（上接B13版）

对公司的内部风险监控;监察稽核部有权对基金投资交易过程实施实时监控;有权对公司各部门内部风险控制制度的建立和落实情况进行检查稽核;对违规事件进行调查并提出处理意见;对设立的内部风险控制制度的合理性、有效性进行分析,提出改进方案,上报督察长或在必要时上报风险管理委员会进行讨论。

（4）风险管理总部:该部门的工作主要对公司管理层负责,为公司管理层提供有关风险评估、测算、日常风险点检查、风险控制措施等方面的报告以及提出有针对性的解决建议。同时,对基金投资、研究、交易、基金业务管理、基金营销、基金会计、信息技术系统、人力资源、财务管理等各业务部门及运作流程中的各个环节进行日常检查,并核查对公司的规章、指引和流程的遵守与执行情况。将检查、核查情况定期向总经理提交独立的风险控制报告,并抄送督察长。

六、基金管理人内部控制要素

1、内部控制环境

（1）内部控制环境包括经营理念和内控文化,公司治理结构、组织结构、员工道德素质等内容;

（2）本基金管理人致力于营造一个强调内控和风险管理的文化氛围;

（3）本基金管理人按现代企业制度的要求,建立了符合公司发展需要的组织结构和运行机制,充分发挥独立董事、监事会对公司管理层和经营活动的监督,通过在董事会、监事会层面建立专业化、民主、透明的决策程序和管理、议事规则,防止不正当的关联交易、利益输送和公司内部人控制的现象并确保基金份额持有人的利益不受侵犯;

（4）本基金管理人建立了科学的聘用、培训、评估考核、晋升、淘汰等人力资源管理制度,建立了健全的激励与约束机制,确保公司职员具备和保持良好的职业操守和专业素养;

（5）本基金管理人建立了贯穿于公司整体的、层次明晰、权责统一、监管明确的四层内部控制防线,包括:

第一层:员工的自律与岗位之间的相互制衡与监督;

第二层:严格的授权管理及等级监督制度;

第三层:独立于各部门、服务于公司高级管理层的由风险管理总部对各业务部门实施的日常常规风险检查;

第四层:服务于董事会的独立的合规监察与稽核;

（6）本基金管理人建立了重要业务处理凭据传递和信息沟通制度,有关部门和岗位之间相互监督、相互制衡。

2、风险评估

（1）风险评估,包括风险鉴别和风险测算两大部分,是风险控制管理的前提;

（2）风险鉴别指公司需要确认并了解它所面临风险的特征;

（3）风险测算则在风险鉴别的基础上进一步对风险可能产生的损失作出较为科学和准确的估测;

（4）风险管理委员会需要从风险损失的领域进行划分,确认某项风险将导致公司承担相应法律责任、社会和公众责任、经济损失或是在以上三个领域的任何组合损失;

（5）各部门应负责落实其相关的风险控制措施;

（6）风险管理总部需要在预期风险损失发生的情景下,评估风险对各方面产生的冲击效应。

3、控制活动

（1）严格的流程控制是公司进行有效的内部控制的基础。

1）本基金管理人各项业务操作均应严格遵守公司制定的相应流程,主要的基本业务流程包括:销售和基金募集管理流程、客户开户和注册登记管理流程、客户服务与客户关系处理流程、投资决策管理流程、投资交易管理流程、基金清算与基金会计管理流程、产品开发流程、信息披露管理流程、信息技术管理与操作流程、紧急应变程序、绩效评估与考核程序、授权管理程序、风险控制流程和监察稽核程序等;

2）在主要基本业务流程体系的基础上,各部门结合基本业务流程和其部门、岗位的职责进一步制定具体的、涵盖操作细节的操作流程;在销售、注册登记、投资、交易、基金清算及授权管理等重要操作流程设计与执行中应产生和保留详细的书面记录;

3）风险管理总部在日常业务运行过程中对操作流程的遵守情况进行全面监督和记录;

4）各部门主管负责对本部门的流程运作进行实时监控以保证本部门的工作严格遵守相关业务流程;

5）监察稽核总部以定期稽核的方式检查各业务部门对相关流程运作与遵守情况,并对该流程的合理性、可操作性以及得到遵守的实际状况进行评估;

（2）严格的分级授权是公司内部控制的基本方式;

（3）建立完善的资产分离制度,基金资产与公司资产、不同基金的资产和其他委托资产实行独立运作,分别核算;

（4）严格执行岗位分离制度,明确制定了岗位职责;

（5） 建立科学的业绩评估和考核体系, 定期对各项业务开展作出综合评价并对各部门和岗位人员的业绩进行评估、考核;

（6）制定切实有效的紧急应变制度,建立危机处理的机制,明确危机处理的程序。

4、信息沟通

（1）建立公司内部的信息沟通渠道,保障信息的及时、准确的传递,并且维护渠道的畅通;

（2）建立清晰的报告系统;

（3）如果遇到紧急情况无法联络上级主管,可以越级汇报。

5、内部监控

本基金管理人建立了有效的内部监控体系,设置督察长和独立的监察稽核总部,对公司内控制度的执行情况进行持续的监督,保证内控制度落实。

（1）设督察长,对董事会负责,经董事会聘任,报中国证监会核准。根据公司监察稽核工作的需要和董事会授权开展工作;

（2）设独立于公司运营管理部门的监察稽核总部,监察稽核总部通过定期稽核计划以及不定期的抽查稽核实现对公司的内部风险监控;

（3）设独立于各业务部门的风险管理总部,该部门的工作主要对公司管理层负责;

（4）各部门主管负责本部门对于内控制度的执行和监督;在具体的业务运营中,授权管理、岗位间相互监督与相互制衡以及业务流程中跨部门之间的相互校验与会签制度的执行将赋予各岗位具体的监督职能;

（5）督察长、风险管理总部和投资总监有权对整个投资交易过程实施全程跟踪的在线监控;信息技术总部在信息技术方面对这项实时监控提供充分的技术支持。监控者根据其授权范围和监控领域对于投资交易过程中的控制参数进行预设置;

（6）各部门在发现任何有违反内控原则的行为时,应立即根据报告流程逐级上报,遇到紧急情况可以越级上报;

（7）对于员工个人违反法律法规和有关规定,视其给公司造成的损失及影响程度进行处理。对各项规定制度完善、风险防范工作积极主动并卓有成效的部门,公司将给予适当表彰与鼓励。由于部门制度不合适或管理不完善而造成较大风险并给公司带来损失的,公司将追究部门主要负责人的责任。

七、基金管理人内部控制制度声明

1、本基金管理人承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确;

2、本基金管理人承诺根据市场变化和基金管理人发展不断完善内部合规控制。

第四部分 基金托管人

（一）基金托管人基本情况

名称:中国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

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九层

法定代表人:蒋超良

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

基金托管资格批准文号:中国证监会证监基字【1998】23号

联系电话:010-63201510

传真:010-63201816

联系人:李芳菲

发展概况:

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

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行,经验丰富,服务优质,业绩突出,2004年被英国《全球托管人》评为中国"最佳托管银行"。2007年中国农业银行通过了美国SAS70内部控制审计,并获得无保留意见的SAS70审计报告,表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设,品牌声誉进一步提升,在2010年首届"'金牌理财'TOP10颁奖盛典"中成绩突出,获"最佳托管银行"奖。2010年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的"最佳资产托管奖"。

中国农业银行证券投资基金托管部于1998年5月经中国证监会和中国人民银行批准成立,2004年9月更名为托管业务部,内设养老金管理中心、技术保障处、营运中心、委托资产托管处、保险资产托管处、证券投资基金托管处、境外资产托管处、综合管理处、风险管理处,拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

