

申万菱信中证申万新兴健康产业主题投资指数证券投资基金(LOF)上市交易公告书

基金管理人：申万菱信基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

公告日期：2016年10月27日

上市日期：2016年11月1日

目录

第一部分 重要声明与提示	3
第二部分 基金概览	4
第三部分 基金的募集与上市交易	5
第四部分 持有人户数、持有人结构及前十名持有人	26
第五部分 基金主要当事人简介	27
第六部分 基金合同摘要	31
第七部分 基金财务状况	32
第八部分 基金投资组合	34
第九部分 重大事件揭示	36
第十部分 基金管理人承诺	38
第十一部分 基金托管人承诺	39
第十二部分 备查文件目录	40

第一部分 重要声明与提示

《申万菱信中证申万新兴健康产业主题投资指数证券投资基金(LOF)上市交易公告书》(以下简称“本公告”)依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号(上市交易公告书的内容与格式)》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制,申万菱信中证申万新兴健康产业主题投资指数证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)管理人的董事会及董事保证本公告所载资料不存在虚假记载、误

误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金托管人中国农业银行股份有限公司保证本公告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。中国证监会、深圳证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。

凡本公告未涉及的有关内容，请投资者详细查阅于2016年9月2日在《中国证券报》、《中国证券报》、《证券时报》刊登的《申万菱信中证申万新兴健康产业主题投资指数证券投资基金(LOF)招募说明书》。本基金的招募说明书同时发布在本公司网站(www.swsml.com)。

第二部分 基金概览

一、基金名称：申万菱信中证申万新兴健康产业主题投资指数证券投资基金(LOF)

基金简称：申万菱信中证申万新兴健康产业主题投资指数

场内简称：申万健康

基金代码：163119

二、基金类型：股票指数型证券投资基金

三、基金运作方式：上市契约型开放式

四、本基金的存续期限：不定期

五、基金份额总额：截至2016年10月25日，本基金的基金份额总额为418,757,156.30份。

六、基金份额净值：截至2016年10月25日，本基金的基金份额净值为1.0005元。

七、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所

八、上市交易日期：2016年11月1日

九、基金管理人：申万菱信基金管理有限公司

十、基金托管人：中国农业银行股份有限公司

十一、本次上市交易的基金份额注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

第三部分 基金的募集与上市交易

一、本次基金上市前基金募集情况

1、基金募集申请的核准机构和核准文号：2016年6月3日获中国证券监督管理委员会证监许可【2016】1204号文核准募集

2、基金运作方式：上市契约型开放式

3、基金合同期限：不定期

4、发售日期：2016年9月5日到2016年9月27日

5、发售价格：1.00元人民币

6、发售方式：本基金通过场外、场内两种方式公开发售

7、发售机构：

(1) 场外销售机构：

1) 直销机构

申万菱信基金管理有限公司直销中心

住所：上海市中山南路100号10层

办公地址：上海市中山南路100号10层

法定代表人：姜国芳

电话：(021) 23261188

传真：(021) 23261199

联系人：申浩波、陈继红

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

网址: www.swsmu.com

电子邮件: service@swsmu.com

2) 代销机构

(1) 名称: 中国农业银行股份有限公司

注册地址: 北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人: 周慕冰

联系人: 李紫钰

电话: 010-85108753

传真: 010-85109219

客户服务电话: 95599

网址: www.abchina.com

(2) 名称: 中国工商银行股份有限公司

住所: 北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址: 北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人: 易会满

客户服务电话: 95588

传真: 010-66107738

网址: www.icbc.com.cn

(3) 名称: 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址: 上海市浦东新区浦东南路 500 号

办公地址: 上海市中山东一路 12 号

法定代表人: 吉晓辉

传真: 021-63604199

联系人: 倪苏云、于慧

客户服务热线: 95528

公司网站: www.spdb.com.cn

(4) 名称: 上海农村商业银行股份有限公司

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

法定代表人: 冀光恒

客服电话: 021-96 2999/4006 962 999

联系人: 李晨

传真: 021-50105124

网址: www.srcb.com

(5) 名称: 国泰君安证券股份有限公司

注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址: 上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人: 杨德红

电话: 021-38676666

传真: 021-38670666

客户服务热线: 95521

公司网站: www.gtja.com

(6) 名称: 中信建投证券股份有限公司
注册地址: 北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼
办公地址: 北京市朝阳区门内大街 188 号
法定代表人: 王常青
联系人: 权唐
开放式基金咨询电话: 400-8888-108
开放式基金业务传真: 010-65182261
公司网站: www.csc108.com

(7) 名称: 国信证券股份有限公司
注册地址: 深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层
办公地址: 深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 6 楼
法定代表人: 何如
联系人: 周杨
传真: 0755-82133952
客户服务电话: 95536
网址: www.guosen.com.cn

(8) 名称: 招商证券股份有限公司
注册地址: 深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层
法定代表人: 宫少林
传真: 0755-82943636
联系人: 林生迎
客户服务热线: 4008881111、95565
公司网站: www.newone.com.cn

