（上接B101版）

第六部分基金份额的申购、赎回与转换 六、申购和赎回的价格、费用及其用途		7.当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，摆动定价机制的具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律组织的规定，具体见基金管理人届时的相关公告。	根据《流动性风险管理规定》第二十五条新增
第六部分基金份额的申购、赎回与转换 七、拒绝或暂停申购的情形	2.发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请；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，并采取暂停接受基金申购申请的措施； ……	2.发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请；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，并采取暂停接受基金申购申请的措施； ……	根据《流动性风险管理规定》第二十四条新增拒绝或暂停申购的情形 根据《流动性风险管理规定》第十九条新增拒绝或暂停申购的情形
第六部分基金份额的申购、赎回与转换 七、拒绝或暂停申购的情形	发生上述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申购时，基金管理人应当在指定媒介刊登暂停申购公告。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。	发生上述1.2.3.5.6.9项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当在指定媒介刊登暂停申购公告。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。	根据《流动性风险管理规定》第二十四条新增拒绝或暂停申购的情形 根据《流动性风险管理规定》第十九条新增拒绝或暂停申购的情形
第六部分基金份额的申购、赎回与转换 八、暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形	2.发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金赎回申请或延缓支付赎回款项，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。	发生上述1.2.3.5.6.9项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当在指定媒介刊登暂停申购公告。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。	根据《流动性风险管理规定》第二十四条新增拒绝或暂停申购的情形 根据《流动性风险管理规定》第十九条新增拒绝或暂停申购的情形
第六部分基金份额的申购、赎回与转换 九、巨额赎回的情形及处理方式	（3）在发生巨额赎回，且单个基金份额持有人赎回申请超过上一日基金总份额30%的情形下，对单个基金份额持有人超过上一日基金总份额30%以上的赎回申请，基金管理人应当延期办理赎回。对该单个基金份额持有人30%以内（含30%）的赎回申请按普通基金份额持有人（即其他赎回申请未超过上一日基金总份额30%以上的基金份额持有人）赎回程序（包括巨额赎回）办理，对该单个基金份额持有人超过30%的赎回申请进行延期办理。对于未能赎回部分，该基金份额持有人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。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。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续该类基金份额的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。	（3）在发生巨额赎回，且单个基金份额持有人赎回申请超过上一日基金总份额30%的情形下，对单个基金份额持有人超过上一日基金总份额30%以上的赎回申请，基金管理人应当延期办理赎回。对该单个基金份额持有人30%以内（含30%）的赎回申请按普通基金份额持有人（即其他赎回申请未超过上一日基金总份额30%以上的基金份额持有人）赎回程序（包括巨额赎回）办理，对该单个基金份额持有人超过30%的赎回申请进行延期办理。对于未能赎回部分，该基金份额持有人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。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。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续该类基金份额的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。	根据《流动性风险管理规定》第二十四条新增拒绝或暂停申购的情形
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	名称：上海东方证券资产管理有限公司 住所：上海市中山南路318号2号楼31层 批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可字[2010]518号 开展公开募集证券投资基金管理业务批准文号：证监许可[2013]1131号 组织形式：有限责任公司 注册资本：3亿元人民币 存续期限：持续经营 联系电话：（021）63325888 联系人：钱慧	名称：上海东方证券资产管理有限公司 住所：上海市黄浦区中山南路318号31层 授权代表：潘鑫军 设立日期：2010年7月28日 批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可字[2010]518号 开展公开募集证券投资基金管理业务批准文号：证监许可[2013]1131号 组织形式：有限责任公司 注册资本：3亿元人民币 存续期限：持续经营 联系电话：（021）63325888 联系人：廉迪	根据实际情况调整
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：上海浦东发展银行股份有限公司 办公地址：上海市北京东路689号 法定代表人：吉晓辉 成立时间：1992年10月19日 批准设立机关和批准设立文号：证监基金字[2003]105号 注册资本：人民币186.5347亿元 存续期间：永久存续 基金托管资格批文及文号：证监基字[2003]105号	名称：上海浦东发展银行股份有限公司 注册地址：上海市中山东一路12号 办公地址：上海市中山东一路12号 法定代表人：高国富 成立日期：1992年10月19日 基金托管业务资格批准机关：中国证监会 基金托管业务资格文号：证监基金字[2003]105号 经营范围：永久存续 注册资本：人民币293.52亿元 存续期间：持续经营	根据实际情况调整