（二）主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工140余名,其中高级会计师、高级经济师、高级工程师、律师等专家10余名,服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强,高级管理层均有20年以上金融从业经验和高级技术职称,精通国内外证券市场的运作。

（三）托管业务经营情况

截止2014年3月31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198只,包括富国天源平衡混合型证券投资基金、华夏平稳增长混合型证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、大成景阳领先股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金、长盛同德主题增长股票型证券投资基金、博时内需增长灵活配置混合型证券投资基金、汉盛证券投资基金、裕隆证券投资基金、景福证券投资基金、鸿阳证券投资基金、丰和价值证券投资基金、久嘉证券投资基金、长盛成长价值证券投资基金、宝盈鸿利收益证券投资基金、大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、银河稳健证券投资基金、银河收益证券投资基金、长盛中信全债指数增强型债券投资基金、长信利息收益开放式证券投资基金、长盛动态精选证券投资基金、景顺长城内需增长开放式证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、长信银利精选开放式证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、鹏华货币市场证券投资基金、中海分红增利混合型证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、新华优选分红混合型证券投资基金、交银施罗德精选股票证券投资基金、泰达宏利货币市场基金、交银施罗德货币市场证券投资基金、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金、大成沪深300指数证券投资基金、信诚四季红混合型证券投资基金、富国天时货币市场基金、富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金、益民货币市场基金、长城安心回报混合型证券投资基金、中邮核心优选股票型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金、交银施罗德成长股票证券投资基金、长盛中证100指数证券投资基金、泰达宏利首选企业股票型证券投资基金、东吴价值成长双动力股票型证券投资基金、鹏华动力增长混合型证券投资基金、宝盈策略增长股票型证券投资基金、国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、益民创新优势混合型证券投资基金、中邮核心成长股票型证券投资基金、华夏复兴股票型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金、申万巴黎竞争优势股票型证券投资基金、新华优选成长股票型证券投资基金、金元惠理成长动力灵活配置混合型证券投资基金、天治稳健双盈债券型证券投资基金、中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、金元惠理丰利债券型证券投资基金、交银施罗德先锋股票证券投资基金、东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、银华内需精选股票型证券投资基金(LOF)、大成行业轮动股票型证券投资基金、交银施罗德上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金、上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金、富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金、南方中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)、景顺长城能源基建股票型证券投资基金、中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信中小盘成长股票型证券投资基金、东吴货币市场证券投资基金、博时创业成长股票型证券投资基金、招商信用添利债券型证券投资基金、易方达消费行业股票型证券投资基金、富国汇利分级债券型证券投资基金、大成景丰分级债券型证券投资基金、兴全沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)、工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国可转换债券证券投资基金、大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金、泰达宏利领先中小盘股票型证券投资基金、交银施罗德信用添利债券证券投资基金、东吴中证新兴产业指数证券投资基金、工银瑞信四季收益债券型证券投资基金、招商安瑞进取债券型证券投资基金、汇添富社会责任股票型证券投资基金、工银瑞信消费服务行业股票型证券投资基金、易方达黄金主题证券投资基金（LOF）、中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金、浙商聚潮产业成长股票型证券投资基金、嘉实领先成长股票型证券投资基金、广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金、广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金、南方保本混合型证券投资基金、交银施罗德先进制造股票证券投资基金、上投摩根新兴动力股票型证券投资基金、富兰克林国海策略回报灵活配置混合型证券投资基金、金元惠理保本混合型证券投资基金、招商安达保本混合型证券投资基金、交银施罗德深证300价值交易型开放式指数证券投资基金、南方中国中小盘股票指数证券投资基金（LOF）、交银施罗德深证300价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国中证500指数增强型证券投资基金（LOF）、长信内需成长股票型证券投资基金、大成中证内地消费主题指数证券投资基金、中海消费主题精选股票型证券投资基金、长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金、景顺长城核心竞争力股票型证券投资基金、汇添富信用债债券型证券投资基金、光大保德信行业轮动股票型证券投资基金、富兰克林国海亚洲（除日本）机会股票型证券投资基金、汇添富逆向投资股票型证券投资基金、大成新锐产业股票型证券投资基金、申万菱信中小板指数分级证券投资基金、广发消费品精选股票型证券投资基金、鹏华金刚保本混合型证券投资基金、汇添富理财14天债券型证券投资基金、嘉实全球房地产证券投资基金、金元惠理新经济主题股票型证券投资基金、东吴保本混合型证券投资基金、建新社会责任股票型证券投资基金、嘉实理财宝7天债券型证券投资基金、富兰克林国海恒久信用债券型证券投资基金、大成月添利理财债券型证券投资基金、安信目标收益债券型证券投资基金、富国7天理财宝债券型证券投资基金、交银施罗德理财21天债券型证券投资基金、易方达中债新综合指数发起式证券投资基金（LOF）、工银瑞信信用纯债债券型证券投资基金、大成现金增利货币市场基金、景顺长城支柱产业股票型证券投资基金、易方达月月利理财债券型证券投资基金、摩根士丹利华鑫量化配置股票型证券投资基金、东方央视财经50指数增强型证券投资基金、交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金、鹏华理财21天债券型证券投资基金、国泰民安增利债券型发起式证券投资基金、万家14天理财债券型证券投资基金、华安纯债债券型发起式证券投资基金、金元惠理惠利保本混合型证券投资基金、南方中证500交易型开放式指数证券投资基金、招商双债增强分级债券型证券投资基金、景顺长城品质投资股票型证券投资基金、中海可转换债券债券型证券投资基金、融通标普中国可转债指数增强型证券投资基金、大成现金宝场内实时申赎货币市场基金、交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金、国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金、富兰克林国海焦点驱动灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城沪深300等权重交易型开放式指数证券投资基金、广发聚源定期开放债券型证券投资基金、大成景安短融债券型证券投资基金、嘉实研究阿尔法股票型证券投资基金、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、汇添富高息债债券型证券投资基金、东方利群混合型发起式证券投资基金、南方稳利一年定期开放债券型证券投资基金、景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金、华夏永福养老理财混合型证券投资基金、嘉实丰益信用定期开放债券型证券投资基金、国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金、交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金、光大保德信现金宝货币市场基金、易方达投资级信用债债券型证券投资基金、广发趋势优选灵活配置混合型证券投资基金、华润元大保本混合型证券投资基金、长盛双月红一年期定期开放债券型证券投资基金、富国国有企业债债券型证券投资基金、富安达信用主题轮动纯债债券型发起式证券投资基金、景顺长城沪深300指数增强型证券投资基金、中邮定期开放债券型证券投资基金、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信信息产业股票型证券投资基金、大成景祥分级债券型证券投资基金、富兰克林国海岁岁恒丰定期开放债券型证券投资基金、景顺长城景益货币市场基金、万家市政纯债定期开放债券型证券投资基金、建信稳定添利债券型证券投资基金、上投摩根双债增利债券型证券投资基金、嘉实活期宝货币市场基金、融通通源一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金、大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金、鹏华品牌传承灵活配置混合型证券投资基金、国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金、汇添富恒生指数分级证券投资基金、长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金、广发新动力股票型证券投资基金、东吴阿尔法灵活配置混合型证券投资基金、诺安天天宝货币市场基金、前海开源可转债债券型发起式证券投资基金。

（四）基金托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定,守法经营、规范运作、严格监察,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

风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作,对托管业务风险管理和内部控制工作进行监督和评价。托管业务部专门设置了风险管理处,配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作,独立行使监督稽核职权。

3、内部控制制度及措施

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;业务管理实行严格的复核、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。

（五）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统,每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作,并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时,基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理:

1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题,电话提示基金管理人;

2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题,以书面方式对基金管理人进行提示;

3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为,书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

