

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型  
证券投资基金  
更新招募说明书  
(2023 年第 2 号)

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

二〇二三年十二月

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

申万菱信中证申万证券行业指数型证券投资基金由申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金终止分级运作并变更而来。

申万菱信申银万国证券行业指数分级证券投资基金依据《基金法》于 2014 年 1 月 26 日获中国证监会证监许可【2014】141 号文准予募集，2015 年 4 月 2 日因为标的指数名称变更而调整基金名称为申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金。

申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金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。基金管理人于 2014 年 3 月 13 日获得中国证监会书面确认，《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》生效。

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》约定，申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金应根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》等法律法规规定终止证券 A 份额与证券 B 份额的运作，无需召开基金份额持有人大会。据此，基金管理人已于 2020 年 12 月 2 日在指定媒介发布《关于申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金之证券 A 份额、证券 B 份额终止运作、终止上市并修改基金合同的公告》，向深圳证券交易所申请申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金的两级子份额退市，并于 2020 年 12 月 31 日（基金折算基准日）进行基金份额折算，《申万菱信中证申万证券行业指数型证券投资基金基金合同》于基金折算基准日次日正式生效，《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》同时失效。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）注册。中国证监会对申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金终止分级运作变更为本基金的备案，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。投资者投资于本基金，必须自担风险。

本基金标的指数为中证申万证券行业指数。指数编制方案简介如下：

### （1）样本空间

同中证全指指数的样本空间

(2) 选样方法

1) 对样本空间内证券按照过去一年的日均成交金额由高到低排名，剔除排名后 20% 的证券；

2) 对样本空间内剩余证券，选取归属于证券行业的上市公司证券作为待选样本。

有关标的指数具体编制方案及成份股信息详见中证指数有限公司网站，网址：[www.csindex.com.cn](http://www.csindex.com.cn)。

本基金投资于证券、期货市场，基金净值会因为证券、期货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：市场风险、信用风险、管理风险、本基金特有的风险、金融期货投资风险、资产支持证券投资风险、税负增加风险、流动性风险和其他风险。

本基金为指数基金，投资者投资于本基金面临跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份股停牌等潜在风险，详见本基金招募说明书“风险揭示”章节。

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、基金合同及基金产品资料概要等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。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。

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。

本基金的投资范围包括存托凭证，若投资可能面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与创新企业、境外发行人、中国存托凭证发行机制以及交易机制等相关的风险。

本基金本次更新招募说明书为年度更新。所载内容中有关财务数据和净值表现截止日为 2023 年 9 月 30 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 .....	12
第四部分 基金托管人 .....	23
第五部分 相关服务机构 .....	28
第六部分 基金的历史沿革 .....	29
第七部分 基金的存续 .....	30
第八部分 基金份额的上市交易 .....	31
第九部分 基金份额的申购与赎回 .....	33
第十部分 基金的非交易过户、转托管、冻结与解冻 .....	46
第十一部分 基金的投资 .....	48
第十二部分 基金的财产 .....	60
第十三部分 基金资产估值 .....	61
第十四部分 基金费用与税收 .....	66
第十五部分 基金的收益与分配 .....	70
第十六部分 基金的会计与审计 .....	72
第十七部分 基金的信息披露 .....	73
第十八部分 风险揭示 .....	79
第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算 .....	87
第二十部分 基金合同内容摘要 .....	88
第二十一部分 基金托管协议的内容摘要 .....	113
第二十二部分 对基金份额持有人的服务 .....	128
第二十三部分 招募说明书的存放及查阅方式 .....	130
第二十四部分 其它应披露事项 .....	131
第二十五部分 备查文件 .....	131

## 第一部分 绪言

《申万菱信中证申万证券行业指数型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》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集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》、《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》及其他相关法律法规及《申万菱信中证申万证券行业指数型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，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，如本招募说明书内容与基金合同有冲突或不一致之处，均以基金合同为准。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型证券投资基金，由申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金终止分级运作并变更而来

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型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型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型证券投资基金招募说明书》及其更新

7、上市交易公告书：指《申万菱信中证申万证券行业指数型证券投资基金上市交易公告书》

8、基金产品资料概要：指《申万菱信中证申万证券行业指数型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新

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 2020 年 8 月 28 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》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 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的《公开募集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 2004 年 6 月 29 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《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、《指数基金指引》：指中国证监会 2021 年 1 月 22 日颁布、同年 2 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》及颁布机关对其不时做出的修订

16、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

17、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

18、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

19、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

20、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

21、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

22、基金份额持有人大会：指按照基金合同第十部分之规定召集、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

23、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

24、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

25、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，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

26、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。

27、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

28、会员单位：指深圳证券交易所会员单位

29、销售场所：指场外销售场所和场内销售场所

30、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申购和赎回等业务的场所。通过该等场所办理基金份额的申购、赎回也称为场外申购、场外赎回

31、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申购、赎回也称为场内申购、场内赎回

32、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

33、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

34、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，通过场外销售机构申购的基金份额登记在注册登记系统

35、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，通过场内会员单位申购或买入的基金份额登记在证券登记结算系统

36、上市交易所：指深圳证券交易所

37、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

38、场外份额：指登记在注册登记系统下的基金份额

39、场内份额：指登记在证券登记结算系统下的基金份额

40、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

41、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

42、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股票账户（即 A 股账户）或证券投资基金账户

43、基金合同生效日：指《申万菱信中证申万证券行业指数型证券投资基金基金合同》生效日，《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》自同一日失效

