# 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
申万菱信多策略灵活配置混合型证券投资基金	001148/001724	华夏银行
(A 类/C 类)	001148/001724	
申万菱信安鑫回报灵活配置混合型证券投资基金	001201/001727	华夏银行
(A 类/C 类)	001201/001727	
申万菱信新能源汽车主题灵活配置混合型证券投资	001156	中国农业银行
基金	001130	
申万菱信安鑫优选混合型证券投资基金(A类/C类)	003493/003512	华夏银行
	003473/003312	
申万菱信安鑫精选混合型证券投资基金(A类/C类)	003601/003602	华夏银行
	003001/003002	
申万菱信量化成长混合型证券投资基金	004135	中国工商银行
申万菱信价值优享混合型证券投资基金	004768	华夏银行
申万菱信价值优利混合型证券投资基金	004951	中国民生银行
申万菱信收益宝货币市场基金(A 类/B 类)	310338/310339	中国工商银行
申万菱信行业轮动股票型证券投资基金	005009	中国农业银行

### 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。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各基金的《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:《申万菱信多策略灵活配置混合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
中中	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	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》、《中	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》、《中华人
	华人民共和国证券投资基金法》(以下简称"《基金法》")、	民共和国证券投资基金法》(以下简称"《基金法》")、《公开
	《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称"《运作	募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称"《运作办法》")、
	办法》")、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称	《证券投资基金销售管理办法》(以下简称"《销售办法》")、
	"《销售办法》")、《证券投资基金信息披露管理办法》	《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称"《信息披露办法》
	(以下简称"《信息披露办法》")和其他有关法律法规。	") 、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下
		<b>简称"《流动性管理规定》")</b> 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 释义	无	13、《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
		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
		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
第六部分 基金	三、申购与赎回的原则	三、申购与赎回的原则
份额的申购与	无	5、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
赎回		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、申购和赎回的数量限制	五、申购和赎回的数量限制
	无	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
		<u>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</u>
		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
		<u>管理人相关公告。</u>
	六、申购和赎回的价格、费用及其用途	六、申购和赎回的价格、费用及其用途
	3、赎回金额的计算及处理方式:本基金赎回金额的计算详见	3、赎回金额的计算及处理方式:本基金赎回金额的计算详见《招募
	《招募说明书》。本基金的赎回费率由基金管理人决定,并在	说明书》。本基金的赎回费率由基金管理人决定,并在招募说明书
	招募说明书中列示	中列示 <u>,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</u>
		赎回费并全额计入基金财产
	七、拒绝或暂停申购的情形	七、拒绝或暂停申购的情形
	无	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
		<u>情形时。</u>
		6、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。

	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
	<b>  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,</b>
	<u>经与基金托管人协商确认后,基金管理人应当暂停接受申购申请。</u>
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	发生上述第 1、2、4、 <u>7、8</u> 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介上刊登	暂停申购时,基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停
暂停申购公告	申购公告 <b><u>当发生上述第5、6项情形时,基金管理人可以采取比</u></b>
	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
	<u>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</u>
	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
	<u>募说明书或相关公告中明确。</u>
八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形
无	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
	<u>暂停接受基金赎回申请。</u>
九、巨额赎回的情形及处理方式	九、巨额赎回的情形及处理方式
2、巨额赎回的处理方式	2、巨额赎回的处理方式
(2) 部分延期赎回:	(2)部分延期赎回: ······ <u>若基金发生巨额赎回,在出现单个基金份</u>
	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。
第七部分 基	一、基金管理人	一、基金管理人
金合同当事人	(一) 基金管理人简况	(一) 基金管理人简况
及权利义务	法定代表人 <b>: 姜国芳</b>	法定代表人:刘郎
	二、基金托管人	二、基金托管人
	(一) 基金托管人简况	(一) 基金托管人简况
	   法定代表人: <b>吴建</b>	法定代表人 <b>: 李民吉</b>
	注册资本: <b>8,904,643,509</b> 元人民币	注册资本: <u>10,685,572,211</u> 元人民币
第十二部分 基	二、投资范围	二、投资范围
金的投资		
	本基金为混合型基金,基金投资组合中股票资产占基金资产的	本基金为混合型基金,基金投资组合中股票资产占基金资产的
	0%~95%;投资于债券、债券回购、货币市场工具、银行存款	0%~95%;投资于债券、债券回购、货币市场工具、银行存款以及
	以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具不低	法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具不低于基金资
	于基金资产的 5%;每个交易日日终 <b>在扣除股指期货保证金以后</b> ,	产的 5%;每个交易日日终,本基金保留的现金或到期日在一年以
	本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金	内的政府债券不低于基金资产净值的 5% <u>,其中现金不包括结算备</u>
	资产净值的 5%。股指期货的投资比例依照法律法规或监管机构	付金、存出保证金及应收申购款等。股指期货的投资比例依照法律
	的规定执行。	法规或监管机构的规定执行。
	四、投资限制	四、投资限制
	1、组合限制	1、组合限制
	(2)每个交易日日终 <b>在扣除股指期货合约需缴纳的保证金以后</b> ,	(2)每个交易日日终,本基金保留的现金或到期日在一年以内的政

	本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金	府债券不低于基金资产净值的 5% <u>,其中现金不包括结算备付金、</u>
	资产净值的 5%;	<u>存出保证金及应收申购款等</u> ;
	(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券,	(4) 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
	不超过该证券的 10%;	过该证券的 10%; <b>本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上</b>
		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%;
		(17) 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;
		(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;
	因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金	<b>除上述第(2)、(12)、(17)、(18)项外,</b> 因证券、期货市场
	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	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
	的	基金投资比例不符合上述规定投资比例的
第十四部分 基	三、估值方法	三、估值方法
金资产估值	无	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	六、暂停估值的情形
	无	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;

第十八部分 基	五、公开披露的基金信息	五、公开披露的基金信息
金的信息披露	(六)基金定期报告	(六)基金定期报告
	无	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。
	(七) 临时报告	(七) 临时报告
	无	27、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;
		28、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;

