

申万菱信基金管理有限公司

关于申万菱信中证内地新能源主题交易型开放式指数证券投资基金标的指数纳入北京证券交易所股票并修订基金合同及招募说明书的公告

根据中证指数有限公司相关指数成份股的定期调整情况，申万菱信基金管理有限公司（以下简称“本公司”或“基金管理人”）旗下申万菱信中证内地新能源主题交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）标的指数纳入北京证券交易所股票。根据相关业务规则、法律法规、基金合同等有关规定，经与基金托管人协商一致，本公司决定对本基金基金合同及招募说明书进行修订，本次修订主要涉及调整申购与赎回章节中现金替代的相关内容，明确北京证券交易所上市成份证券现金替代相关规则，并相应补充本基金投资北京证券交易所股票的相关风险提示。

本次修订涉及的相关规则自2024年12月30日起生效。本次修订已经履行了规定的程序，符合相关法律法规及基金合同的相关规定。基金管理人就基金合同、招募说明书的修订请参考附件。

修订后的基金合同、招募说明书于本公告发布日在本公司网站（www.swsmu.com）、中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn>）和深圳证券交易所网站披露；基金产品资料概要涉及前述内容的，将一并修改，并依照《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定在规定媒介和深圳证券交易所网站上公告。

投资者欲了解本基金的详细情况，可登录本公司官方网站（www.swsmu.com）或拨打客户服务电话（400-880-8588）咨询。

风险提示：本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责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。敬请投资人注意投资风险。投资者投资于基金前应认真阅读基金的基金合同和招募说明书等法律文件，确认已知悉

基金产品资料概要，全面认识基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，在了解产品情况及销售机构适当性匹配意见的基础上，理性判断市场，谨慎做出投资决策。基金具体风险评级结果以销售机构提供的评级结果为准。

特此公告。

申万菱信基金管理有限公司

2024年12月28日

附件：

1、本基金基金合同修订对照表

修改章节	修改前	修改后
第八部分 基金份额的 申购与赎回	<p>一、申购和赎回场所 ……</p> <p>在基金合同生效后，本基金可根据实际情况需要，在法律法规、基金合同及未来条件允许的情况下并在履行适当程序后，向本基金的联接基金和基金管理人认可的投资者开通特殊申购，申购对价按特殊申购日基金管理人公布的申购赎回清单计算，对于申购赎回清单中的沪市成份股，本基金联接基金和基金管理人认可的投资者可以采用实物方式或“沪市退补”的现金替代方式，除此之外的其它方面比照普通申购。</p>	<p>一、申购和赎回场所 ……</p> <p>在基金合同生效后，本基金可根据实际情况需要，在法律法规、基金合同及未来条件允许的情况下并在履行适当程序后，向本基金的联接基金和基金管理人认可的投资者开通特殊申购，申购对价按特殊申购日基金管理人公布的申购赎回清单计算，对于申购赎回清单中的沪市成份股，本基金联接基金和基金管理人认可的投资者可以采用实物方式或“沪市退补”的现金替代方式，除此之外的其它方面比照普通申购。</p>

2、本基金招募说明书修订对照表

修改章节	修改前	修改后
重要提示	<p>本基金投资于证券、期货市场，基金净值会因为证券、期货市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：市场风险、信用风险、管理风险、本基金特有的风险、金融期货投资风险、股票期权投资风险、资产支持证券投资风险、融资和转融通证券出借业务风险、税负增加风险、流动性风险和其他风险等。</p> <p>……</p>	<p>本基金投资于证券、期货市场，基金净值会因为证券、期货市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：市场风险、信用风险、管理风险、本基金特有的风险、金融期货投资风险、股票期权投资风险、资产支持证券投资风险、融资和转融通证券出借业务风险、北交所股票投资风险、税负增加风险、流动性风险和其他风险等。</p> <p>……</p> <p>本基金可投资北交所股票，投资者投资于本基金面临由于投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险、流动性</p>