44、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

45、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

46、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

47、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

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

49、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

50、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

51、《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

52、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

53、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

54、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

55、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

56、跨系统转托管：指基金份额持有人将其持有的 A 类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。除非基金管理人另行公告，本基金不支持 C 类基金份额进行跨系统转托管

57、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

58、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

59、销售服务费：指本基金用于持续销售和服务基金份额持有人的费用，该笔费用从基金财产中计提，属于基金的营运费用

60、基金份额分类：本基金根据申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人申购时，收取申购费用，并不再从本类别基金财产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；不收取申购费用，但从本类别基金财产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。两类基金份额分设不同的基金代码，并分别公布基金份额净值

61、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的 10%

62、元：指人民币元

63、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

64、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

65、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

66、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

67、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

68、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

69、摆动定价机制：指当遭遇大额申购赎回时，通过调整基金申购赎回价格的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待

70、指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊及指定互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介

71、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

注册地址：上海市中山南路 100 号 11 层

办公地址：上海市中山南路 100 号 11 层

法定代表人：陈晓升

设立日期：2004 年 01 月 15 日

批准设立机关及批准设立文号：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

联系电话：021-23261188

联系人：蔡琳娜

股权结构：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

陈晓升先生，董事长，硕士研究生。1994 年起从事金融相关工作，曾任上海申银万国证券研究所有限公司总经理、申万宏源证券有限公司总经理助理等职。2021 年 6 月加入申万菱信基金管理有限公司，现任公司党总支书记、董事长。

王慧晶女士，董事，硕士研究生。2007 年起从事金融相关工作，曾任职于宏源证券，现任申万宏源证券有限公司机构客户总部党支部书记、总经理。

金杰先生，董事，大学本科。1994 年起从事金融相关工作，曾任职于万国证券、申银万国证券等，现任申万宏源证券有限公司财富管理事业部副总经理兼运营管理部总经理。

安田敬之先生，董事，日本籍，大学学历。1987 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），曾任职于市场国际部、伦敦分行、海外资产管理事业部、受托财产企划部等，现任公司副社长、受托财产部门长；MUFU

执行役专务，受托财产事业本部长。

福井雄介先生，董事，日本籍，大学学历。1996年4月至今任职于三菱UFJ信托银行株式会社，曾任职于高松分行、企业金融部、信用投资部、纽约分行、海外资产管理事业部等，现任资产管理事业部国际协同战略室室长。

汪涛先生，董事，硕士研究生。2003年起从事金融相关工作，曾任职于汇丰银行、新加坡华侨银行、渣打银行、宁波银行、永赢基金管理有限公司、平安基金管理有限公司等。2020年3月加入申万菱信基金管理有限公司，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长。

杨晔女士，独立董事，博士研究生。2005年9月起任职于上海财经大学，曾任职于上海财经大学财经研究所副研究员、公共经济与管理学院投资系副研究员，现任公共经济与管理学院投资系教授。

马晨光女士，独立董事，硕士研究生。曾任职于上海怡东建设发展有限公司，现任上海市协力律师事务所高级合伙人。

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

刘震先生，监事会主席，博士研究生。1997年7月起从事金融相关工作，曾任职于申万宏源证券有限公司（原申银万国证券股份有限公司）研发中心、计统部、办公室，现任申万菱信基金管理有限公司监事会主席、党总支副书记，兼任申万菱信（上海）资产管理有限公司监事会主席。

增田义之先生，监事，日本籍，硕士研究生。1989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），曾任职于资产运用部、股票运用部、指数战略运用部、受托财产企划部等，现任资产管理事业部特聘专家职务。

葛诚亮先生，职工监事，硕士研究生。2011年2月加入申万菱信基金管理有限公司，从事风险管理工作，现任风险管理部负责人。

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，现任组织与人力资源部负责人。

### 3、高级管理人员

汪涛先生，相关介绍见董事会成员部分。

周小波先生，硕士研究生。2006年起从事金融相关工作，曾任职于上海申银万国证券研究所有限公司、太平资产管理有限公司。2020年5月加入申万菱信基金管理有限公司，现任公司副总经理，兼任申万菱信（上海）资产管理有限公司董事。

史莉珠女士，大学本科学历。曾任职于中国住总集团建设总公司、香港佳勇国际有限公司，1994年起从事金融相关工作，曾任职于北京京华信托有限责任公司、申银万国证券股份有限公司北京分公司、申万宏源证券有限公司、申万宏源证券承销保荐有限责任公司等。2022年2月加入申万菱信基金，现任公司副总经理兼财务负责人，兼任申万菱信（上海）资产管理有限公司董事。

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，兼任申万菱信（上海）资产管理有限公司监事。

钟瑜阳先生，硕士研究生。曾任江西科益高新技术有限公司系统工程师，上海天玑科技股份有限公司技术服务工程师，2011年起从事金融相关工作，曾任财通基金管理有限公司信息技术部经理、高级经理、总监助理、副总监（主持工作）等职。2021年11月加入申万菱信基金管理有限公司，现任公司首席信息官，兼任申万菱信（上海）资产管理有限公司董事。

### 4、基金经理

#### （1）现任基金经理

王赟杰先生，博士研究生。2011年起从事金融相关工作，曾任职于海通期货、华鑫证券、海富通基金、中信建投证券等，2020年3月加入申万菱信基金，曾任申万菱信中证申万医药生物指数型证券投资基金、申万菱信上证G60战略新

