

# 申万菱信基金管理有限公司

## 申万菱信中证申万证券行业指数分级 证券投资基金招募说明书 (第十次更新)全文

基金管理人：申万菱信基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

二〇一九年四月

本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

## 重要提示

申万菱信申银万国证券行业指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)由申万菱信基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”或“本基金管理人”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》、《申万菱信申银万国证券行业指数分级证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关规定募集,并经中国证监会2014年1月26日【2014】141号文注册募集。

本基金基金合同于2014年3月13日生效,跟踪的标的指数名称为“申银万国证券行业指数”。鉴于申万指数体系中的“申银万国证券行业指数”的名称已自2015年4月16日起变更为“中证申万证券行业指数”(指数代码:399707),本基金管理人根据基金合同的相关规定以及中证指数有限公司与上海申银万国证券研究所有限公司发布的相关公告要求,经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致,将本基金的跟踪标的指数名称由“申银万国证券行业指数”调整为“中证申万证券行业指数”,基金名称相应修改为申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金。修改事项已报中国证监会备案,自2015年4月16日起生效。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册,但中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用本基金财产,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资者在投资本基金前,需充分了解本基金的产品特性,并承担基金投资中出现的各类风险,包括:因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险,基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险,本基金的指数投资风险、杠杆机制风险、折/溢价交易风险、份额配对转换及基金

份额折算等业务办理过程中的特定风险等。

基金管理人建议投资人根据自身的风险收益偏好，选择适合自己的基金产品，并且中长期持有。

投资有风险，投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同。投资者根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。本基金虽为股票型指数基金，但由于采取了基金份额分级的结构设计，不同的基金份额具有不同的风险收益特征。申万证券份额为常规指数基金份额，具有预期风险较高、预期收益较高的特征，其预期风险和预期收益水平均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金；证券 A 份额，则具有预期风险低，预期收益低的特征；证券 B 份额由于利用杠杆投资，则具有预期风险高、预期收益高的特征。

基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行承担。基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金表现的保证。

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（包括申万证券份额、证券 A 份额和证券 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。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为 2019 年 3 月 13 日，有关基金的财务数据和净值表现截止日为 2018 年 12 月 31 日（财务数据未经审计）。

## 目 录

|                            |     |
|----------------------------|-----|
| 第一部分 绪言                    | 5   |
| 第二部分 释义                    | 6   |
| 第三部分 基金管理人                 | 13  |
| 第四部分 基金托管人                 | 24  |
| 第五部分 相关服务机构                | 29  |
| 第六部分 基金份额分级                | 56  |
| 第七部分 基金的募集                 | 59  |
| 第八部分 基金合同的生效               | 65  |
| 第九部分 证券 A 份额与证券 B 份额的上市交易  | 66  |
| 第十部分 申万证券份额的申购与赎回          | 68  |
| 第十一部分 基金的非交易过户、转托管、冻结与解冻   | 80  |
| 第十二部分 基金的份额配对转换            | 82  |
| 第十三部分 基金的投资                | 84  |
| 第十四部分 基金的财产                | 95  |
| 第十五部分 基金资产估值               | 96  |
| 第十六部分 基金的收益与分配             | 102 |
| 第十七部分 基金费用与税收              | 103 |
| 第十八部分 基金份额折算               | 106 |
| 第十九部分 证券 A 份额与证券 B 份额的终止运作 | 114 |
| 第二十部分 基金的会计与审计             | 116 |
| 第二十一部分 基金的信息披露             | 117 |
| 第二十二部分 风险揭示                | 123 |
| 第二十三部分 基金合同的变更、终止与基金财产清算   | 133 |
| 第二十四部分 基金合同的内容摘要           | 135 |
| 第二十五部分 基金托管协议的内容摘要         | 153 |
| 第二十六部分 对基金份额持有人的服务         | 168 |
| 第二十七部分 招募说明书的存放及查阅方式       | 170 |

|        |              |     |
|--------|--------------|-----|
| 第二十八部分 | 其它应披露事项..... | 171 |
| 第二十九部分 | 备查文件.....    | 175 |

## 第一部分 绪言

《申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金招募说明书》(以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”)依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其他相关法律法规及《申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)编写。

本基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息,或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书由本基金管理人根据基金合同编写,并经中国证监会注册,主要向投资者披露本基金及与本基金相关事项的信息,是投资者据以选择及决定是否投资于本基金的要约邀请文件。基金合同是规定基金合同当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资者自依据基金合同取得基金份额,即成为本基金份额持有人和基金合同的当事人,其持有本基金基金份额的行为即视为对基金合同的承认和接受。投资者按照法律法规和基金合同的规定享有权利、承担义务。本基金投资者欲了解本基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

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(包括申万证券份额、证券 A 份额和证券 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 释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金
- 2、基金管理人：指申万菱信基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指中国工商银行股份有限公司
- 4、基金合同：指《申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充
- 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书或本招募说明书：指《申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金招募说明书》及其定期的更新
- 7、基金份额发售公告：指《申万菱信申银万国证券行业指数分级证券投资基金基金份额发售公告》
- 8、上市交易公告书：指《申万菱信申银万国证券行业指数分级证券投资基金之证券 A 份额与证券 B 份额上市交易公告书》
- 9、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
- 10、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，2012 年 12 月 28 日第十一届全国人大常委会第 30 次会议修订，2012 年 12 月 28 日中华人民共和国主席令第 71 号公布，自 2013 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 11、《销售办法》：指中国证监会 2013 年 3 月 15 日颁布、同年 6 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 12、《信息披露办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 8 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 13、《运作办法》：指中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布、同年 8 月 8 日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

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

15、运作周年：指自某运作周年开始日起至该运作周年结束日止的运作期间。基金合同生效之日为第一个运作周年的开始日，其他运作周年的开始日为上一个运作周年结束日的次日。结束日为其开始日至满一周年的最后一日（简称为“对应日”），若某运作周年的对应日为非工作日，则该运作周年的结束日顺延至其对应日之后的第一个工作日。

16、申万证券份额：指申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金之基础份额

17、证券 A 份额：指申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金之稳健收益类份额

18、证券 B 份额：指申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金之积极进取类份额

19、基金份额分级：指本基金的基金份额包括申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金之基础份额、申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金之稳健收益类份额与申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金之积极进取类份额。证券 A 份额、证券 B 份额的基金份额配比始终保持 1:1 的比例不变

20、年基准收益率：指本基金为证券 A 份额设定每运作周年应得的收益率。证券 A 份额的年基准收益率=一年期银行定期存款利率（税后）+3.00%，其中，一年期银行定期存款利率是指每个运作周年的第一天中国人民银行公布并执行的金融机构人民币一年期整存整取基准年利率。年基准收益率除以运作周年的实际天数为日基准收益率，其对应的日分配金额称为日基准收益，日基准收益以面值 1.0000 元为基准采取单利进行计算

21、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

22、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会

23、基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义



务的法律主体,包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人

24、个人投资者:指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

25、机构投资者:指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

26、合格境外机构投资者:指符合现时有效的相关法律法规规定可投资于中国境内证券市场的中国境外的机构投资者

27、基金份额持有人大会:指按照基金合同第十二部分之规定召集、召开并由基金份额持有人或其合法的代理人进行表决的会议

28、投资人:指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称

29、基金份额持有人:指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

30、基金销售业务:指基金管理人或销售机构宣传推介基金,发售基金份额,办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务

31、销售机构:指申万菱信基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件,取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售协议,办理基金销售业务的机构,以及可通过深圳证券交易所交易系统办理基金销售业务的会员单位

32、基金销售网点:指基金管理人的直销中心及基金销售机构的销售网点

33、会员单位:指深圳证券交易所会员单位

34、销售场所:指场外销售场所和场内销售场所

35、场外:指通过深圳证券交易所交易系统外的销售机构进行基金份额认购(场外认购的全部份额将确认为申万证券份额)、申购和赎回等业务的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购、赎回也称为场外认购、场外申购、场外赎回

36、场内:指通过深圳证券交易所内具有基金销售业务资格的会员单位利用深圳证券交易所交易系统办理本基金相关基金份额的认购、申购、赎回和上市交易的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购、赎回也称为场内认购、场

内申购、场内赎回

37、登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等

38、登记机构：指办理登记业务的机构。本基金的登记机构为中国证券登记结算有限责任公司

39、注册登记系统：指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金注册登记系统，通过场外销售机构认购、申购的基金份额登记在注册登记系统

40、证券登记结算系统：指中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统，通过场内会员单位认购、申购或买入的基金份额登记在证券登记结算系统

41、上市交易所：指深圳证券交易所

42、上市交易：指投资者通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖基金份额的行为

43、场外份额：指登记在注册登记系统下的基金份额

44、场内份额：指登记在证券登记结算系统下的基金份额

45、开放式基金账户：指投资者通过场外销售机构在中国证券登记结算有限责任公司注册的开放式基金账户、用于记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户

46、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理基金交易业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户

47 深圳证券账户：指在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开设的深圳证券交易所人民币普通股票账户（即 A 股账户）或证券投资基金账户

48、基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期

49、基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期

50、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长

不得超过 3 个月

51、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

52、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

53、T 日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日

54、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日），n 为自然数

55、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

56、开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

57、《业务规则》：指申万菱信基金管理有限公司、深圳证券交易所和中国证券登记有限责任公司的相关业务规则，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则，由基金管理人、销售机构和投资人共同遵守

58、认购：指在基金募集期内，投资人根据基金合同和招募说明书的规定的条件和销售网点规定的手续，通过场内或场外申请购买基金份额的行为

59、申购：指在基金存续期内，投资人根据基金合同和招募说明书的规定的条件和销售网点规定的手续，通过场内或场外申请购买基金份额的行为

60、赎回：指在基金存续期内，基金份额持有人按基金合同、招募说明书规定的条件和销售网点规定的手续，通过场内或场外将基金份额兑换为现金的行为

61、基金转换：指基金份额持有人按照基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的行为

62、系统内转托管：指基金份额持有人将其持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（交易单元）之间进行转托管的行为

63、跨系统转托管：指基金份额持有人将其持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转托管的行为

64、指令：指基金管理人在运用基金财产进行投资时，向基金托管人发出的资金划拨及实物券调拨指令

65、份额配对转换：指根据基金合同的约定，本基金的申万证券份额与证券 A 份额、证券 B 份额之间的配对转换，包括分拆与合并两个方面

66、分拆：指根据基金合同的约定，基金份额持有人将其持有的每两份申万证券份额的场内份额申请转换成一份证券 A 份额与一份证券 B 份额的行为

67、合并：指根据基金合同的约定，基金份额持有人将其持有的每一份证券 A 份额与一份证券 B 份额进行配对申请转换成两份申万证券份额的场内份额的行为

68、定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及受理申购申请的一种投资方式

69、巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一开放日基金总份额（包括申万证券份额、证券 A 份额和证券 B 份额）的 10%

70、元：指人民币元

71、基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、证券持有期间的公允价值变动、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约

72、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和

73、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

74、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

75、基金资产估值：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程

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：指当申万证券份额遭遇大额申购赎回时，通过调整申万证券份额的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

78、指定媒体：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒体

79、不可抗力：指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

## 第三部分 基金管理人

### 一、基金管理人概况

名称：申万菱信基金管理有限公司

住所：上海市中山南路 100 号 11 层

法定代表人：刘郎

设立日期：2004 年 1 月 15 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证券监督管理委员会，证监基金字【2003】144 号文。

组织形式：有限责任公司

注册资本：壹亿伍仟万元人民币

联系电话：+86-21-23261188

联系人：赵鹏

股本结构：申万宏源证券有限公司持有 67%的股权，三菱 UFJ 信托银行株式会社持有 33%的股权

### 二、主要人员情况

#### 1、董事会成员

刘郎先生，董事长，硕士研究生，副教授。曾任湖南邵阳学院助教，东南大学系副主任、副教授。1994 年起从事金融相关工作，历任泰阳证券有限责任公司党委副书记、总裁、董事，万联证券有限责任公司总裁、董事，广州城市职业学院商学部主任，大通证券股份有限公司党委委员、副总经理，申银万国证券股份有限公司副总经理，申万宏源证券有限公司副总经理。现任申万菱信基金管理有限公司董事长，兼任申万菱信（上海）资产管理有限公司董事长。

朱敏杰先生，董事，硕士研究生，经济师。1988 年起从事证券相关工作，先后任职于万国证券公司，申银万国证券股份有限公司，现任申万宏源证券有限公司副总经理。

张克均先生，董事，硕士研究生。1990 年起从事金融相关工作，曾任职于兴业银行厦门分行、申银万国证券股份有限公司，现任申万宏源证券有限公司总经理助理。

铃木晃先生，董事，日本籍，大学学历。1982年4月至今在三菱UFJ信托银行株式会社（原三菱信托银行）任职，历任投资商品开发部副部长、部长、执行官，管理受托财产部门常务执行官、副部长，现任受托财产副部长、资产管理事业部副事业长。

川上丰先生，董事，日本籍，大学学历。1990年4月至今在三菱UFJ信托银行株式会社（原三菱信托银行）任职，曾任投资企划部科长、海外资产管理事业部科长、次长、副部长等。现任三菱UFJ信托银行株式会社执行官、海外资产管理事业部部长。

来肖贤先生，董事，硕士研究生，中级经济师。曾任申银万国证券股份有限公司国际业务总部投资分析师、部门副经理等。2004年加入申万菱信基金管理有限公司，曾任监察稽核总部副总监、公司督察长、公司副总经理，现任公司总经理，兼任申万菱信（上海）资产管理有限公司董事。

白虹女士，独立董事，硕士研究生。曾任职于中国工商银行总行、韩国釜山分行、万事达卡国际组织、FEXCO国际商务、跨界创新平台（COIN）、汉德产业促进资本，现任社会价值投资联盟（深圳）常务理事兼创始秘书长。

WEI/SHANGJIN（魏尚进）先生，独立董事，美国籍，博士研究生。曾任职于哈佛大学肯尼迪政府学院、世界银行、国际货币基金组织等，现任哥伦比亚大学商学院金融学与经济学终身讲席教授。

余卫明先生，独立董事，大学本科学历。曾任职于湖南省民政干部中等专业学校、中南工业大学，现任中南大学法学院教授。

## 2、监事会成员

徐志斌先生，监事会主席，硕士研究生。曾任高盛集团环球控制部高级分析师、项目经理、团队经理，高盛集团运营风险管理部欧洲区负责人、总监、执行董事，高盛集团市场风险管理部执行董事，中国建银投资有限责任公司风险管理部业务总监、高级业务总监、负责人，宏源证券股份有限公司副总经理，申万宏源证券有限公司副总经理、首席风险官，现任申万宏源集团股份有限公司和申万宏源证券有限公司党委委员、申万宏源证券有限公司副总经理，兼任投资交易事业部总经理。

糠信英树先生，监事，日本籍，大学学历。1988年4月至今任职于三菱UFJ信托银行株式会社（原三菱信托银行），曾任职于人事部、资产运用部、权益运用部、投资企划部、受托财产企划部，现任资产管理事业部部长。

牛锐女士，职工监事，博士研究生，曾任职于申银万国证券股份有限公司、中国证监会上海监管局、中金公司、国泰基金等公司。2013年加入申万菱信基金管理有限公司，曾任监察稽核部总监，现任综合办公室主任。

葛菲斐女士，职工监事，大学本科学历，2006年加入申万菱信基金管理有限公司，曾任职于行政管理总部，主要从事行政管理、人力资源相关工作，曾任人力资源总部总监助理，现任人力资源部负责人，兼任申万菱信（上海）资产管理有限公司监事。

### 3、高级管理人员

刘郎先生，相关介绍见董事会成员部分。

来肖贤先生，相关介绍见董事会成员部分。

王伟先生，博士研究生。曾任职于申银万国证券股份有限公司。2003年加入申万巴黎基金管理有限公司筹备组，后正式加入申万菱信基金管理有限公司，历任市场部副总监、总监，首席市场官，现任公司副总经理。

张少华先生，硕士研究生。曾任职于申银万国证券股份有限公司。2003年1月加入申万巴黎基金筹备组，后正式加入申万菱信基金管理有限公司，历任风险管理总部高级风险分析师、总监，基金投资管理总部基金经理、副总监，投资管理总部总监、基金经理，现任公司副总经理。

张丽红女士，硕士研究生。曾任职于中国工商银行股份有限公司，申银证券股份有限公司，申银万国证券股份有限公司。2004年加入申万菱信基金管理有限公司，历任财务管理总部总监、首席财务官兼财务管理总部总监，现任公司副总经理。

王菲萍女士，硕士研究生。曾在申银万国证券股份有限公司总裁办任法律顾问等职务。2004年加入申万菱信基金管理有限公司，曾任监察稽核总部总监，现任公司督察长。

### 4、现任基金经理

龚丽丽女士，硕士研究生。2011年起从事金融相关工作，曾任华泰柏瑞基



金研究员、专户经理、基金经理等。2017 年加入申万菱信基金，现任申万菱信中小板指数证券投资基金（LOF）、申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金、申万菱信深证成指分级证券投资基金、申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金、申万菱信上证 50 交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理。

袁英杰先生，2015 年 1 月至 2017 年 12 月任本基金基金经理。

俞诚先生，2015 年 12 月至 2017 年 12 月任本基金基金经理。

张少华先生，2014 年 3 月至 2015 年 12 月任本基金基金经理。

#### 5、投资决策委员会委员名单

本委员会由以下人员组成：总经理、公司分管投资的副总经理、权益研究部负责人、权益投资部负责人、量化投资部负责人、固定收益投资部负责人、指数与创新投资部负责人等。

公司总经理为本委员会主席，分管投资的副总经理为本委员会召集人，权益研究部负责人为本委员会秘书，负责协调统筹本委员会的各项事宜。

本公司董事长、督察长、监察稽核部负责人、风险管理部负责人作为非执行委员，有权列席本委员会的任何会议。非执行委员不参与投票表决。

#### 6、上述人员之间不存在近亲属关系。

### 三、基金管理人的职责

（1）依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

（2）办理基金备案手续；

（3）自基金合同生效日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

（4）配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

（5）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

（6）除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得利用基金财产为

自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

(7) 依法接受基金托管人的监督；

(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值、申万证券份额的基金份额净值、证券 A 份额和证券 B 份额的基金份额参考净值，确定申万证券份额申购、赎回的价格；

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度、半年度和年度基金报告；

(11) 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

(12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；

(13) 按基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

(15) 依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

(16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；

(17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照基金合同规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件；

(18) 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(19) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

(20) 因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(21) 监督基金托管人按法律法规和基金合同规定履行自己的义务,基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时,基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;

(22) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时,应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任;

(23) 以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为;

(24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件,基金合同不能生效,基金管理人承担全部募集费用,将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人;

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议;

(26) 建立并保存基金份额持有人名册;

(27) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

#### 四、基金管理人的承诺

1、本基金管理人于此承诺将遵守适用的法律法规和基金合同。

2、本基金管理人承诺禁止用本基金财产从事以下行为:

(1) 将其固有财产或者他人财产混同于本基金财产从事证券投资;

(2) 不公平地对待其管理的不同基金财产;

(3) 利用本基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益;

(4) 向本基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失;

(5) 侵占、挪用基金财产;

(6) 泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或明示、暗示他人从事相关的交易活动;

(7) 玩忽职守,不按照规定履行职责;

(8) 法律法规、中国证监会及基金合同规定禁止从事的其他行为。

#### 3、本基金基金经理承诺

(1) 依照有关法律法规和基金合同的规定,本着谨慎的原则为本基金份额持有人谋取最大利益;

(2) 不为自己、其代理人、代表人、受雇人或任何第三人谋取非法利益;

(3) 不违反现行有效的有关法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定,泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息,利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动;

(4) 不协助、接受委托或以其他任何形式为除本基金管理人以外的其他组织或个人进行证券交易。

## 五、基金管理人的内部控制制度概述

### 1、内控体系设计依据

本基金管理人内控体系的设计基于满足国家有关法律法规的要求,以及本基金管理人对相关法律法规精神的深入理解,结合本基金管理人对基金管理业务的理解和规划并借鉴股东单位在资产管理业务领域长期的实践经验。

### 2、内控体系设计原则

(1) 健全性原则:内部控制覆盖公司的各项业务、部门或机构和各级人员,并贯穿到决策、执行、监督、反馈等各个环节。

(2) 有效性原则:本基金管理人内控体系注重于建立不同层次的风险控制和监察程序,同时各业务部门和岗位均设立并遵循合理的管理制度和有效率的工作流程。本基金管理人内部控制体系的建立在各项业务的运行过程中将发挥事前防范风险、事中监控和事后稽核的作用。

(3) 独立性原则:本基金管理人各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立,公司旗下基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离。设立独立于各业务和管理部门的风险管理部对各部门、岗位进行流程监控和风险管理。此外,更具独立性的督察长和监察稽核部,对各部门的业务开展进行合规监察,并代表董事会对公司的运营进行独立的稽核。

(4) 相互制约原则:公司内部部门和岗位的设置权责分明、相互制衡。

(5) 成本效益原则:公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本,提高经济效益,通过合理的成本控制达到最佳的内部控制效果。

### 3、风险管理及内部风险控制的组织结构

为满足业务发展中风险控制的要求,本公司建立了董事会、经营管理层、内部风险控制部门、各职能部门的四级风险管理及内部风险控制组织结构,并明确

了相应的风险管理职能。

(1) 董事会对有效的风险管理承担最终责任, 董事会下设风险控制委员会与督察长。风险控制委员会负责监督和核实公司作出的与其所管理的基金有关的重大投资决策是否符合该基金的一般投资政策; 检查和监督公司存在或潜在的各种风险以及公司遵守法律的情况。督察长负责独立监督检查基金和公司运作的合法、合规情况及公司内部风险控制情况, 依法向中国证监会和公司董事会报告。

(2) 经营管理层对有效的风险管理承担直接责任, 经营管理层下设风险管理委员会, 负责指导、协调和监督各职能部门和各业务单元开展风险管理工作, 审核公司的风险控制制度和风险管理流程, 确保对公司整体风险进行风险评估的识别、监控与管理, 对公司存在的风险隐患或出现的风险问题进行研究、提出解决方法, 组织实施风险应对方案等。

(3) 监察稽核部和风险管理部是公司内部风险控制部门, 负责对投资组合市场风险、流动性风险、信用风险、合规风险、操作风险、声誉风险、子公司管控风险等的风险管理进行独立评估、监控、检查和报告。

(4) 各职能部门负责执行风险管理的基本制度流程, 具体制定、组织实施并持续完善本部门业务相关的风险管理制度和相关应对措施、控制流程、监控指标等, 将风险管理的原则与要求贯穿业务开展的全过程并对其风险管理的有效性负责。

## 六、基金管理人内部控制要素

### 1、内部控制环境

(1) 内部控制环境包括经营理念和内控文化, 公司治理结构、组织结构、员工道德素质等内容;

(2) 本基金管理人致力于营造一个强调内控和风险管理文化氛围;

(3) 本基金管理人按现代企业制度的要求, 建立了符合公司发展需要的组织结构和运行机制, 充分发挥独立董事、监事会对公司管理层和经营活动的监督, 通过在董事会、监事会层面建立专业化、民主、透明的决策程序和管理、议事规则, 防止不正当的关联交易、利益输送和公司内部人控制的现象并确保基金份额持有人的利益不受侵犯;

(4) 本基金管理人建立了科学的聘用、培训、评估考核、晋升、淘汰等人

力资源管理制度,建立了健全的激励与约束机制,确保公司职员具备和保持良好的职业操守和专业素养;

(5) 本基金管理人建立了贯穿于公司整体的、层次明晰、权责统一、监管明确的四层内部控制防线,包括:

第一层:员工的自律与岗位之间的相互制衡与监督;

第二层:严格的授权管理及等级监督制度;

第三层:独立于各部门、服务于公司高级管理层的由风险管理部对各业务部门实施的日常常规风险检查;

第四层:服务于董事会的独立的合规监察与稽核;

(6) 本基金管理人建立了重要业务处理凭据传递和信息沟通制度,有关部门和岗位之间相互监督、相互制衡。

## 2、风险评估

(1) 风险评估,包括风险鉴别和风险测算两大部分,是风险控制管理的前提;

(2) 风险鉴别指公司需要确认并了解它所面临风险的特征;

(3) 风险测算则在风险鉴别的基础上进一步对风险可能产生的损失作出较为科学和准确的估测;

(4) 风险管理委员会需要从风险损失的领域进行划分,确认某项风险将导致公司承担相应法律责任、社会和公众责任、经济损失或是在以上三个领域的任何组合损失;

(5) 各部门应负责落实其相关的风险控制措施;

