（上接B045版）

关于修改嘉实策略增长混合型证券投资基金基金合同及托管协议的公告

一、本次修改的基本情况

根据中国证监会颁布的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》要求，为推动产品持续良性发展，嘉实基金管理有限公司对嘉实策略增长混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）基金合同、托管协议等法律文件在基金投资限制、申购赎回限制、信息披露条款等方面进行了相应调整。嘉实基金管理有限公司作为本基金的管理人，已与本基金托管人就基金合同、托管协议修改达成一致，并报中国证监会北京监管局备案。本次修改后的基金合同、托管协议将于2018年3月31日起正式施行。

二、基金合同、托管协议修订情况

基于上述调整，本公司将对本基金的基金合同、托管协议中涉及的相关内容进行修订，具体修订内容详见附件《（嘉实策略增长混合型证券投资基金基金合同）条款修改对照表》、《（嘉实策略增长混合型证券投资基金托管协议）条款修改对照表》。

三、重要提示

1、本次基金管理人系根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修订本基金的《基金合同》和《托管协议》，所修订内容可能对本基金投资运作及投资者办理基金申购、赎回业务产生一定影响，包括且不限于：出于流动性风险管理需要增加或调整了基金的部分投资限制规定；对投资者持有基金少于7日（不含）收取不低于1.5%的短期赎回费率；在规定的特定情形下可能会对投资者的申购/赎回申请数量进行限制、临时拒绝或暂停申购/赎回申请、对部分赎回申请进行延期办理等，由此可能导致投资者的申购和赎回申请无法全部及时处理，从而可能影响投资者的资金安排及投资计划。敬请投资者关注以上变化和影响，并仔细阅读本基金修订后的基金合同及相关法律文件，审慎进行投资决策。

2、本次修订属于按照有效的法律法规和监管机构的规定执行，本基金管理人已就修订内容履行了规定的程序，符合相关法律法规及基金合同的规定。

3、本公告仅对本基金基本情况进行说明。基金管理人将在本公告发布当日，将修改后的基金合同、托管协议登载于本公司网站，并将在更新的基金招募说明书中，对涉及上述修订的内容进行相应更新。

