

---

新华中证环保产业指数分级证券投资基金  
招募说明书（更新）

基金管理人：新华基金管理股份有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

### 【重要提示】

新华中证环保产业指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）的募集申请经中国证监会 2014 年 5 月 20 日证监许可【2014】513 号文核准募集。本基金合同已于 2014 年 9 月 11 日正式生效。

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

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，获得基金投资收益，亦承担基金投资中出现的各类风险，包括指数投资风险、利率风险，市场风险、流动性风险，交易风险，信用风险、管理风险和技术系统风险等，还包括本基金运作的特有风险（三类基金份额风险收益特征各异、基金份额的折/溢价交易风险等）。

本基金是股票型基金，具有较高预期收益、较高预期风险的特征。预期收益和预期风险高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。从本基金的基金份额来看，新华环保A份额为稳健收益类份额，具有低预期风险且预期收益相对较低的特征；新华环保B份额为积极收益类份额，具有高预期风险且预期收益相对较高的特征。

投资有风险，投资者认购（或申购）基金份额时应认真阅读本招募说明书及基金产品资料概要。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不向投资者保证基金一定盈利，也不向投资者保证最低收益。

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，由投资人自行负责。

---

---

本招募说明书(更新)所载内容截止日为2020年9月11日,有关财务数据和净值表现截止日为2020年6月30日(财务数据未经会计师事务所审计)。

---

## 目 录

|                                   |    |
|-----------------------------------|----|
| 一、 前言 .....                       | 2  |
| 二、 释义 .....                       | 3  |
| 三、 基金管理人 .....                    | 10 |
| 四、 基金托管人 .....                    | 19 |
| 五、 相关服务机构 .....                   | 22 |
| 六、 基金份额的分类与净值计算规则 .....           | 39 |
| 七、 基金的募集 .....                    | 43 |
| 八、 基金合同的生效 .....                  | 44 |
| 九、 新华环保 A 份额与新华环保 B 份额的上市交易 ..... | 45 |
| 十、 新华环保份额的申购与赎回 .....             | 47 |
| 十一、 基金份额的登记、转托管及其他业务 .....        | 58 |
| 十二、 基金份额的配对转换 .....               | 60 |
| 十三、 基金的投资 .....                   | 62 |
| 十四、 基金的业绩 .....                   | 75 |
| 十五、 基金的财产 .....                   | 77 |
| 十六、 基金资产的估值 .....                 | 78 |
| 十七、 基金的收益与分配 .....                | 83 |
| 十八、 基金的费用与税收 .....                | 84 |

---

---

|                         |     |
|-------------------------|-----|
| 十九、基金份额折算 .....         | 87  |
| 二十、基金的会计与审计 .....       | 95  |
| 二十一、基金的信息披露 .....       | 96  |
| 二十二、风险揭示 .....          | 103 |
| 二十三、基金的终止与清算 .....      | 110 |
| 二十四、基金合同的内容摘要 .....     | 112 |
| 二十五、基金托管协议的内容摘要 .....   | 129 |
| 二十六、对基金份额持有人的服务 .....   | 141 |
| 二十七、其他应披露事项 .....       | 142 |
| 二十八、招募说明书的存放及查阅方式 ..... | 146 |
| 二十九、备查文件 .....          | 147 |

## 一、前言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《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》及其他有关法律法规及《新华中证环保产业指数分级证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)编写。

本招募说明书阐述了新华中证环保产业指数分级证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资者投资决策有关的全部必要事项,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

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。

本基金根据本招募说明书所载明资料申请募集。本招募说明书由基金管理人解释。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出任何解释或者说明。

本基金招募说明书依据基金合同编写,并经中国证监会注册。基金合同是约定基金合同当事人之间权利、义务的法律文件。投资者依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务,基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

## 二、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：指新华中证环保产业指数分级证券投资基金
- 2、基金管理人：指新华基金管理股份有限公司
- 3、基金托管人：指中国建设银行股份有限公司
- 4、基金合同：指《新华中证环保产业指数分级证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充
- 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《新华中证环保产业指数分级证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书或本招募说明书：指《新华中证环保产业指数分级证券投资基金招募说明书》及其更新
- 7、基金份额发售公告：指《新华中证环保产业指数分级证券投资基金基金份额发售公告》
- 8、基金产品资料概要：指《新华中证环保产业指数分级证券投资基金基金产品资料概要》及其更新
- 9、上市交易公告书：指《新华中证环保产业指数分级证券投资基金之新华环保 A 份额、新华环保 B 份额上市交易公告书》
- 10、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
- 11、《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 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修改的《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
- 12、《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》及配套规则

13、《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

14、《运作办法》：指中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布、同年 8 月 8 日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

15、《流动性风险管理规定》：指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《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

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/或中国银行保险监督管理委员会

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《合格境外机构投资者境内证券投资管理办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者

22、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

23、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

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

25、销售机构：指新华基金管理股份有限公司以及符合《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服务代理协议，代为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。其中可通过深圳证券交易所交易系统办理本基金销售



业务的机构必须是具有基金销售业务资格、并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、可通过深圳证券交易所交易系统办理本基金销售业务的深圳证券交易所会员单位

26、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开放式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

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

28、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

29、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

30、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

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

32、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

33、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过 3 个月

34、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

35、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

36、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

37、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日(不包含 T 日)

38、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

39、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

40、《业务规则》：指深圳证券交易所发布实施的《上市开放式基金业务指引》、《深圳证券交易所开放式基金申购赎回业务实施细则》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》及对其不时做出的修订；中国证券登记结算有限责任公司发布实施的《中国证券登记结算有限责任公司上市开放式基金登记结算业务实施细则》及对其不时做出的修订；深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司发布的相关通知、指引、指南等

41、认购：指在基金募集期内，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

42、申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

43、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为

44、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

45、转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作

46、定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期申购日、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基金申购申请的一种投资方式

47、新华环保份额：指本基金的基础份额。投资人在场外认/申购的新华环保份额不进行基金份额自动分离；投资人在场内认购的新华环保份额将进行基金份额自动分离；投资人在场内申购的新华环保份额，可选择进行基金份额分拆，也可选择不进行基金份额分拆

48、新华环保 A 份额：指场内认购的新华环保份额按基金合同约定规则所自动分离的稳健收益类基金份额

49、新华环保 B 份额：指场内认购的新华环保份额按基金合同约定规则所

---

---

### 自动分离的积极收益类基金份额

50、新华环保 A 份额的本金：除非基金合同文义另有所指，对于新华环保 A 份额而言，指 1.000 元乘以所持份额数得到的金额

51、巨额赎回：指本基金单个开放日，新华环保份额净赎回申请(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)超过上一开放日基金总份额（包括新华环保份额、新华环保 A 份额、新华环保 B 份额）的 10%

52、流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等

53、元：指人民币元

54、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、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

55、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

56、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

57、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

58、基金份额参考净值：指在基金份额净值计算的基础上，根据基金合同给定的计算公式得到的基金份额估算价值，按基金份额的不同，可区分为新华环保 A 份额参考净值、新华环保 B 份额参考净值。基金份额参考净值是对基金份额价值的一个估算，并不代表基金份额持有人可获得的实际价值

59、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（参考）净值的过程

60、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

61、场外：指不通过深圳证券交易所交易系统而通过自身的柜台或者其他交易系统办理基金份额认购、申购和赎回业务的基金销售机构和场所

62、场内：指通过深圳证券交易所会员单位和深圳证券交易所交易系统办理基金份额认购、申购、赎回和上市交易业务的场所

63、上市交易：指基金存续期间投资人通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖新华环保 A 份额、新华环保 B 份额的行为

64、系统内转托管：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

65、跨系统转托管：指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统间进行转登记的行为

66、自动分离：指投资人在场内认购的每 2 份新华环保份额在发售结束后按 1:1 比例自动转换为 1 份新华环保 A 份额和 1 份新华环保 B 份额的行为

67、配对转换：指本基金的新华环保份额与新华环保 A 份额、新华环保 B 份额之间按约定的转换规则进行转换的行为，包括分拆和合并

68、分拆：指根据基金合同的约定，基金份额持有人将其持有的每 2 份新华环保份额的场内份额申请转换成 1 份新华环保 A 份额与 1 份新华环保 B 份额的行为

69、合并：指根据基金合同的约定，基金份额持有人将其持有的每 1 份新华环保 A 份额与 1 份新华环保 B 份额申请转换成 2 份新华环保份额的场内份额的行为

70、约定年基准收益率：指新华环保 A 份额约定年基准收益率为“同期银行人民币一年期定期存款利率（税后）+4.0%”，同期银行人民币一年期定期存款利率以当年 1 月 1 日中国人民银行公布的金融机构人民币一年期存款基准利率为准。基金合同生效日所在年度的约定年基准收益率为“基金合同生效日中国人民银行公布的金融机构人民币一年期存款基准利率（税后）+4.0%”。每份新华环保 A 份额约定收益均以 1.00 元为基准进行计算，但基金管理人并不承诺或保证新华环保 A 份额的基金份额持有人的该等收益，如在某一会计年度内本基金资产出现极端损失情况下，新华环保 A 份额的基金份额持有人可能会面临无法取得约定收益的风险甚至损失本金的风险

---

---

71、约定收益、应计收益：新华环保 A 份额依据约定年基准收益率及基金合同约定的截至计算日的实际天数计算的累计收益

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

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

74、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

### 三、基金管理人

#### (一) 基金管理人概况

名称：新华基金管理股份有限公司

住所：重庆市江北区聚贤岩广场6号力帆中心2号办公楼第19层

办公地址：北京市海淀区西三环北路11号海通时代商务中心C1座

重庆市江北区聚贤岩广场6号力帆中心2号办公楼第19层

法定代表人：张宗友

设立日期：2004年12月9日

批准设立机关：中国证监会

批准设立文号：证监基金字【2004】197号

注册资本：贰亿壹仟柒佰伍拾万元

联系人：齐岩

电话：(010) 68779666

传真：(010) 68779528

股权结构：

| 股东名称         | 出资额 (万元人民币) | 出资比例   |
|--------------|-------------|--------|
| 恒泰证券股份有限公司   | 12,750      | 58.62% |
| 新华信托股份有限公司   | 7,680       | 35.31% |
| 杭州永原网络科技有限公司 | 1,320       | 6.07%  |
| 合计           | 21,750      | 100%   |

#### (二) 主要人员情况

##### 1、董事会成员

张宗友先生：董事长，硕士。历任内蒙古证券有限责任公司营业部总经理、太平洋证券股份有限公司副总经理、恒泰证券股份有限公司副总经理、新华基金管理股份有限公司总经理。现任新华基金管理股份有限公司董事长。

刘全胜先生，硕士，董事。历任内蒙古证券包头九原区证券服务部经理、内蒙古证券包头昆区证券服务部经理、恒泰证券区内经纪事业部总经理助理、恒泰证券包头钢铁大街营业部总经理助理、恒泰证券临河胜利北路营业部总经理、恒泰证券经纪业务管理总部总经理、恒泰证券总裁助理兼经纪事业部总经理、恒泰证券副总裁。现任新华基金管理股份有限公司总经理。

项琥先生，硕士，董事。历任中国国际信托投资公司天津分公司、中信证券天津证券业务部经理、天津协通咨询中心国债服务部副经理、天津未来保险代理有限公司总经理、新华信托股份有限公司天津业务部总经理、新华信托股份有限公司副总经理。现任新华信托股份有限公司董事总经理。

翟晨曦女士，经济学博士后。曾任国家开发银行投资业务局、评审三局项目经理、国家开发银行资金交易部交易员、副处长、处长。现任天风证券股份有限公司副总裁兼公司执委会副主任、天风国际证券集团有限公司董事局主席，兼任恒泰证券股份有限公司联席总裁、新华基金管理股份有限公司联席董事长。

胡波先生：独立董事，博士。历任中国人民大学财政金融学院教师、中国人民大学风险投资发展研究中心研究员、副主任、执行主任。现任中国人民大学财政金融学院副教授。

胡湘先生，经济学硕士，独立董事。曾任全国社保基金理事会副处长、鹏华基金管理有限公司副总裁。现任浙江大钧资产管理有限公司总裁。

刘成伟先生，法学硕士，独立董事。曾任环球律师事务所律师、美国众达律师事务所（北京）顾问。现任环球律师事务所合伙人。

## 2、监事会成员

杨淑飞女士：监事会主席，硕士。历任航天科工财务公司结算部经理、航天科工财务公司风险管理部经理，航天科工财务公司总会计师、总法律顾问、董秘、副总裁，华浩信联（北京）科贸有限公司财务总监。现任恒泰证券股份有限公司财务总监。

张浩先生：职工监事，硕士。历任长盛基金管理有限公司信息技术部副总监，长盛基金管理有限公司风险管理部副总监，合众资产管理股份有限公司风险管理部总监，房宝信业（北京）投资管理有限公司总经理。现任新华基金管理股份有限公

司监察稽核部总监。

别冶女士：职工监事，金融学学士。十年证券从业经验，历任《每日经济新闻》、《第一财经日报》财经记者，新华基金管理股份有限公司媒体经理。现任新华基金管理股份有限公司总经理办公室副主任。

### 3、高级管理人员

张宗友先生：董事长，简历同上。

刘全胜先生：总经理，简历同上。

齐岩先生：督察长，学士。历任中信证券股份有限公司解放北路营业部职员、天津管理部职员、天津大港营业部综合部经理。现任新华基金管理股份有限公司督察长兼任子公司北京新华富时资产管理有限公司董事。

徐端骞先生：副总经理兼任首席信息官，学士。历任上海君创财经顾问有限公司并购部经理、上海力矩产业投资管理有限公司并购部经理、新时代证券有限责任公司投行部项目经理、新华基金管理股份有限公司总经理助理兼运作保障部总监。现任新华基金管理股份有限公司副总经理兼任首席信息官。

刘征宇先生：副总经理，本科学历、硕士学位。历任浙江物资贸易中心业务经理、浙江机械投资有限公司部门经理、浙江汇诚期货经纪有限公司总经理、上海艺高广告有限公司总经理、东吴期货有限公司部门经理、光大期货有限公司部门经理、海通期货有限公司部门经理、上海交通大学上海高级金融学院副主任、欧洲期货交易所香港代表处资深顾问、东方证券资产管理有限公司机构业务部总监、安信基金管理有限公司机构创新部总经理、安信乾盛财富管理（深圳）有限公司总经理。现任新华基金管理股份有限公司副总经理。

申峰旗先生：普林斯顿大学金融学硕士，15年证券从业经验。历任长城人寿投资总监、长城财富保险资产管理公司副总经理，中信保诚人寿资产管理中心副总监、投资主管，嘉实基金投资经理；曾就职纽约的投资银行（巴克莱资本、花旗集团）和对冲基金（卡尔森资本）。现任新华基金副总经理兼投资总监、基金经理。

### 4、本基金基金经理人员情况

#### （1）历任基金经理

李昱女士，管理本基金时间：2014年09月11日至2015年9月15日。



李会忠先生，管理本基金时间：2014年9月15日至2016年11月3日。

张永超先生，管理本基金时间：2016年7月20日至2017年9月1日。

## (2) 现任基金经理

邓岳先生：信息与信号处理专业硕士,12年证券从业经验，历任北京红色天时金融科技有限公司量化研究员，国信证券股份有限公司量化研究员，光大富尊投资有限公司量化研究员、投资经理，盈融达投资（北京）有限公司投资经理。2017年6月加入新华基金管理股份有限公司，现任新华中证环保产业指数分级证券投资基金基金经理、新华MSCI中国A股国际交易型开放式指数证券投资基金基金经理、新华MSCI中国A股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、新华沪深300指数增强型证券投资基金基金经理。

## 5、投资管理委员会成员

主席：总经理刘全胜先生；成员：投资总监申峰旗先生、投资副总监于泽雨先生、投资副总监姚秋先生、权益投资部总监赵强先生、固定收益与平衡投资部总监王滨先生、研究部总监张霖女士、基金经理付伟先生、基金经理栾超先生。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

## (三) 基金管理人的职责

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

2、办理基金备案手续；

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4、按照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收益；