兴产业成份交易型开放式指数证券投资基金基金经理，现任申万菱信深证成份指数型证券投资基金、申万菱信中证申万证券行业指数证券投资基金、申万菱信中小企业 100 指数证券投资基金（LOF）、申万菱信中证环保指数型证券投资基金（LOF）、申万菱信上证 50 交易型开放式指数发起式证券投资基金、申万菱信中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金、申万菱信中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、申万菱信中证内地新能源主题交易型开放式指数证券投资基金、申万菱信中证内地新能源主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、申万菱信沪深 300 价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

## （2）历任基金经理

龚丽丽女士，2017 年 12 月至 2020 年 7 月任本基金基金经理。

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：公司总经理、分管投资的副总经理、宏观策略分析师、法律合规与审计部门负责人和 risk 管理部门负责人等。

总经理为本委员会主席，分管投资的副总经理为会议召集人，宏观策略分析师为本委员会秘书，负责协调统筹本委员会的各项事宜。

督察长作为非执行委员，有权列席本委员会的任何会议，但不参与投票表决。

## 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净值信息，确定基金份额申购、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) 编制季度报告、中期报告和年度报告；

(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) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(25) 建立并保存基金份额持有人名册；

(26) 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) 利用本基金财产或者职务之便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牟取非法利益；

(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法律合规与审计部，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) 法律合规与审计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的文化氛围；

(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)法律合规与审计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法律合规与

审计部，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法律合规与审计部，法律合规与审计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  
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：陈四清  
成立时间：1984 年 01 月 01 日  
注册资本：人民币 35,640,625.7089 万元  
联系人：郭明  
联系电话：010-66105799  
传真：（010）66105798  
网址：www.icbc.com.cn

### （二）主要人员情况

截至 2023 年 9 月，中国工商银行资产托管部共有员工 212 人，平均年龄 34 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 2023 年 9 月，中国工商银行共托管证券



投资基金 1365 只。自 2003 年以来，本行连续二十年获得香港《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 95 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。从 2005 年至今共十六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，全部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，其中对基金的投资比例的监督和核查自基金合同生效之后六个月开始。

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、直销机构

名称：申万菱信基金管理有限公司直销中心

办公地址：上海市中山南路 100 号 11 层

法定代表人：陈晓升

电话：+86 21 23261188

传真：+86 21 23261199

联系人：张芸茜

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、其他销售机构

具体名单详见基金管理人网站的公示。

基金管理人可根据有关法律、法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金或变更销售机构，并在基金管理人网站公示。具体请以各发售机构实际情况为准。

#### 3、场内销售机构

（1）本基金的场内发售机构为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（具体名单可在深交所网站查询）。

（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。

### 二、登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：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

法定代表人：于文强

电话：010-50938856

传真：010-50938907

联系人：赵亦清

### 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：韩炯

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：陈颖华

经办律师：黎明、陈颖华

### 四、审计基金财产的会计师事务所

名称：毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场 2 座办公楼 8 层

办公地址：上海静安区南京西路 1266 号恒隆广场二期 16 楼

法定代表人：邹俊

电话：（010）8508 5000

传真：（010）8508 5111

联系人：虞京京

经办注册会计师：王国蓓、虞京京

## 第六部分 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由申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金终止分级运作并变更而来。

申万菱信申银万国证券行业指数分级证券投资基金依据《基金法》于 2014

年 1 月 26 日获中国证监会证监许可【2014】141 号文准予募集，2015 年 4 月 2 日因为标的指数名称变更而调整基金名称为申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金。

申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金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。基金管理人于 2014 年 3 月 13 日获得中国证监会书面确认，《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》生效。

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》约定，申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金应根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》等法律法规规定终止证券 A 份额与证券 B 份额的运作，无需召开基金份额持有人大会。据此，基金管理人已于 2020 年 12 月 2 日在指定媒介发布《关于申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金之证券 A 份额、证券 B 份额终止运作、终止上市并修改基金合同的公告》，向深圳证券交易所申请申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金的两级子份额退市，并于 2020 年 12 月 31 日（基金折算基准日）进行基金份额折算，《申万菱信中证申万证券行业指数型证券投资基金基金合同》于基金折算基准日次日正式生效，《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》同时失效。

## 第七部分 基金的存续

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。

## 第八部分 基金份额的上市交易

### 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，申请本基金的 A 类基金份额上市交易。本基金的 C 类基金份额不上市交易。

如无特别说明，本部分所述基金份额仅指本基金 A 类基金份额。



## 二、上市交易的地点

深圳证券交易所

## 三、上市交易的时间

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介上刊登基金份额上市交易公告书。

## 四、上市交易的规则

本基金在深圳证券交易所的上市交易遵循《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

本基金基金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

本基金基金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基金份额的基金份额净值。

## 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

本基金基金份额的停复牌、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。

## 第九部分 基金份额的申购与赎回

本基金基金合同生效后，A类基金份额投资者可通过场外或场内两种方式对本基金基金份额进行申购与赎回。C类基金份额投资者仅可通过场外方式对基金份额进行申购与赎回。在法律法规允许且对基金份额持有人无实质性不利影响的前提下，基金管理人有权根据实际情况开通C类基金份额等其他份额类别的场内申购和赎回业务，具体见基金管理人届时公告。

### 一、申购和赎回场所

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；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。