(6) 风险管理部需要在预期风险损失发生的情景下,评估风险对各方面产生的冲击效应。

## 3、控制活动

(1) 严格的流程控制是公司进行有效的内部控制的基础。

1) 本基金管理人各项业务操作均应严格遵守公司制定的相应流程,主要的基本业务流程包括:销售和基金募集管理流程、客户开户和注册登记管理流程、客户服务与客户关系处理流程、投资决策管理流程、投资交易管理流程、基金清算与基金会计管理流程、产品开发流程、信息披露管理流程、信息技术管理与操

作流程、紧急应变程序、绩效评估与考核程序、授权管理程序、风险控制流程和监察稽核程序等；

2) 在主要基本业务流程体系的基础上，各部门结合基本业务流程和其部门、岗位的职责进一步制定具体的、涵盖操作细节的操作流程；在销售、注册登记、投资、交易、基金清算及授权管理等重要操作流程设计与执行中应产生和保留详细的书面记录；

3) 风险管理部在日常业务运行过程中对操作流程的遵守情况进行全面监督和记录；

4) 各部门主管负责对本部门的流程运作进行实时监控以保证本部门的工作严格遵守相关业务流程；

5) 监察稽核部以定期稽核的方式检查各业务部门对相关流程运作与遵守情况，并对该流程的合理性、可操作性以及得到遵守的实际状况进行评估；

(2) 严格的分级授权是公司内部控制的基本方式；

(3) 建立完善的资产分离制度，基金资产与公司资产、不同基金的资产和其他委托资产实行独立运作，分别核算；

(4) 严格执行岗位分离制度，明确制定了岗位职责；

(5) 建立科学的业绩评估和考核体系，定期对各项业务开展作出综合评价并对各部门和岗位人员的业绩进行评估、考核；

(6) 制定切实有效的紧急应变制度，建立危机处理的机制，明确危机处理的程序。

#### 4、信息沟通

(1) 建立公司内部的信息沟通渠道，保障信息的及时、准确的传递，并且维护渠道的畅通；

(2) 建立清晰的报告系统；

(3) 如果遇到紧急情况无法联络上级主管，可以越级汇报。

#### 5、内部监控

本基金管理人建立了有效的内部监控体系，设置督察长和独立的监察稽核部，对公司内控制度的执行情况进行持续的监督，保证内控制度落实。

(1) 设督察长，对董事会负责，经董事会聘任，报中国证监会核准。根据

公司监察稽核工作的需要和董事会授权开展工作；

(2) 设独立于公司运营管理部门的监察稽核部，监察稽核部通过定期稽核计划以及不定期的抽查稽核实现对公司的内部风险监控；

(3) 设独立于各业务部门的风险管理部，该部门的工作主要对公司管理层负责；

(4) 各部门主管负责本部门对于内控制度的执行和监督；在具体的业务运营中，授权管理、岗位间相互监督与相互制衡以及业务流程中跨部门之间的相互校验与会签制度的执行将赋予各岗位具体的监督职能；

(5) 督察长、风险管理部和投资总监有权对整个投资交易过程实施全程跟踪的在线监控；信息技术部在信息技术方面对这项实时监控提供充分的技术支持。监控者根据其授权范围和监控领域对于投资交易过程中的控制参数进行预设置；

(6) 各部门在发现任何有违反内控原则的行为时，应立即根据报告流程逐级上报，遇到紧急情况可以越级上报；

(7) 对于员工个人违反法律法规和有关规定，视其给公司造成的损失及影响程度进行处理。对各项规定制度完善、风险防范工作积极主动并卓有成效的部门，公司将给予适当表彰与鼓励。由于部门制度不合适或管理不完善而造成较大风险并给公司带来损失的，公司将追究部门主要负责人的责任。

#### 七、基金管理人内部控制制度声明

- 1、本基金管理人承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确；
- 2、本基金管理人承诺根据市场变化和基金管理人发展不断完善内部合规控制。



## 第四部分 基金托管人

### （一）基金托管人基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

成立时间：1984 年 1 月 1 日

法定代表人：易会满

注册资本：人民币 35,640,625.71 万元

联系电话：010-66105799

联系人：郭明

### （二）主要人员情况

截至 2018 年 6 月，中国工商银行资产托管部共有员工 212 人，平均年龄 33 岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

### （三）基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2018 年 6 月，中国工商银行共托管证券投资基金 874 只。自 2003

年以来,本行连续十五年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的61项最佳托管银行大奖;是获得奖项最多的国内托管银行,优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

#### (四) 基金托管人的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来,各项业务飞速发展,始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得,是与资产托管部“一手抓业务拓展,一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作,在积极拓展各项托管业务的同时,把加强风险防范和控制的力度,精心培育内控文化,完善风险控制机制,强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。2005、2007、2009、2010、2011、2012、2013、2014、2015、2016、2017共十一次顺利通过评估组织内部控制和安全措施最权威的ISAE3402审阅,获得无保留意见的控制及有效性报告。充分表明独立第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可,也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨,达到国际先进水平。目前,ISAE3402审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。

##### 1、内部风险控制目标

保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则,强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格,形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系;防范和化解经营风险,保证托管资产的安全完整;维护持有人的权益;保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

##### 2、内部风险控制组织结构

中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门(内控合规部、内部审计局)、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策,对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处,配备专职稽核监察人员,在总经理的直接领导下,依照有关法律规章,对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

### 3、内部风险控制原则

(1) 合法性原则。内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求,并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

(2) 完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约;监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节,覆盖所有的部门、岗位和人员。

(3) 及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录;按照“内控优先”的原则,新设机构或新增业务品种时,必须做到已建立相关的规章制度。

(4) 审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险,审慎经营,保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。

(5) 有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善,并保证得到全面落实执行,不得有任何空间、时限及人员的例外。

(6) 独立性原则。设立专门履行托管人职责的管理部门;直接操作人员和控制人员必须相对独立,适当分离;内控制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。

### 4、内部风险控制措施实施

(1) 严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离,建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度,并采取了良好的防火墙隔离制度,能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。

(2) 高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为工行托管业务政策和策略的制定者和管理者,要求下级部门及时报告经营管理情况和特别情况,以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展,并根据检查情况提出内部控制措施,督促职能管理部门改进。

(3) 人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制,建立“自控防线”、“互控防线”、“监控防线”三道控制防线,健全绩效考核和激励机制,树立“以人为本”的内控文化,增强员工的责任心和荣誉感,培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书,使员工树立风险防范与控制

制理念。

(4) 经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动、处理各项事务,从而有效地控制和配置组织资源,达到资源利用和效益最大化目的。

(5) 内部风险管理。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理,定期或不定期地对业务运作状况进行检查、监控,指导业务部门进行风险识别、评估,制定并实施风险控制措施,排查风险隐患。

(6) 数据安全控制。我们通过业务操作区相对独立、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。

(7) 应急准备与响应。资产托管业务建立专门的灾难恢复中心,制定了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难恢复方案,并组织员工定期演练。为使演练更加接近实战,资产托管部不断提高演练标准,从最初的按照预订时间演练发展到现在的“随机演练”。从演练结果看,资产托管部完全有能力在发生灾难的情况下两个小时内恢复业务。

## 5、资产托管部内部控制情况

(1) 资产托管部内部设置专职稽核监察部门,配备专职稽核监察人员,在总经理的直接领导下,依照有关法律规章,全面贯彻落实全程监控思想,确保资产托管业务健康、稳定地发展。

(2) 完善组织结构,实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与,只有这样,风险控制制度和措施才会全面、有效。资产托管部实施全员风险管理,将风险控制责任落实到具体业务部门和业务岗位,每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责,通过建立纵向双人制、横向多部门制的内部组织结构,形成不同部门、不同岗位相互制衡的组织结构。

(3) 建立健全规章制度。资产托管部十分重视内控制度的建设,一贯坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年努力,资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度,包括:岗位职责、业务操作流程、稽核监察制度、信息披露制度等,覆盖所有部门和岗位,渗透各项业务过程,形成各个业务环节之间的相互制约机制。

(4) 内部风险控制始终是托管部工作重点之一,保持与业务发展同等地位。

资产托管业务是商业银行新兴的中间业务,资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作,一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展,新问题、新情况不断出现,资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置,视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

#### (五) 基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《基金法》、基金合同、托管协议和有关基金法规的规定,基金托管人对基金的投资范围和投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金参与银行间债券市场、基金资产净值的计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、基金合同、基金托管协议或有关基金法律法规规定的行为,应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正,基金管理人收到通知后应及时核对,并以书面形式对基金托管人发出回函确认。在限期内,基金托管人有权随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为,应立即报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正。

## 第五部分 相关服务机构

### 一、基金份额发售机构

#### 1、场外发售机构

##### (1) 直销机构

申万菱信基金管理有限公司直销中心

住所：上海市中山南路 100 号 11 层

法定代表人：刘郎

电话：86-21-23261188

传真：86-21-23261199

联系人：陈继红

客户服务电话：400 880 8588（免长途话费）或 86-21-962299

网址：[www.swsmu.com](http://www.swsmu.com)

电子邮件：[service@swsmu.com](mailto:service@swsmu.com)

##### (2) 代销机构

##### (1) 名称：中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：易会满

客户服务电话：95588

传真：010—66107738

网址：[www.icbc.com.cn](http://www.icbc.com.cn)

##### (2) 名称：中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：周慕冰

客户服务电话：95599

网址：[www.abchina.com](http://www.abchina.com)

**(3)名称：交通银行股份有限公司**

住所：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

联系人：曹榕

电话：021-58781234

客户服务电话：95559

网址：[www.bankcomm.com](http://www.bankcomm.com)

**(4)名称：上海浦东发展银行股份有限公司**

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 500 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：吉晓辉

传真：021-63604199

联系人：倪苏云、于慧

客户服务热线：95528

公司网站：[www.spdb.com.cn](http://www.spdb.com.cn)

**(5)名称：上海农村商业银行股份有限公司**

注册地址：上海市浦东新区银城中路 8 号中融碧玉蓝天 15—20、22—27 层

法定代表人：冀光恒

客服电话：021-96 2999/4006 962 999

联系人：李晨

传真：021-50105124

网址：[www.srcb.com](http://www.srcb.com)

**(6)名称：南京银行股份有限公司**

注册地址：南京市白下区淮海路 50 号

办公地址：南京市白下区淮海路 50 号

法定代表人：林复

传真：025-84544129

联系人：翁俊

客户服务电话：4008896400

网址：[www.njcb.com.cn](http://www.njcb.com.cn)

**(7)名称：国泰君安证券股份有限公司**

注册地址：中国(上海)自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：杨德红

电话：021-38676666

传真：021-38670666

客户服务热线：95521

公司网站：[www.gtja.com](http://www.gtja.com)

**(8)名称：中信建投证券股份有限公司**

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

联系人：权唐

开放式基金咨询电话：400-8888-108

开放式基金业务传真：010-65182261

公司网站：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

**(9)名称：国信证券股份有限公司**

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1010 号国际信托大厦 21 楼

法定代表人：何如

联系人：周杨



传真: 0755-82133952

客户服务电话: 95536

网址: [www.guosen.com.cn](http://www.guosen.com.cn)

**(10)名称: 招商证券股份有限公司**

注册地址: 深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

法定代表人: 宫少林

传真: 0755-82943636

联系人: 林生迎

客户服务热线: 4008888111、95565

公司网站: [www.newone.com.cn](http://www.newone.com.cn)

**(11)名称: 中信证券股份有限公司**

注册地址: 广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座

办公地址: 北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人: 王东明

电话: 010-60838888

传真: 010-60833739

联系人: 顾凌

网址: [www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

**(12) 名称: 中国银河证券股份有限公司**

注册地址: 北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人: 陈有安

客户服务热线: 4008888888

传真: 010-66568292

联系人: 邓颜

公司网址: [www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

**(13) 名称：海通证券股份有限公司**

注册地址：上海市淮海中路 98 号

办公地址：上海市广东路 689 号

法定代表人：王开国

联系人：金芸、李笑鸣

客户服务电话：400-8888-001(全国)，021-95553，或拨打各城市营业网点  
咨询电话

公司网站：[www.htsec.com](http://www.htsec.com)

**(14) 名称：申万宏源证券有限公司**

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：李梅

联系人：黄莹

电话：021-33389888

传真：021-33388224

客服电话：95523 或 4008895523

电话委托：021-962505

公司网址：[www.swhysec.com](http://www.swhysec.com)

**(15) 名称：长江证券股份有限公司**

注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：崔少华

联系人：奚博宇

传真：027-85481900

客户服务电话：95579 或 4008-888-999

网址：[www.95579.com](http://www.95579.com)

**(16) 名称：安信证券股份有限公司**

注册地址:深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址:深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

深圳市福田区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 栋 9 层

法定代表人:王连志

传真:0755-82558355

联系人:陈剑虹

统一客服电话:4008001001

公司网站地址:[www.essence.com.cn](http://www.essence.com.cn)

**(17)名称:华泰证券股份有限公司**

注册地址:南京市江东中路 228 号

办公地址:南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场、深圳市福田区深南大道 4011 号港中旅大厦 18 楼

法定代表人:周易

联系人:庞晓芸

电话:0755-82492193

传真:0755-82492962

客服电话:95597

网址:[www.htsc.com.cn](http://www.htsc.com.cn)

**(18)名称:中信证券(山东)有限责任公司**

注册地址:青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层

办公地址:青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层

法定代表人:杨宝林

客户服务电话:95548

网址:[www.zxwt.com.cn](http://www.zxwt.com.cn)

**(19)名称:东吴证券股份有限公司**

住所:苏州工业园区星阳街 5 号东吴证券大厦

法定代表人：范力

联系人：方晓丹

电话：0512-65581136

传真：0512-65588021

客服电话：95330

公司网址：[www.dwzq.com.cn](http://www.dwzq.com.cn)

**(20)名称：信达证券股份有限公司**

注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人：张志刚

联系人：唐静

客服电话：95321

公司网址：[www.cindasc.com](http://www.cindasc.com)

**(21)名称：光大证券股份有限公司**

注册地址：上海市静安区新闻路1508号

办公地址：上海市静安区新闻路1508号

法定代表人：薛峰

联系人：刘晨、李芳芳

电话：021-22169999

传真：021-22169134

客户服务电话：95525

公司网址：[www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

**(22) 名称：广州证券股份有限公司**

注册地址：广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层

办公地址：广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层

法定代表人：邱三发

联系人： 梁微

联系电话： 020-88836999

传真： 020-88836654

客户服务电话： 95396

网址： [www.gzs.com.cn](http://www.gzs.com.cn)

**(23) 名称：上海证券有限责任公司**

住所：上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼

法定代表人：李俊杰

联系电话：021-53686888

客户服务电话：021-962518

传真：021-53686100-7008，021-53686200-7008

网址： [www.962518.com](http://www.962518.com)

**(24) 名称：国联证券股份有限公司**

注册地址：江苏省无锡市金融一街 8 号 7-9 层

法定代表人：姚志勇

联系人：沈刚

传真：0510-82830162

客户服务电话：95570

网址： [www.glsc.com.cn](http://www.glsc.com.cn)

**(25) 名称：浙商证券股份有限公司**

注册地址：浙江省杭州市西湖区杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 座

办公地址：浙江省杭州市西湖区杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 座 6、7 楼

邮政编码：310007

法定代表人：吴承根

传真：021-80106010

客服电话： 95345

网址: [www.stocke.com.cn](http://www.stocke.com.cn)

**(26)名称: 平安证券股份有限公司**

住所: 深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

办公地址: 深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

法定代表人: 詹露阳

客户服务电话: 95511-8

传真: 0755-82435367

网址: <http://stock.pingan.com>

**(27)名称: 东莞证券股份有限公司**

住所: 广东省东莞市莞城区可园南路一号金源中心 30 楼

办公地址: 广东省东莞市莞城区可园南路一号金源中心 22 楼

法定代表人: 张运勇

客户服务电话: 95328

传真: 0769-22115712

网址: <http://www.dgzq.com.cn>

**(28)名称: 华西证券股份有限公司**

注册地址: 四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦

办公地址: 四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦

法定代表人: 杨炯洋

联系人: 周志茹

客户服务电话: 95584 或 400 888 8818

传真: 028-86150040

网址: <http://www.hxl68.com.cn>

**(29)名称: 申万宏源西部证券有限公司**

住所: 新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼

2005 室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路 358 号大成国际大厦

20 楼 2005 室

法定代表人：韩志谦

联系人：王怀春

客户服务电话：4008-000-562

传真：010-88085195

网址：[www.hysec.com](http://www.hysec.com)

**(30)名称：中泰证券股份有限公司**

注册地址：山东省济南市市中区经七路 86 号

办公地址：山东省济南市市中区经七路 86 号

法定代表人：李玮

联系人：吴阳

电话：0531-68889155

传真：0531-68889185

客服电话：95538

网址：[www.zts.com.cn](http://www.zts.com.cn)

**(31)名称：第一创业证券股份有限公司**

住所：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 15-20 楼

办公地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 15-20 楼

法定代表人：刘学民

客户服务电话：95358

传真：0755-23838999

网址：[www.fcsc.com.cn](http://www.fcsc.com.cn)

**(32)名称：中航证券有限公司**

注册地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

法定代表人：王宜四

联系人：史江蕊

客服电话：400-8866-567

网址：www.avicsec.com

**(33)名称：西部证券股份有限公司**

注册地址：西安市东大街 232 号陕西信托大厦 16-17 层

法定代表人：刘建武

联系人：梁承华

传真：029-87406710

客户服务电话：95582

网站：www.westsecu.com

**(34)名称：中国国际金融股份有限公司**

住所：北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

法定代表人：丁学东

客户服务电话：4009101166

传真：010-85679203

网址：[www.cicc.com.cn](http://www.cicc.com.cn)

**(35)名称：中山证券有限责任公司**

注册地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新大厦 7 层、8 层

办公地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新大厦 7 层、8 层

法定代表人：黄扬录

联系人：刘军

电话：0755- 83734659

传真：0755-82960582

客户服务电话：4001-022-011



网址: [www.zszq.com](http://www.zszq.com)

**(36)名称: 联讯证券股份有限公司**

住所: 广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼

办公地址: 广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼

法定代表人: 徐刚

客户服务电话: 95564

传真: 010-2119660

网址: [www.lxsec.com](http://www.lxsec.com)

**(37)名称: 国金证券股份有限公司**

办公地址: 四川省成都市东城根上街 95 号

客服电话: 95310

公司网址: [www.gjzq.com.cn](http://www.gjzq.com.cn)

联系人: 刘婧漪、贾鹏

联系电话: 028-86690057、028-86690058

传真号码: 028-86690126

**(38)名称: 华融证券股份有限公司**

注册地址: 北京市西城区金融大街 8 号

办公地址: 北京市朝阳区朝阳门北大街 18 号中国人保寿险大厦 12 层

法定代表人: 祝献忠

联系人: 李慧灵

联系电话: 010-85556100

传真: 010-58568062

客户服务电话: 400-898-9999

网址: [www.hrsec.com.cn](http://www.hrsec.com.cn)

**(39)名称：天风证券股份有限公司**

天风证券股份有限公司

注册地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦4楼

办公地址：湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼

法定代表人：余磊

联系人：杨晨

电话：027-87107535

传真：027-87618863

客服热线：4008005000

**(40)名称：太平洋证券股份有限公司**

住所：云南省昆明市青年路389号志远大厦18层

办公地址：北京市西城区北展北街9号华远企业号D座3单元

法定代表人：李长伟

客户服务电话：400-665-0999

传真：010-88321819

网址：[www.tpyzq.com](http://www.tpyzq.com)

**(41)名称：开源证券股份有限公司**

住所：西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层

办公地址：西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层

法定代表人：李刚

客户服务电话：400-860-8866

传真：029-81887060

网址：[www.kysec.cn](http://www.kysec.cn)

**(42) 中信期货有限公司**

注册地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层

办公地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层  
1301-1305 室、14 层

法定代表人：张皓

传真：0755-83217421

公司网站：www.citicsf.com

客服电话：400-990-8826

**(43)名称：深圳市新兰德证券投资咨询有限公司**

注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

办公地址：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 16 层

法定代表人：杨懿

联系人：张燕

客服电话：400-166-1188

网址：8.jrj.com.cn

**(44)名称：和讯信息科技有限公司**

注册地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

传真：021-20835879

客服电话：400-920-0022/ 021-20835588

网址：licaikexun.com

**(45)名称：诺亚正行基金销售有限公司**

注册地址：上海市金山区廊下镇漕廊公路 7650 号 205 室

法定代表人：汪静波

联系人：方成

传真：021-38509777

客户服务电话：400-821-5399

网址：[www.noah-fund.com](http://www.noah-fund.com)

**(46)名称：深圳众禄基金销售股份有限公司**

注册地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

办公地址：深圳市罗湖区梨园路 8 号 HALO 广场 4 楼

法定代表人：薛峰

联系人：童彩平

电话：0755-33227950

传真：0755-82080798

客户服务电话：4006-788-887

网址：众禄基金网 [www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn)，基金买卖网 [www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

**(47)名称：上海天天基金销售有限公司**

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座

法定代表人：其实

联系人：潘世友

电话：021-54660526

传真：021-54660501

客户服务电话：400-1818-188

网址：[www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

**(48)名称：上海好买基金销售有限公司**

注册地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903-906 室

法定代表人：杨文斌

联系人：张茹

客服电话：400-700-9665

公司网址：[www.ehowbuy.com](http://www.ehowbuy.com)

**(49)名称：蚂蚁（杭州）基金销售有限公司**

住所：杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 栋 202 室

办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6F

法定代表人：陈柏青

联系人：韩爱彬

客服电话：4000-766-123

公司网址：www.fund123.cn

**(50)名称：上海长量基金销售有限公司**

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人：单丙烨

传真：021-20691861

客服电话：400-089-1289

公司网站：[www.erichfund.com](http://www.erichfund.com)

**(51)名称：浙江同花顺基金销售有限公司**

注册办公地址：杭州市西湖区文二西路 1 号元茂大厦 903 室

法定代表人：凌顺平

联系人：杨翼

传真：0571-88910240

客户服务电话：4008-773-772，0571-88920897

网站：www.5ifund.com

**(52)名称：北京展恒基金销售股份有限公司**

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

办公地址：北京市朝阳区安苑路 15-1 号邮电新闻大厦 2 层

法定代表人：闫振杰

联系人：马林

电话: 010-59601366-7024

传真: 010-62020355

客服电话: 4008188000

网址: [www.myfund.com](http://www.myfund.com)

**(53)名称: 上海利得基金销售有限公司**

注册地址: 上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

办公地址: 上海市虹口区东大名路 1098 号浦江金融世纪广场 18F

法定代表人: 李兴春

联系人: 赵沛然

电话: 86-021-50583533

传真: 86-021-50583633

客户服务电话: 400-921-7755

**(54)名称: 宜信普泽(北京)基金销售有限公司**

注册地址: 北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809

办公地址: 北京市朝阳区建国路 88 号 SOHO 现代城 C 座 1809

法定代表人: 沈伟桦

联系人: 程刚

客户服务电话: 400-6099-200

网址: [www.yixinfund.com](http://www.yixinfund.com)

**(55)名称: 众升财富(北京)基金销售有限公司**

注册地址: 北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼 A 座 9 层 908 室

法定代表人: 李招娣

联系人: 李艳

联系电话: 010-59497361

传真: 010-64788016

客服电话: 400-876-9988

网址: [www.zscffund.com](http://www.zscffund.com)

**(56) 名称: 北京恒天明泽基金销售有限公司**

注册地址: 北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

办公地址: 北京市朝阳区亮马桥路 39 号第一上海中心 C 座 6 层

法定代表人: 梁越

联系人: 马鹏程

电话: 86-010-58845304

传真: 86-021-58845306

客户服务电话: 4008-980-618

网址: [www.chtfund.com](http://www.chtfund.com)

**(57) 名称: 一路财富(北京)基金销售股份有限公司**

注册地址: 北京市西城区阜成门外大街 2 号 1 幢 A2208 室

办公地址: 北京市海淀区宝盛里宝盛南路 1 号院奥北科技园国泰大厦 9 层

法定代表人: 吴雪秀

联系人: 段京璐

电话: 010-88312877

传真: 010-88312099

客户服务电话: 400-001-1566

网址: <http://www.yilucaifu.com/>

**(58) 名称: 北京钱景基金销售有限公司**

注册地址: 北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012

办公地址: 北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012

法定代表人: 赵荣春

联系人: 高静

电话: 010-59158281

传真: 010-57569671

客户服务电话: 400-893-6885

网址: [www.qianjing.com](http://www.qianjing.com)

