基金合同当事人及权利义务	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 …… 注册资本：~~贰亿~~元人民币 ~~存续期限：50 年~~ …… 二、基金托管人 （一）基金托管人简况 …… 法定代表人：~~王洪章~~ ……	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 …… 注册资本：叁亿元人民币 营业期限：2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日 …… 二、基金托管人 （一）基金托管人简况 …… 法定代表人：田国立 ……
第十二部分 基金的投资	二、投资范围 …… 基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%-95%；权证及其他金融工具的投资比例按照法律法规或监管机构的规定执行；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%。	二、投资范围 …… 基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%-95%；权证及其他金融工具的投资比例按照法律法规或监管机构的规定执行；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、应收申购款等。
第十二部分 基金的投资	四、投资限制 1、组合限制 …… （2）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； ……	四、投资限制 1、组合限制 …… （2）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、应收申购款等； …… （18）本基金管理人管理的全部开放式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）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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，本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； （21）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 除第（2）、（12）、（19）、（20）项外，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。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	六、暂停估值的情形 ……	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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的； ……
第十八部分基金的信息披露	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。 …… 五、公开披露的基金信息 …… （六）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 …… （七）临时报告 ……	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》、**《流动性风险管理规定》**、《基金合同》及其他有关规定。 …… 五、公开披露的基金信息 …… （六）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 …… 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。 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基金定期报告“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。 （七）临时报告 ……

		27、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；

（二）《东方惠新灵活配置混合型证券投资基金托管协议》修改对照表

章节	原《托管协议》	修订后《托管协议》
一、基金托管协议当事人	（一）基金管理人 …… 注册资本：~~贰亿~~元人民币 ~~存续期间：50 年~~ 经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。 （二）基金托管人 法定代表人：~~王洪章~~ ……	（一）基金管理人 …… 注册资本：叁亿元人民币 营业期限：2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日 经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、从事境外证券投资管理业务和中国证监会许可的其他业务。 （二）基金托管人 法定代表人：田国立 ……
二、基金托管协议的依据、目的和原则	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)等有关法律法规、《基金合同》及其他有关规定制订。	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法律法规、《基金合同》及其他有关规定制订。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%-95%；权证及其他金融工具的投资比例按照法律法规或监管机构的规定执行；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%。	基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%-95%；权证及其他金融工具的投资比例按照法律法规或监管机构的规定执行；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、应收申购款等。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： …… 2.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； ……	（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： …… 2.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、应收申购款等； …… 18.本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部开放式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%；

	…… 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，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。 ……	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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，本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。 …… 除第 2、12、19、20 项外，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，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。 ……
八、基金资产净值计算和会计核算	（五）暂停估值与公告各类基金份额的基金份额净值的情形	（五）暂停估值与公告各类基金份额的基金份额净值的情形 …… 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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的； ……

东方创新科技混合型证券投资基金

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》

修改法律文件的情况说明

（一）《东方创新科技混合型证券投资基金基金合同》修改对照表

章节	原《基金合同》	修订后《基金合同》
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》”）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》”）、**《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》”）**和其他有关法律法规。
第二部分 释义		…… 13、《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 …… 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 基金份额的申购与赎回	五、申购和赎回的数量限制	五、申购和赎回的数量限制 …… 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 基金份额的申购与赎回	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 …… 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。 ……	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 …… 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于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 日的投资者收取不低于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产。** ……
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 …… ~~6、~~法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、5、~~6~~项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，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。……	七、拒绝或暂停申购的情形 …… **6、接受某一投资者申购申请后导致其持有基金份额达到或超过基金总份额 50%的。** **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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。** 8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、5、**7、8** 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，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……
第六部分 基金份额的申购与赎回	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… ……	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… **6、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。** ……
第六部分 基金份额的申购与赎回	九、巨额赎回的情形及处理方式 …… 2、巨额赎回的处理方式 当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。 ……	九、巨额赎回的情形及处理方式 …… 2、巨额赎回的处理方式 当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。 …… **（3）在出现巨额赎回且单个基金份额持有人当日的赎回申请超过前一开放日基金总份额 20%以上的情形时，对于该基金份额持有人当日申请赎回的超过前**

	……	一开放日基金总份额20%以上的基金份额，基金管理人有权全部自动进行延期办理；对于该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人可以根据前段“（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。但是，如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理部分的赎回申请将被撤销。 ……
第七部分 基金合同当事人及权利义务	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 …… 注册资本：~~贰亿~~元人民币 ~~存续期限：50年~~ …… 二、基金托管人 （一）基金托管人简况 …… 法定代表人：~~王洪章~~ ……	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 …… 注册资本：叁亿元人民币 营业期限：2004年6月11日至2054年6月10日 …… 二、基金托管人 （一）基金托管人简况 …… 法定代表人：田国立 ……
第十二部分基金的投资	二、投资范围 …… 基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为30%-95%；投资于具有科技创新的行业及上市公司的股票占非现金基金资产的比例不低于80%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。	二、投资范围 …… 基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为30%-95%；投资于具有科技创新的行业及上市公司的股票占非现金基金资产的比例不低于80%；现金或者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、应收申购款等。
第十二部分基金的投资	四、投资限制 1、组合限制 …… （2）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； ……	四、投资限制 1、组合限制 …… （2）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、应收申购款等； …… （16）本基金管理人管理的全部开放式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%； （17）本基金主动投资于流动性受限资产的市值

	~~（16）~~法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 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，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。 ……	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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资； （18）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； （19）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 除第（2）、（12）、（17）、（18）项外，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，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	六、暂停估值的情形 ……	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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的；
第十八部分基金的信息披露	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。相关法律法规关于信息披露的披露方式、登载媒介、报备方式等规定发生变化时，本基金从其最新规定。 …… 五、公开披露的基金信息 …… （六）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 ……	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》、《流动性风险管理规定》、《基金合同》及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的披露方式、登载媒介、报备方式等规定发生变化时，本基金从其最新规定。 …… 五、公开披露的基金信息 …… （六）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 …… 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。 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基金定期报告“影响投资

	（七）临时报告 ……	**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。** （七）临时报告 …… **26、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；**

（二）《东方创新科技混合型证券投资基金托管协议》修改对照表

章节	原《托管协议》	修订后《托管协议》
一、基金托管协议当事人	（一）基金管理人 …… 注册资本：~~贰亿~~元人民币 ~~存续期间：50 年~~ 经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。 …… （二）基金托管人 法定代表人：~~王洪章~~ ……	（一）基金管理人 …… 注册资本：**叁亿**元人民币 **营业期限：2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日** 经营范围：基金募集；基金销售；资产管理；**从事境外证券投资管理业务**；中国证监会许可的其他业务。 …… （二）基金托管人 法定代表人：**田国立** ……
二、基金托管协议的依据、目的和原则	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）等有关法律法规、《基金合同》及其他有关规定制订。	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、**《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》**等有关法律法规、《基金合同》及其他有关规定制订。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	（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，对基金投资范围、投资对象进行监督。…… 基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 30%-95%；投资于具有科技创新的行业及上市公司的股票占非现金基金资产的比例不低于 80%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。	（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，对基金投资范围、投资对象进行监督。…… 基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 30%-95%；投资于具有科技创新的行业及上市公司的股票占非现金基金资产的比例不低于 80%；现金或者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、应收申购款等**。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核	（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： …… 2.保持不低于基金资产净值 5%的现金或	（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： …… 2.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**

查	者到期日在一年以内的政府债券； ……

东方合家保本混合型证券投资基金

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》

修改法律文件的情况说明

（一）《东方合家保本混合型证券投资基金基金合同》修改对照表

章节	原《基金合同》	修订后《基金合同》
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》”）、《关于保本基金的指导意见》（以下简称“《指导意见》”）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》”）、**《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》”）**、《关于保本基金的指导意见》（以下简称“《指导意见》”）和其他有关法律法规。
第二部分 释义		…… **16、《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** …… **74、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 基金份额的申购与赎回	五、申购和赎回的数量限制 ……	五、申购和赎回的数量限制 …… **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。具体规定请参见相关公告。**
第六部分	六、申购和赎回的价格、费用及其用途	六、申购和赎回的价格、费用及其用途

基金份额的申购与赎回	…… 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。 ……	…… 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于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 日的投资者收取不低于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产**。 ……
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 …… ~~6、~~法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、5、~~6~~项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，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。	七、拒绝或暂停申购的情形 …… **6、接受某一投资者申购申请后导致其持有基金份额达到或超过基金总份额 50%的。** **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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。** 8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、5、**7、8** 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，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。
第六部分 基金份额的申购与赎回	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… ……	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… **6、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。** ……
第六部分 基金份额的申购与赎回	九、巨额赎回的情形及处理方式 …… 2、巨额赎回的处理方式 当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。 ……	九、巨额赎回的情形及处理方式 …… 2、巨额赎回的处理方式 当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。 …… **（3）在出现巨额赎回且单个基金份额持有人当日的**

	……	赎回申请超过前一工作日基金总份额 20%以上的情形时，对于该基金份额持有人当日申请赎回的超过前一工作日基金总份额 20%以上的基金份额，基金管理人有权全部自动进行延期办理；对于该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人可以根据前段“（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。但是，如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理部分的赎回申请将被撤销。 ……
第七部分 基金合同当事人及权利义务	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 …… 注册资本：~~贰亿~~元人民币 …… 二、基金托管人 （一）基金托管人简况 …… 法定代表人：~~王洪章~~ ……	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 …… 注册资本：叁亿元人民币 …… 二、基金托管人 （一）基金托管人简况 …… 法定代表人：田国立 ……
第十五部分基金的投资	二、投资范围 …… 基金的投资组合比例为：股票等权益类资产占基金资产的比例不高于 40%，固定收益类资产占基金资产的比例不低于 60%。本基金投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%。本基金持有现金或投资于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%。 ……	二、投资范围 …… 基金的投资组合比例为：股票等权益类资产占基金资产的比例不高于 40%，固定收益类资产占基金资产的比例不低于 60%。本基金投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%。本基金持有现金或投资于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%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。 ……
第十五部分基金的投资	四、投资限制 1、组合限制 …… （2）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； ……	四、投资限制 1、组合限制 …… （2）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、应收申购款等； …… （18）本基金管理人管理的全部开放式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）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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，本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； （21）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 除第（2）、（12）、（19）、（20）项外，因证券、期货市场波动、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。法律法规另有规定的，从其规定。
	…… ~~（18）~~法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 因证券、期货市场波动、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。法律法规另有规定的，从其规定。	
第十七部分基金资产估值	六、暂停估值的情形 ……	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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的；
第二十一部分基金的信息披露	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。 …… 五、公开披露的基金信息 …… （六）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 ……	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》、《流动性风险管理规定》、《基金合同》及其他有关规定。 …… 五、公开披露的基金信息 …… （六）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 …… 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。 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基金定期报告“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。

	（七）临时报告 ……	（七）临时报告 …… 28、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； ……

（二）《东方合家保本混合型证券投资基金托管协议》修改对照表

章节	原《托管协议》	修订后《托管协议》
一、基金托管协议当事人	（一）基金管理人 …… 注册资本：~~贰亿~~元人民币 …… （二）基金托管人 …… 法定代表人：~~王洪章~~ ……	（一）基金管理人 …… 注册资本：叁亿元人民币 …… （二）基金托管人 …… 法定代表人：田国立 ……
二、基金托管协议的依据、目的和原则	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)等有关法律法规、《基金合同》及其他有关规定制订。	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法律法规、《基金合同》及其他有关规定制订。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： …… 2.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； ……	（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： …… 2.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、应收申购款等； …… 18.本基金管理人管理的、且由本基金托管人托管的全部开放式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.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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，本基金管理人不得主动新

	~~18.~~法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 …… 因证券、期货市场波动、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。法律法规另有规定的，从其规定。	**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；** 21.法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 …… **除第 2、12、19、20 项外**，因证券、期货市场波动、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。法律法规另有规定的，从其规定。
八、基金资产净值计算和会计核算	（四）暂停估值的情形	（四）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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的；** ……

东方臻享纯债债券型证券投资基金

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》

修改法律文件的情况说明

（一）《东方臻享纯债债券型证券投资基金基金合同》修改对照表

章节	原《基金合同》	修订后《基金合同》
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》”）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》”）、**《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》”）**和其他有关法律法规。
第二部分 释义		…… **13、《流动性风险管理规定》：指《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及不时作出的修订** …… **53、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）、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 基金份额的申购与赎回	五、申购和赎回的数量限制	五、申购和赎回的数量限制 …… **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。具体规定请参见相关公告。** ……
第六部分 基金份额的申购与	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 …… 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 …… 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承

赎回	人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。 ……	担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于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 日的投资者收取不低于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产**。 ……
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 …… 6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、5、~~6~~项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，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。	七、拒绝或暂停申购的情形 …… **6、接受某一投资者申购申请后导致其持有基金份额达到或超过基金总份额 50%的。** **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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。** 8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、5、**7、8** 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，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。
第六部分 基金份额的申购与赎回	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… **6、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。** ……
第六部分 基金份额的申购与赎回	九、巨额赎回的情形及处理方式 …… 2、巨额赎回的处理方式 当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。 ……	九、巨额赎回的情形及处理方式 …… 2、巨额赎回的处理方式 当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。 …… **（3）在出现巨额赎回且单个基金份额持有人当日的赎回申请超过上一日基金总份额 20%以上的情形时，对于该基金份额持有人当日申请赎回的超过上一日基金总份额 20%以上的基金份额，有权全部自动进行延期办理；**

	……	**对于该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人可以根据前段“（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。但是，如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理部分的赎回申请将被撤销。** ……
第七部分 基金合同当事人及权利义务	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 …… 注册资本：~~贰亿~~元人民币 …… 二、基金托管人 （一）基金托管人简况 …… 法定代表人：~~王洪章~~ ……	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 …… 注册资本：**叁亿**元人民币 …… 二、基金托管人 （一）基金托管人简况 …… 法定代表人：**田国立** ……
第十二部分 基金的投资	二、投资范围 …… 基金的投资组合比例为：债券资产占基金资产的比例不低于 80%；本基金每个交易日日终在扣除国债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占基金资产净值的比例不低于 5%。 ……	二、投资范围 …… 基金的投资组合比例为：债券资产占基金资产的比例不低于 80%；本基金每个交易日日终在扣除国债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占基金资产净值的比例不低于 5%**，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等**。 ……
第十二部分 基金的投资	四、投资限制 …… （2）本基金每个交易日日终在扣除国债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%的现金或者到期日在一年以内的政府债券； ……	四、投资限制 …… （2）本基金每个交易日日终在扣除国债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、应收申购款等**； …… **（13）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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；** **（14）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**

	~~（13）~~法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 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比例不符合上述规定投资比例的，除上述第（9）项外，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规另有规定的，从其规定。	一致； （15）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 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比例不符合上述规定投资比例的，除上述第（2）、（9）、（13）、（14）项外，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规另有规定的，从其规定。
第十四部分基金资产估值	六、暂停估值的情形	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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的； ……
第十八部分基金的信息披露	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。相关法律法规关于信息披露的披露方式、登载媒介、报备方式等规定发生变化时，本基金从其最新规定。 …… 五、公开披露的基金信息 …… （六）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 …… （七）临时报告 …… ~~27、~~中国证监会规定的其他事项。	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》、《流动性风险管理规定》、《基金合同》及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的披露方式、登载媒介、报备方式等规定发生变化时，本基金从其最新规定。 …… 五、公开披露的基金信息 …… （六）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 …… 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。 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基金定期报告“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。 （七）临时报告 …… 27、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； 28、中国证监会规定的其他事项。

（二）《东方臻享纯债债券型证券投资基金托管协议》修改对照表

章节	原《托管协议》	修订后《托管协议》
一、基金托管协议当事人	（一）基金管理人 …… 注册资本：~~贰亿~~元人民币 …… （二）基金托管人 …… 法定代表人：~~王洪章~~ ……	（一）基金管理人 …… 注册资本：**叁亿**元人民币 …… （二）基金托管人 …… 法定代表人：**田国立** ……
二、基金托管协议的依据、目的和原则	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）等有关法律法规、《基金合同》及其他有关规定制订。	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）**、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》**等有关法律法规、《基金合同》及其他有关规定制订。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	（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，对基金投资范围、投资对象进行监督。…… 基金的投资组合比例为：债券资产占基金资产的比例不低于 80%；本基金每个交易日日终在扣除国债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占基金资产净值的比例不低于 5%。 ……	（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，对基金投资范围、投资对象进行监督。…… 基金的投资组合比例为：债券资产占基金资产的比例不低于 80%；本基金每个交易日日终在扣除国债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占基金资产净值的比例不低于 5%**，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等**。 ……
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： …… 2.本基金每个交易日日终在扣除国债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%的现金或者到期日在一年以内的政府债券； …… 4.本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，基金托管人的监督义务仅限于其托管的由基金管理人管理的基金； …… 8.本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%，基金托管人的监督义务仅限于其托管的由基金管理人管理的基金；	（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： …… 2.本基金每个交易日日终在扣除国债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、应收申购款等**； …… 4.本基金管理人管理的**且由本基金托管人托管的**全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，基金托管人的监督义务仅限于其托管的由基金管理人管理的基金； …… 8.本基金管理人管理的**且由本基金托管人托管的**全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%，基金托管人的监督义务仅限于其托管的由基金管理人管理的

		基金； 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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，本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； 16.法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 …… 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比例不符合上述规定投资比例的，除上述第2、9、14、15项外，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
	（14）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制 …… 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比例不符合上述规定投资比例的，除上述第9项外，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。	
八、基金资产净值计算和会计核算	（四）暂停估值与公告基金份额净值的情形	（四）暂停估值与公告基金份额净值的情形 …… 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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的； ……

东方支柱产业灵活配置混合型证券投资基金

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》

修改法律文件的情况说明

（一）《东方支柱产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》修改对照表

章节	原《基金合同》	修订后《基金合同》
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》”）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》”）、《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》”）和其他有关法律法规。
第二部分 释义		…… 13、《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 …… 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 基金份额的申购与赎回	五、申购和赎回的数量限制	五、申购和赎回的数量限制 …… 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	六、申购和赎回的价格、费用及其用途	六、申购和赎回的价格、费用及其用途

基金份额的申购与赎回	…… 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。 ……	…… 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于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 日的投资者收取不低于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产**。 ……
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 …… ~~6、~~法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、5、~~6~~项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，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。	七、拒绝或暂停申购的情形 …… **6、接受某一投资者申购申请后导致其持有基金份额达到或超过基金总份额 50%的。** **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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。** 8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、5、**7、8** 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，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。
第六部分 基金份额的申购与赎回	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… ……	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… **6、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。** ……
第六部分 基金份额的申购与赎回	九、巨额赎回的情形及处理方式 …… 2、巨额赎回的处理方式 当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。 ……	九、巨额赎回的情形及处理方式 …… 2、巨额赎回的处理方式 当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。 …… **（3）在出现巨额赎回且单个基金份额持有人当日的赎回申请超过上一开放日基金总份额 20%以上的情形时，对于该基金份额持有人当日申请赎回的超过上一开放日**

	……	基金总份额 20%以上的基金份额，基金管理人有权全部自动进行延期办理；对于该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人可以根据前段“（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。但是，如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理部分的赎回申请将被撤销。 ……
第七部分 基金合同当事人及权利义务	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 …… 注册资本：~~贰亿~~元人民币 ~~存续期限：50 年~~ …… 二、基金托管人 （一）基金托管人简况 …… 法定代表人：~~王洪章~~ ……	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 …… 注册资本：叁亿元人民币 营业期限：2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日 …… 二、基金托管人 （一）基金托管人简况 …… 法定代表人：田国立 ……
第十二部分基金的投资	二、投资范围 …… 基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%-95%；投资于我国支柱产业相关上市公司证券的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%;投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%；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，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%。	二、投资范围 …… 基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%-95%；投资于我国支柱产业相关上市公司证券的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%；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，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、应收申购款等。
第十二部分基金的投资	四、投资限制 1、组合限制 …… （2）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，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； ……	四、投资限制 1、组合限制 …… （2）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，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、应收申购款等； …… （18）本基金管理人管理的全部开放式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）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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，本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； （21）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 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比例不符合上述规定投资比例的，除第（2）、（12）、（19）、（20）项外，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。 ……
第十四部分基金资产估值	六、暂停估值的情形 ……	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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的；
第十八部分基金的信息披露	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。相关法律法规关于信息披露的披露方式、登载媒介、报备方式等规定发生变化时，本基金从其最新规定。 …… 五、公开披露的基金信息 …… （六）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 ……	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》、《流动性风险管理规定》、《基金合同》及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的披露方式、登载媒介、报备方式等规定发生变化时，本基金从其最新规定。 …… 五、公开披露的基金信息 …… （六）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 …… 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。 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

	（七）临时报告 ……	**金管理人至少应当在基金定期报告“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。** （七）临时报告 …… **26、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；**

（二）《东方支柱产业灵活配置混合型证券投资基金托管协议》修改对照表

章节	原《托管协议》	修订后《托管协议》
一、基金托管协议当事人	（一）基金管理人 …… 注册资本：~~贰亿~~元人民币 ~~存续期间：50 年~~ （二）基金托管人 法定代表人：~~王洪章~~ ……	（一）基金管理人 …… 注册资本：**叁亿**元人民币 **营业期限：2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日** （二）基金托管人 法定代表人：**田国立** ……
二、基金托管协议的依据、目的和原则	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)等有关法律法规、《基金合同》及其他有关规定制订。	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、**《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》**等有关法律法规、《基金合同》及其他有关规定制订。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	（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，对基金投资范围、投资对象进行监督。…… 基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%-95%；投资于我国支柱产业相关上市公司证券的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%;投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%；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，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%。	（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，对基金投资范围、投资对象进行监督。…… 基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%-95%；投资于我国支柱产业相关上市公司证券的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%；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，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、应收申购款等**。
三、基金托管人对基金管理人的业务	（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：	（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： ……

监督和核查	…… 2.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，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； ……

东方精选混合型开放式证券投资基金

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》

修改法律文件的情况说明

（一）《东方精选混合型开放式证券投资基金基金合同》修改对照表

章节	原《基金合同》	《基金合同》修订后
一、前言	2.订立本基金合同的依据是《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。	2.订立本基金合同的依据是《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》”）**、《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》”）**和其他有关法律法规。
二、释义		…… **13.《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》** …… **53.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** ……
六、基金份额的申购与赎回	（四）申购和赎回的金额	（四）申购和赎回的金额 …… **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。** ……
六、基金	（五）申购和赎回的价格、费用及其用途 8.赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担	（五）申购和赎回的价格、费用及其用途 8.赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承

份额的申购与赎回	赎回费总额的25%归基金财产，75%用于支付注册登记费和其他必要的手续费。 9.本基金的申购费率最高不超过1.8%，赎回费率最高不超过~~0.5%~~。本基金的申购费率、赎回费率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，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前 3 个工作日前在至少一种指定媒体公告。	担，**对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产，其他情况下**赎回费总额的25%归基金财产，75%用于支付注册登记费和其他必要的手续费。 9.本基金的申购费率最高不超过1.8%，赎回费率最高不超过**1.5%**。本基金的申购费率、赎回费率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，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前 3 个工作日前在至少一种指定媒体公告。
六、基金份额的申购与赎回	(六)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人的申购申请： ……	(六)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人的申购申请： …… **5.接受某一投资者申购申请后导致其持有基金份额达到或超过基金总份额50%的。** **6.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。** ……
六、基金份额的申购与赎回	(七)暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形	(七)暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… **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，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。** ……
六、基金份额的申购与赎回	(八)巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 ……	(八)巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 …… **（3）在出现巨额赎回且单个基金份额持有人当日的赎回申请超过上一日基金总份额20%以上的情形时，对于该基金份额持有人当日申请赎回的超过上一日基金总份额20%以上的基金份额，基金管理人有权全部自动进行延期办理；对于该基金份额持有人未超过上述比**