### 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、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介上公告。

#### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

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。

### 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，在当日的开放时间结束后不得撤销；

4、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申购、赎回业务等规则有新的规定，按新规定执行；

5、场外赎回遵循“先进先出”原则，即按照登记机构登记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介上公告。

### 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

投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付申购款项，申购成立；登记机构确认基金份额时，申购生效。投资人在提交赎回申请时，必须有足够的基金份额余额，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

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）。

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

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、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介上公告。

## 六、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 A 类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 A 类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等，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、企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划、企业年金养老金产品、职业年金计划、养老目标基金。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。非养老金客户指除养老金客户外的其他投资人。

A 类基金份额的申购费用由申购 A 类基金份额的投资人承担，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。本基金 C 类基金份额不收取申购费用。

(1) A 类基金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) A 类基金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、赎回费用

赎回费用由赎回相应类别基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回各类基金份额时收取，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) A 类基金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) A 类基金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) C类基金份额的赎回费率

持有期限	赎回费率
7日以内	1.50%
7日（含）以上	0.00%

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介上公告。

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、申购份额计算

#### (1) 申购 A 类基金份额

A 类基金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：

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

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

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{T 日 A 类基金份额净值}$$

当申购费用为固定金额时，申购份额的计算方法如下：

$$\text{申购费用} = \text{固定金额}$$

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

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{T 日 A 类基金份额净值}$$

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 A 类基金份额，对应费率为 1.20%，假设申购当日 A 类基金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 A 类基金份额，假设申购当日 A 类基金份额的基金份额净值为 1.1320 元，则可得到 8,729.17 份 A 类基金份额。

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 A 类基金份额，对应的申购费率为 1.2%，假设申购当日 A 类基金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 A 类基金份额，假设申购当日 A 类基金份额的基金份额净值为 1.1320 元，则其可得到 A 类基金份额 87,291 份，退款 0.82 元。

## (2) 申购 C 类基金份额



申购份额 = 申购金额 / 申购当日 C 类基金份额净值

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。

例：某投资人投资 10,000 元申购本基金 C 类基金份额，假设申购当日 C 类基金份额净值为 1.1320 元，则其可得到的申购份额为：

申购份额 =  $10,000 / 1.1320 = 8,833.92$  份

即：投资人投资 10,000 元申购本基金 C 类基金份额，假设申购当日 C 类基金份额净值为 1.1320 元，则可得到 8,833.92 份 C 类基金份额。

## 2、赎回金额计算

投资人在赎回基金份额时需缴纳一定的赎回费用。计算公式如下：

赎回总金额 = 赎回份额 × T 日该类基金份额净值

赎回费 = 赎回份额 × T 日该类基金份额净值 × 赎回费率

净赎回金额 = 赎回总金额 - 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：

某基金份额持有人持有 10,000 份 A 类基金份额 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 A 类基金份额的基金份额净值是 1.1320 元，则可得到的净赎回金额为：

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

赎回费 =  $11,320.00 \times 0.25\% = 28.30$  元

净赎回金额 =  $11,320.00 - 28.30 = 11,291.70$  元

即：该基金份额持有人持有 10,000 份 A 类基金份额 6 个月后（未满 1 年）从场外赎回，假设赎回当日 A 类基金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：

某基金份额持有人从场内赎回 10,000 份 A 类基金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 A 类基金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=11,320.00×0.5%=56.60 元

净赎回金额=11,320.00-56.60=11,263.40 元

即：该基金份额持有人从深圳证券交易所场内赎回 10,000 份 A 类基金份额且持有时间不少于 7 日，假设赎回当日 A 类基金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。

举例说明：

某基金份额持有人赎回本基金 10,000 份 C 类基金份额且持有时间 7 日以上，赎回费率为 0.00%，假设赎回申请当日 C 类基金份额净值是 1.1320 元，则可得到的赎回金额为：

赎回总金额=10,000×1.1320=11,320.00 元

赎回费=11,320.00×0.00%=0.00 元

净赎回金额=11,320.00-0.00=11,320.00 元

即：该基金份额持有人赎回本基金 10,000 份 C 类基金份额且持有时间 7 日以上，假设赎回当日 C 类基金份额的基金份额净值是 1.1320 元，则可得到的净赎回金额为 11,320.00 元。

### 3、基金份额净值计算

T 日各类基金份额净值=T 日闭市后的各类基金资产净值/T 日各类基金份额总数。

各类基金份额净值的计算，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由基金财产承担。T 日的各类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

若基金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该类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

基金份额连续 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，并应当在指定媒介上进行公告。

### 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，并在 2 日内在指定媒介上刊登公告。

## 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，基金管理人应在规定期限内指定媒介上刊登暂停公告。

2、如发生暂停的时间为 1 日，基金管理人应于重新开放日，在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个工作日的各类基金份额净值。

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，在指定媒介刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个工作日的各类基金份额净值。

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，在指定媒介刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个工作日的各类基金份额净值。

## 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基金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、基金的登记、系统内转托管和跨系统转托管

#### 1、基金份额的登记

(1) 本基金的基金份额采用分系统登记的原则。场外申购的基金份额，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；场内申购的基金份额，或上市交易的基金份额，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基金份额，可以直接申请场内赎回，可以在本基金上市交易后在二级市场卖出，也可以在通过跨系统转托管转至注册登记系统后申请场外赎回。

