申万菱信基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金修改基金合同的公告

根据中国证监会2017年8月31日发布的《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“《管理规定》”），对已经成立的开放式基金，原基金合同内容不符合《管理规定》的，应当在《管理规定》施行之日起6个月内，修改基金合同并公告。根据《管理规定》等有关法律法规，经与相应基金托管人协商一致，并报监管机构备案，申万菱信基金管理有限公司（以下简称“本公司”或“本基金管理人”）对旗下部分开放式基金基金合同相关条款进行修改。详情如下：

一、适用基金范围

基金名称	基金代码	基金托管人
申万菱信深证成指分级证券投资基金	163109	中国工商银行
申万菱信量化小盘股票型证券投资基金（LOF）	163110	中国工商银行
申万菱信中小板指数证券投资基金（LOF）	163111	中国农业银行
申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金	163113	中国工商银行
申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金	163114	中国农业银行
申万菱信中证军工指数分级证券投资基金	163115	中国农业银行
申万菱信中证申万电子行业投资指数分级证券投资基金	163116	广发银行
申万菱信中证申万传媒行业投资指数分级证券投资基金	163117	上海银行
申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金	163118	中国农业银行
申万菱信中证申万新兴健康产业主题投资指数证券投资基金(LOF)	163119	中国农业银行
申万菱信盛利精选证券投资基金	193308	中国工商银行
申万菱信沪深300指数增强型证券投资基金	193318	中国工商银行
申万菱信新动力混合型证券投资基金	193328	中国工商银行
申万菱信新经济混合型证券投资基金	193358	中国工商银行
申万菱信竞争优势混合型证券投资基金	193368	中国农业银行
申万菱信添益宝债券型证券投资基金（A类/B类）	193378/310379	中国工商银行
申万菱信消费增长混合型证券投资基金	193388	中国工商银行
申万菱信沪深300价值指数证券投资基金	193398	中国工商银行
申万菱信稳益宝债券型证券投资基金	319608	华夏银行
申万菱信可转换债券债券型证券投资基金	319618	中国工商银行
申万菱信中证500指数增强型证券投资基金	002510	中国工商银行
申万菱信中证500指数优选增强型证券投资基金	002386	中国农业银行
申万菱信安泰添利纯债一年定期开放债券型证券投资基金	004007	广州农村商业银行
申万菱信安泰增利纯债一年定期开放债券型证券投资基金	004088	徽商银行

二、基金合同修改情况

本次基金合同的修改内容包括释义、申购和赎回、基金的估值、基金的投资和信息披露等条款，具体修改内容见附件。本次基金合同修改的内容符合《管理规定》和相关法律法规的要求，符合基金合同的相关约定，不涉及法律法规规定或基金合同约定的应经基金份额持有人大会决议通过的事项。

本基金管理人经与各基金托管人协商一致，已相应修改上述基金的托管协议，修改后的基金合同和托管协议自2018年3月31日起生效。为不影响原有基金份额持有人的利益，上述修改中“对于持续持有期少于7日的投资者收取不少于1.5%的赎回费并全额计入基金财产”的条款将于2018年3月31日起正式实施，即自2018年3月31日起，上述基金将对持续持有期少于7日的投资者收取1.5%的赎回费并全额计入基金财产。本基金管理人将据此在下次更新基金招募说明书时，对上述修改内容进行相应更新，投资者投资基金时应认真阅读基金的《基金合同》、更新的《招募说明书》等法律文件。

