

申万菱信基金管理有限公司

关于以通讯方式召开申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告

申万菱信基金管理有限公司已于 2020 年 9 月 23 日在《中国证券报》及本公司网站（www.swsmu.com）发布了《申万菱信基金管理有限公司关于以通讯方式召开申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的公告》。为了使本次基金份额持有人大会顺利召开，现发布关于以通讯方式召开申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告。

一、召开会议基本情况

根据《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》和《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》”）的有关规定，申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金管理人申万菱信基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）经与本基金的基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，审议本基金转型方案等相关事宜，会议具体安排如下：

1、会议召开方式：通讯方式。

2、会议投票表决起止时间：自 2020 年 9 月 28 日起，至 2020 年 10 月 28 日 17:00 止（以上海市张江公证处收到表决票的时间为准）。

3、表决票的寄达地点：

收件人：上海市张江公证处 王月

收件地址：上海市浦东新区碧波路 690 号 4 号楼 7 楼

电话：021-50586277

邮政编码：201203

请在信封表面注明：“申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

4、投资者如有任何疑问，可致电本基金管理人客服中心电话 400 880 8588（免长途话费）或 +86 21 962299 咨询。

二、会议审议事项

《关于申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金转型并修改基金合同有关事项的议案》（见附件一）。

上述议案的说明请参见《关于申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金转型并修改基金合同有关事项议案的说明》（见附件四）。

三、权益登记日

本次大会的权益登记日为 2020 年 10 月 27 日，即 2020 年 10 月 27 日下午交易时间结束后在本基金注册登记机构登记在册的本基金全体基金份额持有人（包括申万证券份额、证券 A 份额与证券 B 份额的基金份额持有人）均有权参加本次基金份额持有人大会。

四、投票方式

1、本次会议表决票见附件二。基金份额持有人可剪报、复印或登陆本基金管理人网站（www.swsmu.com）下载表决票。

2、基金份额持有人应当按照表决票的要求填写相关内容，其中：

（1）个人投资者自行投票的，需在表决票上签字，并提供本人开立持有本基金基金份额的申万菱信基金账户或深圳证券账户所使用的身份证件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）正反面复印件；

（2）机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章或经授权的业务公章（以下合称“公章”），并提供该机构的加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权

部门的批文、开户证明或登记证书复印件等);

(3) 合格境外机构投资者自行投票的, 需在表决票上加盖本单位公章(如有)或由授权代表在表决票上签字(如无公章), 并提供该授权代表的有效身份证件正反面复印件, 该合格境外机构投资者所签署的授权委托书或者证明该授权代表有权代表该合格境外机构投资者签署表决票的其他证明文件, 以及该合格境外机构投资者的加盖公章的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件、取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件;

(4) 个人投资者委托他人投票的, 应由代理人在表决票上签字或盖章, 并提供基金份额持有人开立持有本基金基金份额的申万菱信基金账户或深圳证券账户所使用的身份证件(包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明)正反面复印件, 以及填妥的授权委托书原件(见附件三)。如代理人为个人, 还需提供代理人的身份证件正反面复印件; 如代理人为机构, 还需提供代理人加盖公章的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等);

(5) 机构投资者委托他人投票的, 应由代理人在表决票上签字或盖章, 并提供机构投资者的加盖公章的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等), 以及填妥的授权委托书原件(见附件三)。如代理人为个人, 还需提供代理人的身份证件正反面复印件; 如代理人为机构, 还需提供代理人加盖公章的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等);

(6) 合格境外机构投资者委托他人投票的, 应由代理人在表决票上签字或盖章, 并提供该合格境外机构投资者的加盖公章的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件、取得合格境外机构投资者资格

的证明文件的复印件，以及填妥的授权委托书原件（见附件三）；如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；

（7）以上各项中的公章、批文、开户证明及登记证书，以基金管理人的认可为准。

3、基金份额持有人或其代理人需将填妥的表决票和所需的相关文件于前述表决票收取时间内（以收到时间为准），通过专人送交或邮寄的方式，提交给上海市张江公证处。

上海市张江公证处的联系方式如下：

收件人：上海市张江公证处 王月

收件地址：上海市浦东新区碧波路 690 号 4 号楼 7 楼

电话：021-50586277

邮政编码：201203

请在信封表面注明：“申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

五、计票

1、本次通讯会议的计票方式为：由本基金管理人授权的两名监督员在基金托管人（中国工商银行股份有限公司）授权代表的监督下在本次通讯会议表决截止日期后 2 个工作日内统计全部有效表决，并由公证机构对其计票过程予以公证并形成决议；

2、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，即申万证券份额、证券 A 份额和证券 B 份额的基金份额持有人合法持有的每一基金份额在其对应的份额级别内享有平等的投票权。

