

申万菱信中证军工指数型证券投资基金

上市交易公告书

基金管理人：申万菱信基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

注册登记人：中国证券登记结算有限责任公司

上市地点：深圳证券交易所

上市时间：2021年1月25日

公告时间：2021年1月20日

目 录

一、重要声明与提示.....	3
二、基金概览.....	4
三、基金的历史沿革与上市交易.....	5
四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人.....	6
五、基金主要当事人简介.....	8
六、基金合同摘要.....	14
七、基金财务状况.....	14
八、基金投资组合.....	17
九、重大事件揭示.....	20
十、基金管理人承诺.....	21
十一、基金托管人承诺.....	21
十二、备查文件目录.....	21
附录:基金合同摘要.....	22

一、重要声明与提示

申万菱信中证军工指数型证券投资基金(以下简称“本基金”)上市交易公告书(以下简称“本公告”)依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号<上市交易公告书的内容与格式>》、《深圳证券交易所交易规则》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制,本基金管理人的董事会及董事保证本公告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金托管人中国农业银行股份有限公司(以下简称“农业银行”)保证本报告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性,承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)和深圳证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见,均不表明对本基金的任何保证。

本公告第七节“基金财务状况”未经审计。

凡本报告未涉及的有关内容,请仔细阅读本公司网站(www.swsmu.com)和中国证监会基金电子披露网站(<http://eid.csrc.gov.cn/fund>)发布的相关信息披露文件。

二、基金概览

- 1、基金名称：申万菱信中证军工指数型证券投资基金
- 2、基金类型：股票型证券投资基金
- 3、基金运作方式：契约型开放式
- 4、基金存续期限：不定期
- 5、本次上市交易的基金份额场内简称及代码：申万军工、163115
- 6、本基金的基金份额：1,055,170,998.73 份（截止 2021 年 1 月 18 日）
- 7、本次上市交易的基金份额：46,341,463.00 份（截止 2021 年 1 月 18 日）
- 8、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所
- 9、上市交易日期：2021 年 1 月 25 日
- 10、基金管理人：申万菱信基金管理有限公司
- 11、基金托管人：中国农业银行股份有限公司
- 12、上市推荐人：无
- 13、销售机构：

（1）场外销售机构

具体名单详见基金管理人网站的公示。

基金管理人可根据有关法律、法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金或变更销售机构，并在基金管理人网站公示。

（2）场内发销售机构

本基金的场内销售机构为深圳证券交易所内具有基金销售业务资格并经深圳证券交易所认可的会员单位（具体名单可在深交所网站查询）。

三、基金的历史沿革与上市交易

1、本基金的历史沿革

申万菱信中证军工指数型证券投资基金由申万菱信中证军工指数分级证券投资基金于 2021 年 1 月 1 日变更而来。

申万菱信中证军工指数分级证券投资基金经中国证监会证监许可[2014]350 号《关于核准申万菱信中证军工指数分级证券投资基金募集的批复》准予募集，基金管理人为申万菱信基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。申万菱信中证军工指数分级证券投资基金自 2014 年 6 月 30 日至 2014 年 7 月 18 日进行公开募集，募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续。经中国证监会书面确认，《申万菱信中证军工指数分级证券投资基金基金合同》于 2014 年 7 月 24 日生效。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》及相关法律法规的规定，经与基金托管人协商一致，基金管理人就申万菱信中证军工指数分级证券投资基金的基金合同进行了二次修订，并报监管部门备案。第一次修订为依据法律法规增加取消分级运作机制等，此次基金合同修订自 2020 年 11 月 19 日起生效；第二次修订为删除分级结构、变更基金名称等，并自 2021 年 1 月 1 日起，修订后的《申万菱信中证军工指数型证券投资基金基金合同》生效，《申万菱信中证军工指数分级证券投资基金基金合同》同日起失效。

2、本基金上市交易的主要内容

(1) 基金上市交易的核准机构和核准文号：深圳证券交易所深证上[2021]85号

(2) 上市交易日期：2021年1月25日

(3) 上市交易的证券交易所：深圳证券交易所

(4) 本次上市交易的基金份额场内简称及代码：申万军工、163115

(5) 本次上市交易的基金份额：46,341,463.00份(截止2021年1月18日)

