

《国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金基金合同》修改对照表

章节	原文内容	修改后内容
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》”）、《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		新增内容如下： 14、《流动性风险管理规定》：指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订 76、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
第八部分 国泰有色份额的申购、赎回与转换 五、申购和赎回的数量限制		新增内容如下： 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。
第八部分 国泰有色份额的申购、赎回与转换 六、申购和赎回的价格、费用及其用途	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注册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注册登记费和其他必要的手续费。其中，对持续持有期少于 7 日的基金份额持有人收取不低于 1.50%的赎回费并全额计入基金财产。

第八部分 国泰有色份额的申购、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。 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投资人申购申请时，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	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接受基金申购申请。 新增内容如下： 6、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人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。法律法规或中国证监会另有规定的除外。 发生上述第 1、2、3、5、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。
--	---	---

	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。	发生上述第 6 项情形时，基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的申购申请进行限制，基金管理人有权拒绝该等全部或者部分申购申请。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。
第八部分 国泰有色份额的申购、赎回与转换 八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形	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接受基金赎回申请或延缓支付赎回款项。
第八部分 国泰有色份额的申购、赎回与转换 九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的场外处理方式	（2）部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的（包括国泰有色份额、有色 A 份额和有色 B 份额）10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账	（2）部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的（包括国泰有色份额、有色 A 份额和有色 B 份额）10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确

	户赎回申请量占赎回申请总量的比例,确定当日受理的赎回份额;对于未能赎回部分,投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的,将自动转入下一个开放日继续赎回,直到全部赎回为止;选择取消赎回的,当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理,无优先权并以下一开放日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。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。	定当日受理的赎回份额;对于未能赎回部分,投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的,将自动转入下一个开放日继续赎回,直到全部赎回为止;选择取消赎回的,当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理,无优先权并以下一开放日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。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。 若本基金发生巨额赎回,在单个基金份额持有人超过基金总份额(包括国泰有色份额、有色 A 份额和有色 B 份额)50%以上的赎回申请的情形下:对于该基金份额持有人当日赎回申请超过上一开放日基金总份额(包括国泰有色份额、有色 A 份额和有色 B 份额)50%以上的部分,基金管理人可以延期办理赎回申请;对于该基金份额持有人当日赎回申请未超过 50%的部分,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。
第十六部分 基金的投资 二、投资范围	本基金所持有的股票资产占基金资产的比例为90%—95%，其中标的指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于股票资产的90%，且不低于非现金资产的80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，权证投资不高于基金资产净值的3%。	本基金所持有的股票资产占基金资产的比例为90%—95%，其中标的指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于股票资产的90%，且不低于非现金资产的80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。权证投资不高于基金资产净值的3%。
第十六部分 基金的投资 四、投资限制 1、组合限制	（2）每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券； 	（2）每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等； 新增内容如下： （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本基金合同约定的投资范围保持一

	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，基金管理人应当在相关证券可交易的 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。	致； （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、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资； 除上述第（2）、（10）、（15）、（16）项另有约定外，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，基金管理人应当在相关证券可交易的 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。
第十八部分 基金资产估值 六、暂停估值的情形		新增内容如下： 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一致的，基金管理

		人应当暂停估值；
第二十四部分 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		新增内容如下： 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（包括国泰有色份额、有色 A 份额和有色 B 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定风险，中国证监会认定的特殊情形除外。 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。
第二十四部分 基金的信息披露 五、公开披露的基金信息 （八）临时报告		新增内容如下： 32、发生涉及国泰有色份额申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；
第三十部分 基金合同内容摘要	同步更新	

《国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金托管协议》修改对照表

章节	原文内容	修改后内容
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。	本基金所持有的股票资产占基金资产的比例为 90%—95%，其中标的指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于股票资产的 90%，且不低于非现金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，权证投资不高于基金资产净值的 3%。	本基金所持有的股票资产占基金资产的比例为 90%—95%，其中标的指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于股票资产的 90%，且不低于非现金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。权证投资不高于基金资产净值的 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、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.每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券； 11.本基金持有的所有流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的 20%；本基金持	2.每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等； 11.本基金持有的所有流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的 15%；本基金持有的同一流通受限

	有的同一流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的 10 %； 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，基金管理人应当在相关证券可交易的 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规	证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的 10 %； 新增内容如下： 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该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资； 除上述第 2、8、18、19 项另有约定外，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，基金管理人应当在相关证券可交易的 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形
--	---	---

	定的特殊情形除外。	除外。
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		新增内容如下： 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一致的，基金管理人应当暂停估值；