(9) 名称: 中信证券股份有限公司
注册地址: 广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场 (二期) 北座
办公地址: 北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦
法定代表人: 王东明
电话: 010-60838888
传真: 010-60833739
联系人: 顾凌
网址: www.cs.ecitic.com

(10) 名称: 中国银河证券股份有限公司
注册地址: 北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座
法定代表人: 陈有安
客户服务热线: 4008888888
传真: 010-66568292
联系人: 邓颜
公司网址: www.chinastock.com.cn

(11) 名称: 海通证券股份有限公司

注册地址: 上海市淮海中路 98 号

办公地址: 上海市广东路 689 号

法定代表人: 王开国

联系人: 金芸、李笑鸣

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

公司网站: www.htsec.com

(12) 名称: 申万宏源证券有限公司

注册地址: 上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址: 上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人: 李梅

联系人: 黄莹

电话: 021-33389888

传真: 021-33388224

客服电话: 95523 或 4008895523

电话委托: 021-962505

公司网址: www.swhysc.com

(13) 名称: 申万宏源西部证券有限公司

住所: 新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

办公地址: 新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

法定代表人: 韩志谦

联系人: 王怀春

客户服务电话: 4008-000-562

传真: 010-88085195

网址: www.hysec.com

(14) 名称: 长江证券股份有限公司

注册地址: 武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人: 崔少华

联系人: 奚博宇

传真: 027-85481900

客户服务电话: 95579 或 4008-888-999

网址: www.95579.com

(15) 名称: 安信证券股份有限公司

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

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

深圳市福田区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 栋 9 层

法定代表人: 王连志

传真: 0755-82558355

联系人: 陈剑虹

统一客服电话：4008001001

公司网站地址：www.essence.com.cn

(16) 名称：中信证券（山东）有限责任公司

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

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

法定代表人：杨宝林

客户服务电话：95548

网址：www.zxwt.com.cn

(17) 名称：东吴证券股份有限公司

住所：苏州工业园区星阳街 5 号东吴证券大厦

法定代表人：范力

联系人：方晓丹

电话：0512-65581136

传真：0512-65588021

客服电话：95330

公司网址：www.dwzq.com.cn

(18) 名称：信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：张志刚

联系人：唐静

客服电话：95321

公司网址：www.cindasc.com

(19) 名称：光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：薛峰

联系人：刘晨、李芳芳

电话：021-22169999

传真：021-22169134

客户服务电话：95525

公司网址：www.ebscn.com

(20) 名称：广州证券股份有限公司

注册地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

办公地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

法定代表人：邱三发

联系人：梁微

联系电话：020-88836999

传真：020-88836654

客户服务电话：95396

网址：www.gzs.com.cn

(21) 名称：国联证券股份有限公司

注册地址：江苏省无锡市金融一街8号7-9层

法定代表人：姚志勇

联系人：沈刚

传真：0510-82830162

客户服务电话：95570

网址：www.glsc.com.cn

(22) 名称：华西证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦

办公地址：四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦

法定代表人：杨炯洋

联系人：周志茹

客户服务电话：95584 或 400 888 8818

传真：028-86150040

网址：<http://www.hx168.com.cn>

(23) 名称：第一创业证券股份有限公司

住所：深圳市福田区福华一路115号投行大厦15-20楼

办公地址：深圳市福田区福华一路115号投行大厦15-20楼

法定代表人：刘学民

客户服务电话：95358

传真：0755-23838999

网址：www.fcsc.com.cn

(24) 名称：西部证券股份有限公司

注册地址：西安市东新街232号陕西信托大厦16-17层

法定代表人：刘建武

联系人：梁承华

传真：029-87406710

客户服务电话：95582

网站：www.westsecu.com

(25) 名称：中山证券有限责任公司

注册地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新大厦7层、8层

办公地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新大厦7层、8层

法定代表人：黄扬录

联系人：刘军

电话：0755-83734659

传真：0755-82960582

客户服务电话：4001-022-011

网址: www.zszq.com

(26) 名称: 华宝证券有限责任公司

注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区世纪大道100号57层

办公地址: 中国(上海)自由贸易试验区世纪大道100号57层

代表法人: 陈林

联系人: 刘闻川

传真: 021-20515593

客服电话: 400-820-9898

公司网址: www.cnhbstock.com

(27) 名称: 华融证券股份有限公司

注册地址: 北京市西城区金融大街8号

办公地址: 北京市朝阳区朝阳门北大街18号中国人保寿险大厦12层

法定代表人: 祝献忠

联系人: 李慧灵

联系电话: 010-85556100

传真: 010-58568062

客户服务电话: 400-898-9999

网址: www.hrsec.com.cn

(28) 名称: 天风证券股份有限公司

天风证券股份有限公司

注册地址: 湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦4楼

办公地址: 湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼

法定代表人: 余磊

联系人: 杨晨

电话: 027-87107535

传真: 027-87618863

客服热线: 4008005000

(29) 名称: 太平洋证券股份有限公司

住所: 云南省昆明市青年路389号志远大厦18层

办公地址: 北京市西城区北展北街9号华远企业号D座3单元

法定代表人: 李长伟

客户服务电话: 400-665-0999

传真: 010-88321819

网址: www.tpyzq.com

(30) 名称: 联讯证券股份有限公司

住所: 广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼

办公地址: 广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼

法定代表人: 徐刚

