(上接B674版)

章节	原基金合同	修订后的基金合同	修订理由
第一部分	(一)订立本基金合同的目的、依据和原则 2.2、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“《销售管理办法》”)、《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 2.2、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“《销售管理办法》”)、《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。	根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》的发布补充。
第二部分		增加: 55.《流动性规定》: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 56.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,包括但不限于剩期日在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 57.摆动定价机制:指当本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、赎回的投资者,从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响,确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待	对《流动性风险管理规定》做出解释 根据《流动性风险管理规定》第40条补充
第六部分	(五)申购和赎回的金额 增加:4.当投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。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。 5.基金管理人有权规定本基金的总规模限额,以及单日申购金额上限,具体规模或比例上限请参见招募说明书或相关公告。	五、申购和赎回的数量限制 增加:4、当投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。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。 5、基金管理人有权规定本基金的总规模限额,以及单日申购金额上限,具体规模或比例上限请参见招募说明书或相关公告。	根据《流动性风险管理规定》第19条补充。
	(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。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,对持续持有期不少于7日的投资者,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。	根据《流动性风险管理规定》第23条补充。
	(六)申购和赎回的价格、费用及其用途 增加:8、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,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相关法律法规及监管部门、自律组织的规定。	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 5、A类基金份额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。赎回费用人基金财产的比例依照相关法律法规规定,具体见招募说明书。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。C类基金份额不收取赎回费用。	根据《流动性风险管理规定》第23条补充。
	(七)拒绝或暂停申购的情形 增加:6.申请超过基金管理人设定的基金总规模,单日申购金额上限,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。 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,基金管理人应及时恢复申购业务的办理。	七、拒绝或暂停申购的情形 增加:5、申请超过基金管理人设定的基金总规模,单日申购金额上限,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。 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%,或者受相规避50%集中度的情形时。	根据《流动性风险管理规定》第14、19、24条补充。
	(七)拒绝或暂停申购的情形 …… 发生上述1,2,3,5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,基金管理人及基金托管人不承担该退回款项产生的利息等损失。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 …… 发生上述1,2,3,5,7,9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全部或部分拒绝的,被拒绝的申购款项将退还给投资人。基金管理人及基金托管人不承担该退回款项产生的利息等损失。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。	依据前述条款的增加,对相应序号做出变更
	(八)暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 增加: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,基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。	(八)暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 增加: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,基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。	根据《流动性风险管理规定》第24条补充
	增加: (9)巨额赎回的情形及处理方式 (4)如果基金发生巨额赎回,在单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额20%以上的赎回申请的情形下,基金管理人可以对该单个基金份额持有人超过基金总份额20%的部分赎回申请延期办理。基金管理人决定对该单个基金份额持有人超过基金总份额20%的部分赎回申请延期办理的,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。而对于单个基金份额持有人20%以内(含20%)的赎回申请当当日其他投资者的赎回申请按前述(1)或(2)条款处理,具体请见相关公告。	增加: 九、巨额赎回的情形及处理方式 (4)如果基金发生巨额赎回,在单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额20%以上的赎回申请的情形下,基金管理人可以对该单个基金份额持有人超过基金总份额20%的部分赎回申请延期办理。基金管理人决定对该单个基金份额持有人超过基金总份额20%的部分赎回申请延期办理的,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。而对于单个基金份额持有人20%以内(含20%)的赎回申请当当日其他投资者的赎回申请按前述(1)或(2)条款处理,具体请见相关公告。	根据《流动性风险管理规定》第21条补充
第七部分	(一)基金管理人 住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1000号31层 注册资本:12亿元人民币	(一)基金管理人 住所:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1000号31层 注册资本:25亿元人民币	对基金管理人基本信息作出更新
	(二)基金托管人 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	(二)基金托管人 法定代表人:田国立 注册资本:人民币贰千伍佰亿壹仟零贰拾壹万柒千肆百捌拾陆元	对基金托管人基本信息作出更新
第十二部分	(二)投资范围 …… 本基金投资于股票资产占基金资产的比例为85%-95%,其中被动投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于股票资产的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、存出保证金及应收申购款等;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 …… 本基金投资于股票资产占基金资产的比例为85%-95%,其中被动投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于股票资产的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、存出保证金及应收申购款等;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。 (三)投资策略 …… 1. 资产配置策略 ……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、存出保证金及应收申购款等。	根据《流动性风险管理规定》第18条补充
	(七)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。	(七)投资限制 …… 除上述第(9)、(12)、(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。	依据前述条款的增加,对相应序号做出变更
	(七)投资限制 …… (12)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)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、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前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; (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;	(七)投资限制 …… 除上述第(2)、(9)、(12)、(13)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。	依据前述条款的增加,对相应序号做出变更
	(七)投资限制 (12)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、存出保证金及应收申购款等;	(七)投资限制 …… (12)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。	根据《流动性风险管理规定》第18条补充
	(七)投资限制 (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。	(七)投资限制 …… 除上述第(2)、(9)、(12)、(13)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。	根据《流动性风险管理规定》第16条补充 根据《流动性风险管理规定》第17条补充
	(七)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。	(七)投资限制 …… 除上述第(2)、(9)、(12)、(13)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。	依据前述条款的增加,对相应序号做出变更
	(七)投资限制 …… (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。 (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;	(七)投资限制 …… 除上述第(2)、(9)、(12)、(13)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。	依据前述条款的增加,对相应序号做出变更
	(七)投资限制 (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。	(七)投资限制 …… 除上述第(2)、(9)、(12)、(13)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。	根据《流动性风险管理规定》第16条补充 根据《流动性风险管理规定》第17条补充
	(七)投资限制 (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。 (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;	(七)投资限制 …… 除上述第(2)、(9)、(12)、(13)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。	根据《流动性风险管理规定》第16条补充 根据《流动性风险管理规定》第17条补充
	(七)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。	(七)投资限制 …… 除上述第(2)、(9)、(12)、(13)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。	依据前述条款的增加,对相应序号做出变更
	(七)投资限制 …… (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。 (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;	(七)投资限制 …… 除上述第(2)、(9)、(12)、(13)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。	根据《流动性风险管理规定》第16条补充 根据《流动性风险管理规定》第17条补充
	(七)投资限制 (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。	(七)投资限制 …… 除上述第(2)、(9)、(12)、(13)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。	根据《流动性风险管理规定》第16条补充 根据《流动性风险管理规定》第17条补充