投资者可以登录本公司网站www.swsmu.com或拨打客户服务电话400 880 8588（免长途话费）或021-962299了解详情。

风险提示：本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

特此公告。

申万菱信基金管理有限公司
2018年3月24日

附件一：《申万菱信深证成指分级证券投资基金基金合同》修改对照表

章节	原文条款	修改后条款
	内容	内容
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，现在申万菱信深证成指分级证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）运作，依据《中华人民共和国证券法》、《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《流动性管理规定》）、证券投资基金信息披露内容与格式准则第6号《基金合同的内容与格式》及其他有关规定，在平等日期、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《申万菱信深证成指分级证券投资基金基金合同》。	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，现在申万菱信深证成指分级证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）运作，依据《中华人民共和国证券法》、《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《流动性管理规定》）、证券投资基金信息披露内容与格式准则第6号《基金合同的内容与格式》及其他有关规定，在平等日期、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《申万菱信深证成指分级证券投资基金基金合同》。
第一部分 前言和释义 前言	新增： 本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的情形除外。	
	新增： 《流动性管理规定》《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》 …… 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	
第一部分 前言和释义 释义	删除基金基金份额赎回费率。	
	增加基金基金份额赎回费率。	
第二部分 释义	无	14、《流动性管理规定》：指中国证监会2017年8月31日颁布、同年10月1日起实施的《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
第三部分 申万菱信基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金修改基金合同的公告	附件四：《申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基基金合同》修改对照表	

章节	原文条款	修改后条款
	内容	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《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《中华人民共和国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。	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《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《中华人民共和国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《流动性管理规定》）和其他有关法律法规。
	无	无
第二部分 释义	无	14、《流动性管理规定》：指中国证监会2017年8月31日颁布、同年10月1日起实施的《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
第四部分 申万菱信基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金修改基金合同的公告	附件五：《申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金基金合同》修改对照表	