**(59) 名称: 上海联泰基金销售有限公司**

注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

办公地址: 上海市长宁区福泉北路 518 号 8 号楼 3 层

法定代表人: 燕斌

联系人: 陈东

电话: 021-52822063

传真: 021-52975270

客服电话: 4000-466-788

网址: <http://www.66zichan.com>

**(60) 名称: 上海汇付基金销售有限公司**

注册地址: 上海市黄浦区中山南路 100 号 19 层

办公地址: 上海市宜山路 700 号普天信息产业园 2 期 C5 栋汇付天下总部大楼 2 楼

法定代表人: 金佶

联系人: 陈云卉

电话: 021-33323999

传真: 8621-33323837

客户服务电话: 400 820 2819

手机客户端: 天天盈基金

网址: [www.chinapnr.com](http://www.chinapnr.com)

**(61) 名称: 深圳富济基金销售有限公司**

注册地址: 深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路 3088 号中洲大厦 3203A 单元

办公地址: 深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路 3088 号中洲大厦 3203A



## 单元

法定代表人：刘鹏宇

联系人：刘勇

联系电话：0755-83999907-8814

客户服务电话：0755-83999907

传真：0755-83999926

网址：www.fujifund.cn

**(62) 名称：上海陆金所基金销售有限公司**

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

法定代表人：郭坚

客户服务电话：400-821-9031

传真：021-22066653

网址：www.lufunds.com

**(63) 名称：大泰金石基金销售有限公司**

住所：南京市建邺区江东中路 222 号南京奥体中心现代五项馆 2105 室

办公地址：上海市浦东新区峨山路 505 号东方纯一大厦 15 楼

法定代表人：袁顾明

客户服务电话：4009282266

传真：021-20324199

网址：www.dtfunds.com

**(64) 名称：珠海盈米基金销售有限公司**

住所：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼  
B1201-1203

法定代表人：肖雯

客户服务电话: 020-89629066

传真: 020-89629011

网址: [www.yingmi.cn](http://www.yingmi.cn)

**(65) 北京肯特瑞基金销售有限公司**

注册地址: 北京市海淀区中关村东路 66 号 1 号楼 22 层 2603-06

办公地址: 北京市亦庄经济开发区科创十一街 18 号院京东集团总部 A 座 17 层

法定代表人: 陈超

联系人: 赵德赛

电话: 18600280556

传真: 010-89188000

客户服务电话: 4000988511

网址: <http://fund.jd.com/>

**(66) 名称: 中民财富基金销售(上海)有限公司**

注册地址: 上海市黄浦区中山南路 100 号 07 层

办公地址: 上海市黄浦区中山南路 100 号 17 层

法定代表人: 弭洪军

客户服务电话: 400-876-5716

传真: 021-63353736

网址: [www.cmiwm.com](http://www.cmiwm.com)

**(67) 名称: 北京汇成基金销售有限公司**

注册地址: 北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108

办公地址: 北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108

法定代表人: 王伟刚

联系人: 李瑞真

电话: 010-56282140

传真: 010-62680827

客户服务电话: 400-619-9059

网址: [www.hcjjjin.com](http://www.hcjjjin.com)

**(68) 名称: 北京蛋卷基金销售有限公司**

注册地址: 北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507

办公地址: 北京市朝阳区创远路34号院融新科技中心C座17层

法定代表人: 钟斐斐

联系人: 袁永姣

电话: 010-61840688

传真: 010-61840699

客户服务电话: 4000-618-518

网址: [www.danjuanapp.com](http://www.danjuanapp.com)

**(69) 名称: 上海大智慧基金销售有限公司**

注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102单元

办公地址: 中国(上海)自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102、1103单元

法定代表人: 申健

联系人: 印强明

电话: 021-20219988

传真: 021-20219923

客户服务电话: 021-20292031

网址: [www.wg.com.cn](http://www.wg.com.cn)

**(70) 名称: 南京苏宁基金销售有限公司**

注册地址: 南京市玄武区苏宁大道1号

办公地址: 南京市玄武区苏宁大道1号

法定代表人: 刘汉青

联系人：王锋

电话：025-66996699-887226

客户服务电话：95177

网址：www.snjijin.com

**(71) 名称：上海基煜基金销售有限公司**

注册地址：上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和经济发展区）

办公地址：上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室

法定代表人：王翔

联系人：吴鸿飞

电话：021-65370077

传真：021-55085991

客户服务电话：4008-205-369

网址：www.jiyufund.com.cn

**(72) 名称：上海挖财基金销售有限公司**

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03 室

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03 室

法定代表人：冷飞

联系人：李娟

电话：021-50810687

传真：021-58300279

客户服务电话：021-50810673

网址：[www.wacaijijin.com](http://www.wacaijijin.com)

App：挖财宝

**(73) 名称：泰诚财富基金销售（大连）有限公司**

注册地址：辽宁省大连市沙河口区星海中路3号

办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海中路3号

法定代表人：林卓

联系人：张晓辉

电话：0411-88891212

传真：0411-84396536

客户服务电话：40-0411-001

网址：[www.haojiyoujijin.com](http://www.haojiyoujijin.com)

**(74) 名称：上海有鱼基金销售有限公司**

注册地址：上海自由贸易试验区浦东大道2123号3层3E-2655室

办公地址：上海市徐汇区桂平路391号B座19层

法定代表人：林琼

电话：021-60907379

传真：021-60907397

联系人：徐海峥

客服电话：021-60907378

网址：[www.youyufund.com](http://www.youyufund.com)

**(75) 名称：玄元保险代理有限公司**

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区张杨路707号1105室

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区张杨路707号1105室

法定代表人：马永谔

联系人：卢亚博

电话：021-50701053

传真：021-50701053

客户服务电话：021-50701053

网址：[http://www.xyinsure.com/kfit\\_xybx](http://www.xyinsure.com/kfit_xybx)

**(76) 名称: 济安财富(北京)基金销售有限公司**

注册地址: 北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼 3 层 307

办公地址: 北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼 3 层 307

法定代表人: 杨健

联系人: 李海燕

电话: 010-65309516

客户服务电话: 400-673-7010

网址: [www.jianfortune.com](http://www.jianfortune.com)

**(77) 名称: 北京植信基金销售有限公司**

注册地址: 北京市密云县兴盛南路 8 号院 2 号楼 106 室-67

办公地址: 北京市朝阳区惠河南路盛世龙源 10 号

法定代表人: 于龙

客户服务电话: 4006-802-123

网址: [www.zhixin-inv.com](http://www.zhixin-inv.com)

**(78) 名称: 大连网金基金销售有限公司**

注册地址: 辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室

办公地址: 辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室

法定代表人: 樊怀东

客户服务电话: 4000-899-100

网址: <http://www.yibaijin.com/>

**(79) 名称: 北京虹点基金销售有限公司**

注册地址: 北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号裙房 2 层 222 单元

办公地址: 北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号裙房 2 层 222 单元

法定代表人: 郑毓栋

客户服务电话: 4006180707

网址: [www.hongdianfund.com](http://www.hongdianfund.com)

## 2、场内发售机构

(1) 本基金的场内发售机构为具有基金销售业务资格的深圳证券交易所会员单位, 具体名单为: 爱建证券、安信证券、渤海证券、财达证券、财富证券、财富里昂、财通证券、长城证券、长江证券、诚浩证券、川财证券、大通证券、大同证券、德邦证券、第一创业、东北证券、东方证券、东海证券、东莞证券、东吴证券、东兴证券、高华证券、方正证券、光大证券、广发证券、广州证券、国都证券、国海证券、国金证券、国开证券、国联证券、国盛证券、国泰君安、国信证券、国元证券、海通证券、恒泰长财、恒泰证券、红塔证券、宏源证券、宏信证券、华安证券、华宝证券、华创证券、华福证券、华林证券、华龙证券、华融证券、华泰联合、华泰证券、华西证券、华鑫证券、江海证券、金元证券、开源证券、联讯证券、民生证券、民族证券、南京证券、平安证券、齐鲁证券、日信证券、瑞银证券、山西证券、上海证券、申银万国、世纪证券、首创证券、天风证券、天源证券、万和证券、万联证券、西部证券、西藏同信、西南证券、厦门证券、湘财证券、新时代证券、信达证券、兴业证券、银河证券、银泰证券、英大证券、招商证券、浙商证券、中航证券、中金公司、中山证券、中投证券、中天证券、中信建投、中信浙江、中信万通、中信证券、中银证券、中邮证券、中原证券(排名不分先后)。

(2) 本基金募集结束前获得基金销售业务资格的深圳证券交易所会员单位可新增为本基金的场内发售机构。

3、基金管理人可根据有关法律法规要求, 根据实情, 选择其他符合要求的机构代理销售本基金或变更上述代销机构, 并及时公告。

## 二、登记机构

名称: 中国证券登记结算有限责任公司

注册地址: 北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址: 北京市西城区太平桥大街 17 号

邮政编码: 100033

法定代表人: 周明

电话： 010-59378835

传真： 010-59378907

联系人：任瑞新

### 三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：俞卫锋

电话：+86-21-31358666

传真：+86-21-31358600

联系人姓名：孙睿

经办律师：孙睿、黎明

### 四、审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

法定代表人姓名：杨绍信

电话：+86 -21-23238888

传真：+86-21-23238800

联系人姓名：赵钰

经办注册会计师姓名：薛竞、赵钰



## 第六部分 基金份额分级

### 一、基金份额分级

#### 1、基金份额结构

本基金的基金份额包括申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金之基础份额（以下简称“申万证券份额”）、申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金之稳健收益类份额（以下简称“证券 A 份额”）与申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金之积极进取类份额（以下简称“证券 B 份额”）。其中，证券 A 份额、证券 B 份额的基金份额配比始终保持 1:1 的比例不变。

#### 2、基金的自动分离与分拆规则

本基金通过场外、场内两种方式公开发售。基金发售结束后，场外认购的全部基金份额将确认为申万证券份额；场内认购的全部基金份额按照 1:1 的比例自动分离为预期收益与预期风险不同的两种份额类别，即证券 A 份额和证券 B 份额。

基金合同生效后，申万证券份额设置单独的基金代码，只可以进行场内与场外的申购和赎回，但不上市交易。证券 A 份额与证券 B 份额交易代码不同，只可在深圳证券交易所上市交易，不接受单独的申购与赎回。

投资者可在场内申购和赎回申万证券份额，投资者可选择将其在场内申购的申万证券份额按 1:1 的比例分拆成证券 A 份额和证券 B 份额。投资者也可按 1:1 的配比将其持有的证券 A 份额和证券 B 份额申请合并为场内的申万证券份额。

投资者可在场外申购和赎回申万证券份额。投资者不得申请将其场外申购的申万证券份额进行分拆。但投资者可将其持有的场外申万证券份额跨系统转托管至场内并申请将其分拆成证券 A 份额和证券 B 份额后上市交易。

#### 3、证券 A 份额和证券 B 份额的基金份额参考净值计算原则

本基金按基金合同约定的参考净值计算规则对证券 A 份额和证券 B 份额分别进行基金份额参考净值计算，具体计算原则如下：

（1）本基金一份证券 A 份额的参考净值与一份证券 B 份额的参考净值之和等于两份申万证券份额的净值。

（2）证券 A 份额每日获得日基准收益，证券 A 份额实际的投资盈亏都由证

券 B 份额分享与承担。证券 A 份额的日基准收益均以 1.0000 元面值为基准采取单利进行计算。

某运作周年的日基准收益  $R = 1.0000 \text{ 元} \times \text{该运作周年的年基准收益率} / \text{该运作周年的实际天数}$

本基金的运作周年指自某运作周年开始日起至该运作周年结束日止的运作期间。基金合同生效之日为第一个运作周年的开始日，其他运作周年的开始日为上一个运作周年结束日的次日。结束日为其开始日至满一周年的最后一日（简称为“对应日”），若某运作周年的对应日为非工作日，则该运作周年的结束日顺延至其对应日之后的第一个工作日。假设本基金的基金合同生效之日为 2013 年 12 月 1 日，则第一个运作周年的开始日为 2013 年 12 月 1 日，第一个运作周年的对应日为 2014 年 11 月 30 日，因该对应日为非工作日，故第一个运作周年的结束日顺延至 2014 年 11 月 30 日之后的第一个工作日，即 2014 年 12 月 1 日。

年基准收益率是指本基金为证券 A 份额设定每运作周年应得的收益率。

年基准收益率 = 一年期银行定期存款利率（税后）+ 3.00%，其中，一年期银行定期存款利率是指每个运作周年的第一天中国人民银行公布并执行的金融机构人民币一年期整存整取基准年利率。

(3) 证券 B 份额的基金份额参考净值 =  $2 \times$  申万证券份额的基金份额净值 - 证券 A 份额的基金份额参考净值。

基金管理人并不承诺或保证证券 A 份额的基金份额持有人的约定基准收益，如在本基金资产出现极端损失情况下，证券 A 份额的基金份额持有人可能会面临无法取得约定基准收益甚至损失本金的风险。

#### 4、基金份额净值、基金份额参考净值的计算

本基金按照证券 A 份额和证券 B 份额的基金份额参考净值计算规则计算并公告申万证券份额的基金份额净值、证券 A 份额与证券 B 份额的基金份额参考净值。

为了简化表述，记 T 日的申万证券份额的基金份额净值、证券 A 份额和证券 B 份额的基金份额参考净值分别为  $NAV_T$ ， $NAV(A)_T$ ， $NAV(B)_T$ 。

##### 1、申万证券份额的基金份额净值计算

T 日，申万证券份额的基金份额净值计算公式为：

$NAV_T = T$  日闭市后本基金的基金资产净值/ $T$  日本基金(包括申万证券份额、证券 A 份额与证券 B 份额)的基金份额总数

## 2、证券 A 份额的基金份额参考净值计算

证券 A 份额每日获得日基准收益,  $T$  日, 证券 A 份额的基金份额参考净值计算公式如下:

$$NAV(A)_T = NAV(A)_{T-1} + R_T$$

$NAV(A)_{T-1}$ :  $T-1$  日证券 A 份额的基金份额参考净值;

$R_T$ :  $T$  日所在运作周年的日基准收益。

## 3、证券 B 份额的基金份额参考净值计算

$T$  日, 证券 B 份额的基金份额参考净值计算公式为:

$$NAV(B)_T = 2 \times NAV_T - NAV(A)_T$$

申万证券份额的基金份额净值和证券 A 份额和证券 B 份额的基金份额参考净值的计算, 均保留到小数点后 4 位, 小数点后第 5 位四舍五入, 由此误差产生的收益或损失计入基金财产。

$T$  日的基金份额净值在当天收市后计算, 并在  $T+1$  日公告。如遇特殊情况, 经中国证监会同意, 可以适当延迟计算或公告。

## 二、证券 A 份额与证券 B 份额的终止运作

经基金份额持有人大会决议通过, 证券 A 份额与证券 B 份额可申请终止运作。该基金份额持有人大会决议须经本基金所有份额以特别决议的形式表决通过, 即须经参加基金份额持有人大会的申万证券份额、证券 A 份额与证券 B 份额各自的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方为有效。

## 第七部分 基金的募集

本基金由本基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定募集,本次募集经中国证监会【2014】141号文注册。

### 一、基金基本情况

#### 1、基金名称

申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金

#### 2、基金的类别

股票型证券投资基金

#### 3、基金的运作方式

上市契约型开放式

#### 4、基金存续期限

不定期

### 二、募集方式和募集场所

本基金通过场外、场内两种方式公开募集。

场外将通过基金管理人的直销中心及基金场外代销机构的代销网点发售(具体名单详见基金份额发售公告)。场内将通过深圳证券交易所内具有基金销售业务资格并经深圳证券交易所认可的会员单位发售(具体名单详见基金份额发售公告或相关业务公告)。本基金募集期结束前获得基金销售业务资格的会员单位也可代理场内基金份额的发售。基金发售结束后,投资者场外认购所得的全部份额将确认为申万证券份额;投资者场内认购所得的全部份额将按 1:1 的比例确认为证券 A 份额与证券 B 份额。

### 三、募集期

募集期限为自基金份额发售之日起不超过 3 个月,具体募集时间以基金份额发售公告为准,请投资者就募集和认购事宜仔细阅读本基金的基金份额发售公告。

### 四、募集对象

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者和合

格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

## 五、基金的最低募集份额总额和募集金额

基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额不少于 2 亿元。

## 六、认购时间

投资人可在募集期内前往本基金场外销售机构的网点办理基金份额认购手续，具体的业务办理时间详见本基金的基金份额发售公告或各代销机构相关业务办理规则。

投资人可在募集期内前往具有基金销售业务资格的深圳证券交易所会员单位（具体名单详见基金份额发售公告）办理基金份额的场内认购手续，具体的业务办理时间详见本基金的基金份额发售公告或各代销机构相关业务办理规则。

## 七、认购手续

### 1、投资人认购本基金份额应提交的文件和办理的手续

投资人通过场内认购本基金基金份额，应持深圳人民币普通股票账户或证券投资基金账户；投资者通过场外认购本基金基金份额，应开立中国证券登记结算有限责任公司深圳开放式基金账户。募集期内，投资者可通过具有基金销售业务资格的证券经营机构营业部、基金管理人及其代销机构的营业网点办理开户和认购手续。

在募集期间，投资者认购本基金基金份额应当按照证券经营机构营业部、基金管理人及其代销机构网点的规定，到相应的销售网点填写认购申请书，并按照其规定的方式全额缴纳认购款。

投资者认购本基金份额应提交的文件和办理的手续详见本基金的基金份额发售公告。

### 2、认购的确认

销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以登记机构或基金管理人的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资人应及时查询。

## 八、认购方式

### 1、本基金基金份额初始面值为人民币 1.00 元，按初始面值发售。

## 2、认购费率

本基金对通过基金管理人直销中心认购的养老金客户与除此之外的其他投资人实施差别的认购费率，对通过直销中心认购的养老金客户实施特定认购费率。养老金客户指基本养老金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金，包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划。如将来出现经养老金监管部门认可的新的养老基金类型，基金管理人将在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围，并按规定向中国证监会备案。非养老金客户指除养老金客户外的其他投资人。

(1) 本基金的场外认购费率如下表：

| 认购金额（元）        | 特定认购费率  | 认购费率     |
|----------------|---------|----------|
| 100 万以下        | 0.48%   | 1.00%    |
| 100 万（含）—200 万 | 0.14%   | 0.60%    |
| 200 万（含）以上     | 500 元/笔 | 1000 元/笔 |

(2) 本基金的场内认购费率由销售机构参照场外认购费率执行。

基金认购费用不列入基金财产，主要用于基金的市场推广、销售、登记等募集期间发生的各项费用。

## 3、认购份额的计算

(1) 场外认购份额的计算

本基金发售结束后，场外认购的全部份额将确认为申万证券份额。本基金采用前端收费模式，即投资人在认购基金时缴纳认购费。登记机构根据单次认购的实际确认金额确定每次认购所适用的费率并分别计算。

当认购费用适用比例费率时，认购份额的计算方法如下：

净认购金额 = 认购金额 / (1 + 认购费率)

认购费用 = 认购金额 - 净认购金额

认购份额 = (净认购金额 + 认购资金利息) / 基金份额初始面值

当认购费用为固定金额时，认购份额的计算方法如下：

认购费用 = 固定金额

净认购金额 = 认购金额 - 认购费用

认购份额 = (净认购金额 + 认购资金利息) / 基金份额初始面值

场外认购份额的计算保留到小数点后两位, 小数点两位以后的部分四舍五入, 由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有, 其中利息转份额以登记机构的记录为准。利息折算份额的计算采用截位法保留到小数点后两位, 剩余部分计入基金财产。

举例说明:

假设某投资人(非养老金客户)通过场外认购本基金, 认购金额 10,000 元, 认购费率为 1.00%, 假定募集期间认购资金所得利息为 35.5 元, 则其可得到的申万证券份额计算如下:

净认购金额 = 10,000 元 / (1 + 1.00%) = 9,900.99 元

认购费用 = 10,000 元 - 9,900.99 元 = 99.01 元

认购份额 = (9,900.99 + 35.5) / 1.00 = 9,936.49 份

即: 该投资人投资 10,000 元通过场外认购本基金份额, 假定募集期间认购资金所得利息为 35.5 元, 在基金发售结束后, 其所获得的申万证券份额为 9,936.49 份。

## (2) 场内认购份额的计算

本基金发售结束后, 场内认购的全部份额将按 1:1 的比例确认为证券 A 份额与证券 B 份额。

本基金场内认购采用份额认购的方式, 认购价格为 1.00 元/份。计算公式为:

净认购金额 = 认购价格 × 认购份额

认购费用 = 认购价格 × 认购份额 × 认购费率

(注: 对于适用固定金额认购费的认购, 认购费用 = 固定金额认购费)

认购金额 = 净认购金额 + 认购费用

认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有, 其中利息以登记机构的记录为准。计算公式为:

利息折算的份额 = 认购利息 / 认购价格

认购金额的计算保留到小数点后两位, 小数点两位以后的部分四舍五入。场内认购份额按整数申报, 利息折算份额的计算保留到整数位, 剩余部分计入

基金财产。

认购份额总额=认购份额+利息折算的份额

经确认的证券 A 份额=认购份额总额 $\times$ 0.5

经确认的证券 B 份额=认购份额总额-经确认的证券 A 份额

证券 A 份额、证券 B 份额的计算保留至整数位（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

举例说明：

某投资人（非养老金客户）通过场内认购本基金 100,000 份，若会员单位设定发售费率为 1.00%，假定该笔认购产生利息 100 元。则认购金额和利息折算的份额为：

认购价格=1.00 元

净认购金额=认购价格 $\times$ 认购份额=1.00 $\times$ 100,000=100,000.00 元

认购费用=认购价格 $\times$ 认购份额 $\times$ 认购费率=1.00 $\times$ 100,000 $\times$ 1.00%=1,000.00 元

认购金额=净认购金额+认购费用=100,000.00+1,000.00=101,000.00 元

利息折算的份额=利息/认购价格=100/1.00=100 份

认购份额总额=认购份额+利息折算的份额=100,000+100=100,100 份

经确认的证券 A 份额=认购份额总额 $\times$ 0.5=100,100 $\times$ 0.5=50,050 份

经确认的证券 B 份额=认购份额总额-经确认的证券 A 份额=100,100-50,050=50,050 份

即：该投资人通过场内认购 100,000 份申万证券份额，需缴纳 101,000 元，加上认购资金在认购期内获得的利息，在基金发售结束后，其可获得的证券 A 份额为 50,050 份、证券 B 份额为 50,050 份。

#### 九、基金份额的认购原则

1、投资人在募集期内可以多次认购本基金份额，认购一经受理不得撤销。

2、本基金场外认购首次单笔认购最低金额为人民币 1,000 元（含认购费，下同），追加认购的单笔认购最低金额为人民币 1,000 元。投资人在直销中心首次单笔认购最低金额为 1,000 元人民币，追加认购的最低金额为 1,000 元人民币。本基金通过具有基金销售业务资格的深圳证券交易所会员单位进行场内认购的



单笔最低认购份额为 50,000 份, 超过 50,000 份的须是 1,000 份的整数倍, 且每笔认购最大不得超过 99,999,000 份。

3、基金管理人可根据有关法律法规的规定和市场情况, 调整认购的数额限制, 基金管理人最迟应于调整前 2 个工作日在指定媒体上予以公告。

4、投资者认购前, 须按照销售机构规定的方式备足全额缴纳认购的金额款项。

5、具体规则请参照申万菱信基金管理有限公司直销中心和各基金代销机构的规定。

#### 十、募集资金利息的处理方式

本基金的认购款项在基金募集期间产生的利息在基金合同生效后将折算为基金份额, 归基金份额持有人所有。利息转份额以登记机构的记录为准。

#### 十一、募集资金的保管

基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户, 在基金募集行为结束前, 任何人不得动用。

## 第八部分 基金合同的生效

### 一、基金备案和基金合同生效

1、本基金自基金份额发售之日起 3 个月内，在基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额不少于 2 亿元人民币且基金认购人数不少于 200 人的条件下，基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售，并在 10 日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起 10 日内，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续。

基金募集达到基金备案条件的，自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起，基金合同生效；否则基金合同不生效。

2、基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对基金合同生效事宜予以公告。

3、基金合同生效前，基金投资者的认购款项只能存入专用账户，任何人不得动用。有效认购资金在基金募集期形成的利息折成基金份额，归基金投资者所有。利息转份额的具体数额以登记机构的记录为准。

### 二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式

如果募集期限届满，未满足基金备案条件，基金管理人应当承担下列责任：

- 1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；
- 2、在基金募集期限届满后 30 日内退还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期存款利息；

3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

### 三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

基金合同生效后，基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续 20 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因并报送解决方案。

法律法规另有规定时，从其规定。

## 第九部分 证券 A 份额与证券 B 份额的上市交易

### 一、上市交易的基金份额

基金合同生效后,基金管理人将根据有关规定,申请证券 A 份额、证券 B 份额上市交易。

### 二、上市交易的地点

深圳证券交易所

### 三、上市交易的时间

基金合同生效后三个月内,在本基金符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下,证券 A 份额与证券 B 份额开始在深圳证券交易所上市交易。