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6、编制季度报告、中期报告和年度报告；

7、计算并公告基金净值信息、新华环保A份额与新华环保B份额的基金份额参考净值，确定新华环保份额申购、赎回价格；

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

9、召集基金份额持有人大会；

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

11、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者实施其他法律行为；

12、中国证监会规定的其他职责。

#### **(四) 基金管理人的承诺**

1、本基金管理人将根据基金合同的规定，按照招募说明书列明的投资目标、策略及限制全权处理本基金的投资。

2、本基金管理人不得从事违反法律法规的行为，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反法律法规行为的发生。

3、本基金管理人建立健全内部控制制度，采取有效措施，禁止将基金财产用于下列投资或活动：

(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) 以任何形式的交易安排人为降低投资组合的真实久期，变相持有长期债券；

(8) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

4、本基金管理人将加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下行为：

(1) 越权或违规经营，违反基金合同或托管协议；

(2) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益；

(3) 在向中国证监会报送的材料中弄虚作假；

(4) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；

(5) 玩忽职守、滥用职权、不按照规定履行职责；

(6) 泄漏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，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

(7) 进行证券投资，但未事先向基金管理人申报，或与基金份额持有人发生利益冲突；

(8) 其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

#### 5、基金经理承诺

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

(2) 不利用职务之便为自己、代理人、代表人、受雇人或任何其他第三人谋取不当利益；

(3) 不泄漏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；

(4) 不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

#### (五) 基金管理人的内部控制制度

##### 1、内部控制制度

###### (1) 内部控制的原则

**健全性原则：**内部控制应当包括公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节。

**有效性原则：**通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护内控制度的有效执行。

**独立性原则：**公司各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立，基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离。

**相互制约原则：**公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。

**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，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

###### (2) 内部控制的主要内容

###### 1) 控制环境

① 控制环境构成公司内部控制的基础，环境控制包括管理思想、经营理念、

控制文化、公司治理结构、组织结构和员工道德素质等内容。

② 管理层通过定期学习、讨论、检讨内控制度，组织内控设计并以身作则、积极执行，牢固树立诚实信用和内控优先的思想，自觉形成风险管理观念；通过营造公司内控文化氛围，增进员工风险防范意识，使其贯穿于公司各部分、岗位和业务环节。

③ 董事会负责公司内部控制基本制度的制定和内控工作的评估审查，对公司建立有效的内部控制系统承担最终责任；同时，通过充分发挥独立董事和监事会的监督职能，避免不正当关联交易、利益输送和内部人控制现象的发生，建立健全符合现代企业制度要求的法人治理结构。

④ 建立决策科学、运营规范、管理高效的运行机制，包括民主透明的决策程序和管理议事规则、高效严谨的业务执行系统、以及健全有效的内部监督和反馈系统。

⑤ 建立科学的聘用、培训、轮岗、考评、晋升、淘汰等人事管理制度，严格制定单位业绩和个人工作表现挂钩的薪酬制度，确保公司职员具备和保持正直、诚实、公正、廉洁的品质与应有的专业能力。

## 2) 风险评估

内部稽核人员定期评估公司风险状况，范围包括所有可能对经营目标产生负面影响的内部和外部因素，评估这些因素对公司总体经营目标产生影响的程度及可能性，并将评估报告报公司董事会及高级管理人员。

## 3) 组织体系

内部控制组织体系包括三个层次：

第一层次：董事会层面对公司经营管理过程中的风险控制工作的指导；公司董事会层面对公司经营管理过程中的风险控制的组织主要是董事会通过其下设的风险控制委员会和督察长对公司经营活动的合规性进行监督。

风险控制委员会在董事会领导下，着力于从强化内部监控的角度对公司自有资产经营、基金资产经营及合规性经营管理中的合规性进行全面、重点的跟踪分析并提出改进方案，调整、确定公司的内部控制制度并评估其有效性。其目的是完善董事会的合规监控功能，建立良性的公司治理结构。

督察长负责风险控制委员会决议的具体执行，按照中国证监会的规定和风险控制委员会的授权对公司经营管理活动的合规合法性进行监督稽核；参与公司风险控制工作，发生重大风险事件时有权向公司董事会和中国证监会直接报告。

第二层次：公司管理层对经营风险进行预防和控制的组织主要是风险管理委员会、监察稽核部和金融工程部；

①风险管理委员会是公司日常经营管理的最高风险控制机构。主要职权是：拟定公司风险控制的基本策略和制度，并监督实施；对公司日常经营管理风险进行整体分析和评估，并制定相应的改进措施；负责公司的危机处理工作等。

②监察稽核部是公司内部监察部门，独立执行内部的监督稽核工作。风险管理人員使用数量化的风险管理系统，随时对基金投资过程中的市场风险进行独立监控，并提出具体的改进意见。

第三层次：各职能部门对各自业务的自我检查和监控。

公司各职能部门作为公司内部风险控制的具体实施单位，在公司各项基本管理制度的基础上，根据公司经营计划、业务规划和各部门的具体情况制订本部门的业务管理规定、操作流程及内部控制规定，并严格执行，将风险控制在最小范围内。

#### 4) 制度体系

制度是内部控制的指引和规范，制度缜密是内部控制体系的基础。

① 内部控制制度包括内部管理控制制度、业务控制制度、会计核算控制制度、信息披露制度、监察稽核制度等。

② 内部管理控制制度包括授权管理制度、人力资源及业绩考核制度、行政管理制 度、员工行为规范、纪律程序。

③ 业务控制制度包括投资管理制度、风险控制制度、资料档案管理制度、技术保障制度和危机处理制度。

#### 5) 信息与沟通

建立内部办公自动化信息系统与业务汇报体系，通过建立有效的信息交流渠道，保证公司员工及各级管理人员可以充分了解与其职责相关的信息，保证信息及时送达适当的人员进行处理。

## 2、基金管理人关于内部控制制度的声明

- 
- 
- (1) 基金管理人确知建立、实施和维持内部控制制度是基金管理人董事会及管理层的责任，董事会承担最终责任；
  - (2) 上述关于内部控制制度的披露真实、准确；
  - (3) 基金管理人承诺将根据市场环境的变化及基金管理人不断发展完善内部控制制度。

## 四、基金托管人

### (一) 基金托管人情况

#### 1、基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：田国立

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

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]12 号

联系人：周海新

联系电话：(021)6063 7111

#### 2、主要人员情况

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、全球托管处、养老金托管处、新兴业务处、运营管理处、跨境托管运营处、社保及大客户处、托管应用系统支持处、合规监督处等 12 个职能处室，在安徽合肥设有托管运营中心，在上海设有托管运营中心上海分中心，共有员工 300 余人。自 2007 年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

#### 3、基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，

已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金、存托业务等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2020 年二季度末，中国建设银行已托管 1000 只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行先后 9 次获得《全球托管人》“中国最佳托管银行”、4 次获得《财资》“中国最佳次托管银行”、连续多年荣获中央国债登记结算有限责任公司（中债）“优秀资产托管机构”、银行间市场清算所股份有限公司（上清所）“优秀托管银行”奖项，并在 2016 年被《环球金融》评为中国市场唯一一家“最佳托管银行”、在 2017 年及 2019 年分别荣获《亚洲银行家》“最佳托管系统实施奖”、“中国年度托管业务科技实施奖”。

## （二）基金托管人的内部控制制度

### 1、内部控制目标

作为基金托管人，中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格检查，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

### 2、内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。资产托管业务部配备了专职内控合规人员负责托管业务的内控合规工作，具有独立行使内控合规工作职权和能力。

### 3、内部控制制度及措施

资产托管业务部具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

## （三）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



## 1、监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“新一代托管应用监督子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

## 2、监督流程

1) 每工作日按时通过新一代托管应用监督子系统，对各基金投资运作比例控制等情况进行监控，如发现投资异常情况，向基金管理人进行风险提示，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，如有重大异常事项及时报告中国证监会。

2) 收到基金管理人的划款指令后，对指令要素等内容进行核查。

3) 通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理人进行解释或举证，如有必要将及时报告中国证监会。

---

---

## 五、相关服务机构

### (一) 基金份额销售机构

基金份额销售机构包括场外销售机构和场内销售机构:

#### 1、场外销售机构

##### (1) 直销机构

名称: 新华基金管理股份有限公司北京直销中心

办公地址: 北京市海淀区西三环北路 11 号海通时代商务中心 C1 座

法定代表人: 张宗友

电话: 010-68730999

联系人: 陈静

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

客服电话: 400-819-8866

电子直销: 新华基金网上交易平台

网址: <https://trade.ncfund.com.cn>

##### (2) 其他销售机构

#### 1) 中国建设银行股份有限公司

注册地址: 北京市西城区金融大街 25 号

办公地址: 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人: 田国立

联系人: 张静

客服电话: 95533

网址: [www.ccb.com](http://www.ccb.com)

#### 2) 光大证券股份有限公司

住所: 上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人: 周健男

联系人: 刘晨

客服电话: 95525

---

---

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

3) 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

客服电话：95521

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

4) 海通证券股份有限公司

住所：上海市广东路 698 号

法定代表人：周杰

联系人：李笑鸣

客服电话：95553

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

5) 恒泰证券股份有限公司

住所：内蒙古呼和浩特市新城区海拉尔东街满世尚都办公商业综合楼

法定代表人：庞介民

联系人：熊丽

客服电话：400-196-6188 ， 956088

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

6) 华西证券股份有限公司

注册地址：成都市高新区天府二街 198 号

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：谢国梅

客服电话：95584

网址：[www.hx168.com.cn](http://www.hx168.com.cn)

7) 中泰证券股份有限公司

住所：济南市市中区经七路 86 号

---

---

法定代表人：李玮

联系人：许曼华

客服电话：95538

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

8) 新时代证券股份有限公司

住所：北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

法定代表人：叶顺德

联系人：田芳芳

客服电话：95399

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

9) 中国银河证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层

法定代表人：陈共炎

联系人：邓颜

客服电话：95551 或 4008-888-888

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

10) 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

客服电话：95587

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

11) 中信证券（山东）有限责任公司

住所：青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

法定代表人：姜晓林

客服电话：95548

联系人：吴忠超

---

---

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

12) 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: 北京朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦

法定代表人: 张佑君

联系人: 王一通

客服电话: 95548

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

13) 华龙证券股份有限公司

住所: 兰州市城关区东岗西路638号兰州财富中心21楼

法定代表人: 陈牧原

联系人: 李昕田

客服电话: 400-689-8888、0931-96668

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

14) 国信证券股份有限公司

住所: 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

法定代表人: 何如

联系人: 李颖

客服电话: 95536

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

15) 平安证券股份有限公司

住所深圳市福田区益田路5033号平安金融中心61层-64层荣超大厦16-20层

法定代表人: 何之江

联系人: 石静武

客服电话: 95511-8

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

16) 东海证券股份有限公司

注册地址: 江苏省常州延陵西路23号投资广场18层

---

---

办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人：陈耀庭

电话：021-20333333

传真：021-50498825

联系人：王一彦

客服电话：95531；400-8888-588

网址：www.longone.com.cn

17) 华泰证券股份有限公司

住所：南京市江东中路 228 号

法定代表人：周易

联系人：庞晓芸

客服电话：95597

网址：www.htsc.com.cn

18) 华安证券股份有限公司

住所：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

法定代表人：章宏韬

联系人：甘霖

客服电话：95318

网址：www.hazq.com

19) 湘财证券股份有限公司

住所：长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

法定代表人：孙永祥

客服电话：021-68865020

联系人：杜颖灏

网址：www.xcsc.com

20) 东吴证券股份有限公司

注册地址：苏州工业园区星阳街 5 号

办公地址：苏州工业园区星阳街 5 号

---

---

法定代表人：范力

联系电话：0512-62938521

传真：0512-62938527

联系人：陆晓

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

客服电话：95330

21) 东北证券股份有限公司

住所：长春市生态大街 6666 号

法定代表人：李福春

联系人：安岩岩

客服电话：95360

网址：[www.nesc.cn](http://www.nesc.cn)

22) 申万宏源证券有限公司

住所：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：李梅

联系人：陈宇

客服电话：95523 或 4008895523

23) 招商证券股份有限公司

住所：深圳市福田区福田街道福华一路 111 号

法定代表人：霍达

联系人：林生迎

客服电话：95565

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

24) 中信期货有限公司

住所：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 13 层  
1301-1305 室、14 层

法定代表人：张皓

联系人：洪诚

客服电话：400-990-8826

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

25) 北京植信基金销售有限公司

注册地址：北京市密云县兴盛南路8号院2号楼106室-67

办公地址：北京市朝阳区盛世龙源国食苑10号楼

法定代表人：于龙

联系人：张喆

客服电话:4006-802-123

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

26) 中信证券华南股份有限公司

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：胡伏云

客服电话：95396

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

27) 嘉实财富管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期53层5312-15单元

办公地址：上海市浦东新区世纪大道8号国金中心二期5312-15单元

法定代表人：张峰

联系人：景琪

客户服务电话：400-021-8850

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

28) 京东肯特瑞基金销售有限公司

注册地址:北京市海淀区西三旗建材城中路12号17号平房157

办公地址:北京市通州区亦庄经济技术开发区科创十一街18号院京东集团总部A座17层

法定代表人:王苏宁



电话:95118

传真:010-89189566

商务联系人:陈龙鑫

客服热线: 95118

公司网站: [kenterui.jd.com](http://kenterui.jd.com)

29) 北京增财基金销售有限公司

注册地址: 北京市西城区南礼士路 66 号 1 号楼 12 层 1208 号

办公地址: 北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208-1209 室

法定代表人: 罗细安

联系人: 张蕾

客服电话: 010-67000988

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

30) 北京创金启富基金销售有限公司

注册地址: 北京市西城区白纸坊东街 2 号院 6 号楼 712 室

办公地址: 北京市西城区白纸坊东街 2 号经济日报社 A 座综合楼 712 号

法定代表人: 梁蓉

联系人: 李婷婷

客服电话: 400-6262-818

公司网站: [www.5irich.com](http://www.5irich.com)

31) 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: 上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 9 楼

法定代表人: 杨文斌

联系人: 胡凯隽

客服电话: 400-700-9665

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

32) 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 1002 室

---

---

办公地址：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

客服电话：400-920-0022

联系人：刘洋

公司网站：[licaike.hexun.com](http://licaike.hexun.com)

33) 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：北京市朝阳区东三环中路 20 号乐成中心 A 座 23 层

法定代表人：周斌

联系人：张晔

客服电话：4007-868-868

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

34) 北京虹点基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区东三环北路 17 号 10 层 1015 室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路 17 号 10 层 1015 室

法定代表人：何静

联系人：王重阳

座机：010-65951887

客服电话：400-618-0707

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

35) 北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 号

办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层

法定代表人：王伟刚

客服电话：400-619-9059

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

36) 上海汇付基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区黄河路 333 号 201 室 A 区 056 单元

办公地址：上海市宜山路 700 号普天信息产业园 2 期 C5 栋 2 楼

法定代表人：金佶

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

客服电话：400-821-3999

37) 上海凯石财富基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室

办公地址：上海市黄浦区延安东路 1 号凯石大厦 4 楼

法定代表人：陈继武

联系人：葛佳蕊

客服电话：400-643-3389

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

38) 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：李兴春

联系人：曹怡晨

客服电话：95733

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

39) 上海联泰基金销售有限公司

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

办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层

法定代表人：尹彬彬

联系人：陈东

客服电话：400-118-1188

公司网址：[www.66liantai.com](http://www.66liantai.com)

40) 上海陆金所基金销售有限公司

注册地址：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

---

---

法定代表人：王之光

联系人：何雪

客服电话：400-821-9031

公司网站：www.lufunds.com

41) 蚂蚁(杭州)基金销售有限公司

注册地址：杭州市余杭区五常街道文一西路 969 号 3 栋 5 层 599 室

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号 12 楼

法定代表人：祖国明

客服电话：400-766-123

联系人：韩爱彬

网址：www.fund123.cn

42) 南京苏宁基金销售有限公司

注册地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

办公地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法定代表人：王锋

联系人：王锋

客服电话：95177

公司网站：www.snjijin.com

43) 北京钱景基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村东路 18 号 1 号楼 11 层 B-1108