第五部分 相关服务机构

一、基金份额发售机构

1、场外发售机构

（1）直销机构

申万菱信基金管理有限公司直销中心
住所:上海市淮海中路300号香港新世界大厦40层
法定代表人:姜国芳
电话:86-21-23261188
传真:86-21-23261199
联系人:申浩波、李濮君
客户服务电话:400 880 8588（免长途话费）或86-21-962299
网址:www.swsmu.com
电子邮件:service@swsmu.com

（2）代销机构

(1)名称:中国农业银行股份有限公司
注册地址:北京市东城区建国门内大街69号
法定代表人:蒋超良
联系人:刘一宁
电话:010-85108227
传真:010-85109219
客户服务电话:95599
网址:www.abchina.com

(2)名称:交通银行股份有限公司
住所:上海市浦东新区银城中路188号
办公地址:上海市银城中路188号
法定代表人:牛锡明
电话:021-58781234
传真:021-58408483
联系人:曹榕
客户服务电话:95559
网址:www.bankcomm.com

(3)名称:上海农村商业银行股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区银城中路8号中融碧玉蓝天15—20、22—27层
法定代表人:胡平西
客服电话:021-96 2999/4006 962 999
联系人:吴海平
传真:021-38523664
网址:www.srcb.com

(4)名称:申银万国证券股份有限公司
注册地址:上海市常熟路171号
法定代表人:储晓明
传真:021-33388224
联系人:高夫
客服电话:021-95523
公司网站:www.sywg.com

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

(6)名称:海通证券股份有限公司
注册地址:上海市淮海中路98号
办公地址:上海市广东路689号
法定代表人:王开国
联系人:金芸、李笑鸣
客户服务电话:400-8888-001(全国),021-95553,或拨打各城市营业网点咨询电话
公司网站:www.htsec.com

(7)名称:国泰君安证券股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区商城路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:万建华
电话:021-38676666
传真:021-38670666
客户服务热线:400-8888-666

(8)名称:招商证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
法定代表人:宫少林
传真:0755-82943636
联系人:林生迎
客户服务热线:4008888111、95565
公司网站:www.newone.com.cn

(9)名称:中国银河证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人:陈有安
客户服务热线:4008888888
传真:010-66568990
联系人:宋明
公司网址:www.chinastock.com.cn

(10)名称:光大证券股份有限公司
注册地址:上海市静安区新闸路1508号
法定代表人:薛峰
联系人:刘晨、李芳芳
客服电话:95525
传真:021-68815009
公司网站:www.ebscn.com

(11)名称:信达证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人:张志刚
联系人:唐静
客服电话:400-800-8899
公司网址:www.cindasc.com

(12)名称:中航证券有限公司
注册地址:江西省南昌市抚河北路291号
法定代表人:杜航
联系人:戴蕾
客服电话:0791-6768763
网址:www.scstock.com

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

(14)名称:长江证券股份有限公司
注册地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人:胡运钊
联系人:李良
传真:027-85481900
客户服务电话:95579或4008-888-999
网址:www.95579.com

(15)名称:国联证券股份有限公司
注册地址:江苏省无锡市县前东街168号
法定代表人:雷建辉
联系人:徐欣
传真:0510-82830162
客户服务电话:4008885288
网址:www.glsc.com.cn

(16)名称:安信证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
深圳市福田区深南大道2008号中国凤凰大厦1栋9层
法定代表人:牛冠兴
传真:0755-82558355
联系人:余江
统一客服电话:4008001001
公司网站地址:www.essence.com.cn

(17)名称:中信证券股份有限公司
住所:广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦第A层
办公地址:北京朝阳区新源南路6号京城大厦
法定代表人:王东明
电话:010-84588266
传真:010-84865560
联系人:陈忠
网址:www.cs.ecitic.com

(18)名称:东吴证券股份有限公司
住所:苏州工业园区星阳街5号东吴证券大厦
法定代表人:吴永敏
联系人:方晓丹
电话:0512-65581136
传真:0512-65588021
客服电话:4008601555
公司网址:www.dwzq.com.cn

(19)名称:中信万通证券有限责任公司
注册地址:青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层
办公地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层
法定代表人:杨宝林
联系人:吴忠超
客户服务电话:95548
传真:0532-85022605
网址:www.zxwt.com.cn

(20)名称:中信证券（浙江）有限责任公司
注册地址:浙江省杭州市解放东路29号迪凯银座22层
办公地址:浙江省杭州市解放东路29号迪凯银座22层
传真:0571-85106383
客户服务电话:95548
网址:www.bigsun.com.cn

(21)名称:天风证券股份有限公司
注册地址:中国湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦四楼
办公地址:武汉市江汉区唐家墩路32号国资大厦B座四楼
法定代表人:余磊
联系人:翟璟
传真:027-87618863
客服电话:028-86711410
网址:www.tfzq.com

(22) 名称:广州证券有限责任公司
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: 刘东
联系人: 林洁茹
联系电话: 020-88836999
传真: 020-88836654
客户服务电话:020-961303
网址: www.gzs.com.cn

(23)名称:杭州数米基金销售有限公司
注册地址:杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号
办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法定代表人:陈柏青
联系人:张裕
传真:0571-26698533
客户服务电话:4000766123
公司网址:www.fund123.com

(24)名称:上海好买基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
办公地址:上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903-906室
法定代表人:杨文斌
联系人:张茹
客服电话:400-700-9665
公司网址:www.ehowbuy.com

(25)名称:上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册地址:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址:上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层
法定代表人:张跃伟
联系人:敖玲
联系电话021-58788678-8201
传真:021-58787698
客服电话:400-089-1289
公司网站:www.erichfund.com

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

(27)名称:浙江同花顺基金销售有限公司
注册办公地址:杭州市西湖区文二西路1号元茂大厦903室
法定代表人:凌顺平
联系人:杨翼
传真:0571-86800423
客户服务电话:4008-773-772,0571-88920897
网站:www.5ifund.com

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

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

(30)名称:北京展恒基金销售有限公司
注册地址:北京市顺义区后沙峪镇安富街6号
法定代表人:闫振杰
联系人:宋丽冉
电话:010-62020088
传真:010-62020355
客服电话:4008886661
网址:www.myfund.com

(31)名称:和讯信息科技有限公司
注册地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人:王莉
联系人:严跃俊
电话:021-20835788
传真:021-20835879
客服电话:400-920-0022/ 021-20835588
网址:licaike.hexun.com

2、场内发售机构

（1）本基金的场内发售机构为深圳证券交易所内具有基金销售业务资格的会员单位,具体名单为:爱建证券、安信证券、渤海证券、财达证券、财富证券、财富里昂、财通证券、长城证券、长江证券、大通证券、大同证券、德邦证券、第一创业、东北证券、东方证券、东海证券、东莞证券、东吴证券、东兴证券、高华证券、方正证券、光大证券、广发证券、广州证券、国都证券、国海证券、国金证券、国开证券、国联证券、国盛证券、国泰君安、国信证券、国元证券、海通证券、恒泰长财、恒泰证券、红塔证券、宏源证券、华安证券、华宝证券、华创证券、华福证券、华林证券、华龙证券、华融证券、华泰联合、华泰证券、华西证券、华鑫证券、江海证券、金元证券、开源证券、联讯证券、民生证券、民族证券、南京证券、平安证券、齐鲁证券、日信证券、瑞银证券、山西证券、上海证券、申银万国、世纪证券、首创证券、天风证券、天源证券、万和证券、万联证券、西部证券、西藏同信、西南证券、厦门证券、湘财证券、新时代证券、信达证券、兴业证券、银河证券、银泰证券、英大证券、招商证券、浙商证券、中航证券、中金公司、中山证券、中投证券、中天证券、中信建投、中信浙江、中信万通、中信证券、中银证券、中邮证券、中原证券(排名不分先后)。