在确定上市交易的时间后,基金管理人应依据法律法规规定在指定媒体上刊登基金份额上市交易公告书。

### 四、上市交易的规则

- 1、证券 A 份额、证券 B 份额分别采用不同的交易代码上市交易;
- 2、证券 A 份额、证券 B 份额上市首日的开盘参考价分别为各自前一交易日的基金份额参考净值;
- 3、证券 A 份额、证券 B 份额实行价格涨跌幅限制,涨跌幅比例为 10%,自上市首日起实行;
- 4、证券 A 份额、证券 B 份额买入申报数量为 100 份或其整数倍;
- 5、证券 A 份额、证券 B 份额申报价格最小变动单位为 0.001 元人民币;
- 6、证券 A 份额、证券 B 份额上市交易遵循《深圳证券交易所交易规则》及《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》等其他有关规定。

### 五、上市交易的费用

证券 A 份额、证券 B 份额上市交易的费用按照深圳证券交易所的有关规定办理。

### 六、上市交易的行情揭示

证券 A 份额、证券 B 份额在深圳证券交易所挂牌交易,交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示基金前一交易日证券 A 份额、证券 B 份额的基金份额参考净值。

## 七、上市交易的注册登记

投资人 T 日买入成功后, 登记机构在 T 日自动为投资人登记权益并办理注册登记手续, 投资人自 T+1 日(含该日)后有权卖出该部分基金;

投资人 T 日卖出成功后, 登记机构在 T 日自动为投资人办理扣除权益的注册登记手续。

## 八、上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市

证券 A 份额、证券 B 份额的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所的相关规定执行。

九、相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的, 基金合同相应予以修改, 并按照新规定执行, 且此项修改无须召开基金份额持有人大会。

十、若深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司增加了基金上市交易的新功能, 基金管理人可以在履行适当的程序后增加相应功能。

## 第十部分 申万证券份额的申购与赎回

本基金基金合同生效后,投资者可通过场外或场内两种方式对申万证券份额进行申购与赎回。证券 A 份额、证券 B 份额只上市交易,不接受申购与赎回。

### 一、申购和赎回场所

申万证券份额场外申购与赎回的场所包括基金管理人的直销中心和基金管理人委托的场外销售机构,投资者可使用开放式基金账户,通过基金管理人、场外销售机构办理场外申购、赎回业务;申万证券份额场内申购与赎回的场所为深圳证券交易所内具有基金代销业务资格、经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的会员单位,投资者使用深圳证券账户,通过深圳证券交易所交易系统办理场内申购、赎回业务。具体的销售网点将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构,并予以公告。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理申万证券份额的申购与赎回。

### 二、申购和赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

投资人在开放日办理申万证券份额的申购和赎回,具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间,但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

基金合同生效后,若出现新的证券交易市场、期货市场、证券交易所、期货交易所交易时间变更或其他特殊情况,基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整,但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

#### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

基金管理人自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始办理申万证券份额的申购,具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始办理申万证券份额的赎回,具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

在确定申购开始与赎回开始时间后,基金管理人应在申购、赎回开放日前依

照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告申购与赎回的开始时间。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理申万证券份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的,其申万证券份额申购、赎回价格为下一开放日申万证券份额申购、赎回的价格。

### 三、申购与赎回的原则

1、“未知价”原则,即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的申万证券份额的份额净值为基准进行计算;

2、“金额申购、份额赎回”原则,即申购以金额申请,赎回以份额申请;

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销,在当日的开放时间结束后不得撤销;

4、申万证券份额的场内申购、赎回等业务,按照深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司相关业务规则执行。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对申购、赎回业务等规则有新的规定,按新规定执行;

5、除投资人指定赎回外,场外赎回遵循“先进先出”原则,即按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回;

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。

基金管理人可在法律法规允许的情况下,对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

### 四、申购与赎回的程序

#### 1、申购和赎回的申请方式

投资人必须根据销售机构规定的程序,在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

投资人办理申购、赎回等业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守基金合同和招募说明书规定的前提下,以各销售机构的具体规定为准。

## 2、申购和赎回的款项支付

投资人申购申万证券份额时,必须全额交付申购款项,投资人交付申购款项,申购成立;登记机构确认申万证券份额时,申购生效。投资人在提交赎回申请时,必须有足够的申万证券份额余额,则赎回申请成立,否则所提交的赎回申请不成立,登记机构确认赎回时,赎回生效。

投资人 T 日的赎回申请经本基金的登记机构确认生效后,基金管理人将在 T+7 日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回或基金合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时,款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内,对上述业务办理时间进行调整,并按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上提前公告。

## 3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T 日),在正常情况下,本基金登记机构在 T+1 日内(包括该日)对该交易的有效性进行确认,投资人应在 T+2 日后(包括该日)及时到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功,则申购款项退还给投资人。

销售机构对申请的受理并不代表该申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到申请。申请的确认以登记机构或基金管理人的确认结果为准。对于申请的确认情况,投资者应及时查询,否则如因申请未得到登记机构或基金管理人的确认而产生的后果,由投资人自行承担。

## 五、申购和赎回的数量限制

### 1、申购金额的限制

投资人在办理申万证券份额场内申购时,单笔申购的最低金额为 50,000 元人民币(含申购费)。投资人在办理申万证券份额场外申购时,单笔最低金额为 10 元人民币(含申购费)。通过直销中心首次申购的最低金额为 10 元人民币(含申购费),追加申购最低金额为 10 元人民币(含申购费)。本基金直销中心单笔申购最低金额可由基金管理人酌情调整。

代销网点的投资人欲转入直销网点进行交易要受直销网点最低金额的限制。

基金管理人可根据市场情况，调整首次申购的最低金额。

投资人可多次申购，对单个投资人累计持有份额不设上限限制。法律法规、中国证监会另有规定的除外。

## 2、赎回份额的限制

申万证券份额持有人在销售机构赎回时，每笔赎回申请不得低于 10 份申万证券份额，且通过场内单笔申请赎回的申万证券份额必须是整数份；申万证券份额持有人在某一销售机构（网点）的某一交易账户内基金份额不足 10 份的，应一次性全部赎回。

3、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。

4、基金管理人可根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

## 六、申购费用与赎回费用

### 1、申万证券份额的申购费用

本基金对通过基金管理人直销中心申购的养老金客户与除此之外的其他投资人实施差别的申购费率，对通过直销中心申购的养老金客户实施特定申购费率。养老金客户指基本养老基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金，包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划。如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，基金管理人将在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围，并按规定向中国证监会备案。非养老金客户指除养老金客户外的其他投资人。

申万证券份额的申购费用由投资人承担，不列入基金资产，用于基金的市场推广、销售、登记等各项费用

#### （1）申万证券份额的场外申购费率



| 申购金额（元）        | 特定申购费率  | 申购费率     |
|----------------|---------|----------|
| 100 万以下        | 0.48%   | 1.20%    |
| 100 万（含）—200 万 | 0.14%   | 0.80%    |
| 200 万（含）以上     | 500 元/笔 | 1000 元/笔 |

## （2）申万证券份额的场内申购费率

| 申购金额（元）        | 申购费率     |
|----------------|----------|
| 100 万以下        | 1.2%     |
| 100 万（含）-200 万 | 0.8%     |
| 200 万（含）以上     | 1000 元/笔 |

## 2、申万证券份额的赎回费用

申万证券份额的赎回费用由赎回申万证券份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回申万证券份额时收取，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。

### （1）申万证券份额的场外赎回费率

| 持有期限          | 赎回费率  |
|---------------|-------|
| 7 日以内         | 1.50% |
| 7 日（含）-6 个月以内 | 0.50% |
| 6 个月（含）—1 年以内 | 0.25% |
| 1 年（含）以上      | 0.00% |

注：月按 30 日计算，年按 365 日计算。

### （2）申万证券份额的场内赎回费率

| 持有期限     | 赎回费率  |
|----------|-------|
| 7 日以内    | 1.50% |
| 7 日（含）以上 | 0.50% |

3、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

4、对特定交易方式（如网上交易、电话交易等），基金管理人履行适当程序后可以采用低于柜台交易方式的基金申购费率和基金赎回费率。

5、基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情况下根据市场情况制定基金促销计划，针对基金投资者定期和不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以按中国证监会要求履行必要手续后，对基金投资者适当调低基金申购费率和赎回费率。

#### 七、申购份额与赎回金额的计算

##### 1、申万证券份额的申购份额计算

申万证券份额的申购金额包括申购费用和净申购金额。登记机构根据单次申购的实际确认金额确定每次申购所适用的费率并分别计算。

当申购费用适用比例费率时，申购份额的计算方法如下：

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / (1 + \text{申购费率})$$

$$\text{申购费用} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / T \text{ 日申万证券份额净值}$$

当申购费用为固定金额时，申购份额的计算方法如下：

$$\text{申购费用} = \text{固定金额}$$

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} - \text{申购费用}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / T \text{ 日申万证券份额净值}$$

申购费用以四舍五入方式保留到小数点后两位。通过场外方式进行申购的，申购份额计算结果按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担；通过场内方式进行申购的，申购份额计算结果采用截尾法保留至整数位，不足1份部分对应的申购资金将返还给投资人。

举例说明：

某投资人（非养老金客户）通过场外投资10,000元申购申万证券份额，对应费率为1.20%，假设申购当日申万证券份额的基金份额净值为1.1320元，则其可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 10,000 / (1 + 1.20\%) = 9,881.42 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 10,000 - 9,881.42 = 118.58 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 9,881.42 / 1.1320 = 8,729.17 \text{ 份}$$

即：该投资人通过场外投资 10,000 元申购申万证券份额，假设申购当日申万证券份额的基金份额净值为 1.1320 元，则可得到 8,729.17 份申万证券份额。

举例说明：

某投资人（非养老金客户）通过场内投资 100,000 元申购申万证券份额，对应的申购费率为 1.2%，假设申购当日申万证券份额的基金份额净值为 1.1320 元，则其申购手续费、可得到的申购份额及返还的资金余额为：

$$\text{净申购金额} = 100,000 / (1 + 1.2\%) = 98,814.23 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 100,000 - 98,814.23 = 1,185.77 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 98,814.23 / 1.1320 = 87,291.72 \text{ 份}$$

因场内申购份额最后计算结果采用截位法保留至整数份，故投资人申购所得份额为 87,291 份，不足 1 份部分对应的申购资金将返还给投资人。具体计算公式为：

$$\text{实际净申购金额} = 87,291 \times 1.1320 = 98,813.41 \text{ 元}$$

$$\text{退款金额} = 100,000 - 98,813.41 - 1,185.77 = 0.82 \text{ 元}$$

即：该投资人投资 100,000 元从场内申购申万证券份额，假设申购当日申万证券份额的基金份额净值为 1.1320 元，则其可得到申万证券份额 87,291 份，退款 0.82 元。

## 2、申万证券份额的赎回金额计算

投资人在赎回申万证券份额时需缴纳一定的赎回费用。计算公式如下：

$$\text{赎回总金额} = \text{赎回份额} \times T \text{ 日基金份额净值}$$

$$\text{赎回费} = \text{赎回份额} \times T \text{ 日基金份额净值} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{净赎回金额} = \text{赎回金额} - \text{赎回费}$$

赎回金额单位为元，计算结果按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产享有或承担。

举例说明：

某申万证券份额持有人持有 10,000 份申万证券份额 6 个月后（未满 1 年）决定从场外赎回，对应的赎回费率为 0.25%，假设赎回当日申万证券份额的基金份额净值是 1.1320 元，则可得到的净赎回金额为：

$$\text{赎回总金额} = 10,000 \times 1.1320 = 11,320.00 \text{ 元}$$

赎回费用=11,320.00×0.25%=28.30 元

净赎回金额=11,320.00-28.30=11,291.70 元

即：该申万证券份额持有人持有 10,000 份申万证券份额 6 个月后（未满 1 年）从场外赎回，假设赎回当日申万证券份额的基金份额净值是 1.1320 元，则可得到的净赎回金额为 11,291.70 元。

举例说明：

某申万证券份额持有人从场内赎回 10,000 份申万证券份额且持有时间不少于 7 日，赎回费率为 0.50%，假设赎回当日申万证券份额的基金份额净值为 1.1320 元，则可得到的净赎回金额为：

赎回总金额=10,000×1.1320=11,320.00 元

赎回费用=11,320.00×0.5%=56.60 元

净赎回金额=11,320.00-56.60=11,263.40 元

即：该申万证券份额持有人从深圳证券交易所场内赎回 10,000 份申万证券份额且持有时间不少于 7 日，假设赎回当日申万证券份额的基金份额净值为 1.1320 元，则可得到的净赎回金额为 11,263.40 元。

### 3、申万证券份额的基金份额净值计算

T 日申万证券份额的基金份额净值=T 日闭市后的基金资产净值/T 日本基金的基金份额总数（指申万证券份额、证券 A 份额、证券 B 份额的总额）。

申万证券份额的基金份额净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。T 日的申万证券份额的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

### 八、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常运作。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。
- 3、基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。
- 4、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可

能对基金业绩产生负面影响,从而损害现有基金份额持有人利益的情形。

5、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构的异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。

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者超过 50%,或者变相规避 50%集中度的情形时。

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接受申购申请。

9、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1、2、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。基金管理人及基金托管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,基金管理人应当在履行适当程序后,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。

#### 九、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时,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:

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。

3、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

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。

## 5、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时,基金管理人应在当日报中国证监会备案,已确认的赎回申请,基金管理人应足额支付;如暂时不能足额支付,应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人,未支付部分可延期支付。若出现上述第3项所述情形,按基金合同的相关条款处理。在暂停赎回的情况消除时,基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

## 十、巨额赎回的情形及处理方式

### 1、巨额赎回的认定

若申万证券份额单个开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一开放日的基金总份额(包括申万证券份额、证券A份额和证券B份额,下同)的10%,即认为是发生了巨额赎回。

### 2、巨额赎回的场外处理方式

当基金出现巨额赎回时,基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。

(1) 全额赎回:当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时,按正常赎回程序执行。

(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,基金管理人应当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,则基金管理人应当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。

### 3、巨额赎回的场内处理方式

巨额赎回的场内处理,按照深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。

### 4、暂停赎回

申万证券份额连续 2 个开放日以上(含 2 个开放日)发生巨额赎回,如基金管理人认为有必要,可暂停接受基金的赎回申请;已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项,但不得超过 20 个工作日,并应当在指定媒体上进行公告。

### 5、巨额赎回的公告

当发生巨额赎回并延期办理时,基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人,说明有关处理方法,同时在指定媒体上刊登公告。

## 十一、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1、发生上述暂停申购或赎回情况的,基金管理人当日应立即向中国证监会备案,并在规定期限内在指定媒体上刊登暂停公告。

2、如发生暂停的时间为 1 日,基金管理人应于重新开放日,在指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告,并公布最近 1 个工作日申万证券份额的基金份额净值。

3、如发生暂停的时间超过 1 日但少于 2 周,暂停结束,基金重新开放申购

或赎回时，基金管理人应依照《信息披露办法》的有关规定，在指定媒体刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个工作日申万证券份额的基金份额净值。

4、如发生暂停的时间超过 2 周（包括 2 周），暂停期间，基金管理人应每 2 周至少刊登暂停公告 1 次。暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应依照《信息披露办法》的有关规定，在指定媒体刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个工作日申万证券份额的基金份额净值。

## 十二、基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定决定开办申万证券份额与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。



## 第十一部分 基金的非交易过户、转托管、冻结与解冻

### 一、基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下,接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。

继承是指基金份额持有人死亡,其持有的基金份额由其合法的继承人继承;捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体;司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金登记机构要求提供的相关资料,对于符合条件的非交易过户申请按基金登记机构的规定办理,并按基金登记机构规定的标准收费。

### 二、基金的注册登记、系统内转托管和跨系统转托管

#### 1、基金份额的注册登记

(1) 本基金的基金份额采用分系统登记的原则。场外认购或申购的申万证券份额,登记在注册登记系统中基金份额持有人开放式基金账户下;场内认购、申购的申万证券份额,或上市交易的证券 A 份额和证券 B 份额,登记在证券登记结算系统基金份额持有人深圳证券账户下。

(2) 登记在证券登记结算系统中的申万证券份额,可以直接申请场内赎回,不在深圳证券交易所上市交易,但可经基金份额持有人申请,按 1:1 的份额配比分拆为证券 A 份额和证券 B 份额后,在深圳证券交易所上市。

(3) 登记在证券登记结算系统中的证券 A 份额和证券 B 份额在深圳证券交易所上市交易,不能直接申请场内赎回,但可按 1:1 的份额配比申请合并为申万证券份额的场内份额后,再申请场内赎回。

(4) 登记在注册登记系统中的申万证券份额,既可以直接申请场外赎回,也可以在办理跨系统转托管后,转至证券登记结算系统,由基金份额持有人申请,按 1:1 的份额配比分拆为证券 A 份额和证券 B 份额,在深圳证券交易所上市。

#### 2、系统内转托管

(1) 系统内转托管是指基金份额持有人将持有的申万证券份额在注册登记系统内不同销售机构(网点)之间或证券登记结算系统内不同会员单位(交易单元)之间进行转登记的行为。

(2) 基金份额登记在注册登记系统的基金份额持有人在变更办理申万证券份额赎回业务的销售机构(网点)时,需办理已持有申万证券份额的系统内转托管。

(3) 基金份额登记在证券登记结算系统的基金份额持有人在变更办理申万证券份额场内赎回的会员单位(交易单元)、或变更办理证券 A 份额和证券 B 份额上市交易的会员单位(交易单元)时,需办理已持有基金份额的系统内转托管。

### 3、跨系统转托管

(1) 跨系统转托管是指基金份额持有人将持有的申万证券份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转托管的行为。

(2) 本基金跨系统转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。

基金销售机构可以按照相关规定向基金份额持有人收取转托管费。

### 三、定期定额投资计划

基金管理人可以为投资人办理定期定额投资计划,具体规则由基金管理人另行规定。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额,每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

### 四、基金份额的冻结和解冻

基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻,以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。

## 第十二部分 基金的份额配对转换

本基金基金合同生效后,基金管理人将为基金份额持有人办理份额配对转换业务。

一、份额配对转换是指本基金的申万证券份额与证券 A 份额、证券 B 份额之间的配对转换,包括分拆和合并两个方面。

1、分拆。基金份额持有人将其持有的每两份申万证券份额的场内份额申请转换成一份证券 A 份额与一份证券 B 份额的行为。

2、合并。基金份额持有人将其持有的每一份证券 A 份额与一份证券 B 份额进行配对申请转换成两份申万证券份额的场内份额的行为。

### 二、份额配对转换的业务办理机构

份额配对转换的业务办理机构见招募说明书或基金管理人届时发布的相关公告。

投资人应当在份额配对转换业务办理机构的营业场所或按其提供的其他方式办理份额配对转换。深圳证券交易所、基金登记机构或基金管理人可根据情况变更或增减份额配对转换的业务办理机构,并予以公告。

### 三、份额配对转换的业务办理时间

份额配对转换自证券 A 份额、证券 B 份额上市交易后不超过 3 个月的时间内开始办理,基金管理人应在开始办理份额配对转换的具体日期前 2 个工作日在指定媒体公告。

份额配对转换的业务办理日为深圳证券交易所交易日(基金管理人公告暂停份额配对转换时除外),具体的业务办理时间见招募说明书或基金管理人届时发布的相关公告。

若深圳证券交易所交易时间更改或实际情况需要,基金管理人可对份额配对转换业务的办理时间进行调整并公告。

### 四、份额配对转换的原则

1、份额配对转换以份额申请。

2、申请进行“分拆”的申万证券份额的场内份额必须是偶数。

3、申请进行“合并”的证券 A 份额与证券 B 份额必须同时配对申请,且基金

份额数必须同为整数且相等。

4、申万证券份额的场外份额如需申请进行“分拆”，须跨系统转托管为申万证券份额的场内份额后方可进行。

5、份额配对转换应遵循届时相关机构发布的相关业务规则。

深圳证券交易所、基金登记机构或基金管理人可视情况对上述规定作出调整，并在正式实施前 2 个工作日在指定媒体公告。

#### 五、份额配对转换的程序

份额配对转换的程序遵循届时相关机构发布的最新业务规则，具体见相关业务公告。

#### 六、暂停份额配对转换的情形

1、基金管理人根据本基金届时投资运作、交易的实际情形可决定是否暂停接受配对转换；

2、深圳证券交易所、登记机构、份额配对转换业务办理机构因异常情况无法办理份额配对转换业务。

3、法律法规、深圳证券交易所规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生前述情形之一且基金管理人决定暂停份额配对转换的，基金管理人应当在指定媒体刊登暂停份额配对转换业务的公告。

在暂停份额配对转换的情况消除时，基金管理人应及时恢复份额配对转换业务的办理，并依照有关规定在指定媒体公告。

#### 七、份额配对转换的业务办理费用

份额配对转换业务办理机构可对转换业务的办理酌情收取一定的佣金，具体见相关业务公告。

八、深圳证券交易所、基金登记机构调整上述规则，本基金合同将相应予以修改，且此项修改无需召开基金份额持有人大会审议。

## 第十三部分 基金的投资

### 一、投资目标

本基金采取指数化投资方式,通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%,年跟踪误差不超过 4%,实现对中证申万证券行业指数的有效跟踪。

### 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。

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,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、存出保证金及应收申购款等。

### 三、投资策略

#### 1、股票投资策略

本基金主要采用完全复制的方法进行投资,即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。

在标的指数成份股发生变动、增发、配股、分红等公司行为导致成份股的构成及权重发生变化时,由于交易成本、交易制度、个别成份股停牌或者流动性不足等原因导致本基金无法及时完成投资组合同步调整的情况下,基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合,追求尽可能贴近标的指数的表现。

#### (1) 组合构建策略

本管理人构建投资组合的过程主要分为三步：确定目标组合、确定建仓策略和逐步调整。

1) 确定目标组合：本基金管理人根据完全复制成份股权重的方法确定目标组合。

2) 确定建仓策略：本基金管理人根据对成份股流动性的分析，确定合理的建仓策略。

3) 逐步调整：通过完全复制法最终确定目标组合之后，本基金管理人在规定时间内采用适当的手段调整实际组合直至达到跟踪标的指数的要求。

## (2) 组合管理策略

### 1) 定期调整

本基金股票组合根据标的指数对其成份股的定期调整而进行相应的定期跟踪调整。

### 2) 不定期调整

①当成份股发生增发、送配等情况而影响成份股在指数中权重的行为时，本基金将根据指数公司的公告，进行相应调整；

②根据本基金的申购和赎回情况，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数；

③若个别成份股因停牌、流动性不足或法规限制等因素，使得基金管理人无法按照其所占标的指数权重进行购买时，基金管理人将综合考虑跟踪误差最小化和投资者利益，决定部分持有现金或买入相关的替代性组合。

## 2、股指期货投资策略

本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资。本基金投资股指期货将主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

## 四、投资限制

### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

(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，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等；

(3) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%，基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的10%。法律法规或中国证监会另有规定的，遵从其规定；

(4) 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，不得超过基金资产净值的10%；

(5) 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%；

(6) 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%；

(7) 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%；

(8) 本基金应投资于信用级别评级为BBB以上（含BBB）的资产支持证券。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；

(9) 本基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(10) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%；

(11) 本基金参与股指期货交易依据下列标准建构组合：

1) 在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的10%；

2) 在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的100%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年

以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;

3) 在任何交易日日终,持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%;

4) 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)应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定;

5) 在任何交易日内交易(不包括平仓)的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%;

(12) 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%,但符合中国证监会规定的标的指数成分股投资不计入受此限;

(13) 本基金持有一家上市公司的股票,其市值不超过基金资产净值的 10%,但符合中国证监会规定的标的指数成分股投资不计入受此限;

(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;

(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;

(17) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他投资限制。

除上述第(2)、(8)、(15)、(16)项外,因证券市场、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。法律法规另有规定的从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符



合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

如果法律法规对基金合同约定投资组合比例限制进行变更的,以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:

- (1) 承销证券;
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保;
- (3) 从事承担无限责任的投资;
- (4) 买卖其他基金份额,但是中国证监会另有规定的除外;
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资;
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;
- (7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券,或者从事其他重大关联交易的,应当遵循基金份额持有人利益优先的原则,防范利益冲突,符合国务院证券监督管理机构的规定,并履行信息披露义务。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定,在履行适当程序后,本基金可不受上述规定的限制。