投资者可以通过可以拨打本公司客服热线（400-600-8800）或登录本公司网站（www.jsfund.cn）获取相关信息。

特此公告

嘉实基金管理有限公司

2018年3月22日

附件：

1、《（嘉实策略增长混合型证券投资基金基金合同）条款修改对照表》

2、《（嘉实策略增长混合型证券投资基金托管协议）条款修改对照表》

《嘉实策略增长混合型证券投资基金基金合同》条款修改对照表

修改前	修改后
第一部分 前言和释义	
前言 为保护基金投资者合法权益，明确基金合同当事人的权利与义务，规范嘉实策略增长混合型证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）运作，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》”）及其他有关规定……	前言 为保护基金投资者合法权益，明确《基金合同》当事人的权利与义务，规范嘉实增长混合型证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）运作，依据《中华人民共和国合同法》……《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）及其他有关规定……
释义 无	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
第二部分 释义	
无	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 无	五、申购和赎回的数量限制 4、当投资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、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，赎回费中赎回应归基金财产的部分，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，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，赎回费中归赎回应归基金财产的部分，其余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基金投资者的申购申请时…… 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措施以减少该不确定性的影响。	七、拒绝或暂停申购的情形 …… 7、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%，或者变相规避50%集中度的情形时； 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基金投资者的申购申请时……
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。	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。
九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 （2）部分延期赎回：……如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。 若基金发生巨额赎回且基金管理人决定部分延期赎回并在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额10%的前提下，如比例单个基金份额持有人超过前一开放日基金总份额30%的赎回申请（“大额赎回申请人”），基金管理人应当按照优先确认其他赎回申请人（“小额赎回申请人”）赎回申请的原则，对当日的赎回申请按照以下原则办理：如小额赎回申请人的赎回申请金额当日未被全部确认，则在仍可接受赎回申请的范围内对大额赎回申请人的赎回申请按比例（单个大额赎回申请人的赎回申请量/当日大额赎回申请总量）确认，对大额赎回申请人未予确认的赎回申请延期办理；如小额赎回申请人的赎回申请在当日不能被全部确认，则按照单个小额赎回申请人的赎回申请量占当日小额赎回申请总量的比例，确认其当日受理的赎回申请量，对当日全部未确认的赎回申请（含小额赎回申请人的其余赎回申请与大额赎回申请人的全部赎回申请）延期办理。延期办理的具体程序，按照本条规定的延期赎回或取消赎回的方式办理；同时，基金管理人应当对延期办理的事宜在指定媒介上刊登公告。	九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 （2）部分延期赎回：……如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。 若基金发生巨额赎回且基金管理人决定部分延期赎回并在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额10%的前提下，如比例单个基金份额持有人超过前一开放日基金总份额30%的赎回申请（“大额赎回申请人”），基金管理人应当按照优先确认其他赎回申请人（“小额赎回申请人”）赎回申请的原则，对当日的赎回申请按照以下原则办理：如小额赎回申请人的赎回申请金额当日未被全部确认，则在仍可接受赎回申请的范围内对大额赎回申请人的赎回申请按比例（单个大额赎回申请人的赎回申请量/当日大额赎回申请总量）确认，对大额赎回申请人未予确认的赎回申请延期办理；如小额赎回申请人的赎回申请在当日不能被全部确认，则按照单个小额赎回申请人的赎回申请量占当日小额赎回申请总量的比例，确认其当日受理的赎回申请量，对当日全部未确认的赎回申请（含小额赎回申请人的其余赎回申请与大额赎回申请人的全部赎回申请）延期办理。延期办理的具体程序，按照本条规定的延期赎回或取消赎回的方式办理；同时，基金管理人应当对延期办理的事宜在指定媒介上刊登公告。
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 住所：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期46层06-08单元 法定代表人：邓红国 二、基金托管人 （一）基金托管人简况 法定代表人：田国立 注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾叁亿柒仟捌佰肆拾捌万壹仟玖佰陆拾圆整	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心二期31层01-11单元 法定代表人：赵学军 二、基金托管人 （一）基金托管人简况 法定代表人：陈四清 注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万叁仟贰佰陆拾贰圆整
第十二部分 基金的投资	
二、投资范围 …… 本基金投资于目标ETP的资产比例不低于基金资产净值的90%；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，持有现金或剔期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。	二、投资范围 …… 本基金投资于目标ETP的资产比例不低于基金资产净值的90%；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，持有现金或剔期日在一年以内的政府债券的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。
四、投资限制 1、组合限制 （11）本基金对参与股指期货交易，应当将合约市值与其持有的股票、债券、买入返售金融资产、银行存款和结算备付金合计的总额控制在基金合同约定的投资范围内，但因证券市场波动、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不符合前述比例要求的，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 （11）本基金对参与股指期货交易，应当将合约市值与其持有的股票、债券、买入返售金融资产、银行存款和结算备付金合计的总额控制在基金合同约定的投资范围内，但因证券市场波动、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不符合前述比例要求的，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。 （14）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合本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； （15）本基金与私募类证券投资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；
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，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（9）、（14）、（15）项外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制、目标ETP暂停申购、赎回或二级市场交易价格溢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 无	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性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停基金估值；
第十八部分 基金的信息披露	
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 ……	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，为保障其他投资者的利益，基金管理人应当在基金定期报告“重大事件揭示”或“基金管理人的管理工作报告”等部分充分披露投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及产品的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。
（七）临时报告 无	（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；