(3) 登记在注册登记系统中的 A 类基金份额，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后申请场内赎回，或在本基金上市交易后在二级市场卖出。除非基金管理人另行公告，登记在注册登记系统中的 C 类基金份额，仅能申请场外赎回。

#### 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基金份额赎回业务的销售机构(网点)时,需办理已持有基金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基金份额场内赎回的会员单位(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 A 类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。除非基金管理人另行公告,本基金不支持 C 类基金份额进行跨系统转托管。

(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。



## 第十一部分 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、存托凭证、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及存托凭证市值和买入、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%,其中投资于股票及存托凭证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。

3) 指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人将按照基金份额持有人利益优先的原则，综合考虑成份股的退市风险、其在指数中的权重以及对跟踪误差的影响，据此制定成份股替代策略，并对投资组合进行相应调整。

### 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。

### 3、存托凭证投资策略

本基金在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素的基础上，根据审慎原则合理参与存托凭证的投资，以更好地跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

## 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及存托凭证市值和买入、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%，其中投资于股票及存托凭证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以外的因素致使本基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流

动性受限资产的投资；

(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) 本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行，存托凭证与境内上市交易的股票合并计算；

(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)、(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。

未来若出现标的指数不符合要求（因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人应当自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如更换基金标的指数、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进行表决。

自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定期间，基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作。

#### 六、风险收益特征

本基金为股票型指数基金，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。

#### 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 2023 年 09 月 30 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	1,547,465,760.42	93.21
	其中：股票	1,547,465,760.42	93.21
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	111,143,055.95	6.69
7	其他各项资产	1,512,371.24	0.09
8	合计	1,660,121,187.61	100.00

## 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	-	-
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	1,547,465,760.42	93.57
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	1,547,465,760.42	93.57

## 2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 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	9,821,537.00	212,734,491.42	12.86
2	300059	东方财富	12,765,088.00	194,029,337.60	11.73
3	600837	海通证券	9,715,181.00	96,666,050.95	5.84
4	601688	华泰证券	5,181,891.00	81,925,696.71	4.95
5	601211	国泰君安	4,535,871.00	65,951,564.34	3.99
6	600999	招商证券	3,734,250.00	52,204,815.00	3.16
7	600958	东方证券	5,261,381.00	50,404,029.98	3.05
8	601377	兴业证券	6,952,104.00	44,632,507.68	2.70
9	000776	广发证券	2,978,153.00	43,689,504.51	2.64
10	000166	申万宏源	9,070,891.00	39,276,958.03	2.37

#### 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

本基金本报告期内未投资股指期货。

#### 10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

## 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中，其中，广发证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、中信证券股份有限公司在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责或/及处罚。

本基金对上述主体发行证券的投资决策程序符合公司投资管理制度的相关规定。

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	106,632.38
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,405,738.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,512,371.24

### 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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 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2021年12月31日	-4.79%	1.46%	-5.89%	1.48%	1.10%	-0.02%
2022年1月1日至2022年12月31日	-24.76%	1.55%	-26.10%	1.58%	1.34%	-0.03%
2023年1月1日至2023年09月30日	7.81%	1.42%	7.47%	1.44%	0.34%	-0.02%
自基金合同生效起至2023年09月30日	-22.77%	1.48%	-25.26%	1.50%	2.49%	-0.02%

## 2、申万菱信中证申万证券行业指数 C:

阶段	净值增长率①	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
自基金份额增加起至2022年12月31日	-4.29%	1.57%	-5.54%	1.61%	1.25%	-0.04%

2023年1月1日至2023年09月30日	7.50%	1.42%	7.47%	1.44%	0.03%	-0.02%
自基金份额增加起至2023年09月30日	2.88%	1.50%	1.51%	1.53%	1.37%	-0.03%

## 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  
(2021年1月1日至2023年9月30日)

### 1. 申万菱信中证申万证券行业指数 A:



### 2. 申万菱信中证申万证券行业指数 C:



## 第十二部分 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。

## 第十三部分 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、存托凭证、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，当基金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、本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票进行。

10、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资产净值的计算结果对外予以公布。

#### 四、估值程序

1、各类基金份额净值的计算均精确到 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各类基金份额净值，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，将各类基金份额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。当任一类基金份额净值小数点后4位以内（含第4位）发生估值错误时，视为该类基金份额净值错误。

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某类基金份额净值的 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；错误偏差达到某类基金份额净值的 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各类基金份额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各类基金份额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。

## 第十四部分 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、基金的销售服务费；
- 4、标的指数许可使用费；
- 5、基金上市费用及年费；
- 6、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
- 7、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 8、基金份额持有人大会费用；

- 9、基金的证券、期货交易费用或结算而产生的费用；
- 10、基金的银行汇划费用；
- 11、账户开户费用和账户维护费；
- 12、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 0.20% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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、销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.30%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。销售服务费

计提的计算公式如下：

$$H=E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务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销售服务费划款指令，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登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 4、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、销售服务费、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和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》执行；

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。

## 第十五部分 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

1、本基金场外收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，登记在注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，持有人可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；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的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

2、由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

3、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的情况下，基金管理人可在法律法规允许的前提下，履行必要的程序后，酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在指定媒介公告。

### 四、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

### 五、收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在 2 日内在指定媒介公告。

### 六、基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为相应类别的基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。场内基金份额收益分配时发生的费用，遵循深圳证券交易所和登记机构的相关规定。



## 第十六部分 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；
- 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、期货相关业务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按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