	……	例的部分，基金管理人可以根据前段“（1）全额赎回”或“（2）部分顺延赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。但是，如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理部分的赎回申请将被撤销。 ……
七、基金合同当事人及权利义务	（一）基金管理人 …… ~~住所：北京市西城区金融大街 28 号盈泰商务中心 2 号楼 16 层~~ ~~办公地址：北京市西城区金融大街 28 号盈泰商务中心 2 号楼 16 层~~ ~~邮政编码：100032~~ ~~法定代表人：李维雄~~ …… ~~注册资本：1 亿元人民币~~ ~~营业期限：50 年~~ （二）基金托管人 …… ~~住所：北京市东城区正义路 4 号~~ …… ~~法定代表人：董文标~~ …… ~~经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；同业拆借；买卖、代理买卖外汇；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国人民银行批准的其它金融业务。~~ ~~组织形式：股份有限公司~~ ~~注册资本：25.8 亿元~~ ~~存续期间：持续经营~~	（一）基金管理人 …… 住所：北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层 办公地址：北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层 法定代表人：崔伟 …… 注册资本：叁亿元人民币 营业期限：2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日 （二）基金托管人 …… 住所：北京市西城区复兴门内大街 2 号 …… 法定代表人：洪崎 …… 组织形式：其他股份有限公司（上市） 注册资本：28,365,585,227 元人民币 存续期间：持续经营 经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现、发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事结汇、售汇业务；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项；保险兼业代理业务（有效期至 2020 年 02 月 18 日）；提供保管箱服务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。 组织形式：其他股份有限公司（上市） 注册资本：28,365,585,227 元人民币 存续期间：持续经营
十二、基金	（六）投资限制 1.组合限制	（六）投资限制 1.组合限制

的投资	…… (6)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、应收申购款等； ~~(7)~~法律法规或中国证监会对上述比例限制另有规定的，应从其规定。 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(1)—~~(2)~~项规定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。	…… (6)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、应收申购款等； (7)本基金管理人管理的全部开放式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%； (8)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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资； (9)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； (10)法律法规或中国证监会对上述比例限制另有规定的，应从其规定。 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(1)—(5)、(7)、(10)项规定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。
十四、基金资产的估值	(六)暂停估值的情形 ……	(六)暂停估值的情形 …… 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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的； ……
十八、基金的信息披露	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。基金管理人、基金托管人应按规定将基金信息披露事项在规定时间内通过中国证监会指定的全国性报刊和基金管理人、基金托管人的互联网网站等媒介披露。公开披露的基金信息包括： …… (八)基金年度报告、基金半年度报告、基金季度报告	基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》、基金合同及其他有关规定。基金管理人、基金托管人应按规定将基金信息披露事项在规定时间内通过中国证监会指定的全国性报刊和基金管理人、基金托管人的互联网网站等媒介披露。公开披露的基金信息包括： …… (八)基金年度报告、基金半年度报告、基金季度报

	…… (九)临时报告与公告 …… ……	告 …… 4.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。 5.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基金定期报告“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。 (九)临时报告与公告 …… 26.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； ……

（二）《东方精选混合型开放式证券投资基金托管协议》修改对照表

章节	原《托管协议》	《托管协议》修订后
一、托管协议当事人	（一）基金管理人 …… ~~注册地址：北京市西城区金融大街 28 号盈泰商务中心 2 号楼 16 层~~ ~~办公地址：北京市西城区金融大街 28 号盈泰商务中心 2 号楼 16 层~~ ~~邮政编码：100032~~ ~~法定代表人：李维雄~~ …… ~~注册资本：1 亿元人民币~~ ~~营业期限：50 年~~ ~~经营范围：基金募集；基金销售；资产管理；中国证监会许可的其他业务~~ （二）基金托管人 …… ~~注册地址：北京市东城区正义路 4 号~~ …… 法定代表人：~~董文标~~ …… ~~组织形式：股份有限公司~~	（一）基金管理人 …… 住所：北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层 办公地址：北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层 邮政编码：100033 法定代表人：崔伟 …… 注册资本：叁亿元人民币 营业期限：2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日 经营范围：基金募集；基金销售；资产管理；从事境外证券投资管理业务；中国证监会许可的其他业务 （二）基金托管人 …… 住所：北京市西城区复兴门内大街 2 号 …… 法定代表人：洪崎 …… 组织形式：其他股份有限公司（上市） 注册资本：28,365,585,227 元人民币 存续期间：持续经营

	~~注册资本：25.8 亿元~~ ~~经营期限：永久存续~~	
二、托管协议的依据、目的和原则	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”等有关法律、法规（以下简称“法律法规”)、基金合同及其他有关规定制订。	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)**、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》**等有关法律、法规(以下简称“法律法规”)、基金合同及其他有关规定制订。
八、基金资产估值、基金资产净值计算与复核	5.暂停估值与公告基金份额净值的情形 (1)基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； (2)因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时； (3)占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障基金份额持有人的利益，已决定延迟估值时； (4)如果出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况，导致基金管理人不能出售或评估基金资产时； ~~(5)~~中国证监会和基金合同认定的其他情形。	5.暂停估值与公告基金份额净值的情形 （1）基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； （2）因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时； （3）占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障基金份额持有人的利益，已决定延迟估值时； （4）如果出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况，导致基金管理人不能出售或评估基金资产时； **(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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的；** **（6）**中国证监会和基金合同认定的其他情形。
八、投资组合比例监控	九、投资组合比例监控 6.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；	九、投资组合比例监控 6.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、应收申购款等；** **7.本基金管理人管理的全部开放式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%；** **8.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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前款所规定比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；** **9.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；**

	~~7.~~法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。 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 1—2 项规定的比例或者基金合同约定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内调整完毕。	10.法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。 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 1—5、7、10 项规定的比例或者基金合同约定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内调整完毕。

东方金账簿货币市场证券投资基金

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》

修改法律文件的情况说明

（一）《东方金账簿货币市场证券投资基金基金合同》修改对照表

章节	原《基金合同》	《基金合同》修订后
一、前言	2、订立本基金合同的依据是《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》）、《货币市场基金监督管理办法》、《关于实施＜货币市场基金监督管理办法＞有关问题的规定》、《基金管理公司进入银行间同业市场管理规定》（以下简称《管理规定》）及其他有关规定。	2、订立本基金合同的依据是《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》）、《货币市场基金监督管理办法》、《关于实施＜货币市场基金监督管理办法＞有关问题的规定》、**《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》）**、《基金管理公司进入银行间同业市场管理规定》（以下简称《管理规定》）及其他有关规定。
二、释义	……	…… **15、《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作出的修订** …… **58、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）、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**
六、基金份额的申购与赎回	（五）申购与赎回的数额限制 ……	（五）申购与赎回的数额限制 …… **5、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。具体规定请参见相关公告。**

		……
六、基金份额的申购与赎回	（六）申购费用和赎回费用 1、除法律法规另有规定或基金合同另有约定外，本基金不收取申购费用和赎回费用。 2、发生本基金持有的现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计低于5%且偏离度为负的情形时，对当日单个基金份额持有人申请赎回基金份额超过基金总份额1%以上的赎回申请征收1%的强制赎回费用，并将上述赎回费用全额计入基金财产。基金管理人与基金托管人协商确认上述做法无益于基金利益最大化的情形除外。	（六）申购费用和赎回费用 ~~1、~~除法律法规另有规定或基金合同另有约定外，本基金不收取申购费用和赎回费用。**但是，出现以下情形之一：** **1、当本基金前10名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额50%，且当投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计低于10%且偏离度为负时；** 2、发生本基金持有的现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计低于5%且偏离度为负的情形时~~，~~**；** **基金管理人应当**对当日单个基金份额持有人申请赎回基金份额超过基金总份额1%以上的赎回申请征收1%的强制赎回费用，并将上述赎回费用全额计入基金财产。基金管理人与基金托管人协商确认上述做法无益于基金利益最大化的情形除外。
六、基金份额的申购与赎回	（九）拒绝或暂停申购的情形及处理方式 …… 发生上述1-5项暂停申购情形时，基金管理人应当在指定媒体上刊登暂停申购公告； ……	（九）拒绝或暂停申购的情形及处理方式 …… **7、接受某一投资者申购申请后导致其份额达到或超过基金总份额50%以上的。** **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。** 发生上述1-5**、8**项暂停申购情形时，基金管理人应当在指定媒体上刊登暂停申购公告； ……
六、基金份额的申购与赎回	（十）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形及处理方式 …… ……	（十）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形及处理方式 …… **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，基金管理人应当采取延缓支付赎回**

		款项或暂停接受基金赎回申请的措施； ……
六、基金份额的申购与赎回	（十一）巨额赎回的情形及处理方式 …… ……	（十一）巨额赎回的情形及处理方式 …… （3）在出现巨额赎回且单个基金份额持有人当日的赎回申请超过上一日基金总份额 20%以上的情形时，对于该基金份额持有人当日申请赎回的超过上一日基金总份额 20%以上的基金份额，有权全部自动进行延期办理；对于该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人可以根据前段“（1）全额赎回”或“（2）部分顺延赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。但是，如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理部分的赎回申请将被撤销。 ……
七、基金合同当事人及权利义务	一、基金管理人 （一）基金管理人基本情况 …… ~~注册资本：贰亿元人民币~~ ~~存续期间：50 年~~ …… 二、基金托管人 （一）基金托管人简况 ……	一、基金管理人 （一）基金管理人基本情况 …… 注册资本：叁亿元人民币 营业期限：2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日 …… 二、基金托管人 （一）基金托管人简况 ……
十二、基金的投资	（七）投资限制 （2）本基金的投资组合应当符合下列规定： 1）本基金投资组合的平均剩余期限不得超过 120 天，平均剩余存续期不得超过 240 天； ……	（七）投资限制 （2）本基金的投资组合应当符合下列规定： 1）正常情况下，本基金投资组合的平均剩余期限不得超过120天，平均剩余存续期不得超过240天； …… 5）本基金拟投资于主体信用评级低于 AA+的商业银行的银行存款与同业存单的，应当经基金管理人董事会审议批准，相关交易应当事先征得基金托管人的同意； 6）本基金管理人管理的全部货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券，不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的 10%；

	~~5~~）基金投资于有固定期限的银行存款的比例，不得超过基金资产净值的 30%，根据协议有存款期限但可提前支取的银行存款，可不受此限制； ~~6~~）本基金应保持足够比例的流动性资产以应对潜在的赎回要求，其投资组合应当符合下列规定： ①现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券占基金资产净值的比例合计不得低于 5%； ②现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及五个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 10%； ③到期日在 10 个交易日以上的逆回购、银行定期存款等流动性受限资产投资占基金资产净值的比例合计不得超过 30%； ④除发生巨额赎回情形外，连续 3 个交易日累计赎回 20%以上或者连续 5 个交易日累计赎回 30%以上的情形外，本基金债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%； …… ……	7）基金投资于有固定期限的银行存款的比例，不得超过基金资产净值的 30%，根据协议有存款期限但可提前支取的银行存款，可不受此限制； 8）本基金应保持足够比例的流动性资产以应对潜在的赎回要求，其投资组合应当符合下列规定： ①现金**（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）**、国债、中央银行票据、政策性金融债券占基金资产净值的比例合计不得低于 5%； ②现金**（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）**、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及五个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 10%； ③到期日在 10 个交易日以上的逆回购、银行定期存款等流动性受限资产投资占基金资产净值的比例合计不得超过 30%； ④除发生巨额赎回情形外，连续 3 个交易日累计赎回 20%以上或者连续 5 个交易日累计赎回 30%以上的情形外，本基金债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%； …… **15）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、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；** **16）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；** **17）本基金根据份额持有人集中度情况对货币市场基金的投资组合实施调整，并遵守以下要求：** **①当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 50%时，本基金投资组合的平均剩余期限不得超过 60 天，平均剩余存续期不得超过 120 天；投资组合中现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 30%；**

		②当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 20%时，本基金投资组合的平均剩余期限不得超过 90 天，平均剩余存续期不得超过 180 天；投资组合中现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 20%； 18）本基金投资于主体信用评级低于 AAA 的机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 10%，其中单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 2%；前述金融工具包括银行存款、同业存单、相关机构作为原始权益人的资产支持证券及中国证监会认定的其他品种； 19）本基金的基金总资产不得超过基金资产净值的 140%； 20）法律法规或中国证监会、中国人民银行规定的其他比例限制。 法律法规或监管部门取消上述限制，本基金不受上述限制。除法律法规另有规定或上述另有约定外，由于证券市场波动或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例的，除上述第 8）的①、13）、15）、16）项外，但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到标准。
	~~13~~）本基金的基金总资产不得超过基金资产净值的 140%； ~~14~~）法律法规或中国证监会、中国人民银行规定的其他比例限制。 法律法规或监管部门取消上述限制，本基金不受上述限制。除法律法规另有规定或上述另有约定外，由于证券市场波动或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例~~不在限制之内~~，但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到标准。	
十四、基金资产的估值	三、估值方法 …… ~~7、~~相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。	三、估值方法 …… 7、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以对本基金采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。 8、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。
十四、基金资产的估值	（七）暂停估值的情形及处理	（七）暂停估值的情形及处理 …… 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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的； ……

十八、基金的信息披露	（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》、《信息披露特别规定》、基金合同及其他有关规定。 …… （六）基金定期报告 …… （七）临时报告与公告 本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在2日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。 前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金资产净值产生重大影响的下列事件： 1、基金份额持有人大会的召开； 2、终止《基金合同》； …… ~~17、当“影子定价”确定的基金资产净值与“摊余成本法”计算的基金资产净值的负偏离度绝对值达到0.25%或正负偏离度绝对值达到0.5%的情形；当“影子定价”确定的基金资产净值与“摊余成本法”计算的基金资产净值连续2个交易日出现负偏离度绝对值达到0.5%的情形；~~ ……	（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》、《信息披露特别规定》、**《流动性风险管理规定》**、基金合同及其他有关规定。 …… （六）基金定期报告 …… **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，并至少披露报告期末基金前10名份额持有人的类别、持有份额及占总份额的比例等信息。** **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。** （七）临时报告与公告 本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在2日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。 前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金资产净值产生重大影响的下列事件： 1、基金份额持有人大会的召开； 2、终止《基金合同》； …… **17、当“摊余成本法”计算的基金资产净值与“影子定价”确定的基金资产净值偏离度绝对值达到或超过0.5%的情形；** …… **27、发生涉及本基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项；** **28、本基金投资于主体信用评级低于AA+的商**

	……	业银行的银行存款与同业存单的； ……

（二）《东方金账簿货币市场证券投资基金托管协议》修改对照表

章节	原《托管协议》	《托管协议》修订后
一、基金托管协议当事人	（一）基金管理人 名称：东方基金管理有限责任公司 …… 注册资本：~~贰亿元人民币~~ ~~存续期间：50 年~~ 经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、从事境外证券投资管理业务和中国证监会许可的其他业务 （二）基金托管人 基金托管人名称：中国民生银行股份有限公司 …… 经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现、发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事结汇、售汇业务；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项；保险兼业代理业务~~（有效期至 2017 年 02 月 18 日）~~；提供保管箱服务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。	（一）基金管理人 名称：东方基金管理有限责任公司 …… 注册资本：**叁亿元人民币** **营业期限：2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日** 经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、从事境外证券投资管理业务和中国证监会许可的其他业务 （二）基金托管人 基金托管人名称：中国民生银行股份有限公司 …… 经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现、发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事结汇、售汇业务；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项；保险兼业代理业务**（有效期至 2020 年 02 月 18 日）**；提供保管箱服务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。
二、基金托管协议的依据、目的和原则	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）等有关法律、法规（以下简称“法律法规”）、基金合同及其他有关规定制订。	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）等有关法律、法规（以下简称“法律法规”）、**《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》”）、**基金合同及其他有关规定制订。
三、基金托管人对基金管理人	2、组合限制 （1）本基金投资组合的平均剩余期限不得超过 120 天；平均剩余存续期不得超过 240 天； ……	2、组合限制 （1）**正常情况下，**本基金投资组合的平均剩余期限不得超过 120 天；平均剩余存续期不得超过 240 天； …… **（5）本基金拟投资于主体信用评级低于 AA+的商业银行的银行存款与同业存单的，应当经基金管理人**

的业务监督和核查	~~（5）~~基金投资于有固定期限的银行存款的比例，不得超过基金资产净值的 30%，根据协议有存款期限但可提前支取的银行存款，可不受此限制； ~~（6）~~本基金应保持足够比例的流动性资产以应对潜在的赎回要求，其投资组合应当符合下列规定： 1）现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券占基金资产净值的比例合计不得低于 5%； 2）现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及五个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 10%； 4）除发生巨额赎回情形、连续 3 个交易日累计赎回 20%以上或者连续 5 个交易日累计赎回 30%以上的情形外，本基金债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%； ……	董事会审议批准，相关交易应当事先征得基金托管人的同意； （6）本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券，不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的 10%； （7）基金投资于有固定期限的银行存款的比例，不得超过基金资产净值的 30%，根据协议有存款期限但可提前支取的银行存款，可不受此限制； （8）本基金应保持足够比例的流动性资产以应对潜在的赎回要求，其投资组合应当符合下列规定： 1）现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）、国债、中央银行票据、政策性金融债券占基金资产净值的比例合计不得低于 5%； 2）现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及五个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 10%； 4）除发生巨额赎回情形、连续 3 个交易日累计赎回 20%以上或者连续 5 个交易日累计赎回 30%以上的情形外，本基金债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%； …… （15）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、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； （16）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； （17）本基金根据份额持有人集中度情况对货币市场基金的投资组合实施调整，并遵守以下要求： ①当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 50%时，本基金投资组合的平均剩余期限不得超过 60 天，平均剩余存续期不得超过 120 天；投资组合中现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金

	~~（13）~~本基金的基金总资产不得超过基金资产净值的 140%； ~~（14）~~法律法规或中国证监会、中国人民银行规定的其他比例限制。 本基金在基金合同生效后三个月内使基金投资组合符合基金合同的有关约定。除法律法规另有规定或上述另有约定外，因基金规模或市场变化等基金管理人之外的原因导致投资组合超出基金合同的约定时，基金管理人应在 10 个交易日内调整完毕，以符合有关限制规定。	资产净值的比例合计不得低于 30%； ②当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 20%时，本基金投资组合的平均剩余期限不得超过 90 天，平均剩余存续期不得超过 180 天；投资组合中现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 20%； （18）本基金投资于主体信用评级低于 AAA 的机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 10%，其中单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 2%；前述金融工具包括银行存款、同业存单、相关机构作为原始权益人的资产支持证券及中国证监会认定的其他品种； （19）本基金的基金总资产不得超过基金资产净值的 140%； （20）法律法规或中国证监会、中国人民银行规定的其他比例限制。 本基金在基金合同生效后三个月内使基金投资组合符合基金合同的有关约定。除法律法规另有规定或上述另有约定外，因基金规模或市场变化等基金管理人之外的原因导致投资组合超出基金合同的约定时，除上述第（8）的①、（13）、（15）、（16）项外，基金管理人应在 10 个交易日内调整完毕，以符合有关限制规定。
八、基金资产净值计算和会计核算	（四）暂停估值的情形	（四）暂停估值的情形 …… 4、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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的； ……

东方双债添利债券型证券投资基金

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》

修改法律文件的情况说明

（一）《东方双债添利债券型证券投资基金基金合同》修改对照表

章节	原《基金合同》	《基金合同》修订后
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。	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》”）、《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》”）和其他有关法律法规。
第二部分 释义		…… 13、《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 …… 53、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 基金份额的申购与赎回	五、申购和赎回的数量限制	五、申购和赎回的数量限制 …… 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与赎回	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 …… 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。 ……	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 …… 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于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 日的投资者收取不低于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产**。 ……
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人的申购申请： …… ~~7、~~法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、5、~~6、~~项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，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。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。	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人的申购申请： …… **6、接受某一投资者申购申请后导致其持有基金份额达到或超过基金总份额 50%的。** **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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。** 8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、5、6、**7、8** 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，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。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与赎回	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… ……	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… **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，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。** ……
第六部分	九、巨额赎回的情形及处理方式 ……	九、巨额赎回的情形及处理方式 ……

基金份额的申购与赎回	2、巨额赎回的处理方式 当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。 …… ……	2、巨额赎回的处理方式 当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。 …… **（3）在出现巨额赎回且单个基金份额持有人当日的赎回申请超过前一开放日基金总份额 20%以上的情形时，对于该基金份额持有人当日申请赎回的超过前一开放日基金总份额 20%以上的基金份额，基金管理人有权全部自动进行延期办理；对于该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人可以根据前段“（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。但是，如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理部分的赎回申请将被撤销。** ……
第七部分基金合同当事人及权利义务	（一） 基金管理人简况 名称：东方基金管理有限责任公司 …… 注册资本：贰亿元人民币 ~~存续期间：50 年~~ 联系电话：010-66295888	（一） 基金管理人简况 名称：东方基金管理有限责任公司 …… 注册资本：**叁亿元人民币** **营业期限：2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日** 联系电话：010-66295888
第七部分基金合同当事人及权利义务	二、基金托管人 （一） 基金托管人简况 名称：中国民生银行股份有限公司 住所：北京市西城区复兴门内大街 2 号 法定代表人：~~董文标~~ 成立时间：1996 年 2 月 7 日 批准设立机关和批准设立文号：中国人民银行银复[1996]14 号 组织形式：~~股份有限公司~~ 注册资本：28,365,585,227 元人民币 存续期间：持续经营 基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字[2004]101 号	二、基金托管人 （一） 基金托管人简况 名称：中国民生银行股份有限公司 住所：北京市西城区复兴门内大街 2 号 法定代表人：**洪崎** 成立时间：1996 年 2 月 7 日 批准设立机关和批准设立文号：中国人民银行银复[1996]14 号 组织形式：**其他股份有限公司（上市）** 注册资本：28,365,585,227 元人民币 存续期间：持续经营 基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字[2004]101 号
第十二部分	二、投资范围 …… 基金的投资组合比例为：债券资产占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于信用债券和可转换债券	二、投资范围 …… 基金的投资组合比例为：债券资产占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于信用债券和可转换债券

基金的投资	的资产不低于非现金资产的 80%;股票等权益类资产占基金资产的比例不超过 20%，权证投资比例不超过基金资产净值的 3%;现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%。 ……	的资产不低于非现金资产的 80%；股票等权益类资产占基金资产的比例不超过 20%，权证投资比例不超过基金资产净值的 3%；现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%**，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等**。 ……
第十二部分基金的投资	四、投资限制 1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： （1）本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于信用债券和可转换债券的资产不低于非现金资产的 80%；股票 等权益类资产的投资比例合计不超过基金资产的 20%； （2）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； …… …… ~~（16）~~法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 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。法律法规另有规定的，从其规定。 ……	四、投资限制 1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： （1）本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于信用债券和可转换债券的资产不低于非现金资产的 80%；股票 等权益类资产的投资比例合计不超过基金资产的 20%； （2）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、应收申购款等**； …… **（15）本基金管理人管理的全部开放式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%；** **（16）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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；** **（17）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；** **（18）**法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 **除第（2）、（12）、（16）、（17）项外，**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。法律法规另有规定的，从其规定。 ……

第十四部分 基金资产估值	六、暂停估值的情形 …… ~~3、~~中国证监会和基金合同认定的其它情形。	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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的；** **4、**中国证监会和基金合同认定的其它情形。
第十八部分 基金的信息披露	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。 …… 五、公开披露的基金信息 …… （六）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基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定媒体上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。 基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定媒体上。 基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定媒体上。 《基金合同》生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。 基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。	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》**、《流动性风险管理规定》**、《基金合同》及其他有关规定。 …… 五、公开披露的基金信息 …… （六）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基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定媒体上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。 基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定媒体上。 基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定媒体上。 《基金合同》生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。 基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。 **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。** **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基金定期报告“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**