注：基金合同内容摘要涉及上述内容的一并修改。

《嘉实沪港深精选股票型证券投资基金托管协议》条款修改对照表

修改前	修改后
一、托管协议当事人	
（一）基金管理人（或简称“管理人”） 住所：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期46层06-08单元 法定代表人：邓红国 （二）基金托管人（或简称“托管人”） 法定代表人：田国立 注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾叁亿柒仟捌佰肆拾捌万壹仟玖佰陆拾贰圆整	（一）基金管理人（或简称“管理人”） 住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心二期31层01-11单元 法定代表人：赵学军 （二）基金托管人（或简称“托管人”） 法定代表人：陈四清 注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万叁仟贰佰陆拾贰圆整
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》）、《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《嘉实沪港深精选股票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》）、《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《嘉实沪港深精选股票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，对基金管理人的投资运作进行监督。 1、对基金的投资范围、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80%-95%（其中投资于港股通标的股票的比例占基金资产的80%-95%），在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留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%；股指期货、权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。	（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，对基金管理人的投资运作进行监督。 1、对基金的投资范围、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80%-95%（其中投资于港股通标的股票的比例占基金资产的80%-95%），在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。 2、对基金投资进行监督。 （1）本基金管理人的投资范围仅限于上市交易的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、可分离交易可转债的纯债部分、次级债、可转换债券、可交换债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。
四、投资限制 1、组合限制 （11）本基金对参与股指期货交易，应当将合约市值与其持有的股票、债券、买入返售金融资产、银行存款和结算备付金合计的总额控制在基金合同约定的投资范围内，但因证券市场波动、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不符合前述比例要求的，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 （11）本基金对参与股指期货交易，应当将合约市值与其持有的股票、债券、买入返售金融资产、银行存款和结算备付金合计的总额控制在基金合同约定的投资范围内，但因证券市场波动、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不符合前述比例要求的，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。 （14）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合本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； （15）本基金与私募类证券投资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；
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，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（9）、（14）、（15）项外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制、目标ETP暂停申购、赎回或二级市场交易价格溢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 无	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性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停基金估值；
第十八部分 基金的信息披露	
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 ……	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，为保障其他投资者的利益，基金管理人应当在基金定期报告“重大事件揭示”或“基金管理人的管理工作报告”等部分充分披露投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及产品的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。
（七）临时报告 无	（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；