章节	原文条款	修改后条款
	内容	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《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《中华人民共和国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。	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《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《中华人民共和国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《流动性管理规定》）和其他有关法律法规。
	无	无
第二部分 释义	无	14、《流动性管理规定》：指中国证监会2017年8月31日颁布、同年10月1日起实施的《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
第五部分 基金份额的申购与赎回	三、申购与赎回的原则 无	三、申购与赎回的原则 6、本基金暂不采用摆动定价机制。待未来条件成熟，基金管理人在履行适当程序后，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。具体处理原则与操作规范遵循届时有效的相关法律法规及监管部门、自律组织的规定。
	五、申购与赎回的数额限制 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。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告。
	五、申购和赎回的数量限制 无	五、申购和赎回的数量限制 无
	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 5、申万菱信沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)基金合同》为申万菱信沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)基金合同》（以下简称“《申万菱信沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)基金合同》”）。	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 5、申万菱信沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)基金合同》为申万菱信沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)基金合同》（以下简称“《申万菱信沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)基金合同》”）。
	七、拒绝或暂停申购的情形 无	七、拒绝或暂停申购的情形 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者持有基金份额的比例达到或超过50%，或者变相规避50%集中度的情形时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停基金申购申请。 7、申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单一投资者单日或单笔申购金额上限的。 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，基金管理人应当暂停基金估值。
	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：…… …… 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为85%～95%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的85%。投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的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。	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：……若基金发生巨额赎回，在出现单个基金份额持有人超过基金总份额20%的赎回申请（“大额赎回申请人”）情形下，基金管理人应当对大额赎回申请人的赎回申请延期办理，即按照保护其他赎回申请人（“小额赎回申请人”）利益的原则，基金管理人应当优先确认小额赎回申请人的赎回申请。具体为：如小额赎回申请人的赎回申请在当日被全部确认，则基金管理人在当日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。如小额赎回申请人未予确认的赎回申请在当日未被全部确认，则对全部未确认的赎回申请（含小额赎回申请）按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。如果法律法规、监管要求调整导致上述第5项内容取消或变更的，基金管理人在履行适当程序后，有权修改或取消上述限制，而无须召开基金份额持有人大会，并在招募说明书或相关公告中明确。
	十、暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式 无	十、暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式 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，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。
	十一、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：…… …… 本基金单一投资者持有基金份额的比例达到或超过基金份额总数25%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的情形除外。	十一、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：…… …… 本基金单一投资者持有基金份额的比例达到或超过基金份额总数20%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的情形除外。
	十二、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：…… …… 本基金单一投资者持有基金份额的比例达到或超过50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的情形除外。	十二、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：……若基金发生巨额赎回，在出现单个基金份额持有人超过基金总份额20%的赎回申请（“大额赎回申请人”）情形下，基金管理人应当对大额赎回申请人的赎回申请延期办理，即按照保护其他赎回申请人（“小额赎回申请人”）利益的原则，基金管理人应当优先确认小额赎回申请人的赎回申请。具体为：如小额赎回申请人的赎回申请在当日被全部确认，则基金管理人在当日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。如小额赎回申请人未予确认的赎回申请在当日未被全部确认，则对全部未确认的赎回申请（含小额赎回申请）按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。如果法律法规、监管要求调整导致上述第5项内容取消或变更的，基金管理人在履行适当程序后，有权修改或取消上述限制，而无须召开基金份额持有人大会，并在招募说明书或相关公告中明确。
	十三、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：…… …… 本基金单一投资者持有基金份额的比例达到或超过基金份额总数50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的情形除外。	十三、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：……若基金发生巨额赎回，在出现单个基金份额持有人超过基金总份额20%的赎回申请（“大额赎回申请人”）情形下，基金管理人应当对大额赎回申请人的赎回申请延期办理，即按照保护其他赎回申请人（“小额赎回申请人”）利益的原则，基金管理人应当优先确认小额赎回申请人的赎回申请。具体为：如小额赎回申请人的赎回申请在当日被全部确认，则基金管理人在当日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。如小额赎回申请人未予确认的赎回申请在当日未被全部确认，则对全部未确认的赎回申请（含小额赎回申请）按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。如果法律法规、监管要求调整导致上述第5项内容取消或变更的，基金管理人在履行适当程序后，有权修改或取消上述限制，而无须召开基金份额持有人大会，并在招募说明书或相关公告中明确。