附件二:《申万菱信安鑫回报灵活配置混合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
早 早 中	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	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》、《中	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》、《中华人
	华人民共和国证券投资基金法》(以下简称"《基金法》")、	民共和国证券投资基金法》(以下简称"《基金法》")、《公开
	《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称"《运作	募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称"《运作办法》")、
	办法》")、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称	《证券投资基金销售管理办法》(以下简称"《销售办法》")、
	"《销售办法》")、《证券投资基金信息披露管理办法》	《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称"《信息披露办法》
	(以下简称"《信息披露办法》")和其他有关法律法规。	") 、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下
		<b>简称"《流动性管理规定》")</b> 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 释义	无	13、《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
		<u>管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订</u>
		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
		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
第六部分 基金	三、申购与赎回的原则	三、申购与赎回的原则
份额的申购与	无	5、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
赎回		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、申购和赎回的数量限制	五、申购和赎回的数量限制
	无	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
		<u>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</u>
		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
		<u>管理人相关公告。</u>
	六、申购和赎回的价格、费用及其用途	六、申购和赎回的价格、费用及其用途
	3、赎回金额的计算及处理方式:本基金赎回金额的计算详见	3、赎回金额的计算及处理方式:本基金赎回金额的计算详见《招募
	《招募说明书》。本基金的赎回费率由基金管理人决定,并在	说明书》。本基金的赎回费率由基金管理人决定,并在招募说明书
	招募说明书中列示	中列示 <u>,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</u>
		<u>赎回费并全额计入基金财产</u>
	七、拒绝或暂停申购的情形	七、拒绝或暂停申购的情形
	无	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。_
		6、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。
		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,

	Part 1 - Add 10 - Add 20 - Add
	<u>经与基金托管人协商确认后,基金管理人应当暂停接受申购申请。</u>
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	发生上述第1、2、4、7、8 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介上刊登	暂停申购时,基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停
暂停申购公告	申购公告 <b><u>当发生上述第 5、6 项情形时,基金管理人可以采取比</u></b>
	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。
八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形
无	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
	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
	<u>暂停接受基金赎回申请。</u>
九、巨额赎回的情形及处理方式	九、巨额赎回的情形及处理方式
2、巨额赎回的处理方式	2、巨额赎回的处理方式
(2) 部分延期赎回:	(2) 部分延期赎回: ······ <u>若基金发生巨额赎回,在出现单个基金份</u>
	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
1	

# 第十二部分 基金的投资

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。

## 二、投资范围

.....

本基金为混合型基金,基金投资组合中股票资产占基金资产的 0%~95%;投资于债券、债券回购、货币市场工具、银行存款 以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具不低 于基金资产的 5%;每个交易日日终**在扣除股指期货保证金以后**,本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金 资产净值的 5%。股指期货的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

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保证金以后**,本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%;
- (4) 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%:

二、投资范围

.....

本基金为混合型基金,基金投资组合中股票资产占基金资产的 0%~95%;投资于债券、债券回购、货币市场工具、银行存款以及 法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具不低于基金资产的 5%;每个交易日日终,本基金保留的现金或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。股指期货的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

四、投资限制

- 1、组合限制
- (2)每个交易日日终,本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%<u>其中现金不包括结算备付金、</u> **存出保证金及应收申购款等**:
- (4) 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%;
- <u>(17) 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</u>

		模变动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;
		(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;
		<u> </u>
	   因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金	<b>除上述第(2)、(12)、(17)、(18)项外,</b> 因证券、期货市场
	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	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
	的	基金投资比例不符合上述规定投资比例的
Ada I milata di alla	1 112	
第十四部分 基	三、估值方法	三、估值方法
金资产估值	无	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	六、暂停估值的情形
	无	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;
第十八部分 基	五、公开披露的基金信息	五、公开披露的基金信息
金的信息披露	(六)基金定期报告	(六)基金定期报告
		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。
(七) 临时报告	(七) 临时报告
无	27、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;
	28、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;

附件三:《申万菱信新能源汽车主题灵活配置混合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
早卫	内容	内容
第一部分 前言	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》、《中华	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》、《中华
一、订立本基	人民共和国证券投资基金法》(以下简称"《基金法》")、	人民共和国证券投资基金法》(以下简称"《基金法》")、
金合同的目的、	《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称"《运作办	《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称"《运作办
依据和原则	法》")、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称"《销售	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	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。	"《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。
第一部分 前言		新增:
一、订立本基		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
金合同的目的、		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
依据和原则		动达到或超过 50%的情形除外。
第二部分 释义		新增:
		13、《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
		54、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

		生 光 / c
		债券等
		55、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
第六部分 基		新增:
金份额的申购		5、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
与赎回		   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
三、申购与赎		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
一、「// /// 一回的原则		法律法规及监管部门、自律组织的规定。
第六部分基		新增:
金份额的申购		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
与赎回		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
五、申购和赎		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,
回的数量限制		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。
第六部分 基	3、赎回金额的计算及处理方式:本基金赎回金额的计算详见《招	3、赎回金额的计算及处理方式:本基金赎回金额的计算详见《招
金份额的申购	募说明书》。本基金的赎回费率由基金管理人决定,并在招募说	募说明书》。本基金的赎回费率由基金管理人决定,并在招募说
与赎回	明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基	明书中列示,其中对于持续持有期少于7日的投资者收取不少于
六、申购和赎	金份额净值并扣除相应的费用,赎回金额单位为元。上述计算结	1.5%的赎回费并全额计入基金财产。赎回金额为按实际确认的有
回的价格、费	果均按四舍五入方法,保留到小数点后2位,由此产生的收益或	效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用,赎回金额
用及其用途	损失由基金财产承担。	单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法,保留到小数点后
		2位,由此产生的收益或损失由基金财产承担。
第六部分 基		新增:

金份额的申购		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
与赎回		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
七、拒绝或暂		度的情形时。
停申购的情形		6、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。
		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,基金管理人应当暂停接受申购申请。
第六部分 基	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	发生上述第1、2、4、7、8项暂停申购情形之一且基金管理人决
金份额的申购	停申购时,基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停	定暂停申购时,基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登
与赎回	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	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
七、拒绝或暂	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	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
停申购的情形	的利息的损失。在暂停申购的情况消除时,基金管理人应及时恢	产生的利息的损失。在暂停申购的情况消除时,基金管理人应及
	复申购业务的办理。	时恢复申购业务的办理。当发生上述第5、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。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。
第六部分 基		新增:
金份额的申购		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
与赎回		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,
八、暂停赎回		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
或延缓支付赎		或暂停接受基金赎回申请。
回款项的情形		

# 第六部分 基金份额的申购 与赎回

九、巨额赎回 的情形及处理 方式

2、巨额赎回的 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 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,确定当日受理该单个账户的赎回份额;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。部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

(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,确定当日受理该单个账户的赎回份额; 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。部 分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的限制。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。
第七部分 基		法定代表人: 刘郎
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		
第七部分 基	法定代表人: 蒋超良	法定代表人: 周慕冰
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		
第十二部分	本基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例为0%~	本基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例为0%~
基金的投资	95%; 其中投资于新能源汽车主题相关的股票和债券不低于非现	95%; 其中投资于新能源汽车主题相关的股票和债券不低于非现
二、投资范围	金资产的80%; 权证投资占基金资产净值的比例不高于3%; 本基	金资产的80%; 权证投资占基金资产净值的比例不高于3%; 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,	金每个交易日日终,应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到
	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	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
	府债券,股指期货的投资比例遵循国家相关法律法规。	保证金及应收申购款等。股指期货的投资比例遵循国家相关法律
Auto II Non AV		法规。
第十二部分	1、组合限制	1、组合限制
基金的投资	基金的投资组合应遵循以下限制:	基金的投资组合应遵循以下限制:

四、投资限制	•••••	
	(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,	(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
	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	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、
	府债券;	存出保证金及应收申购款等;
	(4) 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	(4) 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%;	超过该证券的10%;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%;
		新增:
		(17) 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;
		(元元为版明日), 至亚百至八十万工列》(石加为江文KX) 田汉英,
		   (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;
	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	12211177 LITY CHILD AND SA
	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,	除上述第(2)、(12)、(17)、(18)项外,因证券、期货市
	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	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
	特殊情形除外。法律法规另有规定的从其规定。	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
	19 //N IF // I/	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。
ΔΔ: 1.π1 ÷π Λ		法律法规另有规定的从其规定。
第十四部分		新增:

基金资产估值	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
三、估值方法	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。
第十四部分	新增:
基金资产估值	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
六、暂停估值	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,
的情形	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	新增:
基金的信息披	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
露	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、
五、公开披露	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
的基金信息	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
(六)基金定	比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特有风险。
期报告	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。
第十八部分	新增:
基金的信息披	27、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
露	重大事项时;
五、公开披露	28、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
的基金信息	技术进行估值;
(五) 临时报	
告	

# 附件四:《申万菱信安鑫优选混合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
<b>丁早</b>	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	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》、《中华	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》、《中华
	人民共和国证券投资基金法》(以下简称"《基金法》")、	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	《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	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	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。	"《信息披露办法》") <u>、《公开募集开放式证券投资基金流动</u>
		<b>性风险管理规定》(以下简称"《流动性管理规定》")</b> 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 释义	无	13、《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
		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
		<u>债券等</u>
		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
第六部分 基金	三、申购与赎回的原则	三、申购与赎回的原则
份额的申购与	无	5、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
赎回		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
		<u>法律法规及监管部门、自律组织的规定。</u>
	五、申购和赎回的数量限制	五、申购和赎回的数量限制
	无	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。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	六、申购和赎回的价格、费用及其用途
	3、赎回金额的计算及处理方式:本基金赎回金额的计算详见《招	3、赎回金额的计算及处理方式:本基金赎回金额的计算详见《招
	募说明书》。本基金的赎回费率由基金管理人决定,并在招募说	募说明书》。本基金的赎回费率由基金管理人决定,并在招募说
	明书中列示	明书中列示 <u>,其中对于持续持有期少于7日的投资者收取不少于</u>
		1.5%的赎回费并全额计入基金财产
	七、拒绝或暂停申购的情形	七、拒绝或暂停申购的情形
	无	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。
		6、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、

	<u>单一投资者单日或单笔申购金额上限的。</u>
	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,基金管理人应当暂停接受申购申请。
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介上刊登暂停	发生上述第1、2、4、7、8项暂停申购情形之一且基金管理人决
申购公告	定暂停申购时,基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登
TOMAL	暂停申购公告当发生上述第5、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。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
	<u>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</u>
	<u>人大会,并在招募说明书或相关公告中明确。</u>
八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形
无	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
	<u> 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,</u>
	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。
九、巨额赎回的情形及处理方式	九、巨额赎回的情形及处理方式
2、巨额赎回的处理方式	2、巨额赎回的处理方式
(2) 部分延期赎回:	(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

		<u>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</u>
		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。
第七部分 基	一、基金管理人	一、基金管理人
金合同当事人	(一) 基金管理人简况	(一) 基金管理人简况
及权利义务	法定代表人: <b>姜国芳</b>	法定代表人: <u>刘郎</u>
	二、基金托管人	二、基金托管人
	(一) 基金托管人简况	(一) 基金托管人简况
	法定代表人: <b>吴建</b>	法定代表人: <u>李民吉</u>
	注册资本: <b>8,904,643,509</b> 元人民币	注册资本: <u>10,685,572,211</u> 元人民币
第十二部分 基	二、投资范围	二、投资范围
金的投资		
	本基金为混合型基金,基金投资组合中股票资产占基金资产的	本基金为混合型基金,基金投资组合中股票资产占基金资产的
	0%~50%; 权证投资占基金资产净值的 0%~3%; 每个交易日日	0%~50%;权证投资占基金资产净值的0%~3%;每个交易日日
	终 <b>在扣除股指期货保证金以后</b> ,本基金保留的现金或到期日在一	终,本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基
	年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。股指期货的投资比	金资产净值的 5% <u>,其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应</u>
	例依照法律法规或监管机构的规定执行。	<b>收申购款等</b> 。股指期货的投资比例依照法律法规或监管机构的规
		定执行。
	四、投资限制	四、投资限制
	1、组合限制	1、组合限制

	(2)每个交易日日终 <b>在扣除股指期货合约需缴纳的保证金以后</b> ,	(2)每个交易日日终,本基金保留的现金或到期日在一年以内的
	本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资	政府债券不低于基金资产净值的 5% <u>,其中现金不包括结算备付金、</u>
	产净值的 5%;	<u>存出保证金及应收申购款等</u> ;
	(4) 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	(4) 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%;	超过该证券的 10%; <b>本基金管理人管理的全部开放式基金持有一</b>
		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%;
		(17) 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;
		(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
		<u>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</u>
		与基金合同约定的投资范围保持一致;
	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,	<b>除上述第(2)、(12)、(17)、(18)项外,</b> 因证券、期货市
	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。	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。
第十四部分 基	三、估值方法	三、估值方法
金资产估值		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
	无	   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
		<u>公平性。</u>
	I	1 ———

	六、暂停估值的情形	六、暂停估值的情形
	无	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;
第十八部分 基	五、公开披露的基金信息	五、公开披露的基金信息
金的信息披露	(六)基金定期报告	(六)基金定期报告
	无	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。
	(七) 临时报告	(七) 临时报告
	无	27、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;
		28、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;