	<p>本次招募说明书为年度更新。本次招募说明书所载内容中有关财务数据和净值表现截止日为 2024 年 9 月 30 日（财务数据未经审计）。</p>	<p>风险、上市公司经营风险、上市公司退市风险等风险，详见本基金招募说明书“风险揭示”章节。</p> <p>.....</p> <p>本次招募说明书主要涉及调整申购与赎回章节中现金替代的相关内容，明确了北京证券交易所上市成份证券现金替代相关规则，并相应补充基金投资北京证券交易所股票的相关风险提示。本次招募说明书所载内容中有关财务数据和净值表现截止日为 2024 年 9 月 30 日（财务数据未经审计）。</p>
<p>第十部分 基金份额的 申购与赎回</p>	<p>一、申购和赎回场所</p> <p>在基金合同生效后，本基金可根据实际情况需要，在法律法规、基金合同及未来条件允许的情况下并在履行适当程序后，向本基金的联接基金和基金管理人认可的投资者开通特殊申购，申购对价按特殊申购日基金管理人公布的申购赎回清单计算，对于申购赎回清单中的沪市成份股，本基金联接基金和基金管理人认可的投资者可以采用实物方式或“沪市退补”的现金替代方式，除此之外的其它方面比照普通申购。</p> <p>.....</p> <p>四、申购与赎回的程序</p> <p>3、申购和赎回的清算交收与登记</p> <p>上海证券交易所上市的成份股现金替代折价部分通过退补款进行交收。</p> <p>.....</p> <p>七、申购赎回清单的内容与格式</p> <p>1、申购赎回清单的内容</p>	<p>一、申购和赎回场所</p> <p>在基金合同生效后，本基金可根据实际情况需要，在法律法规、基金合同及未来条件允许的情况下并在履行适当程序后，向本基金的联接基金和基金管理人认可的投资者开通特殊申购，申购对价按特殊申购日基金管理人公布的申购赎回清单计算，对于申购赎回清单中的沪市成份股，本基金联接基金和基金管理人认可的投资者可以采用实物方式或“沪市退补”的现金替代方式，除此之外的其它方面比照普通申购。</p> <p>.....</p> <p>四、申购与赎回的程序</p> <p>3、申购和赎回的清算交收与登记</p> <p>上海证券交易所上市的成份股现金替代折价部分通过退补款进行交收。</p> <p>.....</p> <p>七、申购赎回清单的内容与格式</p> <p>1、申购赎回清单的内容</p>

T日申购赎回清单公告内容包括最小申购、赎回单位所对应的组合证券内各成份证券数据、现金替代、T日预估现金差额、T-1日现金差额、基金份额净值及其他相关内容。

2、组合证券相关内容

.....

3、现金替代相关内容

现金替代是指申购、赎回过程中，投资者按基金合同和招募说明书的规定，用于替代组合证券中部分证券的一定数量的现金。

现金替代分为3种类型：禁止现金替代（标志为“禁止”）、可以现金替代（标志为“允许”）和必须现金替代（标志为“必须”）。

T日申购赎回清单公告内容包括最小申购、赎回单位所对应的**申赎现金**、组合证券内各成份证券数据、现金替代、T日预估现金差额、T-1日现金差额、基金份额净值及其他相关内容。

2、申赎现金

“申赎现金”不属于组合成份证券，是为了便于登记机构的清算交收安排，在申购赎回清单中增加的虚拟证券。“申赎现金”的现金替代标志为“必须”，但含义与组合成份证券的必须现金替代不同，“申赎现金”的申购替代金额为最小申购单位所对应的现金替代标志为“必须”的非深市成份证券的必须现金替代与现金替代标志为“允许”的非深市成份证券的申购替代金额之和，赎回替代金额为最小赎回单位所对应的现金替代标志为“必须”的非深市成份证券的必须现金替代与现金替代标志为“允许”的非深市成份证券的赎回替代金额之和。

3、组合证券相关内容

.....