## 五、业绩比较基准

业绩比较基准为:  $95\% \times \text{中证申万证券行业指数收益率} + 5\% \times \text{银行同业存款利率}$ 。

本基金以中证申万证券行业指数为标的指数,原则上将不低于 80% 的非现金基金资产投资于标的指数成份股和备选成份股,不低于 5% 的资产投资于现金类资产,业内现金类资产收益率主要以银行同业存款利率为基准,故选用以上业绩比较基准可以有效评估本基金投资组合业绩,反映本基金的风格特点。

如果中证申万证券行业指数被停止编制或发布,或由其他指数替代(单纯更名除外),或由于指数编制方法等重大变更导致该指数不宜继续作为本基金的目

标指数,或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时,基金管理人可以依据审慎原则,在充分考虑基金份额持有人利益及履行适当程序的前提下,更换本基金的标的指数、业绩比较基准和投资对象,并依据市场代表性、流动性、与原标的指数的相关性等诸多因素选择确定新的标的指数,而无需召开基金份额持有人大会,基金管理人应与基金托管人协商一致后,报中国证监会备案并及时公告。

## 六、风险收益特征

本基金虽为股票型指数基金,但由于采取了基金份额分级的结构设计,不同的基金份额具有不同的风险收益特征。申万证券份额为常规指数基金份额,具有预期风险较高、预期收益较高的特征,其预期风险和预期收益水平均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金;证券A份额,则具有预期风险低,预期收益低的特征;证券B份额由于利用杠杆投资,则具有预期风险高、预期收益高的特征。

## 七、基金管理人代表基金行使股东权利和债权人权利的处理原则及方法

- 1、有利于基金资产的安全与增值;
- 2、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利和债权人权利,保护基金份额持有人的利益。

## 八、基金的融资、融券

本基金可以根据届时有效的有关法律法规的规定进行融资、融券。

## 九、基金投资组合报告

本投资组合报告所载数据截止日为2018年12月31日,本报告中所列财务数据未经审计。

### 1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目     | 金额(元)            | 占基金总资产的比例(%) |
|----|--------|------------------|--------------|
| 1  | 权益投资   | 2,496,939,690.30 | 92.54        |
|    | 其中:股票  | 2,496,939,690.30 | 92.54        |
| 2  | 固定收益投资 | —                | —            |
|    | 其中:债券  | —                | —            |

|   |                   |                  |        |
|---|-------------------|------------------|--------|
|   | 资产支持证券            | -                | -      |
| 3 | 贵金属投资             | -                | -      |
| 4 | 金融衍生品投资           | -                | -      |
| 5 | 买入返售金融资产          | -                | -      |
|   | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -                | -      |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计      | 199,988,781.20   | 7.41   |
| 7 | 其他各项资产            | 1,439,847.34     | 0.05   |
| 8 | 合计                | 2,698,368,318.84 | 100.00 |

注：本基金未开通港股通交易机制投资于港股。

## 2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|------------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -                | -            |
| B  | 采矿业              | -                | -            |
| C  | 制造业              | 66,039.50        | 0.00         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -                | -            |
| E  | 建筑业              | -                | -            |
| F  | 批发和零售业           | -                | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -                | -            |
| H  | 住宿和餐饮业           | -                | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | -                | -            |
| J  | 金融业              | 2,496,873,650.80 | 93.18        |
| K  | 房地产业             | -                | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | -                | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -                | -            |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | -                | -            |

|   |               |                  |       |
|---|---------------|------------------|-------|
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | -                | -     |
| P | 教育            | -                | -     |
| Q | 卫生和社会工作       | -                | -     |
| R | 文化、体育和娱乐业     | -                | -     |
| S | 综合            | -                | -     |
|   | 合计            | 2,496,939,690.30 | 93.18 |

## 2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金未开通港股通交易机制投资于港股。

## 3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)         | 公允价值(元)        | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------------|----------------|--------------|
| 1  | 600030 | 中信证券 | 26,594,596.00 | 425,779,481.96 | 15.89        |
| 2  | 600837 | 海通证券 | 27,342,209.00 | 240,611,439.20 | 8.98         |
| 3  | 601211 | 国泰君安 | 15,228,742.00 | 233,304,327.44 | 8.71         |
| 4  | 601688 | 华泰证券 | 11,036,189.00 | 178,786,261.80 | 6.67         |
| 5  | 600999 | 招商证券 | 9,656,231.00  | 129,393,495.40 | 4.83         |
| 6  | 000776 | 广发证券 | 10,000,328.00 | 126,804,159.04 | 4.73         |
| 7  | 600958 | 东方证券 | 12,096,208.00 | 96,406,777.76  | 3.60         |
| 8  | 000166 | 申万宏源 | 22,843,861.00 | 92,974,514.27  | 3.47         |
| 9  | 601901 | 方正证券 | 13,907,642.00 | 73,849,579.02  | 2.76         |
| 10 | 601377 | 兴业证券 | 15,839,073.00 | 73,493,298.72  | 2.74         |

## 4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

## 5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

## 6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

### 9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

## 10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同，本基金不得参与国债期货交易。

### 10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据本基金基金合同，本基金不得参与国债期货交易。

### 10.3 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同，本基金不得参与国债期货交易。

## 11 投资组合报告附注

11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查的情形。本基金投资的前十名证券的发行主体除方正证券(601901.SH)外，在报告编制日前一年内没有受到公开谴责和处罚的情形。

上海证券交易所于2018年3月26日发布了“关于对方正证券股份有限公司及其控股股东、控股股东关联方和有关责任人予以纪律处分的决定”。经查明，就公司控股股东方正集团和相关关联方隐瞒关联关系，公司控股股东方正集团未及时告知公司签署补充协议的相关情况，方正证券均未履行信息披露义务，上海证券交易所为此对公司予以公开谴责。

方正证券为本基金的业绩基准“中证申万证券行业指数”的成份股，因为本基金为采用完全复制方式被动跟踪标的指数的基金产品，所以方正证券受到上海证券交易所公开谴责的情形不会影响本基金的投资决策。

11.2 基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)        |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 584,899.42   |
| 2  | 应收证券清算款 | 40,167.49    |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 44,635.12    |
| 5  | 应收申购款   | 770,145.31   |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 1,439,847.34 |

#### 11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------|
| 1  | 600030 | 中信证券 | 425,779,481.96 | 15.89        | 重大事项     |

### 十、基金的业绩

本基金的过往业绩不代表未来表现。

#### 1、净值增长率与业绩比较基准收益率比较:

| 阶段                         | 基金份额净值增长率① | 基金份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③     | ②-④    |
|----------------------------|------------|---------------|------------|---------------|---------|--------|
| 自基金合同生效起至 2014 年 12 月 31 日 | 158.97%    | 2.29%         | 187.36%    | 2.41%         | -28.39% | -0.12% |
| 2015 年                     | -29.75%    | 3.42%         | -24.20%    | 3.52%         | -5.55%  | -0.10% |
| 2016 年                     | -16.97%    | 2.09%         | -17.24%    | 2.13%         | 0.27%   | -0.04% |

|                            |         |       |         |       |         |        |
|----------------------------|---------|-------|---------|-------|---------|--------|
| 2017 年                     | -11.08% | 0.99% | -11.55% | 1.02% | 0.47%   | -0.03% |
| 2018 年                     | -23.55% | 1.76% | -24.68% | 1.81% | 1.13%   | -0.05% |
| 自基金合同生效起至 2018 年 12 月 31 日 | 2.69%   | 2.26% | 20.09%  | 2.33% | -17.40% | -0.07% |

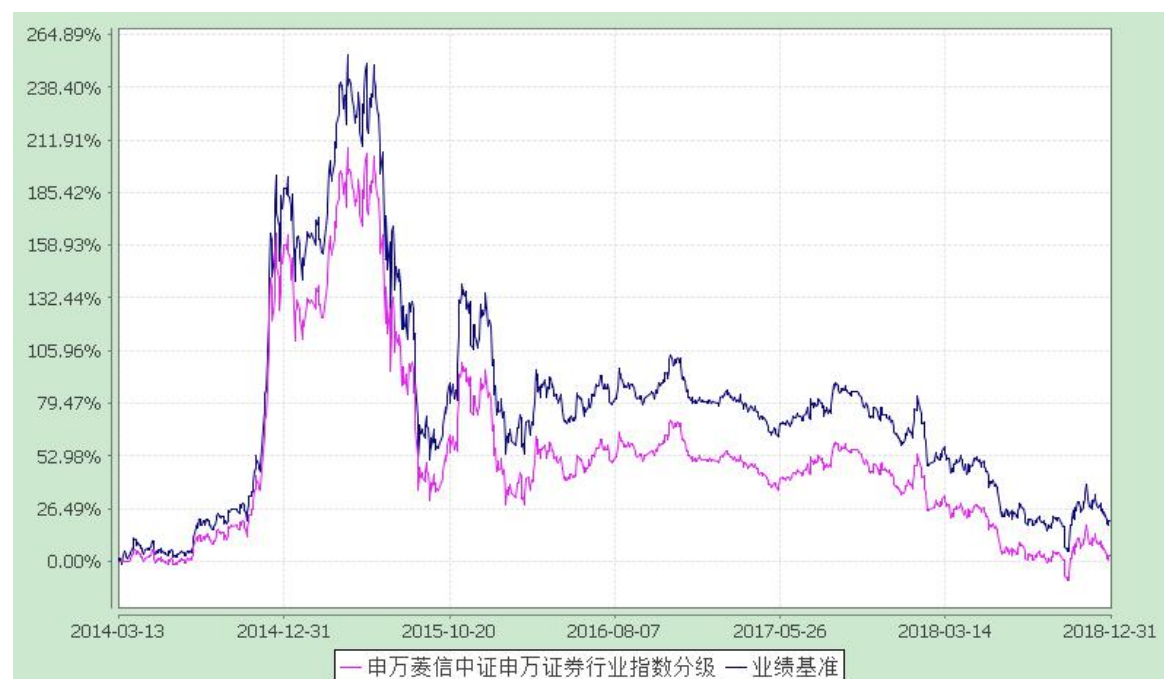
注：上述基金业绩指标已扣除了基金的管理费、托管费和各项交易费用，但不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：申购费、赎回费等），计入认购或交易基金的各项费用后，实际收益水平要低于所列数字。

## 2、自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2014 年 3 月 13 日至 2018 年 12 月 31 日）



## 第十四部分 基金的财产

### 一、基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。

### 二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### 三、基金财产的账户

基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户、期货账户以及投资所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

### 四、基金财产的保管和处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人、基金登记机构和基金销售机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依法律法规和基金合同的规定处分外，基金财产不得被处分。

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵销；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵销。



## 第十五部分 基金资产估值

### 一、估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。

### 二、估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、股指期货合约、其它投资等资产及负债。

### 三、估值方法

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

(1) 交易所上市的有价证券(包括股票、权证等), 以其估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值; 估值日无交易的, 且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的, 以最近交易日的市价(收盘价)估值; 如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的, 可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素, 调整最近交易市价, 确定公允价格;

(2) 交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值, 估值日没有交易的, 且最近交易日后经济环境未发生重大变化, 按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的, 可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素, 调整最近交易市价, 确定公允价格;

(3) 交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值; 估值日没有交易的, 且最近交易日后经济环境未发生重大变化, 按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的, 可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素, 调整最近交易市价, 确定公允价格;

(4) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券, 采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券, 采用估值技术确定公允价值, 在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下, 按成本估值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

(2) 首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

4、停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

5、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

6、股指期货合约的估值：

(1) 股指期货合约按估值日中国金融期货交易所提供的结算价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的结算价估值；

(2) 股指期货合约在估值日无交易的，且最近交易日后经济环境发生重大变化，则采用估值模型确定公允价值。

7、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

8、基金管理人在履行适当程序后，当申万证券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。

9、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知

对方,共同查明原因,双方协商解决。

根据有关法律法规,基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任,因此,就与本基金有关的会计问题,如经相关各方在平等基础上充分讨论后,仍无法达成一致的意见,按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

#### 四、估值程序

1、申万证券份额的基金份额净值、证券 A 份额、证券 B 份额的基金份额参考净值的计算精确到 0.0001 元,小数点后第 5 位四舍五入。国家另有规定的,从其规定。

基金管理人每个工作日计算基金资产净值及申万证券份额的基金份额净值、证券 A 份额和证券 B 份额的基金份额参考净值,并按规定公告。

2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后,将申万证券份额的基金份额净值、证券 A 份额和证券 B 份额的基金份额参考净值结果发送基金托管人,经基金托管人复核无误后,由基金管理人对外公布。

#### 五、估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当申万证券份额的基金份额净值、证券 A 份额和证券 B 份额的基金份额参考净值小数点后 4 位以内(含第 4 位)发生估值错误时,视为基金份额净值错误。

基金合同的当事人应按照以下约定处理:

##### 1、估值错误类型

本基金运作过程中,如果由于基金管理人或基金托管人、或登记机构、或销售机构、或投资人自身的过错造成估值错误,导致其他当事人遭受损失的,过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人(“受损方”)的直接损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿,承担赔偿责任。

上述估值错误的主要类型包括但不限于:资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等。

##### 2、估值错误处理原则

(1) 估值错误已发生, 但尚未给当事人造成损失时, 估值错误责任方应及时协调各方, 及时进行更正, 因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担; 由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误, 给当事人造成损失的, 由估值错误责任方对直接损失承担赔偿责任; 若估值错误责任方已经积极协调, 并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正, 则其应当承担相应赔偿责任。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认, 确保估值错误已得到更正。

(2) 估值错误的责任方对有关当事人的直接损失负责, 不对间接损失负责, 并且仅对估值错误的有关直接当事人负责, 不对第三方负责。

(3) 因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失(“受损方”), 则估值错误责任方应赔偿受损方的损失, 并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利; 如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方, 则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给估值错误责任方。

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后, 有关的当事人应当及时进行处理, 处理的程序如下:

(1) 查明估值错误发生的原因, 列明所有的当事人, 并根据估值错误发生的原因确定估值错误的责任方;

(2) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法对因估值错误造成的损失进行评估;

(3) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法由估值错误的责任方进行更正和赔偿损失;

(4) 根据估值错误处理的方法, 需要修改基金登记机构交易数据的, 由基金登记机构进行更正, 并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。

### 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下:

(1) 基金份额净值计算出现错误时, 基金管理人应当立即予以纠正, 通报

基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

(2) 错误偏差达到或超过申万证券份额的基金份额净值、证券 A 份额与证券 B 份额的基金份额参考净值的 0.25% 时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到申万证券份额的基金份额净值、证券 A 份额与证券 B 份额的基金份额参考净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告。

(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

## 六、暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券交易市场、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

3、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障基金份额持有人的利益，决定延迟估值；

4、如果出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况，会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的；

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；

6、法律法规规定、中国证监会或基金合同认定的其它情形。

## 七、基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和申万证券份额的基金份额净值、证券 A 份额与证券 B 份额的基金份额参考净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值和申万证券份额的基金份额净值、证券 A 份额与证券 B 份额的基金份额参考净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。

## 八、特殊情形的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 7 项进行估值时，所造成的误差不得作为基金资产估值错误处理。

2、由于不可抗力原因，或由于证券交易所、期货交易所及登记结算公司发

送的数据错误等，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任，但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

## 第十六部分 基金的收益与分配

### 一、基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

### 二、基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

### 三、基金收益分配原则

本基金（包括申万证券份额、证券 A 份额、证券 B 份额）不进行收益分配。

在申万证券份额、证券 A 份额、证券 B 份额的运作期间内，如果法律法规或监管部门取消有关限制，则基金管理人本着维护基金份额持有人利益的原则，在履行适当程序后，可以对上述收益分配原则进行修改，且此项修改无需召开基金份额持有人大会。

经基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会备案后，如果终止证券 A 份额、证券 B 份额的运作，本基金将根据基金份额持有人大会决议调整基金的收益分配原则。具体见基金管理人届时发布的相关公告。

## 第十七部分 基金费用与税收

### 一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、标的指数许可使用费；
- 4、基金上市费用及年费；
- 5、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
- 6、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 7、基金份额持有人大会费用；
- 8、基金的证券、期货交易费用或结算而产生的费用；
- 9、基金的银行汇划费用；
- 10、账户开户费用和账户维护费；
- 11、按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

### 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.00% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费自基金合同生效次日起每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.22% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.22\% \div \text{当年天数}$$



H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费自基金合同生效次日起每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

### 3、基金合同生效后标的指数许可使用费

本基金作为指数基金,需根据与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定向中证指数有限公司的指定账户支付指数许可使用基点费。通常情况下,指数许可使用基点费按前一日的基金资产净值的万分之二(贰个基点)的年费率计提。计算方法如下:

$$H=E \times \text{年费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应付的指数许可使用基点费

E 为前一日的基金资产净值

基金合同生效后的指数许可使用基点费每日计算,逐日累计,按季支付。标的指数许可使用基点费的收取下限为每季人民币 50,000 元,计费区间不足一季度的,根据实际天数按比例计算。由基金管理人向基金托管人发送基金标的指数许可使用基点费划付指令,经基金托管人复核后于每一季度结束后的 10 个工作日内将上季度标的指数许可使用基点费,按照指数使用许可协议的约定进行支付。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

如果指数使用许可协议约定的指数许可使用基点费的计算方法、费率和支付方式等发生调整,本基金将采用调整后的方法或费率计算指数许可使用基点费。基金管理人将在招募说明书更新或其他公告中披露基金最新适用的方法。

除管理费、托管费、标的指数许可使用基点费之外的前述第一款约定的其他费用由基金管理人 and 基金托管人根据有关法规及相应协议的规定,列入基金费用。

### 三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或

基金财产的损失；

- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、基金合同生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

#### 四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 第十八部分 基金份额折算

### 一、定期份额折算

在证券 A 份额与证券 B 份额存续期内每个运作周年的结束日,本基金将按照以下规则进行基金的定期份额折算。

#### 1、基金份额折算基准日

每个运作周年的结束日。

#### 2、基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的证券 A 份额、申万证券份额。

#### 3、基金份额折算频率

每个运作周年折算一次。

#### 4、基金份额折算方式

证券 A 份额和证券 B 份额按照基金合同规定的基金份额参考净值计算规则进行基金份额参考净值计算,对证券 A 份额的基准收益进行定期份额折算,每两份申万证券份额将按一份证券 A 份额获得基准收益的新增折算份额。

在每个运作周年,将证券 A 份额上一个运作周年结束日的基金份额参考净值超出本金 1.0000 元部分,折算为场内申万证券份额分配给证券 A 份额持有人。申万证券份额持有人持有的每两份申万证券份额将按一份证券 A 份额获得新增申万证券份额的分配。持有场外申万证券份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外申万证券份额的分配;持有场内申万证券份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内申万证券份额的分配。经过上述份额折算,证券 A 份额的基金份额参考净值和申万证券份额的基金份额净值将相应调整。有关计算公式如下:

#### (1) 证券 A 份额

$$NUM(A)^{\text{后}} = NUM(A)^{\text{前}}$$

$$NAV^{\text{后}} = NAV^{\text{前}} - 0.5 \times (NAV(A)^{\text{前}} - 1.0000)$$

证券 A 份额持有人新增的场内申万证券份额的份额数=

$$\frac{NUM(A)^{\text{前}} \times (NAV(A)^{\text{前}} - 1.0000)}{NAV^{\text{后}}}$$

其中：

$NUM(A)^{\text{前}}$ ：定期份额折算前证券 A 份额的基金份额数；

$NUM(A)^{\text{后}}$ ：定期份额折算后证券 A 份额的基金份额数；

$NAV(A)^{\text{前}}$ ：定期份额折算前证券 A 份额的基金份额参考净值，即折算基准日证券 A 份额的基金份额参考净值；

$NAV^{\text{前}}$ ：定期份额折算前申万证券份额的基金份额净值，即折算基准日申万证券份额的基金份额净值；

$NAV^{\text{后}}$ ：定期份额折算后申万证券份额的基金份额净值。

证券 A 份额新增份额折算成申万证券份额的场内份额取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

## （2）证券 B 份额

每次定期份额折算不改变证券 B 份额的基金份额参考净值及其基金份额数。

## （3）申万证券份额

$$NAV^{\text{后}} = NAV^{\text{前}} - 0.5 \times (NAV(A)^{\text{前}} - 1.0000)$$

原申万证券份额持有人新增的申万证券份额的份额数=

$$\frac{0.5 \times NUM^{\text{前}} \times (NAV(A)^{\text{前}} - 1.0000)}{NAV^{\text{后}}}$$

定期份额折算后原申万证券份额持有人持有的申万证券份额的份额数 =

$$NUM^{\text{前}} + \text{原申万证券份额持有人新增的申万证券份额的份额数}$$

其中：

$NAV^{\text{后}}$ ：定期份额折算后申万证券份额的基金份额净值；

$NAV^{\text{前}}$ ：定期份额折算前申万证券份额的基金份额净值，即折算基准日申万证券份额的基金份额净值；

$NAV(A)^{\text{前}}$ ：定期份额折算前证券 A 份额的基金份额参考净值，即折算基准日证券 A 份额的基金份额参考净值；

$NUM^{\text{前}}$ ：定期份额折算前申万证券份额的份额数。

申万证券份额的场外份额经折算后的份额数采用截位法保留到小数点后 2 位,由此误差产生的收益或损失计入基金财产;申万证券份额的场内份额经折算后的份额数取整计算(最小单位为 1 份),余额计入基金财产。

在实施基金份额折算时,折算日折算前申万证券份额的基金份额净值、证券 A 份额参考净值等具体见基金管理人届时发布的相关公告。

#### 5、基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作,基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停证券 A 份额与证券 B 份额的上市交易和申万证券份额的申购或赎回等相关业务,具体见基金管理人届时发布的相关公告。

#### 6、基金份额折算结果的公告

基金份额折算结束后,基金管理人应按照《信息披露办法》在指定媒体公告,并报中国证监会备案。

### 二、不定期折算

除以上的定期份额折算外,在以下两种情况下也会进行不定期份额折算,即:当申万证券份额的基金份额净值大于或等于 1.5000 元时;当证券 B 份额的基金份额参考净值达到或跌破 0.2500 元时。

1、当申万证券份额的基金份额净值大于或等于 1.5000 元时,本基金将按照以下规则进行份额折算。

#### (1) 基金份额折算基准日

当申万证券份额的基金份额净值大于或等于 1.5000 元时,基金管理人即应确定折算基准日。

#### (2) 基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的申万证券份额与证券 B 份额。

#### (3) 基金份额折算频率

不定期。

#### (4) 基金份额折算方式

当申万证券份额的基金份额净值大于或等于 1.5000 元时,证券 B 份额和申万证券份额按照如下公式进行份额折算:

## 1) 证券 A 份额

此类不定期份额折算不改变证券 A 份额的基金份额参考净值及其份额数。

## 2) 证券 B 份额

份额折算原则：

①份额折算后证券 B 份额与证券 A 份额的份额数保持 1:1 配比；

②将证券 B 份额的基金份额参考净值超过证券 A 份额的基金份额参考净值的部分，折算成场内的申万证券份额；

③份额折算后申万证券份额的基金份额净值、证券 B 份额的基金份额参考净值与折算基准日证券 A 份额的基金份额参考净值三者相等；

④份额折算前证券 B 份额的持有人在份额折算后将持有证券 B 份额与新增场内申万证券份额。

$$NUM(B)^{\text{后}} = NUM(B)^{\text{前}}$$

$$NAV(B)^{\text{后}} = NAV(A)^{\text{前}}$$

$$NAV^{\text{后}} = NAV(A)^{\text{前}}$$

证券 B 份额持有人新增的场内申万证券份额的份额数=

$$\frac{NUM(B)^{\text{前}} \times (NAV(B)^{\text{前}} - NAV(A)^{\text{前}})}{NAV^{\text{后}}}$$

其中：

$NUM(B)^{\text{前}}$ ：份额折算前证券 B 份额的基金份额数；

$NUM(B)^{\text{后}}$ ：份额折算后证券 B 份额的基金份额数；

$NAV(A)^{\text{前}}$ ：份额折算前证券 A 份额的基金份额参考净值，即折算基准日证券 A 份额的基金份额参考净值；

$NAV(A)^{\text{后}}$ ：份额折算后证券 A 份额的基金份额参考净值；

$NAV(B)^{\text{前}}$ ：份额折算前证券 B 份额的基金份额参考净值，即折算基准日证券 B 份额的基金份额参考净值；

$NAV(B)^{\text{后}}$ ：份额折算后证券 B 份额的基金份额参考净值；

$NAV^{\text{后}}$ ：份额折算后申万证券份额的基金份额净值；

经折算后证券 B 份额持有人新增的场内申万证券份额的份额数取整计算(最小单位为 1 份)，余额计入基金财产。

### 3) 申万证券份额

场外申万证券份额持有人份额折算后获得新增场外申万证券份额，场内申万证券份额持有人份额折算后获得新增场内申万证券份额。

$$NAV^{\text{后}} = NAV(A)^{\text{前}}$$

$$NUM^{\text{后}} = \frac{NAV^{\text{前}} \times NUM^{\text{前}}}{NAV^{\text{后}}}$$

其中：

$NUM^{\text{前}}$ ：份额折算前原申万证券份额持有人持有的申万证券份额的基金份额数；

$NUM^{\text{后}}$ ：份额折算后原申万证券份额持有人持有的申万证券份额的基金份额数；

$NAV^{\text{前}}$ ：份额折算前申万证券份额的基金份额净值，即折算基准日申万证券份额的基金份额净值；

$NAV^{\text{后}}$ ：份额折算后申万证券份额的基金份额净值；

申万证券份额的场外份额经折算后的份额数采用截位法保留到小数点后 2 位，由此误差产生的收益或损失计入基金财产；申万证券份额的场内份额经折算后的份额数取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