办公地址：北京市海淀区中关村东路 18 号 1 号楼 11 层 B-1108

法定代表人：王利刚

客服电话：400-875-9885

联系人：盛海娟

公司网站：www.qianjing.com

44) 上海长量基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人：张跃伟

联系人：唐诗洋

客服电话：400-820-2899

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

45) 上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市崇明县长兴镇潘园公里 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和经济开发区）

办公地址：上海市昆明路 518 号北美广场 A1002-A1003 室

法定代表人：王翔

联系人：蓝杰

客服电话：400-820-5369

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

46) 深圳众禄基金销售股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦 8 楼 801

办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

法定代表人：薛峰

客服电话：4006-788-887

联系人：童彩平

公司网址：[www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn)，[www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

47) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座东方财富大厦

法定代表人：其实

客服电话：400-1818-188

联系人：屠彦洋

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

48) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903 室

办公地址：浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2号楼2楼

法定代表人：吴强

联系人：洪泓

客服电话：4008-773-772

公司网站：[fund.10jqka.com.cn](http://fund.10jqka.com.cn)

49) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道民田路178号华融大厦27层2704

办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座9层

法定代表人：洪弘

联系人：张燕

客服电话：400-166-1188

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

50) 一路财富（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区宝盛南路1号院20号楼9层101-14

办公地址：北京市海淀区宝盛南路1号院20号楼9层101-14

法定代表人：吴雪秀

联系人：刘栋栋

客服电话：400-001-1566

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

51) 珠海盈米基金销售有限公司

注册地址：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

联系人：钟琛

客服电话：020-89629066

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

52) 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

客服电话：400-8188-000

联系人：马林

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

53) 中证金牛（北京）投资咨询有限公司

注册地址：北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室

办公地址：北京市宣武门外大街甲一号新华社第三工作区 A 座 5 层

法定代表人：钱昊旻

联系人：仲甜甜

客服电话：4008-909-998

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

54) 浦领基金销售有限公司

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

办公地址：北京市朝阳区望京浦项中心 A 座 9 层 04-08

法定代表人：聂婉君

客服电话：400-876-9988

联系人：李艳

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

55) 奕丰基金销售有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场 A 座 17 楼 1704 室 法

定代表人：TEO WEE HOWE

联系人：叶健

客服电话：400-684-0500

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

56) 北京植信基金销售有限公司

注册地址: 北京市密云县兴盛南路 8 号院 2 号楼 106 室-67

办公地址: 北京市朝阳区盛世龙源国食苑 10 号楼

法定代表人: 于龙

联系人: 张喆

客服电话:4006-802-123

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

57) 民商基金销售(上海)有限公司

注册地址: 上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区(东座) 6 楼 A31 室

办公地址: 上海市浦东新区张杨路 707 号生命人寿大厦 32 楼

法定代表人: 贲惠琴

联系人: 林志枫

电话: 15626219801

电子邮件: [linzhifeng@msfgroup.com](mailto:linzhifeng@msfgroup.com)

58) 阳光人寿保险股份有限公司

注册地址: 海南省三亚市迎宾路 360-1 号三亚阳光金融广场 16 层

办公地址: 北京市朝阳区朝外大街乙 1 号 1 号楼昆泰国际大厦 12 层

法定代表人: 李科

联系人: 王磊

客服电话:95510

网址: <http://fund.sinosig.com/>

59) 泛华普益基金销售有限公司

注册地址: 成都市成华区建设路 9 号高地中心 1101 室

办公地址: 成都市金牛区花照壁西顺街 399 号 1 栋 1 单元龙湖西宸天街 B 座  
12 层

法定代表人: 于海锋

联系人: 隋亚芳

客服电话: 400-080-3388

网址: <https://www.puyifund.com/>



60) 上海大智慧基金销售有限公司

注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102 单元

办公地址: 上海市浦东新区杨高南路 428 号 1 号楼 1102 单元

法定代表人: 申健

联系人: 邢成林

客服电话: 021-20292031

公司网址: <https://www.wg.com.cn/>

61) 宜信普泽(北京)基金销售有限公司

注册地址: 北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809

办公地址: 北京市朝阳区建国路 88 号 SOHO 现代城 C 座 180

法定代表人: 戎兵

联系人: 刘梦轩

客服电话: 400-6099-200

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

2、场内销售机构

场内销售机构为具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位, 具体名单可在深交所网站查询。

3、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。

**(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: 周明

电话: 010-59378839

传真: 010-59378907

联系人: 朱立元

**(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

---

---

注册地址：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：安冬

经办律师：安冬、陆奇

#### **（四）审计基金财产的会计师事务所**

名称：瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市海淀区西四环中路 16 号院 2 号楼 4 层

办公地址：北京市东城区永定门西滨河路 8 号院 7 号楼中海地产广场西塔 11

层

法定代表人：刘贵彬

电话：010—88219191

传真：010—88210558

注册会计师：吕金保、姜明明

经办人：姜明明

## 六、基金份额的分类与净值计算规则

### (一) 基金份额的分类

本基金的基金份额包括新华中证环保产业指数分级证券投资基金之基础份额（即“新华环保份额”）、新华中证环保产业指数分级证券投资基金之稳健收益类份额（即“新华环保 A 份额”）与新华中证环保产业指数分级证券投资基金之积极收益份额（即“新华环保 B 份额”）。其中新华环保 A 份额、新华环保 B 份额配比始终保持 1:1 的比例不变。

### (二) 基金份额的自动分离与配对转换规则

基金发售结束后，本基金将投资人在场内认购的全部新华环保份额按照 1:1 的比例自动分离为预期收益与预期风险不同的两种份额类别，即新华环保 A 份额和新华环保 B 份额。

根据新华环保 A 份额和新华环保 B 份额的基金份额比例，新华环保 A 份额在场内基金初始总份额中的份额占比为 50%，新华环保 B 份额在场内基金初始总份额中的份额占比为 50%，而且两类基金份额的基金资产合并运作。

基金合同生效后，新华环保份额设置单独的基金代码，只可以进行场内与场外的申购和赎回，但不上市交易。新华环保 A 份额与新华环保 B 份额交易代码不同，只可在深圳证券交易所上市交易，不可进行申购或赎回。

投资人可在场内申购和赎回新华环保份额，投资人可选择将其场内申购的新华环保份额按 1:1 的比例分拆成新华环保 A 份额和新华环保 B 份额。投资人可按 1:1 的配比将其持有的新华环保 A 份额和新华环保 B 份额申请合并为场内新华环保份额后赎回。

投资人可在场外认购、申购和赎回新华环保份额。场外认购、申购的新华环保份额不进行自动分离或分拆，但基金合同另有规定的除外。投资人可将其持有的场外新华环保份额跨系统转托管至场内并申请将其按 1:1 的比例分拆成新华环保 A 份额和新华环保 B 份额后上市交易。投资人可按 1:1 的配比将其持有的新华环保 A 份额和新华环保 B 份额合并为场内新华环保份额后赎回。

无论是定期份额折算，还是不定期份额折算（有关本基金的份额折算详见本基金招募说明书“第十八部分 基金份额折算”），其所产生的场内新华环保份额不进行自动分离。投资人可选择将上述折算产生的场内新华环保份额按 1: 1 的比例分拆为新华环保 A 份额和新华环保 B 份额。

### （三）新华环保 A 份额和新华环保 B 份额的净值计算规则

根据新华环保 A 份额和新华环保 B 份额的预期风险和预期收益特性不同，本基金份额所自动分离或分拆的两类基金份额新华环保 A 份额和新华环保 B 份额具有不同的净值计算规则。

在本基金的存续期内，本基金将在每个工作日按基金合同约定的净值计算规则对新华环保 A 份额和新华环保 B 份额分别进行净值计算，新华环保 A 份额为低预期风险且预期收益相对稳定的基金份额，本基金资产净值优先确保新华环保 A 份额的本金及约定收益；新华环保 B 份额为高预期风险且预期收益相对较高的基金份额，本基金在优先确保新华环保 A 份额的本金及约定收益后，将剩余基金资产净值计为新华环保 B 份额的净资产。

在本基金存续期内，新华环保 A 份额和新华环保 B 份额的净值计算规则如下：

1. 新华环保 A 份额约定年基准收益率为“同期银行人民币一年期定期存款利率（税后）+4.0%”，同期银行人民币一年期定期存款利率以当年 1 月 1 日中国人民银行公布的金融机构人民币一年期存款基准利率为准。基金合同生效日所在年度的约定年基准收益率为“基金合同生效日中国人民银行公布的金融机构人民币一年期存款基准利率（税后）+4.0%”。约定年基准收益率每年 1 月 1 日进行调整。约定收益均以 1.000 元为基准进行计算；

2. 本基金每个工作日对新华环保 A 份额和新华环保 B 份额进行净值计算。在进行对新华环保 A 份额和新华环保 B 份额各自的净值计算时，本基金资产净值优先确保新华环保 A 份额的本金及新华环保 A 份额约定收益，之后的剩余基金资产净值计为新华环保 B 份额的净资产。新华环保 A 份额约定收益依据新华环保 A 份额约定年基准收益率计算的每日收益率和截至计算日新华环保 A 份额应计收益的天数确定；

3. 每 2 份新华环保份额所代表的资产净值等于 1 份新华环保 A 份额和 1 份新华环保 B 份额的资产净值之和；

4.在本基金的基金合同生效日所在会计年度或存续的某一完整会计年度内，若未发生基金合同规定的不定期份额折算，则新华环保 A 份额在净值计算日应计收益的天数按自基金合同生效日至计算日或该会计年度年初至计算日的实际天数计算；若发生基金合同规定的不定期份额折算，则新华环保 A 份额在净值计算日应计收益的天数应按照最近一次该会计年度内不定期份额折算基准日至计算日的实际天数计算。

基金管理人并不承诺或保证新华环保 A 份额的基金份额持有人的本金及约定收益，如在某一会计年度内本基金资产出现极端损失情况下，新华环保 A 份额的基金份额持有人可能会面临无法取得约定收益甚至损失本金的风险。

#### （四）本基金基金份额净值的计算

本基金作为分级基金，按照新华环保 A 份额和新华环保 B 份额的净值计算规则依据以下公式分别计算并公告 T 日新华环保份额的基金份额净值、新华环保 A 份额和新华环保 B 份额的基金份额参考净值：

##### 1. 新华环保份额的基金份额净值计算

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

T 日新华环保份额的基金份额净值 = T 日闭市后的基金资产净值 / T 日本基金基金份额的总数

本基金作为分级基金，T 日本基金基金份额的总数为新华环保 A 份额、新华环保 B 份额和新华环保份额的份额数之和。

##### 2. 新华环保 A 份额和新华环保 B 份额的基金份额参考净值计算

$$NAV_{\text{新华环保 A}} = (1 + R)^{\frac{t}{N}}$$

$$NAV_{\text{新华环保 B}} = \frac{NAV_{\text{新华环保份额}} - 0.5 \times NAV_{\text{新华环保 A}}}{0.5}$$

设 T 日为基金份额参考净值计算日，T=1,2,3.....N；N 为当年实际天数；t=min{自年初至 T 日，自基金合同生效日至 T 日，自最近一次会计年度内份额折算基准日至 T 日}； $NAV_{\text{新华环保份额}}$  为 T 日每份新华环保份额的基金份额净值； $NAV_{\text{新华环保 A}}$  为 T 日新华环保 A 份额的基金份额参考净值； $NAV_{\text{新华环保 B}}$  为 T 日新华环保 B 份额的基

---

---

金份额参考净值；R 为新华环保 A 份额约定年基准收益率。

新华环保份额的基金份额净值、新华环保 A 份额和新华环保 B 份额的基金份额参考净值的计算，均保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

T 日的新华环保份额的基金份额净值、新华环保 A 份额和新华环保 B 份额的基金份额参考净值在当天收市后计算，并在 T+1 日公告。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

---

---

## 七、基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证监会证监许可[2014]513号文核准，募集期为2014年8月11日—2014年9月5日。经瑞华会计师事务所验资，按照每份基金份额1.00元计算，设立募集期间募集及利息结转的基金份额共计983,952,960.83份，有效认购户数为8358户。

---

---

## 八、基金合同的生效

根据有关规定，本基金符合基金合同生效有关条件，本基金管理人已向中国证监会办理完毕基金备案手续，并于 2014 年 9 月 11 日获得中国证监会的书面确认，基金合同自该日起生效。自基金合同生效之日起，本基金管理人正式开始管理本基金。



## 九、新华环保 A 份额与新华环保 B 份额的上市交易

### (一) 上市交易的基金份额

基金合同生效后，在本基金符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下，基金管理人将根据有关规定，申请新华环保 A 份额与新华环保 B 份额上市交易。

### (二) 上市交易的地点

本基金新华环保 A 份额与新华环保 B 份额上市交易的地点为深圳证券交易所。

### (三) 上市交易的时间

基金合同生效后六个月内，新华环保 A 份额与新华环保 B 份额将申请在深圳证券交易所上市交易。

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

### (四) 上市交易的规则

新华环保 A 份额与新华环保 B 份额在深圳证券交易所的上市交易需遵循《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》、《深圳证券交易所交易规则》等有关规定，包括但不限于：

1.新华环保 A 份额与新华环保 B 份额以不同的交易代码上市交易，两类基金份额上市首日的开盘参考价为前一交易日两类基金份额的基金份额参考净值；

2.新华环保 A 份额与新华环保 B 份额实行价格涨跌幅限制，涨跌幅比例为 10%，自上市首日起实行；

3.新华环保 A 份额与新华环保 B 份额买入申报数量为 100 份或其整数倍；

4.新华环保 A 份额与新华环保 B 份额申报价格最小变动单位为 0.001 元人民币；

5.新华环保 A 份额与新华环保 B 份额上市交易遵循《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》、《深圳证券交易所交易规则》及相关规定。

### (五) 上市交易的费用

新华环保 A 份额与新华环保 B 份额上市交易的费用按照深圳证券交易所有关规定办理。

---

---

(六) 上市交易的行情揭示

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

(七) 上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市

新华环保 A 份额与新华环保 B 份额的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照《基金法》相关规定和深圳证券交易所的相关规定执行。

(八) 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, 且此项修改无须召开基金份额持有人大会。

(九) 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。

## 十、新华环保份额的申购与赎回

本基金的新华环保 A 份额、新华环保 B 份额不接受投资人的申购与赎回，只上市交易；本基金基金合同生效后，投资人可通过场内或场外两种方式对新华环保份额进行申购与赎回。

### （一）申购和赎回场所

投资人办理新华环保份额场内申购和赎回业务的场所为具有基金销售业务资格且具有场内基金申购赎回资格的深圳证券交易所会员单位。投资人需使用深圳证券账户，通过深圳证券交易所交易系统办理新华环保份额场内申购、赎回业务。

投资人办理新华环保份额场外申购和赎回业务的场所为基金管理人直销机构和场外代销机构。投资人需使用中国证券登记结算有限责任公司开放式基金账户办理新华环保份额场外申购、赎回业务。

投资人应当在基金管理人和场内、场外代销机构办理新华环保份额申购、赎回业务的营业场所或按基金管理人和场内、场外代销机构提供的其他方式办理新华环保份额的申购和赎回。

本基金具体的场内、场外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。

### （二）申购和赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

深圳证券交易所的正常交易日为办理新华环保份额的申购和赎回开放日，场内业务具体办理时间为深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，场外业务办理时间以各销售机构的规定为准，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、证券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

基金管理人自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始办理新华环保份额的申购

与赎回，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒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新华环保份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其申购、赎回价格为下一开放日新华环保份额申购、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新华环保份额的基金份额净值为基准进行计算；

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

4、场外赎回遵循“先进先出”原则，即基金份额持有人在场外销售机构赎回新华环保份额时按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回；

5、投资人通过深圳证券交易所交易系统办理新华环保份额的场内申购、赎回业务时，需遵守深圳证券交易所的相关业务规则。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定，按新规定执行。

基金管理人可在法律法规允许的情况下，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。

投资人在提交申购申请时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资人在提交赎回申请时须持有足够的新华环保份额余额，否则所提交的申购、赎回申请无效。

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，申购申请成立；登记机构确认基金份额时，申购生效。

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；登记机构确认赎回时，赎回生效。投资人赎回申请成功后，基金管理人将在 T+7 日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

## 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 日内对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请，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。