## 第十七部分 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、法人和非法人组织。

本基金信息披露义务人以保护基金份额持有人利益为根本出发点,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、完整性、及时性、简明性和易得性。

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全国性报刊(以下简称“指定报刊”)及指定互联网网站(以下简称“指定网站”)等媒介披露,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、法人和非法人组织的祝贺性、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不同文本的内容一致。不同文本之间发生歧义的,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、基金产品资料概要

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，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在指定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。

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。

4、基金产品资料概要是基金招募说明书的摘要文件，用于向投资者提供简明的基金概要信息。《基金合同》生效后，基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金产品资料概要，并登载在指定网站及基金销售机构网站或营业网点；基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金产品资料概要。

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）基金份额上市交易公告书

本基金基金份额获准在证券交易所上市交易的，基金管理人应当在基金份额上市交易的三个工作日前，将基金份额上市交易公告书登载在指定网站上，并将上市交易公告书提示性公告登载在指定报刊上。

### （三）基金净值信息公告

在开始办理基金份额申购或者赎回前且未上市交易的，基金管理人应当至少每周在指定网站披露一次各类基金份额净值和基金份额累计净值。

在开始办理申购或者赎回后或基金份额上市交易的，基金管理人应当在不晚于每个开放日/交易日的次日，通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日/交易日的各类基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在指定网站披露半年度和年度最后一日的各类基金份额净值和基金份额累计净值。

#### （四）基金份额申购、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基金份额申购、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销售机构网站或营业网点查阅或者复制前述信息资料。

#### （五）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、基金中期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三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。

2、基金中期报告：基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成基金中期报告，将中期报告登载在指定网站上，并将中期报告提示性公告登载在指定报刊上。

3、基金季度报告：基金管理人应当在季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在指定网站上，并将季度报告提示性公告登载在指定报刊上。

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、中期报告、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中期报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

#### （六）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，

并登载在指定报刊和指定网站上。

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及决定的事项；
- 2、基金合同终止、基金清算；
- 3、转换基金运作方式、基金合并；
- 4、更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
- 5、基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- 6、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 7、基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；
- 8、基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- 9、基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；
- 10、涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或仲裁；
- 11、基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；
- 12、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事项，但中国证监会另有规定的除外；
- 13、基金收益分配事项；
- 14、管理费、托管费、销售服务费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- 15、任一类基金份额净值计价错误达该类基金份额净值百分之零点五；

- 16、本基金开始办理申购、赎回；
- 17、本基金发生巨额赎回并延期办理；
- 18、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；
- 19、本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；
- 20、本基金上市交易、停复牌、暂停上市、恢复上市或终止上市；
- 21、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；
- 22、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；
- 23、基金信息披露义务人认为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其他事项或中国证监会规定的其他事项。

#### （七）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，以及可能损害基金份额持有人权益的，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、基金上市交易的证券交易所。

#### （八）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。

（九）本基金投资股指期货的，在季度报告、中期报告、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）清算报告

基金合同终止的，基金管理人应当依法组织基金财产清算小组对基金财产进行清算并作出清算报告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

#### （十一）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，指定专门部门及高级管理人员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等法规的规定。

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、各类基金份额净值、申购赎回价格、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或电子确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择一家报刊披露本基金信息。基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。

基金管理人、基金托管人除依法在指定媒介上披露信息外，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介、基金上市交易的证券交易所网站披露信息，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。

基金管理人、基金托管人除按法律法规要求披露信息外，也可着眼于为投资者决策提供有用信息的角度，在保证公平对待投资者、不误导投资者、不影响基金正常投资操作的前提下，自主提升信息披露服务的质量。具体要求应当符合中国证监会及自律规则的相关规定。前述自主披露如产生信息披露费用，该费用不得从基金财产中列支。

#### 七、信息披露文件的存放与查阅

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于公司住所、基金上市交易的证券交易所，供社会公众查阅、复制。

#### 八、本基金信息披露事项以法律法规规定及本章节约定的内容为准。

## 第十八部分 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、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，对标的指数进行有



效跟踪，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“第九部分 基金份额的申购与赎回”，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“第九部分 基金份额的申购与赎回”中“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“第九部分 基金份额的申购与赎回”中“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“第九部分 基金份额的申购与赎回”中“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“第九部分 基金份额的申购与赎回”中“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“第十三部分 基金资产估值”中“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、跟踪误差控制未达约定目标的风险

本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值和年化跟踪误差控制在约定范围内，

但因标的指数编制规则调整或其他因素可能导致跟踪误差超过上述范围，本基金净值表现与指数价格走势可能发生较大偏离。

#### 4、指数编制机构停止服务的风险

本基金的标的指数由指数编制机构发布并管理和维护，未来指数编制机构可能由于各种原因停止对指数的管理和维护，本基金将根据基金合同的约定自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如更换基金标的指数、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进行表决。投资人将面临更换基金标的指数、转换运作方式，与其他基金合并、或者终止基金合同等风险。

自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定并实施前，基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作，该期间由于标的指数不再更新等原因可能导致指数表现与相关市场表现存在差异，影响投资收益。