(6) 未上市交易份额的流通规定：未上市交易的基金份额登记在中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统基金份额持有人开放式基金账户下,可以通过跨系统转托管转至中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记系统在深圳证券交易所上市交易。本基金已于2021年1月5日恢复办理跨系统转托管业务。

(7) 基金资产净值的披露：本基金上市交易后,基金管理人于每个工作日交易结束后将经过基金托管人复核的基金份额净值传送给深圳证券交易所,深圳证券交易所于每个估值日的下一个工作日通过行情系统揭示。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

1、持有人户数

截止2021年1月18日,本基金基金份额持有人户数为123,575户,平均每户持有的基金份额为8,538.71份。其中上市交易的场内基金份额持有人户数为18,977户,平均每户持有的基金份额为2,441.98份。

2、持有人结构

截至 2021 年 1 月 18 日，本基金基金份额 1,055,170,998.73 份，其中机构投资者持有的基金份额为 19,746,491.90 份，占基金份额比例为 1.87%；个人投资者持有的基金份额为 1,035,424,506.83 份，占基金份额比例为 98.13%。

本基金上市交易的场内基金份额 46,341,463.00 份，其中机构投资者持有的本次上市交易的场内基金份额为 1,455,871.00 份，占本次上市交易场内基金份额比例为 3.14%；个人投资者持有的本次上市交易的场内基金份额为 44,885,592.00 份，占本次上市交易场内基金份额比例为 96.86%。

3、前十名场内基金份额持有人情况

截至 2021 年 1 月 18 日，前十名场内基金份额持有人的情况如下表：

序号	持有人名称	持有基金份额（份）	占场内基金份额比例
1	郑淑芬	899252.00	1.94%
2	吕万山	557260.00	1.20%
3	郑芹珠	388815.00	0.84%
4	苏明文	359309.00	0.78%
5	陈莉	316718.00	0.68%
6	王暉	309605.00	0.67%
7	梁恭杰	290335.00	0.63%
8	何湘	271368.00	0.59%
9	陈明杰	236722.00	0.51%
10	刘方	210000.00	0.45%
合计		3,839,384.00	8.29%

注：以上信息依据中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司提供的持有人信息编制。

五、基金主要当事人简介

(一) 基金管理人

1、基本情况

名称：申万菱信基金管理有限公司

注册地址：上海市中山南路 100 号 11 层

办公地址：上海市中山南路 100 号 11 层

法定代表人：刘郎

设立日期：2004 年 1 月 15 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字【2003】144 号

工商登记注册的法人营业执照文号：91310000MA1FL0B90E

注册资本：壹亿伍仟万元人民币

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

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

2、内部组织结构及职能

公司下设权益投资部、量化投资部、指数投资部、固定收益投资部、海外投资部、创新投资部、机构业务部、渠道业务部、电子商务部、销售支持部、产品与战略规划部、专户管理部、交易部、信息技术部、基金运营部、风险管理部、法律合规与审计部、计划财务部、组织与人力资源部、综合办公室 20 个部门，北京分公司、广州分公司 2 个分公司及申万菱信（上海）资产管理有限公司 1 家子公司。

- （1）权益投资部负责权益类投资产品的管理工作。
- （2）量化投资部负责量化类投资产品的管理工作。
- （3）指数投资部负责指数类投资产品的管理工作。
- （4）固定收益投资部负责固定收益类投资产品的管理工作。
- （5）海外投资部负责海外投资产品的管理工作。
- （6）创新投资部负责开展基金投资顾问业务及各类新业务的研究和落实。
- （7）机构业务部负责制定、实施机构客户销售和商业发展计划等工作。
- （8）渠道业务部负责制定、实施渠道销售策略和区域销售计划等工作。
- （9）电子商务部负责非传统代销机构的第三方理财和互联网业务的整体规划、业务推介和产品销售等工作。
- （10）销售支持部负责负责公司品牌及媒体管理、营销策划、客户服务和直销柜台业务相关工作，提供各类线上、线下客户服务和直销客户的开户、交易等服务。
- （11）产品与战略规划部负责制订并实施公司新产品开发的战略和计划，负责新产品落地和存量产品优化调整的全生命周期管理，开展各类产品、金融工具的研究等。