（2）本基金募集结束前获得基金销售业务资格的深圳证券交易所会员单位可新增为本基金的场内发售机构。

3、基金管理人可根据有关法律法规要求,根据实情,选择其他符合要求的机构代理销售本基金或变更上述代销机构,并及时公告。

二、登记机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
注册地址: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
邮政编码:100033
法定代表人:周明
电话: 010-59378835
传真: 010-59378907
联系人:任瑞新

三、出具法律意见书的律师事务所
名称:上海市通力律师事务所
住所:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人:韩炯
电话:+86-21-31358666
传真:+86-21-31358600
联系人姓名:孙睿
经办律师:孙睿、黎明

四、审计基金财产的会计师事务所
名称:普华永道中天会计师事务所有限公司
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
法定代表人姓名:杨绍信
电话:+86 -21-23238888
传真:+86-21-23238800
联系人姓名:张振波
经办注册会计师姓名:薛竞、张振波

第六部分 基金份额分级

一、基金份额分级

1、基金份额结构

本基金的基金份额包括申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金之基础份额（以下简称"申万环保份额"）、申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金之稳健收益类份额（以下简称"申万环保A份额"）与申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金之积极进取类份额（以下简称"申万环保B份额"）。其中,申万环保A份额、申万环保B份额的基金份额配比始终保持1:1的比例不变。

2、基金的自动分离与分拆规则

本基金通过场外、场内两种方式公开发售。基金发售结束后,场外认购的全部基金份额将确认为申万环保份额;场内认购的全部基金份额按照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,即申万环保A份额和申万环保B份额。

基金合同生效后,申万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。申万环保A份额与申万环保B份额交易代码不同,只可在深圳证券交易所上市交易,不接受单独的申购与赎回。

投资者可在场内申购和赎回申万环保份额, 投资者可选择将其在场内申购的申万环保份额按1:1的比例分拆成申万环保A份额和申万环保B份额。投资者也可按1:1的配比将其持有的申万环保A份额和申万环保B份额申请合并为场内的申万环保份额。

投资者可在场外申购和赎回申万环保份额。投资者不得申请将其场外申购的申万环保份额进行分拆。但投资者可将其持有的场外申万环保份额跨系统转托管至场内并申请将其分拆成申万环保A份额和申万环保B份额后上市交易。

3、申万环保A份额和申万环保B份额的基金份额参考净值计算原则

本基金按基金合同约定的参考净值计算规则对申万环保A份额和申万环保B份额分别进行基金份额参考净值计算,具体计算原则如下:

（1）本基金一份申万环保A份额的参考净值与一份申万环保B份额的参考净值之和等于两份申万环保份额的净值。

（2）申万环保A份额每日获得日基准收益,申万环保A份额实际的投资盈亏都由申万环保B份额分享与承担。申万环保A份额的日基准收益均以1.0000元面值为基准采取单利进行计算。

某运作周年的日基准收益R＝1.0000元×该运作周年的年基准收益率/该运作周年的实际天数

本基金的运作周年指自某运作周年开始日起至该运作周年结束日止的运作期间。基金合同生效之日为第一个运作周年的开始日,其他运作周年的开始日为上一个运作周年结束日的次日。结束日为其开始日至满一周年的最后一日（简称为"对应日"）,若某运作周年的对应日为非工作日,则该运作周年的结束日顺延至其对应日之后的第一个工作日。假设本基金的基金合同生效之日为2014年3月3日,则第一个运作周年的开始日为2014年3月3日,第一个运作周年的对应日为2015年3月2日,因该对应日为工作日,故第一个运作周年的结束日为2015年3月2日。

年基准收益率是指本基金为申万环保A份额设定每个运作周年应得的收益率。

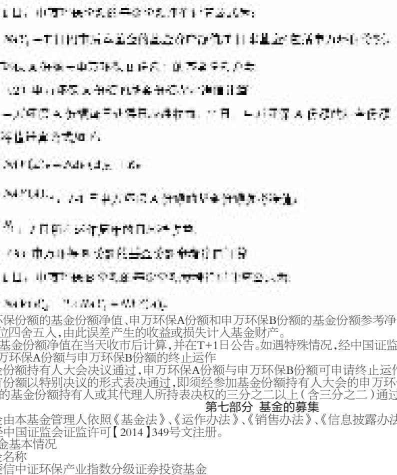
年基准收益率＝一年期银行定期存款利率（税后）+3.00%,其中,一年期银行定期存款利率是指每个运作周年的第一天中国人民银行公布并执行的金融机构人民币一年期整存整取基准年利率。

（3）申万环保B份额的基金份额参考净值＝2×申万环保份额的基金份额净值－申万环保A份额的基金份额参考净值。

基金管理人并不承诺或保证申万环保A份额的基金份额持有人的约定基准收益, 如在本基金资产出现极端损失情况下,申万环保A份额的基金份额持有人可能会面临无法取得约定基准收益甚至损失本金的风险。

4、基金份额净值、基金份额参考净值的计算

本基金按照申万环保A份额和申万环保B份额的基金份额参考净值计算规则计算并公告申万环保份额的基金份额净值、申万环保A份额与申万环保B份额的基金份额参考净值。



申万环保份额的基金份额净值、申万环保A份额和申万环保B份额的基金份额参考净值的计算,均保留到小数点后4位,小数点后第5位四舍五入,由此误差产生的收益或损失计入基金财产。

T日的基金份额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。

二、申万环保A份额与申万环保B份额的终止运作

经基金份额持有人大会决议通过,申万环保A份额与申万环保B份额可申请终止运作。该基金份额持有人大会决议须经本基金所有份额以特别决议的形式表决通过,即须经参加基金份额持有人大会的申万环保份额、申万环保A份额与申万环保B份额各自的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方为有效。

第七部分 基金的募集

本基金由本基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定募集,本次募集经中国证监会证监许可【2014】349号文注册。

一、基金基本情况

1、基金名称
申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金

2、基金的类别
股票型证券投资基金

3、基金的运作方式
上市契约型开放式

4、基金存续期限
不定期

二、募集方式和募集场所

本基金通过场外、场内两种方式公开募集。

场外将通过基金管理人的直销中心及基金场外代销机构的代销网点发售（具体名单详见基金份额发售公告）。场内将通过深圳证券交易所内具有基金代销业务资格并经深圳证券交易所认可的会员单位发售（具体名单详见基金份额发售公告或相关业务公告）。本基金募集期结束前获得基金销售业务资格的会员单位也可代理场内基金份额的发售。基金发售结束后,投资者场外认购所得的全部份额将确认为申万环保份额;投资者场内认购所得的全部份额将按1:1 的比例确认为申万环保A份额与申万环保B 份额。

三、募集期

募集期限为自基金份额发售之日起不超过3个月,具体募集时间以基金份额发售公告为准,请投资者就募集和认购事宜仔细阅读本基金的基金份额发售公告。

四、募集对象

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、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。

五、基金的最低募集份额总额和募集金额

基金募集份额总额不少于2亿份,基金募集金额不少于2亿元。

六、认购时间

投资人可在募集期内前往本基金场外销售机构的网点办理基金份额认购手续, 具体的业务办理时间详见本基金的基金份额发售公告或各代销机构相关业务办理规则。

投资人可在募集期内前往具有基金销售业务资格的深圳证券交易所会员单位（具体名单见基金份额发售公告）办理基金份额的场内认购手续,具体的业务办理时间详见本基金的基金份额发售公告或各代销机构相关业务办理规则。

七、认购手续

1、投资人认购本基金份额应提交的文件和办理的手续

投资人通过场内认购本基金基金份额,应持深圳人民币普通股票账户或证券投资基金账户;投资者通过场外认购本基金基金份额,应开立中国证券登记结算有限责任公司深圳开放式基金账户。募集期内,投资者可通过具有基金销售业务资格的证券经营机构营业部、基金管理人及其代销机构的营业网点办理开户和认购手续。