基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资者应及时查询。

### (五) 申购和赎回的数量限制

1、投资者场外申购新华环保份额，在其他销售机构申购时每个账户单笔申购的最低金额为 100 元；投资者场内申购新华环保份额，每个账户单笔申购的最低金额为 50,000 元。

通过基金管理人直销网点场外申购新华环保份额，每个账户首次申购的最低金额为 10,000 元，追加申购新华环保份额的最低金额为单笔 1000 元。其他销售网点的投资者欲转入直销网点进行交易要受直销网点申购最低金额的限制。通过基金管理人网上交易系统办理新华环保份额申购业务的，申购最低金额为单笔 1000 元。基金管理人可根据市场情况，调整本基金首次申购和追加申购的最低金额。

2、基金份额持有人在销售机构赎回新华环保份额时，每次对新华环保份额的赎回申请不得低于 10 份基金份额。基金份额持有人赎回时或赎回后在销售机构(网点)保留的基金份额余额不足 10 份的，需一次全部赎回。

3、本基金可对单个投资人累计持有的基金份额上限进行限制，具体限制请参

见相关公告。

4、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益，具体规定请参见招募说明书或相关公告。

5、基金管理人可根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述规定的申购金额和赎回份额及最低持有份额的数量限制，基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定媒介上公告并报中国证监会备案。

#### (六) 申购和赎回的价格、费用及其用途

##### 1、申购费

###### (1) 场外申购费

本基金的场外申购率如下。

前端申购费率表：

| 申购金额（记为 M）                      | 申购费率      |
|---------------------------------|-----------|
| $M < 50$ 万元                     | 1.0%      |
| $50 \text{ 万元} \leq M < 100$ 万元 | 0.6%      |
| $M \geq 100$ 万元                 | 每笔 1000 元 |

###### (2) 场内申购费率

新华环保份额的场内申购费率由基金销售机构比照场外申购费率执行。

##### 2、赎回费率：

###### (1) 场外赎回费率

新华环保份额的场外赎回费率按照基金份额持有时间逐级递减，场外赎回的实际执行的费率如下：

| 持有期（记为 T）                  | 场外赎回费率 |
|----------------------------|--------|
| $T < 7$ 日                  | 1.50%  |
| $7 \text{ 日} \leq T < 1$ 年 | 0.5%   |
| $1 \text{ 年} \leq T < 2$ 年 | 0.2%   |
| $T \geq 2$ 年               | 0      |

**(2) 场内赎回费率**

| 持有期（记为 T） | 场内赎回费率 |
|-----------|--------|
| T < 7 日   | 1.50%  |
| T ≥ 7 日   | 0.50%  |

投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。本基金的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。其中，对持续持有期少于 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。对持有期不少于 7 日的投资者收取的赎回费不低于赎回费总额的 25% 归基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。

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、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）等进行基金交易的投资人定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

**(七) 新华环保份额申购与赎回金额的计算方式**

1、新华环保份额的基金份额净值的计算，保留到小数点后3位，小数点后第4位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T日的基金份额净值在当天收市后计算，并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。

**2、新华环保份额申购份额的计算**

新华环保份额基金的场外申购和场内申购均采用金额申购方式，申购金额包括申购费用和净申购金额，申购份额的计算公式为：

申购费用适用比例费率时：

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

---

---

申购份额=净申购金额/申购当日基金份额净值

申购费用适用固定金额时:

净申购金额 = 申购金额 - 申购费用

申购费用=固定金额

申购份额=净申购金额/申购当日基金份额净值

场内申购份额计算结果采用截位方式，保留至整数位，不足1份额对应的申购资金返还至投资人资金账户；场外申购份额计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

例：某投资者投资 100,000.00 元通过场外申购新华环保份额，其对应申购费率为 1.0%，假设申购当日基金份额净值为 1.015 元，则其获得的基金份额计算如下：

净申购金额=100,000.00/（1+1.0%）=99,009.90 元

申购费用=100,000.00-99,009.90=990.10 元

申购份额=99,009.90/1.015=97,546.70 份

若投资者通过场外交易投资 100,000.00 元申购新华环保份额，假设申购当日基金份额净值为 1.015 元，即可获得 97,546.70 份本基金的新华环保份额。

例：某投资者通过场内交易投资 100,000.00 元申购新华环保份额，对应费率为 1.0%，投资者申购当日基金份额净值为 1.015 份，则其获得的基金份额计算如下：

净申购金额=100,000.00/（1+1.0%）=99,009.90 元

申购费用=100,000.00-99,009.90=990.10 元

申购份额=99,009.90/1.015=97,546 份（保留至整数位）

实际净申购金额=97,546×1.015=99,009.19 元

退款金额=100,000.00-99,009.19-990.10=0.71 元

即投资者投资 100,000.00 元从场内申购新华环保份额，假设申购当日基金份额净值为 1.015 元，则其可得到基金份额 97,546 份新华环保份额，申购费用 990.10 元。

### 3、新华环保份额赎回金额的计算：

新华环保份额的场外赎回和场内赎回均采用份额赎回的方式，赎回金额以当日



新华环保份额的基金份额净值为基准计算，计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

赎回金额的计算公式为：

赎回总金额=赎回份额×T日新华环保份额净值

赎回费用=赎回总金额×赎回费率

净赎回金额=赎回总金额-赎回费用

例：某投资者赎回新华环保份额 100,000.00 份，持有时间为 30 日，赎回费率为 0.5%，假定 T 日本基金的基金份额净值为 1.015 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总额=100,000×1.015 元=101,500.00 元

赎回费用=101,500.00×0.5%=507.50 元

赎回金额=101,500.00-507.50=100,992.50 元

即投资者赎回 100,000.00 份新华环保份额，假定 T 日本基金的基金份额净值为 1.015 元，则其可得到的赎回金额为 100,992.50 元。

#### （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时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。
- 3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- 4、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。
- 5、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。
- 6、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金申购申请。
- 7、接受某一投资者申购申请后导致其份额达到或超过基金总份额 50%以上的。

8、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、3、5、6、8 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，被拒绝的申购款项将退还给投资人。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。

#### **(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。

3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

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，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施

6、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 4 项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。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

若本基金单个开放日内的新华环保份额净赎回申请(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)超过前一开放日的全部基金份额(包括新华环保份额、新华环保 A 份额、新华环保 B 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全部基金份额(包括新华环保 A 份额、新华环保 B 份额和新华环保份额)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新华环保份额的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

(3) 在出现巨额赎回时，对于单个基金份额持有人当日超过上一日基金总份额(包括新华环保 A 份额、新华环保 B 份额和新华环保份额) 10%以上的赎回申请，基金管理人有权先行对该单个基金份额持有人超出该比例的赎回申请实施延期办理，之后对该单个基金份额持有人剩余赎回申请与其他账户赎回申请根据前段“(1) 全额赎回”或“(2) 部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。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新华环保份额的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。延期部分如选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。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。

(4) 暂停赎回：新华环保份额连续 2 日以上(含本数)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。

### 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业务规则办理。

### 4、巨额赎回的公告

当发生上述延期赎回并延期办理时，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 个开放日的基金份额净值。

3、基金管理人可以根据暂停申购或赎回的时间，依照《信息披露办法》的有关规定，最迟于重新开放日在指定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告；也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告。

#### (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本基金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。

#### (十三) 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。

## 十一、基金份额的登记、转托管及其他业务

### (一) 基金份额的登记、系统内转托管和跨系统转托管

#### 1. 基金份额的登记

(1) 本基金的份额采用分系统登记的原则。场外认购或申购的新华环保份额基金份额登记在注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下；场内认购、申购的新华环保份额或上市交易买入的新华环保 A、新华环保 B 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新华环保份额可以直接申请场内赎回但不在深圳证券交易所上市交易，登记在证券登记结算系统中的新华环保 A 份额和新华环保 B 份额在深圳证券交易所上市交易，不能申请场内赎回，但可按 1: 1 比例申请合并为场内新华环保份额后再申请场内赎回。

(3) 登记在注册登记系统中的新华环保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通过跨系统转托管转至证券登记结算系统，经过基金份额持有人申请按 1: 1 比例分拆为新华环保 A 份额和新华环保 B 份额后在深圳证券交易所上市交易。

#### 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新华环保份额赎回业务的销售机构（网点）时，须办理已持有新华环保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新华环保份额场内赎回或新华环保 A 份额和新华环保 B 份额上市交易的会员单位（交易单元）时，须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新华环保份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转托管的行为。

(2)新华环保份额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及深圳证券交易所的相关规定办理。

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。

处于募集期内的基金份额不能办理跨系统转托管。

## (二) 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。

## (三) 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，以及注册登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益一并冻结，被冻结部分份额仍然参与收益分配。

## 十二、基金份额的配对转换

本基金基金合同生效后,在新华环保 A 份额、新华环保 B 份额的存续期内,基金管理人将为基金份额持有人办理配对转换业务。

(一) 配对转换是指本基金的新华环保份额与新华环保 A 份额、新华环保 B 份额之间的配对转换,包括以下两种方式的配对转换:

### 1.分拆

分拆指基金份额持有人将其持有的每两份新华环保份额的场内份额申请转换成一份新华环保 A 份额与一份新华环保 B 份额的行为。

### 2.合并

合并指基金份额持有人将其持有的每一份新华环保 A 份额与一份新华环保 B 份额申请转换成两份新华环保份额的场内份额的行为。

### (二) 配对转换的业务办理机构

配对转换的业务办理机构见招募说明书或基金管理人届时发布的相关公告。

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

### (三) 配对转换的业务办理时间

配对转换自新华环保 A 份额、新华环保 B 份额上市交易后不超过 6 个月的时间内开始办理,基金管理人应在开始办理配对转换的具体日期前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

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

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

### (四) 配对转换的原则

1.配对转换以份额申请。

2.申请分拆为新华环保 A 份额和新华环保 B 份额的新华环保份额的场内份额必



须是偶数。

3.申请合并为新华环保份额的新华环保 A 份额与新华环保 B 份额必须同时配对申请，且基金份额数必须同为整数且相等。

4.新华环保份额的场外份额如需申请进行分拆，须跨系统转托管为新华环保份额的场内份额后方可进行。

5.配对转换应遵循届时相关机构发布的相关业务规则。

基金管理人、基金登记机构或深圳证券交易所可视情况对上述规定作出调整，并在正式实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

#### （五）配对转换的程序

配对转换的程序遵循届时相关机构发布的最新业务规则，具体见相关业务公告。

#### （六）暂停配对转换的情形

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

2.基金管理人认为继续接受配对转换可能损害基金份额持有人利益的情形。

3.法律法规、深圳证券交易所规定或经中国证监会认定的其他情形。

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

在暂停配对转换的情况消除时，基金管理人应及时恢复配对转换业务的办理，并依照有关规定在指定媒介上公告。

#### （七）配对转换的业务办理费用

投资人申请办理配对转换业务时，配对转换业务办理机构可酌情收取一定的佣金，具体见相关业务办理机构公告。

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

## 十三、基金的投资

### (一) 投资目标

本基金采用被动式指数化投资方法，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，以实现对标的指数的有效跟踪。在正常市场情况下，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误差不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。

### (二) 投资范围

本基金可投资于具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及备选成份股等股票（包括中小板、创业板以及其它经中国证监会核准上市的股票）、债券、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

此外，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：本基金股票投资占基金资产的比例范围为90—95%，其中投资于标的指数成份股及备选成份股的组合比例不低于非现金基金资产的80%。现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

### (三) 标的指数

本基金的标的指数是中证环保产业指数。

如果标的指数被停止编制及发布,或标的指数由其他指数替代(单纯更名除外),或由于指数编制方法等重大变更导致标的指数不宜继续作为标的指数,或证券市场上有代表性更强、更适合投资的指数推出,本基金管理人可以依据审慎性原则和维护基金份额持有人合法权益的原则,经与基金托管人协商一致,在履行适当程序后,依法变更本基金的标的指数和投资对象,并依据市场代表性、流动性、与原指数的相关性等诸多因素选择确定新的标的指数。

由于上述原因变更标的指数,若标的指数变更涉及本系列基金投资范围或投资策略的实质性变更,则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会,并报中国证监会备案,并在指定媒介上公告。若标的指数变更对基金投资无实质性影

响(包括但不限于编制机构变更、指数更名等),则无需召开基金份额持有人大会,基金管理人应与基金托管人协商一致后,报中国证监会备案,并在指定媒介上公告。

#### (四) 投资策略

本基金按照成份股在中证环保产业指数中的基准权重构建指数化投资组合,原则上采用完全复制法,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,基金管理人会对实际投资组合进行适当调整,以便实现对跟踪误差的有效控制。

##### 1、资产配置策略

本基金股票投资占基金资产的比例范围为90—95%,其中投资于标的指数成份股及备选成份股的组合比例不低于非现金基金资产的80%。现金或者到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

为进一步降低投资组合的跟踪误差,基金管理人将综合考虑股票市场状况以及基金运作的资金需求等因素,在法律法规和基金合同规定的范围内,进行科学的现金需求预测,尽可能保持现金资产合理比重,防止大量现金拖累导致跟踪误差的加大。

##### 2、股票投资策略

###### (1) 投资组合的构建

本基金采用完全复制方法构建股票投资组合,基金资产按照中证环保产业指数的成份股构成及其基准权重进行投资以拟合、跟踪标的指数的业绩表现。

在建仓期间,本基金将依据对市场整体以及成份股运行情况的全面分析,结合基金经理经验判断,采取逐步建仓策略,按照中证环保产业指数各成份股的基准权重对其逐步买入,在确保跟踪误差最小化的基础上,降低由于买入成本上升所带来的影响。

###### (2) 投资组合的调整

在基金的日常运作中,出现:①基金申购、赎回变动;②标的指数成份股定期或不定期调整;③标的指数成份股的配股、增发及分红;④标的指数成份股停牌或流动性严重不足;⑤法律法规及基金合同中对成份股投资比例限制等情况时,容易

导致投资组合与标的指数的偏离，因此本基金将适时调整投资组合，对跟踪误差进行有效控制。

从组合调整的频率上来划分，主要可分为定期调整和不定期调整：

#### 1) 定期调整

根据中证环保产业指数的调整规则，该指数的成份股原则上每半年调整一次，一般为每年的1月初和7月初实施调整，调整方案提前两周公布。在指数定期调整方案公布之后，基金管理人将根据调整后的成份股及权重状况，结合对市场行情的分析判断，适时对现有组合的构成进行相应调整。同时考虑冲击成本对组合跟踪误差的影响，样本股调整时本基金采用逐步调整的方式进行。

#### 2) 不定期调整

a.基金管理人将依据对市场行情的分析研究，判断基金申购、赎回的未来变化趋势，并据此进行投资组合的相应调整，以减少现金流对跟踪误差的冲击，从而有效跟踪标的指数。

b.当标的指数成份股出现临时调整时，基金管理人将密切关注相关调整公告，及时进行投资组合的调整，以更好地拟合标的指数。

c.当标的指数成份股出现临配股、增发及分红等情形导致权重发生变化时，基金管理人将积极跟踪成份股的权重变化，实时调整投资组合各成份股头寸。

d.当标的指数成份股的投资比例受到法律法规及基金合同的限制，或由于停牌、流动性严重不足造成投资组合无法按照基准权重进行配置时，基金管理人将依据行业基本面相似性、历史收益率高度相关性以及流动性充足性等标准，选取替代股票或组票组合进行投资，尽量降低由此产生的跟踪误差。

#### (3) 跟踪误差管理

基金管理人通过设定阈值的方式对投资组合跟踪误差进行日常监控。当跟踪误差超过0.3%时，基金管理人将对跟踪误差进行归因分析，从申购\赎回现金流冲击、成份股调整、成份股替代、交易成本等方面综合测算，判断形成跟踪误差的主要来源，采取有针对性的措施防止跟踪误差的进一步扩大。

#### 3、现金头寸管理

一方面，为应对基金的日常赎回、计提管理费和托管费等相关费用、支付交易

成本、参与上市公司配股及增发等行为,以及满足法律法规和基金合同的相关规定,基金应持有必要的现金头寸。而另一方面,过多的现金留存将形成现金拖累,影响投资组合对标的指数的有效跟踪。