(12) 专户管理部负责公司专户项目的全流程管理工作，保障专户产品的正常运作。

(13) 交易部负责公募基金投资和专户资产投资的交易支持业务。

(14) 信息技术部负责建立和完善公司信息技术管理体系，保障系统安全运作，提升公司运营效率。

(15) 基金运营部负责对基金、专户的各项交易活动进行会计处理、注册登记、基金清算等工作。

(16) 风险管理部负责完成投资相关业务环节风险点的识别、评估等工作。

(17) 法律合规与审计部负责检查、监督和评价公司及各部门的合法合规以及信息披露等工作。

(18) 计划财务部负责公司财务计划及预算、财务管理及会计核算，为公司的经营管理提供服务。

(19) 组织与人力资源部负责提供全方位的人力资源支持工作，为公司的持续发展提供基础。

(20) 综合办公室推进公司党建和党风廉政工作，落实股东会、董事会、监事会及下设各专业委员会的会议组织和相关事务，负责公司总部及分支机构行政、内务、安保等工作。

(21) 北京分公司、广州分公司负责华北地区、华南地区的渠道销售和服务工作。

(22) 申万菱信(上海)资产管理有限公司负责申万菱信基金管理有限公司授权开展的各项工作。

3、人员情况

截止 2020 年 12 月，公司共有 191 名员工，硕士及以上人员占比 69%，其中硕士 125 人，博士 6 人。

4、信息披露负责人：王菲萍

电话：021-23261088

5、基金业务介绍

公司目前旗下有 46 只基金产品，即申万菱信上证 50 交易型开放式指数发起式证券投资基金、申万菱信中小板指数证券投资基金(LOF)、申万菱信中证 500 指数优选增强型证券投资基金、申万菱信中证 500 指数增强型证券投资基金、申万菱信中证军工指数型证券投资基金、申万菱信中证环保产业指数型证券投资基金 (LOF)、申万菱信中证申万医药生物指数型证券投资基金、申万菱信深证成份指数型证券投资基金、申万菱信中证申万证券行业指数型证券投资基金、申万菱信中证申万电子行业投资指数型证券投资基金 (LOF)、申万菱信中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金、申万菱信中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、申万菱信价值优先混合型证券投资基金、申万菱信价值优利混合型证券投资基金、申万菱信创业板量化精选股票型证券投资基金、申万菱信可转换债券债券型证券投资基金、申万菱信多策略灵活配置混合型证券投资基金、申万菱信安泰丰利债券型证券投资基金、申万菱信安泰富利三年定期开放债券型证券投资基金、申万菱信安泰惠利纯债债券型证券投资基金、申万菱信安泰瑞利中短债债券型证券投资基金、申万菱信安泰鑫利纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、申万菱信安泰鼎利一年定期开放债券型发起式证券投资基金、申万菱信安鑫优选混合型证券投资基金、申万菱信安鑫回报灵活配置混合型证券投资基金、申万菱信安鑫慧选混合型证券投资基金、申万菱信安鑫

精选混合型证券投资基金、申万菱信收益宝货币市场基金、申万菱信新动力混合型证券投资基金、申万菱信新经济混合型证券投资基金、申万菱信新能源汽车主题灵活配置混合型证券投资基金、申万菱信智能驱动股票型证券投资基金、申万菱信沪深 300 价值指数证券投资基金、申万菱信沪深 300 指数增强型证券投资基金、申万菱信消费增长混合型证券投资基金、申万菱信盛利精选证券投资基金、申万菱信稳益宝债券型证券投资基金、申万菱信竞争优势混合型证券投资基金、申万菱信行业轮动股票型证券投资基金、申万菱信量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金、申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)、申万菱信量化成长混合型证券投资基金、申万菱信量化驱动混合型证券投资基金、申万菱信安泰广利 63 个月定期开放债券型证券投资基金、申万菱信医药先锋股票型证券投资基金、申万菱信稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金。