附件五:《申万菱信安鑫精选混合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
平月	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	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》、《中华	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》、《中华
	人民共和国证券投资基金法》(以下简称"《基金法》")、	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	《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	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	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。	"《信息披露办法》") <u>、《公开募集开放式证券投资基金流动</u>
		<b>性风险管理规定》(以下简称"《流动性管理规定》")</b> 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 释义	无	13、《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
		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
		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
		<u>对待</u>
第六部分 基金	三、申购与赎回的原则	三、申购与赎回的原则
份额的申购与	无	5、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
赎回		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
		<u>法律法规及监管部门、自律组织的规定。</u>
	五、申购和赎回的数量限制	五、申购和赎回的数量限制
	无	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
		<u>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</u>
		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	六、申购和赎回的价格、费用及其用途
	3、赎回金额的计算及处理方式:本基金赎回金额的计算详见《招	3、赎回金额的计算及处理方式:本基金赎回金额的计算详见《招
	募说明书》。本基金的赎回费率由基金管理人决定,并在招募说	募说明书》。本基金的赎回费率由基金管理人决定,并在招募说
	明书中列示•••••	明书中列示 <u>,其中对于持续持有期少于7日的投资者收取不少于</u>
		1.5%的赎回费并全额计入基金财产
	七、拒绝或暂停申购的情形	七、拒绝或暂停申购的情形
	无	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。
		6、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、

	<u>单一投资者单日或单笔申购金额上限的。</u>
	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,基金管理人应当暂停接受申购申请。
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介上刊登暂停	   发生上述第 1、2、4、 <b>7、8</b> 项暂停申购情形之一且基金管理人决
申购公告	定暂停申购时,基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登
	暂停申购公告当发生上述第5、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。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
	<u>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</u>
	<u>人大会,并在招募说明书或相关公告中明确。</u>
八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形
无	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
	<u> 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,</u>
	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。
九、巨额赎回的情形及处理方式	九、巨额赎回的情形及处理方式
2、巨额赎回的处理方式	2、巨额赎回的处理方式
(2) 部分延期赎回:	(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
	<u> </u>

		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。
第七部分 基	一、基金管理人	一、基金管理人
金合同当事人	(一) 基金管理人简况	(一) 基金管理人简况
及权利义务	法定代表人: <b>姜国芳</b>	法定代表人: <u>刘郎</u>
	二、基金托管人	二、基金托管人
	(一) 基金托管人简况	(一) 基金托管人简况
	法定代表人: <b>吴建</b>	法定代表人: <u>李民吉</u>
	注册资本: <b>8,904,643,509</b> 元人民币	注册资本: <u>10,685,572,211</u> 元人民币
第十二部分 基	二、投资范围	二、投资范围
金的投资		
	本基金为混合型基金,基金投资组合中股票资产占基金资产的	本基金为混合型基金,基金投资组合中股票资产占基金资产的
	0%~50%;权证投资占基金资产净值的0%~3%;每个交易日日	0%~50%;权证投资占基金资产净值的0%~3%;每个交易日日
	终 <b>在扣除股指期货保证金以后</b> ,本基金保留的现金或到期日在一	终,本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基
	年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。股指期货的投资比	金资产净值的 5% <u>,其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应</u>
	例依照法律法规或监管机构的规定执行。	<b>收申购款等</b> 。股指期货的投资比例依照法律法规或监管机构的规
		定执行。
	四、投资限制	四、投资限制
	1、组合限制	1、组合限制

	(2)每个交易日日终 <b>在扣除股指期货合约需缴纳的保证金以后</b> ,	(2)每个交易日日终,本基金保留的现金或到期日在一年以内的
	本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资	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、
	产净值的 5%;	存出保证金及应收申购款等;
	(4) 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	(4) 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%;	超过该证券的 10%;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%;
		(17) 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本基金不符合本款所规
		(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
		与基金合同约定的投资范围保持一致;
	   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	<b>除上述第(2)、(12)、(17)、(18)项外,</b> 因证券、期货市
	的·····	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
第十四部分 基	   三、估值方法	三、估值方法
金资产估值	无	
		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	7
	<sup>78</sup>	

		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	五、公开披露的基金信息	五、公开披露的基金信息
金的信息披露	(六)基金定期报告	(六)基金定期报告
	无	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。
	(七) 临时报告	(七) 临时报告
	无	27、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;
		28、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;

## 附件六:《申万菱信量化成长混合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
부 나	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	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	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	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》	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	(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"《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。	下简称"《信息披露办法》") <u>、《公开募集开放式证券投资基金流</u>
		<b>动性风险管理规定》(以下简称"《流动性管理规定》")</b> 和其他有关
		法律法规。
	无	六、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 释义	无	13、《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
		<u>险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订</u>
		52、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
		53、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
第六部分 基金	三、申购与赎回的原则	三、申购与赎回的原则
份额的申购与	无	5、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
赎回		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
		<u>法律法规及监管部门、自律组织的规定。</u>
	五、申购和赎回的数量限制	五、申购和赎回的数量限制
	无	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。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	六、申购和赎回的价格、费用及其用途
	3、赎回金额的计算及处理方式:本基金赎回金额的计算及处理方	3、赎回金额的计算及处理方式:本基金赎回金额的计算及处理方
	式详见《招募说明书》。本基金的赎回费率由基金管理人决定,	式详见《招募说明书》。本基金的赎回费率由基金管理人决定,
	并在招募说明书中列示。	并在招募说明书中列示 <u>,其中对于持续持有期少于7日的投资者</u>
		收取不少于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产。
	七、拒绝或暂停申购的情形	七、拒绝或暂停申购的情形
	无	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、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。
	9、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申购申请。
发生上述第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,基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊	发生上述第1、2、3、5、6、9、10 项暂停申购情形之一且基金管
登暂停申购公告。	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介
	上刊登暂停申购公告。 ······ <u>当发生上述第 7、8 项情形时,基金管</u>
	<u>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,</u>
	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7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。
八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形
无	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
	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。
九、巨额赎回的情形及处理方式	力、巨额赎回的情形及处理方式
2、巨额赎回的处理方式	2、巨额赎回的处理方式
(2) 部分延期赎回:部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的	(2) 部分延期赎回:部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的
限制。	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
	他然四甲項八二小微然四甲項八二八利血的原则,基金官理八四

# 第十二部分 基金的投资

二、投资范围

• • • • •

基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例为 10%~95%;其中,本基金每个交易日日终**在扣除股指期货合约和国债 期货合约需缴纳的交易保证金以及股票期权需缴纳的现金保证金 后**,应当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。

四、投资限制

- 1、组合限制
- (2) 本基金每个交易日日终**在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金以及股票期权需缴纳的现金保证金后**,应当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:
- (4) 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%;

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。

二、投资范围

....