3、表决票效力的认定如下：

(1) 表决票填写完整清晰，所提供文件符合本公告规定，且在规定截止时间之前送达上海市张江公证处的，为有效表决票；有效表决票按表决意见计入相应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

(2) 表决票上的表决意见未选、多选、模糊不清、相互矛盾或意见无法判断，但其他各项符合会议通知规定的视为弃权表决，弃权表决票计入对应的表决结果，其所代表的基金份额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。

(3) 表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的，或未能提供有效证明持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的，或未能在截止时间之前送达上海市张江公证处的，均为无效表决票；无效表决票不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

(4) 基金份额持有人重复提交表决票的，如各表决票表决意见相同，则视为同一表决票。如各表决票表决意见不相同，则按如下原则处理：

i . 送达时间不是同一天的，以最后送达的填写有效的表决票为准，先送达的表决票视为被撤回；

i i . 送达时间为同一天的，视为在同一表决票上做出了不同表决意见，计入弃权表决票；

i i i . 送达时间按如下原则确定：专人送达的以实际递交时间为准，邮寄的以上海市张江公证处收到的时间为准。

六、决议生效条件

1、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 份额与证券 B 份额各自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 50%（含 50%）；

2、《关于申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金转型并修改基金合同有关事项的议案》应当经参加本次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）通过方为有效；

3、本次基金份额持有人大会表决通过的事项，将由本基金管理人自通过之日起 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 日内在规定媒介上公告。法律法规另有规定的，从其规定。

七、本次大会相关机构

1、召集人：申万菱信基金管理有限公司

客服中心电话：400 880 8588（免长途话费）或 +86 21 962299

会务常设联系人：赵兵

联系电话：021-23261188

网址：www.swsmu.com

2、基金托管人：中国工商银行股份有限公司

3、律师事务所：上海市通力律师事务所

4、公证机构：上海市张江公证处

办公地址：上海市浦东新区碧波路 690 号 4 号楼 7 楼

公证员：张磊

电话：021-50586277

邮政编码：201203

八、重要提示

1、如本次基金份额持有人大会未成功召开或议案未通过的，基金管理人将根据中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国证券监督管理委员会、国家外汇管理局联合发布的《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》的要求，于2020年底完成本基金的整改，取消分级运作机制，将证券A份额与证券B份额按照基金份额参考净值折算为申万证券份额。届时，基金管理人将相应变更基金名称、修改基金合同并就取消分级运作的安排进行公告。敬请投资者合理安排投资计划；

2、请持有人在提交表决票时，充分考虑邮寄在途时间，提前寄出表决票；

3、关于本次议案的说明见附件四《关于申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金转型并修改基金合同有关事项议案的说明》；

4、基金管理人将在发布本公告后，在2个工作日内连续公布相关提示性公告，敬请基金份额持有人予以关注；

5、本基金证券A份额、证券B份额于基金份额持有人大会计票之日（2020年10月29日）开市起开始停牌至基金份额持有人大会决议生效公告日10:30复牌（如基金份额持有人大会决议生效公告发布日为非交易日，则发布日后首个交易日开市时复牌）。敬请基金份额持有人关注本基金停牌期间的流动性风险；

6、本次基金份额持有人大会有关公告可通过本基金管理人网站查阅，投资者如有任何疑问，可致电本基金管理人咨询；

7、本公告的有关内容由申万菱信基金管理有限公司负责解释。

申万菱信基金管理有限公司

2020年9月24日

（此页无正文）

附件一：《关于申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金转型并修改基金合同有关事项的议案》

附件二：《申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金基金份额持有人大会通讯表决票》

附件三：《申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金基金份额持有人大会授权委托书》

附件四：《关于申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金转型并修改基金合同有关事项议案的说明》

附件一：

关于申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金 转型并修改基金合同有关事项的议案

申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金基金份额持有人：

根据市场环境变化，为更好地满足投资者需求，保护基金份额持有人的利益，根据《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》和《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”）有关规定，申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金管理人申万菱信基金管理有限公司经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，决定召开本基金的基金份额持有人大会，提议对申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金按照《关于申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金转型并修改基金合同有关事项议案的说明》（见附件四）提出的方案实施转型。

为实施申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金转型方案，提议授权基金管理人办理本次基金转型的有关具体事宜，包括但不限于根据现时有效的法律法规的要求和《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》、《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》等法律文件和转型方案的有关内容对基金合同、托管协议、招募说明书进行必要的修改和补充，并在实施转型前披露修改后的基金法律文件；提议授权基金管理人在本基金转型实施前，制订转型方案并提前公告；提议授权基金管理人在本基金转型期间根据届时有效的相关规则暂停基金的申购、赎回等业务，终止上市并进行基金份额的转换以及其他有