6、本基金基金经理

龚丽丽女士，硕士研究生。2011 年起从事金融相关工作，曾任华泰柏瑞基金研究员、专户经理、基金经理等。2017 年加入申万菱信基金，曾任申万菱信中证申万新兴健康产业主题投资指数证券投资基金(LOF)、申万菱信深证成指分级证券投资基金、申万菱信中小板指数证券投资基金(LOF)、申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金、申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金基金经理，现任指数投资部负责人、申万菱信上证 50 交易型开放式指数发起式证券投资基金、申万菱信中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金、申万菱信中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、申万菱信沪深 300 价值指数证券投资基金、申万菱信中证军工指数证券投资基金、申万菱信中证申万电子行业投资指数型证券投资基金(LOF)、申万菱信中证申万

医药生物指数型证券投资基金基金经理。

（二）基金托管人

1、基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法定代表人：周慕冰

成立日期：2009 年 1 月 15 日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13 号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]23 号

注册资本：34,998,303.4 万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

联系人：贺倩

2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工近 310 名，其中具有高级职称的专家 60 名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有 20 年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。

3、基金托管业务经营情况

截止到 2020 年 9 月 30 日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共 550 只。

(三) 审计基金财产的会计师事务所

名称：毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：北京市东城区东长安街1号东方广场2座办公楼8层

办公地址：上海静安区南京西路1266号恒隆广场二期16楼

法定代表人：邹俊

电话：(010) 8508 5000

传真：(010) 8508 5111

联系人：虞京京

经办注册会计师：王国蓓、虞京京

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附录。

七、基金财务状况

本基金自基金合同生效后至本上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

申万菱信中证军工指数型证券投资基金 2021 年 1 月 18 日资产负债表如下：

资产	2021 年 1 月 18 日
资产：	

银行存款	110,595,059.53
结算备付金	1,028,875.82
存出保证金	162,663.12
交易性金融资产	1,253,364,038.25
其中：股票投资	1,253,364,038.25
基金投资	
债券投资	
资产支持证券投资	
贵金属投资	
衍生金融资产	
买入返售金融资产	
应收证券清算款	
应收利息	57,668.67
应收股利	
应收申购款	13,301,069.88
递延所得税资产	
其他资产	
资产总计	1,378,509,375.27
负债和所有者权益	
负 债：	
短期借款	
交易性金融负债	

衍生金融负债	
卖出回购金融资产款	
应付证券清算款	27,674,305.74
应付赎回款	13,688,794.81
应付管理人报酬	654,485.73
应付托管费	143,986.86
应付销售服务费	
应付交易费用	126,397.74
应交税费	
应付利息	
应付利润	
递延所得税负债	
其他负债	327,059.00
负债合计	42,615,029.88
所有者权益：	
实收基金	741,903,451.00
未分配利润	593,990,894.39
所有者权益合计	1,335,894,345.39
负债和所有者权益总计	1,378,509,375.27

八、基金投资组合

截至 2021 年 1 月 18 日，申万菱信中证军工指数型证券投资基金的投资组合如下：

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,253,364,038.25	90.92
	其中：股票	1,253,364,038.25	90.92
2	固定收益投资		
	其中：债券		
	资产支持证券		
3	贵金属投资		
4	金融衍生品投资		
5	买入返售金融资产		
	其中：买断式回购的买入返售金融资产		
6	银行存款和结算备付金合计	111,623,935.35	8.10
7	其他各项资产	13,521,401.67	0.98
8	合计	1,378,509,375.27	100.00

注：本基金未开通港股通交易机制投资于港股。

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

(1) 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业		
B	采矿业		
C	制造业	1,215,892,685.77	91.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业		
E	建筑业		
F	批发和零售业	17,756.16	0.00
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	37,356,236.67	2.80
J	金融业		
K	房地产业	10,023.27	0.00
L	租赁和商务服务业		
M	科学研究和技术服务业	17,039.40	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	14,448.64	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业		
P	教育	10,448.38	0.00
Q	卫生和社会工作		
R	文化、体育和娱乐业	45,399.96	0.00
S	综合		
	合计	1,253,364,038.25	93.82