基金的投资组合比例为: 股票投资占基金资产的比例为 10%~95%; 其中,本基金每个交易日日终,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。

四、投资限制

- 1、组合限制
- (2) 本基金每个交易日日终,应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券<u>,其中现金不包括结算</u> 备付金、存出保证金及应收申购款等;
- (4) 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%;
		(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;
		(20)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;
	   因证券、期货市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管	<u> </u>
	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,	   <b>除上述第(2)、(12)、(19)、(20)项外,</b> 因证券、期货市
	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	场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的因素
	特殊情形除外。法律法规另有规定的从其规定。	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。
第十四部分 基	三、估值方法	三、估值方法
金资产估值	无	10、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
		<u>的公平性。</u>
	六、暂停估值的情形	六、暂停估值的情形
	无	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
		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	五、公开披露的基金信息	五、公开披露的基金信息
金的信息披露	(六)基金定期报告	(六) 基金定期报告

无	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。
(七) 临时报告	(七) 临时报告
无	27、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;
	28、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;

附件七:《申万菱信价值优享混合型证券投资基金基金合同》修改对照表

<b>★</b> #	原文条款	修改后条款
章节	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	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	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	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》	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"《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	(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。	办法》(以下简称"《信息披露办法》") <u>、《公开募集开放式</u>
		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
		<b>定》")</b> 和其他有关法律法规。
第二部分 释义	无	13、《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
		52、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
		<u>债券等</u>
		53、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
第六部分 基金	   三、申购与赎回的原则	三、申购与赎回的原则
份额的申购与	无	5、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
赎回		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、申购和赎回的数量限制	五、申购和赎回的数量限制
	无	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
		<u>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</u>
		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	六、申购和赎回的价格、费用及其用途
	3、赎回金额的计算及处理方式:本基金赎回金额的计算及处理方	3、赎回金额的计算及处理方式:本基金赎回金额的计算及处理方
	式详见《招募说明书》。本基金的赎回费率由基金管理人决定,	式详见《招募说明书》。本基金的赎回费率由基金管理人决定,
	并在招募说明书中列示。	并在招募说明书中列示 <u>,<b>其中对于持续持有期少于7日的投资者</b></u>
		收取不少于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产。
	七、拒绝或暂停申购的情形	七、拒绝或暂停申购的情形
	无	8、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、
		<u>单一投资者单日或单笔申购金额上限的。</u>
		9、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申购申请。
	发生上述第1、2、3、5、6、8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介上刊	发生上述第1、2、3、5、6、9、10项暂停申购情形之一且基金管
登暂停申购公告	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介
	上刊登暂停申购公告 当发生上述第 7、8 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7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。
八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形
无	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,
	<u>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</u>
	或暂停接受基金赎回申请。
九、巨额赎回的情形及处理方式	九、巨额赎回的情形及处理方式
2、巨额赎回的处理方式	2、巨额赎回的处理方式
(2) 部分延期赎回:	(2)部分延期赎回: ······ <u>若基金发生巨额赎回,在出现单个基金</u>
	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"
	<u>)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</u>
	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。
第十二部分 基	二、投资范围	二、投资范围
金的投资		
	基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例不低于50%	基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例不低于50%
	; 其中,本基金每个交易日日终 <b>在扣除股指期货合约和国债期货</b>	; 其中, 本基金每个交易日日终, 应当保持不低于基金资产净值
	<b>合约需缴纳的交易保证金后</b> ,应当保持不低于基金资产净值 5%的	5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券 <u>,其中现金不包括结</u>
	现金或者到期日在一年以内的政府债券。	<u>算备付金、存出保证金及应收申购款等</u> 。
	四、投资限制	四、投资限制
	1、组合限制	1、组合限制
	(2) 本基金每个交易日日终 <b>在扣除股指期货合约和国债期货合约</b>	(2) 本基金每个交易日日终,应当保持不低于基金资产净值
	<b>需缴纳的交易保证金后</b> ,应当保持不低于基金资产净值 5%的现金	5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券 <u>,其中现金不包括结</u>
	或者到期日在一年以内的政府债券;	算备付金、存出保证金及应收申购款等;
	(4) 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	(4) 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%;	超过该证券的 10%; <b>本基金管理人管理的全部开放式基金持有一</b>
		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%;
		(18) 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;
		(19) 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
		<u>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</u>

	除上述第(12)项外,因证券、期货市场波动、上市公司合并或	与基金合同约定的投资范围保持一致;
	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	除上述第 <u>(2)、</u> (12) <u>、(18)、(19)</u> 项外,因证券、期货市
	上述规定投资比例的	场波动、上市公司合并或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
第十四部分 基	三、估值方法	三、估值方法
金资产估值	无	10、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
		<u>的公平性。</u>
	六、暂停估值的情形	六、暂停估值的情形
	无	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;
第十八部分 基	五、公开披露的基金信息	五、公开披露的基金信息
金的信息披露	(六)基金定期报告	(六)基金定期报告
	报告期内出现单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情形,基	报告期内出现单一投资者持有基金份额比例 <u>达到或</u> 超过 20%的情
	金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告文	形, <b>为保障其他投资者权益,</b> 基金管理人 <u>至少</u> 应当在季度报告、
	件中披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内	半年度报告、年度报告等定期报告文件中 <u>"影响投资者决策的其他</u>
	持有份额变化情况及 <b>产品</b> 的特有风险。	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 <u>本基金</u> 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。
	(七) 临时报告	(七) 临时报告
	无	27、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;
		28、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;
八、暂停或延迟披露基金信息的情形	八、暂停或延迟披露基金信息的情形
无	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决定暂停估值的;

## 附件八:《申万菱信价值优利混合型证券投资基金基金合同》修改对照表

辛士	原文条款	修改后条款
章节	内容	内容
第一部分 前言	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	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
一、订立本基	称"《合同法》")、《中华人民共和国证券投资基金法》(以	称"《合同法》")、《中华人民共和国证券投资基金法》(以
金合同的目的、	下简称"《基金法》")、《公开募集证券投资基金运作管理办	下简称"《基金法》")、《公开募集证券投资基金运作管理办
依据和原则	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"《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	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。	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。
第一部分 前言		新增:
一、订立本基		六、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
金合同的目的、		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
依据和原则		动达到或超过 50%的情形除外。
第二部分 释义		新增:
		13、《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

		52、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
		(大大大大大大大大大大大大大大大大大大大大大大大大大大大大大大大大大大大大
		53、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
第六部分 基		新增:
金份额的申购		5、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
与赎回		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
三、申购与赎		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
回的原则		法律法规及监管部门、自律组织的规定。
第六部分 基		新增:
金份额的申购		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
与赎回		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
五、申购和赎		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,
回的数量限制		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。
第六部分 基	3、赎回金额的计算及处理方式:本基金赎回金额的计算详见《招	3、赎回金额的计算及处理方式:本基金赎回金额的计算详见《招
金份额的申购	募说明书》。本基金的赎回费率由基金管理人决定,并在招募说	募说明书》。本基金的赎回费率由基金管理人决定,并在招募说