关本次基金转型的具体事宜。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定，基金管理人将在决议通过后、转型实施前预留不少于二十个开放日或交易日供基金份额持有人选择赎回、转出或卖出。

以上议案，请予审议。

基金管理人：申万菱信基金管理有限公司

2020 年 9 月 24 日

附件二：

申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金 基金份额持有人大会通讯表决票

基金份额持有人基本资料			
持有人姓名/名称			
持有人证件号码			
委托代理人姓名或名称			
委托代理人证件号码			
持有人基金账户号/证券账户号 （本栏可不填写，若不填写，则本表决票所示表决意见将默认代表该基金份额持有人持有的全部份额的表决意见。）			
《关于申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金转型并修改基金合同有关事项的议案》的表决意见	同意	反对	弃权
个人基金份额持有人签字栏 签字： 日期：	机构基金份额持有人签章栏 单位公章： 日期：		

关于表决票的填写说明：

1、请就审议事项表示“同意”、“反对”或“弃权”并在相应表决栏内划“√”，同一议案只能表示一项意见。

2、若基金份额持有人或其代理人未作特别说明，则以上表决意见是持有人或其代理人就持有人持有的本基金全部份额做出的表决意见。

3、本表决票的“持有人基金账户号/证券账户号”一栏中，“基金账户号”指持有申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金场外份额的基金账户号，“证券账户号”指持有申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金场内份额的证券账户号。

同一基金份额持有人拥有多个此类账户号且需要按照不同账户持有基金份额分别行使表决权的，应当填写基金账户号/证券账户号，其他情况可不必填写。

持有人基金账户号/证券账户号空白、多填、错填、无法识别等情况，将被默认为代表此基金份额持有人所持有的申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金所有份额。

4、表决票上的表决意见未选、多选、模糊不清、相互矛盾或意见无法判断，但其他各项符合会议通知规定的视为弃权表决，弃权表决票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。

5、表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的，或未能提供有效证明持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的，或未能在截止时间之前送达上海市张江公证处的，均为无效表决票；无效表决票不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

6、本表决票可剪报、复印或按以上格式自制，在填写完整并签字盖章后均为有效。

附件三：

申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金 基金份额持有人大会授权委托书

兹委托[]先生(女士)或[]单位代表本人(本单位)参加投票截止日为 2020 年 10 月 28 日 17:00 止召开的申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金基金份额持有人大会，并代为全权行使对所有议案的表决权，表决意见以受托人/代理人的表决意见为准。授权有效期自签署日起至本次基金份额持有人大会会议结束之日止。本授权不得转授权。

委托人（个人持有人签字/机构持有人盖章）：

委托人证件号码（个人持有人身份证号/机构持有人营业执照注册号）：

受托人/代理人（个人受托人签字/机构受托人盖章）：

受托人/代理人证件号码（个人受托人身份证号/机构受托人营业执照注册号）：

委托日期：2020 年 月 日

附注：

- 1、此授权委托书可剪报、复印或按以上格式自制，在填写完整并签字盖章后均为有效。
- 2、受托人/代理人的表决意见代表委托人在权益登记日所持全部基金份额的表决意见。

附件四：

关于申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金 转型并修改基金合同有关事项议案的说明

一、重要提示

（一）申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）于 2014 年 3 月 13 日成立，证券 A 份额和证券 B 份额于 2014 年 3 月 31 日起在深圳证券交易所上市交易，申万菱信基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）为本基金的基金管理人。鉴于目前基金市场需求的变化，为维护基金份额持有人利益，根据《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》、《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》”）的有关规定，本基金管理人申万菱信基金管理有限公司经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，决定以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议《关于申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金转型并修改基金合同有关事项的议案》。

（二）本次申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金转型事宜属原注册事项的实质性调整，经基金管理人向中国证监会申请，已经中国证监会准予变更注册。中国证监会对本次基金变更注册所作的任何决定或意见，均不表明其对本次基金合同转型方案或本基金的价值或投资者的收益做出实质性判断或保证。

（三）本次基金份额持有人大会需要由本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人或其代理人所代表的有效的申万证券份额、证券 A 份额与证券 B 份额各自基金份额分别合计占权益登记日对应的各级别基金总份额的 50%以上（含 50%）方可召开；同时，本次转型方案需经参加本次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）通过方为有效，存在无法获得基金份额持有人大会表决通过的可能；

（四）本次基金份额持有人大会表决通过的事项，本基金管理人自通过之日起 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 日内在规定媒介上公告。法律法规另有规定的，从其规定。

二、基金转型方案要点及基金合同修改内容要点

（一）变更基金名称

基金名称由“申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金”变更为“申万菱信中证申万证券行业指数型证券投资基金（LOF）”。

