(上接B130版)

第十六部分 基金的投资	二、投资范围	本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、权证、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。 如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。 基金的投资组合比例为：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%－96%，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，预留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。
第十六部分 基金的投资 四、投资限制 1、组合限制	（二）投资组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： （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%－96%，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； …… （15）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发行的可流通股票的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； （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、基金规模变动等客观原因导致投资比例不符合上述规定投资比例的…… （17）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）、（10）、（17）、（18）项外，因证券、期货市场波动、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……	本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、权证、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。 如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。 基金的投资组合比例为：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%－96%，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）投资组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： （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%－96%，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； …… 新增： （15）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发行的可流通股票的30%； （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、基金规模变动等客观原因导致投资比例不符合上述规定投资比例的…… （17）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）、（10）、（17）、（18）项外，因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动等客观原因导致投资比例不符合上述规定投资比例的……	发生上述第1,2,3,4,5,8,9项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体和基金管理人网站上刊登暂停申购公告。如果基金投资者的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给基金投资者。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。当发生上述第6,7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。如果法律法规、监管要求调整导致上述第6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。
		新增： 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申购业务。
第十八部分 基金资产估值 三、估值方法	新增： 9.基金管理人在履行适当程序后，当市万佛钙物有限公司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。	新增： 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。
第十八部分 基金资产估值 六、暂停估值的情形	新增： 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；	新增： 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。
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	新增： 报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情形，为保障其他投资者权益，基金管理人至少应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告文件中“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有风险。 本基金持续运作过程中，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。	新增： 33.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； 34、基金管理人在履行适当程序后采用摆动定价机制等改变估值技术进行估值；

附件九：《申万菱信中证申万医药生物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法（以下简称“《证券法》”）、《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。	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法（以下简称“《证券法》”）、《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。
	无	五、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（包括申万医药价格、申万医药A份额和申万医药B份额）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。
第二部分 前言	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 77.摆动定价机制：指当申万医药份额遭遇大额申购赎回时，通过调整基金申购赎回价格的方式，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
第三部分 基金当事人及权利义务	二、基金托管人 （一）基金托管人简况 法定代表人：刘杰	二、基金托管人 （一）基金托管人简况 法定代表人：周慕冰
第十六部分 基金的投资	二、投资范围 …… 基金的投资组合比例为：……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 …… 基金的投资组合比例为：……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。 新增： （15）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发行的可流通股票的30%； （16）本基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、基金规模变动等客观原因导致投资比例不符合上述规定投资比例的…… （17）本基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）、（10）、（17）、（18）项外，因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动等客观原因导致投资比例不符合上述规定投资比例的……
第十八部分 基金资产估值 三、估值方法	新增： 9.基金管理人在履行适当程序后，当申万佛钙物有限公司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。	新增： 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。
第十八部分 基金资产估值 六、暂停估值的情形	新增： 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；	新增： 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。
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	新增： 33.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； 34、基金管理人在履行适当程序后采用摆动定价机制等改变估值技术进行估值；	新增： 26.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； 27、基金管理人在履行适当程序后采用摆动定价机制等改变估值技术进行估值；