(2) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金未开通港股通交易机制投资于港股。

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600893	航发动力	1,678,133	114,146,606.66	8.54
2	000768	中航西飞	2,178,793	76,214,179.14	5.71
3	002179	中航光电	866,351	65,149,595.20	4.88
4	601989	中国重工	14,355,156	64,598,202.00	4.84
5	600760	中航沈飞	661,154	56,462,551.60	4.23
6	000547	航天发展	2,021,368	53,182,192.08	3.98
7	002414	高德红外	1,002,166	47,923,578.12	3.59
8	600862	中航高科	1,096,302	39,565,539.18	2.96
9	002013	中航机电	3,057,147	38,458,909.26	2.88
10	300699	光威复材	407,890	37,803,245.20	2.83

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

截止 2021 年 1 月 18 日，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

截止 2021 年 1 月 18 日，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明细

截止 2021 年 1 月 18 日，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

截止 2021 年 1 月 18 日，本基金未持有贵金属投资。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

截止 2021 年 1 月 18 日，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

截止 2021 年 1 月 18 日，本基金未投资股指期货交易。

(2) 本基金投资股指期货的投资政策

截止 2021 年 1 月 18 日，本基金未投资股指期货交易。

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

截止 2021 年 1 月 18 日，本基金未投资国债期货交易。

(2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

截止 2021 年 1 月 18 日，本基金未投资国债期货交易。

(3) 本期国债期货投资评价

截止 2021 年 1 月 18 日，本基金未投资国债期货交易。

11、投资组合报告附注

(1) 本基金投资的前十大证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查的情形。

(2) 基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

(3) 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	162,663.12
2	应收证券清算款	
3	应收股利	
4	应收利息	57,668.67
5	应收申购款	13,301,069.88
6	其他应收款	
7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	13,521,401.67

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

截止 2021 年 1 月 18 日，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

截止 2021 年 1 月 18 日，本基金前十名指数投资中不存在流通受限情况。

九、重大事件揭示

本基金自基金合同生效至上市交易期间未发生对基金份额持有人有较大影响的重大的事件。

十、基金管理人承诺

基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出以下承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、《基金合同》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。

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

十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺：

（一）严格遵守《基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本《基金合同》、《托管协议》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则托管基金资产。

（二）根据《基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本《基金合同》、《托管协议》的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金份额净值计算进行监督和核查；如发现基金管理人的行为违反《基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本《基金合同》、《托管协议》的规定，将及时通知基金管理人纠正；基金管理人未能在限期内纠正的，基金托管人将及时向中国证监会报告。

十二、备查文件目录

1、中国证监会关于申万菱信中证军工指数分级证券投资基金募集的批复；

- 2、《申万菱信中证军工指数型证券投资基金基金合同》；
- 3、《申万菱信中证军工指数型证券投资基金托管协议》；
- 4、《申万菱信中证军工指数型证券投资基金招募说明书》；
- 5、法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

存放地点：基金管理人、基金托管人处。

查阅方式：投资者可在办公时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

申万菱信基金管理有限公司

2021年1月20日

附录:基金合同摘要

第一部分 基金管理人、基金托管人及基金份额持有人的权利与义务

一、基金管理人

(一) 基金管理人简况

名称：申万菱信基金管理有限公司

住所：上海市中山南路 100 号 11 层

法定代表人：刘郎

设立日期：2004年1月15日

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

组织形式：有限责任公司

注册资本：壹亿伍仟万元人民币

存续期限：持续经营

联系电话：+86-21-23261188

（二）基金管理人的权利与义务

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

- （1）依法募集资金；
- （2）自基金合同生效之日起，根据法律法规和基金合同独立运用并管理基金财产；
- （3）依照基金合同收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- （4）销售基金份额；
- （5）按照规定召集基金份额持有人大会；
- （6）依据基金合同及有关法律规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了基金合同及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- （7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- （8）选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- （9）担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得基金合同规定的费用；
- （10）依据基金合同及有关法律规规定决定基金收益的分配方案；
- （11）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
- （12）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- （13）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券；
- （14）以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- （15）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

(16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金申购、赎回、转换等业务规则；

(17) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

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

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

(2) 办理基金备案手续；

(3) 自基金合同生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

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

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

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

(7) 依法接受基金托管人的监督；

(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

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

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

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

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

(17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间内发出,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) 执行生效的基金份额持有人大会的决议;