#### 5、成份股停牌的风险

标的指数成份股可能因各种原因临时或长期停牌，发生成份股停牌时可能面临如下风险：

(1) 基金可能因无法及时调整投资组合而导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

(2) 若成份股停牌时间较长，在约定时间内仍未能及时买入或卖出的，由此可能影响投资者的投资损益并使基金产生跟踪偏离度和跟踪误差。

(3) 在极端情况下，标的指数成份股可能大面积停牌，基金可能无法及时卖出成份股以支付投资人的赎回申请，由此基金管理人可能在申购赎回中设置较低的赎回份额上限或者采取暂停赎回的措施，投资者将面临无法赎回全部或部分基金份额的风险。

#### 6、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、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。

### 七、存托凭证的投资风险

(1) 存托凭证是新证券品种，由存托人签发、以境外证券为基础在中国境内发行，代表境外基础证券权益。存托凭证持有人实际享有的权益与境外基础证券持有人的权益虽然基本相当，但不能等同于直接持有境外基础证券。

(2) 基金买入或者持有红筹公司境内发行的存托凭证，即被视为自动加入存托协议，成为存托协议的当事人。存托协议可能通过红筹公司和存托人商议等方式进行修改，基金无法单独要求红筹公司或者存托人对存托协议作出额外修改。

(3) 基金持有红筹公司存托凭证，不是红筹公司登记在册的股东，不能以股东身份直接行使股东权利；基金仅能根据存托协议的约定，通过存托人享有并行使分红、投票等权利。

(4) 存托凭证存续期间，存托凭证项目内容可能发生重大、实质变化，包括但不限于存托凭证与基础证券转换比例发生调整、红筹公司和存托人可能对存托协议作出修改，更换存托人、更换托管人、存托凭证主动退市等。部分变化可能仅以事先通知的方式，即对基金生效。基金可能无法对此行使表决权。

(5) 存托凭证存续期间，对应的基础证券等财产可能出现被质押、挪用、司法冻结、强制执行等情形，基金可能存在失去应有权利的风险。

(6) 存托人可能向存托凭证持有人收取存托凭证相关费用。

(7) 存托凭证退市的，基金可能面临存托人无法根据存托协议的约定卖出基础证券，基金持有的存托凭证无法转到境内其他市场进行公开交易或者转让，存托人无法继续按照存托协议的约定为基金提供相应服务等风险。

## 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在外在风险两方面。

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、未经授权活动、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“第九部分 基金份额的申购与赎回”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。

## 第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### 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日内在指定媒介公告。

### 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基金份额持有人持有的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。

## 第二十部分 基金合同内容摘要

### 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：陈晓升

成立日期：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的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净值信息，确定基金份额申购、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) 编制季度报告、中期报告和年度报告；

(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) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(25) 建立并保存基金份额持有人名册；

(26) 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：陈四清

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 35,640,625.7089 万元

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、基金份额净值及申购、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、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，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。

同一类别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) 依法申请赎回或转让其持有的基金份额；
- (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各种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。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

### 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或销售服务费率，依据法律法规要求提高该等报酬标准或销售服务费率的除外；
- (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) 终止基金份额的上市，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；
- (11) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- (12) 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就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
- (13) 对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
- (14) 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，调整申购费率、变更收费方式或调低赎回费率、销售服务费率；
- (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，在指定媒介公告。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书委派代表出席，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书符合法律法规、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, 有效的基金份额合计不少于在权益登记日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基金份额合计少于在权益登记日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基金份额合计不少于在权益登记日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, 有效的基金份额合计不小于在权益登记日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基金份额合计少于在权益登记日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基金份额合计代表三分之一以上的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基金份额持有人或其代理人所持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基金份额持有人或其代理人所持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。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 日内在指定媒介上公告。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 基金收益分配原则、执行方式

### 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

1、本基金场外收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，登记在注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，持有人可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；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的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

2、由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

3、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的情况下，基金管理人可在法律法规允许的前提下，履行必要的程序后，酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在指定媒介公告。

## 四、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

## 五、收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在 2 日内在指定媒介公告。

## 六、基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为相应类别的基金份额。红利再投



资的计算方法，依照《业务规则》执行。场内基金份额收益分配时发生的费用，遵循深圳证券交易所和登记机构的相关规定。

#### 第四部分 与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

##### 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、基金的销售服务费；
- 4、标的指数许可使用费；
- 5、基金上市费用及年费；
- 6、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
- 7、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 8、基金份额持有人大会费用；
- 9、基金的证券、期货交易费用或结算而产生的费用；
- 10、基金的银行汇划费用；
- 11、账户开户费用和账户维护费；
- 12、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 0.20% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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、销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.30%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。销售服务费计提的计算公式如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务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销售服务费划款指令，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登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### 4、基金合同生效后标的指数许可使用费

本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费计提方法，按前一日基金资产净值每日计提标的指数许可使用费，具体计提方法见本基金招募说明书。

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。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、销售服务费、标的指数许可使用费之外的前述第一款约

定的其他费用由基金管理人和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》执行；

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。

## 第五部分 基金财产的投资方向和投资限制

### 一、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、存托凭证、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及存托凭证市值和买入、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%，其中投资于股票及存托凭证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。

### 二、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及存托凭证市值和买入、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%，其中投资于股票及存托凭证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上市公司发行的证券,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股票,不得超过该上市公司可流通股股票的 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股票,不得超过该上市公司可流通股股票的 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) 本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行,存托凭证与境内上市交易的股票合并计算;

(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)、(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本基金合同生效之日起开始。