与赎回	明书中列示。	明书中列示,其中对于持续持有期少于7日的投资者收取不少于
六、申购和赎		1.5%的赎回费并全额计入基金财产。
回的价格、费		
用及其用途		
第六部分 基		新增:
金份额的申购		8、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、
与赎回		单一投资者单日或单笔申购金额上限的。
七、拒绝或暂		9、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
停申购的情形		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申购申请。
第六部分 基	发生上述第1、2、3、5、6、8项暂停申购情形之一且基金管理人	发生上述第1、2、3、5、6、9、10项暂停申购情形之一且基金管
金份额的申购	决定暂停申购时,基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊	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介
与赎回	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,被	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,
七、拒绝或暂	拒绝的申购款项本金将退还给投资人。基金管理人及基金托管人	被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。基金管理人及基金托管
停申购的情形	不承担该退回款项产生的利息的损失。在暂停申购的情况消除时,	人不承担该退回款项产生的利息的损失。在暂停申购的情况消除
	基金管理人应及时恢复申购业务的办理。	时,基金管理人应及时恢复申购业务的办理。当发生上述第7、
		8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7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。
第六部分 基		新增:
金份额的申购		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
与赎回		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,

八、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 与赎回

九、巨额赎回 的情形及处理 方式

2、巨额赎回的 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工作日基金总份额的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,确定当日受理该单个账户的赎回份额;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。部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

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。

(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 不低于上一工作日基金总份额的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,确定当日受理该单个账户的赎回份额; 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目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。部 分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的限制。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

		日土油人如本年 同社人如土本年始時日中津 / 人工经时日中津
		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。
第十二部分	基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例不低于	基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例不低于
基金的投资	50%; 其中, 本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债	50%; 其中,本基金每个交易日日终,应当保持不低于基金资产
二、投资范围	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	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
	5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。	括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。
第十二部分	1、组合限制	1、组合限制
基金的投资	基金的投资组合应遵循以下限制:	基金的投资组合应遵循以下限制:
四、投资限制		
	(2) 本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约	(2) 本基金每个交易日日终, 应当保持不低于基金资产净值
		5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结
	或者到期日在一年以内的政府债券;	算备付金、存出保证金及应收申购款等;
	   (4)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	   (4) 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%:	超过该证券的 10%: 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一
	超度该证券的 10%;	, ,
		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%;
		新增:
		(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;
		7

	除上述第(12)项外,因证券、期货市场波动、上市公司合并或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。	(20) 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;
第十四部分		新增:
基金资产估值		<sup>初                                   </sup>
三、估值方法		10、
二、怕阻力伝		回
AA: 1 1111-341 /\		
第十四部分		新增:
基金资产估值		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
六、暂停估值		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,
的情形		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		新增:
基金的信息披		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
露		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、
五、公开披露		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
的基金信息		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
(六)基金定		比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特有风险。
期报告		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。
		周生显然自然/ 16000/1000 AE/ NIE / 17 NIE /

第十八部分	新增:
基金的信息披	27、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
露	重大事项时;
五、公开披露	28、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
的基金信息	技术进行估值;
(五) 临时报	
告	
第十八部分	新增:
基金的信息披	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
露	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,
八、暂停或延	经与基金托管人协商确认后决定暂停估值的;
迟披露基金信	
息的情形	

## 附件九:《申万菱信收益宝货币市场基金基金合同》修改对照表

章节	原文条款	修改后条款
부 나	内容	内容
第一部分 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	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
和释义	义务,规范申万菱信收益宝货币市场基金(以下简称"本基金"	义务,规范申万菱信收益宝货币市场基金(以下简称"本基金"
前言	或"基金")运作,依照《中华人民共和国合同法》、《中华人	或"基金")运作,依照《中华人民共和国合同法》、《中华人
	民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、《公开募	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》)、	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》	《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称《信息披露办法》
	)、《货币市场基金监督管理办法》、《关于实施<货币市场基	)、《货币市场基金监督管理办法》、《关于实施<货币市场基

	金监督管理办法>有关问题的规定》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《申万菱信收益宝货币市场基金基金合同》	金监督管理办法>有关问题的规定》、《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》)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
	(以下简称"本合同"或"《基金合同》")。	关当事人的合法权益的原则基础上,特订立《申万菱信收益宝货币市场基金基金合同》(以下简称"本合同"或"《基金合同》")。
第一部分 前言 和释义 前 言		新增: 四、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
第一部分 前言		动达到或超过 50%的情形除外。
和释义释义		《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)、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	4、基金管理人可以依照相关法律法规以及基金合同的约定,在特	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
金份额的申购	定市场条件下暂停或者拒绝接受一定金额以上的资金申购,具体	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
与赎回	以基金管理人的公告为准。	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,
五、申购和赎 回的数额限制		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。
第五部分 基		六、

A FF. T. HEF. T. HAD		
金的申购与赎	1、本基金在一般情况下不收取申购费用和赎回费用,但当基金持	1、本基金在一般情况下不收取申购费用和赎回费用,但当出现以
回	有的现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易	下情形之一:
	日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计低于 5%且偏	(1) 基金持有的现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以
	离度为负时,为确保基金平稳运作,避免诱发系统性风险,对当	及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计
	日单个基金份额持有人申请赎回基金份额超过基金总份额的 1%以	低于 5%且偏离度为负时;
	上的赎回申请(超过基金总份额1%以上的部分)征收1%的强制	(2) 当本基金前 10 名基金份额持有人的持有份额合计超过基金
	赎回费用,并将上述赎回费用全额计入基金财产。基金管理人与	总份额 50%,且本基金投资组合中现金、国债、中央银行票据、
	基金托管人协商确认上述做法无益于基金利益最大化的情形除外。	政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资
		产净值的比例合计低于 10%且偏离度为负时;
		为确保基金平稳运作,避免诱发系统性风险,对当日单个基金份
		额持有人申请赎回基金份额超过基金总份额的 1%以上的赎回申请
		(超过基金总份额 1%以上的部分)征收 1%的强制赎回费用,并
		将上述赎回费用全额计入基金财产。基金管理人与基金托管人协
		商确认上述做法无益于基金利益最大化的情形除外。
第五部分 基		新增:
金的申购与赎		(8)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
回		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
八、拒绝		中度的情形时;
或暂停申购的		(9)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
情形及处理方		限、单一投资者单日或单笔申购金额上限的;
式		(10) 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申
		购申请;
第五部分 基	发生上述(1)到(7)项暂停申购情形时,基金管理人应当在至	发生上述(1)、(2)、(3)、(4)、(5)、(6)、(7)项
金的申购与赎	少一家指定媒介刊登暂停申购公告。	暂停申购情形时,基金管理人应当在至少一家指定媒介刊登暂停