	（七）临时报告 本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书， 予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。 前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件： 1、基金份额持有人大会的召开； 2、终止《基金合同》； …… ~~27、~~中国证监会规定的其他事项。	**除外。** （七）临时报告 本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书， 予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。 前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件： 1、基金份额持有人大会的召开； 2、终止《基金合同》； …… **27、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；** 28、中国证监会规定的其他事项。

（二）《东方双债添利债券型证券投资基金托管协议》修改对照表

章节	原《托管协议》	《托管协议》修订后
一、基金托管协议当事人	（一）基金管理人 名称：东方基金管理有限责任公司 ~~注册地址：~~北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层 办公地址：北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层 邮政编码：100033 法定代表人：崔伟 成立日期：2004 年 6 月 11 日 批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字【2004】80 号 组织形式：有限责任公司 注册资本：~~贰亿元人民币~~ ~~存续期间：50 年~~ 经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务 （二）基金托管人 名称：中国民生银行股份有限公司 ~~注册地址：~~北京市西城区复兴门内大街 2 号 办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号邮	（一）基金管理人 名称：东方基金管理有限责任公司 **住所：**北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层 办公地址：北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层 邮政编码：100033 法定代表人：崔伟 成立日期：2004 年 6 月 11 日 批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字【2004】80 号 组织形式：有限责任公司 注册资本：**叁亿元人民币** **营业期限：2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日** 经营范围：基金募集、基金销售、资产管理**、从事境外证券投资管理业务**和中国证监会许可的其他业务 （二）基金托管人 名称：中国民生银行股份有限公司 住所：北京市西城区复兴门内大街 2 号 办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号 邮政编码：100031 法定代表人：**洪崎** 成立日期：1996 年 2 月 7 日

	政编码：100031 法定代表人：~~董文标~~ 成立日期：1996 年 2 月 7 日 基金托管业务批准文号：证监基金字[2004]101 号 组织形式：~~股份有限公司~~ 注册资本：28,365,585,227 元人民币 存续期间：持续经营 经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算； 办理票据承兑与贴现、发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事结汇、售汇业务；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项；保险兼业代理业务~~（有效期至 2014 年 02 月 18 日）~~；提供保管箱服务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。	基金托管业务批准文号：证监基金字[2004]101 号 组织形式：**其他股份有限公司（上市）** 注册资本：28,365,585,227 元人民币 存续期间：持续经营 经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算； 办理票据承兑与贴现、发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事结汇、售汇业务；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项；保险兼业代理业务**（有效期至2020年02月18日）**；提供保管箱服务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。
二、基金托管协议的依据、目的和原则	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金托管业务管理办法》、《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》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 7 号〈托管协议的内容与格式〉》等有关法律法规、基金合同及其他有关规定制订。	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金托管业务管理办法》、《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》”）**、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》**、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 7 号〈托管协议的内容与格式〉》等有关法律法规、基金合同及其他有关规定制订。

三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	（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，对基金投资范围、投资对象进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。 …… 本基金为【债券】型基金，投资组合比例为：【债券资产占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于信用债券和可转换债券的资产不低于非现金资产的 80%；股票等权益类资产占基金资产的比例不超过 20%，权证投资比例不超过基金资产净值的 3%；现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%。】	（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，对基金投资范围、投资对象进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的， 基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。 …… 本基金为【债券】型基金，投资组合比例为：【债券资产占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于信用债券和可转换债券的资产不低于非现金资产的 80%；股票等权益类资产占基金资产的比例不超过 20%，权证投资比例不超过基金资产净值的 3%；现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。】
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资、融券比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： 【1、本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于信用债券和可转换债券的资产不低于非现金资产的 80%；股票等权益类资产的投资比例合计不超过基金资产的 20%； 2、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； ……	（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资、融券比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： 【1、本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于信用债券和可转换债券的资产不低于非现金资产的 80%；股票等权益类资产的投资比例合计不超过基金资产的 20%； 2、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、应收申购款等； …… 10、本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部开放式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%； 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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资； 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基金合同约定的投资范围保持一致； 13、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。】 …… **除第 2、8、11、12 项外，**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。法律法规另有规定的，从其规定。
	10、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。】 …… 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。法律法规另有规定的，从其规定。	
八、基金资产净值计算和会计核算	（四）暂停估值与公告基金份额净值的情形 1.基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； 2.因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时； 3.中国证监会和基金合同认定的其他情形。	（四）暂停估值与公告基金份额净值的情形 1.基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； 2.因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时； **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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的；** 4.中国证监会和基金合同认定的其他情形。

东方永润债券型证券投资基金

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》

修改法律文件的情况说明

（一）《东方永润债券型证券投资基金基金合同》修改对照表

章节	原《基金合同》	《基金合同》修订后
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》”）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》”）、**《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》”）**和其他有关法律法规。
第二部分 释义		…… 12、《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 …… 48、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 基金份额的申购与赎回	五、申购和赎回的数量限制	五、申购和赎回的数量限制 …… 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与赎回	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 …… 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。 …… 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人的申购申请： …… ~~8、~~法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第1、2、3、5、6、~~7~~、8项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，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。	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 …… 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于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 日的投资者收取不低于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产**。 …… 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人的申购申请： …… **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。** **9、**法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第1、2、3、5、6、8、**9**项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，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。
第六部分基金份额的申购与赎回	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… ……	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… **6、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。** ……
第六部分基金份额	九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎	九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。

的申购与赎回	回。 …… …… ……	…… **（3）在出现巨额赎回且单个基金份额持有人当日的赎回申请超过前一开放日基金总份额 20%以上的情形时，对于该基金份额持有人当日申请赎回的超过前一开放日基金总份额 20%以上的基金份额，基金管理人有权全部自动进行延期办理；对于该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人可以根据前段“（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。但是，如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理部分的赎回申请将被撤销。** ……
第十二部分基金的投资	二、投资范围 …… 基金的投资组合比例为：债券资产占基金资产的比例不低于 80%；本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%。 ……	二、投资范围 …… 基金的投资组合比例为：债券资产占基金资产的比例不低于 80%；本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%**，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等**。 ……
第十二部分基金的投资	四、投资限制 1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： （1）本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%； （2）本基金每个交易日日终在扣除国债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%的现金或者到期日在一年以内的政府债券； ……	四、投资限制 1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： （1）本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%； （2）本基金每个交易日日终在扣除国债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、应收申购款等**； …… **（16）本基金管理人管理的全部开放式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%；** **（17）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、基金规模变动等本基金管理人之外的**

		因素致使本基金不符合前述比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资； **（18）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；** ~~（16）~~法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 因证券、期货市场波动、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，除上述第（12）项外，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。 ……
第十四部分 基金资产估值	六、暂停估值的情形 …… ~~3、~~中国证监会和基金合同认定的其它情形。	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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的；** 4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。
第十八部分 基金的信息披露	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》、**《流动性风险管理规定》**、《基金合同》及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的披露方式、登载媒介、报备方式等规定发生变化时，本基金从其最新规定。 …… 五、公开披露的基金信息 …… （四）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 …… 基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。 ~~报告期内出现单一投资者持有基金份额数比例超过基金份额 20%的情形，基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告“影响投资者~~	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》、**《流动性风险管理规定》**、《基金合同》及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的披露方式、登载媒介、报备方式等规定发生变化时，本基金从其最新规定。 …… 五、公开披露的基金信息 …… （四）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 …… 基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。 **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。**

	~~决策的其他重要信息”文件中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。~~ （五）临时报告 本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。 前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件： 1、基金份额持有人大会的召开； 2、终止《基金合同》； …… ~~26、~~中国证监会规定的其他事项。	**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基金定期报告“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。** （五）临时报告 本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。 前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件： 1、基金份额持有人大会的召开； 2、终止《基金合同》； …… **26、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；** **27、**中国证监会规定的其他事项。

（二）《东方永润债券型证券投资基金托管协议》修改对照表

章节	原《托管协议》	《托管协议》修订后
一、基金托管协议当事人	（二）基金托管人 名称：中国民生银行股份有限公司 …… 经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现、发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事结汇、售汇业务；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项；保险兼业代理业务~~（有效期至 2014 年 02 月 18 日）~~；提供保管箱服务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。	（二）基金托管人 名称：中国民生银行股份有限公司 …… 经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现、发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事结汇、售汇业务；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项；保险兼业代理业务**（有效期至 2020 年 02 月 18 日）**；提供保管箱服务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。
二、基金托	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以

管协议的依据、目的和原则	（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金托管业务管理办法》、《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》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第7号〈托管协议的内容与格式〉》等有关法律法规、基金合同及其他有关规定制订。	下简称“《基金法》”）、《证券投资基金托管业务管理办法》、《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》”）、**《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》**、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第7号〈托管协议的内容与格式〉》等有关法律法规、基金合同及其他有关规定制订。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	（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，对基金投资范围、投资对象进行监督。 …… 基金的投资组合比例为：债券资产占基金资产的比例不低于 80%；本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%。	（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，对基金投资范围、投资对象进行监督。 …… 基金的投资组合比例为：债券资产占基金资产的比例不低于80%；本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%**，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等**。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： 1、本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的80%； 2、本基金每个交易日日终在扣除国债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%的现金或者到期日在一年以内的政府债券； ……	（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： 1、本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的80%； 2、本基金每个交易日日终在扣除国债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、应收申购款等**； …… **16、本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部开放式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**

	~~16、~~法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 …… 因证券市场、期货市场波动、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，除上述第 12 项外，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。	30%； 17、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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资； 18、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； 19、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 …… 因证券市场、期货市场波动、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，除上述第 2、12、17、18 项外，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。
八、基金资产净值计算和会计核算	（四）暂停估值的情形 1.基金投资所涉及的证券、期货交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； 2.因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时； ~~3.~~中国证监会和基金合同认定的其他情形。	（四）暂停估值的情形 1.基金投资所涉及的证券、期货交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； 2.因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时； 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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的； 4.中国证监会和基金合同认定的其他情形。

东方新思路灵活配置混合型证券投资基金

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》

修改法律文件的情况说明

（一）《东方新思路灵活配置混合型证券投资基金基金合同》修改对照表

章节	原《基金合同》	《基金合同》修订后
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》”）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》”）、《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》”）和其他有关法律法规。
第二部分 释义		…… 13. 《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 …… 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 基金份额的申购与赎回	五、申购和赎回的数量限制	五、申购和赎回的数量限制 …… 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与赎回	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 …… 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。 ……	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 …… 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于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 日的投资者收取不低于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产**。 ……
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人的申购申请： …… ~~6、~~法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、5、~~6~~项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，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。	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人的申购申请： …… **6、接受某一投资者申购申请后导致其持有基金份额达到或超过基金总份额 50%的。** **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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。** 8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、5、**7、8** 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，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。
第六部分基金份额的申购与赎回	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… ……	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… **6、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。** ……
第六部分	九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式	九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式

基金份额的申购与赎回	当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。 …… …… ……	当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。 …… **（3）在出现巨额赎回且单个基金份额持有人当日的赎回申请超过上一开放日基金总份额 20%以上的情形时，对于该基金份额持有人当日申请赎回的超过上一开放日基金总份额 20%以上的基金份额，基金管理人有权全部自动进行延期办理；对于该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人可以根据前段“（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。但是，如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理部分的赎回申请将被撤销。** ……
第七部分基金合同当事人及权利义务	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 …… ~~注册资本：贰亿元人民币~~ ~~存续期限：50 年~~ ……	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 …… **注册资本：叁亿元人民币** **营业期限：2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日** ……
第七部分基金合同当事人及权利义务	二、基金托管人 （一） 基金托管人简况 …… 组织形式：股份有限公司 ……	二、基金托管人 （一） 基金托管人简况 …… 组织形式：**其他**股份有限公司**（上市）** ……
第十二部分基金的投资	二、投资范围 …… 股票资产占基金资产的比例为 0%-95%，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例按照法律法规或监管机构的规定执行；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，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%。	二、投资范围 …… 股票资产占基金资产的比例为 0%-95%，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例按照法律法规或监管机构的规定执行；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，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、应**

		收申购款等。
第十二部分 基金的投资	四、投资限制 1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： （1）本基金股票投资占基金资产的比例为 0%—95%； （2）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，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； …… ~~（18）~~法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 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。 ……	四、投资限制 1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： （1）本基金股票投资占基金资产的比例为 0%—95%； （2）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，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、应收申购款等； …… （18）本基金管理人管理的全部开放式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）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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，本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； （21）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 除第（2）、（12）、（19）、（20）项外，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。 ……
第十四部分 基金资产	六、暂停估值的情形 ……	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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的；

估值	~~3、~~中国证监会和基金合同认定的其它情形。	4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。
第十八部分 基金的信息披露	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》、**《流动性风险管理规定》、**《基金合同》及其他有关规定。 …… 五、公开披露的基金信息 …… （六）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 …… 基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。 （七）临时报告 本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书， 予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。 前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件： 1、基金份额持有人大会的召开； 2、终止《基金合同》； …… ~~27、~~中国证监会规定的其他事项。	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》、**《流动性风险管理规定》、**《基金合同》及其他有关规定。 …… 五、公开披露的基金信息 …… （六）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 …… 基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。 **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。** **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基金定期报告“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。** （七）临时报告 本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书， 予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。 前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件： 1、基金份额持有人大会的召开； 2、终止《基金合同》； …… **27、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；** 28、中国证监会规定的其他事项。

（二）《东方新思路灵活配置混合型证券投资基金托管协议》修改对照表

章节	原《托管协议》	《托管协议》修订后
一、基金托管协议当事人	（一）基金管理人 名称：东方基金管理有限责任公司 ~~注册地址~~：北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层 …… 注册资本：~~贰亿元人民币~~ ~~存续期限：50 年~~ 经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务 （二）基金托管人 名称：中国民生银行股份有限公司 ~~注册地址：~~北京市西城区复兴门内大街 2 号 …… 组织形式：股份有限公司 …… 经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算； 办理票据承兑与贴现、发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事结汇、售汇业务；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项；保险兼业代理业务~~（有效期至 2017 年 02 月 18 日）~~；提供保管箱服务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。	（一）基金管理人 名称：东方基金管理有限责任公司 **住所**：北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层 …… 注册资本：**叁亿元人民币** **营业期限：2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日** 经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、**从事境外证券投资管理业务**和中国证监会许可的其他业务 （二）基金托管人 名称：中国民生银行股份有限公司 **住所：**北京市西城区复兴门内大街 2 号 …… 组织形式：**其他**股份有限公司**（上市）** …… 经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算； 办理票据承兑与贴现、发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事结汇、售汇业务；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项；保险兼业代理业务**（有效期至 2020 年 02 月 18 日）**；提供保管箱服务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。
二、基金托管协议的依据、目的和原则	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、 《证券投资基金托管业务管理办法》、《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》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 7 号〈托管协议的内容与格式〉》等有关法律法规、基金合同及其他有关规定制订。	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、 《证券投资基金托管业务管理办法》、《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》”）、**《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》、**《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 7 号〈托管协议的内容与格式〉》等有关法律法规、基金合同及其他有关规定制订。

	（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，对基金投资范围、投资对象进行监督。 …… 本基金为混合型基金，投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%-95%，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例按照法律法规或监管机构的规定执行；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， 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%。	（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，对基金投资范围、投资对象进行监督。 …… 本基金为混合型基金，投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%-95%，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例按照法律法规或监管机构的规定执行；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， 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、应收申购款等**。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： 1、本基金股票投资占基金资产的比例为 0%—95%； 2、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，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； …… ~~18、~~法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 …… 因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规	（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： 1、本基金股票投资占基金资产的比例为 0%—95%； 2、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，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、应收申购款等**； …… **18、本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部开放式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、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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，本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；** **21、**法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 …… **除第 2、12、19、20 项外，**因证券市场或期货市场波

	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，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。	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，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。
八、基金资产净值计算和会计核算	（四）暂停估值与公告基金份额净值的情形 1. 基金投资所涉及的证券/期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； 2. 因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时； ~~3.~~中国证监会和基金合同认定的其他情形。	（四）暂停估值与公告基金份额净值的情形 1. 基金投资所涉及的证券/期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； 2. 因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时； **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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的；** **4.** 中国证监会和基金合同认定的其他情形。

东方金元宝货币市场基金

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》

修改法律文件的情况说明

（一）《东方金元宝货币市场基金基金合同》修改对照表

章节	原《基金合同》	《基金合同》修订后
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》”） 、《货币市场基金监督管理办法》、《关于实施＜货币市场基金监督管理办法＞有关问题的规定》、《证券投资基金信息披露编报规则第 5 号〈货币市场基金信息披露特别规定〉》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》”） 、《货币市场基金监督管理办法》、《关于实施＜货币市场基金监督管理办法＞有关问题的规定》、《证券投资基金信息披露编报规则第 5 号〈货币市场基金信息披露特别规定〉》**、《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》”）** 和其他有关法律法规。
第二部分 释义	……	…… **13、《流动性风险管理规定》：指《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作出的修订** …… **55、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）、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 基金份额的申购与赎回	五、申购和赎回的数量限制 ……	五、申购和赎回的数量限制 …… **6、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。具体规定请参见相关公**

		告。 ……
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 1、除法律法规另有规定或基金合同另有约定外，本基金不收取申购费用和赎回费用。 ~~2、~~发生本基金持有的现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计低于 5%且偏离度为负的情形时；对当日单个基金份额持有人申请赎回基金份额超过基金总份额 1%以上的赎回申请征收 1%的强制赎回费用，并将上述赎回费用全额计入基金财产。基金管理人与基金托管人协商确认上述做法无益于基金利益最大化的情形除外。	**六、申购和赎回的价格、费用及其用途** 1、除法律法规另有规定或基金合同另有约定外，本基金不收取申购费用和赎回费用。**但是，出现以下情形之一：** **（1）**发生本基金持有的现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计低于 5%且偏离度为负的情形时； **（2）当本基金前 10 名基金份额持有人的持有份额合计超过基金总份额 50%，且本基金投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计低于 10%且偏离度为负时。** **基金管理人应当**对当日单个基金份额持有人申请赎回基金份额超过基金总份额 1%以上的赎回申请征收 1%的强制赎回费用，并将上述赎回费用全额计入基金财产。基金管理人与基金托管人协商确认上述做法无益于基金利益最大化的情形除外。
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 …… ~~10、~~法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、4、5、8、9、~~10~~项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，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。	七、拒绝或暂停申购的情形 …… **10、接受某一投资者申购申请后导致其份额达到或超过基金总份额 50%以上的。** **11、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。** 12、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、4、5、8、9、**11、12** 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，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。
第六部分 基金份额	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 ……	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… **9、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出**

的申购与赎回	……	**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。** ……
第六部分基金份额的申购与赎回	九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 …… …… ……	九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 …… **（3）在出现巨额赎回且单个基金份额持有人当日的赎回申请超过上一日基金总份额20%以上的情形时，对于该基金份额持有人当日申请赎回的超过上一日基金总份额 20%以上的基金份额，有权全部自动进行延期办理；对于该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人可以根据前段“（1）全部赎回”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。但是，如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理部分的赎回申请将被撤销。** ……
第七部分基金合同当事人及权利义务	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 …… ~~注册资本：贰亿元人民币~~ ~~存续期限：50 年~~	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 …… **注册资本：叁亿元人民币** **营业期限：2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日**
第十二部分基金的投资	四、投资限制 …… 2、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： （1）本基金投资组合的平均剩余期限不得超过 120 天，平均剩余存续期不得超过 240 天； …… （5）本基金应保持足够比例的流动性资产以应对潜在的赎回要求，其投资组合应当符合下列规定： 1）现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券占基金资产净值的比例合计不得低于 5%；	四、投资限制 …… 2、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： （1）**正常情况下，**本基金投资组合的平均剩余期限不得超过 120 天，平均剩余存续期不得超过 240 天； …… （5）本基金应保持足够比例的流动性资产以应对潜在的赎回要求，其投资组合应当符合下列规定： 1）现金**（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）**、国债、中央银行票据、政策性金融债券占基金资产净值的比例合计不得低于 5%；

	2）现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及五个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 10%； …… …… …… ……	2）现金**（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）**、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及五个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 10%； …… **（14）本基金拟投资于主体信用评级低于 AA+的商业银行的银行存款与同业存单的，应当经基金管理人董事会审议批准，相关交易应当事先征得基金托管人的同意；** **（15）本基金管理人管理的全部货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券，不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的 10%；** **（16）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、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；** **（17）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；** **（18）本基金根据份额持有人集中度情况对货币市场基金的投资组合实施调整，并遵守以下要求：** **①当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 50%时，本基金投资组合的平均剩余期限不得超过 60 天，平均剩余存续期不得超过 120 天；投资组合中现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 30%；** **②当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 20%时，本基金投资组合的平均剩余期限不得超过 90 天，平均剩余存续期不得超过 180 天；投资组合中现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 20%；** **（19）本基金投资于主体信用评级低于 AAA 的机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超**

	~~（14）~~中国证监会规定的其他比例限制。 除法律法规另有规定或上述另有约定外，因证券市场波动、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。	**过10%，其中单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过2%；前述金融工具包括银行存款、同业存单、相关机构作为原始权益人的资产支持证券及中国证监会认定的其他品种；** **（20）**中国证监会规定的其他比例限制。 除法律法规另有规定或上述另有约定外，因证券市场波动、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比例不符合上述规定投资比例的，**除上述第（5）之1）、（11）、（16）、（17）项外，**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。
第十四部分 基金资产估值	六、暂停估值的情形 1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； 2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时； ~~3、~~中国证监会和基金合同认定的其它情形。	六、暂停估值的情形 1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； 2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时； **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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的；** **4、**中国证监会和基金合同认定的其它情形。
第十八部分 基金的信息披露	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。 …… 日每万份基金已实现收益＝当日~~该类~~基金份额的已实现收益/当日~~该类~~基金份额总额×10000 …… 五、公开披露的基金信息 …… （五）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 基金管理人应当在每年结束之日起90日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定媒介上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。	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》、**《流动性风险管理规定》、**《基金合同》及其他有关规定。 …… 日每万份基金已实现收益＝当日基金份额的已实现收益/当日基金份额总额×10000 …… 五、公开披露的基金信息 …… （五）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 基金管理人应当在每年结束之日起90日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定媒介上。基金年度报告的

	基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定媒介上。 基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定媒介上。 《基金合同》生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。 基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。 （六）临时报告 本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。 前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金资产净值产生重大影响的下列事件： 1、基金份额持有人大会的召开； 2、终止《基金合同》； …… ~~26、当“影子定价”确定的基金资产净值与“摊余成本法”计算的基金资产净值的负偏离度绝对值达到 0.25%或正负偏离度绝对值达到 0.5%的情形；当“影子定价”确定的基金资产净值与“摊余成本法”计算的基~~	财务会计报告应当经过审计。 基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定媒介上。 基金管理人应当在每个季度结束之日起15个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定媒介上。 《基金合同》生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。 基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。 **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，并至少披露报告期末基金前 10 名份额持有人的类别、持有份额及占总份额的比例等信息。** **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。** （六）临时报告 本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。 前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金资产净值产生重大影响的下列事件： 1、基金份额持有人大会的召开； 2、终止《基金合同》； …… **26、当“摊余成本法”计算的基金资产净值与“影子定价”确定的基金资产净值偏离度绝对值达到或超过 0.5%的情形；** **27、发生涉及本基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项；** **28、本基金投资于主体信用评级低于 AA+的商业**

	~~金资产净值连续 2 个交易日出现负偏离度绝对值达到 0.5%的情形，~~ ~~27、~~中国证监会规定的其他事项。	银行的银行存款与同业存单的； 29、中国证监会规定的其他事项。