客户服务电话: 95564

传真：010-2119660

网址：www.lxsec.com

(31) 名称：上海证券有限责任公司

住所：上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼

法定代表人：李俊杰

联系人：邵珍珍

电话：021-53686888

传真：021-53686100-7008

客户服务电话：4008918918、021-962518

网址：www.shzq.com

(32) 名称：开源证券股份有限公司

住所：西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层

办公地址：西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层

法定代表人：李刚

客户服务电话：400-860-8866

传真：029-81887060

网址：www.kysec.cn

(33) 名称：中国国际金融股份有限公司

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

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

法定代表人：丁学东

客户服务电话：4009101166

传真：010-85679203

网址：www.cicc.com.cn

(34) 名称：中泰证券股份有限公司

注册地址：山东省济南市市中区经七路 86 号

办公地址：山东省济南市市中区经七路 86 号

法定代表人：李玮

联系人：吴阳

电话：0531-68889155

传真：0531-68889185

客服电话：95538

网址：www.zts.com.cn

(35) 名称：华泰证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路 228 号

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

法定代表人：周易

联系人：庞晓芸

电话：0755-82492193

传真：0755-82492962
客服电话：95597
网址：www.htsc.com.cn

(36)名称：国金证券股份有限公司
办公地址：四川省成都市东城根上街95号
客服电话：95310
公司网址：www.gjzq.com.cn
联系人：刘婧漪、贾鹏
联系电话：028-86690057、028-86690058
传真号码：028-86690126

(37)名称：深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#
办公地址：北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦16层
法定代表人：杨懿
联系人：张燕
客服电话：400-166-1188
网址：8.jrj.com.cn

(38)名称：和讯信息科技有限公司
注册地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人：王莉
传真：021-20835879
客服电话：400-920-0022/ 021-20835588
网址：licaike.hexun.com

(39)名称：诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司
注册地址：上海市金山区廊下镇漕廊公路7650号205室
法定代表人：汪静波
联系人：方成
传真：021-38509777
客户服务电话：400-821-5399
网址：www.noah-fund.com

(40)名称：深圳众禄金融控股股份有限公司
注册(办公)地址：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元
法定代表人：薛峰
联系人：童彩平
电话：0755-33227950
传真：0755-82080798
客户服务电话：4006-788-887
网址：众禄基金网 www.zlfund.cn，基金买卖网 www.jjmmw.com

(41) 名称: 上海天天基金销售有限公司
注册地址: 上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层
办公地址: 上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 9 楼
法定代表人: 其实
联系人: 潘世友
电话: 021-54509998
传真: 021-64385308
客户服务电话: 400-1818-188
网址: www.1234567.com.cn

(42) 名称: 上海好买基金销售有限公司
注册地址: 上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号
办公地址: 上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903-906 室
法定代表人: 杨文斌
联系人: 张茹
客服电话: 400-700-9665
公司网址: www.ehowbuy.com

(43) 名称: 蚂蚁(杭州)基金销售有限公司
注册地址: 浙江省杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 幢 202 室
客户服务电话: 4000766123
公司网址: www.fund123.cn

(44) 名称: 上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册地址: 上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室
办公地址: 上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层
法定代表人: 单丙焯
传真: 021-20691861
客服电话: 400-089-1289
公司网站: www.erichfund.com

(45) 名称: 浙江同花顺基金销售有限公司
注册办公地址: 杭州市西湖区文二西路 1 号元茂大厦 903 室
法定代表人: 凌顺平
联系人: 杨翼
传真: 0571-88910240
客户服务电话: 4008-773-772, 0571-88920897
网站: www.5ifund.com

(46) 名称: 北京展恒基金销售股份有限公司
注册地址: 北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号
办公地址: 北京市朝阳区安苑路 15-1 号邮电新闻大厦 2 层
法定代表人: 闫振杰
联系人: 马林

电话：010-59601366-7024

传真：010-62020355

客服电话：4008188000

网址：www.myfund.com

(47)名称：上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路5475号1033室

办公地址：上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼

法定代表人：沈继伟

联系人：赵沛然

电话：86-021-50583533

传真：86-021-50583633

客户服务电话：400-067-6266

(48)名称：众升财富（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区望京东园四区13号楼A座9层908室

法定代表人：李招娣

联系人：李艳

联系电话：010-59497361

传真：010-64788016

客服电话：400-059-8888

网址：www.wy-fund.com

(49)名称：一路财富（北京）信息科技有限公司

注册地址：北京市西城区车公庄大街9号五栋大楼C座702室

办公地址：北京市西城区阜成门外大街2号万通新世界广场A座2208

法定代表人：吴雪秀

联系人：段京璐

电话：010-88312877

传真：010-88312099

客户服务电话：400-001-1566

网址：<http://www.yilucaifu.com/>

(50)名称：北京钱景财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012

办公地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012

法定代表人：赵荣春

联系人：高静

电话：010-59158281

传真：010-57569671

客户服务电话：400-893-6885

网址：www.qianjing.com

(51)名称：上海汇付金融服务有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏中路 336 号 1807-5 室
办公地址：上海市虹梅路 1801 号凯科国际大厦 7 楼
法定代表人：张焱
联系人：周丹
电话：021-33323999
传真：8621-33323837
客户服务电话：400 820 2819
手机客户端：天天盈基金