因此,基金管理人将通过科学的现金流预判、成份股流动性的有效分析以及现金资产的收益性管理等方面,进行积极的现金头寸管理,以减少现金拖累带来的跟踪误差。

#### 4、债券投资策略

本基金债券投资主要基于流动性管理的需要,在满足跟踪误差最小化的前提下,主要选择信用等级高、剩余期限短以及流动性充裕的到期日在一年期以内的政府债券进行投资。

#### 5、投资管理程序

(1) 决策和交易机制:本基金实行投资管理委员会下的基金经理负责制。投资管理委员会的主要职责是制定基金投资的整体策略和原则,审定基金定期投资报告及决定基金禁止的投资事项等。基金经理主要负责投资组合的构建、调整和日常管理等工作。中央交易室负责资产运作的一线监控,并确保确保交易指令在合法、合规的前提下得到执行。

(2) 组合构建:基金经理依据跟踪指数成份股或备选成份股的权重占比、停复牌情况以及每日基金申购赎回的资金情况,在追求跟踪误差最小化的目标下,决定交易的数量和时机。

(3) 交易操作和执行:中央交易室依据基金经理指令,制定交易策略,通过组合交易系统执行指数投资组合的交易。中央交易室确保投资指令处于合法、合规的执行状态,对交易过程中出现的任何情况,负有监控、处置的职责。中央交易室确保将无法自行处置并可能影响指令执行的交易状况和市场变化向基金经理、投资总监及时反馈。

(4) 投资组合风险分析:风险管理人员对指数投资的偏差风险和流动性风险进行每日跟踪测算,并提供数量风险分析报告。研究部行业研究员对基准指数成份股中基本面变化、流动性变化等企业情况提供及时的风险分析报告。

(5) 投资管理委员会在确保基金持有人利益的前提下有权根据环境变化和实际

需要调整上述投资管理程序。

### （五）业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：

$95\% \times \text{中证环保产业指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行活期存款利率（税后）}$ 。

由于本基金的投资标的为中证环保产业指数，且本基金现金或者到期日在一年之内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，因此本基金将业绩比较基准定为中证环保产业指数收益率+5%×商业银行活期存款利率（税后）。

随着法律法规和市场环境发生变化，如果上述业绩比较基准不适用本基金、或者本基金业绩比较基准中所使用的指数暂停或终止发布，或者推出更权威的能够表征本基金风险收益特征的指数，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。若标的指数、业绩比较基准变更涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更业绩比较基准召开基金份额持有人大会，并报中国证监会备案。若业绩比较基准变更对基金投资无实质性影响（包括但不限于标的指数供应商变更、指数更名等），本基金管理人可以在取得基金托管人同意后变更业绩比较基准，不需要召集基金份额持有人大会，但需报中国证监会备案并及时公告。

### （六）风险收益特征

本基金是股票型基金，具有较高预期收益、较高预期风险的特征。预期收益和预期风险高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。

从本基金的基金份额来看，新华环保 A 份额为稳健收益类份额，具有低预期风险且预期收益相对较低的特征；新华环保 B 份额为积极收益类份额，具有高预期风险且预期收益相对较高的特征。

### （七）投资限制

#### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金股票投资占基金资产的比例范围为90—95%，其中投资于标的指数

成份股及备选成份股的组合比例不低于非现金基金资产的80%；

(2) 保持不低于基金资产净值 5%的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券；

(3) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

(4) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

(5) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

(6) 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%；

(7) 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%；

(8) 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%；

(9) 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%；

(10) 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；

(11) 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；

(12) 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%；

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

(14) 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；

(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。

除上述第(2)、(10)、(13)、(14)项外,因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价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。

法律法规对上述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) 依照法律、行政法规有关规定,由中国证监会规定禁止的其他活动。

法律、行政法规或监管部门取消上述禁止性规定,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。

## (八) 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、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及债权人权利,保护基金份额持有人的利益;

- 2、不谋求对上市公司的控股,不参与所投资上市公司的经营管理;
- 3、有利于基金财产的安全与增值;
- 4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟



取任何不当利益。

### (九) 基金投资组合报告

本基金管理人的董事会及董事保证所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，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。

本基金的托管人——中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至 2020 年 6 月 30 日。

#### 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              | 56,095,805.44 | 94.08        |
|    | 其中：股票             | 56,095,805.44 | 94.08        |
| 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      | 3,330,358.67  | 5.59         |
| 7  | 其他各项资产            | 198,910.15    | 0.33         |
| 8  | 合计                | 59,625,074.26 | 100.00       |

#### 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

##### (1) 积极投资按行业分类的股票投资组合

| 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              | 52,841.93 | 0.09         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 7,660.80  | 0.01         |
| 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  | 10,722.43 | 0.02         |
| J  | 金融业              | -         | -            |
| 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               | 71,225.16 | 0.12         |

## (2) 指数投资按行业分类的股票投资组合

| 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      | 37,753,926.89 | 64.42        |

|   |                  |               |       |
|---|------------------|---------------|-------|
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 8,042,726.66  | 13.72 |
| E | 建筑业              | 1,571,709.77  | 2.68  |
| 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  | 2,177,954.00  | 3.72  |
| J | 金融业              | -             | -     |
| 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    | 5,853,628.96  | 9.99  |
| 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               | 624,634.00    | 1.07  |
|   | 合计               | 56,024,580.28 | 95.59 |

### 3、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

(1)期末指数投资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  | 600884 | 杉杉股份 | 61,500 | 725,085.00 | 1.24         |
| 2  | 601865 | 福莱特  | 37,300 | 701,240.00 | 1.20         |
| 3  | 601012 | 隆基股份 | 16,696 | 680,028.08 | 1.16         |
| 4  | 603806 | 福斯特  | 13,381 | 667,845.71 | 1.14         |
| 5  | 300037 | 新宙邦  | 12,100 | 666,226.00 | 1.14         |
| 6  | 002459 | 晶澳科技 | 35,400 | 664,812.00 | 1.13         |
| 7  | 300014 | 亿纬锂能 | 13,699 | 655,497.15 | 1.12         |

|    |        |      |        |            |      |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 8  | 300751 | 迈为股份 | 2,200  | 653,312.00 | 1.11 |
| 9  | 002745 | 木林森  | 41,800 | 644,138.00 | 1.10 |
| 10 | 300274 | 阳光电源 | 44,462 | 639,808.18 | 1.09 |

(2)期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资  
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<br>净值比例<br>(%) |
|----|--------|------|----------|-----------|----------------------|
| 1  | 300842 | 帝科股份 | 455.00   | 18,527.60 | 0.03                 |
| 2  | 603087 | 甘李药业 | 150.00   | 15,045.00 | 0.03                 |
| 3  | 300839 | 博汇股份 | 502.00   | 11,751.82 | 0.02                 |
| 4  | 600956 | 新天绿能 | 1,520.00 | 7,660.80  | 0.01                 |
| 5  | 300843 | 胜蓝股份 | 751.00   | 7,517.51  | 0.01                 |

#### 4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末，本基金未持有债券。

#### 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

报告期末，本基金未持有债券。

#### 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 投资明细

报告期末，本基金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

报告期末，本基金未持有贵金属。

#### 8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

报告期末，本基金未持有权证。

#### 9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### (1) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

##### (2) 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末尚无股指期货投资政策。

## 10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### (1) 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末尚无国债期货投资政策。

### (2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### (3) 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 11、投资组合报告附注

(1) 本报告期末本基金投资的前十名证券没有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。

(2) 本报告期,本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。

### (3) 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)      |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | 3,474.61   |
| 2  | 应收证券清算款 | 21,459.99  |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | 592.48     |
| 5  | 应收申购款   | 173,383.07 |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 待摊费用    | -          |
| 8  | 其他      | -          |
| 9  | 合计      | 198,910.15 |

### (4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末,本基金未持有处于转股期的可转换债券。

### (5) 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 1) 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末,本基金指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

## 2) 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值<br>(元) | 占基金资产<br>净值比例(%) | 流通受限<br>情况说明 |
|----|--------|------|--------------------|------------------|--------------|
| 1  | 300843 | 胜蓝股份 | 7,517.51           | 0.01             | 网下新股<br>未上市  |

## 十四、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩不代表未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金成立以来的业绩如下：

### 1、本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

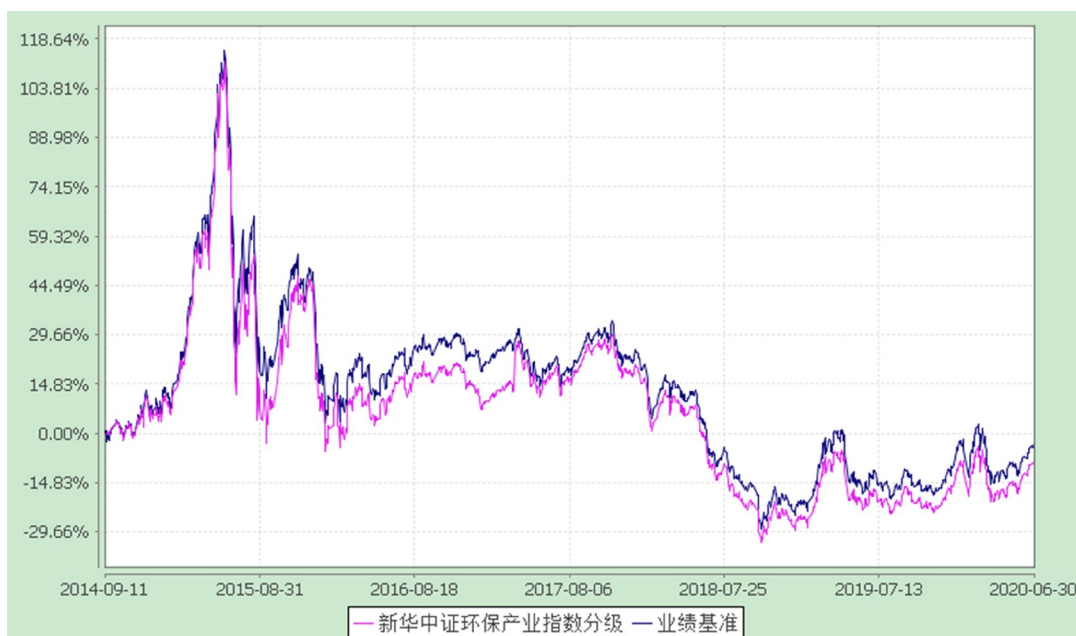
| 阶段                               | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④    |
|----------------------------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 2014.9.11-2014.12.31             | 5.40%    | 1.35%       | 6.64%      | 1.45%         | -1.24% | -0.10% |
| 2015.1.1-2015.12.31              | 35.97%   | 3.07%       | 37.84%     | 2.71%         | -1.87% | 0.36%  |
| 2016.1.1-2016.12.31              | -16.05%  | 1.88%       | -16.18%    | 1.81%         | 0.13%  | 0.07%  |
| 2017.1.1-2017.12.31              | -2.03%   | 0.93%       | -0.91%     | 0.93%         | -1.12% | 0.00%  |
| 2018.1.1-2018.12.31              | -38.86%  | 1.37%       | -37.38%    | 1.33%         | -1.48% | 0.04%  |
| 2019.1.1-2019.6.30               | 12.30%   | 1.76%       | 12.89%     | 1.76%         | -0.59% | 0.00%  |
| 自基金成立至今<br>(2014.9.11-2019.6.30) | -19.08%  | 1.92%       | -13.70%    | 1.79%         | -5.38% | 0.13%  |

### 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

新华中证环保产业指数分级证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2014年9月11日至2020年6月30日)



注：报告期内本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。



---

---

## 十五、基金的财产

### （一）基金资产总值

基金资产总值是指购买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。

## 十六、基金资产的估值

### (一) 估值日

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

### (二) 估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、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、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。

5、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。

6、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、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.001 元，小数点后第 4 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的基金份额净值或基

基金份额参考净值，并按规定公告。

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

### （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。当新华环保份额的基金份额净值、新华环保 A 份额的基金份额参考净值、新华环保 B 份额的基金份额参考净值小数点后 3 位以内(含第 3 位)发生估值错误时，视为基金份额净值错误。

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

#### 1、估值错误类型

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

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

#### 2、估值错误处理原则

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

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

(3) 因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估

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

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后,有关的当事人应当及时进行处理,处理的程序如下:

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

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

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

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

### 4、基金份额(参考)净值估值错误处理的方法如下:

(1) 基金份额(参考)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) 错误偏差达到基金份额(参考)净值的 0.25%时,基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案;错误偏差达到基金份额(参考)净值的 0.5%时,基金管理人应当公告。

(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的,从其规定处理。

### (六) 暂停估值的情形

- 1、基金投资所涉及的证券交易市场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、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，基金管理人经与基金托管人协商一致的；

4、中国证监会和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新华环保份额的基金份额净值、新华环保 A 份额、新华环保 B 份额的基金份额参考净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值和各类基金份额的基金份额（参考）净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人按规定对基金净值予以公布。

#### **（八）特殊情况的处理**

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 5 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、由于证券交易所、登记结算公司或标的指数供应商发送的数据错误，有关会计制度变化或由于其他不可抗力原因，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，但是未能发现该错误而造成的基金资产净值计算错误，基金管理人、基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

---

---

## 十七、基金的收益与分配

在存续期内，本基金（包括新华环保份额、新华环保 A 份额、新华环保 B 份额）不进行收益分配。

法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

## 十八、基金的费用与税收

### (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、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金的标的指数使用许可费；
- 9、基金上市费用；
- 10、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 1.0%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.0\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

#### 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

基金托管费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

### 3、基金的标的指数使用许可费

本基金作为指数基金，需根据与指数所有人中证指数有限公司签署的指数许可使用协议的约定向中证指数有限公司支付标的指数许可使用费。如上述指数许可使用协议约定的费率发生变更，本条下的标的指数许可使用费将相应变更，基金管理人将在更新的招募说明书或公告中予以披露。

通常情况下，标的指数许可使用费按前一日基金资产净值的 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 为每日应付的标的指数许可使用费，

E 为前一日的基金资产净值

标的指数许可使用费的收取下限为每季度人民币 5 万元（大写：伍万元整）。计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算，该季度标的指数许可使用费收取下限的计算方法如下：标的指数许可使用费的收取下限=5 万元 \* 本基金在本季度的实际运作天数/所在季度的实际天数

标的指数许可使用费从基金合同生效日开始每日计算，逐日累计。标的指数许可使用费的支付方式为每季支付一次，自基金合同生效日起，由基金管理人向基金托管人发送指数使用费划付指令，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。

---

---

上述“一、基金费用的种类中第 3—7、9、10 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### （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。

## 十九、基金份额折算

### (一) 定期份额折算

在新华环保 A 份额、新华环保份额存续期内的每个会计年度（除基金合同生效日所在会计年度外）第一个工作日，本基金将按照以下规则进行基金的定期份额折算。

#### 1、基金份额折算基准日

每个会计年度第一个工作日。

#### 2、基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的新华环保 A 份额、新华环保份额。

#### 3、基金份额折算频率

每年折算一次。

#### 4、基金份额折算方式

新华环保 A 份额与新华环保 B 份额按照基金合同第四部分“基金份额的分类与净值计算规则”进行基金份额参考净值计算，对新华环保 A 份额的应计收益进行定期份额折算，每 2 份新华环保份额将按 1 份新华环保 A 份额获得约定收益的新增折算份额。在基金份额折算前与折算后，新华环保 A 份额和新华环保 B 份额的份额配比保持 1: 1 的比例。

对于新华环保 A 份额的约定收益，即新华环保 A 份额每个会计年度 12 月 31 日的基金份额参考净值超出 1.000 元部分，将折算为场内新华环保份额分配给新华环保 A 份额持有人。新华环保份额持有人持有的每 2 份新华环保份额将按 1 份新华环保 A 份额获得新增新华环保份额的分配。持有场外新华环保份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外新华环保份额的分配；持有场内新华环保份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内新华环保份额的分配。经过上述份额折算，新华环保 A 份额的基金份额参考净值和新华环保份额的基金份额净值将相应调整。

每个会计年度第一个工作日为基金份额定期折算基准日，本基金将对新华环保 A 份额和新华环保份额进行应得收益的定期份额折算。

每个会计年度第一个工作日进行新华环保 A 份额上一年度应计收益的定期份额折算时,有关计算公式如下:

(1) 新华环保 A 份额的折算:

定期份额折算后新华环保 A 份额的份额数 = 定期份额折算前新华环保 A 份额的份额数

$NAV_{\text{新华环保份额}}^{\text{后}}$

$$= \frac{\text{折算前新华环保份额的资产净值} - (\text{NAV}_{\text{新华环保 A}}^{\text{期末}} - 1.000) \times 0.5 \times \text{NUM}_{\text{新华环保份额}}^{\text{前}}}{\text{NUM}_{\text{新华环保份额}}^{\text{前}}}$$

新华环保 A 份额持有人新增的场内新华环保份额的份额数=

$$\frac{\text{NUM}_{\text{新华环保 A}}^{\text{前}} \times (\text{NAV}_{\text{新华环保 A}}^{\text{期末}} - 1.000)}{\text{NAV}_{\text{新华环保份额}}^{\text{后}}}$$

其中:

$NAV_{\text{新华环保份额}}^{\text{后}}$ : 定期份额折算后的新华环保份额的基金份额净值

$NAV_{\text{新华环保 A}}^{\text{期末}}$ : 每份新华环保 A 份额期末的基金份额参考净值

$\text{NUM}_{\text{新华环保份额}}^{\text{前}}$ : 定期份额折算前新华环保份额的份额数

$\text{NUM}_{\text{新华环保 A}}^{\text{前}}$ : 定期份额折算前新华环保 A 份额的份额数

(2) 新华环保 B 份额的折算:

每个会计年度的定期份额折算不改变新华环保 B 份额的基金份额参考净值及其份额数。

(3) 新华环保份额的折算:

$NAV_{\text{新华环保份额}}^{\text{后}}$

$$= \frac{\text{折算前新华环保份额的资产净值} - (\text{NAV}_{\text{新华环保 A}}^{\text{期末}} - 1.000) \times 0.5 \times \text{NUM}_{\text{新华环保份额}}^{\text{前}}}{\text{NUM}_{\text{新华环保份额}}^{\text{前}}}$$

新华环保份额持有人新增的新华环保份额的份额数=

$$\frac{\text{NUM}_{\text{新华环保份额}}^{\text{前}}}{2} \times \frac{\text{NAV}_{\text{新华环保 A}}^{\text{期末}} - 1.000}{\text{NAV}_{\text{新华环保份额}}^{\text{后}}}$$

定期份额折算后新华环保份额的份额数 = 定期份额折算前新华环保份额的份  
额数+新华环保份额持有人新增的新华环保份额的份额数+新华环保 A 份额持有人  
新增的新华环保份额的份额数

$\text{NAV}_{\text{新华环保份额}}^{\text{后}}$ ：定期份额折算后的新华环保份额净值

$\text{NUM}_{\text{新华环保份额}}^{\text{前}}$ ：定期份额折算前新华环保份额的份额数

$\text{NAV}_{\text{新华环保 A}}^{\text{期末}}$ ：每份新华环保 A 份额期末的基金份额参考净值

## (二) 不定期份额折算

除以上定期份额折算外,本基金还将在以下两种情况进行不定期份额折算,即:  
当新华环保份额的基金份额净值高至 1.500 元或以上;当新华环保 B 份额的基金份  
额参考净值低至 0.250 元或以下。

1、当新华环保份额的基金份额净值高至 1.500 元或以上,本基金将按照以下  
规则进行份额折算。

### (1) 基金份额折算基准日

新华环保份额的基金份额净值高至 1.500 元或以上,基金管理人即可根据市场  
情况确定折算基准日。

### (2) 基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的新华环保 A 份额、新华环保 B 份额和新华环  
保份额。

### (3) 基金份额折算频率

不定期。

### (4) 基金份额折算方式

当新华环保份额的基金份额净值高至 1.500 元或以上后,本基金将分别对新华

环保 A 份额、新华环保 B 份额和新华环保份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保新华环保 A 份额和新华环保 B 份额的比例为 1: 1，份额折算后新华环保 A 份额的基金份额参考净值、新华环保 B 份额的基金份额参考净值和新华环保份额的基金份额净值均调整为 1.000 元。

当新华环保份额的份额净值高至 1.500 元或以上后，新华环保 A 份额、新华环保 B 份额、新华环保份额三类份额将按照如下公式进行份额折算：

### 1) 新华环保 A 份额

份额折算原则：

① 份额折算前新华环保 A 份额的份额数与份额折算后新华环保 A 份额的份额数相等；

② 新华环保 A 份额持有人份额折算后获得新增的份额数，即超出 1.000 元以上的净值部分全部折算为场内新华环保份额。

$$NUM_{\text{新华环保 A}}^{\text{后}} = NUM_{\text{新华环保 A}}^{\text{前}}$$

新华环保 A 份额持有人新增的场内新华环保份额的份额数=

$$\frac{NUM_{\text{新华环保 A}}^{\text{前}} \times (NAV_{\text{新华环保 A}}^{\text{前}} - 1.000)}{1.000}$$

其中：

$NUM_{\text{新华环保 A}}^{\text{前}}$ ：份额折算前新华环保 A 份额的份额数

$NUM_{\text{新华环保 A}}^{\text{后}}$ ：份额折算后新华环保 A 份额的份额数

$NAV_{\text{新华环保 A}}^{\text{前}}$ ：份额折算前新华环保 A 份额的基金份额参考净值

### 2) 新华环保 B 份额

份额折算原则：

① 份额折算后新华环保 B 份额与新华环保 A 份额的份额数保持 1: 1 配比；

② 份额折算前新华环保 B 份额的资产净值与份额折算后新华环保 B 份额的资产净值及新增场内新华环保份额的资产净值之和相等；

③ 份额折算前新华环保 B 的持有人在份额折算后将持有新华环保 B 份额与新

增场内新华环保份额。

$$NUM_{\text{新华环保 B}}^{\text{后}} = NUM_{\text{新华环保 A}}^{\text{后}}$$

新华环保 B 份额持有人新增的场内新华环保份额的份额数=

$$\frac{NUM_{\text{新华环保 B}}^{\text{前}} \times (NAV_{\text{新华环保 B}}^{\text{前}} - 1.000)}{1.000}$$

其中：

$NUM_{\text{新华环保 B}}^{\text{后}}$ ：份额折算后新华环保 B 份额的份额数

$NUM_{\text{新华环保 A}}^{\text{后}}$ ：份额折算后新华环保 A 份额的份额数

$NUM_{\text{新华环保 B}}^{\text{前}}$ ：份额折算前新华环保 B 份额的份额数

$NAV_{\text{新华环保 B}}^{\text{前}}$ ：份额折算前新华环保 B 份额的基金份额参考净值

### 3) 新华环保份额

份额折算原则：

场外新华环保份额持有人份额折算后获得新增场外新华环保份额，场内新华环保份额持有人份额折算后获得新增场内新华环保份额。

$$NUM_{\text{新华环保份额}}^{\text{后}} = \frac{NAV_{\text{新华环保份额}}^{\text{前}} \times NUM_{\text{新华环保份额}}^{\text{前}}}{1.000}$$

其中：

$NUM_{\text{新华环保份额}}^{\text{后}}$ ：份额折算后新华环保份额的份额数

$NAV_{\text{新华环保份额}}^{\text{前}}$ ：份额折算前新华环保份额的基金份额参考净值

$NUM_{\text{新华环保份额}}^{\text{前}}$ ：份额折算前新华环保份额的份额数

2、当新华环保 B 份额的基金份额参考净值低至 0.250 元或以下，本基金将按照以下规则进行份额折算

**(1) 基金份额折算基准日**

新华环保 B 份额的基金份额参考净值低至 0.250 元或以下, 基金管理人即可根据市场情况确定折算基准日。

**(2) 基金份额折算对象**

基金份额折算基准日登记在册的新华环保 A 份额、新华环保 B 份额和新华环保份额。

**(3) 基金份额折算频率**

不定期。

**(4) 基金份额折算方式**

当新华环保 B 份额的基金份额参考净值低至 0.250 元或以下后, 本基金将分别对新华环保 A 份额、新华环保 B 份额和新华环保份额进行份额折算, 份额折算后本基金将确保新华环保 A 份额和新华环保 B 份额的比例为 1: 1, 份额折算后新华环保份额的基金份额净值、新华环保 A 份额和新华环保 B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元。

**1) 新华环保 B 份额**

份额折算原则:

份额折算前新华环保 B 份额的资产净值与份额折算后新华环保 B 份额的资产净值相等。

$$NUM_{\text{新华环保 B}}^{\text{后}} = \frac{NAV_{\text{新华环保 B}}^{\text{前}} \times NUM_{\text{新华环保 B}}^{\text{前}}}{1.000}$$

其中:

$NUM_{\text{新华环保 B}}^{\text{后}}$ : 份额折算后新华环保份额的份额数

$NAV_{\text{新华环保 B}}^{\text{前}}$ : 份额折算前新华环保份额的基金份额参考净值

$NUM_{\text{新华环保 B}}^{\text{前}}$ : 份额折算前新华环保份额的份额数

**2) 新华环保 A 份额**

份额折算原则:



① 份额折算前后新华环保 A 份额与新华环保 B 份额的份额数始终保持 1: 1 配比;

② 份额折算前新华环保 A 份额的资产净值与份额折算后新华环保 A 份额的资产净值及新增场内新华环保份额的资产净值之和相等;

③ 份额折算前新华环保 A 的持有人在份额折算后将持有新华环保 A 份额与新增场内新华环保份额。

$$NUM_{\text{新华环保 A}}^{\text{后}} = NUM_{\text{新华环保 B}}^{\text{后}}$$

新华环保 A 份额持有人新增的场内新华环保份额的份额数=

$$\frac{NUM_{\text{新华环保 A}}^{\text{前}} \times NAV_{\text{新华环保 A}}^{\text{前}} - NUM_{\text{新华环保 A}}^{\text{后}} \times 1.000}{1.000}$$

其中:

$NUM_{\text{新华环保 A}}^{\text{后}}$ : 份额折算后新华环保 A 份额的份额数

$NUM_{\text{新华环保 B}}^{\text{后}}$ : 份额折算后新华环保 B 份额的份额数

$NUM_{\text{新华环保 A}}^{\text{前}}$ : 份额折算前新华环保 A 份额的份额数

$NAV_{\text{新华环保 A}}^{\text{前}}$ : 份额折算前新华环保 A 份额的基金份额参考净值

### 3) 新华环保份额

份额折算原则:

份额折算前新华环保份额的资产净值与份额折算后新华环保份额的资产净值相等。

$$NUM_{\text{新华环保份额}}^{\text{后}} = \frac{NAV_{\text{新华环保份额}}^{\text{前}} \times NUM_{\text{新华环保份额}}^{\text{前}}}{1.000}$$

其中:

$NUM_{\text{新华环保份额}}^{\text{后}}$ : 份额折算后新华环保份额的份额数

$NAV_{\text{新华环保份额}}^{\text{前}}$ : 份额折算前新华环保份额的基金份额净值

---

---

$NUM_{\text{新华环保份额}}^{\text{前}}$ ：份额折算前新华环保份额的份额数

### （三）基金份额折算期间的基金业务办理

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

### （四）基金份额折算结果的公告

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

### （五）特殊情形的处理

若在某会计年度最后一个工作日发生基金合同约定的本基金不定期份额折算的情形时，基金管理人本着维护基金份额持有人利益的原则，根据具体情况选择按照定期份额折算的规则或者不定期份额折算的规则进行份额折算。

### （六）其他事项

基金管理人、深圳证券交易所、基金登记机构有权调整上述规则，本基金《基金合同》将相应予以修改，且此项修改无须召开基金份额持有人大会，并在本基金更新的招募说明书中列示。

---

---

## 二十、基金的会计与审计

### (一) 基金会计政策

- 1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；
- 2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果《基金合同》生效少于2个月，可以并入下一个会计年度披露；
- 3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- 7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

### (二) 基金的年度审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券、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。更换会计师事务所按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

## 二十一、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及其日常机构等法律、行政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。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:

##### 1、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,说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后,基金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。

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

##### 2、基金份额发售公告

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

##### 3、《基金合同》生效公告

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

#### 4、《上市交易公告书》

基金管理人应当在新华环保A份额和新华环保B份额上市交易前3个工作日，将《上市交易公告书》登载在指定媒介上。

#### 5、基金净值信息

(1) 本基金的基金合同生效后，在新华环保A份额和新华环保B份额两类份额开始上市交易或者新华环保份额开始办理申购赎回前，基金管理人将至少每周在指定网站披露一次新华环保份额的基金份额净值、基金份额累计净值和新华环保A份额与新华环保B份额的基金份额参考净值。

(2) 在新华环保A份额和新华环保B份额两类份额上市交易或者本基金开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过指定网站、销售机构网站或者营业网点披露开放日的新华环保份额的基金份额净值、基金份额累计净值和新华环保A份额与新华环保B份额的基金份额参考净值。

(3) 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基金份额净值、基金份额累计净值、新华环保A份额与新华环保B份额的基金份额参考净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日（或自然日）的次日，将新华环保份额的基金份额净值和基金份额累计净值、新华环保A份额与新华环保B份额的基金份额参考净值登载在指定媒介上。

#### 6、新华环保份额申购、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新华环保份额申购、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。

#### 7、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

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。

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。

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。

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

如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者利益，基金管理人至少应当在定期报告“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定风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

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。

#### 8、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) 基金募集期延长或提前结束募集；
- (9) 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;

(10) 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;

(11) 涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁;

(12) 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;

(13) 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;

(14) 基金收益分配事项;

(15) 管理费、托管费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更;

(16) 基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五;

(17) 本基金开始办理申购、赎回;

(18) 本基金发生巨额赎回并延期办理;

(19) 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;

(20) 新华环保份额暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请;

(21) 本基金开始办理或暂停接受配对转换申请;

(22) 本基金暂停接受配对转换后恢复办理配对转换业务;

(23) 本基金实施基金份额折算;

(24) 新华环保 A 份额、新华环保 B 份额上市交易;

(25) 新华环保 A 份额、新华环保 B 份额停复牌、暂停上市、恢复上市或终止上市;

(26) 基金推出新业务或服务;

(27) 发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项;

(28) 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。

#### 9、澄清公告

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

#### 10、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。

#### 11、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。

#### 12、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、各类基金份额的基金份额净值或基金份额参考净值、基金份额申购赎回价格、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介披露信息，但是其他公共媒介不得早于指定媒介披露信息，并且在不可

---

---

同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

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。

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

#### （七）信息披露文件的存放与查阅

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各自住所，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。

## 二十二、风险揭示

本基金的主要风险在于以下几方面：

### (一) 市场风险

即由于股票（债券）价格的不利变化导致基金损失的可能性。根据引起股票（债券）价格波动的主要因素，市场风险主要分为：

1、政策风险：由于国家财政政策或货币政策的变动导致股票（债券）波动，所引发本基金收益产生损失的风险。

2、经济周期风险：随着经济的周期性变化，国家经济和各个行业也呈周期性变化，从而影响到股票（债券）走势，给本基金的投资收益带来风险。

3、利率风险：金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着股票和债券的价格和收益率，同时也影响着企业的融资成本和利润。本基金投资于债券和股票，因此基金的收益水平会受到利率变化的影响。

#### 4、上市公司风险

市场中可能存在公司质量迅速恶化的上市公司，针对可能投资此类股票而产生的风险，本基金首先在构建股票备选库时剔除此类股票，其次采取分散化投资策略，降低少数出现问题的上市公司对基金资产的影响。

5、再投资风险：票据、债券偿付本息后以及回购到期后的再投资获得的收益取决于再投资时的利率水平和再投资的策略。因未来市场利率的变化而引起再投资收益率的不确定性为再投资风险。再投资风险与利率风险呈反向关系。

### (二) 流动性风险

流动性风险指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。

#### 1、基金申购、赎回安排

具体详见本招募说明书“十、新华环保份额的申购与赎回”部分内容。

#### 2、拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金采用被动式指数化投资方法，主要投资于标的指数的成分股及备选成分股，正常情况下能够满足本基金运作的流动性需求。

同时，在日常的流动性检测中，公司内部将对中证环保产业指数的成份股和备选成份股进行事先的流动性风险分析和评级，在投资组合出现较大的跟踪误差或者市场出现大幅波动时，将通过增加或降低流动性好的资产比例来加速指数化投资组合的构建或基金资产的变现，从而有效降低流动性风险。