如果法律法规对本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。

## 第六部分 基金资产净值的计算方式和公布方式

### 一、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。

### 二、基金净值信息公告

在开始办理基金份额申购或者赎回前且未上市交易的，基金管理人应当至少每周在指定网站披露一次各类基金份额净值和基金份额累计净值。

在开始办理申购或者赎回后或基金份额上市交易的，基金管理人应当在不晚于每个开放日/交易日的次日，通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日/交易日的各类基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在指定网站披露半年度和年度最后一日的各类基金份额净值和基金份额累计净值。

## 第七部分 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本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 日内在指定媒介公告。

### 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基金份额持有人持有的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。

### 第八部分 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。

### 第九部分 基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

基金合同是约定基金合同当事人之间权利义务关系的法律文件。

1、基金合同经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字，于 2021 年 1 月 1 日《基金合同》生效，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》自同一起失效。

2、基金合同的有效期自其生效之日起至基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。

3、基金合同自生效之日起对包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人在内的基金合同各方当事人具有同等的法律约束力。

4、基金合同正本一式二份，基金管理人、基金托管人各持有一份，每份具有同等的法律效力。

5、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。

## 第二十一部分 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：陈晓升

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：蔡琳娜

#### （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：陈四清

电话：（010）66105799

传真：（010）66105798

联系人：郭明

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 35,640,625.7089 万元

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、存托凭证、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及存托凭证市值和买入、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%，其中投资于股票及存托凭证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及存托凭证市值和买入、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%，其中投资于股票及存托凭证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；

18) 本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行，存托凭证与境内上市交易的股票合并计算。

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、各类基金份额净值计算、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。

(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有关重大违规行为，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各类基金份额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。基金管理人有关义务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关重大违规行为，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）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。

### （三）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。

#### （四）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。

#### （五）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。

#### （六）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。

#### （七）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。各类基金份额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各类基金份额净值，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、各类基金份额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

基金管理人和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、托管协议的变更与终止

### （一）托管协议的变更与终止

#### 1、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。

## 2、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。



## 第二十二部分 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

投资人通过基金管理人网站等平台可享有基金交易查询、账户查询和基金管理人依法披露的各类基金信息等服务，包括基金产品基本信息（包括但不限于基金名称、基金代码、风险等级、持有份额、单位净值、收益情况等）、基金的法律文件、基金公告、定期报告和基金管理人最新动态等各类资料。

基金管理人可根据法律法规及投资者需求不定期通过电话、短信、邮件、微信等任一或多种方式为投资人提供与投资人相关的账户服务通知、交易确认通知、重要公告通知、活动消息、营销信息、客户关怀等资讯及增值服务，投资本基金前请详阅申万菱信基金官网服务介绍和隐私政策。如需取消相应资讯服务，可通过基金管理人客户服务中心热线 400-880-8588、在线服务等人工服务方式退订。

### 二、服务渠道

#### （一）客服中心电话服务

1、自助语音服务（7×24 小时）：提供 7×24 小时自动语音查询服务，基金份额持有人可查询基金余额、交易情况、基金产品与服务等相关信息。

2、人工服务：在每一交易日提供不少于 8 小时的人工咨询服务。基金份额持有人可通过基金管理人全国统一客服热线：400-880-8588（免长途话费）或 021-962299 享受业务咨询、信息查询、投诉建议等服务。

#### （二）在线服务

1、智能客服服务（7×24 小时）：提供 7×24 小时智能客服服务，业务规则、常见问题等自助咨询服务。

2、人工服务：在每一交易日提供不少于 8 小时的在线人工咨询服务，提供基金份额持有人可查询基金余额、交易情况、基金产品与服务等相关信息。

3、留言服务（7×24 小时）：提供客户留言平台，客服中心一般在 T+2 个工

作日内处理完成。

### （三）互联网服务

基金份额持有人可以通过基金管理人网站（[www.swsmu.com](http://www.swsmu.com)）、微信公众号“申万菱信基金（SW\_SMU）”和官方 APP“申万菱信基金”享受理财资讯、信息披露、账户信息、交易信息、在线咨询等多项服务。基金份额持有人也可以通过上述渠道中的“网上交易”办理开户、交易及查询等业务。有关基金网上交易的协议文本请参见基金管理人网站。

三、如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容，请通过上述方式联系本公司。请确保投资前，您/贵机构已经全面理解了本招募说明书。

## 第二十三部分 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。

## 第二十四部分 其它应披露事项

公告事项	信息披露方式	公告日期
申万菱信中证申万证券行业指数型证券投资基金托管协议	规定报刊及 规定网站	2023/ 8/19
申万菱信中证申万证券行业指数型证券投资基金基金合同	规定报刊及 规定网站	2023/ 8/19
申万菱信中证申万证券行业指数型证券投资基金（申万菱信中证申万证券行业指数 A）产品资料概要更新	规定报刊及 规定网站	2023/ 8/19
申万菱信中证申万证券行业指数型证券投资基金（申万菱信中证申万证券行业指数 C）产品资料概要更新	规定报刊及 规定网站	2023/ 8/19
申万菱信中证申万证券行业指数型证券投资基金更新招募说明书（2023 年第 1 号）	规定报刊及 规定网站	2023/ 8/19
关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告	规定报刊及 规定网站	2023/ 8/19
关于申万菱信中证申万证券行业指数型证券投资基金开通同一基金不同份额类别相互转换业务的公告	规定报刊及 规定网站	2023/ 4/18

注：上述公告更新至 2023 年 12 月 25 日。

## 第二十五部分 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型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型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。