在募集期间,投资者认购本基金基金份额应当按照证券经营机构营业部、基金管理人及其代销机构网点的规定,到相应的销售网点填写认购申请书,并按照其规定的方式全额缴纳认购款。

投资者认购本基金份额应提交的文件和办理的手续详见本基金的基金份额发售公告。

2、认购的确认

销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以登记机构或基金管理人的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况,投资人应及时查询。

八、认购方式

1、本基金基金份额初始面值为人民币1.00 元,按初始面值发售。

2、认购费率

本基金对通过基金管理人直销中心认购的养老金客户与除此之外的其他投资人实施差别的认购费率, 对通过直销中心认购的养老金客户实施特定认购费率。养老金客户指基本养老基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金,包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划。如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型, 基金管理人将在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围,并按规定向中国证监会备案。非养老金客户指除养老金客户外的其他投资人。

（1）本基金的场外认购费率如下表:

认购金额（元）	特定认购费率	认购费率
50万以下	0.40%	0.80%
50万（含）—100万	0.12%	0.50%
100万（含）以上	500元/笔	1000元/笔

（2）本基金的场内认购费率由销售机构参照场外认购费率执行。

基金认购费用不列入基金财产,主要用于基金的市场推广、销售、登记等募集期间发生的各项费用。

3、认购份额的计算

（1）场外认购份额的计算

本基金发售结束后,场外认购的全部份额将确认为申万环保份额。本基金采用前端收费模式,即投资人在认购基金时缴纳认购费。登记机构根据单次认购的实际确认金额确定每次认购所适用的费率并分别计算。

当认购费用适用比例费率时,认购份额的计算方法如下:

净认购金额＝认购金额/（1+认购费率）

认购费用＝认购金额－净认购金额

认购份额＝（净认购金额＋认购资金利息）/基金份额初始面值

当认购费用为固定金额时,认购份额的计算方法如下:

认购费用＝固定金额

净认购金额=认购金额－认购费用

认购份额＝（净认购金额+认购资金利息）/基金份额初始面值

场外认购份额的计算保留到小数点后两位,小数点两位以后的部分四舍五入,由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。有效认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有, 其中利息转份额以登记机构的记录为准。利息折算份额的计算采用截位法保留到小数点后两位,剩余部分计入基金财产。

举例说明:

假设某投资人（非养老金客户）通过场外认购本基金,认购金额10,000元,认购费率为0.80%,假定募集期间认购资金所得利息为35.5元且该笔认购全部予以确认,则其可得到的申万环保份额计算如下:

净认购金额=10,000/（1+0.80%）=9,920.63元

认购费用=10,000−9,920.63=79.37元

认购份额=（9,920.63+35.5）/1.00=9,956.13份

即:该投资人投资10,000 元通过场外认购本基金份额,假定募集期间认购资金所得利息为35.5元,在基金发售结束后,其所获得的申万环保份额为9,956.13份。

（2）场内认购份额的计算

本基金发售结束后,场内认购的全部份额将按1:1的比例确认为申万环保A份额与申万环保B份额。

本基金场内认购采用份额认购的方式,认购价格为1.00元/份。计算公式为:

净认购金额＝认购价格×认购份额

认购费用＝认购价格×认购份额×认购费率

（注:对于适用固定金额认购费的认购,认购费用＝固定金额认购费）

认购金额＝净认购金额＋认购费用

有效认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有,其中利息以登记机构的记录为准。计算公式为:

利息折算的份额＝认购利息/认购价格

认购金额的计算保留到小数点后两位,小数点两位以后的部分四舍五入。场内认购份额按整数申报,利息折算份额的计算保留到整数位,剩余部分计入基金财产。

认购份额总额＝认购份额＋利息折算的份额

经确认的申万环保A份额＝认购份额总额×0.5

经确认的申万环保B份额＝认购份额总额−经确认的申万环保A份额

申万环保A份额、申万环保B份额的计算保留至整数位（最小单位为1份）,余额计入基金财产。

举例说明:

某投资人（非养老金客户）通过场内认购本基金100,000份,若会员单位设定发售费率为0.80%,假定该笔认购产生利息100元且该笔认购全部予以确认,则认购金额和利息折算的份额为:

认购价格＝1.00元

净认购金额＝认购价格×认购份额＝1.00×100,000＝100,000.00元

认购费用＝认购价格×认购份额×认购费率＝1.00×100,000×0.80%＝800.00元

认购金额＝净认购金额＋认购费用＝100,000.00＋800.00＝100,800.00元

利息折算的份额＝利息/认购价格＝100/1.00＝100份

认购份额总额＝认购份额＋利息折算的份额＝100,000+100=100,100份

经确认的申万环保A份额＝认购份额总额×0.5＝100,100×0.5＝50,050份

经确认的申万环保B份额＝认购份额总额−经确认的申万环保A份额＝100,100−50,050＝50,050份

即:该投资人通过场内认购100,000份申万环保份额,需缴纳100,800元,假定该笔认购产生利息100元,在基金发售结束后,其可获得的申万环保A份额为50,050份、申万环保B份额为50,050份。

九、基金份额的认购原则

1、投资人在募集期内可以多次认购本基金份额,认购一经受理不得撤销。

2、本基金场外认购首次单笔认购最低金额为人民币 1,000 元（含认购费,下同）,追加认购的单笔认购最低金额为人民币1,000 元。投资人在直销中心首次单笔认购最低金额为1,000元人民币,追加认购的最低金额为1,000 元人民币。本基金通过具有基金销售业务资格的深圳证券交易所会员单位进行场内认购的单笔最低认购份额为50,000 份, 超过50,000份的须是1,000 份的整数倍,且每笔认购最大不得超过99,999,000 份。

3、基金管理人可根据有关法律法规的规定和市场情况,调整认购的数额限制,基金管理人最迟应于调整前2个工作日在指定媒体上予以公告。

4、投资者认购前,须按照销售机构规定的方式备足全额缴纳认购的金额的款项。

5、具体规则请参照申万菱信基金管理有限公司直销中心和各基金代销机构的规定。

十、募集资金利息的处理方式

本基金的有效认购款项在基金募集期间产生的利息在基金合同生效后将折算为基金份额,归基金份额持有人所有。利息转份额以登记机构的记录为准。

十一、募集资金的保管

基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户,在基金募集行为结束前,任何人不得动用。

第八部分 基金合同的生效

一、基金备案和基金合同生效

1、本基金自基金份额发售之日起3个月内,在基金募集份额总额不少于2亿份,基金募集金额不少于2亿元人民币且基金认购人数不少于200人的条件下,基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售。基金管理人应当自基金募集期结束之日起10日内聘请法定验资机构验资,自收到验资报告之日起10日内,向中国证监会提交验资报告,办理基金备案手续。

基金募集达到基金备案条件的, 自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起, 基金合同生效;否则基金合同不生效。

2、基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对基金合同生效事宜予以公告。

3、基金合同生效前,基金投资者的认购款项只能存入专用账户,任何人不得动用。有效认购资金在基金募集期形成的利息折成基金份额,归基金投资者所有。利息转份额的具体数额以登记机构的记录为准。

二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式

如果募集期限届满,未满足基金备案条件,基金管理人应当承担下列责任:

1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用;

2、在基金募集期限届满后30日内返还投资者已缴纳的款项,并加计银行同期存款利息;

3、如基金募集失败,基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

基金合同生效后,基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000 万元的,基金管理人应当及时报告中国证监会;连续20个工作日出现前述情形的,基金管理人应当向中国证监会说明原因并报送解决方案。