回		la de la companya de
<b>—</b>		申购公告;当发生上述第(8)、(9)项情形时,基金管理人可
八、 拒绝		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
或暂停申购的		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
情形及处理方		要求调整导致上述第(8)项内容取消或变更的,基金管理人在履
式		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。
第五部分 基		新增:
金的申购与赎		(五)当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考
回		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
九、暫停		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
赎回或者延缓		回款项或暂停接受基金赎回申请;
支付赎回款项		
的情形及处理		
方式		
第五部分 基	2、巨额赎回的处理方式	2、巨额赎回的处理方式
金的申购与赎		
回	(2) 部分顺延赎回:	(2) 部分顺延赎回:当基金管理人认为支付投资者的赎回申
十、 巨额		请有困难或认为支付投资者的赎回申请可能会对基金的资产净值
赎回的情形及		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日
处理方式		基金总份额的10%的前提下,对其余赎回申请延期予以办理。对
(二) 巨额赎		于单个基金份额持有人的赎回申请,应当按照其申请赎回份额占
回的处理方式		当日申请赎回总份额的比例,确定该单个基金份额持有人当日办
		理的赎回份额;投资者未能赎回部分,除投资者在提交赎回申请
		时明确作出不参加顺延下一个开放日赎回的表示外,自动转为下
		一个开放日赎回处理。依照上述规定转入下一个开放日的赎回不
		享有赎回优先权,并以此类推,直到全部赎回为止。部分顺延赎
(二) 巨额赎		于单个基金份额持有人的赎回申请,应当按照其申请赎回份额占 当日申请赎回总份额的比例,确定该单个基金份额持有人当日办 理的赎回份额;投资者未能赎回部分,除投资者在提交赎回申请 时明确作出不参加顺延下一个开放日赎回的表示外,自动转为下

# 第十一部分 基金的投资

(二)投资组合限制

六、投资限制

- 2、本基金的投资组合应当符合下列规定:
- (1) 本基金投资组合的平均剩余期限不得超过120天,平均剩余 存续期不得超过 240 天;
- (2) 本基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的 证券,不得超过该证券的10%;
- (3) 同一机构发行的债券、非金融企业债务融资工具及其作为原 始权益人的资产支持证券占基金资产净值的比例合计不得超过 10%, 国债、中央银行票据、政策性金融债券除外;
- (4) 除发生巨额赎回、连续3个交易日累计赎回20%以上或者连

回不受单笔赎回最低份额的限制。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官在指定媒介上刊登公告。

### (二)投资组合限制

- 2、本基金的投资组合应当符合下列规定:
- (1) 现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券占基金资产净 值的比例合计不得低于5%。其中,现金不包括结算备付金、存出 保证金、应收申购款等:
- (2) 基金投资组合的平均剩余期限不得超过120天,平均剩余存 续期不得超过 240 天:
- (3) 现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及五个交易 日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 10%:
- (4) 到期日在 10 个交易日以上的逆回购、银行定期存款等流动

- 续 5 个交易日累计赎回 30%以上的情形外,本基金债券正回购的资金余额占基金资产净值的比例不得超过 20%;
- (5)本基金投资于具有基金托管资格的同一商业银行的银行存款、同业存单,合计不得超过基金资产净值的 20%;投资于不具有基金托管资格的同一商业银行的银行存款、同业存单,合计不得超过基金资产净值的 5%;
- (6) 本基金投资于固定期限银行存款的比例不得超过基金资产净值的 30%,但如果基金投资有存款期限,根据协议可提前支取的银行存款不受上述比例限制;
- (7) 现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券占基金资产净值的比例合计不得低于 5%;
- (8) 现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易 日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 10%:
- (9) 到期日在 10 个交易日以上的逆回购、银行定期存款等流动性受限资产投资占基金资产净值的比例合计不得超过 30%:
- (10) 本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%:
- (11) 持有的剩余期限不超过 397 天但剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债券的摊余成本总计不得超过当日基金资产净值的 20%:
- (12) 通过买断式回购融入的基础债券的剩余期限不得超过 397 天:
- (13)本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例, 不得超过该资产支持证券规模的 10%;
- (14) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例, 不得超过该基金资产净值的 10%:

性受限资产投资占基金资产净值的比例合计不得超过30%:

- (5) 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 10%。因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人 之外的因素致使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;
- (6) 当基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 50%时,本基金投资组合的平均剩余期限不得超过 60 天,平均剩余存续期不得超过 120 天;投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 30%。
- (7) 当基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 20%时,本基金投资组合的平均剩余期限不得超过 90 天,平均剩余存续期不得超过 180 天;投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 20%。
- (8) 本基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券,不得超过该证券的10%:
- (9) 同一机构发行的债券、非金融企业债务融资工具及其作为原始权益人的资产支持证券占基金资产净值的比例合计不得超过10%,国债、中央银行票据、政策性金融债券除外:
- (10) 除发生巨额赎回、连续 3 个交易日累计赎回 20%以上或者连续 5 个交易日累计赎回 30%以上的情形外,本基金债券正回购的资金余额占基金资产净值的比例不得超过 20%:
- (11) 本基金投资于固定期限银行存款的比例不得超过基金资产 净值的 30%,但如果基金投资有存款期限,根据协议可提前支取 的银行存款不受上述比例限制;

- (15) 本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的20%,中国证监会规定的特殊品种除外;
- (16)本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%;
- (17) 本基金投资的资产支持证券的信用评级,应不低于国内信用评级机构评定的 AAA 级或相当于 AAA 级的信用级别。基金持有资产支持证券期间,如果其信用等级下降、不再符合投资标准,应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出:
- (18) 法律法规及中国证监会规定的其他比例限制。
- 除第(1)、(7)、(17)项外,由于市场波动或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的,基金管理人应在10个交易日内进行调整,以达到标准,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。法律法规或监管部门取消上述限制,本基金不受上述限制。

- (12) 本基金投资于具有基金托管资格的同一商业银行的银行存款、同业存单,合计不得超过基金资产净值的 20%;投资于不具有基金托管资格的同一商业银行的银行存款、同业存单,合计不得超过基金资产净值的 5%;
- (13) 基金投资于主体信用评级低于 AAA 的机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 10%,其中单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 2%。前述金融工具包括债券、非金融企业债务融资工具、银行存款、同业存单、相关机构作为原始权益人的资产支持证券及中国证监会认定的其他品种;
- (14) 货币市场基金拟投资于主体信用评级低于 AA+的商业银行的银行存款与同业存单的,应当经基金管理人董事会审议批准,相关交易应当事先征得基金托管人的同意,并作为重大事项履行信息披露程序;
- (15) 本基金管理人管理的全部货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券,不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的 10%;
- (16) 本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%;
- (17) 持有的剩余期限不超过 397 天但剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债券的摊余成本总计不得超过当日基金资产净值的 20%:
- (18) 通过买断式回购融入的基础债券的剩余期限不得超过 397 天;
- (19) 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;