(52) 名称：上海陆金所资产管理有限公司
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元
法定代表人：郭坚
客户服务电话：400-821-9031
传真：021-22066653
网址：www.lufunds.com

(53) 名称：北京恒天明泽基金销售有限公司
注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室
办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 39 号第一上海中心 C 座 6 层
法定代表人：梁越
联系人：马鹏程
电话：86-010-58845304
传真：86-021-58845306
客户服务电话：4008-980-618
网址：www.chtfund.com

(54) 名称：深圳富济财富管理有限公司
注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室
办公地址：深圳市南山区高新南七道 12 号惠恒集团二期 418 室
法定代表人：齐小贺
联系人：陈勇军
电话：0755-83999907-806
传真：0755-83999926
客户服务电话：0755-83999913
网址：www.jinqianwo.cn

(55) 名称：上海联泰资产管理有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室
办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 号楼 3 层
法定代表人：燕斌
联系人：陈东
电话：021-52822063
传真：021-52975270

客服电话：4000-466-788

网址：<http://www.66zichan.com>

(56)名称：珠海盈米财富管理有限公司

住所：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491

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

法定代表人：肖雯

客户服务电话：020-89629066

传真：020-89629011

网址：www.yingmi.cn

(57)名称：大泰金石投资管理有限公司

住所：南京市建邺区江东中路359号国睿大厦一号楼B区4楼A506室

办公地址：上海市长宁区虹桥路1386号文广大厦15楼

法定代表人：袁顾明

客户服务电话：4009282266

传真：021-22268089

网址：www.dtfunds.com

(2) 场内销售机构：

本基金通过深圳证券交易所上网定价发售，基金份额发售机构为具有基金销售资格的深圳证券交易所会员单位，具体名单为：爱建证券、安信证券、渤海证券、财达证券、财富证券、财富里昂、财通证券、长城证券、长江证券、诚浩证券、川财证券、大通证券、大同证券、德邦证券、第一创业、东北证券、东方证券、东海证券、东莞证券、东吴证券、东兴证券、高华证券、方正证券、光大证券、广发证券、广州证券、国都证券、国海证券、国金证券、国开证券、国联证券、国盛证券、国泰君安、国信证券、国元证券、海通证券、恒泰长财、恒泰证券、红塔证券、宏信证券、华安证券、华宝证券、华创证券、华福证券、华林证券、华龙证券、华融证券、华泰联合、华泰证券、华西证券、华鑫证券、江海证券、金元证券、开源证券、联讯证券、民生证券、民族证券、南京证券、平安证券、齐鲁证券、日信证券、瑞银证券、山西证券、上海证券、申万宏源、世纪证券、首创证券、太平洋证券、天风证券、天源证券、万和证券、万联证券、西部证券、西藏同信、西南证券、厦门证券、湘财证券、新时代证券、信达证券、兴业证券、银河证券、银泰证券、英大证券、招商证券、浙商证券、中航证券、中金公司、中山证券、中投证券、中天证券、中信建投、中信浙江、中信万通、中信证券、中银证券、中邮证券、中原证券（排名不分先后）。

本基金募集结束前获得基金代销资格的深圳证券交易所会员单位可通过深圳证券交易所系统办理本基金的场内认购业务。

(3) 基金管理人可根据有关法律法规要求，根据实情，选择其他符合要求的机构销售本基金或变更上述销售机构，并及时公告。具体请以各发售机构实际情况为准。

8、验资机构名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。

9、募集资金总额及入账情况

本次募集的有效净认购总金额为418,650,878.85元人民币，认购资金的银行利息106,277.45元人民币，其中，场外认购缴存款产生折算为基金份额的利息为85,634.45元人民币，场内认购缴存款产生折算为基金份额的利息为

20,643.00元人民币。本基金有效净认购总额418,650,878.85元人民币及场外认购缴存款产生折算为基金份额的利息

85,634.45元人民币已于2016年9月30日全额划入本基金在基金托管人中国农业银行股份有限公司开立的申万菱信中证申万新兴健康产业主题投资指数证券投资基金(LOF)托管专户；场内认购缴存款产生折算为基金份额的利息

20,643.00元人民币将于下一季度银行结息日(2016年12月20日)后划入本基金在基金托管人中国农业银行股份有限公司开立的申万菱信中证申万新兴健康产业主题投资指数证券投资基金(LOF)托管专户。按照每份基金单位面值人民币1.00元计算，本基金设立募集期间含本息共募集418,757,156.30份基金单位，有效认购户数为4,681户。