附件十：《申万菱信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	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，规范申万菱信盛利精选证券投资基金运作，依照《证券投资基金管理暂行办法》（以下简称《暂行办法》）、《开放式证券投资基金试点办法》（以下简称《试点办法》）、《开放式证券投资基金流动性风险管理规定》和其他有关规定，在平等自愿、诚实信用、充分保护基金投资者合法权益的原则基础上，特订立《申万菱信盛利精选证券投资基金基金合同》（以下简称“本合同”或“《基金合同》”）。 …… 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。	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，规范申万菱信盛利精选证券投资基金运作，依照《证券投资基金管理暂行办法》（以下简称《暂行办法》）、《开放式证券投资基金试点办法》（以下简称《试点办法》）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》和其他有关规定，在平等自愿、诚实信用、充分保护基金投资者合法权益的原则基础上，特订立《申万菱信盛利精选证券投资基金基金合同》（以下简称“本合同”或“《基金合同》”）。 …… 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。
第二部分 《基金合同》当事人及权利义务	一、基金发起人 （一）基金发起人简况 注册地址：上海市淮海中路300号香港新世界大厦40楼 邮政编码：200021 法定代表人：姜国芳 实收资本：1亿元人民币 存续期间：持续经营	一、基金发起人 （一）基金发起人简况 注册地址：上海市中山南路100号11层 邮政编码：200010 法定代表人：刘凯 注册资本：15亿元人民币 存续期间：持续经营
	二、基金管理人 （一）基金管理人简况 注册地址：上海市淮海中路300号香港新世界大厦40楼 邮政编码：200021 法定代表人：姜国芳 实收资本：1亿元人民币 存续期间：30年	二、基金管理人 （一）基金管理人简况 注册地址：上海市中山南路100号11层 邮政编码：200010 法定代表人：刘凯 注册资本：15亿元人民币 存续期间：持续经营
	三、基金托管人 （一）基金托管人简况 法定代表人：姜建清 实收资本：1710.24亿元人民币	三、基金托管人 （一）基金托管人简况 法定代表人：易会满 注册资本：人民币35,640,625万元
第十六部分 基金资产估值	三、估值方法 无	三、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。
	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；
第二十二部分 基金的信息披露	五、公开披露的基金信息 （七）基金定期报告 3.…… 无 （八）临时报告 无	五、公开披露的基金信息 （七）基金定期报告 3.…… 报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情形，为保障其他投资者权益，基金管理人至少应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告文件中“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有风险。 本基金持续运作过程中，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。 （八）临时报告 29.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； 30、基金管理人在履行适当程序后采用摆动定价机制等改变估值技术进行估值；

附件十一：《申万菱信盛利精选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，规范申万菱信盛利精选证券投资基金运作，依照《证券投资基金管理暂行办法》（以下简称《暂行办法》）、《开放式证券投资基金试点办法》（以下简称《试点办法》）、《开放式证券投资基金流动性风险管理规定》和其他有关规定，在平等自愿、诚实信用、充分保护基金投资者合法权益的原则基础上，特订立《申万菱信盛利精选证券投资基金基金合同》（以下简称“本合同”或“《基金合同》”）。 …… 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。 释 义 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	前 言 《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，在平等自愿、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《申万菱信添益宝债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“本合同”或“《基金合同》”）。 …… 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。 释 义 《流动性管理规定》：指《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
第二部分 《基金合同》当事人及权利义务	一、基金发起人 （一）基金发起人简况 注册地址：上海市淮海中路300号香港新世界大厦40楼 邮政编码：200021 法定代表人：姜国芳 实收资本：1亿元人民币 存续期间：30年	一、基金发起人 （一）基金发起人简况 注册地址：上海市中山南路100号11层 邮政编码：200010 法定代表人：刘凯 注册资本：15亿元人民币 存续期间：持续经营
	二、基金管理人 （一）基金管理人简况 注册地址：上海市淮海中路300号香港新世界大厦40楼 邮政编码：200021 法定代表人：姜国芳 实收资本：1亿元人民币 存续期间：30年	二、基金管理人 （一）基金管理人简况 注册地址：上海市中山南路100号11层 邮政编码：200010 法定代表人：刘凯 注册资本：15亿元人民币 存续期间：持续经营
	三、基金托管人 （一）基金托管人简况 法定代表人：姜建清 实收资本：1710.24亿元人民币	三、基金托管人 （一）基金托管人简况 法定代表人：易会满 注册资本：人民币35,640,625万元
第十六部分 基金的投资	二、投资范围和投资对象 根据法律法规的规定，本基金的投资范围为在中华人民共和国境内依法发行上市交易的股票和债券、银行间债券以及国务院证券监督管理机构规定的其他品种。在资产配置层面，本基金原则上可能的资产配置比例为：股票50－75%，债券20－40%，现金5－10%。	二、投资范围和投资对象 根据法律法规的规定，本基金的投资范围为在中华人民共和国境内依法发行上市交易的股票和债券、银行间债券以及国务院证券监督管理机构规定的其他品种。在资产配置层面，本基金原则上可能的资产配置比例为：股票50－75%，债券20－40%，现金5－10%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。
	三、申购与赎回的原则 无	三、申购与赎回的原则 4.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、目律组织的规定；
	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。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。
	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 5.申万医药份额的赎回费用由赎回申万医药份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回申万医药份额时收取，其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，赎回费用纳入基金财产的比例请见招募说明书，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。	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 5.申万医药份额的赎回费用由赎回申万医药份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回申万医药份额时收取，其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，赎回费用纳入基金财产的比例请见招募说明书，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。
	七、拒绝或暂停申购的情形 无 发生上述第1,2,4,5项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告……	七、拒绝或暂停申购的情形 5.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，基金管理人应当采取拒绝部分申购申请的方式，以确保基金份额的公平性。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、目律组织的规定；
	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 无	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：……	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，因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比例不低于上一开放日基金总份额的10%的前提下，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。
第十八部分 基金资产估值	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 法定代表人：姜国芳	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 法定代表人：刘凯
	二、基金托管人 （一）基金托管人简况 法定代表人：刘士余	二、基金托管人 （一）基金托管人简况 法定代表人：周慕冰
第十九部分 基金的投资	二、投资范围 …… 基金的投资组合比例为：……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。 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%－96%，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。 （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。 （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、基金规模变动等客观原因导致投资比例不符合上述规定投资比例的…… （17）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）、（16）、（17）项外，因证券、期货市场波动、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……	四、投资限制 1.组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： …… （16）本基金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，应当保证现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%； …… 因证券、期货市场波动、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，以达到规定比例的…… （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）、（13）、（17）、（18）项外，因证券、期货市场波动、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，以达到规定比例的…… 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。
第二十部分 基金的信息披露	五、公开披露的基金信息 （七）基金定期报告 3.…… 无 （八）临时报告 无	五、公开披露的基金信息 （七）基金定期报告 3.…… 报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情形，为保障其他投资者权益，基金管理人至少应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告文件中“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有风险。 本基金持续运作过程中，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。 （八）临时报告 29.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； 30、基金管理人在履行适当程序后采用摆动定价机制等改变估值技术进行估值；