（二）《东方金元宝货币市场基金托管协议》修改对照表

章节	原《托管协议》	《托管协议》修订后
一、基金托管协议当事人	（一）基金管理人 名称：东方基金管理有限责任公司 …… 注册资本：~~贰亿元人民币~~ ~~存续期间：50 年~~ …… （二）基金托管人 名称：中国民生银行股份有限公司 …… 经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现、发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事结汇、售汇业务；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项；保险兼业代理业务~~（有效期至 2017 年 02 月 18 日）~~；提供保管箱服务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。	（一）基金管理人 名称：东方基金管理有限责任公司 …… 注册资本：叁亿元人民币 营业期限：2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日 …… （二）基金托管人 名称：中国民生银行股份有限公司 …… 经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现、发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事结汇、售汇业务；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项；保险兼业代理业务（有效期至 2020 年 02 月 18 日）；提供保管箱服务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。
二、基金托管协议的依据、目的和原则	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金托管业务管理办法》、《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》”）、《货币市场基金监督管理办法》、《关于实施＜货币市场基金监督管理办法＞有关问题的规定》、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 7 号〈托管协议的内容与格式〉》等有关法律法规、基金合同及其他有关规定制订。	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金托管业务管理办法》、《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》”）、《货币市场基金监督管理办法》、《关于实施＜货币市场基金监督管理办法＞有关问题的规定》、《证券投资基金信息披露管理办法》（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“《流动性风险管理规定》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 7 号〈托管协议的内容与格式〉》等有关法律法规、基金合同及其他有关规定制订。

三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： 2、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： （1）本基金投资组合的平均剩余期限不得超过 120 天；平均剩余存续期不得超过 240 天； …… （5）本基金应保持足够比例的流动性资产以应对潜在的赎回要求，其投资组合应当符合下列规定： 1）现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券占基金资产净值的比例合计不得低于 5%； 2）现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及五个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 10%； 4）除发生巨额赎回情形、连续 3 个交易日累计赎回 20%以上或者连续 5 个交易日累计赎回 30%以上的外，本基金债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%； ……	（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： 2、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： （1）**正常情况下，**本基金投资组合的平均剩余期限不得超过 120 天；平均剩余存续期不得超过 240 天； …… （5）本基金应保持足够比例的流动性资产以应对潜在的赎回要求，其投资组合应当符合下列规定： 1）现金**（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）**、国债、中央银行票据、政策性金融债券占基金资产净值的比例合计不得低于 5%； 2）现金**（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）**、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及五个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 10%； 4）除发生巨额赎回情形、连续 3 个交易日累计赎回 20%以上或者连续 5 个交易日累计赎回 30%以上的**情形**外，本基金债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%； …… **（13）本基金拟投资于主体信用评级低于 AA+的商业银行的银行存款与同业存单的，应当经基金管理人董事会审议批准，相关交易应当事先征得基金托管人的同意；** **（14）本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券，不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的 10%；** **（15）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、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；** **（16）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；**

		（17）本基金根据份额持有人集中度情况对货币市场基金的投资组合实施调整，并遵守以下要求： ①当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 50%时，本基金投资组合的平均剩余期限不得超过 60 天，平均剩余存续期不得超过 120 天；投资组合中现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 30%； ②当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 20%时，本基金投资组合的平均剩余期限不得超过 90 天，平均剩余存续期不得超过 180 天；投资组合中现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 20%； （18）本基金投资于主体信用评级低于 AAA 的机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 10%，其中单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 2%；前述金融工具包括银行存款、同业存单、相关机构作为原始权益人的资产支持证券及中国证监会认定的其他品种；
	~~（13）~~中国证监会规定的其他比例限制。 如果法律法规或监管部门对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，在履行适当程序后本基金投资不再受相关限制。 基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。 除法律法规另有规定或上述另有约定外，因证券市场波动、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。	（19）中国证监会规定的其他比例限制。 如果法律法规或监管部门对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，在履行适当程序后本基金投资不再受相关限制。 基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。 除法律法规另有规定或上述另有约定外，因证券市场波动、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比例不符合上述规定投资比例的，**除上述第（5）之 1）、（10）、（15）、（16）项外，**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。

八、基金资产净值计算和会计核算	…… 日每万份基金已实现收益＝当日~~该类~~基金份额的已实现收益/当日~~该类~~基金份额总额×10000 …… （四）暂停估值的情形 2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；	…… 日每万份基金已实现收益＝当日基金份额的已实现收益/当日基金份额总额×10000 …… （四）暂停估值的情形 2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时； **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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的；**

东方金证通货币市场基金

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》

修改法律文件的情况说明

（一）《东方金证通货币市场基金基金合同》修改对照表

章节	原《基金合同》	《基金合同》修订后
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》”）、《货币市场基金监督管理办法》、《关于实施＜货币市场基金监督管理办法＞有关问题的规定》、《证券投资基金信息披露编报规则第 5 号〈货币市场基金信息披露特别规定〉》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》”）、《货币市场基金监督管理办法》**、《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“《流动性风险管理规定》”）**、《关于实施＜货币市场基金监督管理办法＞有关问题的规定》、《证券投资基金信息披露编报规则第 5 号〈货币市场基金信息披露特别规定〉》和其他有关法律法规。
第二部分 释义		…… **13、《流动性风险管理规定》：指《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作出的修订** …… **55、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）、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 基金份额的申购与赎回	五、申购和赎回的数量限制	五、申购和赎回的数量限制 …… **6、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。具体规定请参见相关公告。** ……

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 1、除法律法规另有规定或基金合同另有约定外，本基金不收取申购费用和赎回费用。 ~~2、~~发生本基金持有的现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计低于 5%且偏离度为负的情形时；对当日单个基金份额持有人申请赎回基金份额超过基金总份额 1%以上的赎回申请征收 1%的强制赎回费用，并将上述赎回费用全额计入基金财产。基金管理人与基金托管人协商确认上述做法无益于基金利益最大化的情形除外。	**六、申购和赎回的价格、费用及其用途** 1、除法律法规另有规定或基金合同另有约定外，本基金不收取申购费用和赎回费用。**但是，出现以下情形之一：** **（1）**发生本基金持有的现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计低于 5%且偏离度为负的情形时； **（2）当本基金前 10 名基金份额持有人的持有份额合计超过基金总份额 50%，且本基金投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计低于 10%且偏离度为负时。** **基金管理人应当**对当日单个基金份额持有人申请赎回基金份额超过基金总份额 1%以上的赎回申请征收 1%的强制赎回费用，并将上述赎回费用全额计入基金财产。基金管理人与基金托管人协商确认上述做法无益于基金利益最大化的情形除外。
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 …… ~~10、~~法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、4、5、8、9、~~10~~项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，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。	七、拒绝或暂停申购的情形 …… **10、接受某一投资者申购申请后导致其份额达到或超过基金总份额 50%以上的。** **11、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。** **12、**法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、4、5、8、9、**11、12** 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，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。
第六部分基金份额的申购与	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 ……	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… **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**

赎回	…… ……	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。 ……
第六部分 基金份额的申购与赎回	九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 …… …… ……	九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 …… （3）在出现巨额赎回且单个基金份额持有人当日的赎回申请超过上一日基金总份额 20%以上的情形时，对于该基金份额持有人当日申请赎回的超过上一日基金总份额 20%以上的基金份额，有权全部自动进行延期办理；对于该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人可以根据前段“（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。但是，如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理部分的赎回申请将被撤销。 ……
第七部分 基金合同当事人及权利义务	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 …… ~~注册资本：贰亿元人民币~~ ~~存续期限：50 年~~	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 …… 注册资本：叁亿元人民币 营业期限：2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日
第七部分 基金合同当事人及权利义务	二、基金托管人 （一） 基金托管人简况 …… 组织形式：股份有限公司	二、基金托管人 （一） 基金托管人简况 …… 组织形式：其他股份有限公司（上市）
第十二部分	四、投资限制 …… 2、组合限制	四、投资限制 …… 2、组合限制

基金的投资	基金的投资组合应遵循以下限制： （1）本基金投资组合的平均剩余期限不得超过 120 天，平均剩余存续期不得超过 240 天； …… （5)本基金应保持足够比例的流动性资产以应对潜在的赎回要求，其投资组合应当符合下列规定： 1）现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券占基金资产净值的比例合计不得低于 5%； 2）现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及五个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 10%； …… …… ……

		过基金总份额的 20%时，本基金投资组合的平均剩余期限不得超过 90 天，平均剩余存续期不得超过 180 天；投资组合中现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 20%； （19）本基金投资于主体信用评级低于 AAA 的机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 10%，其中单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 2%；前述金融工具包括银行存款、同业存单、相关机构作为原始权益人的资产支持证券及中国证监会认定的其他品种； ~~（14）~~中国证监会规定的其他比例限制。 （20）法律法规及中国证监会规定的其他比例限制。 因市场波动、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以上规定投资比例的，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。 除上述第（5）之 1）、（11）、（16）、（17）项外，因市场波动、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以上规定投资比例的，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。 基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。 基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。 法律法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按调整后的规定执行。 法律法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按调整后的规定执行。
第十四部分 基金资产估值	六、暂停估值的情形 1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； 2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；	六、暂停估值的情形 1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； 2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时； 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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的；
第十八部分 基金	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。 ……	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》、《流动性风险管理规定》、《基金合同》及其他有关规定。 ……

的信息披露	五、公开披露的基金信息 …… （五）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 基金管理人应当在每年结束之日起90日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定媒介上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。 基金管理人应当在上半年结束之日起60日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定媒介上。 基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定媒介上。 《基金合同》生效不足2个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。 基金定期报告在公开披露的第2个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。 （六）临时报告 本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在2日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。 前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人	五、公开披露的基金信息 …… （五）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 基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定媒介上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。 基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定媒介上。 基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定媒介上。 《基金合同》生效不足2个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。 基金定期报告在公开披露的第2个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。 **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，并至少披露报告期末基金前 10 名份额持有人的类别、持有份额及占总份额的比例等信息。** **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。** （六）临时报告 本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在2日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。 前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金资产净值产生重大影响的下列事件： 1、基金份额持有人大会的召开； 2、终止《基金合同》； ……

	权益或者基金资产净值产生重大影响的下列事件： 1、基金份额持有人大会的召开； 2、终止《基金合同》； …… ~~26、当“影子定价”确定的基金资产净值与“摊余成本法”计算的基金资产净值的负偏离度绝对值达到0.25%或正负偏离度绝对值达到0.5%的情形；当“影子定价”确定的基金资产净值与“摊余成本法”计算的基金资产净值连续2个交易日出现负偏离度绝对值达到0.5%的情形；~~ ~~27、~~中国证监会规定的其他事项。	**26、当“摊余成本法”计算的基金资产净值与“影子定价”确定的基金资产净值偏离度绝对值达到或超过0.5%的情形；** **27、发生涉及本基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项；** **28、本基金投资于主体信用评级低于AA+的商业银行的银行存款与同业存单的；** **29、**中国证监会规定的其他事项。

（二）《东方金证通货币市场基金托管协议》修改对照表

章节	原《托管协议》	《托管协议》修订后
一、基金托管协议当事人	（一）基金管理人 名称：东方基金管理有限责任公司 …… 注册资本：~~贰亿元人民币~~ ~~存续期间：50年~~ …… （二）基金托管人 名称：中国民生银行股份有限公司 …… 组织形式：股份有限公司 经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现、发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事结汇、售汇业务；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项；保险兼业代理业务~~（有效期至2017年02月18日）~~；提供保管箱服务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。	（一）基金管理人 名称：东方基金管理有限责任公司 …… 注册资本：**叁亿元人民币** **营业期限：2004年6月11日至2054年6月10日** …… （二）基金托管人 名称：中国民生银行股份有限公司 …… 组织形式：**其他**股份有限公司**（上市）** 经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现、发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事结汇、售汇业务；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项；保险兼业代理业务**（有效期至2020年02月18日）**；提供保管箱服务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。
二、基金托管协议的依据、目的和原则	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金托管业务管理办法》、《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》”）、《货币市场基金监督管理办法》、《关于实施＜货币市场基金监督管理办法＞有关问题的规定》、《证券投资基金信息披露管理办法》	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金托管业务管理办法》、《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》”）、《货币市场基金监督管理办法》、《关于实施＜货币市场基金监督管理办法＞有关问题的规定》、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简

	（以下简称“《信息披露办法》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 7 号〈托管协议的内容与格式〉》等有关法律法规、基金合同及其他有关规定制订。	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》、**《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 7 号〈托管协议的内容与格式〉》等有关法律法规、基金合同及其他有关规定制订。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： 2、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： （1）本基金投资组合的平均剩余期限不得超过 120 天；平均剩余存续期不得超过 240 天； …… （5）本基金应保持足够比例的流动性资产以应对潜在的赎回要求，其投资组合应当符合下列规定： 1）现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券占基金资产净值的比例合计不得低于 5%； 2）现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及五个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 10%； 4）除发生巨额赎回情形、连续 3 个交易日累计赎回 20%以上或者连续 5 个交易日累计赎回 30%以上的外，本基金债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%； ……	（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： 2、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： （1）**正常情况下，**本基金投资组合的平均剩余期限不得超过 120 天；平均剩余存续期不得超过 240 天； …… （5）本基金应保持足够比例的流动性资产以应对潜在的赎回要求，其投资组合应当符合下列规定： 1）现金**（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）**、国债、中央银行票据、政策性金融债券占基金资产净值的比例合计不得低于 5%； 2）现金**（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）**、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及五个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 10%； 4）除发生巨额赎回情形、连续 3 个交易日累计赎回 20%以上或者连续 5 个交易日累计赎回 30%以上的**情形**外，本基金债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%； …… **（13）本基金拟投资于主体信用评级低于 AA+的商业银行的银行存款与同业存单的，应当经基金管理人董事会审议批准，相关交易应当事先征得基金托管人的同意；** **（14）本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券，不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的 10%；** **（15）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、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；** **（16）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； （17）本基金根据份额持有人集中度情况对货币市场基金的投资组合实施调整，并遵守以下要求： ①当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 50%时，本基金投资组合的平均剩余期限不得超过 60 天，平均剩余存续期不得超过 120 天；投资组合中现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 30%； ②当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 20%时，本基金投资组合的平均剩余期限不得超过 90 天，平均剩余存续期不得超过 180 天；投资组合中现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 20%； （18）本基金投资于主体信用评级低于 AAA 的机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 10%，其中单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 2%；前述金融工具包括银行存款、同业存单、相关机构作为原始权益人的资产支持证券及中国证监会认定的其他品种；
	~~（13）~~中国证监会规定的其他比例限制。 如果法律法规或监管部门对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，在履行适当程序后本基金投资不再受相关限制。 基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。 除法律法规另有规定或上述另有约定外，因证券市场波动、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	（19）中国证监会规定的其他比例限制。 如果法律法规或监管部门对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，在履行适当程序后本基金投资不再受相关限制。 基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。 除上述第（5）之 1）、（10）、（15）、（16）项外，除法律法规另有规定或上述另有约定外，因证券市场波动、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

	有规定的，从其规定。	监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。
八、基金资产净值计算和会计核算	（四）暂停估值的情形 2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时； …… 	（四）暂停估值的情形 2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时； **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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的；** ……

东方盛世灵活配置混合型证券投资基金

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》

修改法律文件的情况说明

（一）《东方盛世灵活配置混合型证券投资基金基金合同》修改对照表

章节	原《基金合同》	《基金合同》修订后
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》”）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》”）、《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》”）和其他有关法律法规。
第二部分 释义		…… 13、《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 …… 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 基金份额的申购与赎回	五、申购和赎回的数量限制	五、申购和赎回的数量限制 …… 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与赎回	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 …… 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。 ……	**六、申购和赎回的价格、费用及其用途** …… 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于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 日的投资者收取不低于1.5%的赎回费并全额计入基金财产**。 ……
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 …… 5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或出现其他损害现有基金份额持有人利益的情形。 ~~6、~~法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、5、~~6~~项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，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。	七、拒绝或暂停申购的情形 …… 5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或出现其他损害现有基金份额持有人利益的情形。 **6、接受某一投资者申购申请后导致其持有基金份额达到或超过基金总份额 50%的。** **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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。** 8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、5、**7、8** 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，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。
第六部分基金份额的申购与赎回	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 ……	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… **6、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。**

		……
第六部分基金份额的申购与赎回	九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。 …… ……	九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。 …… **（3）在出现巨额赎回且单个基金份额持有人当日的赎回申请超过上一开放日基金总份额 20%以上的情形时，对于该基金份额持有人当日申请赎回的超过上一开放日基金总份额 20%以上的基金份额，基金管理人有权全部自动进行延期办理；对于该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人可以根据前段“（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。但是，如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理部分的赎回申请将被撤销。** ……
第七部分基金合同当事人及权利义务	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 …… ~~注册资本：贰亿元人民币~~ ……	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 …… **注册资本：叁亿元人民币** ……
第七部分基金合同当事人及权利义务	二、基金托管人 （一） 基金托管人简况 …… 组织形式：股份有限公司	二、基金托管人 （一） 基金托管人简况 …… 组织形式：**其他**股份有限公司**（上市）**
第十二部分基金	二、投资范围 …… 基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%-95%，投资于权证的比例不超过基金资产净	二、投资范围 …… 基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%-95%，投资于权证的比例不超过基金资产

的投资	值的 3%；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，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%。	净值的 3%；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，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、应收申购款等**。
第十二部分基金的投资	四、投资限制 …… （2）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，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； …… ~~（17）~~法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 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。	四、投资限制 …… （2）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，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、应收申购款等**； …… **（18）本基金管理人管理的全部开放式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）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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，本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；** **（21）**法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 **除第（2）、（12）、（19）、（20）项外，**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。
第十四部分基金资产估值	六、暂停估值的情形 ……	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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的；**

	~~3、~~中国证监会和基金合同认定的其它情形。	4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。
第十八部分 基金的信息披露	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。 …… 五、公开披露的基金信息 …… （六）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 …… 基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。 （七）临时报告 本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。 前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件： 1、基金份额持有人大会的召开； 2、终止《基金合同》； …… ~~26、~~中国证监会规定的其他事项。	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》**、《流动性风险管理规定》、**《基金合同》及其他有关规定。 …… 五、公开披露的基金信息 …… （六）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 …… 基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。 **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。** **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基金定期报告“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。** （七）临时报告 本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。 前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件： 1、基金份额持有人大会的召开； 2、终止《基金合同》； …… **26、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；** 27、中国证监会规定的其他事项。

（二）《东方盛世灵活配置混合型证券投资基金托管协议》修改对照表

章节	原《托管协议》	《托管协议》修订后
一、基金托管协议当事人	（一）基金管理人 名称：东方基金管理有限责任公司 ~~注册地址：~~北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层 …… 注册资本：~~贰亿元人民币~~ …… （二）基金托管人 名称：中国民生银行股份有限公司 ~~注册地址：~~北京市西城区复兴门内大街 2 号 …… 组织形式：股份有限公司 …… 经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现、发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事结汇、售汇业务；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项；保险兼业代理业务~~（有效期至 2017 年 02 月 18 日）~~；提供保管箱服务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。	（一）基金管理人 名称：东方基金管理有限责任公司 **住所：**北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层 …… 注册资本：**叁亿元人民币** …… （二）基金托管人 名称：中国民生银行股份有限公司 **住所：**北京市西城区复兴门内大街 2 号 …… 组织形式：**其他**股份有限公司**（上市）** …… 经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现、发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事结汇、售汇业务；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项；保险兼业代理业务**（有效期至 2020 年 02 月 18 日）**；提供保管箱服务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。
二、基金托管协议的依据、目的和原则	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金托管业务管理办法》、《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》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 7 号〈托管协议的内容与格式〉》等有关法律法规、基金合同及其他有关规定制订。	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金托管业务管理办法》、《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》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 7 号〈托管协议的内容与格式〉》等有关法律法规、基金合同及其他有关规定制订。
三、基金托管人对基	（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，对基金投资范围、投资对象进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品	（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，对基金投资范围、投资对象进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资

金管理人的业务监督和核查	种池，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。 …… 基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%-95%，投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%；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，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%。 （二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： 1、本基金股票投资占基金资产的比例为 0%—95%； 2、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，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； ……

	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，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。	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，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。
八、基金资产净值计算和会计核算	（四）暂停估值与公告基金份额净值的情形 1. 基金投资所涉及的证券/期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； 2. 因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时； ~~3.~~中国证监会和基金合同认定的其他情形。	（四）暂停估值与公告基金份额净值的情形 1. 基金投资所涉及的证券/期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； 2. 因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时； **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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的；** **4.** 中国证监会和基金合同认定的其他情形。

东方永兴 18 个月定期开放债券型证券投资基金

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》

修改法律文件的情况说明

（一）《东方永兴 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》修改对照表

章节	原《基金合同》	《基金合同》修订后
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》”）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》”）**、《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》”）**和其他有关法律法规。
第二部分 释义		…… **13、《流动性风险管理规定》：指《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作出的修订** …… **50、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）、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 基金份额的申购与赎回	五、申购和赎回的数量限制	五、申购和赎回的数量限制 …… **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	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 ……	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 ……

基金份额的申购与赎回	5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。 ……	5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于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 日的投资者收取不低于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产**。 ……
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 …… ~~7、~~法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、5、6、~~7~~项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，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。	七、拒绝或暂停申购的情形 …… **7、接受某一投资者申购申请后导致其持有基金份额达到或超过基金总份额 50%的。** **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。** 9、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、5、6、8、9 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，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。
第六部分基金份额的申购与赎回	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… ……	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… **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，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。** ……
第六部分基金份额的申购与赎回	九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。 ……	九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。 …… **（3）开放期内，在出现巨额赎回且单个基金份额持有人当日的赎回申请超过上一日基金总份额 20%以上**

	……	**的情形时，对于该基金份额持有人当日申请赎回的超过上一日基金总份额 20%以上的基金份额，基金管理人有权全部自动进行延期办理，如延期办理期限超过开放期的，开放期相应延长，延长的开放期内不办理申购，亦不接受新的赎回申请，即基金管理人仅为原开放期内因提交赎回申请超过基金总份额 20%以上而被延期办理赎回的单个基金份额持有人办理赎回业务；对于该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人可以根据前段“（1）全部赎回”或“（2）延缓支付赎回款项”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。但是，如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理部分的赎回申请将被撤销。** ……
第七部分 基金合同当事人及权利义务	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 …… ~~注册资本：贰亿元人民币~~ ~~存续期限：50 年~~ ……	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 …… **注册资本：叁亿元人民币** **营业期限：2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日** ……
第十二部分 基金的投资	二、投资范围 …… 基金的投资组合比例为：债券资产占基金资产的比例不低于 80%，但在每个开放期前三个月、开放期间及开放期结束后三个月内，基金投资不受上述比例限制（基金管理人可根据实际情况对上述期间适当调整）；本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过本基金资产净值的 10%；开放期间，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，在封闭期内，本基金不受该比例限制**，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等**。 ……	二、投资范围 …… 基金的投资组合比例为：债券资产占基金资产的比例不低于 80%，但在每个开放期前三个月、开放期间及开放期结束后三个月内，基金投资不受上述比例限制（基金管理人可根据实际情况对上述期间适当调整）；本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过本基金资产净值的 10%；开放期间，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，在封闭期内，本基金不受该比例限制**，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等**。 ……
第十二部分 基金	四、投资限制 …… （2）开放期间，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净	四、投资限制 …… （2）开放期间，每个交易日日终在扣除国债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