（二）不再设置基金份额的分级、折算与配对转换机制

“申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金”拟转型为“申万菱信中证申万证券行业指数型证券投资基金（LOF）”，转型后由分级基金变更为股票型指数基金，运作方式变更为上市契约型开放式（LOF），因此不再设置基金份额的分级、折算与配对转换等机制。

（三）基金份额的终止上市

本基金份额持有人大会决议生效后，本基金管理人将按照深圳证券交易所业务规则申请证券 A 份额和证券 B 份额终止上市交易。

（四）变更后基金的基本情况

- 1、基金名称：申万菱信中证申万证券行业指数型证券投资基金（LOF）
- 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（LOF）
- 4、基金标的指数：中证申万证券行业指数及其未来可能发生的变更或基金管理人按照基金合同约定更换的其他指数。
- 5、基金存续期限：不定期
- 6、若将来本基金管理人推出跟踪同一标的指数的交易型开放式指数基金（ETF），则基金管理人可以在履行适当程序后使本基金采取 ETF 联

接基金模式运作并相应修改《基金合同》，届时无需召开基金份额持有人大会，但需报中国证监会备案并提前公告。ETF 联接基金是指其绝大部分基金资产投资于同一标的指数的交易型开放式指数基金（ETF），以紧密跟踪标的指数为目的的指数化产品。法律法规另有规定的从其规定。

（五）变更后基金的基金份额的上市交易

1、基金份额上市

申万菱信中证申万证券行业指数型证券投资基金（LOF）基金合同生效后，具备下列条件的，基金管理人可依据《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》，向深圳证券交易所申请本基金基金份额上市：

- （1）基金募集金额不低于 2 亿元；
- （2）基金份额持有人不少于 1,000 人；
- （3）《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》规定的其他条件。

基金上市前，基金管理人应与深圳证券交易所签订上市协议书。基金获准在深圳证券交易所上市的，基金管理人应按照相关规定发布基金上市交易公告书。

2、基金份额的上市交易

基金份额在深圳证券交易所的上市交易需遵照《深圳证券交易所交易规则》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》、《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》等有关规定。

3、上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市

上市基金份额的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》等的相关规定执行。

当本基金发生深圳证券交易所相关规定所规定的因不再具备上市条件而应当终止上市的情形时，本基金变更为跟踪标的指数的非上市的开放式指数基金，基金名称变更为“申万菱信中证申万证券行业指数型证券投资基金”，而无需召开基金份额持有人大会审议。基金转型并终止上市后，对于本基金场内份额的处理规则由基金管理人提前制定并公告。

若届时本基金管理人已有以该指数作为标的指数的指数基金，则基金管理人将本着维护基金份额持有人合法权益的原则，履行适当的程序后与该指数基金合并或者选取其他合适的指数作为标的指数。

4、在不违反法律法规及不损害基金份额持有人利益的前提下，在履行适当程序后，本基金可以申请在包括境外交易所在内的其他证券交易所上市交易，而无需召开基金份额持有人大会审议。

（六）变更后基金的存续

申万菱信中证申万证券行业指数型证券投资基金（LOF）基金合同生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当在 10 个工作日内中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

（七）变更后基金的投资目标、投资范围、投资策略、投资限制、标的指数、业绩比较基准、风险收益特征

1、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平均跟踪误差不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%，实现对标的指数的有效跟踪。

2、投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。

为更好地实现基金的投资目标，本基金可能会少量投资于国内依法发行上市的非成份股（包括主板、中小板、创业板及其他依法发行、上市的股票）、债券（含国债、央行票据、金融债、次级债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、可转债及分离交易可转债、可交

换债券、地方政府债等）、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

本基金可以参与融资和转融通证券出借业务。

在建仓完成后,本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%,且不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终,在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

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。

3、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

本基金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

i 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；

ii 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；

iii 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) 其他金融工具投资策略

本基金可以投资于债券和资产支持证券等固定收益类工具，固定收益类资产投资的目的是有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。

本基金为提高投资效率更好地达到本基金的投资目标，在风险可控的前提下，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。本基金主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金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。此外，本基金还将运用股指期货来对冲特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理，如在基金出现巨额或较大申购赎回时，通过股

指期货及时进行加仓或减仓，迅速的进行仓位调整，以达成申购赎回对基金运作带来的影响最小化的目的。

本基金在参与融资业务时将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资业务。参与融资业务时，本基金将力争利用融资的杠杆作用，降低因申购造成基金仓位较低带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

为更好实现投资目标，在加强风险防范和坚持审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场情况、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性情况等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、期限和比例。

本基金管理人运用上述金融衍生工具必须是出于追求基金充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差的目的，不得应用于投机交易目的。

若相关法律法规发生变化时，基金管理人对上述金融衍生工具投资管理从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。未来如法律法规或监管机构允许基金投资其他金融衍生工具，本基金将在履行适当程序后，纳入投资范围并制定相应投资策略。