第十二部分 基金的投资 二、投资范围	…… 本基金投资组合中股票资产投资比例为基金资产的0%—30%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货及国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%。	…… 本基金投资组合中股票资产投资比例为基金资产的0%—30%（其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的0%—30%，投资于港股通标的股票的比例占基金资产的0%—30%）；本基金每个交易日日终在扣除股指期货及国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%。	根据《流动性风险管理规定》第十八条增加现金的限制
第十二部分 基金的投资 四、投资组合限制	（3）本基金每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等； （5）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%；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%； （23）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金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。	（3）本基金每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等； （5）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券（同一家公司在境内和香港同时上市的A+H股合计计算），不超过该证券的10%； （23）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金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。	根据《流动性风险管理规定》第十八条增加现金的限制 根据《流动性风险管理规定》第十九条增加流动性受限资产投资限制 根据《流动性风险管理规定》第二十条增加巨额赎回的处理方式
第十二部分 基金的投资 四、投资组合限制	（3）本基金每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等； （5）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%；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%； （23）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金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。	（3）本基金每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等； （5）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券（同一家公司在境内和香港同时上市的A+H股合计计算），不超过该证券的10%； （23）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金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。	根据《流动性风险管理规定》第十八条增加现金的限制 根据《流动性风险管理规定》第十九条增加流动性受限资产投资限制 根据《流动性风险管理规定》第二十条增加巨额赎回的处理方式
第十四部分 基金资产估值 三、估值方法	7.当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，并需履行相关信息披露义务。	7.基金托管人对基金投资流通受限证券的监督 基金管理人投资流通受限证券，应事先根据中国证监会相关规定，明确基金投资流通受限证券的比例，制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险，法律风险和操作风险等各种风险。基金托管人对基金管理人是否遵守相关制度、流动性风险处置预案以及相关投资额度和比例等的情况进行监督。 （1）本基金投资的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，须为经中国证监会批准的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发行人未满足流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金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。	明确“流通受限证券”与“流动性受限资产”并不完全一致
第十四部分 基金资产估值 六、暂停估值的情形	3.当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值；	3.当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值；	根据《流动性风险管理规定》第二十四条增加极端情形下的估值原则
第十六部分 基金的信息披露 五、公开披露的基金信息（七）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（合称“基金定期报告”）	…… 本基金投资组合中股票资产投资比例为基金资产的0%—30%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货及国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%。	…… 报告期内出现单一投资人持有基金份额比例达到或超过基金总份额20%的情形，为保障其他投资人权益，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”项下披露该投资人的类别、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。 本基金持续运作过程中，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。	根据《流动性风险管理规定》第二十六条第二款增加临时公告的事项。 根据《流动性风险管理规定》第二十五条增加摆动定价机制的信息披露义务。
第十八部分 基金的信息披露 五、公开披露的基金信息（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人赎回等重大事项时； 27、基金管理人采用摆动定价机制；	
基金合同摘要做相应调整			

（二）《基金托管协议》修改内容及修改说明

位置	原条款	调整后条款	修改说明