的投资	值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，在封闭期内，本基金不受该比例限制； …… ~~（15）~~法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 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比例不符合上述规定投资比例的，除第（9）项外，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。	5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；在封闭期内，本基金不受该比例限制**，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等**； …… **（15）在开放期，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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；** **（16）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；** **（17）**法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 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比例不符合上述规定投资比例的，除第**（2）、**（9）**、（15）、（16）**项外，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。
第十四部分 基金资产估值	六、暂停估值的情形 1、基金投资所涉及的证券/期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； 2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时； ~~3、~~中国证监会和基金合同认定的其它情形。	六、暂停估值的情形 1、基金投资所涉及的证券/期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； 2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时； **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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的；** **4、**中国证监会和基金合同认定的其它情形。
第十八部分 基金的信息披露	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。 …… 五、公开披露的基金信息 …… （六）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 ……	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》**、《流动性风险管理规定》、**《基金合同》及其他有关规定。 …… 五、公开披露的基金信息 …… （六）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 ……

	基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。 （七）临时报告 本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。 前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件： 1、基金份额持有人大会的召开； 2、终止《基金合同》； …… ~~27、~~中国证监会规定的其他事项。	基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。 **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。** **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基金定期报告“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。** （七）临时报告 本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。 前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件： 1、基金份额持有人大会的召开； 2、终止《基金合同》； …… **27、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；** 28、中国证监会规定的其他事项。

（二）《东方永兴 18 个月定期开放债券型证券投资基金托管协议》修改对照表

章节	原《托管协议》	《托管协议》修订后
一、基金托管协议当事人	（一）基金管理人 名称：东方基金管理有限责任公司 …… 注册资本：~~贰亿元人民币~~ ~~存续期间：50 年~~ 经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、从事境外证券投资管理业务和中国证监会许可的其他业务	（一）基金管理人 名称：东方基金管理有限责任公司 …… 注册资本：**叁亿元人民币** **营业期限：2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日** 经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、从事境外证券投资管理业务和中国证监会许可的其他业务 （二）基金托管人 名称：中国民生银行股份有限公司

	（二）基金托管人 名称：中国民生银行股份有限公司 …… 经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现、发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事结汇、售汇业务；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项；保险兼业代理业务~~（有效期至 2017 年 02 月 18 日）~~；提供保管箱服务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。	…… 经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现、发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事结汇、售汇业务；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项；保险兼业代理业务**（有效期至 2020 年 02 月 18 日）**；提供保管箱服务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。
二、基金托管协议的依据、目的和原则	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金托管业务管理办法》、《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》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 7 号〈托管协议的内容与格式〉》等有关法律法规、基金合同及其他有关规定制订。	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金托管业务管理办法》、《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》”）、**《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》”）、**《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 7 号〈托管协议的内容与格式〉》等有关法律法规、基金合同及其他有关规定制订。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	…… 本基金为债券型基金，投资组合比例为：债券资产占基金资产的比例不低于 80%，但在每个开放期前三个月、开放期间及开放期结束后三个月内，基金投资不受上述比例限制（基金管理人可根据实际情况对上述期间适当调整）；本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过本基金资产净值的 10%；开放期间，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，在封闭期内，本基金不受该比例限制**，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等**。 ……	…… 本基金为债券型基金，投资组合比例为：债券资产占基金资产的比例不低于 80%，但在每个开放期前三个月、开放期间及开放期结束后三个月内，基金投资不受上述比例限制（基金管理人可根据实际情况对上述期间适当调整）；本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过本基金资产净值的 10%；开放期间，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，在封闭期内，本基金不受该比例限制**，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等**。 ……
三、基金托管人对基	（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： ……	（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： ……

金管理人的业务监督和核查	（2）开放期内，每个交易日日终在扣除国债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%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；在封闭期内，本基金不受该比例限制； …… ~~（13）~~法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制 …… 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比例不符合上述规定投资比例的，除第（7）项外，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。	（2）开放期内，每个交易日日终在扣除国债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%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；在封闭期内，本基金不受该比例限制**，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等**； …… **（13）在开放期，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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；** **（14）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；** **（15）**法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制 …… 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比例不符合上述规定投资比例的，除第**（2）、**（7）**、（13）、（14）**项外，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。
八、基金资产净值计算和会计核算	（四）暂停估值的情形 1.基金投资所涉及的证券/期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； 2.因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时； ~~3.~~中国证监会和基金合同认定的其他情形。	（四）暂停估值的情形 1.基金投资所涉及的证券/期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； 2.因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时； **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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的；** 4.中国证监会和基金合同认定的其他情形。

东方民丰回报赢安混合型证券投资基金

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》

修改法律文件的情况说明

（一）《东方民丰回报赢安混合型证券投资基金基金合同》修改对照表

章节	原《基金合同》	《基金合同》修订后
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》”）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》”）、**《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》”）**和其他有关法律法规。
第二部分 释义		…… **12、《流动性风险管理规定》：指《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》** …… **50、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 基金份额的申购与赎回	五、申购和赎回的数量限制	五、申购和赎回的数量限制 …… **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。具体规定请参见相关公告。** ……
第六部分	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 ……	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 ……

基金份额的申购与赎回	5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。 ……	5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于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 日的投资者收取不低于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产**。 ……
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 …… ~~7、~~法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、5、7、~~8~~项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，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。	七、拒绝或暂停申购的情形 …… **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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。** 8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、5、7、8 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，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。
第六部分基金份额的申购与赎回	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… ……	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… **6、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。** ……
第六部分基金份额的申购与赎回	九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 ……	九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 …… **（3）在出现巨额赎回且单个基金份额持有人当日的赎回申请超过上一开放日基金总份额 20%以上的情形时，对于该基金份额持有人当日申请赎回的超过上一开放日基金总份额 20%以上的基金份额，基金管理人有权全部自动进行延期办理；对于该基金份额持有人未超过上述比例**

	……	的部分，基金管理人可以根据前段“（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。但是，如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理部分的赎回申请将被撤销。 ……
第七部分 基金合同当事人及权利义务	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 …… ~~注册资本：贰亿元人民币~~ ……	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 …… 注册资本：叁亿元人民币 ……
第十二部分 基金的投资	二、投资范围 …… 基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例不高于 40%，投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，持有现金或投资于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%。 ……	二、投资范围 …… 基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例不高于 40%，投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，持有现金或投资于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%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。 ……
第十二部分 基金的投资	四、投资限制 …… （2）本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，持有现金或投资于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%； ……	四、投资限制 …… （2）本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，持有现金或投资于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%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等； …… （17）本基金管理人管理的全部开放式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%； （18）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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致

	…… ~~（17）~~法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 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比例不符合上述规定投资比例的，除第（12）项外，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。 ……	**使本基金不符合前述比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；** **（19）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；** **（20）**法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 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比例不符合上述规定投资比例的，除第**（2）、**（12）**、（18）、（19）**项外，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。 ……
第十四部分 基金资产估值	六、暂停估值的情形 …… ~~3、~~中国证监会和基金合同认定的其它情形。	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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的；** **4、**中国证监会和基金合同认定的其它情形。
第十八部分 基金的信息披露	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》、**《流动性风险管理规定》、**《基金合同》及其他有关规定。 …… 五、公开披露的基金信息 …… （四）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 基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定媒介上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。 基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定媒介上。 基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定媒介上。 基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分	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》、**《流动性风险管理规定》、**《基金合同》及其他有关规定。 …… 五、公开披露的基金信息 …… （四）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 基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定媒介上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。 基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定媒介上。 基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定媒介上。 基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中

	别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。 ~~报告期内出现单一投资者持有基金份额数比例超过基金份额总数 20%的情形，基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告文件中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。~~ （五）临时报告 本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。 前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件： 1、基金份额持有人大会的召开； 2、终止《基金合同》； …… ~~26、~~中国证监会规定的其他事项。	国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。 **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。** **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，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“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。** （五）临时报告 本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。 前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件： 1、基金份额持有人大会的召开； 2、终止《基金合同》； …… **26、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；** 27、中国证监会规定的其他事项。

（二）《东方民丰回报赢安混合型证券投资基金托管协议》修改对照表

章节	原《托管协议》	《托管协议》修订后
一、基金托管协议当事人	（一）基金管理人 名称：东方基金管理有限责任公司 …… 注册资本：~~贰亿元人民币~~ 营业期限：2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日 ……	（一）基金管理人 名称：东方基金管理有限责任公司 …… 注册资本：**叁亿元人民币** 营业期限：2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日 ……
一、基金托	（二）基金托管人 经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和	（二）基金托管人 经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷

管协议当事人	长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现、发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事结汇、售汇业务；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项；保险兼业代理业务；提供保管箱服务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。	款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现、发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事结汇、售汇业务；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项；保险兼业代理业务**（有效期至 2020 年 02 月 18 日）**；提供保管箱服务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。
二、基金托管协议的依据、目的和原则	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金托管业务管理办法》、《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》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 7 号〈托管协议的内容与格式〉》等有关法律法规、基金合同及其他有关规定制订。	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金托管业务管理办法》、《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》”）、**《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》**、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 7 号〈托管协议的内容与格式〉》等有关法律法规、基金合同及其他有关规定制订。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	（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，对基金投资范围、投资对象进行监督。 …… 基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例不高于 40%，投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，持有现金或投资于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%。 若法律法规的相关规定发生变更或监管机构允许，基金管理人在履行适当程序后，可对上述资产配置比例进行调整。 （二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： (1)本基金股票资产占基金资产的比例不高于 40%； (2)本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，持有现金或投资于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%；	（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，对基金投资范围、投资对象进行监督。 …… 基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例不高于 40%，投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，持有现金或投资于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%，**其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。** 若法律法规的相关规定发生变更或监管机构允许，基金管理人在履行适当程序后，可对上述资产配置比例进行调整。 （二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： （1）本基金股票资产占基金资产的比例不高于 40%； （2）本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，持有现金或投资于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%，**其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；** ……

	…… ~~（17）~~法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制 …… 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比例不符合上述规定投资比例的，除第（12）项外，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。	（17）本基金管理人管理的且本基金托管人托管的全部开放式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%； （18）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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资； （19）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； （20）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制 …… 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比例不符合上述规定投资比例的，除第（2）、（12）、（18）、（19）项外，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。
八、基金资产净值计算和会计核算	（四）暂停估值的情形 1.基金投资所涉及的证券/期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； 2.因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时； ~~3.~~中国证监会和基金合同认定的其他情形。	（四）暂停估值的情形 1.基金投资所涉及的证券/期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； 2.因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时； 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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的； 4.中国证监会和基金合同认定的其他情形。

东方价值挖掘灵活配置混合型证券投资基金

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》

修改法律文件的情况说明

（一）《东方价值挖掘灵活配置混合型证券投资基金基金合同》修改对照表

章节	原《基金合同》	修订后《基金合同》
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》”）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》”）、**《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》”）**和其他有关法律法规。
第二部分 释义		…… **13、《流动性风险管理规定》：指《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** …… **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 基金份额的申购与赎回	五、申购和赎回的数量限制	五、申购和赎回的数量限制 …… **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	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 …… 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 …… 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，

份额的申购与赎回	承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。 ……	在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于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 日的投资者收取不低于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产**。 ……
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 …… ~~6、~~法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、5、~~6~~项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，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。	七、拒绝或暂停申购的情形 …… **6、接受某一投资者申购申请后导致其持有基金份额达到或超过基金总份额 50%的。** **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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。** 8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、5、7、8 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，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。
第六部分基金份额的申购与赎回	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… ……	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… **6、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。** ……
第六部分基金份额的申购与赎回	九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 ……	九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 …… **（3）在出现巨额赎回且单个基金份额持有人当日的赎回申请超过上一开放日基金总份额 20%以上的情形时，对于该基金份额持有人当日申请赎回的超过上一开放日基金总份额 20%以上的基金份额，基金管理人有权全部自动进行延期办理；对于该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人可以根据前段“（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。但是，如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理部分的赎回申请将被撤销。** ……
第七部分基金合同当事人及权利义务	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 …… 注册资本：~~贰~~亿元人民币 ~~存续期限：50 年~~ ……	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 …… 注册资本：**叁**亿元人民币 **营业期限：2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日** ……
第十二部分基金的投资	二、投资范围 …… 基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%-95%；投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%；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，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%。	二、投资范围 …… 基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%-95%；投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%；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，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、应收申购款等**。
第十二部分基金的投资	四、投资限制 …… （2）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，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； …… 	四、投资限制 …… （2）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，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、应收申购款等**； …… **（17）本基金管理人管理的全部开放式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%；** **（18）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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前款所规定比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；** **（19）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； **（20）**法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 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比例不符合上述规定投资比例的，除第**（2）、**（12）**、（18）、（19）**项外，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。
第十四部分 基金资产估值	六、暂停估值的情形 …… 3、中国证监会和基金合同认定的其它情形。	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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的；** **4、**中国证监会和基金合同认定的其它情形。
第十八部分 基金的信息披露	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。 …… 五、公开披露的基金信息 …… （六）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 …… 基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。	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》、**《流动性风险管理规定》、**《基金合同》及其他有关规定。 …… 五、公开披露的基金信息 …… （六）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 …… 基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。 **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。** **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基金定期报告“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。** （七）临时报告 本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报

	（七）临时报告 本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。 前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件： 1、基金份额持有人大会的召开； 2、终止《基金合同》； …… ~~26、~~中国证监会规定的其他事项。	中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。 前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件： 1、基金份额持有人大会的召开； 2、终止《基金合同》； …… **26、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；** 27、中国证监会规定的其他事项。

（二）《东方价值挖掘灵活配置混合型证券投资基金托管协议》修改对照表

章节	原《托管协议》	修订后《托管协议》
一、基金托管协议当事人	（一）基金管理人 名称：东方基金管理有限责任公司 …… 注册资本：~~贰~~亿元人民币 ~~存续期间：50 年~~ …… （二）基金托管人 名称：中国民生银行股份有限公司 …… 经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现、发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事结汇、售汇业务；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项；保险兼业代理业务~~（有效期至 2017 年 02 月 18 日）~~；提供保管箱服务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。	（一）基金管理人 名称：东方基金管理有限责任公司 …… 注册资本：**叁**亿元人民币 **营业期限：2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日** …… （二）基金托管人 名称：中国民生银行股份有限公司 …… 经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现、发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事结汇、售汇业务；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项；保险兼业代理业务**（有效期至 2020 年 02 月 18 日）**；提供保管箱服务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。
二、基金托管协议的依据、目的	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金托管业务管理办法》、《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	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金托管业务管理办法》、《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

和原则	管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 7 号〈托管协议的内容与格式〉》等有关法律法规、基金合同及其他有关规定制订。	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》**、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 7 号〈托管协议的内容与格式〉》等有关法律法规、基金合同及其他有关规定制订。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	（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，对基金投资范围、投资对象进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。 …… 基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%-95%；投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%；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，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%。 若法律法规的相关规定发生变更或监管机构允许，基金管理人在履行适当程序后，可对上述资产配置比例进行调整。 （二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： （1）本基金股票投资占基金资产的比例为 0%—95%； （2）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，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； ……	（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，对基金投资范围、投资对象进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。 …… 基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%-95%；投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%；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，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、应收申购款等**。 若法律法规的相关规定发生变更或监管机构允许，基金管理人在履行适当程序后，可对上述资产配置比例进行调整。 （二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： （1）本基金股票投资占基金资产的比例为 0%—95%； （2）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，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、应收申购款等**； …… **（14）本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部开放式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%；** **（15）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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前款所规定比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资； **（16）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；** **（17）**法律法规或监管部门及《基金合同》对上述比例限制另有规定的，从其规定。 …… 因证券市场或期货市场波动、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比例不符合上述规定投资比例的，除第**(2)、**(9)**、(15)、(16)**项外，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。
八、基金资产净值计算和会计核算	（四）暂停估值与公告基金份额净值的情形 1.基金投资所涉及的证券/期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； 2.因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时； 3.中国证监会和基金合同认定的其他情形。	（四）暂停估值与公告基金份额净值的情形 1.基金投资所涉及的证券/期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； 2.因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时； **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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的；** **4.**中国证监会和基金合同认定的其他情形。

东方利群混合型发起式证券投资基金

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》

修改法律文件的情况说明

（一）《东方利群混合型发起式证券投资基金基金合同》修改对照表

章节	原《基金合同》	《基金合同》修订后
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》”）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》”）、**《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》”）**和其他有关法律法规。
第二部分 释义		…… 13.《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 …… 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 基金份额的申购与赎回	五、申购和赎回的数量限制 ~~4、~~基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整	五、申购和赎回的数量限制 …… 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。 5、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人

	上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案。 ……	必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案。 ……
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 …… 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取不低于赎回费总额的 25%应归基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。 ……	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 …… 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。**对持续持有期少于 7 日的投资者收取不少于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产，其他情形下**不低于赎回费总额的 25%应归基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。 ……
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 …… 5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或出现其他损害现有基金份额持有人利益的情形。 ~~6、~~法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、5、~~6~~项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，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。	七、拒绝或暂停申购的情形 …… 5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或出现其他损害现有基金份额持有人利益的情形。 **6、接受某一投资者申购申请后导致其持有基金份额达到或超过基金总份额 50%的。** **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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。** 8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、5、7、8 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，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。
第六部分 基金份额的申购与赎回	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… ~~5、~~法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… **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，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。** 6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

	……	……
第六部分 基金份额的申购与赎回	九、巨额赎回的情形及处理方式 …… 2、巨额赎回的处理方式 当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。 …… ~~（3）~~暂停赎回：连续 2 个开放日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。 ……	九、巨额赎回的情形及处理方式 …… 2、巨额赎回的处理方式 当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。 …… **（3）在出现巨额赎回且单个基金份额持有人当日的赎回申请超过上一开放日基金总份额 20%以上的情形时，对于该基金份额持有人当日申请赎回的超过上一开放日基金总份额 20%以上的基金份额，基金管理人有权全部自动进行延期办理；对于该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人可以根据前段“（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。但是，如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理部分的赎回申请将被撤销。** **（4）**暂停赎回：连续 2 个开放日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。 ……
第七部分 基金合同当事人及权利义务	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 …… 注册资本：~~贰亿元~~人民币 ~~存续期限：50 年~~ …… 二、基金托管人 （一） 基金托管人简况 …… ~~注册地址：~~北京市东城区建国门内大街 69 号 …… 法定代表人：~~刘士余~~ ……	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 …… 注册资本：**叁亿元**人民币 **营业期限：2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日** …… 二、基金托管人 （一） 基金托管人简况 …… **住所：**北京市东城区建国门内大街 69 号 …… 法定代表人：**周慕冰** ……
第十二部分 基金的	二、投资范围 …… 基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的	二、投资范围 …… 基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比

投资	比例为 0%-95%，投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%；债券及其他金融工具投资比例不低于基金资产的 5%，其中本基金持有中小企业私募债券，其市值不得超过本基金资产净值的 10%；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，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%。 ……	例为 0%-95%，投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%；债券及其他金融工具投资比例不低于基金资产的 5%，其中本基金持有中小企业私募债券，其市值不得超过本基金资产净值的 10%；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，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、应收申购款等。** ……
第十二部分 基金的投资	四、投资限制 …… （2）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，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 …… …… …… ~~（16）~~法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 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。法律法规另有规定的，从其规定。 ……	四、投资限制 …… （2）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，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、应收申购款等；** …… **（18）本基金管理人管理的全部开放式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）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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，本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；** **（21）**法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 **除第（2）、（12）、（19）、（20）项外，**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。法律法规另有规定的，从其规定。 ……

第十四部分 基金资产估值	六、暂停估值的情形 …… ~~4、~~中国证监会和基金合同认定的其它情形。	六、暂停估值的情形 …… **4、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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的；** **5、**中国证监会和基金合同认定的其它情形。
第十八部分 基金的信息披露	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。 …… 五、公开披露的基金信息 …… （六）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 …… 基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。 （七）临时报告 本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。 前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件： 1、基金份额持有人大会的召开； 2、终止《基金合同》； …… ~~27、~~中国证监会规定的其他事项。	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》**、《流动性风险管理规定》、**《基金合同》及其他有关规定。 …… 五、公开披露的基金信息 …… （六）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 …… 基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。 **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。** **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基金定期报告“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。** （七）临时报告 本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。 前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件： 1、基金份额持有人大会的召开； 2、终止《基金合同》； …… **27、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； 28、中国证监会规定的其他事项。

（二）《东方利群混合型发起式证券投资基金托管协议》修改对照表

章节	原《托管协议》	《托管协议》修订后
一、基金托管协议当事人	（一）基金管理人 名称：东方基金管理有限责任公司 ~~注册地址~~：北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层 …… 注册资本：~~贰亿元人民币~~ ~~存续期间：50 年~~ 经营范围~~：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务~~ ……	（一）基金管理人 名称：东方基金管理有限责任公司 住所：北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层 …… 注册资本：叁亿元人民币 营业期限：2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日 经营范围：基金募集；基金销售；资产管理；从事境外证券投资管理业务和中国证监会许可的其他业务 ……
一、基金托管协议当事人	（二）基金托管人 名称：中国农业银行股份有限公司 ~~注册地址~~：北京市东城区建国门内大街 69 号 …… 法定代表人：~~刘士余~~ 成立时间：2009 年 1 月 15 日 ……	（二）基金托管人 名称：中国农业银行股份有限公司 住所：北京市东城区建国门内大街 69 号 …… 法定代表人：周慕冰 成立时间：2009 年 1 月 15 日 ……
二、基金托管协议的依据、目的和原则	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）等有关法律、法规（以下简称“法律法规”）、基金合同及其他有关规定制订。	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法律、法规（以下简称“法律法规”）、基金合同及其他有关规定制订。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	（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，对基金投资范围、投资对象进行监督。 …… 本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%-95%，投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%；债券及其他金融工具投资比例不低于基金资产的 5%，其中本基金持有中小企业私募债券，其市值不得超过本基金资产净值的 10%；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，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%。	（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，对基金投资范围、投资对象进行监督。 …… 本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%-95%，投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%；债券及其他金融工具投资比例不低于基金资产的 5%，其中本基金持有中小企业私募债券，其市值不得超过本基金资产净值的 10%；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，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

	…… （二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资、融券比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： （1）本基金股票投资占基金资产的比例为 0%—95%；债券及其他金融工具投资比例不低于基金资产的 5%； （2）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，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。 ……

算和会计核算	法准确评估基金资产价值时； …… ~~（4）~~中国证监会和基金合同认定的其他情形。	法准确评估基金资产价值时； …… **（4）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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的；** **（5）**中国证监会和基金合同认定的其他情形。

东方新兴成长混合型证券投资基金

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》

修改法律文件的情况说明

（一）《东方新兴成长混合型证券投资基金基金合同》修改对照表

章节	原《基金合同》	《基金合同》修订后
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》”）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》”）、**《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》”）**和其他有关法律法规。
第二部分 释义		…… **13.《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** …… **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 基金份额的申购与赎回	五、申购和赎回的数量限制 ~~4、~~基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理	五、申购和赎回的数量限制 …… **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。** 5、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人

	人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。 ……	必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。 ……
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 …… 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。 ……	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 …… 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于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 日的投资者收取不低于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产。** ……
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人的申购申请： …… ~~6、~~法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、5、~~6~~项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，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。	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人的申购申请： …… **6、接受某一投资者申购申请后导致其持有基金份额达到或超过基金总份额 50%的。** **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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。** 8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、5、**7、8** 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，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。
第六部分 基金份额的申购与赎回	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… ~~5、~~法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 ……	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… **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，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。** 6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 ……