### (5) 基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停证券 A 份额与证券 B 份额的上市交易和申万证券份额的申购或赎回等相关业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

### (6) 基金份额折算结果的公告

基金份额折算结束后，基金管理人应按照《信息披露办法》在指定媒体公告，

并报中国证监会备案。

2、当证券 B 份额的基金份额参考净值达到或跌破 0.2500 元时，本基金将按照以下规则进行份额折算。

(1) 基金份额折算基准日

证券 B 份额的基金份额参考净值达到或跌破 0.2500 元时，基金管理人即可确定折算基准日。

(2) 基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的申万证券份额、证券 A 份额与证券 B 份额。

(3) 基金份额折算频率

不定期。

(4) 基金份额折算方式

当证券 B 份额的基金份额参考净值达到或跌破 0.2500 元后，本基金将分别对申万证券份额、证券 A 份额和证券 B 份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保证券 A 份额和证券 B 份额的份额数比例为 1:1，份额折算后申万证券份额的基金份额净值、证券 A 份额和证券 B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.0000 元。

当证券 B 份额的基金份额参考净值达到或跌破 0.2500 元后，证券 A 份额、证券 B 份额、申万证券份额三类份额按照如下公式进行份额折算。

1) 证券 B 份额

份额折算原则：

份额折算前证券 B 份额的资产与份额折算后证券 B 份额的资产相等。

$$NUM(B)^{\text{后}} = \frac{NAV(B)^{\text{前}} \times NUM(B)^{\text{前}}}{NAV(B)^{\text{后}}}$$

$$NAV(B)^{\text{后}} = 1.0000 \text{ 元}$$

其中：

$NAV(B)^{\text{后}}$ ：份额折算后证券 B 份额的基金份额参考净值；

$NAV(B)^{\text{前}}$ ：份额折算前证券 B 份额的基金份额参考净值，即折算基准日证券 B 份额的基金份额参考净值；



$NUM(B)^{\text{前}}$ ：份额折算前证券 B 份额的基金份额数；

$NUM(B)^{\text{后}}$ ：份额折算后证券 B 份额的基金份额数。

## 2) 证券 A 份额

份额折算原则：

①份额折算后证券 A 份额与证券 B 份额的份额数始终保持 1:1 配比；

②份额折算前证券 A 份额持有人的资产与份额折算后其持有的证券 A 份额的资产及其持有的新增场内申万证券份额的资产之和相等；

③份额折算前证券 A 份额的持有人在份额折算后将持有证券 A 份额与新增场内申万证券份额；

$$NUM(A)^{\text{后}} = NUM(B)^{\text{后}}$$

证券 A 份额持有人新增的场内申万证券份额的份额数=

$$\frac{NAV(A)^{\text{前}} \times NUM(A)^{\text{前}} - NUM(A)^{\text{后}} \times NAV(A)^{\text{后}}}{NAV^{\text{后}}}$$

$$NAV(A)^{\text{后}} = NAV^{\text{后}} = 1.0000 \text{元}$$

其中：

$NAV(A)^{\text{后}}$ ：份额折算后证券 A 份额的基金份额参考净值；

$NAV(A)^{\text{前}}$ ：份额折算前证券 A 份额的基金份额参考净值，即折算基准日证券 A 份额的基金份额参考净值；

$NAV^{\text{后}}$ ：份额折算后申万证券份额的基金份额净值；

$NUM(A)^{\text{后}}$ ：份额折算后证券 A 份额的基金份额数；

$NUM(A)^{\text{前}}$ ：份额折算前证券 A 份额的基金份额数。

## 3) 申万证券份额

份额折算原则：

折算前原申万证券份额持有人持有的申万证券份额的资产与折算后原申万证券份额持有人持有的申万证券份额的资产相等

$$NUM^{\text{后}} = \frac{NAV^{\text{前}} \times NUM^{\text{前}}}{NAV^{\text{后}}}$$

$$NAV^{\text{后}}=1.0000\text{元}$$

其中：

$NUM^{\text{前}}$ ：份额折算前原申万证券份额持有人持有的申万证券份额的基金份额数；

$NUM^{\text{后}}$ ：份额折算后原申万证券份额持有人持有的申万证券份额的基金份额数；

$NAV^{\text{后}}$ ：份额折算后申万证券份额的基金份额净值；

$NAV^{\text{前}}$ ：份额折算前申万证券份额的基金份额净值，即折算基准日申万证券份额的基金份额净值。

申万证券份额的场外份额经折算后的份额数采用截位法保留到小数点后 2 位，由此误差产生的收益或损失计入基金财产；申万证券份额的场内份额经折算后的份额数取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

#### （5）基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停证券 A 份额与证券 B 份额的上市交易和申万证券份额的申购或赎回等相关业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

#### （6）基金份额折算结果的公告

基金份额折算结束后，基金管理人应按照《信息披露办法》在指定媒体公告，并报中国证监会备案。

## 第十九部分 证券 A 份额与证券 B 份额的终止运作

经基金份额持有人大会决议通过, 证券 A 份额与证券 B 份额可申请终止运作。该基金份额持有人大会决议须经本基金所有份额以特别决议的形式表决通过, 即须经参加基金份额持有人大会的申万证券份额、证券 A 份额与证券 B 份额各自的基金份额持有人或其代理人所持该级基金份额表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方为有效。

证券 A 份额与证券 B 份额终止运作后, 除非基金份额持有人大会决议另有规定的, 证券 A 份额、证券 B 份额将全部转换成申万证券份额的场内份额。

### 一、份额转换基准日

证券 A 份额与证券 B 份额终止运作日(如该日为非工作日, 则顺延至下一个工作日)。

### 二、份额转换方式

在份额转换基准日日终, 证券 A 份额、证券 B 份额按照各自的基金份额参考净值, 以申万证券份额的基金份额净值为基准, 转换成申万证券份额的场内份额。

证券 A 份额(或证券 B 份额)基金份额持有人持有的转换后申万证券份额的场内份额取整计算(最小单位为 1 份), 余额计入基金财产。

份额转换计算公式:

证券 A 份额(或证券 B 份额)的转换比率 = 份额转换基准日证券 A 份额(或证券 B 份额)的基金份额参考净值 / 份额转换基准日申万证券份额的基金份额净值。

证券 A 份额(或证券 B 份额)基金份额持有人持有的转换后申万证券份额的场内份额 = 基金份额持有人持有的转换前证券 A 份额(或证券 B 份额)的份额数 × 证券 A 份额(或证券 B 份额)的转换比率。

### 三、份额转换后的基金运作

证券 A 份额与证券 B 份额全部转换为申万证券份额的场内份额后, 本基金仅余申万证券份额这一类基金份额。申万证券份额将上市交易, 并接受场外与场内申购和赎回。

#### 四、份额转换的公告

证券 A 份额与证券 B 份额进行份额转换结束后,基金管理人应在指定媒体公告,并报中国证监会备案。

## 第二十部分 基金的会计与审计

### 一、基金会计政策

1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；

2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果基金合同生效少于2个月，可以并入下一个会计年度披露；

3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；

4、会计制度执行国家有关会计制度；

5、本基金独立建账、独立核算；

6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；

7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

### 二、基金的年度审计

1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券从业资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。

2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。

3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需在2个工作日内在指定媒体公告并报中国证监会备案。

## 第二十一部分 基金的信息披露

一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定。

### 二、信息披露义务人

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。

本基金信息披露义务人按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的媒体披露，并保证基金投资者能够按照基金合同约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

三、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 2、对证券投资业绩进行预测；
- 3、违规承诺收益或者承担损失；
- 4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；
- 5、登载任何自然人、法人或者其他组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

四、本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

### 五、公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

#### （一）基金招募说明书、基金合同、基金托管协议

- 1、基金合同是界定基金合同当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额

持有人大会召开的规则及具体程序,说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件。

2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项,说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。基金合同生效后,基金管理人在每6个月结束之日起45日内,更新招募说明书并登载在网站上,将更新后的招募说明书摘要登载在指定媒体上;基金管理人在公告的15日前向主要办公场所所在地的中国证监会派出机构报送更新的招募说明书,并就有关更新内容提供书面说明。

3、基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。

基金募集申请经中国证监会注册后,基金管理人在基金份额发售的3个工作日前,将基金招募说明书、基金合同摘要登载在指定媒体上;基金管理人、基金托管人应当将基金合同、基金托管协议登载在网站上。

## (二) 基金份额发售公告

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告,并在披露招募说明书的当日登载于指定媒体上。

## (三) 基金合同生效公告

基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在指定媒体上登载基金合同生效公告。

## (四) 基金份额上市交易公告书

本基金相关基金份额获准在证券交易所上市交易的,基金管理人应当在其上市交易3个工作日前,将上市交易公告书登载在指定媒体上。

## (五) 基金资产净值、基金份额净值公告

基金合同生效后,在证券A份额、证券B份额上市交易前或者开始办理申万证券份额申购或者赎回前,基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和申万证券份额的基金份额净值、证券A份额与证券B份额的基金份额参考净值。

在证券A份额、证券B份额上市交易后或开始办理申万证券份额申购或者赎回后,基金管理人应当在每个开放日的次日,通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介,披露开放日的申万证券份额的基金份额净值和基金份额累计净值、

证券 A 份额与证券 B 份额各自的基金份额参考净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和申万证券份额的基金份额净值、证券 A 份额与证券 B 份额各自的基金份额参考净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、申万证券份额的基金份额净值和基金份额累计净值、证券 A 份额与证券 B 份额各自的基金份额参考净值登载在指定媒体上。

#### (六) 申万证券份额申购、赎回价格

基金管理人应当在基金合同、招募说明书等信息披露文件上载明申万证券份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

#### (七) 基金定期报告

基金定期报告由基金管理人按照法律法规和中国证监会颁布的有关证券投资基金信息披露内容与格式的相关文件的规定单独编制，由基金托管人按照法律法规的规定对相关内容进行复核。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

1、基金年度报告：基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定媒体上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。

2、基金半年度报告：基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定媒体上。

3、基金季度报告：基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定媒体上。

基金合同生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。

基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。

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

本基金发生重大事件,有关信息披露义务人应当在2日内编制临时报告书,予以公告,并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。

前款所称重大事件,是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件:

- 1、基金份额持有人大会的召开;
- 2、终止基金合同;
- 3、转换基金运作方式;
- 4、更换基金管理人、基金托管人;
- 5、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更;
- 6、基金管理人股东及其出资比例发生变更;
- 7、基金募集期延长;
- 8、基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动;
- 9、基金管理人的董事在一年内变更超过百分之五十;
- 10、基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过百分之三十;
- 11、涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼;
- 12、基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查;
- 13、基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚,基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚;
- 14、重大关联交易事项;
- 15、基金收益分配事项;

- 16、管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更;
- 17、基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五;
- 18、基金改聘会计师事务所;
- 19、变更基金销售机构;
- 20、更换基金登记机构;
- 21、申万证券份额开始办理申购、赎回;
- 22、申万证券份额申购、赎回费率及其收费方式发生变更;
- 23、本基金发生巨额赎回并延期支付;
- 24、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请;
- 25、本基金暂停接受申万证券份额申购、赎回申请
- 26、本基金暂停接受申万证券份额申购、赎回申请后重新接受申购、赎回申请;
- 27、本基金接受或暂停接受份额配对转换申请;
- 28、本基金暂停接受份额配对转换后恢复办理份额配对转换业务;
- 29、证券 A 份额与证券 B 份额终止运作;
- 30、证券 A 份额与证券 B 份额终止运作后证券 A 份额与证券 B 份额的份额转换;
- 31、证券 A 份额与证券 B 份额上市交易、停复牌、暂停上市、恢复上市或终止上市;
- 32、本基金实施基金份额折算;
- 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;
- 35、中国证监会规定的其他事项。

#### (九) 澄清公告

在基金合同存续期限内,任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动的,相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清,并将有关情况立即报告中国证监会。

#### (十) 基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项,应当依法报中国证监会备案,并予以公告。

(十一) 本基金投资股指期货的,在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露股指期货交易情况,包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等,并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。

(十二) 中国证监会规定的其他信息。

## 六、信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度,指定专人负责管理信息披露事务。

基金信息披露义务人公开披露基金信息,应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则的规定。

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和基金合同的约定,对基金管理人编制的基金资产净值、申万证券份额的基金份额净值、证券 A 份额与证券 B 份额的基金份额参考净值、申万证券份额的基金份额申购赎回价格、基金定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关基金信息进行复核、审查,并向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定媒体中选择披露信息的媒介。

基金管理人、基金托管人除依法在指定媒体上披露信息外,还可以根据需要在其他公共媒体披露信息,但是其他公共媒体不得早于指定媒体披露信息,并且,在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机构,应当制作工作底稿,并将相关档案至少保存到基金合同终止后 10 年。

## 七、信息披露文件的存放与查阅

招募说明书公布后,应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的住所,供公众查阅、复制。

基金定期报告公布后,应当分别置备于基金管理人和基金托管人的住所,以供公众查阅、复制。

## 第二十二部分 风险揭示

本基金面临的风险主要有：市场风险、流动性风险、政策风险、再投资风险、指数投资相关风险、基金运作的特有风险、信用风险、道德风险、营运风险、管理风险和其他风险。

### 一、市场风险

市场风险指金融工具或证券的价值对市场参数变化的敏感性，是基金资产运作中所不可避免地承受因市场任何波动而产生的风险，其中包括：

1、经济周期风险：市场的收益水平随经济运行的周期性变动而变动，基金所投资于上市公司股票的收益水平也会随之变化，从而产生风险；

2、利率风险：金融市场利率波动会导致证券市场价格和收益率的变动，直接影响基金所投资股票的价格和收益率，从而给基金的投资带来风险；

3、上市公司经营风险：如果基金所投资的上市公司经营不善，会导致其股票价格的下跌，或股息、红利减少，使基金投资收益下降，从而给基金的投资带来风险；

4、购买力风险：基金的收益主要通过现金的形式来分配，而现金可能因为通货膨胀影响而使购买力下降，从而使基金的实际投资收益下降。

5、期货市场波动风险：本基金可按照基金合同的约定投资股指期货。期货市场与现货市场不同，采取保证金交易，风险较现货市场更高。虽然本基金对股指期货的投资仅限于现金管理和套期保值等用途，在极端情况下，期货市场波动仍可能对基金资产造成不良影响。

### 二、流动性风险

流动性风险包括两类。一是指在市场中的投资操作由于市场的深度限制或由于市场剧烈波动而导致投资交易无法实现或不能以当前合理的价格实现，从而可能为基金带来投资损失的风险。二是指开放式基金由于申购赎回要求可能导致流动资金不足的风险。

#### 1. 本基金拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金的投资市场主要为证券交易所、全国银行间债券市场等流动性较好的规范型交易场所，主要投资对象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、债券等)。同时本基金为被动指数型基金,对中证申万证券行业投资指数进行有效跟踪。该指数选取归属于证券行业的股票构成中证申万证券行业指数成份股,指数成分股未有高集中度的特征。因此,本基金拟投资市场、行业及资产的流动性良好,流动性风险相对可控。

## 2. 基金申购、赎回安排

投资人具体请参见本招募说明书“第十部分 申万证券份额的申购与赎回”,详细了解本基金的申购以及赎回安排。

## 3. 巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

当基金出现巨额赎回情形时,为应对流动性风险,保障投资者得到公平对待,基金管理人可根据基金当时的资产组合状况决定全部赎回还是部分延期赎回;此外,基金管理人还可以在特定情形下暂停赎回。具体请参见本招募说明书“第十部分 申万证券份额的申购与赎回”中“十、巨额赎回的情形及处理方式”的相关内容。

## 4. 实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响

在确保投资者得到公平对待的前提下,可依照法律法规及基金合同的约定,综合运用各类流动性风险管理工具,对赎回申请等进行适度调整,作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施,包括但不限于:

### 1) 延期办理巨额赎回申请

具体请参见招募说明书“第十部分 申万证券份额的申购与赎回”中“十、巨额赎回的情形及处理方式”的相关内容。

### 2) 暂停接受赎回申请以及延缓支付赎回款项

具体请参见招募说明书“第十部分 申万证券份额的申购与赎回”中“九、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形”的相关内容。

### 3) 收取短期赎回费

具体请参见招募说明书“第十部分 申万证券份额的申购与赎回”中“六、申购费用与赎回费用”的相关内容。

### 4) 暂停基金估值

具体请参见招募说明书“第十五部分 基金资产估值”中“六、暂停估值的情形”。

### 5) 摆动定价

当基金发生大额申购或赎回情形时,基金管理人可采用摆动定价机制,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以及监管部门、自律规则规定。

当本基金出现上述情形时,本基金可能无法及时满足所有投资者的赎回申请,投资者收到赎回款项的时间也可能晚于预期或可能增加投资者赎回的成本。

## 三、政策风险

政策风险指政府各种经济和非经济政策的变化给公司所管理的基金资产带来的风险。政策风险包括:货币政策的变动、财政政策的波动、税收政策的变动、产业政策的变动、进出口政策的变动等政策的变动引发的市场价格变动,对公司所管理的基金资产带来的风险。

## 四、再投资风险

再投资获得的收益又被称做利息的利息,这一收益取决于再投资时的市场利率水平和再投资的策略。未来市场利率的变化可能会引起再投资收益的不确定性并可能影响到基金投资策略的顺利实施。

## 五、指数投资相关的风险

### 1、标的指数波动风险

标的指数成份股价格可能受政治因素、经济因素、上市公司经营情况、市场情绪等各种因素的影响而波动,导致指数波动,从而使跟踪标的指数的本基金收益水平发生变化。

### 2、基金投资组合收益率与标的指数收益率偏离的风险

以下因素可能导致基金投资组合收益率与标的指数收益率发生偏离:

- (1) 标的指数成份股的配股、增发、分红等公司行为;
- (2) 标的指数成份股的调整;
- (3) 基金买卖股票时产生的交易成本和交易冲击;
- (4) 申购、赎回因素带来的跟踪误差;
- (5) 新股市值配售、新股认购带来的跟踪误差;
- (6) 基金现金资产的拖累;
- (7) 基金的管理费和托管费带来的跟踪误差;

(8) 指数成份股停牌、摘牌, 成份股涨、跌停板等因素带来的偏差;

(9) 其他因素带来的偏差。

### 3、标的指数变更风险

尽管标的指数变更的可能性很小, 但根据基金合同规定, 如出现变更标的指数的情形, 本基金将变更标的指数。基于原标的指数的投资政策将会改变, 投资组合将随之调整, 本基金的收益风险特征将与新的标的指数保持一致, 投资者须承担此项调整带来的风险与成本。

## 六、分级结构运作的特有风险

本基金作为分级基金, 证券 A 份额与证券 B 份额的运作有别于普通的开放式基金与封闭式基金, 所以投资者投资于本基金还将面临以下特有风险:

### 1、上市交易的风险

本基金在基金合同生效后, 证券 A 份额和证券 B 份额在深圳证券交易所挂牌上市交易。由于上市期间可能因信息披露导致基金停牌, 投资人在停牌期间不能买卖基金, 产生风险; 同时, 可能发生因证券 A 份额与证券 B 份额的规模较小或交易量不足, 导致投资者不能迅速、低成本地变现或买入的风险; 另外, 当基金份额持有人将份额转向场外交易后导致场内的基金份额或持有人数不满足上市条件时, 本基金存在暂停上市或终止上市的可能。

### 2、证券 A 份额持有人的特有风险

如果约定年基准收益率发生调整, 那么证券 A 份额的约定收益率将出现变化, 证券 A 份额的持有人将面临证券 A 份额价格出现较大波动的风险。

### 3、证券 B 份额持有人的特有风险

由于证券 B 份额具有高杠杆特性, 呈现出预期风险高、预期收益高的特征。证券 B 份额的基金份额参考净值和价格变化一般与本基金所跟踪的中证申万证券行业指数走势密切相关。由于证券 B 份额具有杠杆属性, 在基金投资比例符合本基金基金合同要求的情况下, 其基金份额参考净值和价格的波动幅度一般要大于中证申万证券行业指数, 极端情况下单日净值波动幅度可能超过 40%, 投资风险较大。

证券 B 份额的净值杠杆不恒定, 一般随着证券 B 份额的基金份额参考净值增大而变小, 随着证券 B 份额基金份额参考净值降低而变大。极端情况下, 证

券 B 份额的杠杆可能超过 5 倍,如申万证券份额基金份额净值跌幅为 1%,证券 B 份额基金份额参考净值跌幅可能超过 5%。

#### 4、份额配对转换业务中存在的风险

本基金基金合同生效后,基金管理人将根据基金合同的约定办理申万证券份额与证券 A 份额、证券 B 份额之间的份额配对转换。一方面,份额配对转换业务的办理可能改变证券 A 份额与证券 B 份额的市场供求关系,从而可能影响基金份额的交易价格变化;另一方面,份额配对转换业务可能出现暂停办理的情形,投资者的份额配对转换申请也可能存在不能及时确认的风险。

#### 5、基金份额的折/溢价交易风险

证券 A 份额与证券 B 份额上市交易后,基金份额的交易价格与其基金份额参考净值之间可能发生偏离并出现折/溢价交易的风险。

对于证券 A 份额与证券 B 份额,尽管在份额配对转换机制下,一份证券 A 份额与一份证券 B 份额的市价总和将与两份申万证券份额的净值之间具有逼近的趋势,但受投资者预期、市场情绪、供求关系和价格涨跌幅限制等方面的影响,证券 A 份额、证券 B 份额市场价格可能会偏离其基金份额参考净值,交易时可能存在较高的折溢价。例如,对于证券 B 份额而言,在市场快速下跌时,证券 B 份额在杠杆作用下其基金份额参考净值会加速下跌,跌幅可能超过 10%(如 20%甚至更高),但因价格存在 10%涨跌幅限制,证券 B 份额交易价格与基金份额参考净值可能出现较大偏离,造成较高的溢价,投资者应特别注意高溢价买入所带来的风险。

此外,由于份额配对转换下套利机制的影响,证券 A 份额与证券 B 份额的交易价格可能会互相影响。

#### 6、份额折算风险

(1) 在基金份额折算过程中由于尾差处理而可能给投资者带来损失。

场外份额进行份额折算时计算结果采用截位法保留到小数点后两位,由此误差产生的收益或损失计入基金财产。场内份额进行份额折算时计算结果保留至整数位(最小单位为 1 份),余额计入基金财产。因此,在基金份额折算过程中由于尾差处理而可能给投资者带来损失。

(2) 份额折算后新增份额有可能面临无法赎回的风险。



新增份额可能面临无法赎回的风险是指从场内购买证券 A 份额或证券 B 份额的一部分投资者可能面临的风险。由于在二级市场可以做交易的证券公司并不全部具备中国证监会颁发的基金销售资格,而只有具备基金销售资格的证券公司才可以允许投资者赎回基金份额。因此,如果投资者通过不具备基金销售资格的证券公司购买证券 A 份额或证券 B 份额,在其参与份额折算后,则折算新增的申万证券份额并不能被赎回。此风险需要引起投资者注意,投资者可以选择在份额折算前将证券 A 份额或证券 B 份额卖出,或者将新增的申万证券份额通过转托管业务转入具有基金销售资格的证券公司后赎回基金份额。

(3) 不定期折算基准日基金份额净值/基金份额参考净值与折算阈值不同的风险。

根据基金合同的约定,本基金向上不定期折算将按照折算基准日申万证券份额基金份额净值进行,向下不定期折算将按照折算基准日证券 B 份额基金份额参考净值进行,因此如果折算基准日申万证券份额基金份额净值与向上折算阈值或者证券 B 份额基金份额参考净值与向下折算阈值有一定的差异,则对投资者利益可能会产生一定的影响。