法律法规另有规定时,从其规定。

第九部分 申万环保A份额与申万环保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,基金管理人将根据有关规定,申请申万环保A 份额、申万环保B 份额上市交易。

二、上市交易的地点

深圳证券交易所

三、上市交易的时间

基金合同生效后三个月内,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,申万环保A份额与申万环保B份额开始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体上刊登基金份额上市交易公告书。

四、上市交易的规则

1、申万环保A份额、申万环保B份额分别采用不同的交易代码上市交易;

2、申万环保A份额、申万环保B份额上市首日的开盘参考价分别为各自前一交易日的基金份额参考净值;

3、申万环保A份额、申万环保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;

4、申万环保A份额、申万环保B份额买入申报数量为100份或其整数倍;

5、申万环保A份额、申万环保B份额申报价格最小变动单位为0.001元人民币;

6、申万环保A份额、申万环保B份额上市交易遵循《深圳证券交易所交易规则》及《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》等其他有关规定。

五、上市交易的费用

申万环保A份额、申万环保B份额上市交易的费用按照深圳证券交易所的有关规定办理。

六、上市交易的行情揭示

申万环保A份额、申万环保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申万环保A份额、申万环保B份额的基金份额参考净值。

七、上市交易的注册登记

投资人T日买入成功后,登记机构在T日自动为投资人登记权益并办理注册登记手续,投资人自T+1日（含该日）后有权卖出该部分基金;

投资人T 日卖出成功后,登记机构在T 日自动为投资人办理扣除权益的注册登记手续。

八、上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市

申万环保A份额、申万环保B份额的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所的相关规定执行。

九、相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的,基金合同相应予以修改,并按照新规定执行,且此项修改无须召开基金份额持有人大会。

十、若深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司增加了基金上市交易的新功能,基金管理人可以在履行适当的程序后增加相应功能。

第十部分 申万环保份额的申购与赎回

本基金基金合同生效后,投资者可通过场外或场内两种方式对申万环保份额进行申购与赎回。申万环保A份额、申万环保B份额只上市交易,不接受申购与赎回。

一、申购和赎回场所

申万环保份额场外申购与赎回的场所包括基金管理人的直销中心和基金管理人委托的场外销售机构, 投资者可使用开放式基金账户,通过基金管理人、场外销售机构办理场外申购、赎回业务;申万环保份额场内申购与赎回的场所为深圳证券交易所内具有基金代销业务资格、经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的会员单位,投资者使用深圳证券账户,通过深圳证券交易所交易系统办理场内申购、赎回业务。具体的销售网点参见本招募说明书"第五部分 相关服务机构"或由基金管理人在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,并予以公告。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理申万环保份额的申购与赎回。

二、申购和赎回的开放日及时间

1、开放日及开放时间

投资人在开放日办理申万环保份额的申购和赎回,具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间,但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

基金合同生效后,若出现新的证券交易市场、期货交易市场、证券交易所、期货交易所交易时间变更或其他特殊情况,基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整,但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

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个月开始办理申万环保份额的申购,具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理申万环保份额的赎回,具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

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体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申万环保份额的申购、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,其申万环保份额申购、赎回价格为下一开放日申万环保份额申购、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申万环保份额的份额净值为基准进行计算;

2、"金额申购、份额赎回"原则,即申购以金额申请,赎回以份额申请;

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销,在当日的开放时间结束后不得撤销;

4、申万环保份额的场内申购、赎回等业务,按照深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则执行。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对申购、赎回业务等规则有新的规定,按新规定执行;

5、除投资人指定赎回外,场外赎回遵循"先进先出"原则,即按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回;

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体上公告。

四、申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

投资人必须根据销售机构规定的程序,在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

投资人办理申购、赎回等业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守基金合同和本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

投资人申购申万环保份额时,必须全额交付申购款项,投资人交付申购款项,申购成立;登记机构确认申万环保份额时,申购生效。投资人在提交赎回申请时,必须有足够的申万环保份额余额,则赎回申请成立,否则所提交的赎回申请不成立,登记机构确认赎回时,赎回生效。

投资人T日的赎回申请经本基金的登记机构确认生效后,基金管理人将在T+7日（包括该日）内支付赎回款项。在发生巨额赎回或基金合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时,款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内,对上述业务办理时间进行调整,并按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上提前公告。

3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T日）,在正常情况下,本基金登记机构在T+1日内（包括该日）对该交易的有效性进行确认,投资人应在T+2日后（包括该日）及时到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功,则申购款项退还给投资人。

销售机构对申请的受理并不代表该申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到申请。申请的确认以登记机构或基金管理人的确认结果为准。对于申请的确认情况,投资者应及时查询,否则如因申请未得到登记机构或基金管理人的确认而产生的后果,由投资人自行承担。

五、申购和赎回的数量限制

1、申购金额的限制

投资人在办理申万环保份额场内申购时,单笔申购的最低金额为50,000元人民币（含申购费）。投资人在办理申万环保份额场外申购时,单笔最低金额为1,000元人民币（含申购费）。通过直销中心首次申购的最低金额为1,000元人民币（含申购费）,追加申购最低金额为1,000元人民币（含申购费）。基金直销中心单笔申购最低金额可由基金管理人酌情调整。

代销网点的投资人欲转入直销网点进行交易要受直销网点最低金额的限制。基金管理人可根据市场情况,调整首次申购的最低金额。

投资人可多次申购,对单个投资人累计持有份额不设上限限制。法律法规、中国证监会另有规定的除外。

2、赎回份额的限制

申万环保份额持有人在销售机构赎回时,每笔赎回申请不得低于1,000份申万环保份额,且通过场内单笔申请赎回的申万环保份额必须是整数份;申万环保份额持有人赎回时或赎回后将导致在销售机构（网点）保留的申万环保份额余额不足1,000份的,需一并全部赎回。

3、申万环保份额持有人每个交易账户的最低份额余额为100份。申万环保份额持有人因赎回、转换等原因导致其单个交易账户内剩余的申万环保份额低于100份时,注册登记系统可对该剩余的基金份额自动进行强制赎回处理。

4、基金管理人可根据市场情况,在法律法规允许的情况下,调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

六、申购费用与赎回费用

1、申万环保份额的申购费用

本基金对通过基金管理人直销中心申购的养老金客户与除此之外的其他投资人实施差别的申购费率, 对通过直销中心申购的养老金客户实施特定申购费率。养老金客户指基本养老基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金,包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划。如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型, 基金管理人将在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围,并按规定向中国证监会备案。非养老金客户指除养老金客户外的其他投资人。

申万环保份额的申购费用由投资人承担,不列入基金资产,用于基金的市场推广、销售、登记等各项费用

（1）申万环保份额的场外申购费率

申购金额（元）	特定申购费率	申购费率
50万以下	0.40%	1.00%
50万（含）—100万	0.12%	0.60%
100万（含）以上	500元/笔	1000元/笔

（2）申万环保份额的场内申购费率由基金代销机构参照场外申购费率执行

2、申万环保份额的赎回费用

申万环保份额的赎回费用由赎回申万环保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。赎回费用不纳入基金财产,用于支付市场推广、销售、登记费和其他必要的手续费。

（1）申万环保份额的场外赎回费率

持有期限	赎回费率
6个月以内	0.50%
6个月（含）—1年	0.25%
1年（含）以上	0.00%

（2）申万环保份额的场内赎回费率为固定值0.5%,不按基金份额持有时间分段设置赎回费率。从场内转托管至场外的申万环保份额,从场外赎回时,其持有期限从转托管转入确认日开始计算。