4、投资限制

（1）组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

1）本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；

2）每个交易日日终，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等；

3）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%；

4) 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%；

5) 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%；

6) 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%；

7) 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；

8) 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；

9) 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%，进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

10) 基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

11) 本基金参与股指期货交易后，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，持有的买入股指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）、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，持有的卖出股指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) 若本基金参与融资的，在任何交易日日终，本基金融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；

13) 本基金参与转融通证券出借交易的资产不得超过基金资产净值的 30%，出借期限在 10 个交易日以上的出借证券应纳入第 16) 条所述的流动性受限资产的范围；参与出借业务的单只证券不得超过本基金持有该证券总量的 50%；证券出借的平均剩余期限不得超过 30 天，平均剩余期限按照市值加权平均计算；最近 6 个月内日均基金资产净值不得低于 2 亿元；

14) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%，但完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的，不受前述限制；

15) 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%，但完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的，不受前述限制；

16) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

17) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，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；

18) 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)、7)、13)、16)、17) 项外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变

动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述第 13) 条规定的，基金管理人不得新增出借业务。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。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。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。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制，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或按照调整后的规定执行，且该等事项无需召开基金份额持有人大会。

(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。

基金管理人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重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

如法律、行政法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定，在履行适当程序后，本基金可不受上述规定的限制或按变更后的规定执行，且该等事项无需召开基金份额持有人大会。

5、基金标的指数

本基金的标的指数为中证申万证券行业指数及其未来可能发生的变更或基金管理人按照基金合同约定更换的其他指数。

6、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为中证申万证券行业指数收益率 $\times 95\%$ +银行同业存款利率 $\times 5\%$ 。

如果指数编制单位更改以上指数名称、停止或变更以上指数的编制或发布，或以上指数由其他指数替代、或由于指数编制方法等重大变更导致以上指数不宜继续作为业绩比较基准，或市场上出现其他代表性更强、更加适用于本基金的业绩比较基准时，本基金管理人可以根据本基金的投资范围和投资策略，在取得基金托管人同意，按照监管部门要求履行适当程序后调整基金的业绩比较基准并及时公告，而无须召开基金份额持有人大会审议。

7、风险收益特征

本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

本基金为被动式投资的股票型指数基金，跟踪中证申万证券行业指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

（八）变更后的基金资产估值

1、证券交易所上市的非固定收益品种的估值

交易所上市的非固定收益品种（包括股票等），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、交易所市场交易的固定收益品种的估值

(1) 对在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(另有规定的除外),选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值;

(2) 对在交易所市场上市交易的可转换债券,按估值日收盘价减去可转换债券收盘价中所含债券应收利息(税后)后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或证券发行人未发生影响证券价格的重大事件,按最近交易日债券收盘价减去最近交易日债券收盘价中所含的债券应收利息(税后)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或证券发行人发生影响证券价格的重大事件,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) 交易所上市实行全价交易的债券(可转债除外),选取第三方估值机构提供的估值全价减去估值全价中所含的债券应收利息(税后)得到的净价进行估值;

(4) 对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券,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。

3、银行间市场交易的固定收益品种,选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。

4、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;

(2) 首次公开发行未上市的股票,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) 非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值；

(4) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的固定收益品种，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) 对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的固定收益品种，按成本估值。

5、同一固定收益品种同时在两个或两个以上市场交易的，按固定收益品种所处的市场分别估值。

6、本基金投资股指期货等衍生品种合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

7、持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按相应利率逐日计提利息。

8、本基金参与转融通证券出借业务的，参照法律法规和行业协会的相关规定进行估值。

9、其他资产按法律法规或监管机构有关规定进行估值。

10、如基金管理人认为按上述方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人在综合考虑市场各因素的基础上，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方法估值。

11、当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。

12、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，按照基金管理人对于基金净值信息的计算结果对外予以公布。

（九）变更后基金的费率水平

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日次日起每日计提，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，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

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日次日起每日计提，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，经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金资产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

3、基金标的指数许可使用费

本基金作为契约型开放式指数基金，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支付指数许可使用费。基金管理人应及时按照《信息披露办法》的规定在规定媒介进行公告。标的指数许可使用费的费率、具体计算方法、收取下限和支付方式请参见招募说明书。

如果指数使用许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、费率、收取下限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费，且无需召开基金份额持有人大会。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等。

（十）变更后基金的收益分配原则

本基金不进行收益分配。

在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，无需召开基金份额持有人大会。

（十一）变更后基金的申购、赎回

1、申购和赎回场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。本基金场外申购和赎回场所为基金管理人的直销柜台、网上直销系统及各场外销售机构的基金销售网点，场内申购和赎回场所为深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位，具体的销售机构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，并在基金管理人网站公