	基金管理人：上海东方证券资产管理有限公司 住所：上海市中山南路318号2号楼31层 法定代表人：王国斌 成立时间：2010年7月28日 批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可字[2010]518号 组织形式：有限责任公司 注册资本：3亿元人民币 存续期间：持续经营 联系电话：（021）63325888 联系人：钱慧	基金管理人：上海东方证券资产管理有限公司 住所：上海市黄浦区中山南路318号31层 授权代表：潘鑫军 成立时间：2010年7月28日 批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可字[2010]518号 组织形式：有限责任公司 注册资本：3亿元人民币 存续期间：持续经营 联系电话：（021）63325888	根据实际情况调整
	基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司 办公地址：上海市北京东路689号 法定代表人：吉晓辉 成立日期：1992年10月19日 基金托管业务资格批准机关：中国证监会 基金托管业务资格文号：证监基金字[2003]105号 组织形式：股份有限公司 注册资本：人民币186.5347亿元 经营期限：永久存续	基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司 办公地址：上海市中山东一路12号 法定代表人：高国富 成立日期：1992年10月19日 基金托管业务资格批准机关：中国证监会 基金托管业务资格文号：证监基金字[2003]105号 组织形式：股份有限公司（上市） 注册资本：人民币293.52亿元 存续期间：持续经营	根据实际情况调整
一、基金托管协议的依据、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》）、《证券投资基金托管业务管理办法》、《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）》、《东方红稳健精选混合型证券投资基金基金合同》（以下简称《基金合同》）及其他有关法律、法规制定。	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》、《证券投资基金托管业务管理办法》、《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）》、《东方红稳健精选混合型证券投资基金基金合同》（以下简称《基金合同》）及其他有关法律、法规制定。	增加《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》
二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查 （一）基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权	2.发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请；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，并采取暂停接受基金申购申请的措施； …… 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、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致超过基金管理人设定的基金总规模上限、单日净申购比例上限、单一投资人单日申购金额上限，基金管理人有权对该等申购申请进行部分确认或拒绝接受该等申购申请； 发生上述1.2.3.5.6.9项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当在指定媒介刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，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。	2.发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请；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，并采取暂停接受基金申购申请的措施； …… 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、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致超过基金管理人设定的基金总规模上限、单日净申购比例上限、单一投资人单日申购金额上限，基金管理人有权对该等申购申请进行部分确认或拒绝接受该等申购申请； 发生上述1.2.3.5.6.9项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当在指定媒介刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，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。	根据《流动性风险管理规定》第二十四条新增拒绝或暂停申购的情形 根据《流动性风险管理规定》第十九条新增拒绝或暂停申购的情形
第六部分基金份额的申购、赎回与转换 七、拒绝或暂停申购的情形			
第六部分基金份额的申购、赎回与转换 八、暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形	2.发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项；	2.发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项；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，并采取延缓支付赎回款项或者停接受基金赎回申请的措施；	根据《流动性风险管理规定》第二十四条新增暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形
第六部分基金份额的申购、赎回与转换 九、巨额赎回的情形及处理方式	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，赎回费归入基金财产的比例依照相关法律法规设定，具体见招募说明书，未归入部分用于支付登记费和其他必要的手续费。	（3）在发生巨额赎回，且单个基金份额持有人赎回申请超过上一日基金总份额30%的情形下，对单个基金份额持有人超过上一日基金总份额30%以上的赎回申请，基金管理人应当延期办理赎回。对该单个基金份额持有人30%以内（含30%）的赎回申请按普通基金份额持有人（即其他赎回申请未超过上一日基金总份额30%以上的基金份额持有人）赎回程序（包括巨额赎回）办理，对该单个基金份额持有人超过30%的赎回申请进行延期办理。对于未能赎回部分，该基金份额持有人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。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。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续该类基金份额的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。	根据《流动性风险管理规定》第十九条新增巨额赎回的处理方式