	十四、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：…… …… 本基金单一投资者持有基金份额的比例达到或超过50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的情形除外。	十四、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：……若基金发生巨额赎回，在出现单个基金份额持有人超过基金总份额20%的赎回申请（“大额赎回申请人”）情形下，基金管理人应当对大额赎回申请人的赎回申请延期办理，即按照保护其他赎回申请人（“小额赎回申请人”）利益的原则，基金管理人应当优先确认小额赎回申请人的赎回申请。具体为：如小额赎回申请人的赎回申请在当日被全部确认，则基金管理人在当日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。如小额赎回申请人未予确认的赎回申请在当日未被全部确认，则对全部未确认的赎回申请（含小额赎回申请）按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。如果法律法规、监管要求调整导致上述第5项内容取消或变更的，基金管理人在履行适当程序后，有权修改或取消上述限制，而无须召开基金份额持有人大会，并在招募说明书或相关公告中明确。
	十五、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：…… …… 本基金单一投资者持有基金份额的比例达到或超过50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的情形除外。	十五、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：……若基金发生巨额赎回，在出现单个基金份额持有人超过基金总份额20%的赎回申请（“大额赎回申请人”）情形下，基金管理人应当对大额赎回申请人的赎回申请延期办理，即按照保护其他赎回申请人（“小额赎回申请人”）利益的原则，基金管理人应当优先确认小额赎回申请人的赎回申请。具体为：如小额赎回申请人的赎回申请在当日被全部确认，则基金管理人在当日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。如小额赎回申请人未予确认的赎回申请在当日未被全部确认，则对全部未确认的赎回申请（含小额赎回申请）按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。如果法律法规、监管要求调整导致上述第5项内容取消或变更的，基金管理人在履行适当程序后，有权修改或取消上述限制，而无须召开基金份额持有人大会，并在招募说明书或相关公告中明确。
	十六、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：…… …… 本基金单一投资者持有基金份额的比例达到或超过50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的情形除外。	十六、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：……若基金发生巨额赎回，在出现单个基金份额持有人超过基金总份额20%的赎回申请（“大额赎回申请人”）情形下，基金管理人应当对大额赎回申请人的赎回申请延期办理，即按照保护其他赎回申请人（“小额赎回申请人”）利益的原则，基金管理人应当优先确认小额赎回申请人的赎回申请。具体为：如小额赎回申请人的赎回申请在当日被全部确认，则基金管理人在当日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。如小额赎回申请人未予确认的赎回申请在当日未被全部确认，则对全部未确认的赎回申请（含小额赎回申请）按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。如果法律法规、监管要求调整导致上述第5项内容取消或变更的，基金管理人在履行适当程序后，有权修改或取消上述限制，而无须召开基金份额持有人大会，并在招募说明书或相关公告中明确。
	十七、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：…… …… 本基金单一投资者持有基金份额的比例达到或超过50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的情形除外。	十七、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：……若基金发生巨额赎回，在出现单个基金份额持有人超过基金总份额20%的赎回申请（“大额赎回申请人”）情形下，基金管理人应当对大额赎回申请人的赎回申请延期办理，即按照保护其他赎回申请人（“小额赎回申请人”）利益的原则，基金管理人应当优先确认小额赎回申请人的赎回申请。具体为：如小额赎回申请人的赎回申请在当日被全部确认，则基金管理人在当日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。如小额赎回申请人未予确认的赎回申请在当日未被全部确认，则对全部未确认的赎回申请（含小额赎回申请）按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。如果法律法规、监管要求调整导致上述第5项内容取消或变更的，基金管理人在履行适当程序后，有权修改或取消上述限制，而无须召开基金份额持有人大会，并在招募说明书或相关公告中明确。
	十八、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：…… …… 本基金单一投资者持有基金份额的比例达到或超过50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的情形除外。	十八、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：……若基金发生巨额赎回，在出现单个基金份额持有人超过基金总份额20%的赎回申请（“大额赎回申请人”）情形下，基金管理人应当对大额赎回申请人的赎回申请延期办理，即按照保护其他赎回申请人（“小额赎回申请人”）利益的原则，基金管理人应当优先确认小额赎回申请人的赎回申请。具体为：如小额赎回申请人的赎回申请在当日被全部确认，则基金管理人在当日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。如小额赎回申请人未予确认的赎回申请在当日未被全部确认，则对全部未确认的赎回申请（含小额赎回申请）按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。如果法律法规、监管要求调整导致上述第5项内容取消或变更的，基金管理人在履行适当程序后，有权修改或取消上述限制，而无须召开基金份额持有人大会，并在招募说明书或相关公告中明确。
	十九、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：…… …… 本基金单一投资者持有基金份额的比例达到或超过50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的情形除外。	十九、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：……若基金发生巨额赎回，在出现单个基金份额持有人超过基金总份额20%的赎回申请（“大额赎回申请人”）情形下，基金管理人应当对大额赎回申请人的赎回申请延期办理，即按照保护其他赎回申请人（“小额赎回申请人”）利益的原则，基金管理人应当优先确认小额赎回申请人的赎回申请。具体为：如小额赎回申请人的赎回申请在当日被全部确认，则基金管理人在当日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。如小额赎回申请人未予确认的赎回申请在当日未被全部确认，则对全部未确认的赎回申请（含小额赎回申请）按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。如果法律法规、监管要求调整导致上述第5项内容取消或变更的，基金管理人在履行适当程序后，有权修改或取消上述限制，而无须召开基金份额持有人大会，并在招募说明书或相关公告中明确。
第十一部分 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：上海市淮海中路300号香港新世界大厦40楼 法定代表人：委国芳	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 住所：上海市中山南路100号11层 法定代表人：刘郡
	二、基金托管人 （一）基金托管人简况 法定代表人：蒋超良	二、基金托管人 （一）基金托管人简况 法定代表人：周慕冰