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体上公告。

4、对特定交易方式（如网上交易、电话交易等）,基金管理人履行适当程序后可以采用低于柜台交易方式的基金申购费率和基金赎回费率。

5、基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情况下根据市场情况制定基金促销计划,针对基金投资者定期和不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,基金管理人可以按中国证监会要求履行必要手续后,对基金投资者适当调低基金申购费率和赎回费率。

七、申购份额与赎回金额的计算

1、申万环保份额的申购份额计算

申万环保份额的申购金额包括申购费用和净申购金额。登记机构根据单次申购的实际确认金额确定每次申购所适用的费率并分别计算。

当申购费用适用比例费率时,申购份额的计算方法如下:

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/T日申万环保份额净值

当申购费用为固定金额时,申购份额的计算方法如下:

申购费用＝固定金额

净申购金额=申购金额－申购费用

申购份额＝净申购金额/T日申万环保份额净值

申购费用以四舍五入方式保留到小数点后两位。通过场外方式进行申购的,申购份额计算结果按四舍五入方法,保留到小数点后两位,由此误差产生的收益或损失由基金财产承担;通过场内方式进行申购的,申购份额计算结果采用截尾法保留至整数位,不足1份部分对应的申购资金将返还给投资人。

举例说明:

某投资人（非养老金客户）通过场外投资10,000元申购申万环保份额,对应费率为1.00%,假设申购当日申万环保份额的基金份额净值为1.1320元,则其可得到的申购份额为:

净申购金额=10,000/（1+1.00%）=9,900.99元

申购费用=10,000−9,900.99=99.01元

申购份额=9,900.99 /1.1320=8,746.46份

即:该投资人通过场外投资10,000元申购申万环保份额,假设申购当日申万环保份额的基金份额净值为1.1320元,则可得到8,746.46份申万环保份额。

举例说明:

某投资人（非养老金客户）通过场内投资100,000元申购申万环保份额,对应的申购费率为1.00%,假设申购当日申万环保份额的基金份额净值为1.1320元,则其申购手续费、可得到的申购份额及返还的资金余额为:

净申购金额=100,000/（1+1.00%）=99,009.90元

申购费用=100,000−99,009.90=990.10元

申购份额=99,009.90/1.1320=87,464.58份

因场内申购份额计算结果采用截尾法保留至整数份,故投资人申购所得份额为87,464份,不足1份部分对应的申购资金将返还给投资人。具体计算公式为:

实际净申购金额=87,464×1.1320=99,009.25元

退款金额=100,000−99,009.25−990.10=0.65元

即:该投资人投资100,000元从场内申购申万环保份额,假设申购当日申万环保份额的基金份额净值为1.1320元,则其可得到申万环保份额87,464份,退款0.65元。

2、申万环保份额的赎回金额计算

投资人在赎回申万环保份额时需缴纳一定的赎回费用。计算公式如下:

赎回总金额＝赎回份额×T日申万环保份额净值

赎回费＝赎回份额×T日申万环保份额净值×赎回费率

净赎回金额＝赎回总金额－赎回费

赎回金额单位为元,计算结果按四舍五入方法,保留到小数点后两位,由此产生的收益或损失由基金财产享有或承担。

举例说明:

某申万环保份额持有人持有10,000份申万环保份额6个月后（未满1年）决定从场外赎回,对应的赎回费率为0.25%,假设赎回当日申万环保份额的基金份额净值是1.1320元,则可得到的净赎回金额为:

赎回总金额=10,000×1.1320=11,320.00元

赎回费用=11,320.00×0.25%=28.30元

净赎回金额=11,320.00−28.30=11,291.70元

即:该申万环保份额持有人持有10,000份申万环保份额6个月后（未满1年）从场外赎回,假设赎回当日申万环保份额的基金份额净值是1.1320元,则可得到的净赎回金额为11,291.70元。

举例说明:

某申万环保份额持有人从场内赎回10,000份申万环保份额,赎回费率为0.50%,假设赎回当日申万环保份额的基金份额净值为1.1320 元,则可得到的净赎回金额为:

赎回总金额=10,000×1.1320=11,320.00元

赎回费用=11,320.00×0.5%=56.60元

净赎回金额=11,320.00−56.60=11,263.40元

即:该申万环保份额持有人从深圳证券交易所场内赎回10,000份申万环保份额,假设赎回当日申万环保份额的基金份额净值为1.1320元,则可得到的净赎回金额为11,263.40元。

3、申万环保份额的基金份额净值计算

T 日申万环保份额的基金份额净值＝T日闭市后的基金资产净值/T 日本基金的基金份额总数（指申万环保份额、申万环保A 份额、申万环保B 份额的总额）。

申万环保份额的基金份额净值的计算,保留到小数点后4位,小数点后第5位四舍五入,由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。T日的申万环保份额的基金份额净值在当天收市后计算,并在T+1日内公告。遇特殊情况,经中国证监会同意,可以适当延迟计算或公告。

八、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时,基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请:

1、因不可抗力导致基金无法正常运作。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时。

3、基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

4、基金资产规模过大,使基金管理人无法找到合适的投资品种,或其他可能对基金业绩产生负面影响,从而损害现有基金份额持有人利益的情形。

5、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第1、2、4、5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体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝,被拒绝的申购款项将退还给投资人。基金管理人及基金托管人不承担该退回款项产生的利息损失。在暂停申购的情况消除时,基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

九、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时,基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项:

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。

3、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

4、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时,基金管理人应在当日报中国证监会备案,已确认的赎回申请,基金管理人应足额支付;如暂时不能足额支付,应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人,未支付部分可延期支付。若出现上述第3项所述情形,按基金合同的相关条款处理。在暂停赎回的情况消除时,基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

十、巨额赎回的情形及处理方式

1、巨额赎回的认定

若申万环保份额单个开放日内的基金份额净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过前一开放日的基金总份额（包括申万环保份额、申万环保A份额和申万环保B份额,下同）的10%,即认为是发生了巨额赎回。

2、巨额赎回的场外处理方式

当基金出现巨额赎回时,基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。

（1）全额赎回:当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时,按正常赎回程序执行。

（2）部分延期赎回:当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时, 基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的10% 的前提下,可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请,应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例,确定当日受理该单个账户的赎回份额;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。

3、巨额赎回的场内处理方式

巨额赎回的场内处理,按照深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。

4、暂停赎回

申万环保份额连续2个开放日以上（含2个开放日）发生巨额赎回,如基金管理人认为有必要,可暂停接受基金的赎回申请;已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项,但不得超过20个工作日,并应当在指定媒体上进行公告。

5、巨额赎回的公告

当发生巨额赎回并延期办理时,基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在3个交易日内通知基金份额持有人,说明有关处理方法,同时在指定媒体上刊登公告。

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,基金管理人当日应立即向中国证监会备案,并在规定期限内在指定媒体上刊登暂停公告。

2、如发生暂停的时间为1日,基金管理人应于重新开放日,在指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告,并公布最近1个工作日申万环保份额的基金份额净值。

3、如发生暂停的时间超过1 日但少于2 周,暂停结束,基金重新开放申购或赎回时,基金管理人应依照《信息披露办法》的有关规定,在指定媒体刊登基金重新开放申购或赎回公告,并公告最近1 个工作日申万环保份额的基金份额净值。

4、如发生暂停的时间超过2周（包括2周）,暂停期间,基金管理人应每2 周至少刊登暂停公告1次。暂停结束,基金重新开放申购或赎回时,基金管理人应依照《信息披露办法》的有关规定,在指定媒体刊登基金重新开放申购或赎回公告,并公告最近1 个工作日申万环保份额的基金份额净值。

十二、基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定决定开办申万环保份额与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务,基金转换可以收取一定的转换费,相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制定并公告,并提前告知基金托管人与相关机构。

第十一部分 基金的非交易过户、转托管、冻结与解冻

一、基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下,接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。