## 7、风险收益特征变化风险

根据本基金份额折算的设计,本基金将进行定期份额折算和不定期份额折算。在实施基金份额折算后,证券 A 份额持有人或证券 B 份额持有人将会获得一定比例的申万证券份额的场内份额,因此其所持有的基金份额将面临风险收益特征出现变化的风险。当证券 A 份额和证券 B 份额终止运作后,证券 A 份额和证券 B 份额将全部转换成申万证券份额的场内份额,基金份额持有人所持有的基金份额也将面临风险收益特征出现变化的风险。

投资者应特别注意基金下折带来的风险:对于证券 B 份额持有人,在本基金临近向下折算时或者在折算基准日,证券 B 份额可能以较高的溢价率进行交易。向下折算业务办理完毕后,证券 B 份额基金份额参考净值和杠杆率将回到初始水平,在此基础上,证券 B 份额溢价率可能随之大幅降低,若投资者在折算前以高溢价率买入证券 B 份额,折算后可能遭受较大损失。极端情况下,如果市场连续大幅下跌,向下折算前证券 B 份额溢价率可能超过 400%,投资者若此时买入证券 B 份额,折算后亏损可能超过 80%;对于证券 A 份额持有人,约 3/4

或更多的证券 A 份额折算为申万证券份额，原证券 A 份额持有人的风险收益特征将发生一定变化，由持有单一的较低风险收益特征的证券 A 份额变为同时持有证券 A 份额与申万证券份额，其获得的申万证券份额基金份额净值将随市场涨跌而变化，可能会承担因市场下跌而遭受损失的风险。

## 8、基金的收益分配

在存续期内，本基金（包括申万证券份额、证券 A 份额、证券 B 份额）将不进行收益分配。基金管理人将根据基金合同约定对本基金的证券 A 份额和证券 B 份额实施份额折算。基金份额折算后，如果出现新增份额的情形，投资者可通过分拆卖出或赎回折算后新增份额的方式获取投资回报，但是，投资者通过变现折算后的新增份额以获取投资回报的方式并不等同于基金收益分配，投资者不仅须承担相应的交易成本，还可能面临基金份额卖出或赎回的价格波动风险。

## 七、投资于股指期货可能引致的特定风险

### 1、基差风险

在使用股指期货进行套期保值的过程中，基金资产可能因为所持有股指期货合约与标的指数价格波动方向不一致而承受基差风险。因存在基差风险，在进行股指期货合约展期的过程中，基金资产可能因股指期货合约之间价差的异常变动而遭受展期风险。

### 2、盯市结算风险

股指期货采取保证金交易制度，保证金账户实行当日无负债结算制度，对资金管理要求较高。如出现极端行情，市场持续向不利方向波动导致期货保证金不足，又未能在规定的时间内补足，按规定期货保证金账户将被强制平仓，从而导致超出预期的损失。

### 3、交易对手风险

#### （1）对手方风险

基金管理人运用基金资产投资于股指期货，会尽力选择资信状况优良、风险控制能力强的期货公司作为经纪商，但不能杜绝因所选择的期货公司在交易过程中存在违法、违规经营行为或破产清算导致基金资产遭受损失。

#### （2）连带风险

为基金资产进行结算的结算会员或该结算会员下的其他投资人出现保证金

不足、又未能在规定的时间内补足，或因其他原因导致中金所对该结算会员下的经纪账户强行平仓时，基金资产的资产可能因被连带强行平仓而遭受损失。

#### 八、信用风险

指金融工具的一方到期无法履行约定义务致使本基金遭受损失的风险。本基金的信用风险主要来源于金融工具的发行者或是交易对手不能履行约定义务的行为。无论是整体市场投资者的信用偏好变化，还是基金具体投资债券和上市公司的信用恶化，都会对本基金的回报带来负面影响。另外，信用评级调整也会带来相应风险。当信用评级机构调低本基金所持有的债券的信用级别时，债券的价格会下跌，从而导致本基金的收益下降。

#### 九、道德风险

指由员工之行为违反法律法规、监管部门之规定及公认的道德标准，损害客户或公司利益所造成的风险。

#### 十、营运风险

指由于公司组织结构不健全，内部管理的漏洞与人为失误所蕴藏的风险。营运风险可以分内在和外任风险两方面。

内在风险包括因人员、系统和程序而衍生的风险如人为错失、犯法行为、未授权活动、人员损失等操作风险、技术风险、系统稳定安装等风险和决策及程序风险；

外在风险主要因其他风险如法规、法律、公共责任等产生的营运风险。

#### 十一、管理风险

基金管理人的专业技能、研究能力及投资管理水平直接影响到其对信息的占有、分析和对经济形势、证券价格走势的判断，进而影响基金的投资收益水平。同时，基金管理人的投资管理制度、风险管理和内部控制制度是否健全，能否有效防范道德风险和其他合规性风险，以及基金管理人的职业道德水平等，也会对基金的风险收益水平造成影响。

#### 十二、投资者申购失败的风险

基金管理人在特定情形下可以拒绝或暂停申购，则投资者可能会面临申购申请失败的风险。具体规定详见本招募说明书“第十部分 申万证券份额的申购与赎回”的“八、拒绝或暂停申购的情形”。

### 十三、税负增加风险

财政部、国家税务总局财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》第四条规定：“资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。”鉴于基金合同中基金管理人的管理费中不包括产品运营过程中发生的税款，本基金运营过程中需要缴纳增值税应税的，将由基金份额持有人承担并从基金资产中支付，按照税务机关的规定以基金管理人为增值税纳税人履行纳税义务，因此可能增加基金份额持有人的投资税费成本。

### 十四、投资于资产支持证券的特定风险

(1) 信用风险：基金所投资的资产支持证券之债务人出现违约，或在交易过程中发生交收违约，或由于资产支持证券信用质量降低导致证券价格下降，造成基金财产损失。

(2) 利率风险：市场利率将随宏观经济环境的变化而波动，利率波动会导致资产支持证券的收益率和价格的变动，一般而言，如果市场利率上升，基金持有资产支持证券将面临价格下降、本金损失的风险，而如果市场利率下降，资产支持证券利息的再投资收益将面临下降的风险。

(3) 流动性风险：受资产支持证券市场规模及交易活跃程度的影响，可能无法在合理的时间内以公允价格卖出较大数量的资产支持证券，存在一定的流动性风险。

(4) 提前偿付风险：债务人可能会由于利率变化等原因进行提前偿付，从而使基金资产面临再投资风险。

(5) 操作风险：在资产支持证券的投资过程中由于未能按照既有的操作流程进行操作或操作失误未能达到预期投资目标而形成的风险。

(6) 法律风险：在资产支持证券的投资运作过程中，由于违反投资限制、信息披露的相关法律法规的规定或产品合同的约定，导致公司利益受损或受到监管处罚的风险。

### 十五、基金进入清算期的相关风险

基金进入清算程序后，基金管理人将及时变现资产，但由于变现过程中的市场波动、流动受限证券无法及时变现而可能面临的进一步损失、清算费用等原因，

基金份额持有人将可能面临最终收到的全部清算款偏离该基金最后运作日公告的资产净值的风险。此外，基金进入清算程序后，如因持有流动受限证券暂时无法全部变现的，基金将先以已变现基金资产为限进行分配，待该类流动受限证券全部变现后进行再次分配，因此，若该类流动受限证券一直无法变现，基金份额持有人将面临剩余清算款收取时间不确定的风险。

#### 十六、其他风险

- 1、因金融市场危机、行业竞争压力可能产生的风险；
- 2、战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，可能严重影响证券市场运行，导致基金资产损失；和其他意外导致的风险；
- 3、其他意外事件导致的风险。

## 第二十三部分 基金合同的变更、终止与基金财产清算

### 一、基金合同的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于基金合同变更的基金份额持有人大会决议自表决通过后方可执行，自决议生效后2个工作日内在指定媒体公告。

### 二、基金合同的终止事由

有下列情形之一的，基金合同应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、基金合同约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

基金合同终止后，基金管理人和基金托管人有权依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关法律法规的规定，行使请求给付报酬、从基金资产中获得补偿的权利。

### 三、基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现基金合同终止事由之日起30个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

4、基金财产清算程序：

- (1) 基金合同终止情形出现时, 由基金财产清算小组统一接管基金;
- (2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认;
- (3) 对基金财产进行估值和变现;
- (4) 制作清算报告;
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计, 聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书;
- (6) 将清算报告报中国证监会备案并公告;
- (7) 对基金剩余财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为 6 个月。

#### 四、清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用, 清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

#### 五、基金剩余财产的分配

基金财产按下列顺序清偿:

- 1、支付清算费用;
- 2、交纳所欠税款;
- 3、清偿基金债务;
- 4、根据基金合同终止日申万证券份额、证券 A 份额与证券 B 份额各自的基金净值分别计算申万证券份额、证券 A 份额与证券 B 份额三类份额各自的应计分配比例, 在此基础上, 在申万证券份额、证券 A 份额与证券 B 份额各自类别内按其基金份额持有人持有的该类别基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款 1-3 项规定清偿前, 不分配给基金份额持有人。

#### 六、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告; 基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

#### 七、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 第二十四部分 基金合同的内容摘要

### 第一部分 基金管理人、基金托管人及基金份额持有人的权利与义务

#### 一、基金管理人

##### (一) 基金管理人简况

名称：申万菱信基金管理有限公司

住所：上海市中山南路 100 号 11 层

法定代表人：刘郎

设立日期：2004 年 1 月 15 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证券监督管理委员会，中国证监会证监基金字【2003】144 号文

组织形式：有限责任公司

注册资本：壹亿伍仟万元人民币

存续期限：持续经营

联系电话：+86-21-23261188

##### (二) 基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

(1) 依法募集资金；

(2) 自基金合同生效之日起，根据法律法规和基金合同独立运用并管理基金财产；

(3) 依照基金合同收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；

(4) 销售基金份额；

(5) 按照规定召集基金份额持有人大会；

(6) 依据基金合同及有关法律规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了基金合同及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；



- (7) 在基金托管人更换时, 提名新的基金托管人;
- (8) 选择、更换基金销售机构, 对基金销售机构的相关行为进行监督和处理;
- (9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得基金合同规定的费用;
- (10) 依据基金合同及有关法律规定决定基金收益的分配方案;
- (11) 在基金合同约定的范围内, 拒绝或暂停受理申购与赎回申请;
- (12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利, 为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利;
- (13) 在法律法规允许的前提下, 为基金的利益依法为基金进行融资、融券;
- (14) 以基金管理人的名义, 代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;
- (15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构;
- (16) 在符合有关法律、法规的前提下, 制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换等业务规则;
- (17) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定, 基金管理人的义务包括但不限于:

- (1) 依法募集资金, 办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;
- (2) 办理基金备案手续;
- (3) 自基金合同生效之日起, 以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产;
- (4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策, 以专业化的经营方式管理和运作基金财产;
- (5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度, 保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立, 对所管理的不同基金分别管理, 分别记账, 进行证券投资;

(6) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外,不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人运作基金财产;

(7) 依法接受基金托管人的监督;

(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定,按有关规定计算并公告基金资产净值、申万证券份额的基金份额净值、证券 A 份额和证券 B 份额的基金份额参考净值,确定申万证券份额申购、赎回的价格;

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

(10) 编制季度、半年度和年度基金报告;

(11) 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;

(12) 保守基金商业秘密,不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予保密,不向他人泄露;

(13) 按基金合同的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配基金收益;

(14) 按规定受理申购与赎回申请,及时、足额支付赎回款项;

(15) 依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;

(16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上;

(17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出,并且保证投资者能够按照基金合同规定的时间和方式,随时查阅到与基金有关的公开资料,并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件;

(18) 组织并参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;

(19) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会并通知基金托管人;

(20) 因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益

时,应当承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;

(21) 监督基金托管人按法律法规和基金合同规定履行自己的义务,基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时,基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;

(22) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时,应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任;

(23) 以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为;

(24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件,基金合同不能生效,基金管理人承担全部募集费用,将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人;

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议;

(26) 建立并保存基金份额持有人名册;

(27) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

## 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

住所: 北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人: 易会满

成立时间: 1984 年 1 月 1 日

批准设立机关和批准设立文号: 国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》(国发【1983】146 号)

组织形式: 股份有限公司

注册资本: 人民币 349,018,545,827 元

存续期间: 持续经营

基金托管资格批文及文号: 中国证监会和中国人民银行证监基字【1998】3 号

### (二) 基金托管人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金托管人的权利包括

但不限于：

(1) 自基金合同生效之日起，依法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；

(2) 依基金合同约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用；

(3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反基金合同及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(4) 根据相关市场规则，为基金开设证券账户、为基金办理证券交易资金清算；

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

(2) 设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；

(3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

(4) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

(6) 按规定开设基金财产的资金账户、证券账户和期货账户等投资所需账户，按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

(7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定

外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、申万证券份额的基金份额净值、证券 A 份额和证券 B 份额的基金份额参考净值、申万证券份额申购、赎回价格；

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(10) 对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

(11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；

(12) 建立并保存基金份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

(14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；

(15) 依据《基金法》、基金合同及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

(16) 按照法律法规和基金合同的规定监督基金管理人的投资运作；

(17) 参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；

(19) 因违反基金合同导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(20) 按规定监督基金管理人按法律法规和基金合同规定履行自己的义务，基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

### 三、基金份额持有人

基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对基金合同的承认和接受,基金投资者自依据基金合同取得基金份额,即成为本基金份额持有人和基金合同的当事人,直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为基金合同当事人并不以在基金合同上书面签章或签字为必要条件。

申万证券份额、证券 A 份额和证券 B 份额仅在其各自份额类别内具有同等的合法权益。如果证券 A 份额和证券 B 份额终止运作,则在终止证券 A 份额和证券 B 份额的运作后,本基金每份基金份额具有同等的合法权益。

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金份额持有人的权利包括但不限于:

- (1) 分享基金财产收益;
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产;
- (3) 依法申请赎回其持有的申万证券份额,依法转让其持有的证券 A 份额和证券 B 份额;
- (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会;
- (5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会,对基金份额持有人大会审议事项行使表决权;
- (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料;
- (7) 监督基金管理人的投资运作;
- (8) 对基金管理人、基金托管人、基金销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁;
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金份额持有人的义务包括但不限于:

- (1) 认真阅读并遵守基金合同;
- (2) 了解所投资基金产品,了解自身风险承受能力,自行承担投资风险;
- (3) 关注基金信息披露,及时行使权利和履行义务;
- (4) 缴纳基金认购、申购、赎回款项及法律法规和基金合同所规定的费用;
- (5) 在其持有的基金份额范围内,承担基金亏损或者基金合同终止的有限

责任；

- (6) 不从事任何有损基金及其他基金合同当事人合法权益的活动；
- (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

## 第二部分 基金份额持有人大会召集、议事规则及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人大会的审议事项应分别由申万证券份额、证券 A 份额、证券 B 份额的基金份额持有人独立进行表决。基金份额持有人持有的每一基金份额在其对应的份额级别内拥有平等的投票权。

### 一、召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

- (1) 终止基金合同；
- (2) 更换基金管理人；
- (3) 更换基金托管人；
- (4) 转换基金运作方式；
- (5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，依据法律法规要求提高该等报酬标准的除外；
- (6) 变更基金类别；
- (7) 本基金与其他基金的合并；
- (8) 变更基金投资目标、范围或策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；
- (9) 变更基金份额持有人大会程序；
- (10) 终止证券 A 份额与证券 B 份额的运作；
- (11) 终止证券 A 份额与证券 B 份额上市，但因基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的除外；

(12) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会;

(13) 单独或合计持有本基金总份额 10%以上(含 10%)基金份额的基金份额持有人(①以基金管理人收到提议当日的基金份额计算,下同;②指单独或合计持有申万证券份额、证券 A 份额、证券 B 份额不少于本基金总份额的 10%(含 10%),下同)就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会;

(14) 对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项;

(15) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改,不需召开基金份额持有人大会:

(1) 调低基金管理费、基金托管费;

(2) 法律法规要求增加的基金费用的收取;

(3) 在不违背法律法规的规定和基金合同的约定,以及对基金份额持有人利益无实质性影响的情形下,调整申万证券份额的申购费率、变更收费方式或调低申万证券份额的赎回费率;

(4) 因相应的法律法规、深圳证券交易所或登记机构的相关业务规则发生变动而应当对基金合同进行修改;

(5) 对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化;

(6) 按照法律法规和基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

## 二、会议召集人及召集方式

1、除法律法规规定或基金合同另有约定外,基金份额持有人大会由基金管理人召集。

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时,由基金托管人召集。

3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的,应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集,并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的,应当自出具书面决定之日起 60 日内召开;基金管理人决定不召集,基金托管人仍认为有必要召开的,应当



由基金托管人自行召集。

4、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。

5、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

6、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

### 三、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 日，在指定媒体公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

- （1）会议召开的时间、地点和会议形式；
- （2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；
- （3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- （4）授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
- （5）会务常设联系人姓名及联系电话；
- （6）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- （7）召集人需要通知的其他事项。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知

中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

#### 四、基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式等法律法规或监管机构允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或基金托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

(1) 亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

(2) 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的申万证券份额、证券 A 份额与证券 B 份额各自的基金份额分别合计不少于在权益登记日对应级别基金总份额的二分之一（含二分之一）。若到会者在权益登记日代表的有效的申万证券份额、证券 A 份额与证券 B 份额各自的基金份额分别合计少于在权益登记日对应级别基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的申万证券份额、证券 A 份额与证券 B 份额各自的基金份额分别合计不少于在权益登记日对应级别基金总份额的三分之一。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面

形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

(1) 会议召集人按基金合同约定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

(2) 召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

(3) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，有效的申万证券份额、证券 A 份额、证券 B 份额各自基金份额分别合计不小于在权益登记日对应级别基金总份额的二分之一（含二分之一）；若本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见基金份额持有人所持有的申万证券份额、证券 A 份额、证券 B 份额各自基金份额分别合计少于在权益登记日对应级别基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有申万证券份额、证券 A 份额、证券 B 份额各自基金份额分别合计代表三分之一以上的对应级别基金份额持有人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见；

(4) 上述第(3)项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与基金登记机构记录相符。

3、在法律法规和监管机关允许的情况下，本基金亦可采用网络、电话等其他非现场方式或者以非现场方式与现场方式结合的方式召开基金份额持有人大会，或者采用网络、电话或其他方式授权他人代为出席会议并表决，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。

## 五、议事内容与程序

## 1、议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如基金合同的重大修改、决定终止基金合同、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及基金合同规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

## 2、议事程序

### (1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

### (2) 通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

## 六、表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的申万证券份额、证券 A 份额、证券

B 份额各自基金份额持有人或其代理人所持该级基金份额表决权的二分之一以上(含二分之一)通过方为有效;除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

2、特别决议,特别决议应当经参加大会的申万证券份额、证券 A 份额、证券 B 份额各自基金份额持有人或其代理人所持该级基金份额表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止基金合同、本基金与其他基金合并、证券 A 份额与证券 B 份额的终止运作以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时,除非在计票时有充分的相反证据证明,否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者,表面符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决,表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决,但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

## 七、计票

### 1、现场开会

(1) 如大会由基金管理人或基金托管人召集,基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人;如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集,但是基金管理人或基金托管人未出席大会的,基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的,不影响计票的效力。

(2) 监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

(3) 如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑,可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行

重新清点,重新清点以一次为限。重新清点后,大会主持人应当当场公布重新清点结果。

(4) 计票过程应由公证机关予以公证,基金管理人或基金托管人拒不出席大会的,不影响计票的效力。

## 2、通讯开会

在通讯开会的情况下,计票方式为:由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表(若由基金托管人召集,则为基金管理人授权代表)的监督下进行计票,并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的,不影响计票和表决结果。

## 八、生效与公告

基金份额持有人大会的决议,召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起2个工作日内在指定媒体上公告。如果采用通讯方式进行表决,在公告基金份额持有人大会决议时,必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

九、本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定,凡与将来颁布的其他涉及基金份额持有人大会规定的法律法规不一致的,基金管理人提前公告后,可直接对本部分内容进行修改和调整,无需召开基金份额持有人大会审议。

## 第三部分 基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

### 一、基金合同的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的,应召开基金份额持有人大会决议通过。对于可不经基金份

额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于基金合同变更的基金份额持有人大会决议自表决通过后方可执行，自决议生效后2个工作日内在指定媒体公告。

## 二、基金合同的终止事由

有下列情形之一的，基金合同应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、基金合同约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

基金合同终止后，基金管理人和基金托管人有权依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关法律法规的规定，行使请求给付报酬、从基金资产中获得补偿的权利。

## 三、基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现基金合同终止事由之日起30个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

### 4、基金财产清算程序：

- (1) 基金合同终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
- (2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- (3) 对基金财产进行估值和变现；
- (4) 制作清算报告；
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算

报告出具法律意见书;

(6) 将清算报告报中国证监会备案并公告;

(7) 对基金剩余财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为 6 个月。

#### 四、清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用, 清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

#### 五、基金剩余财产的分配

基金财产按下列顺序清偿:

1、支付清算费用;

2、交纳所欠税款;

3、清偿基金债务;

4、根据基金合同终止日申万证券份额、证券 A 份额与证券 B 份额各自的基金净值分别计算申万证券份额、证券 A 份额与证券 B 份额三类份额各自的应计分配比例, 在此基础上, 在申万证券份额、证券 A 份额与证券 B 份额各自类别内按其基金份额持有人持有的该类别基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款 1-3 项规定清偿前, 不分配给基金份额持有人。

#### 六、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告; 基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

#### 七、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

### 第四部分 争议的处理和适用的法律

各方当事人同意, 因基金合同而产生的或与基金合同有关的一切争议, 如经友好协商未能解决的, 应提交中国国际经济贸易仲裁委员会, 根据该会当时有效



的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京市，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费由败诉方承担。

争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

基金合同受中国法律管辖。

## 第五部分 基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

基金合同可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。

## 第二十五部分 基金托管协议的内容摘要

### 一、托管协议当事人

#### (一) 基金管理人

名称：申万菱信基金管理有限公司

住所：上海市中山南路 100 号 11 层

法定代表人：刘郎

成立时间：2004 年 1 月 15 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证券监督管理委员会，中国证监会证监基金字【2003】144 号文

注册资本：壹亿伍仟万元人民币

组织形式：有限责任公司

经营范围：基金管理业务、发起设立基金及中国证券监督管理委员会批准的其他业务。

存续期间：持续经营

电话：+86-21-23261188

传真：+86-21-23261388

联系人：牛锐

#### (二) 基金托管人

名称：中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号（100032）

法定代表人：易会满

电话：（010）66105799

传真：（010）66105798

联系人：赵会军

成立时间：1984 年 1 月 1 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 349,018,545,827 元

批准设立机关和设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》（国发【1983】146号）

存续期间：持续经营

经营范围：办理人民币存款、贷款、同业拆借业务；国内外结算；办理票据承兑、贴现、转贴现、各类汇兑业务；代理资金清算；提供信用证服务及担保；代理销售业务；代理发行、代理承销、代理兑付政府债券；代收代付业务；代理证券投资基金清算业务（银证转账）；保险代理业务；代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务；保管箱服务；发行金融债券；买卖政府债券、金融债券；证券投资基金、企业年金托管业务；企业年金受托管理服务；年金账户管理服务；开放式基金的注册登记、认购、申购和赎回业务；资信调查、咨询、见证业务；贷款承诺；企业、个人财务顾问服务；组织或参加银团贷款；外汇存款；外汇贷款；外币兑换；出口托收及进口代收；外汇票据承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券；自营、代客外汇买卖；外汇金融衍生业务；银行卡业务；电话银行、网上银行、手机银行业务；办理结汇、售汇业务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。

## 二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

### （一）基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

1、基金托管人根据有关法律法规的规定和基金合同的约定，对下述基金投资范围、投资对象进行监督。

本基金将投资于以下金融工具：

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。

本基金不得投资于相关法律、法规、部门规章及基金合同禁止投资的投资工具。

2、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下述基金投融资比例进行监督:

(1) 按法律法规的规定及基金合同的约定,本基金的投资资产配置比例为: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%—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,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、存出保证金及应收申购款等。

(2) 根据法律法规的规定及基金合同的约定,本基金投资组合遵循以下投资限制:

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,其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等;

3) 本基金在任何交易日买入权证的总金额,不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%,基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%,基金管理人管理且由基金托管人托管的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。法律法规或中国证监会另有规定的,遵从其规定;

4) 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,不得超过基金资产净值的 10%;

5) 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%;

6) 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%;

7) 基金管理人管理且由基金托管人托管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%;

8) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。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;

9) 本基金财产参与股票发行申购, 所申报的金额不得超过本基金的总资产, 所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;

10) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%;

11) 本基金参与股指期货交易依据下列标准建构组合:

①在任何交易日日终, 持有的买入股指期货合约价值, 不得超过基金资产净值的10%;

②在任何交易日日终, 持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和, 不得超过基金资产净值的100%, 其中, 有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;