注：基金合同内容摘要涉及上述内容的一并修改。

《嘉实沪港深精选股票型证券投资基金基金合同》条款修改对照表

修改前	修改后
第一部分 前言	
一、订立本基金合同的目的、依据和原则 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》”）……《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。	一、订立本基金合同的目的、依据和原则 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》”）……《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》及颁布机关对其不时做出的修订
第二部分 释义	
无	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
第三部分 基金的基本情况	
十、本基金为目标ETF的联接基金，二者既有联系也有区别： …… 本基金与目标ETF业绩表现可能出现差异，可能引发差异的因素主要包括： 1、法律法规对投资比例的要求。目标ETF作为一种特殊的基金品种，可将全部或按证全部的基金资产，用于跟踪标的指数的表现；而本基金作为普通的开放式基金，仍需将不低于基金资产净值5%的资产投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券；	十、本基金为目标ETF的联接基金，二者既有联系也有区别： …… 本基金与目标ETF业绩表现可能出现差异，可能引发差异的因素主要包括： 1、法律法规对投资比例的要求。目标ETF作为一种特殊的基金品种，可将全部或按证全部的基金资产，用于跟踪标的指数的表现；而本基金作为普通的开放式基金，仍需将不低于基金资产净值5%的资产投资于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；
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 无	五、申购和赎回的数量限制 4、当投资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、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，赎回费中赎回应归基金财产的部分，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，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，赎回费中归赎回应归基金财产的部分，其余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基金投资者的申购申请时……	七、拒绝或暂停申购的情形 …… 7、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%，或者变相规避50%集中度的情形时； 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措施以减少该不确定性的影响，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基金投资者的申购申请时……
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。	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。
九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 （2）部分延期赎回：……如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。 若基金发生巨额赎回且基金管理人决定部分延期赎回并在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额10%的前提下，如比例单个基金份额持有人超过前一开放日基金总份额30%的赎回申请（“大额赎回申请人”），基金管理人应当按照优先确认其他赎回申请人（“小额赎回申请人”）赎回申请的原则，对当日的赎回申请按照以下原则办理：如小额赎回申请人的赎回申请金额当日未被全部确认，则在仍可接受赎回申请的范围内对大额赎回申请人的赎回申请按比例（单个大额赎回申请人的赎回申请量/当日大额赎回申请总量）确认，对大额赎回申请人未予确认的赎回申请延期办理；如小额赎回申请人的赎回申请在当日不能被全部确认，则按照单个小额赎回申请人的赎回申请量占当日小额赎回申请总量的比例，确认其当日受理的赎回申请量，对当日全部未确认的赎回申请（含小额赎回申请人的其余赎回申请与大额赎回申请人的全部赎回申请）延期办理。延期办理的具体程序，按照本条规定的延期赎回或取消赎回的方式办理；同时，基金管理人应当对延期办理的事宜在指定媒介上刊登公告。	九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 （2）部分延期赎回：……如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。 若基金发生巨额赎回且基金管理人决定部分延期赎回并在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额10%的前提下，如比例单个基金份额持有人超过前一开放日基金总份额30%的赎回申请（“大额赎回申请人”），基金管理人应当按照优先确认其他赎回申请人（“小额赎回申请人”）赎回申请的原则，对当日的赎回申请按照以下原则办理：如小额赎回申请人的赎回申请金额当日未被全部确认，则在仍可接受赎回申请的范围内对大额赎回申请人的赎回申请按比例（单个大额赎回申请人的赎回申请量/当日大额赎回申请总量）确认，对大额赎回申请人未予确认的赎回申请延期办理；如小额赎回申请人的赎回申请在当日不能被全部确认，则按照单个小额赎回申请人的赎回申请量占当日小额赎回申请总量的比例，确认其当日受理的赎回申请量，对当日全部未确认的赎回申请（含小额赎回申请人的其余赎回申请与大额赎回申请人的全部赎回申请）延期办理。延期办理的具体程序，按照本条规定的延期赎回或取消赎回的方式办理；同时，基金管理人应当对延期办理的事宜在指定媒介上刊登公告。
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 住所：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期46层06-08单元 法定代表人：邓红国 二、基金托管人 （一）基金托管人简况 法定代表人：田国立 注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾叁亿柒仟捌佰肆拾捌万壹仟玖佰陆拾贰圆整	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心二期31层01-11单元 法定代表人：赵学军 二、基金托管人 （一）基金托管人简况 法定代表人：陈四清 注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万叁仟贰佰陆拾贰圆整
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80%-95%（其中投资于港股通标的股票的比例占基金资产的80%-95%），在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留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%；股指期货、权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。	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80%-95%（其中投资于港股通标的股票的比例占基金资产的80%-95%），在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留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%，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	
（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，对基金管理人的投资运作进行监督。 1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。 …… 正常情况下，本基金资产中投资于目标ETP的比例不低于基金资产净值的90%；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%。	（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，对基金管理人的投资运作进行监督。 1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。 …… 正常情况下，本基金资产中投资于目标ETP的比例不低于基金资产净值的90%；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。
四、投资限制 1、组合限制 （11）本基金对参与股指期货交易，应当将合约市值与其持有的股票、债券、买入返售金融资产、银行存款和结算备付金合计的总额控制在基金合同约定的投资范围内，但因证券市场波动、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不符合前述比例要求的，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 （11）本基金对参与股指期货交易，应当将合约市值与其持有的股票、债券、买入返售金融资产、银行存款和结算备付金合计的总额控制在基金合同约定的投资范围内，但因证券市场波动、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不符合前述比例要求的，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。 （14）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合本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； （15）本基金与私募类证券投资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；
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，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（9）、（14）、（15）项外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制、目标ETP暂停申购、赎回或二级市场交易价格溢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 无	六、暂停估值的情形 3、当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停基金估值；
第十八部分 基金的信息披露	
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 ……	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，为保障其他投资者的利益，基金管理人应当在基金定期报告“重大事件揭示”或“基金管理人的管理工作报告”等部分充分披露投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及产品的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。
（七）临时报告 无	（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；

注：基金合同内容摘要涉及上述内容的一并修改。

《嘉实黄金证券投资基金（LOF）托管协议》条款修改对照表

修改前	修改后
一、前言和释义	
前言 为保护基金投资者合法权益，明确《基金合同》当事人的权利与义务，规范嘉实黄金证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”或“基金”）运作，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》）及其他有关法律法规，制定本基金合同。	前言 为保护基金投资者合法权益，明确《基金合同》当事人的权利与义务，规范嘉实黄金证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”或“基金”）运作，依据《中华人民共和国合同法》、《关于实施〈合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法〉有关问题的通知》（以下简称《通知》）、《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》）及其他有关规定，在平等自愿、公平合理、诚实信用、充分保护基金投资者及相关当事人的合法权益的原则基础上，特订立《嘉实黄金证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“本合同”或“《基金合同》”）。
释义 无	释义 4、《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
六、基金份额的申购与赎回	
五、申购和赎回的数量限制 无	五、申购与赎回的数额限制 4、当投资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、申购费用和赎回费用 2、本基金的赎回费用由基金份额持有人承担，投资者可