	二、投资范围 …… 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为85%～95%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的85%。投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的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。	二、投资范围 …… 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为85%～95%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的85%。投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的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。其中投资于低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。
	四、投资限制 1.组合限制 （1）本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为85%～95%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的85%，投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%。 （2）每个交易日日终，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。其中投资于低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。	四、投资限制 1.组合限制 （1）本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为85%～95%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的85%，投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%。 （2）每个交易日日终，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。其中投资于低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。 （11）本基金参与股指期货交易依据下列标准建构组合： （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%；但除非法律法规另有规定，本基金指数化投资部分不受此限制。 （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、基金规模等基金管理人之外的因素致使本基金不符合本款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资。 （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。 除上述第（2）、（8）、（15）、（16）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。法律法规另有规定的从其规定。
	五、估值方法 无	五、估值方法 8、基金管理人在履行适当程序后，当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循届时有效的相关法律法规及监管部门、自律组织的规定。
	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。	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。
	七、暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式 无	七、暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式 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，基金管理人应当暂停接受基金赎回申请。
	十一、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：……部分赎延期回不受单笔赎回延期低份额的限制。	十一、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：……部分赎延期回不受单笔赎回延期低份额的限制。若基金发生巨额赎回，在出现单个基金份额持有人超过基金总份额20%的赎回申请（“大额赎回申请人”）情形下，基金管理人应当对大额赎回申请人的赎回申请延期办理，即按照保护其他赎回申请人（“小额赎回申请人”）利益的原则，基金管理人应当优先确认小额赎回申请人的赎回申请。具体为：如小额赎回申请人的赎回申请在当日被全部确认，则基金管理人在当日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。如小额赎回申请人未予确认的赎回申请在当日未被全部确认，则对全部未确认的赎回申请（含小额赎回申请）按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。如果法律法规、监管要求调整导致上述第5项内容取消或变更的，基金管理人在履行适当程序后，有权修改或取消上述限制，而无须召开基金份额持有人大会，并在招募说明书或相关公告中明确。
	十二、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：…… …… 本基金单一投资者持有基金份额的比例达到或超过50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的情形除外。	十二、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：……若基金发生巨额赎回，在出现单个基金份额持有人超过基金总份额20%的赎回申请（“大额赎回申请人”）情形下，基金管理人应当对大额赎回申请人的赎回申请延期办理，即按照保护其他赎回申请人（“小额赎回申请人”）利益的原则，基金管理人应当优先确认小额赎回申请人的赎回申请。具体为：如小额赎回申请人的赎回申请在当日被全部确认，则基金管理人在当日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。如小额赎回申请人未予确认的赎回申请在当日未被全部确认，则对全部未确认的赎回申请（含小额赎回申请）按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。如果法律法规、监管要求调整导致上述第5项内容取消或变更的，基金管理人在履行适当程序后，有权修改或取消上述限制，而无须召开基金份额持有人大会，并在招募说明书或相关公告中明确。
	十三、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：…… …… 本基金单一投资者持有基金份额的比例达到或超过50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的情形除外。	十三、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：……若基金发生巨额赎回，在出现单个基金份额持有人超过基金总份额20%的赎回申请（“大额赎回申请人”）情形下，基金管理人应当对大额赎回申请人的赎回申请延期办理，即按照保护其他赎回申请人（“小额赎回申请人”）利益的原则，基金管理人应当优先确认小额赎回申请人的赎回申请。具体为：如小额赎回申请人的赎回申请在当日被全部确认，则基金管理人在当日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。如小额赎回申请人未予确认的赎回申请在当日未被全部确认，则对全部未确认的赎回申请（含小额赎回申请）按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。如果法律法规、监管要求调整导致上述第5项内容取消或变更的，基金管理人在履行适当程序后，有权修改或取消上述限制，而无须召开基金份额持有人大会，并在招募说明书或相关公告中明确。
	十四、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：…… …… 本基金单一投资者持有基金份额的比例达到或超过50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的情形除外。	十四、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：……若基金发生巨额赎回，在出现单个基金份额持有人超过基金总份额20%的赎回申请（“大额赎回申请人”）情形下，基金管理人应当对大额赎回申请人的赎回申请延期办理，即按照保护其他赎回申请人（“小额赎回申请人”）利益的原则，基金管理人应当优先确认小额赎回申请人的赎回申请。具体为：如小额赎回申请人的赎回申请在当日被全部确认，则基金管理人在当日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。如小额赎回申请人未予确认的赎回申请在当日未被全部确认，则对全部未确认的赎回申请（含小额赎回申请）按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。如果法律法规、监管要求调整导致上述第5项内容取消或变更的，基金管理人在履行适当程序后，有权修改或取消上述限制，而无须召开基金份额持有人大会，并在招募说明书