### 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时，本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。若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额一定比例以上的，基金管理人有权采取具体措施对其进行延期办理赎回申请。

### 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

本基金管理人经与基金托管人协商，在保障投资者合法权益前提下，可以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措施，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) 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，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金申购赎回申请的措施。

(2) 若本基金发生巨额赎回，基金管理人可能采取部分延期赎回或暂停赎回的措施以应对巨额赎回。

(3) 本基金对持续持有期少于 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。

(4) 当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人可能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以保护存量基金份额持有人的合法权益。

## (三) 信用风险

基金所投资企业债券的发行人如出现违约、无法支付到期本息，或由于企业债券发行人信用等级降低导致债券价格下降，将造成基金资产损失。

#### （四）交易对手违约风险

交易对手违约风险是指当债券、票据或债券回购等交易对手发生交收违约时，将直接导致基金资产的损失，或导致基金不能及时抓住市场机会，对投资收益产生影响。

#### （五）管理风险

指在基金管理运作过程中，基金管理人的投资研究水平、经营管理能力，会影响其对市场走势的判断和具体投资操作，如果发生失误，可能造成基金资产的损失。

#### （六）资产配置风险

虽然资产配置将会对本基金资产的增值带来超额回报，但由于信息来源的不足、滞后或错误，导致基金管理人在判断宏观市场、行业周期产生偏差及选择证券品种的失误，造成基金资产的配置未能达到预期的目标，投资者将蒙受一定的损失。

#### （七）本基金的特定风险

##### 1、指数投资风险

###### （1）目标指数回报与股票市场平均回报偏离的风险

目标指数并不能完全代表整个股票市场。目标指数成份股的平均回报率与整个股票市场的平均回报率可能存在偏离。

###### （2）目标指数波动的风险

目标指数成份股的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资者心理和交易制度等各种因素的影响而波动，导致指数波动，从而使基金收益水平发生变化，产生风险。

###### （3）基金投资组合回报与目标指数回报偏离的风险

以下因素可能使基金投资组合的收益率与目标指数的收益率发生偏离：

1) 由于目标指数调整成份股或变更编制方法, 使本基金在相应的组合调整中产生跟踪误差。

2) 由于目标指数成份股发生配股、增发等行为导致成份股在目标指数中的权重发生变化, 使本基金在相应的组合调整中产生跟踪误差。

3) 成份股派发现金红利、新股收益将导致基金收益率超过目标指数收益率, 产生跟踪误差。

4) 由于成份股停牌、摘牌或流动性差等原因使本基金无法及时调整投资组合或承担冲击成本而产生跟踪误差。

5) 由于基金应对日常赎回保留的少量现金、投资过程中的证券交易成本, 以及基金管理费和托管费的存在, 使基金投资组合与目标指数产生跟踪误差。

6) 由于本基金为指数增强型基金, 采用复制目标指数基础上的有限度个股调整策略, 因此对指数跟踪进行修正与适度增强可能会对本基金的收益产生影响, 从而影响本基金对目标指数的跟踪程度。

7) 其他因素产生的跟踪误差。如因缺乏卖空、对冲机制及其他工具造成的指数跟踪成本较大; 因基金申购与赎回带来的现金变动。

#### (4) 目标指数变更的风险

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

## 2、基金运作的特有风险

### (1) 上市交易风险

新华环保 A 份额和新华环保 B 份额在深圳证券交易所挂牌上市, 由于上市期间可能因信息披露导致基金停牌, 投资人在停牌期间不能买卖基金新华环保 A 份额和新华环保 B 份额, 产生风险; 同时, 可能因上市后交易对手不足导致新华环保 A 份额和新华环保 B 份额产生流动性风险。

### (2) 杠杆机制风险

本基金为复制指数的股票型基金, 具有较高风险、较高预期收益的特征。从本

基金所分离的两类基金份额来看，新华环保 A 份额具有低预期风险、收益相对稳定的特征；新华环保 B 份额具有高预期风险、高预期收益的特征。

由于新华环保 B 份额内含杠杆机制的设计，新华环保 B 份额的净值的变动幅度将大于新华环保份额和新华环保 A 份额的净值的变动幅度，即新华环保 B 份额的净值变动的波动性要高于其他两类份额。

### （3）折/溢价交易风险

新华环保 A 份额和新华环保 B 份额上市交易后，由于受市场供求关系的影响，基金份额的交易价格与其基金份额参考净值之间可能发生偏离从而出现折/溢价交易的风险。

### （4）风险收益特征变化风险

由于基金份额折算的设计，在新华环保份额净值高至1.500元1.500 元或以上后，本基金将进行份额不定期份额折算。原新华环保B份额持有人将会获得一定比例的新华环保份额，因此原新华环保B份额持有人所持有的部分基金份额的风险收益特征将会发生改变。

由于基金份额折算的设计，在新华环保B份额的净值低至0.250 元或以下后，本基金将进行份额不定期份额折算。原新华环保A份额持有人将会获得一定比例的新华环保份额，因此，原新华环保A份额持有人所持有的部分基金份额的风险收益特征将会发生改变。

由于对新华环保 A 份额在会计年度初，把约定收益折算为场内新华环保份额的设计，使原新华环保 A 份额持有人将会获得一定比例的新华环保份额，因此，原新华环保 A 份额持有人所持有的部分基金份额的风险收益特征将会发生改变。

### （5）份额折算风险

①在基金份额折算过程中由于尾差处理而可能给投资人带来损失。场外份额进行份额折算时计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分舍去，舍去部分所代表的资产计入基金财产。场内份额进行份额折算时计算结果保留至整数位（最小单位为1份），小数点以后的部分舍去，舍去部分所代表的资产计入基金财产。因此，在基金份额折算过程中由于尾差处理而可能给投资人带来损失。

②份额折算后新增份额有可能面临无法赎回的风险。

新增份额可能面临无法赎回的风险是指在场内购买新华环保 A 份额或新华环保 B 份额的一部分投资人可能面临的风险。由于在二级市场可以做交易的证券公司并不全部具备中国证监会颁发的基金销售资格，而只有具备基金销售资格的证券公司才可以允许投资人赎回基金份额。因此，如果投资人通过不具备基金销售资格的证券公司购买新华环保 A 份额或新华环保 B 份额，在其参与份额折算后，则折算新增的新华环保份额并不能被赎回。投资人可以选择在份额折算前将新华环保 A 份额或新华环保 B 份额卖出，或者将新增的新华环保份额通过转托管业务转入具有基金代销资格的证券公司后赎回基金份额。

#### (6) 份额配对转换业务中存在的风险

基金合同生效后，在新华环保份额、新华环保 A 份额和新华环保 B 份额的存续期内，基金管理人将根据基金合同的约定办理新华环保份额、新华环保 A 份额和新华环保 B 份额之间份额配对转换。一方面，份额配对转换业务的办理可能改变新华环保 A 份额和新华环保 B 份额的市场供求关系，从而可能影响其交易价格；另一方面，份额配对转换业务可能出现暂停办理的情形，投资人的份额配对转换申请也可能存在不能及时确认的风险。

#### (7) 基金的收益分配

在存续期内，本基金将不进行收益分配

在每个会计年度年（除成立当年外）的第一个工作日，基金管理人将根据基金合同的约定对新华环保份额和新华环保 A 份额实施定期份额折算。基金份额折算后，如果出现新增份额的情形，投资人可通过卖出或赎回折算后新增份额的方式获取投资回报，但是，投资人通过变现折算后的新增份额以获取投资回报的方式并不等同于基金收益分配，投资人不仅须承担相应的交易成本，还可能面临基金份额卖出或赎回的价格波动风险。

#### (八) 不可抗力风险

战争、自然灾害等不可抗力的出现将会严重影响证券市场的运行，可能导致基金资产的损失，影响基金收益水平，从而带来风险；金融市场危机、行业竞争、代理商违约、托管行违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险，也可能导



---

---

致基金或者基金持有人的利益受损。

**(九) 其他风险**

- 1、因技术因素而产生的风险，如电脑系统不可靠产生的风险；
- 2、因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面不完善而产生的风险；
- 3、因人为因素而产生的风险，如内幕交易、欺诈等行为产生的风险；
- 4、对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险；
- 5、因业务竞争压力可能产生的风险；
- 6、其他风险。

## 二十三、基金的终止与清算

### (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生效后方可执行，自决议生效后两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。

### (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, 分别计算新华环保份额、新华环保 A 份额、新华环保 B 份额各自的应计分配比例, 并据此向新华环保份额、新华环保 A 份额、新华环保 B 份额各自的基金份额持有人按其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。

## 二十四、基金合同的内容摘要

(本摘要如与正文不符,以正文为准)

### (一) 基金管理人、基金份额持有人和基金托管人的权利、义务

#### 1、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》及有关法律的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;

14) 以基金管理人的名义,代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;

15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构;

16) 在符合有关法律、法规的前提下,制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换的业务规则;

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净值信息、新华环保 A 份额与新华环保 B 份额的基金份额参考净值,确定新华环保份额申购、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前提下得到有关资料的复印件；

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

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

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

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

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

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

24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，

基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

- 25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- 26) 建立并保存基金份额持有人名册；
- 27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## 2、基金份额持有人的权利与义务

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) 依法申请赎回其持有的新华环保份额或转让新华环保 A 份额、新华环保 B 份额；
- 4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；
- 5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- 6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- 7) 监督基金管理人的投资运作；
- 8) 对基金管理人、基金托管人、基金销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
- 9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

- 1) 认真阅读并遵守《基金合同》;
- 2) 了解所投资基金产品, 了解自身风险承受能力, 自行承担投资风险;
- 3) 关注基金信息披露, 及时行使权利和履行义务;
- 4) 缴纳基金认购、申购款项及法律法规和《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。

### 3、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, 为基金开设资金账户、证券账户等投资所需账户、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和证券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、新华环保 A 份额与新华环保 B 份额的基金份额参考净值、新华环保份额申购、赎回价格;
- 9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;
- 10) 对基金财务会计报告、季度报告、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。

## (二) 基金份额持有人大会

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

### 1、召开事由

(1)、当出现或需要决定下列事由之一的,经基金管理人、基金托管人或单独或合计持有新华环保份额、新华环保 A 份额、新华环保 B 份额各自份额 10%以上(含 10%)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)提议时,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;
- 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) 终止新华环保 A 份额、新华环保 B 份额上市,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;
- 12) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项;
- 13) 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、基金托管费和其他应由基金承担的费用;
- 2) 法律法规要求增加的基金费用的收取;
- 3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整新华环保份额的申购费率、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;
- 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重大变化;
- 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。

## 2、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) 单独或合计持有新华环保份额、新华环保 A 份额、新华环保 B 份额各自份额 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，单独或合计持有新华环保份额、新华环保 A 份额、新华环保 B 份额各自份额 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) 单独或合计持有新华环保份额、新华环保 A 份额、新华环保 B 份额各自份额 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，单独或合计持有新华环保份额、新华环保 A 份额、新华环保 B 份额各自份额 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。

### 3、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。

#### 4、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、通讯开会方式以及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,有效的新华环保份额、新华环保 A 份额、新华环保 B 份额的基金份额不少于在权益登记日各自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新华环保份额、新华环保 A 份额、新华环保 B 份额各自基金份额少于在权益登记日各自基金份额的二分之一,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新华环保份额、新华环保 A 份额、新华环保 B 份额的基金份额应不少于在权益登记日各自基金份额的三分之一（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，在两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新华环保份额、新华环保 A 份额、新华环保 B 份额的基金份额不小于在权益登记日各自基金份额的二分之一（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新华环保份额、新华环保 A 份额、新华环保 B 份额小于在权益登记日各自基金份额的二分之一，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）以上新华环保份额、新华环保 A 份额、新华环保 B 份额各自基金份额的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）项中直接出具表决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关允许的情况下，本基金的基金份额持有人亦可采用其他非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会；在会议召开方式上，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。

## 5、议事内容与程序

### (1) 议事内容及提案权

1) 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。

2) 基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日新华环保份额、新华环保 A 份额、新华环保 B 份额各自份额 10%以上(含 10%)的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案。

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。

3) 对于基金份额持有人提交的提案，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上进行解释和说明。

程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题做出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

### (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。

## 6、表决

新华环保份额、新华环保 A 份额、新华环保 B 份额的基金份额持有人所持每份基金份额在其对应的份额类别内享有同等表决权。

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，一般决议须经出席会议的新华环保份额、新华环保 A 份额、新华环保 B 份额的各自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新华环保份额、新华环保 A 份额、新华环保 B 份额的各自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。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。

## 7、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。

## 8、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完成备案手续之日起生效。

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。

9、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、表决条件等的规定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，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。

### **(三) 基金合同解除和终止的事由、程序**

#### **1、《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。

#### **2、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。

### 3、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。

### 4、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，分别计算新华环保份额、新华环保 A 份额、新华环保 B 份额各自的应计分配比例，并据此向新华环保份额、新华环保 A 份额、新华环保 B 份额各自的基金份额持有人按其持有的基金份额比例进行分配。

### 5、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。

### 6、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。

#### **（四）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。

《基金合同》受中国法律管辖。

#### **（五）基金合同存放地和投资者取得合同的方式**

基金合同可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。

## 二十五、基金托管协议的内容摘要

(本摘要如与正文不符,以正文为准)

### (一) 托管协议当事人

#### 1、基金管理人

名称:新华基金管理股份有限公司

注册地址:重庆市江北区聚贤岩广场6号力帆中心2号办公楼第19层

办公地址:北京市海淀区西三环北路11号海通时代商务中心C1座

重庆市江北区聚贤岩广场6号力帆中心2号办公楼第19层

邮政编码:100089

法定代表人:张宗友

成立日期:2004年12月9日

批准设立机关及批准设立文号:中国证监会证监基金字【2004】197号

注册资本:21,750万元人民币

组织形式:股份有限公司

经营范围:基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务

存续期间:持续经营

#### 2、基金托管人

名称:中国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行)

住所:北京市西城区金融大街25号

办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

邮政编码:100033

法定代表人:田国立

成立日期:2004年09月17日

基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字[1998]12号

组织形式:股份有限公司

注册资本:贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间:持续经营

经营范围:吸收公众存款;发放短期、中期、长期贷款;办理国内外结算;办

理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国银行业监督管理委员会等监管部门批准的其他业务。

## (二) 基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

1、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。《基金合同》明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合《基金合同》关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

本基金可投资于具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及备选成份股等股票（包括中小板、创业板以及其它经中国证监会核准上市的股票）、债券、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金股票投资占基金资产的比例范围为 90—95%，其中投资于标的指数成份股及备选成份股的组合比例不低于非现金基金资产的 80%。现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

此外，如法律法规或中国证监会允许基金投资其他品种的，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本基金的投资范围。

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，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：

(1) 本基金股票投资占基金资产的比例范围为 90—95%，其中投资于标的指数成份股及备选成份股的组合比例不低于非现金基金资产的 80%；

(2) 保持不低于基金资产净值 5% 的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券；

(3) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

(4) 本基金在任何交易日买入权证的总金额, 不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%;

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

(12) 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;

(13) 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。

如果法律法规对上述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, 则本基金投资不再受相关限制。

除上述第(2)、(8)、(11)、(12)项外, 因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价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。

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。

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，对本托管协议第十五条第九款基金投资禁止行为进行监督。基金托管人通过事后监督方式对基金管理人基金投资禁止行为进行监督。

4、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的、经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单，并约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金管理人应严格按照交易对手名单的范围在银行间债券市场选择交易对手。基金托管人监督基金管理人是否按事前提提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单及结算方式进行更新，新名单确定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。如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单及结算方式的，应向基金托管人说明理由，并在与交易对手发生交易前 3 个工作日内与基金托管人协商解决。

基金管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，并负责解决因交易对手不履行合同而造成的纠纷及损失，基金托管人不承担由此造成的任何法律责任及损失。若未履约的交易对手在基金托管人与基金管理人确定的时间前仍未承担违约责任及其他相关法律责任的，基金管理人可以对相应损失先行予以承担，然后再向相关交易对手追偿。基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手或交易方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。