示。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基金份额的申购与赎回。

2、申购和赎回的开放日及时间

（1）开放日及开放时间

投资者在开放日办理基金份额的申购和赎回，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或期货市场、证券交易所或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》的有关规定在规定媒介上公告，具体时间以基金管理人届时公告为准。

（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个月开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

本基金可在基金上市交易之前开始办理申购、赎回，但在基金申请上市期间，可暂停办理申购、赎回。

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》的有关规定在规定媒介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基金份额的申购、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，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。

3、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基金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；

(4) 赎回遵循“先进先出”原则，即按照登记机构基金份额登记的先后次序进行顺序赎回；

(5) 办理申购、赎回业务时，应当遵循基金份额持有人利益优先原则，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待；

(6) 投资者通过场外申购、赎回应使用中国证券登记结算有限责任公司开立的开放式基金账户，通过场内申购、赎回应使用中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开立的深圳证券账户（人民币普通股票账户和证券投资基金账户）；

(7) 本基金的场内申购、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的相关业务规则执行。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场内申购、赎回业务等规则有新的规定，按新规定执行。

基金管理人可在法律法规允许的情况下，或依据深圳证券交易所、登记机构的相关规则及其变更调整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》的有关规定在规定媒介上公告。

4、申购与赎回的程序

(1) 申购和赎回的申请方式

投资者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。

投资者办理申购、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

投资者申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资者全额交付申购款项，申购成立；基金份额登记机构确认基金份额时，申购生效。基金份额持有人在提交赎回申请时，必须有足够的份额余额，则赎回成立；基金份额登记机构确认赎回时，赎回生效。

投资者赎回申请生效后，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。

遇交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其他非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程，则赎回款项划付时间相应顺延。

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》的有关规定在规定媒介上提前公告。

（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（包括该日）内对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请，投资者应在 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。若申购不成立或无效，则申购款项本金退还给投资者。

销售机构对申购、赎回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。申购、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。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的确认而产生的后果，由投资者自行承担。

5、申购和赎回的数量限制

（1）申购金额的限制

通过本基金除基金管理人以外的其他销售机构进行场外申购，首次申购最低金额为人民币 1 元（含申购费），追加申购的最低金额为人民币 1 元（含申购费）；各销售机构对最低申购限额及交易级差有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准。

通过基金管理人的直销中心进行场外申购，单个基金账户单笔首次申购最低金额为人民币 10 元（含申购费），追加申购最低金额为单笔人民币 10 元（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。

通过具有基金销售业务资格且符合深圳证券交易所有关风险控制要求的深圳证券交易所会员单位场内申购基金，首次申购最低金额为人民币 1 元（含申购费），追加申购的最低金额为人民币 1 元（含申购费）。

本基金对单个投资人的累计申购金额不设上限，但单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的 50%（在基金运作过程中因基金份额赎回、基金份额上市交易、基金管理人委托的登记机构技术条件不允许等基金管理人无法予以控制的情形导致被动达到或超过 50%的除外）。投资人将持有的基金份额当期分配的基金收益转为基金份额时，不受最低申购金额的限制。

（2）赎回份额的限制

基金份额持有人在销售机构场外赎回时，每笔赎回申请不得低于 1 份基金份额（但交易账户内剩余基金份额不足 1 份的除外）；基金份额持有人在销售机构的某一交易账户内基金份额不足 1 份的，应一次性全部赎回。基金份额持有人办理基金份额场内赎回时，赎回份额必须是整数份额。

（3）基金管理人有权规定本基金的总规模限额，以及单日申购金额上限和净申购比例上限，具体规定请参见招募说明书或相关公告。

(4) 对于场内申购、赎回及持有场内份额的数量限制等，深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则有规定的，从其规定办理。

(5) 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。

(6) 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》的有关规定在规定媒介上公告。

6、申购与赎回的登记

投资人 T 日申购基金成功后，本基金登记机构在 T+1 日为投资人增加权益并办理登记结算手续，投资人自 T+2 日起有权赎回该部分基金份额。

投资人 T 日赎回基金成功后，本基金登记机构在 T+1 日为投资人扣除权益并办理相应的登记结算手续。

在法律法规允许的范围内，本基金登记机构可对上述登记结算办理时间进行调整，本基金管理人将于开始实施前按照《信息披露办法》有关规定，在规定媒介公告。

7、申购费用与赎回费用

(1) 申购费用

本基金对通过基金管理人直销中心申购基金份额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基金份额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。

基金份额的申购费用由投资人承担，不列入基金财产，用于基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

本基金的场外申购费率如下表：

申购金额（元）	特定申购费率	申购费率
100 万以下	0.36%	1.20%
100 万（含）—300 万	0.24%	0.80%
300 万（含）—500 万	0.15%	0.50%
500 万（含）以上	300 元/笔	1,000 元/笔