(25) 建立并保存基金份额持有人名册;

(26) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

二、基金托管人

(一) 基金托管人简况

名称:中国农业银行股份有限公司

住所:北京市东城区建国门内大街69号

法定代表人:周慕冰

成立时间:2009年1月15日

批准设立机关和批准设立文号:中国银监会银监复【2009】13号

组织形式:股份有限公司

注册资本:32,479,411.7 万元人民币

存续期间:持续经营

基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]23号

(二) 基金托管人的权利与义务

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

(1) 自基金合同生效之日起,依法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产;

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

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

(4) 根据相关市场规则，为基金开设证券账户、为基金办理证券交易资金清算。

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

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

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

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

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

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

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

(7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值及申购、赎回价格；

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

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

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

(12) 建立并保存基金份额持有人名册；

- (13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- (14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
- (15) 依据《基金法》、基金合同及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- (16) 按照法律法规和基金合同的规定监督基金管理人的投资运作；
- (17) 参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；
- (19) 因违反基金合同导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- (20) 按规定监督基金管理人按法律法规和基金合同规定履行自己的义务，基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；
- (21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (22) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

三、基金份额持有人

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

每份基金份额具有同等的合法权益。

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

- (1) 分享基金财产收益；
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- (3) 依法申请赎回或转让其持有的基金份额；
- (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；
- (5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- (7) 监督基金管理人的投资运作；
- (8) 对基金管理人、基金托管人、基金销售机构损害其合法权益的行为依法提

起诉讼或仲裁；

(9) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

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

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

第二部分 基金份额持有人大会召集、议事规则及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

一、召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

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

(12) 单独或合计持有本基金总份额 10%以上(含 10%)基金份额的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会;

(13) 对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项;

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

2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改,不需召开基金份额持有人大会:

(1) 调低基金管理费、基金托管费;

(2) 法律法规要求增加的基金费用的收取;

(3) 在不违背法律法规的规定和基金合同的约定,以及对基金份额持有人利益无实质性影响下,调整申购费率、变更收费方式或调低赎回费率;

(4) 因相应的法律法规、深圳证券交易所或登记机构的相关业务规则发生变动而应当对基金合同进行修改;

(5) 对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化;

(6) 按照法律法规和基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

二、会议召集人及召集方式

1、除法律法规规定或基金合同另有约定外,基金份额持有人大会由基金管理人召集。

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时,由基金托管人召集。

3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的,应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集,并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的,应当自出具书面决定之日起 60 日内召开;基金管理人决定不召集,基金托管人仍认为有必要召开的,应当由基金托管人自行召集。

4、代表基金份额 10%以上(含 10%)的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会,应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集,并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的,应当自出具书面决定之日起 60 日内召开;基金管理人决定不召集,代表基金份额 10%以上(含 10%)的基金份额持有人仍认为有必要召开的,应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集,并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人;基金托管人决定召集的,应当自出具书面决定

之日起 60 日内召开。

5、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

6、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

三、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 日，在指定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

- （1）会议召开的时间、地点和会议形式；
- （2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；
- （3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- （4）授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
- （5）会务常设联系人姓名及联系电话；
- （6）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- （7）召集人需要通知的其他事项。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

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

四、基金份额持有人出席会议的方式

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

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

时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

（1）亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

（2）经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额合计不少于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额合计少于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额合计不少于在权益登记日基金总份额的三分之一。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式进行表决。在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

（1）会议召集人按基金合同约定公布会议通知后，在2个工作日内连续公布相关提示性公告；

（2）召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

（3）本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，有效的基金份额合计不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；若本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见基金份额持有人所持有的基金份额合计少于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有基金份额合计代表三分之一以上的基金份额持有人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见；

（4）上述第（3）项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与基金登记机构记录相符。

3、在法律法规和监管机关允许的情况下，本基金亦可采用网络、电话等其他非现场方式或者以非现场方式与现场方式结合的方式召开基金份额持有人大会，或

者采用网络、电话或其他方式授权他人代为出席会议并表决，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。

五、议事内容与程序

1、议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如基金合同的重大修改、决定终止基金合同、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及基金合同规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