10、本基金募集备案情况：本基金于2016年9月30日验资完毕，2016年10月10日向中国证监会提交了验资报告，办

理基金备案手续。根据证监会《关于申万菱信中证申万新兴产业主题投资指数证券投资基金(LOF)备案确认的函》

(《证券投资基金监管部函[2016] 2437号)的书面确认,本基金合同于2016年10月10日正式生效。

11、基金合同生效日:2016年10月10日。

12、基金合同生效日的基金份额总额:418,757,156.30份。

二、本基金的日常申购、赎回业务安排

本基金管理人将于2016年11月1日起开始办理本基金的日常申购和赎回业务,具体业务办理时间等情况在开放申购和赎回公告中规定。

三、申万健康上市交易的主要内容

1、本基金上市交易的核准机构和核准文号:深证上【2016】740号

2、上市交易日期:2016年11月1日

3、上市交易的证券交易所:深圳证券交易所

投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。

4、基金场内简称:申万健康

5、基金交易代码:163119

6、本次上市交易份额:188,638,643.00份

7、未上市交易份额的流通规定:未上市交易的份额托管在场外,持有人将其转托管至深圳证券交易所场内后即可上市流通。

8、基金资产净值的披露:基金合同生效后,在基金份额开始上市交易或者开始办理基金份额申购或者赎回前,基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值。

在基金份额开始上市交易或者开始办理基金份额申购或者赎回后,基金管理人应当在每个开放日的次日,通过其网站、基金份额发售网点以及其他媒介,披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日,将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒介上。

第四部分 持有人户数、持有人结构及前十名持有人

一、持有人户数

截至2016年10月25日,本基金份额持有人户数共计4,681户,其中场内份额持有人户数为602户,平均每户持有的基金份额为313,353.23份。

二、持有人结构

截至2016年10月25日,本基金场内份额持有人结构如下:

场内机构投资者持有的基金份额为13,800,261份,占场内基金总份额的7.32%;场内个人投资者持有的基金份额为174,838,382份,占场内基金总份额的92.68%。

三、截至2016年10月25日,前十名场内基金份额持有人情况:

序号 持有人名称 持有份额 占场内基金总份额比例

1 浙江天时国际经济技术合作有限公司 10,390,931 5.51%

2 杜萍 9,100,884 4.82%

3 谭凯 7,451,158 3.95%

4 雷鹏 7,120,761 3.77%

5 刘晓松 6,000,933 3.18%

6 王璐玻 5,000,486 2.65%

7 李斌 3,550,552 1.88%

8 陈道芳 3,500,349 1.86%

9 刘莉 3,000,291 1.59%

10 宁波艾格丽特进出口有限公司 2,910,282 1.54%

合计 58,026,627 30.76%

第五部分 基金主要当事人简介

一、基金管理人

1、公司概况

名称：申万菱信基金管理有限公司

法定代表人：姜国芳

总经理：来肖贤（代）

成立日期：2004 年 1 月 15 日

注册资本：1.5 亿元人民币

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

设立批准文号：中国证券监督管理委员会，证监基金字【2003】144 号文

工商登记注册的法人营业执照注册号：100000400010467

经营范围：基金管理业务、发起设立基金以及经中国证监会批准的其他业务（包括销售其本身发起设立的基金）。

存续期间：持续经营

2、股东及其出资比例：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。

3、内部组织结构及职能

公司设置了合理的组织结构，设有包括投研、专户、市场营销、合规风控和后台运作等共十七个部门。其中，投研部门主要负责研究、投资管理、投资交易等工作；专户部门主要负责专户客户的开发及维护，专户资产的投资运作等工作；市场营销部门主要负责基金产品销售、营销和市场推广等工作；风控合规部门主要负责投资的事前、事中、事后风险、绩效评估和法务、合规等工作；后台运作部门主要负责会计估值与核算、注册登记等日常运营业务，信息系统的管理和维护，财务会计、行政管理，董事会和人力资源管理等工作。

4、人员情况

截至 2016 年 10 月 25 日，我公司共有 165 名员工，其中博士 5 人、硕士 98 人和本科 58 人，其他学历 3 人。

5、信息披露负责人：王菲萍

咨询电话：400 880 8588

6、基金管理业务情况

截止 2016 年 10 月 25 日，申万菱信基金管理有限公司旗下共管理 25 只开放式基金，分别为申万菱信盛利精选证券投资基金、申万菱信沪深 300 指数增强型证券投资基金、申万菱信新动力混合型证券投资基金、申万菱信收益宝货币市场基金、申万菱信新经济混合型证券投资基金、申万菱信竞争优势混合型证券投资基金、申万菱信添益宝债券型证券投资基金、申万菱信消费增长混合型证券投资基金、申万菱信沪深 300 价值指数证券投资基金、申万菱信深证成指分级证券投资基金、申万菱信稳益宝债券型证券投资基金、申万菱信量化小盘股票型证券投资基金 (LOF)、申万菱信可转换债券债券型证券投资基金、申万菱信中小板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、申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金、申万菱信中证军工指数分级证券投资基金、申万菱信多策略灵活配置混合型证券投资基金、申万菱信安鑫回报灵活配置混合型证券投资基金、申万菱信新能源汽车主题灵活配置混合型证券投资基金、申万菱信中证申万电子行业投资指数分级证券投资基金、申万菱信中证申万传媒行业投资指数分级证券投资基金、申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金、申万菱信中证 500 指数增强型证券投资基金和申万菱信中证申万新兴健康产业主题投资指数证券投资基金 (LOF)。