本基金的场内申购费率由基金场内销售机构参照场外申购费率执行。

（2）基金份额的赎回费用

本基金的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对于持续持有期少于 7 日的投资人收取的赎回费，将全额计入基金财产；对于持续持有期不少于 7 日的投资者，赎回费用不纳入基金财产，用于支付市场推广、销售、登记费和其他必要的手续费。对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费，并全额计入基金财产。

本基金场外赎回费率如下表：

持有期限	赎回费率
7 日以内	1.50%
7 日（含）—90 日	0.50%
90 日（含）—180 日	0.25%
180 日（含）以上	0.00%

本基金的场内赎回费率如下表：

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》的有关规定在规定媒介上公告。

（4）基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情形下根据市场情况制定基金促销计划，定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以在对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下适当调低基金销售费率，并进行公告。

（十二）转型选择期的相关安排

本基金份额持有人大会决议生效后，本基金将在转型正式实施前安排不少于 20 个开放日或交易日的选择期，以供基金份额持有人做出赎回、卖出等选择，具体时间安排详见基金管理人届时发布的相关公告。对于在选择期内未作出选择的基金份额持有人，其持有的申万证券份额、证券 A 份额或证券 B 份额将最终将转换为申万菱信中证申万证券行业指数型证券投资基金（LOF）。

在选择期期间，申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金仍按照原《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》约定的运作方式进行运作，投资者在选择期期间选择赎回的，适用申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金的赎回费率和赎回费计入基金财产的比例。由于本基金需应对赎回等情况，基金份额持有人同意在选择期豁免本基金基金合同中约定的投资组合比例限制等条款，并自本次基金份额持有人大会议案被表决通过之日起豁免进行基金份额折算业务。基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人据此落实相关事项，并授

权基金管理人可根据实际情况做相应调整，以及根据实际情况可暂停申购、赎回或调整赎回方式等。

（十三）基金份额的转换业务

本基金管理人将在基金份额持有人大会决议生效、转型选择期届满后确定份额转换基准日，将申万证券份额、证券 A 份额和证券 B 份额转换为申万菱信中证申万证券行业指数型证券投资基金（LOF）。

在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登记在册的场内申万证券份额、证券 A 份额和证券 B 份额将转换为申万菱信中证申万证券行业指数型证券投资基金（LOF）的场内份额，在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登记在册的场外申万证券份额将转换为申万菱信中证申万证券行业指数型证券投资基金（LOF）的场外份额。

证券 A 份额（或证券 B 份额）转换为申万菱信中证申万证券行业指数型证券投资基金（LOF）的场内基金份额数截位取整计算（最小单位为 1 份），舍去部分计入基金财产。由于基金份额数取整计算存在误差，基金份额持有人将面临资产净值减小的风险；对于持有份额数较少的证券 A 份额、证券 B 份额和申万证券场内份额持有人，将面临因持有的基金份额转换后份额数不足 1 份而被计入基金财产的风险。

由申万证券份额的场内份额或申万证券份额的场外份额转换的申万菱信中证申万证券行业指数型证券投资基金（LOF）的份额数=申万证券份额的场内份额或申万证券份额的场外份额数×份额转换基准日申万证券份额的基金份额净值÷1.0000

由证券 A 份额转换的申万菱信中证申万证券行业指数型证券投资基金（LOF）的份额数=证券 A 份额的场内份额数×份额转换基准日每份证券 A 份额的基金份额参考净值÷1.0000

由证券 B 份额转换的申万菱信中证申万证券行业指数型证券投资基金（LOF）的份额数=证券 B 份额的场内份额数×份额转换基准日每份证券 B 份额的基金份额参考净值÷1.0000

为尽可能减少因基金份额净值、基金份额参考净值小数保留位数带来的计算误差，以上计算时采用的基金份额净值、基金份额参考净值的小数保留位数可能会多于公布的基金份额净值、基金份额参考净值的小数保留位数。

基金份额转换后，申万菱信中证申万证券行业指数型证券投资基金（LOF）之的场内份额数截位取整计算（最小单位为 1 份），舍去部分计入基金财产。由于基金份额数取整计算产生的误差，基金份额持有人将面临资产净值减小的风险。经基金份额转换后，申万菱信中证申万证券行业指数型证券投资基金（LOF）的场外份额数采用截位法保留到小数点后两位，舍去部分计入基金财产。

证券 A 份额和证券 B 份额转换为申万菱信中证申万证券行业指数型证券投资基金（LOF）场内份额的持有期将按照中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的相关规则执行，投资者持有的转换后的场内份额持有期将自份额转换处理日开始计算，若投资者选择赎回，将适用该持有期对应的赎回费率。中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司另有规定的，从其规定。