第六部分 基金份额的申购与赎回	九、巨额赎回的情形及处理方式 …… 2、巨额赎回的处理方式 当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。 …… ~~（3）~~暂停赎回：连续 2 个开放日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。 ……	九、巨额赎回的情形及处理方式 …… 2、巨额赎回的处理方式 当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。 …… **（3）在出现巨额赎回且单个基金份额持有人当日的赎回申请超过上一开放日基金总份额 20%以上的情形时，对于该基金份额持有人当日申请赎回的超过上一开放日基金总份额 20%以上的基金份额，基金管理人有权全部自动进行延期办理；对于该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人可以根据前段“（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。但是，如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理部分的赎回申请将被撤销。** **（4）**暂停赎回：连续 2 日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒体上进行公告。 ……
第七部分 基金合同当事人及权利义务	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 …… 注册资本：~~贰亿元~~人民币 ~~存续期限：50 年~~ ……	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 …… 注册资本：**叁亿元**人民币 **营业期限：2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日** ……
第七部分 基金合同当事人及权利义务	二、基金托管人 （一） 基金托管人简况 名称：中国农业银行股份有限公司 住所：北京市东城区建国门内大街 69 号 法定代表人：~~刘士余~~ 成立时间：2009 年 1 月 15 日	二、基金托管人 （一） 基金托管人简况 名称：中国农业银行股份有限公司 住所：北京市东城区建国门内大街 69 号 法定代表人：**周慕冰** 成立时间：2009 年 1 月 15 日
第十二部分 基金的投资	二、投资范围 …… 基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 30%-95%，其中， 投资于本基金定义的新兴成长股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或	二、投资范围 …… 基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 30%-95%，其中， 投资于本基金定义的新兴成长股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监

	监管机构的规定执行；本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过本基金资产净值的 10%；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，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%。 ……	管机构的规定执行；本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过本基金资产净值的 10%；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，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、应收申购款等。** ……
第十二部分 基金的投资	四、投资限制 1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： （1）本基金股票投资占基金资产的比例为30%—95%；非现金基金资产中不低于 80%的资产投资于本基金定义的新兴成长股票； （2）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，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 …… …… …… ~~（17）~~法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 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。法律法规另有规定的，从其规定。	四、投资限制 1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： （1）本基金股票投资占基金资产的比例为30%—95%；非现金基金资产中不低于 80%的资产投资于本基金定义的新兴成长股票； （2）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，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、应收申购款等；** …… **（17）本基金管理人管理的全部开放式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%；** **（18）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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；** **（19）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；** **（20）**法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 **除第（2）、（12）、（18）、（19）项外，**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。法律法规另有规定的，从其规定。

第十四部分 基金资产估值	六、暂停估值的情形 …… ~~3、~~中国证监会和基金合同认定的其它情形。	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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的；** **4、**中国证监会和基金合同认定的其它情形。
第十八部分 基金的信息披露	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。 …… 五、公开披露的基金信息 …… （六）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 …… 基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。 （七）临时报告 本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。 …… ~~26、~~中国证监会规定的其他事项。	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》**、《流动性风险管理规定》、**《基金合同》及其他有关规定。 …… 五、公开披露的基金信息 …… （六）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 …… 基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。 **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。** **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基金定期报告“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。** （七）临时报告 本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。 …… **26、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；** **27、**中国证监会规定的其他事项。

（二）《东方新兴成长混合型证券投资基金托管协议》修改对照表

章节	原《托管协议》	《托管协议》修订后
一、基金托管协议当事人	（一）基金管理人 名称：东方基金管理有限责任公司 ~~注册地址~~：北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层办公 …… 注册资本：~~贰亿元~~人民币 ~~存续期限：50 年~~ 经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务	（一）基金管理人 名称：东方基金管理有限责任公司 **住所**：北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层办公 …… 注册资本：**叁亿元**人民币 **营业期限：2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日** 经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、**从事境外证券投资管理业务**和中国证监会许可的其他业务
一、基金托管协议当事人	（二） 基金托管人简况 名称：中国农业银行股份有限公司 ~~注册地址：~~北京市东城区建国门内大街 69 号 法定代表人：~~刘士余~~ 成立时间：2009 年 1 月 15 日	（二）基金托管人 名称：中国农业银行股份有限公司 **住所：**北京市东城区建国门内大街 69 号 法定代表人：**周慕冰** 成立时间：2009 年 1 月 15 日
二、基金托管协议的依据、目的和原则	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)等有关法律、法规(以下简称“法律法规”)、基金合同及其他有关规定制订。	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)**、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》**等有关法律、法规(以下简称“法律法规”)、基金合同及其他有关规定制订。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	（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，对基金投资范围、投资对象进行监督。 …… 本基金的投资组合比例为股票资产占基金资产的比例为 30%-95%，其中，投资于本基金定义的新兴成长股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行；本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过本基金资产净值的 10%；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，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%。	（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，对基金投资范围、投资对象进行监督。 …… 本基金的投资组合比例为股票资产占基金资产的比例为 30%-95%，其中，投资于本基金定义的新兴成长股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行；本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过本基金资产净值的 10%；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，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、应收申购款等。**
三、基金托管人对基金管理	（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资、融券比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： 1、本基金股票投资占基金资产的比例为	（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资、融券比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： 1、本基金股票投资占基金资产的比例为

人的业务监督和核查	30%—95%；非现金基金资产中不低于 80%的资产投资于本基金定义的新兴成长股票； 2、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，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 …… ~~14、~~法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 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之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。	30%—95%；非现金基金资产中不低于 80%的资产投资于本基金定义的新兴成长股票； 2、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，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、应收申购款等**； …… **14、本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部开放式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%；** **15、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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；** **16、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；** **17、**法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 **除第 2、7、15、16 项外**，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之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。
八、基金资产净值计算和会计核算	（四）暂停估值与公告基金份额净值的情形 (1)基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； (2)因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时； ~~(3)~~中国证监会和基金合同认定的其他情形。	（四）暂停估值与公告基金份额净值的情形 (1)基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； (2)因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时； **(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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的；** **(4)**中国证监会和基金合同认定的其他情形。

东方添益债券型证券投资基金

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》

修改法律文件的情况说明

（一）《东方添益债券型证券投资基金基金合同》修改对照表

章节	原《基金合同》	《基金合同》修订后
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》”）、《货币市场基金监督管理办法》、《关于实施＜货币市场基金监督管理办法＞有关问题的规定》、《证券投资基金信息披露编报规则第 5 号〈货币市场基金信息披露特别规定〉》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》”）、**《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》”）**和其他有关法律法规。
第二部分 释义		…… 13、《流动性风险管理规定》：指《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作出的修订 …… 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）、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 基金份额的申购与赎回	五、申购和赎回的数量限制 4、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管	五、申购和赎回的数量限制 …… 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。 5、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定

	理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案。 ……	在指定媒体上公告并报中国证监会备案。 ……
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 …… 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。 ……	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 …… 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于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 日的投资者收取不低于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产**。 ……
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 …… ~~6~~、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、5、~~6~~项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，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。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。	七、拒绝或暂停申购的情形 …… **6、接受某一投资者申购申请后导致其持有基金份额达到或超过基金总份额 50%的。** **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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。** **8、**法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、5、**7、8** 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，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。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 基金份额的申购与赎回	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… ~~5、~~法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 ……	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… **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，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。** **6、**法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 ……
第六部分 基	九、巨额赎回的情形及处理方式 ……	九、巨额赎回的情形及处理方式 ……

金份额的申购与赎回	2、巨额赎回的处理方式 当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。 …… ~~（3）~~暂停赎回：连续 2 个开放日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。 ……	2、巨额赎回的处理方式 当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。 …… **（3）在出现巨额赎回且单个基金份额持有人当日的赎回申请超过上一日基金总份额 20%以上的情形时，对于该基金份额持有人当日申请赎回的超过上一日基金总份额 20%以上的基金份额，有权全部自动进行延期办理；对于该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人可以根据前段“（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。但是，如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理部分的赎回申请将被撤销。** **（4）**暂停赎回：连续 2 个开放日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。 ……
第七部分 基金合同当事人及权利义务	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 …… 注册资本：~~贰亿元~~人民币 ~~存续期限：50 年~~ …… 二、基金托管人 （一）基金托管人简况 名称：中国农业银行股份有限公司 住所：北京市东城区建国门内大街 69 号 法定代表人：~~蒋超良~~ ……	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 …… 注册资本：**叁亿元**人民币 **营业期限：2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日** …… 二、基金托管人 （一）基金托管人简况 名称：中国农业银行股份有限公司 住所：北京市东城区建国门内大街 69 号 法定代表人：**周慕冰** ……
第十二部分 基金的投资	二、投资范围 基金的投资组合比例为：债券资产占基金资产的比例不低于 80%，本基金保持现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%。	二、投资范围 基金的投资组合比例为：债券资产占基金资产的比例不低于 80%，本基金保持现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%**，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等**。
第十二部分 基金的	四、投资限制 1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制：	四、投资限制 1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制：

投资	（1）本基金持有的债券资产占基金资产的比例不低于 80%； （2）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； …… ~~（12）~~法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 因证券市场波动、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。法律法规另有规定的，从其规定。	（1）本基金持有的债券资产占基金资产的比例不低于 80%； （2）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、应收申购款等；** …… **（12）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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；** **（13）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；** （14）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 **除第（2）、（8）、（12）、（13）项外，**因证券市场波动、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。法律法规另有规定的，从其规定。
第十四部分 基金资产估值	六、暂停估值的情形 1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； 2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时； …… ~~3、~~中国证监会和基金合同认定的其它情形。	六、暂停估值的情形 1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； 2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时； **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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的；** **4、**中国证监会和基金合同认定的其它情形。
第十八部分 基金的信息披露	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。 …… 五、公开披露的基金信息 …… （六）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	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》**、《流动性风险管理规定》、**《基金合同》及其他有关规定。 …… 五、公开披露的基金信息 …… （六）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

	…… 基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。 …… （七）临时报告 本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。 …… ~~26、~~中国证监会规定的其他事项。	…… 基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。 **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。** **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基金定期报告“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。** （七）临时报告 本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。 **26、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；** 27、中国证监会规定的其他事项。

（二）《东方添益债券型证券投资基金托管协议》修改对照表

章节	原《托管协议》	《托管协议》修订后
一、基金托管协议当事人	（一）基金管理人 名称：东方基金管理有限责任公司 ~~注册地址：~~北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层 …… 注册资本：~~贰亿元~~人民币 ~~存续期间：50 年~~ 经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务 （二）基金托管人 名称：中国农业银行股份有限公司 ~~注册地址：~~北京市东城区建国门内大街 69 号 办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座九层 邮政编码：100031	（一）基金管理人 名称：东方基金管理有限责任公司 **住所：**北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层 …… 注册资本：**叁亿元**人民币 **营业期限：2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日** 经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、**从事境外证券投资管理业务**和中国证监会许可的其他业务 （二）基金托管人 名称：中国农业银行股份有限公司 **住所：**北京市东城区建国门内大街 69 号 办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座九层 邮政编码：100031

	法定代表人：~~蒋超良~~ ……	法定代表人：**周慕冰** ……
二、基金托管协议的依据、目的和原则	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)等有关法律法规、《基金合同》及其他有关规定制订。	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、**《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》**等有关法律法规、《基金合同》及其他有关规定制订。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	本基金的投资组合比例为债券资产占基金资产的比例不低于 80%，本基金保持现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%。	本基金的投资组合比例为债券资产占基金资产的比例不低于 80%，本基金保持现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%**，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等**。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资、融券比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： 1、本基金持有的债券资产占基金资产的比例不低于 80%； 2、本基金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； …… ~~12、~~法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 因证券市场波动、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比例不符合上述规定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。	（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资、融券比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： 1、本基金持有的债券资产占基金资产的比例不低于 80%； 2、本基金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、应收申购款等**； …… **12、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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；** **13、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；** **14、**法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 **除第 2、8、12、13 项外，**因证券市场波动、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比例不符合上述规定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

八、基金资产净值计算和会计核算	（四）暂停估值与公告基金份额净值的情形 （1）基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； （2）因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时； ~~（3）~~中国证监会和基金合同认定的其他情形。	（四）暂停估值与公告基金份额净值的情形 （1）基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； （2）因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时； **（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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的；** **（4）**中国证监会和基金合同认定的其他情形。

东方新价值混合型证券投资基金

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》

修改法律文件的情况说明

（一）《东方新价值混合型证券投资基金基金合同》修改对照表

章节	原《基金合同》	《基金合同》修订后
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》”）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》”）、**《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》”）**和其他有关法律法规。
第二部分 释义		…… 13、《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 …… 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 基金份额的申购与赎回	五、申购和赎回的数量限制 4、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整	五、申购和赎回的数量限制 …… 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。具体规定请参见相关公告。 5、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人

	上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。 ……	必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。 ……
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 …… 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。 ……	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 …… 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于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 日的投资者收取不低于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产。** ……
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人的申购申请： …… ~~6、~~法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、5、6 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，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。	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人的申购申请： …… 6、**接受某一投资者申购申请后导致其持有基金份额达到或超过基金总份额 50%的。** **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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。** **8、**法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、5、**7、8** 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，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。
第六部分 基金份额的申购与赎回	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… ~~6、~~法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 ……	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… **6、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。** **7、**法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 ……

第六部分 基金份额的申购与赎回	九、巨额赎回的情形及处理方式 …… 2、巨额赎回的处理方式 当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。 …… ~~（3）~~暂停赎回：连续 2 个开放日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。 ……	九、巨额赎回的情形及处理方式 …… 2、巨额赎回的处理方式 当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。 …… **（3）在出现巨额赎回且单个基金份额持有人当日的赎回申请超过上一开放日基金总份额 20%以上的情形时，对于该基金份额持有人当日申请赎回的超过上一开放日基金总份额 20%以上的基金份额，基金管理人有权全部自动进行延期办理；对于该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人可以根据前段“（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。但是，如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理部分的赎回申请将被撤销。** **（4）**暂停赎回：连续 2 个开放日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。 ……
第七部分 基金合同当事人及权利义务	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 …… 注册资本：~~贰亿元~~人民币 ~~存续期限：50 年~~ …… 二、基金托管人 （一） 基金托管人简况 名称：中国农业银行股份有限公司 住所：北京市东城区建国门内大街 69 号 法定代表人：~~刘士余~~ 成立时间：2009 年 1 月 15 日 ……	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 …… 注册资本：**叁亿元**人民币 **营业期限：2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日** …… 二、基金托管人 （一） 基金托管人简况 名称：中国农业银行股份有限公司 住所：北京市东城区建国门内大街 69 号 法定代表人：**周慕冰** 成立时间：2009 年 1 月 15 日 ……
第十二部分 基金的投资	二、投资范围 …… 基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%-60%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例按照法律法规或监管机构的规定执行；本基金	二、投资范围 …… 基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%-60%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例按照法律法规或监管机构的规定执行；本基金每个交

	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%。 ……	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、应收申购款等。** ……
第十二部分 基金的投资	四、投资限制 1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： （1）本基金股票投资占基金资产的比例为 0%—60%； （2）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，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 …… …… ~~（18）~~法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 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。 ……	四、投资限制 1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： （1）本基金股票投资占基金资产的比例为 0%—60%； （2）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，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、应收申购款等；** …… **（18）本基金管理人管理的全部开放式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）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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，本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；** **（21）**法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 **除第（2）、（12）、（19）、（20）项外**，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。 ……
第十四部分 基金资	六、暂停估值的情形 ……	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**

产估值	3、中国证监会和基金合同认定的其它情形。	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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的； 4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。
第十八部分 基金的信息披露	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。 …… 五、公开披露的基金信息 …… （六）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 …… （七）临时报告 本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。 …… 27、中国证监会规定的其他事项。	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》、《流动性风险管理规定》、《基金合同》及其他有关规定。 …… 五、公开披露的基金信息 …… （六）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 …… 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。 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基金定期报告“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。 （七）临时报告 本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。 …… 27、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； 28、中国证监会规定的其他事项。

（二）《东方新价值混合型证券投资基金托管协议》修改对照表

章节	原《托管协议》	《托管协议》修订后
一、基金托管协议当事人	（一）基金管理人 名称：东方基金管理有限责任公司 …… 注册地址：北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层 …… 注册资本：贰亿元人民币	（一）基金管理人 名称：东方基金管理有限责任公司 …… 住所：北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层 …… 注册资本：叁亿元人民币

	~~存续期限：50 年~~ 经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务	营业期限：2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日 经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、从事境外证券投资管理业务和中国证监会许可的其他业务
一、基金托管协议当事人	（二）基金托管人 名称：中国农业银行股份有限公司 ~~注册地址：~~北京市东城区建国门内大街 69 号 办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座九层 邮政编码：100031 法定代表人：~~刘士余~~ 成立时间：2009 年 1 月 15 日	（二）基金托管人 名称：中国农业银行股份有限公司 住所：北京市东城区建国门内大街 69 号 办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座九层 邮政编码：100031 法定代表人：周慕冰 成立时间：2009 年 1 月 15 日
二、基金托管协议的依据、目的和原则	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)等有关法律、法规(以下简称“法律法规”)、基金合同及其他有关规定制订。	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法律、法规(以下简称“法律法规”)、基金合同及其他有关规定制订。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	（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，对基金投资范围、投资对象进行监督。 …… 基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%-60%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例按照法律法规或监管机构的规定执行；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，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%。 （二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： 1)本基金股票投资占基金资产的比例为 0%—60%； 2)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，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， ……	（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，对基金投资范围、投资对象进行监督。 …… 基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%-60%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例按照法律法规或监管机构的规定执行；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，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、应收申购款等。 （二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： 1)本基金股票投资占基金资产的比例为 0%—60%； 2)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，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、应收申购款等； …… 18)本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部开放式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)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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，本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；
	~~18)~~法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 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。	21)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 除第 2)、12)、19)、20）项外，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。
八、基金资产净值计算和会计核算	（四）暂停估值与公告基金份额净值的情形 （1）基金投资所涉及的证券/期货交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； （2）因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时； ~~（3）~~中国证监会和基金合同认定的其他情形。	（四）暂停估值与公告基金份额净值的情形 （1）基金投资所涉及的证券/期货交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； （2）因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时； （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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的； （4）中国证监会和基金合同认定的其他情形。

东方稳定增利债券型证券投资基金

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》

修改法律文件的情况说明

（一）《东方稳定增利债券型证券投资基金基金合同》修改对照表

章节	原《基金合同》	《基金合同》修订后
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》”）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》”）、**《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》”）**和其他有关法律法规。
第二部分 释义		…… 13、《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 …… 53、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 基金份额的申购与赎回	五、申购和赎回的数量限制 ~~4、~~基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整	五、申购和赎回的数量限制 …… 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。具体规定请参见相关公告。 5、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整

	上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。 ……	上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。 ……
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 …… 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。 ……	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 …… 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于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 日的投资者收取不低于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产。** ……
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人的申购申请： …… ~~6、~~法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、5、6 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，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。	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人的申购申请： …… 6、**接受某一投资者申购申请后导致其持有基金份额达到或超过基金总份额 50%的。** **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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。** **8、**法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、5、**7、8** 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，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。
第六部分 基金份额的申购与赎回	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… ~~6、~~法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… **6、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。** **7、**法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

	……	……
第六部分 基金份额的申购与赎回	九、巨额赎回的情形及处理方式 …… 2、巨额赎回的处理方式 当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。 …… ~~（3）~~暂停赎回：连续 2 个开放日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。 ……	九、巨额赎回的情形及处理方式 …… 2、巨额赎回的处理方式 当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。 …… **（3）在出现巨额赎回且单个基金份额持有人当日的赎回申请超过前一开放日基金总份额 20%以上的情形时，对于该基金份额持有人当日申请赎回的超过前一开放日基金总份额 20%以上的基金份额，基金管理人有权全部自动进行延期办理；对于该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人可以根据前段“（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。但是，如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理部分的赎回申请将被撤销。** **（4）**暂停赎回：连续 2 个开放日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。 ……
第七部分 基金合同当事人及权利义务	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 …… 注册资本~~：贰亿元~~人民币 ~~存续期限：50 年~~ ……	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 …… 注册资本：**叁亿元**人民币 **营业期限：2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日** ……
第七部分 基金合同当事人及权利义务	二、基金托管人 （一） 基金托管人简况 名称：中国农业银行股份有限公司 住所：北京市东城区建国门内大街 69 号 法定代表人：~~刘士余~~ 成立时间：2009 年 1 月 15 日 ……	二、基金托管人 （一） 基金托管人简况 名称：中国农业银行股份有限公司 住所：北京市东城区建国门内大街 69 号 法定代表人：**周慕冰** 成立时间：2009 年 1 月 15 日 ……
第十二部分 基金的投资	二、投资范围 …… 基金的投资组合比例为：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%，对权益类资产的投资比	二、投资范围 …… 基金的投资组合比例为：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%，对权益类资产的投资比例

	例不高于基金资产的 20%；现金或者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%。 ……	不高于基金资产的 20%；现金或者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、应收申购款等。** ……
第十二部分 基金的投资	四、投资限制 1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： （1）本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%； （2）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 …… …… …… ~~（16）~~法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 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，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。 ……	四、投资限制 1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： （1）本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%； （2）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、应收申购款等；** …… **（16）本基金管理人管理的全部开放式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%；** **（17）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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；** **（18）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；** **（19）**法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 **除第（2）、（12）、（17）、（18）项外，**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，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	六、暂停估值的情形 ……	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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的； 3、中国证监会和基金合同认定的其它情形。	4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。
第十八部分 基金的信息披露	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》、《流动性风险管理规定》、《基金合同》及其他有关规定。 …… 五、公开披露的基金信息 …… （六）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 …… 基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。 （七）临时报告 本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。 …… 27、中国证监会规定的其他事项。	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》、《流动性风险管理规定》、《基金合同》及其他有关规定。 …… 五、公开披露的基金信息 …… （六）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 …… 基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。 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。 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基金定期报告“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。 （七）临时报告 本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。 …… 27、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； 28、中国证监会规定的其他事项。

（二）《东方稳定增利债券型证券投资基金托管协议》修改对照表

章节	原《托管协议》	《托管协议》修订后
一、基金托管	（一）基金管理人 名称：东方基金管理有限责任公司	（一）基金管理人 名称：东方基金管理有限责任公司

协议当事人	~~注册地址~~：北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层 …… 注册资本：~~贰亿元~~人民币 ~~存续期限：50 年~~ 经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。 ……	**住所**：北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层 …… 注册资本：**叁亿元**人民币 营业期限：**2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日** 经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、**从事境外证券投资管理业务**和中国证监会许可的其他业务。 ……
一、基金托管协议当事人	（二）基金托管人 名称：中国农业银行股份有限公司 ~~注册地址~~：北京市东城区建国门内大街 69 号 办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座九层 邮政编码：100031 法定代表人：~~刘士余~~	（二）基金托管人 名称：中国农业银行股份有限公司 **住所**：北京市东城区建国门内大街 69 号 办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座九层 邮政编码：100031 法定代表人：**周慕冰**
二、基金托管协议的依据、目的和原则	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”等有关法律、法规（以下简称“法律法规”）、基金合同及其他有关规定制订。	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）**、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》**等有关法律、法规（以下简称“法律法规”）、基金合同及其他有关规定制订。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	（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，对基金投资范围、投资对象进行监督。 …… 本基金的投资组合比例为本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%，对权益类资产的投资比例不高于基金资产的 20%；现金或者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%。 若法律法规的相关规定发生变更或监管机构允许，基金管理人在履行适当程序后，可对上述资产配置比例进行调整。	（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，对基金投资范围、投资对象进行监督。 …… 本基金的投资组合比例为本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%，对权益类资产的投资比例不高于基金资产的 20%；现金或者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、应收申购款等。** 若法律法规的相关规定发生变更或监管机构允许，基金管理人在履行适当程序后，可对上述资产配置比例进行调整。
三、基金托管	（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资比例进行监督。	（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人

人对基金管理人的业务监督和核查	基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： 1、本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%； 2、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 …… ~~16、~~本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资策略、投资比例的规定。 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的投资比例的，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。	按下述比例和调整期限进行监督： 1、本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%； 2、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、应收申购款等；** …… **16、本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部开放式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%；** **17、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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；** **18、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；** **19、**本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资策略、投资比例的规定。 **除第 2、12、17、18 项外，**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的投资比例的，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。
八、基金资产净值计算和会计核算	（四）暂停估值与公告基金份额净值的情形 （1）基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； （2）因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时； ~~（3）~~中国证监会和基金合同认定的其他情形。	（四）暂停估值与公告基金份额净值的情形 （1）基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； （2）因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时； **（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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的；** **（4）**中国证监会和基金合同认定的其他情形。