7、本基金基金经理

袁英杰先生，硕士研究生，曾任职于兴业证券、申银万国证券研究所等，2013 年 5 月加入申万菱信基金管理有限公司，曾任高级数量研究员，基金经理助理，现任申万菱信深证成指分级证券投资基金、申万菱信中小板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、申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金、申万菱信中证军工指数分级证券投资基金、申万菱信中证申万电子行业投资指数分级证券投资基金，申万菱信中证申万传媒行业投资指数分级证券

投资基金、申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金和申万菱信中证申万新兴健康产业主题投资指数证券投资基金(LOF)基金经理。

二、基金托管人

1、基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司（简称“中国农业银行”）

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法定代表人：周慕冰

成立日期：2009 年 1 月 15 日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13 号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]23 号

注册资本：32,479,411.7 万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

联系人：林葛

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分，总行设在北京。经国务院批准，中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于 2009 年 1 月 15 日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡，成为国内网点最多、业务辐射范围最广，服务领域最广，服务对象最多，业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外，中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉，每年位居《财富》世界 500 强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行，中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念，坚持审慎稳健经营、可持续发展，立足县域和城市两大市场，实施差异化竞争策略，着力打造“伴你成长”服务品牌，依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品，致力为广大客户提供优质的金融服务，与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行，经验丰富，服务优质，业绩突出，2004 年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007 年中国农业银行通过了美国 SAS70 内部控制审计，并获得无保留意见的 SAS70 审计报告。自 2010 年起中国农业银行连续通过托管业务国际内控标准（ISAE3402）认证，表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设，品牌声誉进一步提升，在 2010 年首届“‘金牌理财’ TOP10 颁奖盛典”中成绩突出，获“最佳托管银行”奖。2010 年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。2013 年至 2015 年连续获得中国债券市场“优秀托管机构奖”，2015 年被中国银行业协会授予“养老金业务最佳发展奖”。

中国农业银行证券投资基金托管部于 1998 年 5 月经中国证监会和中国人民银行批准成立，2014 年更名为托管业务部/养老金管理中心，内设综合管理处、证券投资基金托管处、委托资产托管处、境外资产托管处、保险资产托管处、风险管理处、技术保障处、营运中心、市场营销处、内控监管处、账户管理处，拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工 140 余名，其中具有高级职称的专家 30 余名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有 20 年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。

3、基金托管业务经营情况

截止到 2016 年 6 月 30 日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共 342 只。

三、验资机构

会计师事务所：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

法定代表人姓名：杨绍信

电话: +86 -21-23238888

传真: +86-21-23238800

联系人: 赵钰

经办注册会计师: 陈玲、赵钰

第六部分 基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

第七部分 基金财务状况

深圳证券交易所申万菱信中证申万新兴健康产业主题投资指数证券投资基金(LOF)募集期间未收取任何费用,其他各基金销售机构根据本基金招募说明书设定的费率收取认购费。本基金募集结束后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

申万菱信中证申万新兴健康产业主题投资指数证券投资基金(LOF)2016年10月25日资产负债表(未经审计)如下:

资产

资产:

银行存款 320,040,362.87

存出保证金

交易性金融资产

其中: 股票投资

基金投资

债券投资

资产支持证券投资

衍生金融资产

买入返售金融资产 98,700,000.00

应收证券清算款

应收利息 446,603.43

应收股利

应收申购款

递延所得税资产

其他资产 16,353.80

资产合计 419,203,320.10

负债和所有者权益

负债:

短期借款

交易性金融负债

衍生金融负债

卖出回购金融资产款

应付证券清算款

应付赎回款

应付管理人报酬 171,673.77

应付托管费 37,768.22

应付销售服务费

应付交易费用

应交税费

应付利息
应付利润
递延所得税负债
其他负债 32,349.15
负债合计 241,791.14
所有者权益：
实收基金 418,757,156.30
未分配收益 204,372.66
所有者权益合计 418,961,528.96
负债和所有者权益合计 419,203,320.10

注：报告截止日 2016 年 10 月 25 日，基金份额净值 1.0005 元，基金份额总额 418,757,156.30 份。

第八部分 基金投资组合

截止到 2016 年 10 月 25 日，申万菱信中证申万新兴健康产业主题投资指数证券投资基金(LOF)的投资组合如下：

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

其中：股票

2 固定收益投资

其中：债券

资产支持证券

3 金融衍生品投资

4 买入返售金融资产 98,700,000.00 23.54

其中：买断式回购的买入返售金融资产

5 银行存款和结算备付金合计 320,040,362.87 76.35

6 其他各项资产 462,957.23 0.11

7 合计 419,203,320.10 100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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名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名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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8、投资组合报告附注

8.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.2 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。