场外申万证券份额转换为申万菱信中证申万证券行业指数型证券投资基金（LOF）场外基金份额持有期在转换前后连续计算。

基金份额转换结束后，基金管理人将在规定媒介公告，并报中国证监会备案。

（十四）基金合同的生效

本基金份额持有人大会决议生效后，基金管理人将根据基金份额持有人大会的决议办理本基金转型及份额转换业务，基金转型后，本基金名称将由“申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金”更名为“申

万菱信中证申万证券行业指数型证券投资基金（LOF）”，关于《申万菱信中证申万证券行业指数型证券投资基金（LOF）基金合同》生效及《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》失效的时间安排，请详见基金管理人届时发布的相关公告。

（十五）授权基金管理人办理本次基金转型及基金合同等法律文件修改的有关事宜

基金管理人拟提请基金份额持有人大会授权基金管理人按照法律法规的规定、变更注册后的申万菱信中证申万证券行业指数型证券投资基金（LOF）产品特征以及《关于申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金转型并修改基金合同有关事项议案的说明》列明的转型方案要点修订基金合同，授权基金管理人制定基金转型方案并办理本次基金转型的具体事宜，在转型实施前，由基金管理人根据基金份额持有人大会的授权，制订有关基金转型正式实施的日期、转型实施前的申购赎回、份额折算安排等事项的转型实施安排规则并提前公告。

三、基金管理人就方案相关事项的说明

（一）申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金的历史沿革

申万菱信中证申万证券行业指数型证券投资基金（LOF）由申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金变更注册而来。申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金经中国证监会证监许可【2014】141号文准予募集，基金管理人为申万菱信基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金原基金名称为申万菱信申银万国证券行业指数分级证券投资基金，鉴于本基金跟踪标的指数名称自2015年4月16日起由“申银万国证券行业指数”变更为“中证申万证券行业指数”，本基金名称自2015年4月16日起相应变更为申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金。

申万菱信申银万国证券行业指数分级证券投资基金自 2014 年 2 月 24 日至 2014 年 3 月 7 日进行公开募集，募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续。经中国证监会书面确认，《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》于 2014 年 3 月 13 日生效。

（二）基金转型的可行性

1、法律层面不存在障碍

根据《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》的规定，当出现或需要决定转换基金运作方式，变更基金类别，变更基金投资目标、范围或策略，终止证券 A 份额与证券 B 份额上市等事项时，应当召开基金份额持有人大会。

选择通讯开会的，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）。

除基金合同另有约定外，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。

因此，申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金转型为申万菱信中证申万证券行业指数型证券投资基金（LOF）具有法律和合同依据。

2、基金转型不存在技术障碍

申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金转型后，将进行基金份额变更登记。基金管理人已就变更登记有关事项进行了充分准备，技术可行。基金转型不存在技术障碍。

四、基金转型的主要风险及预备措施

（一）转型方案被基金份额持有人大会否决的风险

为防范终止转型方案被基金份额持有人大会否决的风险，基金管理人可能提前向基金份额持有人征询意见。如有必要，基金管理人将根据基金份额持有人意见，在履行相关程序后对转型方案进行适当的修订，并重新公告。基金管理人可以在必要的情况下，推迟基金份额持有人大会的召开时间，或更改其他会务安排，并予以公告。

如本次基金份额持有人大会未成功召开或议案未通过的，基金管理人将根据中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国证券监督管理委员会、国家外汇管理局联合发布的《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》的要求，于 2020 年底完成本基金的整改，取消分级运作机制，将证券 A 份额与证券 B 份额按照基金份额参考净值折算为申万证券份额。届时，基金管理人将相应变更基金名称、修改基金合同并就取消分级运作的安排进行公告。敬请投资者合理安排投资计划。

（二）基金转型后风险收益特征或产品风险等级变化的风险

由于基金转型后运作方式等发生较大变化，影响基金的风险收益特征，转型前证券 A 份额具有预期风险低，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。转型后基金的风险收益特征为，申万菱信中证申万证券行业指数型证券投资基金（LOF）属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，该基金为被动式投资的股票型指数基金，跟踪中证申万证券行业指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

同时，不同的销售机构采用的风险评价方法也不同，因此存在基金变更前后风险等级不一致的可能。提示投资者关注。

（三）基金转型过程中的操作风险和管理风险

对于基金转型后运作过程中的相关运作风险，基金管理人将提前做好充分的内部沟通及外部沟通，积极避免基金转型过程中及基金转型后的运作过程中出现相关操作风险和管理风险。

五、基金管理人联系方式

基金份额持有人若对本方案的内容有任何意见和建议,请通过以下方式联系基金管理人:

联系人: 申万菱信基金管理有限公司客服中心

联系电话: 400 880 8588 (免长途话费) 或 +86 21 962299

网址: www.swsmu.com

申万菱信基金管理有限公司

2020年9月24日