继承是指基金份额持有人死亡,其持有的基金份额由其合法的继承人继承;捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体; 司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金登记机构要求提供的相关资料,对于符合条件的非交易过户申请按基金登记机构的规定办理,并按基金登记机构规定的标准收费。

二、基金的注册登记、系统内转托管和跨系统转托管

1、基金份额的注册登记

（1）本基金的基金份额采用分系统登记的原则。场外认购或申购的申万环保份额,登记在注册登记系统中基金份额持有人开放式基金账户下;场内认购、申购的申万环保份额,或上市交易的申万环保A份额和申万环保B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申万环保份额,可以直接申请场内赎回,不在深圳证券交易所上市交易,但可经基金份额持有人申请,按1:1的份额配比分拆为申万环保A份额和申万环保B份额后,在深圳证券交易所上市。

（3）登记在证券登记结算系统中的申万环保A份额和申万环保B份额在深圳证券交易所上市交易,不能直接申请场内赎回,但可按1:1的份额配比申请合并为申万环保份额的场内份额后,再申请场内赎回。

（4）登记在注册登记系统中的申万环保份额,既可以直接申请场外赎回,也可以在办理跨系统转托管后,转至证券登记结算系统,由基金份额持有人申请,按1:1的份额配比分拆为申万环保A份额和申万环保B份额,在深圳证券交易所上市。

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申万环保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申万环保份额赎回业务的销售机构（网点）时,需办理已持有申万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申万环保份额场内赎回的会员单位（交易单元）、或变更办理申万环保A份额和申万环保B份额上市交易的会员单位（交易单元）时,需办理已持有基金份额的系统内转托管。

3、跨系统转托管

（1）跨系统转托管是指基金份额持有人将持有的申万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）本基金跨系统转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。

基金销售机构可以按照相关规定向基金份额持有人收取转托管费。

三、定期定额投资计划

基金管理人可以为投资人办理定期定额投资计划,具体规则由基金管理人另行规定。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额, 每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

四、基金份额的冻结和解冻

基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻,以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。

第十二部分 基金的份额配对转换

本基金基金合同生效后,基金管理人将为基金份额持有人办理份额配对转换业务。

一、份额配对转换是指本基金的申万环保份额与申万环保A份额、申万环保B份额之间的配对转换,包括分拆和合并两个方面。

1、分拆。基金份额持有人将其持有的每两份申万环保份额的场内份额申请转换成一份申万环保A份额与一份申万环保B份额的行为。

2、合并。基金份额持有人将其持有的每一份申万环保A份额与一份申万环保B份额进行配对申请转换成两份申万环保份额的场内份额的行为。

二、份额配对转换的业务办理机构

份额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。

投资人应当在份额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份额配对转换。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份额配对转换的业务办理机构,并予以公告。

三、份额配对转换的业务办理时间

份额配对转换自申万环保A份额、申万环保B份额上市交易后不超过3个月的时间内开始办理,基金管理人应在开始办理份额配对转换的具体日期前2个工作日在指定媒体公告。

份额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份额配对转换时除外）,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,基金管理人可对份额配对转换业务的办理时间进行调整并公告。

四、份额配对转换的原则

1、份额配对转换以份额申请。

2、申请进行"分拆"的申万环保份额的场内份额必须是偶数。

3、申请进行"合并"的申万环保A份额与申万环保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、申万环保份额的场外份额如需申请进行"分拆",须跨系统转托管为申万环保份额的场内份额后方可进行。

5、份额配对转换应遵循届时相关机构发布的相关业务规则。

深圳证券交易所、基金登记机构或基金管理人可视情况对上述规定作出调整,并在正式实施前2个工作日在指定媒体公告。

五、份额配对转换的程序

份额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、暂停份额配对转换的情形

1、基金管理人根据本基金届时投资运作、交易的实际情形可决定是否暂停接受配对转换;

2、深圳证券交易所、登记机构、份额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。

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份额配对转换的, 基金管理人应当在指定媒体刊登暂停份额配对转换业务的公告。

在暂停份额配对转换的情况消除时, 基金管理人应及时恢复份额配对转换业务的办理, 并依照有关规定在指定媒体公告。

七、份额配对转换的业务办理费用

份额配对转换业务办理机构可对转换业务的办理酌情收取一定的佣金,具体见相关业务公告。

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。

第十三部分 基金的投资

一、投资目标

本基金采取指数化投资方式,通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%,实现对中证环保产业指数的有效跟踪。

二、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、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%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。

三、投资策略

1、股票投资策略

本基金主要采用完全复制的方法进行投资,即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。

在标的指数成份股发生变动、增发、配股、分红等公司行为导致成份股的构成及权重发生变化时,由于交易成本、交易制度、个别成份股停牌或者流动性不足等原因导致本基金无法及时完成投资组合同步调整的情况下,基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合,追求尽可能贴近标的指数的表现。

（1）组合构建策略

本管理人构建投资组合的过程主要分为三步:确定目标组合、确定建仓策略和逐步调整。

1）确定目标组合:本基金管理人根据完全复制成份股权重的方法确定目标组合。

2）确定建仓策略:本基金管理人根据对成份股流动性的分析,确定合理的建仓策略。

3）逐步调整:通过完全复制法最终确定目标组合之后,本基金管理人在规定时间内采用适当的手段调整实际组合直至达到跟踪标的指数的要求。

（2）组合管理策略

1）定期调整

本基金股票组合根据标的指数对其成份股的定期调整而进行相应的定期跟踪调整。

2）不定期调整

①当成份股发生增发、送配等情况而影响成份股在指数中权重的行为时,本基金将根据指数公司的公告,进行相应调整;

②根据本基金的申购和赎回情况,对股票投资组合进行调整,从而有效跟踪标的指数;

③若个别成份股因停牌、流动性不足或法规限制等因素,使得基金管理人无法按照其所占标的指数权重进行购买时,基金管理人将综合考虑跟踪误差最小化和投资者利益,决定部分持有现金或买入相关的替代性组合。

2、股指期货投资策略

本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货的投资。本基金投资股指期货将主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约,力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。

四、投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制:

（1）本基金所持有的股票市值和买入、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%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后, 应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券;

（2）本基金在任何交易日买入权证的总金额,不超过上一交易日基金资产净值的0.5%,本基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%,基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的10%。法律法规或中国证监会另有规定的,遵从其规定;

（3）本基金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%;

（4）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%;

（5）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%;

（6）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%;

（7）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;

（8）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;

（9）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%;

（10）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%;

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

（11）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;

（12）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;

（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。

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

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

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

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:

（1）承销证券;

（2）违反规定向他人贷款或者提供担保;

（3）从事承担无限责任的投资;

（4）买卖其他基金份额,但是中国证监会另有规定的除外;

（5）向其基金管理人、基金托管人出资;

（6）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;

（7）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

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

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定,在履行适当程序后,本基金可不受上述规定的限制。

五、业绩比较基准

业绩比较基准为:95%×中证环保产业指数收益率+5%×银行同业存款利率。

本基金以中证环保产业指数为标的指数, 原则上将不低于80%的非现金基金资产投资于标的指数成份股和备选成份股,不低于5%的资产投资于现金类资产,业内现金类资产收益率主要以银行同业存款利率为基准,故选用以上业绩比较基准可以有效评估本基金投资组合业绩,反映本基金的风格特点。

中证环保产业指数由中证指数有限公司编制并发布,根据联合国环境与经济综合核算体系对于环保产业的界定方法,将符合资源管理、清洁技术和产品、污染管理的公司纳入环保产业主题,采用等权重加权方式,反映上海和深圳市场环保产业公司表现的指数。

如果中证环保产业指数被停止编制或发布,或由其他指数替代（单纯更名除外）,或由于指数编制方法等重大变更导致

（下转B15版）