8.3 其他各项资产构成

序号 名称 金额（元）

- 1 存出保证金
- 2 应收证券清算款
- 3 应收股利
- 4 应收利息 446,603.43
- 5 应收申购款
- 6 其他应收款 16,353.80
- 7 待摊费用
- 8 其他
- 9 合计 462,957.23

8.4 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。

8.5 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。

第九部分 重大事件揭示

本基金以下信息披露事项均已通过指定报刊以及基金管理人网站(www.swsmu.com.cn)进行公开披露,并已报送相关监管部门备案。

- 1、2016年9月2日,刊登于基金管理人网站的申万菱信中证申万新兴健康产业主题投资指数证券投资基金(LOF)基金合同;
- 2、2016年9月2日,刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站的申万菱信中证申万新兴健康产业主题投资指数证券投资基金(LOF)基金合同摘要;
- 3、2016年9月2日,刊登于基金管理人网站的申万菱信中证申万新兴健康产业主题投资指数证券投资基金(LOF)基金托管协议;
- 4、2016年9月2日,刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站的申万菱信中证申万新兴健康产业主题投资指数证券投资基金(LOF)基金份额发售公告;
- 5、2016年9月2日,刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站的申万菱信中证申万新兴健康产业主题投资指数证券投资基金(LOF)招募说明书;
- 6、2016年9月2日,刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站的关于旗下申万菱信中证申万新兴健康产业主题投资指数证券投资基金(LOF)新增上海浦东发展银行股份有限公司为代销机构的公告;
- 7、2016年9月5日,刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站的申万菱信中证申万新兴健康产业主题投资指数证券投资基金(LOF)上网发售提示性公告;
- 8、2016年9月23日,刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站的关于旗下申万菱信中证申万新兴健康产业主题投资指数证券投资基金(LOF)新增中国工商银行股份有限公司为代销机构的公告;
- 9、2016年10月11日,刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站的申万菱信中证申万新兴健康产业主题投资指数证券投资基金(LOF)基金合同生效公告。

第十部分 基金管理人承诺

本基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺:

- (一) 严格遵守《基金法》及其他法律法规、《基金合同》的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。
- (二) 真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件,披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息,并接受中国证监会、深圳证券交易所的监督管理。

(三) 在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

第十一部分 基金托管人承诺

基金托管人就本基金上市交易后履行托管人职责做出如下承诺：

(一) 严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，设立专门的基金托管部，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。

(二) 根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。

(三) 基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，并在限期内，随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。

(四) 基金托管人发现基金管理人重大违规行为，将立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

第十二部分 备查文件目录

以下备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅：

- (一) 中国证监会核准基金募集的文件
- (二) 《申万菱信中证申万新兴健康产业主题投资指数证券投资基金(LOF)基金合同》
- (三) 《申万菱信中证申万新兴健康产业主题投资指数证券投资基金(LOF)托管协议》
- (四) 《申万菱信中证申万新兴健康产业主题投资指数证券投资基金(LOF)招募说明书》
- (五) 法律意见书
- (六) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (七) 基金托管人业务资格批件、营业执照

申万菱信基金管理有限公司

2016年10月27日

附件：基金合同摘要

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：姜国芳

设立日期：2004年1月15日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字【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定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了基金合同及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- （7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- （8）选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- （9）担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得基金合同规定的费用；
- （10）依据基金合同及有关法律规定决定基金收益的分配方案；
- （11）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
- （12）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- （13）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资以及转融通证券出借业务；
- （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、期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
- （16）在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换等业务规则；
- （17）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

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

- （1）依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- （2）办理基金备案手续；
- （3）自基金合同生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；
- （4）配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
- （5）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；
- （6）除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
- （7）依法接受基金托管人的监督；
- （8）采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值、基金份额净值，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、半年度和年度基金报告；
- （11）严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
- （12）保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在

基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；

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

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(26) 建立并保存基金份额持有人名册；

(27) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

二、基金托管人

(一) 基金托管人简况

名称：中国农业银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：周慕冰

成立时间：2009 年 1 月 15 日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复【2009】13 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：32,479,411.7 万元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字【1998】23 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、期货交易资金清算；

(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，协助开立股指期货业务相关账户及交易编码，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、交割和期货保证金出入金事宜；
- (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、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
- (11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；
- (12) 从基金管理人或其委托的登记机构处接收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。

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、基金服务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、招募说明书等信息披露文件；
- (2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，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；
- (3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- (4) 缴纳基金认购、申购、赎回款项及法律法规和基金合同所规定的费用；
- (5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
- (6) 不从事任何有损基金及其他基金合同当事人合法权益的活动；
- (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