第六部分基金份额的申购、赎回与转换 十、其他	7.当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，并需履行相关信息披露义务。	7.当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，并需履行相关信息披露义务。	根据《流动性风险管理规定》第二十四条新增摆动定价机制
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	名称：上海东方证券资产管理有限公司 住所：上海市中山南路318号2号楼31层 法定代表人：王国斌 成立时间：2010年7月28日 批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可字[2010]518号 组织形式：有限责任公司 注册资本：3亿元人民币 存续期间：持续经营 联系电话：（021）63325888 联系人：钱慧	名称：上海东方证券资产管理有限公司 住所：上海市黄浦区中山南路318号31层 授权代表：潘鑫军 成立时间：2010年7月28日 批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可字[2010]518号 组织形式：有限责任公司 注册资本：3亿元人民币 存续期间：持续经营 联系电话：（021）63325888 联系人：廉迪	根据实际情况调整
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：上海浦东发展银行股份有限公司 办公地址：上海市北京东路689号 法定代表人：吉晓辉 成立日期：1992年10月19日 基金托管业务资格批准机关：中国证监会 基金托管业务资格文号：证监基金字[2003]105号 组织形式：股份有限公司（上市） 注册资本：人民币186.5347亿元 经营期限：永久存续	名称：上海浦东发展银行股份有限公司 注册地址：上海市中山东一路12号 办公地址：上海市中山东一路12号 法定代表人：高国富 成立日期：1992年10月19日 基金托管业务资格文号：证监基金字[2003]105号 组织形式：股份有限公司（上市） 注册资本：人民币293.52亿元 存续期间：持续经营	根据实际情况调整
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：上海浦东发展银行股份有限公司 办公地址：上海市中山东一路12号 法定代表人：吉晓辉 成立日期：1992年10月19日 基金托管业务资格批准机关：中国证监会 基金托管业务资格文号：证监基金字[2003]105号 组织形式：股份有限公司（上市） 注册资本：人民币186.5347亿元 经营期限：永久存续	基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司 办公地址：上海市中山东一路12号 法定代表人：高国富 成立日期：1992年10月19日 基金托管业务资格批准机关：中国证监会 基金托管业务资格文号：证监基金字[2003]105号 组织形式：股份有限公司（上市） 注册资本：人民币293.52亿元 存续期间：持续经营	根据实际情况调整
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：中国建设银行股份有限公司 办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼 法定代表人：王洪章 成立时间：2004年09月17日 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 基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12号	名称：中国建设银行股份有限公司 办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼 法定代表人：田国立 成立时间：2004年09月17日 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 基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12号	根据实际情况调整
第十二部分 基金的投资 二、投资范围	…… 本基金投资组合中股票资产投资比例为基金资产的0%—95%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货及国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%。	…… 本基金投资组合中股票资产投资比例为基金资产的0%—95%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货及国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%。	根据《流动性风险管理规定》第十八条增加现金的限制

（二）《基金托管协议》修改内容及修改说明

位置	原条款	调整后条款	修改说明
一、基金托管协议当事人 （一）基金管理人	注册地址：上海市中山南路318号2号楼31层 办公地址：上海市中山南路318号2号楼31层 …… 法定代表人：陈光明	住所：上海市黄浦区中山南路318号31层 办公地址：上海市中山南路318号2号楼31层 …… 授权代表：潘鑫军	根据实际情况调整
一、基金托管协议当事人 （二）基金托管人	…… 法定代表人：王洪章	…… 法定代表人：田国立	根据实际情况调整
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。基金托管人按下述比例和时间进行监督： …… 本基金投资组合中股票资产投资比例为基金资产的0%—95%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货及国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%。	…… 本基金投资组合中股票资产投资比例为基金资产的0%—95%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货及国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%。	根据《流动性风险管理规定》第十八条增加现金的限制