东方启明量化先锋混合型证券投资基金

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》

修改法律文件的情况说明

（一）《东方启明量化先锋混合型证券投资基金基金合同》修改对照表

章节	原《基金合同》	《基金合同》修订后
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》”）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》”）、**《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》”）**和其他有关法律法规。
第二部分 释义		…… 12.《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 …… 48.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 基金份额的申购与赎回	五、申购和赎回的数量限制 ……	五、申购和赎回的数量限制 …… 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。

	~~4、~~基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。	5、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。
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 …… 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。 ……	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 …… 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于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 日的投资者收取不低于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产。** ……
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人的申购申请： …… ~~6、~~法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、5、~~6~~项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，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。	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人的申购申请： …… 6、**接受某一投资者申购申请后导致其持有基金份额达到或超过基金总份额 50%的。** **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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。** 8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、5、**7、8** 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，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。
第六部分 基金份额的申购与赎回	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… ~~6、~~法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 ……	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… **6、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。** 7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 ……

第六部分 基金份额的申购与赎回	九、巨额赎回的情形及处理方式 …… 2、巨额赎回的处理方式 当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。 …… ~~（3）~~暂停赎回：连续 2 个开放日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。 ……	九、巨额赎回的情形及处理方式 …… 2、巨额赎回的处理方式 当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。 …… **（3）在出现巨额赎回且单个基金份额持有人当日的赎回申请超过上一开放日基金总份额 20%以上的情形时，对于该基金份额持有人当日申请赎回的超过上一开放日基金总份额 20%以上的基金份额，基金管理人有权全部自动进行延期办理；对于该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人可以根据前段“（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。但是，如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理部分的赎回申请将被撤销。** **（4）**暂停赎回：连续 2 个开放日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。 ……
第七部分 基金合同当事人及权利义务	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 …… 注册资本：~~贰亿元~~人民币 ~~存续期限：50 年~~ ……	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 …… 注册资本：**叁亿元**人民币 **营业期限：2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日** ……
第七部分 基金合同当事人及权利义务	二、基金托管人 （一） 基金托管人简况 名称：中国农业银行股份有限公司 住所：北京市东城区建国门内大街 69 号 法定代表人：~~刘士余~~ 成立时间：2009 年 1 月 15 日 ……	二、基金托管人 （一） 基金托管人简况 名称：中国农业银行股份有限公司 住所：北京市东城区建国门内大街 69 号 法定代表人：**周慕冰** 成立时间：2009 年 1 月 15 日 ……
第十二部分 基金的投资	二、投资范围 …… 基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 30%-95%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例按照法律法规或监管机构的规定执行；本基	二、投资范围 …… 基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 30%-95%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例按照法律法规或监管机构的规定执行；本基金持

	金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过本基金资产净值的 10%；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，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%。 ……	有单只中小企业私募债券，其市值不得超过本基金资产净值的 10%；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，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、应收申购款等。** ……
第十二部分 基金的投资	四、投资限制 …… （2）本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，持有现金或投资于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% …… …… …… ~~（18）~~法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 ~~（19）~~本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资策略、投资比例的规定。 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，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。 ……	四、投资限制 …… （2）本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，持有现金或投资于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%，**其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；** …… **（18）本基金管理人管理的全部开放式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）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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，本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；** **（21）**法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 **（22）**本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资策略、投资比例的规定。 **除第（2）、（12）、（19）、（20）项外，**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。 ……

第十四部分 基金资产估值	六、暂停估值的情形 …… ~~3、~~中国证监会和基金合同认定的其它情形。	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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的；** 4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。
第十八部分 基金的信息披露	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。 …… 五、公开披露的基金信息 …… （四）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 …… 基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。 （五）临时报告 本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。 …… ~~25、~~中国证监会规定的其他事项。	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》**、《流动性风险管理规定》、**《基金合同》及其他有关规定。 …… 五、公开披露的基金信息 …… （四）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 …… 基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。 **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。** **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基金定期报告“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。** （五）临时报告 本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。 …… **25、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；** 26、中国证监会规定的其他事项。

（二）《东方启明量化先锋混合型证券投资基金托管协议》修改对照表

章节	原《托管协议》	《托管协议》修订后
一、基金托管协议当事人	（一）基金管理人 名称：东方基金管理有限责任公司 ~~注册地址~~：北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层 …… 注册资本：~~贰亿元~~人民币 ~~存续期限：50 年~~ 经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。 ……	（一）基金管理人 名称：东方基金管理有限责任公司 **住所**：北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层 …… 注册资本：**叁亿元**人民币 营业期限：**2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日** 经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、**从事境外证券投资管理业务**和中国证监会许可的其他业务。 ……
一、基金托管协议当事人	（二）基金托管人 名称：中国农业银行股份有限公司 ~~注册地址：~~北京市东城区建国门内大街 69 号 办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座九层 邮政编码：100031 法定代表人：~~刘士余~~ ……	（二）基金托管人 名称：中国农业银行股份有限公司 **住所：**北京市东城区建国门内大街 69 号 办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座九层 邮政编码：100031 法定代表人：**周慕冰** ……
二、基金托管协议的依据、目的和原则	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”等有关法律、法规(以下简称“法律法规”)、基金合同及其他有关规定制订。	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)**、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》**等有关法律、法规(以下简称“法律法规”)、基金合同及其他有关规定制订。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	（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，对基金投资范围、投资对象进行监督。 …… 基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 30%-95%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例按照法律法规或监管机构的规定执行；本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过本基金资产净值的 10%；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，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%。 ……	（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，对基金投资范围、投资对象进行监督。 …… 基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 30%-95%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例按照法律法规或监管机构的规定执行；本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过本基金资产净值的 10%；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，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、应收申购款等。** ……
三、基金托管	（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资、融券比例进行监	（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资、融券比例进行监督。

人对基金管理人的业务监督和核查	督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： 1、本基金股票投资占基金资产的比例为 30%—95%； 2、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，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； …… ~~15、~~法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制； ~~16~~、本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资策略、投资比例的规定。 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。	基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： 1、本基金股票投资占基金资产的比例为 30%—95%； 2、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，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、应收申购款等；** …… **15、本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部开放式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%；** **16、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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；** **17、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；** 18、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制； 19、本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资策略、投资比例的规定。 **除第 2、10、16、17 项外**，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。
八、基金资产净值计算和会计核算	（四）暂停估值与公告基金份额净值的情形 （1）基金投资所涉及的证券/期货交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； （2）因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；	（四）暂停估值与公告基金份额净值的情形 （1）基金投资所涉及的证券/期货交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； （2）因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时； **（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时，基金管理人经与基金托管人**

	~~（3）~~中国证监会和基金合同认定的其他情形。	**协商一致的；** **（4）**中国证监会和基金合同认定的其他情形。

东方大健康混合型证券投资基金

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》

修改法律文件的情况说明

（一）《东方大健康混合型证券投资基金基金合同》修改对照表

章节	原《基金合同》	《基金合同》修订后
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》”）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》”）、**《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》”）**和其他有关法律法规。
第二部分 释义		…… 13、《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 …… 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 基金份额的申购与赎回	五、申购和赎回的数量限制	五、申购和赎回的数量限制 …… 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 基金份额的申购与赎回	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 …… 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。 ……	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 …… 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于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 日的投资者收取不低于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产。** ……
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 …… 5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或出现其他损害现有基金份额持有人利益的情形。 ~~6、~~法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、5、~~6~~项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，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。	七、拒绝或暂停申购的情形 …… 5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或出现其他损害现有基金份额持有人利益的情形。 **6、接受某一投资者申购申请后导致其持有基金份额达到或超过基金总份额 50%的。** **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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。** 8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、5、**7、8** 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，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。
第六部分 基金份额的申购与赎回	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… ……	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… **6、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。** ……
第六部分 基金份额	九、巨额赎回的情形及处理方式 …… 2、巨额赎回的处理方式	九、巨额赎回的情形及处理方式 …… 2、巨额赎回的处理方式

的申购与赎回	当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。 …… ~~（3）~~暂停赎回：连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。 ……	当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。 …… **（3）在出现巨额赎回且单个基金份额持有人当日的赎回申请超过前一开放日基金总份额 20%以上的情形时，对于该基金份额持有人当日申请赎回的超过前一开放日基金总份额 20%以上的基金份额，基金管理人有权全部自动进行延期办理；对于该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人可以根据前段“（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。但是，如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理部分的赎回申请将被撤销。** **（4）**暂停赎回：连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。 ……
第七部分 基金合同当事人及权利义务	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 …… 注册资本：~~贰亿元~~人民币 …… 二、基金托管人 （一） 基金托管人简况 …… 法定代表人：~~刘士余~~ ……	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 …… 注册资本：**叁亿元**人民币 …… 二、基金托管人 （一） 基金托管人简况 …… 法定代表人：**周慕冰** ……
第十二部分 基金的投资	二、投资范围 …… 基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 30%-95%；投资于本基金定义的健康产业的证券资产占非现金基金资产的比例不低于 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，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。 ……	二、投资范围 …… 基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 30%-95%；投资于本基金定义的健康产业的证券资产占非现金基金资产的比例不低于 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，现金或者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、应收申购款等**。 ……

第十二部分 基金的投资	四、投资限制 …… （2）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，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； ~~（18）~~法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 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。 ……	四、投资限制 …… （2）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，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、应收申购款等；** …… **（18）本基金管理人管理的全部开放式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）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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，本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；** **（21）**法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 **除第（2）、（12）、（19）、（20）项外**，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。 ……
第十四部分 基金资产估值	六、暂停估值的情形 …… ~~3、~~中国证监会和基金合同认定的其它情形。	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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的；** **4、**中国证监会和基金合同认定的其它情形。
第十八部分 基金的	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。相关法律法规关于信息披露的披露方式、登载媒	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》、**《流动性风险管理规定》、**《基金合同》及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的

信息披露	介、报备方式等规定发生变化时，本基金从其最新规定。 …… 五、公开披露的基金信息 …… （六）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 …… 基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。 （七）临时报告 本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。 前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件： 1、基金份额持有人大会的召开； 2、终止《基金合同》； …… ~~26、~~中国证监会规定的其他事项。	披露方式、登载媒介、报备方式等规定发生变化时，本基金从其最新规定。 …… 五、公开披露的基金信息 …… （六）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 …… 基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。 **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。** **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基金定期报告“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。** （七）临时报告 本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。 前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件： 1、基金份额持有人大会的召开； 2、终止《基金合同》； …… **26、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；** **27、**中国证监会规定的其他事项。

（二）《东方大健康混合型证券投资基金托管协议》修改对照表

章节	原《托管协议》	《托管协议》修订后
一、基金托管	（一）基金管理人 名称：东方基金管理有限责任公司	（一）基金管理人 名称：东方基金管理有限责任公司

协议当事人	~~注册地址~~：北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层 …… 注册资本：~~贰亿元~~人民币 营业期限：2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日 ……	住所：北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层 …… 注册资本：叁亿元人民币 营业期限：2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日 ……
一、基金托管协议当事人	（二）基金托管人 …… ~~注册地址~~：北京市东城区建国门内大街 69 号 法定代表人：~~刘士余~~ 成立时间：2009 年 1 月 15 日 ……	（二）基金托管人 …… 住所：北京市东城区建国门内大街 69 号 法定代表人：周慕冰 成立时间：2009 年 1 月 15 日 ……
二、基金托管协议的依据、目的和原则	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）等有关法律、法规（以下简称“法律法规”）、基金合同及其他有关规定制订。	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法律、法规（以下简称“法律法规”）、基金合同及其他有关规定制订。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	（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，对基金投资范围、投资对象进行监督。 …… 本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 30%-95%；投资于本基金定义的健康产业的证券资产占非现金基金资产的比例不低于 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，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。 （二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： 1、本基金持有的股票资产占基金资产的比例为 30%-95%；投资于本基金定义的健康产业证券资产占非现金基金资产的比例不低于 80%； 2、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，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； ……	（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，对基金投资范围、投资对象进行监督。 …… 本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 30%-95%；投资于本基金定义的健康产业的证券资产占非现金基金资产的比例不低于 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，现金或者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、应收申购款等。 （二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： 1、本基金持有的股票资产占基金资产的比例为 30%-95%；投资于本基金定义的健康产业证券资产占非现金基金资产的比例不低于 80%； 2、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，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、应收申购款等； …… 18、本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部开放式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、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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，本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；
	18、法律法规或监管部门及《基金合同》对上述比例限制另有规定的，从其规定。 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。	21、法律法规或监管部门及《基金合同》对上述比例限制另有规定的，从其规定。 除第 2、12、19、20 项外，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。
第八部分 基金资产净值计算和会计核算	（四）暂停估值与公告基金份额净值的情形 （1）基金投资所涉及的证券/期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； （2）因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时； （3）中国证监会和基金合同认定的其他情形。	（四）暂停估值与公告基金份额净值的情形 （1）基金投资所涉及的证券/期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； （2）因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时； （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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的； （4）中国证监会和基金合同认定的其他情形。

东方互联网嘉混合型证券投资基金

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》

修改法律文件的情况说明

（一）《东方互联网嘉混合型证券投资基金基金合同》修改对照表

章节	原《基金合同》	《基金合同》修订后
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》”）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》”）、**《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》”）**和其他有关法律法规。
第二部分 释义		…… 13、《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 …… 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 基金份额的申购与赎回	五、申购和赎回的数量限制 ~~5、~~基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整	五、申购和赎回的数量限制 …… 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。 5、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整

	上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。	上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。
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 …… 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。 ……	**六、申购和赎回的价格、费用及其用途** …… 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于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 日的投资者收取不低于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产**。 ……
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 …… 5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或出现其他损害现有基金份额持有人利益的情形。 ~~6、~~法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、5、~~6~~项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，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。	七、拒绝或暂停申购的情形 …… 5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或出现其他损害现有基金份额持有人利益的情形。 **6、接受某一投资者申购申请后导致其持有基金份额达到或超过基金总份额 50%的。** **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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。** 8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、5、**7、8** 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，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。
第六部分 基金份额的申购与赎回	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… ……	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… **6、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。** ……

第六部分 基金份额的申购与赎回	九、巨额赎回的情形及处理方式 …… 2、巨额赎回的处理方式 当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。 …… ~~（3）~~暂停赎回：连续 2 个开放日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。 ……	九、巨额赎回的情形及处理方式 …… 2、巨额赎回的处理方式 当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。 …… **（3）在出现巨额赎回且单个基金份额持有人当日的赎回申请超过前一开放日基金总份额 20%以上的情形时，对于该基金份额持有人当日申请赎回的超过前一开放日基金总份额 20%以上的基金份额，基金管理人有权全部自动进行延期办理；对于该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人可以根据前段“（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。但是，如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理部分的赎回申请将被撤销。** **（4）**暂停赎回：连续 2 个开放日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。 ……
第七部分 基金合同当事人及权利义务	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 …… 注册资本：~~贰亿元~~人民币 …… 二、基金托管人 （一） 基金托管人简况 …… 法定代表人：~~刘士余~~ ……	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 …… 注册资本：**叁亿元**人民币 …… 二、基金托管人 （一） 基金托管人简况 …… 法定代表人：**周慕冰** ……
第十二部分 基金的投资	二、投资范围 …… 基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 30%-95%；投资于互联网及受益于互联网发展的相关产业和行业的股票占非现金基金资产的比例不低于 80%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。 ……	二、投资范围 …… 基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 30%-95%；投资于互联网及受益于互联网发展的相关产业和行业的股票占非现金基金资产的比例不低于 80%；现金或者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、应收申购款等**。

		……
第十二部分 基金的投资	四、投资限制 …… （2）现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%； …… …… …… ~~（16）~~法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 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，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。 ……	四、投资限制 …… （2）现金或者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、应收申购款等**； …… **（16）本基金管理人管理的全部开放式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%；** **（17）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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；** **（18）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；** **（19）**法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 **除第（2）、（12）、（17）、（18）项外**，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，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	六、暂停估值的情形 …… **3、**中国证监会和基金合同认定的其它情形。	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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的；** **4、**中国证监会和基金合同认定的其它情形。
第十八部分	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	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》**、《流动性风险管理规定》、**《基金

基金的信息披露	定。。相关法律法规关于信息披露的披露方式、登载媒介、报备方式等规定发生变化时，本基金从其最新规定。 …… 五、公开披露的基金信息 …… （六）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 …… 基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。 （七）临时报告 本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。 前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件： 1、基金份额持有人大会的召开； 2、终止《基金合同》； …… ~~26、~~中国证监会规定的其他事项。	合同》及其他有关规定。。相关法律法规关于信息披露的披露方式、登载媒介、报备方式等规定发生变化时，本基金从其最新规定。 …… 五、公开披露的基金信息 …… （六）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 …… 基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。 **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。** **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基金定期报告“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。** （七）临时报告 本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。 前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件： 1、基金份额持有人大会的召开； 2、终止《基金合同》； …… **26、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；** **27、**中国证监会规定的其他事项。

（二）《东方互联网嘉混合型证券投资基金托管协议》修改对照表

章节	原《托管协议》	《托管协议》修订后
一、基	（一）基金管理人	（一）基金管理人

金托管协议当事人	名称：东方基金管理有限责任公司 ~~注册地址~~：北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层 …… 注册资本：~~贰亿元~~人民币 营业期限：2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日 ……	名称：东方基金管理有限责任公司 **住所**：北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层 …… 注册资本：**叁亿元**人民币 营业期限：2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日 ……
一、基金托管协议当事人	（二）基金托管人 …… ~~注册地址~~：北京市东城区建国门内大街 69 号 法定代表人：~~刘士余~~ 成立时间：2009 年 1 月 15 日 ……	（二）基金托管人 …… **住所**：北京市东城区建国门内大街 69 号 法定代表人：**周慕冰** 成立时间：2009 年 1 月 15 日 ……
二、基金托管协议的依据、目的和原则	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）等有关法律、法规（以下简称“法律法规”）、基金合同及其他有关规定制订。	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）**、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》**等有关法律、法规（以下简称“法律法规”）、基金合同及其他有关规定制订。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	（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，对基金投资范围、投资对象进行监督。 …… 本基金的配置比例为:股票资产占基金资产的比例为 30%-95%；投资于互联网及受益于互联网发展的相关产业和行业的股票占非现金基金资产的比例不低于 80%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。 （二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： 1、本基金持有的股票资产占基金资产的比例为 30%-95%；投资于互联网及受益于互联网发展的相关产业和行业的股票占非现金基金资产的比例不低于 80%； 2、现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%； ……	（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，对基金投资范围、投资对象进行监督。 …… 本基金的配置比例为:股票资产占基金资产的比例为 30%-95%；投资于互联网及受益于互联网发展的相关产业和行业的股票占非现金基金资产的比例不低于 80%；现金或者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、应收申购款等。** （二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： 1、本基金持有的股票资产占基金资产的比例为 30%-95%；投资于互联网及受益于互联网发展的相关产业和行业的股票占非现金基金资产的比例不低于 80%； 2、现金或者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、应收申购款等；** …… **16、本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的**

		全部开放式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%； 17、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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资； 18、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； 19、法律法规或监管部门及《基金合同》对上述比例限制另有规定的，从其规定。 除第 2、12、17、18 项外，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，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。
	16、法律法规或监管部门及《基金合同》对上述比例限制另有规定的，从其规定。 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，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。	
第八部分 基金资产净值计算和会计核算	（四）暂停估值与公告基金份额净值的情形 （1）基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； （2）因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时； （3）中国证监会和基金合同认定的其他情形。	（四）暂停估值与公告基金份额净值的情形 （1）基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； （2）因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时； （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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的； （4）中国证监会和基金合同认定的其他情形。

东方岳灵活配置混合型证券投资基金

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》

修改法律文件的情况说明

（一）《东方岳灵活配置混合型证券投资基金基金合同》修改对照表

章节	原《基金合同》	《基金合同》修订后
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》”）、《关于保本基金的指导意见》（以下简称“指导意见”）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》”）、**《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》”）**、《关于保本基金的指导意见》（以下简称“指导意见”）和其他有关法律法规。
第二部分 释义		…… 13、《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 …… 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 基金份额的申购与赎回	五、申购和赎回的数量限制	五、申购和赎回的数量限制 …… 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。

	~~4、~~基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。 ……	5、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。 ……
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 …… 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。 ……	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 …… 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于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 日的投资者收取不低于1.5%的赎回费并全额计入基金财产。** ……
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 …… 5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或出现其他损害现有基金份额持有人利益的情形。 ~~6、~~法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、5、~~6~~项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，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。	七、拒绝或暂停申购的情形 …… 5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或出现其他损害现有基金份额持有人利益的情形。 **6、接受某一投资者申购申请后导致其持有基金份额达到或超过基金总份额 50%的。** **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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。** 8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、5、7、8 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，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。
第六部分 基金份额的申购与赎回	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… ~~6、~~法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… **6、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。** 7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

	……	……
第六部分 基金份额的申购与赎回	九、巨额赎回的情形及处理方式 …… 2、巨额赎回的处理方式 当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。 …… ~~（3）~~暂停赎回：连续 2 个开放日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。 ……	九、巨额赎回的情形及处理方式 …… 2、巨额赎回的处理方式 当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。 …… **（3）在出现巨额赎回且单个基金份额持有人当日的赎回申请超过上一开放日基金总份额 20%以上的情形时，对于该基金份额持有人当日申请赎回的超过上一开放日基金总份额 20%以上的基金份额，基金管理人有权全部自动进行延期办理；对于该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人可以根据前段“（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。但是，如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理部分的赎回申请将被撤销。** **（4）**暂停赎回：连续 2 个开放日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。 ……
第七部分 基金合同当事人及权利义务	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 …… 注册资本~~：贰亿元~~人民币 ~~存续期限：50 年~~ ……	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 …… 注册资本：**叁亿元**人民币 **营业期限：2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日** ……
第十二部分 基金的投资	二、投资范围 …… 基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%-95%；投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%；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，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%。	二、投资范围 …… 基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%-95%；投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%；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，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、应收申购款等**。

第十三部分 基金的投资	四、投资限制 …… （2）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，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； …… ~~（18）~~法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 因证券、期货市场波动、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。法律法规另有规定的，从其规定。 ……	四、投资限制 …… （2）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，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、应收申购款等**； …… **（18）本基金管理人管理的全部开放式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）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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，本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；** **（21）**法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 **除第（2）、（12）、（19）、（20）项外**，因证券、期货市场波动、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。法律法规另有规定的，从其规定。 ……
第十四部分 基金资产估值	六、暂停估值的情形 …… ~~3、~~中国证监会和基金合同认定的其它情形。	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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的；** **4、**中国证监会和基金合同认定的其它情形。
第十八部分 基金的	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。 ……	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》、**《流动性风险管理规定》**、《基金合同》及其他有关规定。

信息披露	五、公开披露的基金信息 …… （六）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 …… 基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。 （七）临时报告 本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 个工作日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。 前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件： 1、基金份额持有人大会的召开； 2、终止《基金合同》； …… ~~26、~~中国证监会规定的其他事项。	…… 五、公开披露的基金信息 …… （六）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 …… 基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。 **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。** **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基金定期报告“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。** （七）临时报告 本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 个工作日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。 前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件： 1、基金份额持有人大会的召开； 2、终止《基金合同》； …… **26、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；** 27、中国证监会规定的其他事项。

（二）《东方岳灵活配置混合型证券投资基金托管协议》修改对照表

章节	原《托管协议》	《托管协议》修订后
一、基金托管协议当	（一）基金管理人 名称：东方基金管理有限责任公司 ……	（一）基金管理人 名称：东方基金管理有限责任公司 ……