③在任何交易日日终, 持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%;

④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)应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定;

⑤在任何交易日内交易(不包括平仓)的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%;

12) 本基金管理人管理且由基金托管人托管的全部基金持有一家公司发行的证券, 不超过该证券的10%, 但符合中国证监会规定的标的指数成分股投资不计入受此限;

13) 本基金持有一家上市公司的股票, 其市值不超过基金资产净值的10%, 但符合中国证监会规定的标的指数成分股投资不计入受此限;

14) 本基金管理人管理且由基金托管人托管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%; 本基金管理人管理且由基金托管人托管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;

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;

17) 本基金持有一家公司发行的流通受限证券,其市值不得超过基金资产净值的 5%; 本基金持有的所有流通受限证券,其市值不得超过该基金资产净值的 10%; 经基金管理人和基金托管人协商,可对以上比例进行调整。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金投资的监督和检查自基金合同生效之日起开始。

《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消或变更上述限制的,履行适当程序后,本基金不受上述限制或以变更后的规定为准。

### (3) 法规允许的基金投资比例调整期限

除上述第 2)、8)、15)、16) 项外,由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例,基金管理人应在 10 个交易日内进行调整,以达到规定的投资比例限制要求。法律法规另有规定的从其规定。

基金管理人应在出现可预见资产规模大幅变动的情况下,至少提前 2 个工作日正式向基金托管人发函说明基金可能变动规模和公司应对措施,便于托管人实施交易监督。

### (4) 本基金可以按照国家的有关规定进行融资融券。

3、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下述基金投资禁止行为进行监督:

为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:

- (1) 承销证券;
- (2) 违反规定向他人贷款或提供担保;
- (3) 从事承担无限责任的投资;

(4) 买卖其他基金份额, 但中国证监会另有规定的除外;

(5) 向基金管理人、基金托管人出资。

运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券, 或者从事其他重大关联交易的, 应当遵循基金份额持有人利益优先的原则, 防范利益冲突, 符合国务院证券监督管理机构的规定, 并履行信息披露义务。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定, 基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

4、基金托管人依据有关法律法规的规定和基金合同的约定对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。

(1) 基金托管人按以下方式对基金管理人参与银行间市场交易的交易对手资信风险控制措施进行监督。

基金管理人向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的银行间市场交易对手的名单, 并按照审慎的风险控制原则在该名单中约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金托管人在收到名单后 2 个工作日内回函确认收到该名单。基金管理人应定期或不定期对银行间市场现券及回购交易对手的名单进行更新, 名单中增加或减少银行间市场交易对手时须提前书面通知基金托管人, 基金托管人于 2 个工作日内回函确认收到后, 对名单进行更新。基金管理人收到基金托管人书面确认后, 被确认调整的名单开始生效, 新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易, 仍应按照协议进行结算。

如果基金托管人发现基金管理人与不在名单内的银行间市场交易对手进行交易, 应及时提醒基金管理人撤销交易, 经提醒后基金管理人仍执行交易并造成基金资产损失的, 基金托管人不承担责任, 发生此种情形时, 基金托管人有权报告中国证监会。

(2) 基金托管人对于基金管理人参与银行间市场交易的交易方式的控制

基金管理人在银行间市场进行现券买卖和回购交易时, 需按交易对手名单中约定的该交易对手所适用的交易结算方式进行交易。如果基金托管人发现基金管理人没有按照事先约定的交易方式进行交易时, 基金托管人应及时提醒基金管理人与交易对手重新确定交易方式, 经提醒后仍未改正时造成基金资产损失的,

基金托管人不承担责任。

(3) 基金管理人参与银行间市场交易的核心交易对手为中国工商银行、中国银行、中国建设银行、中国农业银行和交通银行,基金管理人在通知基金托管人后,可以根据当时的市场情况调整核心交易对手名单。基金管理人有责任控制交易对手的资信风险,在与核心交易对手以外的交易对手进行交易时,由于交易对手资信风险引起的损失先由基金管理人承担,其后有权要求相关责任人进行赔偿。基金托管人的监督责任仅限于根据已提供的名单,审核交易对手是否在名单内列明。

#### 5、基金托管人对基金管理人选择存款银行进行监督。

本基金投资银行存款的信用风险主要包括存款银行的信用等级、存款银行的支付能力等涉及到存款银行选择方面的风险。本基金核心存款银行名单为中国工商银行、中国银行、中国建设银行、中国农业银行和交通银行,本基金投资除核心存款银行以外的银行存款出现由于存款银行信用风险而造成的损失时,先由基金管理人负责赔偿,之后有权要求相关责任人进行赔偿。基金管理人在通知基金托管人后,可以根据当时的市场情况对于核心存款银行名单进行调整。基金托管人的监督责任仅限于根据已提供的名单,审核核心存款银行是否在名单内列明。

#### 6、基金托管人对基金投资流通受限证券的监督

(1) 流通受限证券与上文提及的流动性受限资产并不完全一致,包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。基金投资流通受限证券,还应遵守《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。

(2) 基金管理人应在基金首次投资流通受限证券前,向基金托管人提供经基金管理人董事会批准的有关基金投资流通受限证券的投资决策流程、风险控制制度。基金投资非公开发行股票,基金管理人还应提供基金管理人董事会批准的流动性风险处置预案。上述资料应包括但不限于基金投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制情况。

基金管理人应至少于首次执行投资指令之前两个工作日将上述资料书面发



至基金托管人,保证基金托管人有足够的时间进行审核。基金托管人应在收到上述资料后两个工作日内,以书面或其他双方认可的方式确认收到上述资料。

(3) 基金投资流通受限证券前,基金管理人应向基金托管人提供符合法律法规要求的有关书面信息,包括但不限于拟发行证券主体的中国证监会批准文件、发行证券数量、发行价格、锁定期,基金拟认购的数量、价格、总成本、总成本占基金资产净值的比例、已持有流通受限证券市值占资产净值的比例、资金划付时间等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整,并应至少于拟执行投资指令前两个工作日将上述信息书面发至基金托管人,保证基金托管人有足够的时间进行审核。

(4) 基金托管人应按照《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》规定,对基金管理人是否遵守法律法规进行监督,并审核基金管理人提供的有关书面信息。基金托管人认为上述资料可能导致基金出现风险的,有权要求基金管理人在投资流通受限证券前就该风险的消除或防范措施进行补充书面说明。否则,基金托管人经事先书面告知基金管理人后,有权拒绝执行有关指令。因拒绝执行该指令造成基金财产损失的,基金托管人不承担任何责任,并有权报告中国证监会。

如基金管理人和基金托管人无法达成一致,应及时上报中国证监会请求解决。如果基金托管人切实履行监督职责,则不承担任何责任。如果基金托管人没有切实履行监督职责,导致基金出现风险,基金托管人应承担连带责任。

(二) 基金托管人应根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金资产净值计算、申万证券份额的基金份额净值计算、证券 A 份额与证券 B 份额的基金份额参考净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。

(三) 基金托管人发现基金管理人的投资运作及其他运作违反《基金法》、基金合同、基金托管协议有关规定时,应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正,基金管理人收到通知后应在下一个工作日及时核对,并以书面形式向基金托管人发出回函,进行解释或举证。

在限期内,基金托管人有权随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。

基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人应报告中国证监会。基金托管人应当督促基金管理人赔偿因其违反基金合同而致使投资者遭受的损失。

对于依据交易程序尚未成交的且基金托管人在交易前能够监控的投资指令,基金托管人发现该投资指令违反法律法规规定或者违反基金合同约定的,应当拒绝执行,立即通知基金管理人,并向中国证监会报告。

对于必须于估值完成后方可获知的监控指标或依据交易程序已经成交的投资指令,基金托管人发现该投资指令违反法律法规或者违反基金合同约定的,应当立即通知基金管理人,并报告中国证监会。

基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查,必须在规定时间内答复基金托管人并改正,就基金托管人的疑义进行解释或举证,对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的,基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为,应立即报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正。

基金管理人无正当理由,拒绝、阻挠基金托管人根据本协议规定行使监督权,或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金托管人进行有效监督,情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的,基金托管人应报告中国证监会。

### 三、基金管理人对于基金托管人的业务核查

基金管理人对于基金托管人履行托管职责情况进行核查,核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户、证券账户和期货账户等投资所需账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和申万证券份额的基金份额净值、证券 A 份额与证券 B 份额的基金份额参考净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、无故未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、基金合同、本托管协议及其他有关规定时,基金管理人应及时

以书面形式通知基金托管人限期纠正,基金托管人收到通知后应在下一个工作日及时核对确认并以书面形式向基金管理人发出回函,进行解释或举证。在限期内,基金管理人有权随时对通知事项进行复查,督促基金托管人改正,并予协助配合。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金管理人应报告中国证监会。基金管理人有权要求基金托管人赔偿基金因此所遭受的损失。

基金管理人发现基金托管人有重大违规行为,应立即报告中国证监会和银行业监督管理机构,同时通知基金托管人限期纠正。

基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为,包括但不限于:提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性,在规定时间内答复基金管理人并改正。

基金托管人无正当理由,拒绝、阻挠基金管理人根据本协议规定行使监督权,或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金管理人进行有效监督,情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的,基金管理人应报告中国证监会。

## 四、基金财产的保管

### (一) 基金财产保管的原则

- 1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
- 2、基金托管人应安全保管基金财产。未经基金管理人的正当指令,不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。
- 3、基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户、证券账户和期货账户等投资所需账户。
- 4、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户,与基金托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行严格的分账管理,确保基金财产的完整与独立。

对于因基金认(申)购、基金投资过程中产生的应收财产,应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人,到账日基金财产没有到达基金托管人处的,基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的,基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失,基金托管人对

此不承担责任。

## （二）募集资金的验证

基金募集期间募集的资金应划入本基金在中国证券登记结算有限公司开立的备付金账户。该账户由基金管理人或由接受基金管理人委托代为办理登记业务的机构开立并管理。基金募集期满，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，由基金管理人聘请具有从事证券业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的2名以上（含2名）中国注册会计师签字有效。验资完成，基金管理人应将募集的属于本基金财产的全部资金划入基金托管人为基金开立的资产托管专户中，基金托管人在收到资金当日出具确认文件。

若基金募集期限届满，未能达到基金合同生效的条件，由基金管理人按规定办理退款事宜。

## （三）基金的银行账户的开立和管理

基金托管人以基金托管人的名义在其营业机构开设资产托管专户，保管基金的银行存款。该账户的开设和管理由基金托管人承担。本基金的一切货币收支活动，均需通过基金托管人的资产托管专户进行。

资产托管专户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立其他任何银行账户；亦不得使用基金的任何银行账户进行本基金业务以外的活动。

资产托管专户的管理应符合《人民币银行结算账户管理办法》、《现金管理暂行条例》、《人民币利率管理规定》、《利率管理暂行规定》、《支付结算办法》以及银行业监督管理机构的其他规定。

## （四）基金证券账户与证券交易资金账户的开设和管理

基金托管人以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司开设证券账户。

基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司开立基金证券交易资金账户，用于证券清算。

基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借和未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户；亦不得使

用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

#### (五) 债券托管账户的开立和管理

1、基金合同生效后,基金管理人负责以本基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格,并代表本基金进行交易;基金托管人负责以本基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开设银行间债券市场债券托管自营账户,并由基金托管人负责基金的债券的后台匹配及资金的清算。

2、基金管理人和基金托管人应一起负责为基金对外签订全国银行间债券市场回购主协议,正本由基金托管人保管,基金管理人保存副本。

#### (六) 其他账户的开设和管理

在本托管协议订立日之后,本基金被允许从事符合法律法规规定和基金合同约定的其他投资品种的投资业务时,如果涉及相关账户的开设和使用,由基金管理人协助基金托管人根据有关法律法规的规定和基金合同的约定,开立有关账户。该账户按有关规则使用并管理。

#### (七) 基金财产投资的有关实物证券、银行定期存款存单等有价凭证的保管

基金财产投资的有关实物证券由基金托管人存放于基金托管人的保管库;其中实物证券也可存入中央国债登记结算有限责任公司或中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库。实物证券的购买和转让,由基金托管人根据基金管理人的指令办理。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失,由此产生的责任应由基金托管人承担。基金托管人对基金托管人以外机构实际有效控制或保管的证券不承担保管责任。

#### (八) 与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别应由基金托管人、基金管理人保管。除本协议另有规定外,基金管理人在代表本基金签署与基金有关的重大合同时应保证基金一方持有两份以上的正本,以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人在合同签署后5个工作日内通过专人送达、挂号邮寄等安全方式将合同原件送达基金托管人处。合同原件应存放于基金管理人和基金托管人各自文件保管部门15年以上。

## 五、基金资产净值的计算与复核

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。本基金分别计算申万证券份额的基金份额净值、证券 A 份额与证券 B 份额的基金份额参考净值。申万证券份额的基金份额净值、证券 A 份额与证券 B 份额的基金份额参考净值的计算保留到小数点后 4 位, 小数点后第 5 位四舍五入, 由此产生的误差计入基金财产。

基金管理人应每工作日对基金资产估值, 但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。估值原则应符合基金合同、《证券投资基金会计核算办法》及其他法律、法规的规定。用于基金信息披露的基金资产净值和申万证券份额的基金份额净值、证券 A 份额与证券 B 份额的基金份额参考净值, 由基金管理人负责计算, 基金托管人复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金资产净值、申万证券份额的基金份额净值、证券 A 份额与证券 B 份额的基金份额参考净值并以双方认可的方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后以双方认可的方式发送给基金管理人, 由基金管理人对外公布。

根据《基金法》, 基金管理人计算并公告基金资产净值, 基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值。因此, 本基金的会计责任方是基金管理人, 就与本基金有关的会计问题, 如经相关各方在平等基础上充分讨论后, 仍无法达成一致的意见, 按照基金管理人对外公布的基金资产净值的计算结果对外予以公布。法律法规以及监管部门有强制规定的, 从其规定。如有新增事项, 按国家最新规定估值。

## 六、基金份额持有人名册的登记与保管

基金管理人和基金托管人须分别妥善保管的基金份额持有人名册, 包括基金合同生效日、基金合同终止日、基金份额持有人大会权利登记日、每年 6 月 30 日、12 月 31 日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容必须包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册由基金登记机构根据基金管理人的指令编制和保管,基金管理人、基金托管人应按照目前相关规则分别保管基金份额持有人名册。保管方式可以采用电子或文档的形式。保管期限为 20 年。

基金管理人应当及时向基金托管人提交下列日期的基金份额持有人名册:基金合同生效日、基金合同终止日、基金份额持有人大会权益登记日、每年 6 月 30 日、每年 12 月 31 日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容必须包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。其中每年 12 月 31 日的基金份额持有人名册应于下月前十个工作日内提交;基金合同生效日、基金合同终止日等涉及到基金重要事项日期的基金份额持有人名册应于发生日后十个工作日内提交。

基金托管人以电子版形式妥善保管基金份额持有人名册,并定期刻成光盘备份,保存期限为 15 年。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途,并应遵守保密义务。

若基金管理人或基金托管人由于自身原因无法妥善保管基金份额持有人名册,应按有关法规规定各自承担相应的责任。

## 七、争议解决方式

相关各方当事人同意,因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议,除经友好协商可以解决的,应提交中国国际经济贸易仲裁委员会,根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁,仲裁地点为北京市,仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力,仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间,相关各方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责,继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和托管协议规定的义务,维护基金份额持有人的合法权益。

本协议受中国法律管辖。

## 八、托管协议的修改与终止

### （一）托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议的内容进行变更。变更后的托管协议，其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。基金托管协议的变更应报中国证监会备案。

### （二）基金托管协议终止的情形

发生以下情况，本托管协议终止：

- 1、基金合同终止；
- 2、基金托管人解散、依法被撤销、破产或有其他基金托管人接管基金资产；
- 3、基金管理人解散、依法被撤销、破产或有其他基金管理人接管基金管理权；
- 4、发生法律法规或基金合同规定的终止事项。



## 第二十六部分 对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为本基金份额持有人提供一系列的服务。以下是主要的服务内容,基金管理人根据本基金份额持有人的需要和市场的变化,有权增加、修改这些服务项目。

### (一) 为基金份额持有人提供的服务

#### 1、基金份额持有人投资记录对帐服务

基金份额持有人可直接登录公司网站下载或打印对帐单,也可选择E-MAIL、短信、微信等方式得到投资记录对账服务。如基金份额持有人因特殊原因需获取指定期间的纸质对账单,可拨打本公司客服电话400-880-8588(免长途话费)或021-962299,公司将按流程为基金份额持有人免费邮寄。

#### 2、互联网服务

基金管理人可利用公司官方网站([www.swsmu.com](http://www.swsmu.com))、官方微信(SW\_SMU)、申万菱信申级宝(SW\_SMUZX)为基金份额持有人提供基金查询/交易服务及各类在线咨询服务。

#### 3、基金转换服务

为方便基金份额持有人,投资者可以依照基金管理人的有关规定选择在本基金和基金管理人管理的其他基金之间进行基金转换。基金转换的数额限制、转换费率等具体规定可以由基金管理人届时另行规定并公告。

#### 4、定期定额投资计划

基金管理人可利用直销中心或代销网点为投资者提供定期投资的服务。通过定期定额投资计划,投资者可以通过固定的渠道,定期定额申购基金份额。该定期定额投资计划的办理时间、费率和有关规则由基金管理人另行公告。

### (二) 服务渠道

#### 1、咨询电话: +86-21-962299 或 400-880-8588 (免长途话费)

- 2、网站：[www.swsmu.com](http://www.swsmu.com)
- 3、微信：申万菱信基金（SW\_SMU）或申万菱信申级宝（SW\_SMUZX）
- 4、其他：如微博等

## 第二十七部分 招募说明书的存放及查阅方式

招募说明书公布后，应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的住所，供公众查阅、复制。投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

## 第二十八部分 其它应披露事项 5

自 2018 年 9 月 14 日至 2019 年 3 月 13 日, 与本基金和本基金管理人有关的公告如下:

1、2018 年 9 月 18 日, 刊登于《中国证券报》和《上海证券报》的申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的提示公告;

2、2018 年 10 月 9 日, 刊登于《中国证券报》和《上海证券报》的申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的提示公告;

3、2018 年 10 月 12 日, 刊登于《中国证券报》和《上海证券报》的申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的提示公告;

4、2018 年 10 月 13 日, 刊登于《中国证券报》和《上海证券报》的申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的提示公告;

5、2018 年 10 月 15 日, 刊登于《中国证券报》和《上海证券报》的关于旗下申万菱信中证 500 指数优选增强型证券投资基金新增中国国际金融股份有限公司为代销机构并开通部分基金的定期定额投资及参加中国国际金融股份有限公司开展的费率优惠活动的公告;

6、2018 年 10 月 16 日, 刊登于《中国证券报》和《上海证券报》的申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金证券 B 份额不定期份额折算的风险提示公告;

7、2018 年 10 月 16 日, 刊登于《中国证券报》和《上海证券报》的关于申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金办理不定期份额折算业务期间暂停申购、赎回、转换转入、转换转出及定期定额投资业务的公告;

8、2018 年 10 月 16 日, 刊登于《中国证券报》和《上海证券报》的申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金办理不定期份额折算业务的公告;

9、2018 年 10 月 17 日, 刊登于《中国证券报》和《上海证券报》的申万菱

信中证申万证券行业指数分级证券投资基金不定期折算业务期间证券 A 、 证券 B 停复牌的公告；

10、2018 年 10 月 18 日，刊登于《中国证券报》和《上海证券报》的申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金不定期份额折算结果及恢复交易的公告；

11、2018 年 10 月 18 日，刊登于《中国证券报》和《上海证券报》的关于证券 A 和证券 B 不定期份额折算后前收盘价调整的公告；

12、2018 年 10 月 24 日，刊登于《中国证券报》和《上海证券报》的申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金 2018 年第 3 季度报告；

13、2018 年 10 月 27 日，刊登于《中国证券报》和《上海证券报》的申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金招募说明书第九次更新（摘要）；

14、2018 年 11 月 13 日，刊登于《中国证券报》和《上海证券报》的关于旗下部分基金新增北京虹点基金销售有限公司为代销机构并开通定期定额投资、转换业务并参加北京虹点基金销售有限公司开展的费率优惠活动的公告；

15、2018 年 11 月 15 日，刊登于《中国证券报》和《上海证券报》的关于旗下部分基金新增上海有鱼基金销售有限公司为代销机构并开通定期定额投资、转换业务并参加上海有鱼基金销售有限公司开展的费率优惠活动的公告；

16、2018 年 12 月 26 日，刊登于《中国证券报》和《上海证券报》的关于旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司开展的“2019 倾心回馈”基金定投优惠活动的公告；

17、2018 年 12 月 27 日，刊登于《中国证券报》和《上海证券报》的关于旗下部分开放式基金参加中国农业银行股份有限公司开展的费率优惠活动的公告；

18、2019 年 1 月 2 日，刊登于《中国证券报》和《上海证券报》的关于旗下开放式基金 2018 年 12 月 31 日基金净值公告；

19、2019 年 1 月 18 日，刊登于《中国证券报》的关于调整旗下部分基金申购金额、赎回份额及转换份额最低下限的公告；

20、2019 年 1 月 22 日，刊登于《中国证券报》的申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金 2018 年第 4 季度报告；

21、2019 年 1 月 25 日,刊登于《中国证券报》的关于旗下部分基金参加中国农业银行股份有限公司开展的费率优惠活动的公告;

22、2019 年 1 月 25 日,刊登于《中国证券报》的关于旗下部分基金新增玄元保险代理有限公司为代销机构并开通定期定额投资、转换业务并参加玄元保险代理有限公司开展的费率优惠活动的公告;

23、2019 年 2 月 18 日,刊登于《中国证券报》的关于取消旗下部分基金场内申购费率优惠的公告;

24、2019 年 2 月 21 日,刊登于《中国证券报》的申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金暂停大额申购、定期定额投资及转换转入业务的公告;

25、2019 年 2 月 22 日,刊登于《中国证券报》的关于旗下部分基金暂停跨系统转托管(场外转场内)业务的公告;

26、2019 年 2 月 23 日,刊登于《中国证券报》的申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金开展直销人工柜台赎回费率优惠活动的公告;

27、2019 年 2 月 25 日,刊登于《中国证券报》的关于申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金办理不定期份额折算业务期间暂停申购、赎回、转换转入、转换转出及定期定额投资业务的公告;

28、2019 年 2 月 25 日,刊登于《中国证券报》的申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金办理不定期份额折算业务的公告;

29、2019 年 2 月 26 日,刊登于《中国证券报》的关于申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金办理不定期份额折算业务的更正公告;

30、2019 年 2 月 26 日,刊登于《中国证券报》的申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金不定期折算业务期间证券 B 停复牌的公告;

31、2019 年 2 月 27 日,刊登于《中国证券报》的申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金暂停大额申购、定期定额投资及转换转入业务的公告;

32、2019 年 2 月 27 日,刊登于《中国证券报》的关于证券 B 不定期份额折算后前收盘价调整的公告;

33、2019 年 2 月 27 日,刊登于《中国证券报》的申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金不定期份额折算结果及恢复交易的公告;

34、2019 年 3 月 2 日,刊登于《中国证券报》的申万菱信中证申万证券行

业指数分级证券投资基金直销人工柜台赎回费率优惠活动结束的公告；

35、2019年3月4日，刊登于《中国证券报》的申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金恢复直销机构大额申购、定期定额投资及转换转入业务的公告；

36、2019年3月5日，刊登于《中国证券报》的申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金B类份额溢价风险提示公告；

37、2019年3月7日，刊登于《中国证券报》的申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金调整代销机构场外大额申购、定期定额投资及转换转入业务的公告；

38、2019年3月8日，刊登于《中国证券报》的申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金B类份额溢价风险提示公告；

39、2019年3月11日，刊登于《中国证券报》的关于申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间暂停申购、赎回、转换转入、转换转出及定期定额投资业务的公告；

40、2019年3月11日，刊登于《中国证券报》的关于申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务的公告；

41、2019年3月13日，刊登于《中国证券报》的申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金B类份额溢价风险提示公告。

## 第二十九部分 备查文件

(一)中国证监会准予申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金募集注册的文件

(二)《申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金基金合同》

(三)《申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金托管协议》

(四)《法律意见书》

(五)基金管理人业务资格批件和营业执照

(六)基金托管人业务资格批件和营业执照

(七)注册登记协议

(八)中国证监会要求的其他文件

存放地点：上述备查文件存放在基金管理人、基金托管人的办公场所。

查阅方式：投资者可以在办公时间免费查询；也可按工本费购买本基金备查文件复制件或复印件，但应以基金备查文件正本为准。

申万菱信基金管理有限公司

2019年4月26日