4、现金替代相关内容

现金替代是指申购、赎回过程中，投资者按基金合同和招募说明书的规定，用于替代组合证券中部分证券的一定数量的现金。

现金替代分为3种类型：禁止现金替代（标志为“禁止”）、可以现金替代（标志为“允许”）和必须现金替代（标志为“必须”）。

对于深圳证券交易所上市的成份证券，现金替代的类型可以设为：“禁止”、“允许”和“必须”。

对于非深圳证券交易所上市的成份证券，现金替代的类型可以设为：“允许”和“必须”。

	<p>禁止现金替代适用于深圳证券交易所上市的成份股，是指在申购、赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。</p> <p>可以现金替代适用于所有成份股。用于深圳证券交易所上市的成份股时是指在申购基金份额时，允许使用现金作为全部或部分该成份证券的替代，但在赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。用于上海证券交易所上市的成份股时是指在申购或赎回基金份额时，必须使用现金作为替代，根据基金管理人买卖情况，与投资者进行退款或补款。</p> <p>.....</p> <p>(1) 可以现金替代</p> <p>1) 适用情形：对于深圳证券交易所上市的成份证券，可以现金替代的证券一般是投资者申购时持仓不足的深市成份证券。登记机构先用深市成份证券，不足时差额部分用现金替代。对于上海证券交易所上市的成份证券，登记机构对设置可以现金替代的沪市成份证券全部用现金替代。</p> <p>2) 替代金额：</p> <p>.....</p> <p>对于上海证券交易所上市的成份证券，可以现金替代的证券替代金额的计算公式为：</p> <p>.....</p> <p>赎回时扣除现金替代折价的原因是，对于可以现金替代的上海证券交易所上市的证券，基金管理人将卖出该部分证券，实际卖出价格扣除相关交易费用后与赎回时的参考价格可能有所差异。</p> <p>.....</p>	<p>禁止现金替代适用于深圳证券交易所上市的成份股，是指在申购、赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。</p> <p>可以现金替代适用于所有成份股。用于深圳证券交易所上市的成份股时是指在申购基金份额时，允许使用现金作为全部或部分该成份证券的替代，但在赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。用于非深圳证券交易所上市的成份股时是指在申购或赎回基金份额时，必须使用现金作为替代，根据基金管理人买卖情况，与投资者进行退款或补款。</p> <p>.....</p> <p>(1) 可以现金替代</p> <p>1) 适用情形：对于深圳证券交易所上市的成份证券，可以现金替代的证券一般是投资者申购时持仓不足的深市成份证券。登记机构先用深市成份证券，不足时差额部分用现金替代。对于非深圳证券交易所上市的成份证券，登记机构对设置可以现金替代的非深圳证券交易所成份证券全部用现金替代。</p> <p>2) 替代金额：</p> <p>.....</p> <p>对于非深圳证券交易所上市的成份证券，可以现金替代的证券替代金额的计算公式为：</p> <p>.....</p> <p>赎回时扣除现金替代折价的原因是，对于可以现金替代的非深圳证券交易所上市的证券，基金管理人将卖出该部分证券，实际卖出价格扣除相关交易费用后与赎回时的参考价格可能有所差异。</p> <p>.....</p> <p>3) 替代金额的处理程序</p> <p>.....</p>
--	--	---

	<p>3) 替代金额的处理程序</p> <p>在 T 日后被替代的成份证券有正常交易的 2 个交易日（简称为 T+2 日）内，基金管理人将以卖出赎回被替代的上海证券交易所上市的证券。</p> <p>.....</p> <p>4) 替代限制</p> <p>.....</p> <p>4、预估现金差额相关内容</p> <p>5、现金差额相关内容</p> <p>6、申购赎回清单的格式</p>	<p>在 T 日后被替代的成份证券有正常交易的 2 个交易日（简称为 T+2 日）内，基金管理人将以卖出赎回被替代的非深圳证券交易所上市的证券。</p> <p>.....</p> <p>4) 替代限制</p> <p>如果深圳证券交易所现金替代比例计算公式发生变化，以深圳证券交易所通知规定的为准。</p> <p>.....</p> <p>5、预估现金差额相关内容</p> <p>6、现金差额相关内容</p> <p>7、申购赎回清单的格式</p> <p>若深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对申购赎回清单的格式进行调整，基金管理人将视情况对相关格式进行相应的调整。</p>
<p>第十八部分 风险揭示</p>	<p>本基金面临的风险主要有：市场风险、信用风险、管理风险、本基金特有的风险、金融期货投资风险、股票期权投资风险、资产支持证券投资风险、融资和转融通证券出借业务风险、税负增加风险、流动性风险和其他风险。</p> <p>.....</p> <p>八、存托凭证投资风险</p> <p>本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可</p>	<p>本基金面临的风险主要有：市场风险、信用风险、管理风险、本基金特有的风险、金融期货投资风险、股票期权投资风险、资产支持证券投资风险、融资和转融通证券出借业务风险、北交所股票投资风险、税负增加风险、流动性风险和其他风险。</p> <p>.....</p> <p>八、存托凭证投资风险</p> <p>本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深京市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、</p>

能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

.....

行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

.....

十一、投资于北交所股票的风险

(1) 由于投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险

北京证券交易所是独立于沪深证券交易所之外的全国性证券交易所，其制度规则包括股票发行、交易、分层管理、投资者适当性等方面，与沪深证券交易所的制度规则存在一定差别，可能导致挂牌股票股价波动较大。

(2) 流动性风险

北交所挂牌公司可能股权相对集中、投资者门槛较高，因此市场整体流动性可能弱于沪深证券交易所，基金存在无法及时变现及其他相关流动性风险。

(3) 上市公司经营风险

北交所主要服务创新型中小企业，企业多处于成长期，抵御市场和行业风险的能力较弱，同时其规模也可能偏小，往往具有依赖核心技术人员和供应商、客户集中度高、应对外部冲击能力较弱等特点，企业上市后的持续创新能力、收入及盈利水平等仍具有较大不确定性。

(4) 上市公司退市风险

北交所股票可能因触及退市情形被终止上市。因触及交易类情形被终止上市的北交所股票，

	<p>十一、税负增加风险</p> <p>十二、本基金法律文件风险 收益特征表述与销售机构基金风 险评价可能不一致的风险</p>	<p>不进入退市整理期；因触及财务 类、规范类及重大违法类情形， 会被实施退市风险警示。</p> <p>十二、税负增加风险</p> <p>十三、本基金法律文件风险 收益特征表述与销售机构基金风 险评价可能不一致的风险</p>
--	---	--