附件十一：《申万菱信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法（以下简称“《证券法》”）、《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。	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法（以下简称“《证券法》”）、《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。
	无	五、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（包括申万医药价格、申万医药A份额和申万医药B份额）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。
第二部分 前言	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 77.摆动定价机制：指当申万医药份额遭遇大额申购赎回时，通过调整基金申购赎回价格的方式，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
第三部分 基金当事人及权利义务	二、基金托管人 （一）基金托管人简况 法定代表人：刘士余	二、基金托管人 （一）基金托管人简况 法定代表人：易会满
第十六部分 基金的投资	二、投资范围 …… 基金的投资组合比例为：……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。 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%－96%，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。 （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。 （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、基金规模变动等客观原因导致投资比例不符合上述规定投资比例的…… （17）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）、（16）、（17）项外，因证券、期货市场波动、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……	二、投资范围 …… 基金的投资组合比例为：……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。 四、投资限制 1.组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： …… （16）本基金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，应当保证现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%； …… 因证券、期货市场波动、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，以达到规定比例的…… （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）、（13）、（17）、（18）项外，因证券、期货市场波动、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，以达到规定比例的…… 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。
第十八部分 基金资产估值	三、估值方法 无	三、估值方法 8.基金管理人在履行适当程序后，当市万医药份额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。
	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 3.…… 无 （八）临时报告 无	五、公开披露的基金信息 （七）基金定期报告 3.…… 报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情形，为保障其他投资者权益，基金管理人至少应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告文件中“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有风险。 本基金持续运作过程中，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。 （八）临时报告 29.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； 30、基金管理人在履行适当程序后采用摆动定价机制等改变估值技术进行估值；

附件十二：《申万菱信沪深300指数增强型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	二、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。	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。
第二部分 《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：上海市中山南路100号11层（200021） 法定代表人：姜国芳 注册资本：壹亿元人民币 存续期限：三十年	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（200010） 法定代表人：刘凯 注册资本：壹亿伍仟万元人民币 存续期限：持续经营
	二、基金托管人 （一）基金托管人简况 名称：中国工商银行 法定代表人：姜建清 注册资本：人民币35,640,625万元	二、基金托管人 （一）基金托管人简况 名称：中国工商银行股份有限公司 法定代表人：易会满 注册资本：人民币35,640,625万元
第十一部分 基金的投资	二、投资范围 ……其中现金和到期日在一年以内的政府债券为基金净资产的5%以上，现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。因基金规模或市场变化等因素导