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查 （五）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金管理人投资流通受限证券进行监督。	1.本基金投资的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，须为经中国证监会批准的非公开发行股票，公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发行人未满足流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金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。 本基金投资的流通受限证券是指中国证券登记结算有限责任公司或中央国债登记结算有限责任公司负责登记和存管，并可在证券交易所或全国银行间债券市场交易的证券。 本基金投资的流通受限证券应保证登记存管在本基金名下，基金管理人负责相关工作的落实和协调，并确保基金托管人能够正常监督。因基金管理人原因产生的流通受限证券登记存管问题，造成基金托管人无法安全保管本基金资产的责任与损失，及因流通受限证券存管直接影响本基金安全的责任及损失，由基金管理人承担。 本基金持有一家公司发行的流通受限证券，按买入成本不得超过买入前一交易日基金资产净值的20%）更为严格，此处流通受限证券投资比例调整以及因流通受限证券存管直接影响本基金安全的责任及损失，及因流通受限证券存管直接影响本基金安全的责任及损失，由基金管理人承担。 本基金持有一家公司发行的流通受限证券，按买入成本不得超过买入前一日基金资产净值的6%；基金持有的所有流通受限证券，按买入成本计不得超过买入前一日基金资产净值的20%。	1.本基金投资的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，须为经中国证监会批准的非公开发行股票，公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发行人未满足流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金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。 本基金投资的流通受限证券是指中国证券登记结算有限责任公司或中央国债登记结算有限责任公司负责登记和存管，并可在证券交易所或全国银行间债券市场交易的证券。 本基金投资的流通受限证券应保证登记存管在本基金名下，基金管理人负责相关工作的落实和协调，并确保基金托管人能够正常监督。因基金管理人原因产生的流通受限证券登记存管问题，造成基金托管人无法安全保管本基金资产的责任与损失，及因流通受限证券存管直接影响本基金安全的责任及损失，由基金管理人承担。 本基金持有一家公司发行的流通受限证券，按买入成本不得超过买入前一交易日基金资产净值的20%）更为严格，此处流通受限证券投资比例调整以及因流通受限证券存管直接影响本基金安全的责任及损失，及因流通受限证券存管直接影响本基金安全的责任及损失，由基金管理人承担。	避免与《流动性风险管理规定》中的流动性受限资产混淆，明确“流通受限证券”与“流动性受限资产”不完全一致，流通受限证券比流动性受限资产的范围小。 由于流通受限证券比流动性受限资产的范围小，根据《流动性风险管理规定》第十八条增加现金的限制
四、基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权	2.发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请；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，并采取暂停接受基金申购申请的措施； …… 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、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致超过基金管理人设定的基金总规模上限、单日净申购比例上限、单一投资人单日申购金额上限，基金管理人有权对该等申购申请进行部分确认或拒绝接受该等申购申请； 发生上述1.2.3.5.6.9项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当在指定媒介刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，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。	2.发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请；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，并采取暂停接受基金申购申请的措施； …… 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、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致超过基金管理人设定的基金总规模上限、单日净申购比例上限、单一投资人单日申购金额上限，基金管理人有权对该等申购申请进行部分确认或拒绝接受该等申购申请； 发生上述1.2.3.5.6.9项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当在指定媒介刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，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。	根据《流动性风险管理规定》第二十四条新增拒绝或暂停申购的情形 根据《流动性风险管理规定》第十九条新增拒绝或暂停申购的情形
第六部分基金份额的申购、赎回与转换 七、拒绝或暂停申购的情形			
第六部分基金份额的申购、赎回与转换 九、巨额赎回的情形及处理方式	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 58.摆动定价机制：指当开放式基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资人，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资人的合法权益不受损害并得到公平对待	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 58.摆动定价机制：指当开放式基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资人，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资人的合法权益不受损害并得到公平对待	《流动性风险管理规定》于2017年颁布，增加释义 根据《流动性风险管理规定》第四十条第一款增加流动性受限资产释义 根据《流动性风险管理规定》第四十条第三款增加摆动定价释义
第六部分基金份额的申购、赎回与转换 十、其他	7.当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，并需履行相关信息披露义务。	7.当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，并需履行相关信息披露义务。	根据《流动性风险管理规定》第二十四条新增暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形
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	名称：上海东方证券资产管理有限公司 住所：上海市中山南路318号2号楼31层 法定代表人：王国斌 成立时间：2010年7月28日 批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可字[2010]518号