5、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金管理人投资流通受限证券进行监督。

基金管理人投资流通受限证券，应事先根据中国证监会相关规定，明确基金投资流通受限证券的比例，制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。基金托管人对基金管理人是否遵守相关制度、流动性风险处置预案以及相关投资额度和比例等的情况进行监督。

(1) 本基金投资的受限证券须为经中国证监会批准的非公开发行股票、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。本基金不投资有锁定期但锁定期不明确的证券。

本基金投资的受限证券限于可由中国证券登记结算有限责任公司或中央国债登记结算有限责任公司负责登记和存管，并可在证券交易所或全国银行间债券市场交易的证券。

本基金投资的受限证券应保证登记存管在本基金名下，基金管理人负责相关工作的落实和协调，并确保基金托管人能够正常查询。因基金管理人原因产生的受限证券登记存管问题，造成基金托管人无法安全保管本基金资产的责任与损失，及因受限证券存管直接影响本基金安全的责任及损失，由基金管理人承担。

本基金投资受限证券，不得预付任何形式的保证金。

(2) 基金管理人投资非公开发行股票，应制订流动性风险处置预案并经其董事会批准。风险处置预案应包括但不限于因投资受限证券需要解决的基金投资比例限制失调、基金流动性困难以及相关损失的应对解决措施，以及有关异常情况的处置。基金管理人应在首次投资流通受限证券前向基金托管人提供基金投资非公开发行股票相关流动性风险处置预案。

基金管理人对本基金投资受限证券的流动性风险负责，确保对相关风险采取积极有效的措施，在合理的时间内有效解决基金运作的流动性问题。如因基金巨额赎回或市场发生剧烈变动等原因而导致基金现金周转困难时，基金管理人应保证提供足额现金确保基金的支付结算，并承担所有损失。对本基金因投资受限证券导致的流动性风险，基金托管人不承担任何责任。如因基金管理人原因导致本基金出现损

失致使基金托管人承担连带赔偿责任的，基金管理人应赔偿基金托管人由此遭受的损失。

(3) 本基金投资非公开发行股票，基金管理人应至少于投资前三个工作日向基金托管人提交有关书面资料，并保证向基金托管人提供的有关资料真实、准确、完整。有关资料如有调整，基金管理人应及时提供调整后的资料。上述书面资料包括但不限于：

1) 中国证监会批准发行非公开发行股票的批准文件。

2) 非公开发行股票有关发行数量、发行价格、锁定期等发行资料。

3) 非公开发行股票发行人与中国证券登记结算有限责任公司或中央国债登记结算有限责任公司签订的证券登记及服务协议。

4) 基金拟认购的数量、价格、总成本、账面价值。

(4) 基金管理人应在本基金投资非公开发行股票后两个交易日内，在中国证监会指定媒介披露所投资非公开发行股票的名称、数量、总成本、账面价值，以及总成本和账面价值占基金资产净值的比例、锁定期等信息。

本基金有关投资受限证券比例如违反有关限制规定，在合理期限内未能进行及时调整，基金管理人应在两个工作日内编制临时报告书，予以公告。

(5) 基金托管人根据有关规定有权对基金管理人进行以下事项监督：

1) 本基金投资受限证券时的法律法规遵守情况。

2) 在基金投资受限证券管理工作方面有关制度、流动性风险处置预案的建立与完善情况。

3) 有关比例限制的执行情况。

4) 信息披露情况。

(6) 相关法律法规对基金投资受限证券有新规定的，从其规定。

6、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金资产净值计算、新华环保份额的基金份额净值、新华环保 A 份额和新华环保 B 份额的基金份额参考净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、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。

7、基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作违反法律

法规、《基金合同》和本托管协议的规定，应及时以电话提醒或书面提示等方式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到书面通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

8、基金管理人应积极配合和协助基金托管人依照法律法规、《基金合同》和本托管协议对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提示，基金管理人应在规定时间内答复并改正，或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律法规、《基金合同》和本托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

9、若基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》约定的，应当立即通知基金管理人，由此造成的损失由基金管理人承担。

10、基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应及时报告中国证监会，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。基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本托管协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，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**

1、基金管理人对于基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值、新华环保份额基金份额净值、新华环保 A 份额和新华环保 B 份额的基金份额参考净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

2、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、

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》、本协议及其他有关规定时，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及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，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。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。

3、基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金托管人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，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**

##### **1、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。
- (3) 基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。
- (4) 基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立。
- (5) 基金托管人按照《基金合同》和本协议的约定保管基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。基金托管人未经基金管理人的指令，不得自行运用、处分、分配本基金的任何资产（不包含基金托管人依据中国证券登记结算有限责任公司结算数据完成场内交易交收、托管资产开户银行扣收结算费和账户维护费等费用）。
- (6) 对于因为基金投资产生的应收资产，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账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金财产的损失，基金托管人对此不承担任何责任。

(7) 除依据法律法规和《基金合同》的规定外,基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

## 2、基金募集期间及募集资金的验资

(1) 基金募集期间募集的资金应存于基金管理人在基金托管人的营业机构开立的“基金募集专户”。该账户由基金管理人开立并管理。

(2) 基金募集期满或基金停止募集时,募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后,基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金银行账户,同时在规定时间内,聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资,出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的2名或2名以上中国注册会计师签字方为有效。

(3) 若基金募集期限届满,未能达到《基金合同》生效的条件,由基金管理人按规定办理退款等事宜。

## 3、基金银行账户的开立和管理

(1) 基金托管人应当以本基金的名义在其营业机构开立基金的银行账户,并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。

(2) 基金银行账户的开立和使用,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假借本基金的名义开立任何其他银行账户;亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

(3) 基金银行账户的开立和管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

(4) 在符合法律法规规定的条件下,基金托管人可以通过基金托管人专用账户办理基金资产的支付。

## 4、基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理

(1) 基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为基金开立基金托管人与本基金联名的证券账户。

(2) 基金证券账户的开立和使用,仅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或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。

(3) 基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责, 账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

(4) 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开立结算备付金账户, 并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作, 基金管理人应予以积极协助。结算备付金、结算互保基金、交收价差资金等的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

(5) 若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许基金从事其他投资品种的投资业务, 涉及相关账户的开立、使用的, 若无相关规定, 则基金托管人比照上述关于账户开立、使用的规定执行。

#### 5、债券托管专户的开设和管理

《基金合同》生效后, 基金托管人根据中国人民银行、银行间市场登记结算机构的有关规定, 以本基金的名义在银行间市场登记结算机构开立债券托管账户, 持有人账户和资金结算账户, 并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人共同代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

#### 6、其他账户的开立和管理

(1) 因业务发展需要而开立的其他账户, 可以根据法律法规和《基金合同》的规定, 由基金托管人负责开立。新账户按有关规定使用并管理。

(2) 法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的, 从其规定办理。

#### 7、基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券、银行存款开户证实书等有价凭证由基金托管人存放于基金托管人的保管库, 也可存入中央国债登记结算有限责任公司、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, 保管凭证由基金托管人持有。有价凭证的购买和转让, 由基金管理人和基金托管人共同办理。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的资产不承担保管责任。

#### 8、与基金财产有关的重大合同的保管

与基金财产有关的重大合同的签署, 由基金管理人负责。由基金管理人代表基金签署的、与基金财产有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管。除本协议另有规定外, 基金管理人代表基金签署的与基金财产有关的重大合同包括

但不限于基金年度审计合同、基金信息披露协议及基金投资业务中产生的重大合同，基金管理人应保证基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人应在重大合同签署后及时以加密方式将重大合同传真给基金托管人，并在三十个工作日内将正本送达基金托管人处。重大合同的保管期限为《基金合同》终止后 15 年。

### **(五) 基金资产净值计算与复核**

基金资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

#### **1. 基金资产净值**

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

本基金作为分级基金，按照新华环保 A 份额和新华环保 B 份额的净值计算规则分别计算并公告新华环保份额的基金份额净值、新华环保 A 份额和新华环保 B 份额的基金份额参考净值，新华环保份额的基金份额净值、新华环保 A 份额和新华环保 B 份额的基金份额参考净值的计算，均精确到 0.001 元，小数点后第四位四舍五入，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新华环保份额的基金份额净值、新华环保 A 份额和新华环保 B 份额的基金份额参考净值，经基金托管人复核，按规定公告。

#### **2. 复核程序**

基金管理人每工作日对基金资产进行估值后，将新华环保份额的基金份额净值、新华环保 A 份额和新华环保 B 份额的基金份额参考净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

基金管理人应每交易日对基金资产估值。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。基金管理人每个交易日对基金资产估值后，将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。

### **(六) 基金份额持有人名册的登记与保管**

基金份额持有人名册至少应包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。基

基金份额持有人名册由基金注册登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应分别保管基金份额持有人名册，保存期不少于 15 年。如不能妥善保管，则按相关法规承担责任。

在基金托管人要求或编制中期报告和年报前，基金管理人应将有关资料送交基金托管人，不得无故拒绝或延误提供，并保证其的真实性、准确性和完整性。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。

### **(七) 争议解决方式**

因本协议产生或与之相关的一切争议，双方当事人应通过协商、调解解决，协商、调解不能解决的，任何一方均有权将争议交中国国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为北京市，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，双方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行《基金合同》和本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) 基金托管协议的修改与终止**

#### **1、托管协议的变更程序**

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，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报中国证监会备案。

#### **2、基金托管协议终止出现的情形**

- (1) 《基金合同》终止；
- (2) 基金托管人解散、依法被撤销、破产或由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、破产或由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。



## 二十六、对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。基金管理人将根据基金份额持有人的需要和市场的变化，增加或变更服务项目。主要服务内容如下：

### （一）资料寄送

#### 1、基金投资者对账单：

基金管理人将向发生交易的基金份额持有人以书面或电子文件形式定期或不定期寄送对账单。

2、基金份额持有人可通过客户服务中心开通净值短信服务，基金管理人将（每工作日）发送基金净值信息。

#### 3、其他相关的信息资料。

### （二）多种收费方式选择

基金管理人在合适时机将为基金投资者提供多种收费方式购买本基金，满足基金投资者多样化的投资需求，具体实施办法见有关公告。

### （三）基金电子交易服务

基金管理人现已开通基金网上交易服务，在未来市场和技术条件成熟时，基金管理人将为基金投资者提供更多基金电子交易服务。

### （四）联系方式

投资者如果了解申购与赎回的交易情况、基金帐户余额、基金产品与服务等信息，可拨打基金管理人如下电话：

客户服务专线：400-819-8866（免长途）

传真：010-68731199

互联网站：<http://www.ncfund.com.cn>

## 二十七、其他应披露事项

- 1、本基金管理人、托管人目前无重大诉讼事项。
- 2、2019年9月25日 新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在上海好买基金销售有限公司调整定期定额投资业务起点金额的公告
- 3、2019年10月24日 新华中证环保产业指数分级证券投资基金 2019年第3季度报告
- 4、2019年10月26日 新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在上海天天基金销售有限公司调整基金最低申购金额的公告
- 5、2019年11月26日 新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在奕丰基金销售有限公司调整基金最低申购金额、定期定额投资业务起点的公告
- 6、2019年12月13日 新华中证环保产业指数分级证券投资基金招募说明书(更新)
- 7、2019年12月13日 新华中证环保产业指数分级证券投资基金基金合同及托管协议(更新)
- 8、2019年12月27日 新华基金管理股份有限公司关于新华中证环保产业指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务的公告 2020年1月10日
- 9、2019年12月27日 新华基金管理股份有限公司关于新华中证环保产业指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间暂停及恢复申购、赎回、定期定额投资业务、转托管、配对转换业务的公告
- 10、2020年1月3日 新华基金管理股份有限公司关于新华中证环保产业指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间新华环保A份额停复牌的公告
- 11、2020年1月6日 新华基金管理股份有限公司关于新华环保A份额定期份额折算后次日前收盘价调整的公告
- 12、2020年1月6日 新华基金管理股份有限公司关于新华中证环保产业指数分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告
- 13、2020年1月6日 新华基金管理股份有限公司关于新华中证环保产业指数分级证券投资基金之新华环保A份额本次定期折算期间约定年基准收益率的公告

- 
- 
- 14、2020年1月10日 新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在蚂蚁（杭州）基金销售有限公司调整基金最低申购金额的公告
- 15、2020年1月20日 新华基金管理股份有限公司旗下全部基金 2019年第4季度报告提示性公告
- 16、2020年1月20日 新华中证环保产业指数分级证券投资基金 2019年第4季度报告
- 17、2020年3月23日 新华基金管理股份有限公司关于新华中证环保产业指数分级证券投资基金暂停场内申购业务的公告
- 18、2020年3月26日 新华基金管理股份有限公司旗下全部基金 2019年年度报告提示性公告
- 19、2020年3月26日 新华中证环保产业指数分级证券投资基金 2019年年度报告
- 20、2020年3月27日 新华基金管理股份有限公司关于董事及独立董事变更的公告
- 21、2020年4月8日 新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加恒泰证券股份有限公司基金申购及定期定额投资费率优惠活动的公告
- 22、2020年4月21日 新华中证环保产业指数分级证券投资基金 2020年第1季度报告
- 23、2020年4月21日 新华基金管理股份有限公司旗下全部基金 2020年第1季度报告提示性公告
- 24、2020年4月30日 新华基金管理股份有限公司关于调整网上直销汇款交易优惠费率的公告
- 25、2020年4月30日 新华基金管理股份有限公司旗下部分基金增加中信证券华南股份有限公司为销售机构并开通定期定额投资业务及基金转换业务的公告
- 26、2020年5月27日 新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加民商基金销售(上海)有限公司为代销机构并开通相关业务及参加网上费率优惠活动的公告
- 27、2020年6月6日 新华基金管理股份有限公司基金行业高级管理人员变

---

---

更公告

28、2020年6月20日 新华基金管理股份有限公司关于武汉市伯嘉基金销售有限公司终止代销旗下基金的公告

29、2020年6月24日 新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加泛华普益基金销售有限公司为代销机构并开通相关业务及参加网上费率优惠活动的公告

30、2020年7月1日 新华基金管理股份有限公司关于厦门市鑫鼎盛控股有限公司终止代销旗下基金的公告

31、2020年7月9日 新华中证环保产业指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告

32、2020年7月14日 新华中证环保产业指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告

33、2020年7月17日 新华中证环保产业指数分级证券投资基金 2020 年第 2 季度报告

34、2020年7月23日 新华中证环保产业指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告

35、2020年7月31日 新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加玄元保险代理有限公司为代销机构并开通相关业务及参加网上费率优惠活动的公告

36、2020年8月3日 新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加上海大智慧基金销售有限公司为代销机构并开通相关业务及参加网上费率优惠活动的公告

37、2020年8月4日 新华中证环保产业指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告

38、2020年8月5日 新华中证环保产业指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告

39、2020年8月11日 新华中证环保产业指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告

40、2020年8月12日 新华基金管理股份有限公司关于旗下基金参加东吴证

---

---

券股份有限公司申购费率优惠活动的公告

41、2020年8月18日 新华中证环保产业指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告

42、2020年8月19日 新华中证环保产业指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告

43、2020年8月25日 新华中证环保产业指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告

44、2020年8月27日 新华中证环保产业指数分级证券投资基金 2020年半年度报告

45、2020年8月28日 新华中证环保产业指数分级证券投资基金基金产品资料概要(更新)

46、2020年8月29日 新华中证环保产业指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告

47、2020年9月2日 新华中证环保产业指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告

---

---

## 二十八、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。投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。基金招募说明书条款及内容应以基金招募说明书正本为准。

---

---

## 二十九、备查文件

备查文件等文本存放在基金管理人、基金托管人和销售机构的办公场所和营业场所，在办公时间内可供免费查阅。

(一) 中国证监会准予新华中证环保产业指数分级证券投资基金募集注册的文件

(二) 《新华中证环保产业指数分级证券投资基金基金合同》

(三) 《新华中证环保产业指数分级证券投资基金托管协议》

(四) 关于申请募集新华中证环保产业指数分级证券投资基金之法律意见书

(五) 基金管理人业务资格批件、营业执照

(六) 基金托管人业务资格批件、营业执照

(七) 注册登记协议

(八) 中国证监会要求的其他文件

新华基金管理股份有限公司

2020年10月24日