事人	注册资本：~~贰亿元~~人民币 ~~存续期间：50 年~~	注册资本：叁亿元人民币 营业期限：2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日
二、基金托管协议的依据、目的和原则	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)等有关法律法规、《基金合同》及其他有关规定制订。	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法律法规、《基金合同》及其他有关规定制订。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	（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，对基金投资范围、投资对象进行监督。 …… 基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%-95%；投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%；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，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%。 （二）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： 1、本基金股票投资占基金资产的比例为 0%—95%； 2、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，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、应收申购款等； ……	（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，对基金投资范围、投资对象进行监督。 …… 基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%-95%；投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%；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，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、应收申购款等。 （二）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： 1、本基金股票投资占基金资产的比例为 0%—95%； 2、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，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、应收申购款等； …… 18、本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部开放式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、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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，本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； 21、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 **除第 2、12、19、20 项外，**因证券、期货市场波动、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。法律法规另有规定的，从其规定。 ……
八、基金资产净值计算和会计核算	（四）暂停估值与公告基金份额净值的情形 （1）基金投资所涉及的证券/期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； （2）因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时； （3）中国证监会和基金合同认定的其他情形。	（四）暂停估值与公告基金份额净值的情形 （1）基金投资所涉及的证券/期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； （2）因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时； **（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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的；** （4）中国证监会和基金合同认定的其他情形。

东方永熙 18 个月定期开放债券型证券投资基金

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》

修改法律文件的情况说明

（一）《东方永熙 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》修改对照表

章节	原《基金合同》	《基金合同》修订后
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》”）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》”）、**《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》”）**和其他有关法律法规。
第二部分 释义		…… **13、《流动性风险管理规定》：指《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及不时作出的修订** …… **50、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 基金份额的申购与赎回	五、申购和赎回的数量限制 ~~4、~~基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额等数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规	五、申购和赎回的数量限制 …… **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。具体规定请参见相关公告。** **5、**基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额等数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在

	定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。 ……	指定媒介上公告并报中国证监会备案。 ……
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 …… 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。 ……	**六、申购和赎回的价格、费用及其用途** …… 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于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 日的投资者收取不低于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产。** ……
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 …… 6、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记结算机构因技术故障或异常情况导致基金销售系统、基金登记系统、基金会计系统或证券登记结算系统无法正常运行。 ~~7、~~法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、5、6、~~7~~项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，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。	七、拒绝或暂停申购的情形 …… 6、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记结算机构因技术故障或异常情况导致基金销售系统、基金登记系统、基金会计系统或证券登记结算系统无法正常运行。 **7、接受某一投资者申购申请后导致其持有基金份额达到或超过基金总份额 50%的。** **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。** 9、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、5、6、8、9 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，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。
第六部分 基金份额的申购	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 ……	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… **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**

与赎回	~~5、~~法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 ……	**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。** **6、**法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 ……
第六部分 基金份额的申购与赎回	九、巨额赎回的情形及处理方式 …… 2、巨额赎回的处理方式 当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。 …… ……	九、巨额赎回的情形及处理方式 …… 2、巨额赎回的处理方式 当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。 …… **（3）开放期内，在出现巨额赎回且单个基金份额持有人当日的赎回申请超过上一日基金总份额 20%以上的情形时，对于该基金份额持有人当日申请赎回的超过上一日基金总份额 20%以上的基金份额，基金管理人有权全部自动进行延期办理，如延期办理期限超过开放期的，开放期相应延长，延长的开放期内不办理申购，亦不接受新的赎回申请，即基金管理人仅为原开放期内因提交赎回申请超过基金总份额 20%以上而被延期办理赎回的单个基金份额持有人办理赎回业务；对于该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人可以根据前段“（1）全额赎回”或“（2）延缓支付赎回款项”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。但是，如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理部分的赎回申请将被撤销。** ……
第七部分 基金合同当事人及权利义务	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 …… 注册资本：~~贰亿元~~人民币 ……	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 …… 注册资本：**叁亿元**人民币 ……
第十二部分 基金的投资	二、投资范围 …… 基金的投资组合比例为：债券资产占基金资产的比例不低于 80%，但在每个开放期前一个月、开放期间及开放期结束后一个月内，基金投资不受上述比例限制；股票资产占基金资产的比例不超过 20%，权证投资比例不超过基金资产净值的 3%；开放期内，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，	二、投资范围 …… 基金的投资组合比例为：债券资产占基金资产的比例不低于 80%，但在每个开放期前一个月、开放期间及开放期结束后一个月内，基金投资不受上述比例限制；股票资产占基金资产的比例不超过 20%，权证投资比例不超过基金资产净值的 3%；开放期内，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持

	本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，在封闭期内，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持不低于交易保证金一倍的现金。 ……	有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，在封闭期内，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持不低于交易保证金一倍的现金，**其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等**。 ……
第十二部分 基金的投资	四、投资限制 …… （2）开放期内，每个交易日日终在扣除国债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%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；封闭期内，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持不低于交易保证金一倍的现金； …… ~~（16）~~法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 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比例不符合上述规定投资比例的，除第（12）项外，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。 ……	四、投资限制 …… （2）开放期内，每个交易日日终在扣除国债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%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；封闭期内，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持不低于交易保证金一倍的现金，**其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；** …… **（17）在开放期，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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；** **（18）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；** **（19）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%；** （20）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 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比例不符合上述规定投资比例的，除第**(2)**、（12）、**(17)、(18)**项外，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。 ……

第十四部分 基金资产估值	六、暂停估值的情形 …… ~~3、~~中国证监会和基金合同认定的其它情形。	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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的；** **4、**中国证监会和基金合同认定的其它情形。
第十八部分 基金的信息披露	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。 …… 五、公开披露的基金信息 …… （六）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 …… 基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。 （七）临时报告 本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。 前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件： 1、基金份额持有人大会的召开； 2、终止《基金合同》； ……	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》**、《流动性风险管理规定》、**《基金合同》及其他有关规定。 …… 五、公开披露的基金信息 …… （六）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 …… 基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。 **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。** **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基金定期报告“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。** （七）临时报告 本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。 前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件： 1、基金份额持有人大会的召开； 2、终止《基金合同》； …… **27、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响**

	~~27、~~中国证监会规定的其他事项。	**投资者赎回等重大事项时；** 28、中国证监会规定的其他事项。

（二）《东方永熙 18 个月定期开放债券型证券投资基金托管协议》修改对照表

章节	原《托管协议》	《托管协议》修订后
一、基金托管协议当事人	（一）基金管理人 名称：东方基金管理有限责任公司 …… 注册资本：~~贰亿元~~人民币 ……	（一）基金管理人 名称：东方基金管理有限责任公司 …… 注册资本：**叁亿元**人民币 ……
二、基金托管协议的依据、目的和原则	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）等有关法律、法规（以下简称“法律法规”）、基金合同及其他有关规定制订。	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、**《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》**等有关法律、法规（以下简称“法律法规”）、基金合同及其他有关规定制订。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	…… 基金的投资组合比例为：债券资产占基金资产的比例不低于 80%，但在每个开放期前一个月、开放期间及开放期结束后一个月内，基金投资不受上述比例限制；股票资产占基金资产的比例不超过 20%，权证投资比例不超过基金资产净值的 3%；开放期间，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，在封闭期内，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持不低于交易保证金一倍的现金。 ……	…… 基金的投资组合比例为：债券资产占基金资产的比例不低于 80%，但在每个开放期前一个月、开放期间及开放期结束后一个月内，基金投资不受上述比例限制；股票资产占基金资产的比例不超过 20%，权证投资比例不超过基金资产净值的 3%；开放期间，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，在封闭期内，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持不低于交易保证金一倍的现金，**其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。** ……
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： …… 2、开放期内，每个交易日日终在扣除国债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%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；封闭期内，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持不低于交易保证金一倍的现金。 ……	（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： …… 2、开放期内，每个交易日日终在扣除国债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%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；封闭期内，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持不低于交易保证金一倍的现金，**其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；** ……

	16、封闭期内，本基金资产总值不得超过基金资产净值的 200%；开放期内，本基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%； ~~17、~~法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 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比例不符合上述投资比例的，除第 2、12、~~17、18~~ 项外，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。 ……	16、封闭期内，本基金资产总值不得超过基金资产净值的 200%；开放期内，本基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%； **17、在开放期，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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；** **18、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；** **19、本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部开放式基金(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且由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%；** 20、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 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比例不符合上述投资比例的，除第 2、12、17、18 项外，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。 ……
八、基金资产净值计算和会计核算	（四）暂停估值的情形 1．基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； 2．因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时； ~~3.~~中国证监会和基金合同认定的其他情形。	（四）暂停估值的情形 1．基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； 2．因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时； **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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的；** 4、中国证监会和基金合同认定的其他情形。

东方周期优选灵活配置混合型证券投资基金

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》

修改法律文件的情况说明

（一）《东方周期优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》修改对照表

章节	原《基金合同》	《基金合同》修订后
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》”）、《关于保本基金的指导意见》（以下简称“指导意见”）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》”）、**《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》”）**、《关于保本基金的指导意见》（以下简称“指导意见”）和其他有关法律法规。
第二部分 释义		…… 13、《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 …… 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 基金份额的申购与赎回	五、申购和赎回的数量限制	五、申购和赎回的数量限制 …… 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。

	~~4、~~基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。 ……	5、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。 ……
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 …… 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。 ……	**六、申购和赎回的价格、费用及其用途** …… 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于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 日的投资者收取不低于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产。** ……
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 …… 5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或出现其他损害现有基金份额持有人利益的情形。 ~~6、~~法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、5、~~6~~项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，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。	七、拒绝或暂停申购的情形 …… 5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或出现其他损害现有基金份额持有人利益的情形。 **6、接受某一投资者申购申请后导致其持有基金份额达到或超过基金总份额 50%的。** **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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。** 8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、5、**7、8** 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，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。
第六部分 基金份额的申购与赎回	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 ……	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 …… **6、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。**

	~~6、~~法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 ……	7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 ……
第六部分 基金份额的申购与赎回	九、巨额赎回的情形及处理方式 …… 2、巨额赎回的处理方式 当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。 …… ~~3）~~暂停赎回：连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。 ……	九、巨额赎回的情形及处理方式 …… 2、巨额赎回的处理方式 当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。 …… **（3）在出现巨额赎回且单个基金份额持有人当日的赎回申请超过上一开放日基金总份额 20%以上的情形时，对于该基金份额持有人当日申请赎回的超过上一开放日基金总份额 20%以上的基金份额，基金管理人有权全部自动进行延期办理；对于该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人可以根据前段“（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。但是，如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理部分的赎回申请将被撤销。** **（4）**暂停赎回：连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。 ……
第七部分 基金合同当事人及权利义务	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 …… 注册资本：~~贰亿元人民币~~ ~~存续期限：50 年~~ ……	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 …… 注册资本：**叁亿元**人民币 **营业期限：2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日** ……
第十二部分 基金的投资	二、投资范围 …… 基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%-95%；投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%；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，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%。	二、投资范围 …… 基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%-95%；投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%；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，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、应收申购款等。**
第十二	四、投资限制	四、投资限制

部分基金的投资	1、组合限制 （1）本基金股票投资占基金资产的比例为 0%—95%； （2）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，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； …… ~~（17）~~法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 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比例不符合上述规定投资比例的，除第（12）项外，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。 ……	1、组合限制 （1）本基金股票投资占基金资产的比例为 0%—95%； （2）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，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、应收申购款等**； …… **（17）本基金管理人管理的全部开放式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%；** **（18）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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；** **（19）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；** **（20）**法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 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比例不符合上述规定投资比例的，除第**（2）**、（12）、**（18）、（19）**项外，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。 ……
第十四部分基金资产估值	六、暂停估值的情形 1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； 2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时； ~~4、~~中国证监会和基金合同认定的其它情形。	六、暂停估值的情形 1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； 2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时； **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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的；** **4、**中国证监会和基金合同认定的其它情形。

第十八部分 基金的信息披露	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。 …… 五、公开披露的基金信息 …… （六）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 基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定媒介上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。 …… （七）临时报告 本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 个工作日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。 前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件： 1、基金份额持有人大会的召开； 2、终止《基金合同》； …… ~~26、~~中国证监会规定的其他事项。	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》、**《流动性风险管理规定》、**《基金合同》及其他有关规定。 …… 五、公开披露的基金信息 …… （六）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 基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定媒介上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。 …… **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。** **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基金定期报告“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。** （七）临时报告 本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 个工作日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。 前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件： 1、基金份额持有人大会的召开； 2、终止《基金合同》； …… **26、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；** 27、中国证监会规定的其他事项。

（二）《东方周期优选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》修改对照表

章节	原《托管协议》	《托管协议》修订后

一、基金托管协议当事人	（一）基金管理人 名称：东方基金管理有限责任公司 …… 注册资本：~~贰亿~~元人民币 ~~存续期间：50 年~~ ……	（一）基金管理人 名称：东方基金管理有限责任公司 …… 注册资本：**叁亿元**人民币 **营业期限：2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日** ……
二、基金托管协议的依据、目的和原则	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)等有关法律法规、《基金合同》及其他有关规定制订。	（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、**《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》**等有关法律法规、《基金合同》及其他有关规定制订。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%-95%；投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%；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，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%。	基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%-95%；投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%；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，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、应收申购款等。**
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： 1、本基金股票投资占基金资产的比例为 0%—95%； 2、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，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。 ……	（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督： 1、本基金股票投资占基金资产的比例为 0%—95%； 2、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，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、应收申购款等**； …… **17、本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部开放式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%；** **18、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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；** **19、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**

	~~17~~、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 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比例不符合上述投资比例的，除第 12 项外，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。 ……	一致； 20、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 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比例不符合上述投资比例的，除第 2、12、18、19 项外，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。 ……
八、基金资产净值计算和会计核算	（四）暂停估值的情形 1、基金投资所涉及的证券/期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； 2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时； …… ~~3、~~中国证监会和基金合同认定的其他情形。	（四）暂停估值的情形 1、基金投资所涉及的证券/期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； 2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时； **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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的；** 4、中国证监会和基金合同认定的其他情形。

东方核心动力混合型证券投资基金

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》

修改法律文件的情况说明

（一）《东方核心动力混合型证券投资基金基金合同》修改对照表

<table>
<tr><th>章节</th><th>原《基金合同》</th><th>修订后《基金合同》</th></tr>
<tr><td>一、
前言</td><td>2、订立本基金合同的依据
订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法通则》、《中华人民共和国合同法》、《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》）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）和《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）及其他法律法规的有关规定。</td><td>2、订立本基金合同的依据
订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法通则》、《中华人民共和国合同法》、《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》）、<u>《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》”）、</u>《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《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）及其他法律法规的有关规定。</td></tr>
<tr><td>二、
释义</td><td></td><td>……
<table><tr><td><u>《流动性风险管理规定》：</u></td><td><u>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></td></tr></table>……
<table><tr><td><u>流动性受限资产：</u></td><td><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或交易的债券等；</u></td></tr></table>……</td></tr>
<tr><td>六、
基金份额的申</td><td>（五）申购与赎回的数额限制</td><td>（五）申购与赎回的数额限制
……
<u>3、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构</u></td></tr>
</table>

购、赎回与转换		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。 ……
六、基金份额的申购、赎回与转换	（七）申购和赎回的费用及其用途 …… 4、本基金的申购费用由申购人承担，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金财产。 本基金的赎回费用由基金份额持有人承担，不低于25%的部分归入基金资产，其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。 ……	（七）申购和赎回的费用及其用途 …… 4、本基金的申购费用由申购人承担，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金财产。 本基金的赎回费用由基金份额持有人承担，其中对持续持有期少于 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，其他情形下不低于 25%的部分归入基金资产，其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。 ……
六、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 2、巨额赎回的处理方式 …… …… ……	（九）巨额赎回的认定及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 …… （3）在出现巨额赎回且单个基金份额持有人当日的赎回申请超过上一开放日基金总份额 20%以上的情形时，对于该基金份额持有人当日申请赎回的超过上一开放日基金总份额 20%以上的基金份额，基金管理人有权全部自动进行延期办理；对于该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人可以根据前段“（1）接受全额赎回”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。但是，如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理部分的赎回申请将被撤销。 ……
六、基金份额的申购、赎回与转换	（十）拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理 1、在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请： …… ~~（5）~~法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。	（十）拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理 1、在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请： …… （5）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； （6）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； （7）法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

六、基金份额的申购、赎回与转换	2、在以下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请： …… ~~（5）~~法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。	2、在以下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请： …… **（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，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施；** **（6）**法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。
八、基金合同当事人及其权利义务	（一）基金管理人 1、基金管理人基本情况 名称：东方基金管理有限责任公司 住所：~~西城区金融大街 28 号盈泰商务中心 2 号楼 16 层~~ 法定代表人：~~李维雄~~ 设立日期：2004 年 6 月 11 日 ~~批准设立机关：中国证券监督管理委员~~ ~~批准设立文号：中国证监会证监基金字【2004】80 号~~ 经营范围：基金募集；基金销售；资产管理；中国证监会许可的其他业务 组织形式：有限责任公司 注册资本：~~1~~亿元人民币 ~~存续期间：50 年~~	（一）基金管理人 1、基金管理人基本情况 名称：东方基金管理有限责任公司 住所：**北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层** 法定代表人：**崔伟** 设立日期：2004 年 6 月 11 日 **批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2004]80 号** 经营范围：基金募集；基金销售；资产管理；**从事境外证券投资管理业务；**中国证监会许可的其他业务 组织形式：有限责任公司 注册资本：**叁**亿元人民币 **营业期限：2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日**
八、基金合同当事人及其权利义务	（二）基金托管人 1、基金托管人基本情况 名称：中国银行股份有限公司 …… 法定代表人：~~肖钢~~ 成立日期：1983 年 10 月 31 日 基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号 组织形式：股份有限公司 注册资本：人民币~~贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰仟零玖元~~	（二）基金托管人 1、基金托管人基本情况 名称：中国银行股份有限公司 …… 法定代表人：**陈四清** 成立日期：1983 年 10 月 31 日 基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号 组织形式：股份有限公司 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**
十四、基金的投资	（二）投资范围 本基金投资范围限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行或上市的股票、债券及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。 本基金股票资产投资比例为基金资产的 60%-95%，债券、现金等类型资产及权证、资产支持证券的投资	（二）投资范围 本基金投资范围限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行或上市的股票、债券及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。 本基金股票资产投资比例为基金资产的 60%-95%，债券、现金等类型资产及权证、资产支持证券的投资比

	比例为基金资产的 5%－40%，其中，现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，权证投资比例不高于基金资产净值的 3%，资产支持证券投资比例不高于基金资产净值的 20%。	例为基金资产的 5%－40%，其中，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投资比例不低于基金资产净值的 5%，权证投资比例不高于基金资产净值的 3%，资产支持证券投资比例不高于基金资产净值的 20%。
十四、基金的投资	（八）投资禁止行为与限制 …… 2、基金投资组合比例限制 …… （9）本基金股票资产投资比例为基金资产的 60%-95%，债券、现金等类型资产及权证、资产支持证券的投资比例为基金资产的 5%－40%，其中，现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，权证投资比例不高于基金资产净值的 3%，资产支持证券投资比例不高于基金资产净值的 20%。 …… ~~（13）~~法律法规及中国证监会规定的其他限制。 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。	（八）投资禁止行为与限制 …… 2、基金投资组合比例限制 …… （9）本基金股票资产投资比例为基金资产的 60%-95%，债券、现金等类型资产及权证、资产支持证券的投资比例为基金资产的 5%－40%，其中，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投资比例不低于基金资产净值的 5%，权证投资比例不高于基金资产净值的 3%，资产支持证券投资比例不高于基金资产净值的 20%。 …… **（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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，本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；** **（16）**法律法规及中国证监会规定的其他限制。 **除第（9）中“现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%”及第(10)、(14)、（15）项外，**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。
十四、基金的投资	（九）投资组合比例调整 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。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。法律法规另有规定时，从其规定。	（九）投资组合比例调整 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。**除基金投资组合比例限制的第（9）中“现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%”及第（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。法律法规另有规定时，从其规定。
十七、基金资产估值	（六）暂停估值的情形 …… ~~3、~~中国证监会和基金合同认定的其它情形。	（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时，基金管理人经与基金托管人协商一致的；** 4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。
二十一、基金的信息披露	（五）定期报告 …… （六）临时报告与公告 基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在两日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。 前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的事件，包括： 1、基金份额持有人大会的召开； 2、终止基金合同； …… ~~28、~~中国证监会规定的其他事项。	（五）定期报告 …… **5、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。** **6、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基金定期报告“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。** （六）临时报告与公告 基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在两日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。 前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的事件，包括： 1、基金份额持有人大会的召开； 2、终止基金合同； …… **28、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；** 29、中国证监会规定的其他事项。

（二）《东方核心动力混合型证券投资基金托管协议》修改对照表

章节	原《托管协议》	《托管协议》修订后
一、托管协议当事人	（一）基金管理人（或简称“管理人”） 名称：东方基金管理有限责任公司 住所：~~北京市西城区金融大街 28 号盈泰商务中心 2 号楼 16 层~~ 法定代表人：~~李维雄~~	（一）基金管理人（或简称“管理人”） 名称：东方基金管理有限责任公司 住所：**北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层** **办公地址：北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层** **邮政编码：100033**

	成立时间：2004 年 6 月 11 日 ~~批准设立机关：中国证监会~~ ~~批准设立文号：证监基金字【2004】80 号~~ 组织形式：有限责任公司 注册资本：~~1~~亿元人民币 经营范围：基金募集；基金销售；资产管理；中国证监会许可的其他业务 ~~存续期间：50 年~~	法定代表人：**崔伟** 成立日期：2004 年 6 月 11 日 **批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2004]80 号** 组织形式：有限责任公司 注册资本：**叁**亿元人民币 **营业期限：2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日** 经营范围：基金募集；基金销售；资产管理；**从事境外证券投资管理业务；**中国证监会许可的其他业务
一、托管协议当事人	（二）基金托管人（或简称“托管人”） 名称：中国银行股份有限公司 …… 法定代表人：~~肖钢~~ 成立日期：1983 年 10 月 31 日 基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号 组织形式：股份有限公司 注册资本：人民币~~贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰仟零玖元~~ ……	（二）基金托管人（或简称“托管人”） 名称：中国银行股份有限公司 …… 法定代表人：**陈四清** 成立日期：1983 年 10 月 31 日 基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号 组织形式：股份有限公司 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** ……
二、托管协议的依据、目的、原则和解释	（一）依据 本协议依据《中华人民共和国合同法》、《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》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）及其他有关法律法规与《东方核心动力混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）订立。	（一）依据 本协议依据《中华人民共和国合同法》、《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》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（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“《流动性风险管理规定》”）**及其他有关法律法规与《东方核心动力混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）订立。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	（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： 1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。基金管理人应将拟投资的股票库、债券库等各投资品种的具体范围提供给基金托管人。基金管理人可以根据实际情况的变化，对各投资品种的具体范围予以更新和调整，并通知基金托管人。基金托管人根据上述投资范围对基金的投资进行监督； 2、对基金投融资比例进行监督；	（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： 1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。基金管理人应将拟投资的股票库、债券库等各投资品种的具体范围提供给基金托管人。基金管理人可以根据实际情况的变化，对各投资品种的具体范围予以更新和调整，并通知基金托管人。基金托管人根据上述投资范围对基金的投资进行监督； 2、对基金投融资比例进行监督； **3、根据《流动性风险管理规定》，对以下投资进行监督：** **（1）本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的**

	……	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且由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%； （2）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等本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，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资； （3）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。本基金管理人承诺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。 因证券市场波动、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比例不符合上述第（1）项规定投资比例的，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。 ……