	(20) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,
	不得超过该资产支持证券规模的 10%;
	(21) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,
	不得超过该基金资产净值的 10%。
	(22) 本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资
	产净值的20%,中国证监会规定的特殊品种除外;
	(23) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各
	类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的
	10%;
	(24) 本基金投资的资产支持证券的信用评级,应不低于国内信
	用评级机构评定的 AAA 级或相当于 AAA 级的信用级别。基金持
	有资产支持证券期间,如果其信用等级下降、不再符合投资标准,
	应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出;
	(25) 法律法规或中国证监会、中国人民银行规定的其他比例限
	制。
	除上述第(1)、(2)、(5)、(19)和(24)项外,由于市场
	波动或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不
	符合上述约定的,基金管理人应在 10 个交易日内进行调整,以达
	到标准,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。
	法律法规或监管部门取消上述限制,本基金不受上述限制。
第十三部分	新增:
基金资产估值	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
七、暂停估值	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,
的情形	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;
第十七部分	新增:

基金的信息披	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
露	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、
五、公开披露	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
的基金信息	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
(五)基金定	比、报告期内持有份额变化情况及本基金产品的特有风险。
期报告,包括	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
基金年度报告、	露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。
基金半年度报	本基金应当在年度报告、半年度报告中至少披露报告期末基金前
告和基金季度	10 名基金份额持有人的类别、持有份额及占总份额的比例等信息。
报告	0
第十七部分	新增:
基金的信息披	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
露	重大事项时;
五、公开披露	
的基金信息	
(六) 临时报	
告	

附件十:《申万菱信行业轮动股票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
니 <del>보</del>	内容	内容
	一、订立本基金合同的目的、依据和原则	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	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	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》	简称"《基金法》")、《公开募集证券投资基金运作管理办法》
第一部分 前言	(以下简称"《运作办法》")、《证券投资基金销售管理办法》(以	(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"《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。	下简称"《信息披露办法》") <u>、《公开募集开放式证券投资基金流</u>
		<u>动性风险管理规定》(以下简称"《流动性管理规定》")</u> 和其他有
		关法律法规。
	无	13、《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
		<u>险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订</u>
		52、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
第二部分释义		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
		<u>债券等</u>
		53、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
		<u>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</u>
		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
	三、申购与赎回的原则	三、申购与赎回的原则
	无	5、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
		<u>法律法规及监管部门、自律组织的规定。</u>
	五、申购和赎回的数量限制	五、申购和赎回的数量限制
	无	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。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。
第六部分 基金		具体见基金管理人相关公告。
份额的申购与	六、申购和赎回的价格、费用及其用途	六、申购和赎回的价格、费用及其用途
赎回	3、赎回金额的计算及处理方式:本基金赎回金额的计算及余额的	3、赎回金额的计算及处理方式:本基金赎回金额的计算及余额的
	处理方式详见《招募说明书》。本基金的赎回费率由基金管理人	处理方式详见《招募说明书》。本基金的赎回费率由基金管理人
	决定,并在招募说明书中列示。	决定,并在招募说明书中列示 <u>,<b>其中对于持续持有期少于7日的</b></u>
		投资者收取不少于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产。
	七、拒绝或暂停申购的情形	七、拒绝或暂停申购的情形
	无	8、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。
		9、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申购申请。
	发生上述第1、2、3、5、6、8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介上刊	发生上述第1、2、3、5、6、9、10 项暂停申购情形之一且基金管
登暂停申购公告	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介
	上刊登暂停申购公告 <b>当发生上述第 7、8 项情形时,基金管理</b>
	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、
	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
八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形	人、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 
无	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
	或暂停接受基金赎回申请。
九、巨额赎回的情形及处理方式	九、巨额赎回的情形及处理方式
2、巨额赎回的处理方式	2、巨额赎回的处理方式
(2) 部分延期赎回:	(2) 部分延期赎回: ······ <u>若基金发生巨额赎回,在出现单个基金</u>
	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"
	<u>)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</u>
	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

		<u>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,</u>
		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。
	二、投资范围	二、投资范围
	······	
	本基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例不低于	本基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例不低于
	80%; 其中,本基金每个交易日日终 <b>在扣除股指期货合约和国债</b>	80%; 其中, 本基金每个交易日日终, 应当保持不低于基金资产
	<b>期货合约需缴纳的交易保证金后</b> ,应当保持不低于基金资产净值	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
	5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。	<u>括结算备付金、存出保证金及应收申购款等</u> 。
	四、投资限制	四、投资限制
	1、组合限制	1、组合限制
	(2) 本基金每个交易日日终 <b>在扣除股指期货合约和国债期货合约</b>	(2) 本基金每个交易日日终,应当保持不低于基金资产净值
	<b>需缴纳的交易保证金后</b> ,应当保持不低于基金资产净值 5%的现金	5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券 <u>,其中现金不包括结</u>
第十二部分 基	或者到期日在一年以内的政府债券;	算备付金、存出保证金及应收申购款等;
金的投资	(4) 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	(4) 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%;	超过该证券的 10%; <b>本基金管理人管理的全部开放式基金持有一</b>
		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%;
		(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;
		(20) 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

	除上述第(12)项外,因证券、期货市场波动、上市公司合并或	与基金合同约定的投资范围保持一致;
	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	除上述第 <u>(2)、</u> (12) <u>、(19)、(20)</u> 项外,因证券、期货市
	上述规定投资比例的	场波动、上市公司合并或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
	三、估值方法	三、估值方法
	无	10、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
第十四部分 基		的公平性。
金资产估值	六、暂停估值的情形	六、暂停估值的情形
	无	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;
	五、公开披露的基金信息	五、公开披露的基金信息
	(六)基金定期报告	(六)基金定期报告
	3、	3、
	报告期内出现单一投资者持有基金份额比例超过20%的情形,基	报告期内出现单一投资者持有基金份额比例 <u>达到或</u> 超过 <u>基金总份</u>
	金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告文	<u>额</u> 20%的情形, <u>为保障其他投资者权益,</u> 基金管理人 <u>至少</u> 应当在
	件中披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内	季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告文件中 <u>"<b>影响投资者</b></u>
第十八部分 基	持有份额变化情况及 <b>产品</b> 的特有风险。	<b>决策的其他重要信息"项下</b> 披露该投资者的类别、报告期末持有份
金的信息披露		额及占比、报告期内持有份额变化情况及 <u>本基金</u> 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。
	(七) 临时报告	(七) 临时报告
	无	27、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;
		28、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;
八、暂停或延迟披露基金信息的情形	八、暂停或延迟披露基金信息的情形
无	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决定暂停估值的;