第二部分 基金份额持有人大会召集、议事规则及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。

基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

本基金基金份额持有人大会不设日常机构，如今后设立基金份额持有人大会的日常机构，日常机构的设立按照相关法律法规的要求执行。

一、召开事由

1、除法律法规、监管机构另有规定的，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，基金合同另有约定的除外；
- (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) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求调整该等报酬标准的除外；
- (6) 变更基金类别；
- (7) 本基金与其他基金的合并；
- (8) 变更基金投资目标、范围或策略；
- (9) 变更基金份额持有人大会程序；
- (10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- (11) 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（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
- (12) 对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
- (13) 终止基金份额的上市，但因本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；
- (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、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不利影响下，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) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- (2) 在法律法规和基金合同规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率或者在不影响现有基金份额持有人利益的前提下变更收费方式，调整基金份额类别、停止现有基金份额类别的销售或者增减本基金的基金份额类别；
- (3) 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；
- (4) 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重大变化；
- (5) 经中国证监会允许，基金推出新业务或服务；

(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，并自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

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 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

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、表决意见寄交的截止时间和收取方式。

3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

四、基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式等法律法规或监管机构允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或基金托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

- (1) 亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；
- (2) 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基

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少于本基金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应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。

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或会议通知等相关公告中指定的其他形式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式或会议通知等相关公告中指定的其他形式进行表决。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表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取表决意见的，不影响表决效力；

（3）本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；若到会者在权益登记日持有的有效的基金份额小于本基金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代表三分之一（含三分之一）以上基金份额的持有人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见；

（4）上述第（3）项中直接出具表决意见的基金份额持有人或受托代表他人出具表决意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具表决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构允许的情况下，经会议通知载明，基金份额持有人也可以采用网络、电话或其他方式进行表决，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。在会议的召开方式上，本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，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单。签名单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，除非在计票时监督员及公证机关均认为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，但应当计入出具表决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表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

八、生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起2个工作日内在指定媒介上公告。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、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在登记结算系统基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额的持有人可选择现金红利或将现金红利自动转为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、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

3、每一基金份额享有同等分配权；如本基金在未来条件成熟时，增减基金份额类别，则同一类别内每一基金份额享有同等分配权；

4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规及监管规定且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可在按监管部门要求履行适当程序后对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

本基金每次收益分配比例详见届时基金管理人发布的公告。

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个工作日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。

基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过15个工作日。

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基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

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

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

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

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

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费自基金合同生效次日起每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起3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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

2、基金托管人的托管费

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

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

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费自基金合同生效次日起每日计算，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首日起3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

3、基金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支付指数许可使用费。基金管理人应及时按照《信息披露办法》的规定在指定媒介进行公告。指数许可使用费自基金合同生效之日起从基金资产中计收，按前一日的基金资产净值的0.02%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费每日计算，逐日累计，按季支付。标的指数许可使用费的收取下限为每季人民币5万元（大写：伍万元整），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指数许可使用费划付指令，经基金托管人复核后，于每年1月、4月、7月、10月的前十（10）个工作日内从基金财产中一次性支付给中证指数有限公司上一季度的标的指数许可使用费。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，且无需召开基金份额持有人大会。基金管理人将在招募说明书更新或其他公告中披露基金最新适用的方法。

除管理费、托管费、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；
- 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项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

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、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）。

在条件允许的情况下，本基金可以依照法律法规规定，参与融资和转融通证券出借业务。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的资产不低于基金资产的80%，其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资

产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。

二、投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

(1) 本基金投资于股票的资产不低于基金资产的 80%，其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券；

(2) 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%，本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；

(3) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%，但符合中国证监会规定的标的指数成份股投资不计入受此限；

(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，但符合中国证监会规定的标的指数成份股投资不计入受此限；

(5) 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%；

(6) 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%；

(7) 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%；

(8) 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%；

(9) 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；

(10) 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；

(11) 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%，在全国银行间同业市场中进行的债券回购期限不得超过 1 年，债券回购到期后不得展期；

(12) 如本基金参与股指期货交易的，依据下列标准建构组合：

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

2) 在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、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，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；

4) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

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

(13) 本基金参与融资与转融通证券出借的，应当符合以下要求：

1) 本基金参与融资业务的，在任何交易日日终，本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；

2) 本基金参与转融通证券出借业务的，在任何交易日日终，本基金参与转融通证券出借交易的资产不得超过基金资产净值的 50%，证券出借的平均剩余期限不得超过 30 天，平均剩余期限按照市值加权平均计算。

(14) 本基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

(15) 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。

因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。

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，且该等事项无需召开基金份额持有人大会。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (5) 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；
- (6) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有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，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

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

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、基金资产净值、基金份额净值公告

- 1、本基金的基金合同生效后，在基金份额开始上市交易或者开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值。
- 2、在基金份额开始上市交易或者开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过其网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。
- 3、基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒介上。

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之日起生效后方可执行，自决议生效后2个工作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、基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

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。

八、本基金被其他基金吸收合并或本基金与其他基金合并为新基金引起本基金基金合同终止的，本基金财产应清理、估价，但可根据届时有效的相关规定，基金财产不予变现和分配。本基金的债权债务由合并后的基金享有和承担。本基金清算的其他事项参照前述约定执行。

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。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费用由败诉方承担。

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并在募集结束后经基金管理人向中国证监会办理基金备案手续，并经中国证监会书面确认后生效。
- 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、基金合同正本一式六份，除上报有关监管机构一式二份外，基金管理人、基金托管人各持有二份，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。