(1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

(2) 通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

六、表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持基金份额表决权的二分之一以上（含二分之一）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持基金份额表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。除基金合同另有约定外，转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止基金合同、本基金与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

七、计票

1、现场开会

（1）如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

（2）监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

（3）如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

（4）计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。

2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

八、生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 日内在指定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

九、本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡与将来颁布的其他涉及基金份额持有人大会规定的法律法规不一致的，基金管理人提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

第三部分 基金收益分配原则、执行方式

一、基金利润的构成

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

二、基金可供分配利润

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

三、基金收益分配原则

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

2、每一基金份额享有同等分配权；

3、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的情况下，基金管理人可在法律法规允许的前提下，履行必要的程序后，酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不

需要召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在指定媒介公告。

四、收益分配方案

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

五、收益分配方案的确定、公告与实施

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

六、基金收益分配中发生的费用

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

第四部分 与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

一、基金费用的种类

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

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费自基金合同生效次日起每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费自基金合同生效次日起每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

3、基金合同生效后标的指数许可使用费

本基金作为指数基金，需根据与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指数许可使用费。通常情况下，指数许可使用费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年费率} / \text{当年天数} \quad , \quad \text{本基金年指数使用费率为 } 0.02\%$$

H 为每日应付的指数许可使用费

E 为前一日的基金资产净值

基金合同生效后的指数许可使用费每日计算，逐日累计，按季支付。标的指数许可使用费的收取下限为每季人民币 5 万元（大写：伍万元整），计费区间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。由基金管理人向基金托管人发送指数许可使用费划付指令，经基金托管人复核后，于每年 1 月、4 月、7 月、10 月的前十（10）个工作日内从基金财产中一次性支付给中证指数有限公司上一季度的标的指数许可使用费。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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

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

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、基金合同生效前的相关费用根据《申万菱信中证军工指数分级证券投资基金基金合同》执行；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、基金税收

本基金运作过程中涉及各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

第五部分 基金财产的投资方向和投资限制

一、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、权证、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

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

本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为 85% - 95%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

二、投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为 85% - 95%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；

（2）每个交易日日终，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等；

（3）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，本基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，基金管理

人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。法律法规或中国证监会另有规定的，遵从其规定；

(4) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

(5) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

(6) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

(7) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

(8) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

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

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

(11) 本基金参与股指期货交易依据下列标准建构组合：

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

2) 在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的 100%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

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

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

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

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

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

(14) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组

合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%；但除非法律法规另有规定，本基金指数化投资部分不受此限制；

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

（16）本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

（17）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他投资限制。

除上述第（2）、（8）、（15）、（16）项外，因证券市场、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。法律法规另有规定的从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

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

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

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

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

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，在履行适当程序后，本基金可不受

上述规定的限制。

第六部分 基金资产净值的计算方式和公布方式

一、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

二、基金净值信息公告

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

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

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

第七部分 基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

一、基金合同的变更

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

2、关于基金合同变更的基金份额持有人大会决议自完成备案手续之日起生效后,方可执行,自决议生效后2日内在指定媒介公告。

二、基金合同的终止事由

有下列情形之一的,基金合同应当终止:

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

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

三、基金财产的清算

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

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

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

4、基金财产清算程序：

(1) 基金合同终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

(2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；

(3) 对基金财产进行估值和变现；

(4) 制作清算报告；

(5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

(6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；

(7) 对基金剩余财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为 6 个月。

四、清算费用

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

五、基金剩余财产的分配

基金财产按下列顺序清偿：

1、支付清算费用；

2、交纳所欠税款；

3、清偿基金债务；

4、根据基金合同终止日基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款 1-3 项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

六、基金财产清算的公告

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

七、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

第八部分 争议的处理和适用的法律

各方当事人同意，因基金合同而产生的或与基金合同有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会，根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京市，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力。

争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

基金合同受中国法律管辖。

第九部分 基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

基金合同是约定基金合同当事人之间权利义务关系的法律文件。

1、基金合同经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字，于 2021 年 1 月 1 日《基金合同》生效，原《申万菱信中证军工指数分级证券投资基金基金合同》自同一日起失效。

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

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

4、基金合同正本一式六份，除上报有关监管机构一式二份外，基金管理人、基金托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。

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