申万菱信基金管理有限公司关于以通讯方式召开申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告

申万菱信基金管理有限公司已于 2020 年 8 月 11 日在《证券日报》及本公司网站（www.swsmu.com）发布了《申万菱信基金管理有限公司关于以通讯方式召开申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的公告》。为了使本次基金份额持有人大会顺利召开，现发布关于以通讯方式召开申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告。

一、召开会议基本情况

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《申万菱信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》”）的有关规定，申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金管理人申万菱信基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）经与本基金的基金托管人中国农业银行股份有限公司协商一致，决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，审议本基金转型方案等相关事宜，会议具体安排如下：

1、会议召开方式：通讯方式。

2、会议投票表决起止时间：自 2020 年 8 月 14 日起，至 2020 年 9 月 10 日 17:00 止（以本基金管理人收到表决票的时间为准）。

3、表决票的寄达地点：

收件人：申万菱信基金管理有限公司 产品与创新业务部

收件地址：上海市中山南路 100 号 10 层 1004 室

联系人：赵兵

电话：021-23261188

邮政编码：200010

请在信封表面注明：“申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

4、投资者如有任何疑问，可致电本基金管理人客服中心电话 400 880 8588（免长途话费）或 +86 21 962299?咨询。

二、会议审议事项

《关于申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金转型并修改基金合同有关事项的议案》（见附件一）。

上述议案的说明请参见《关于申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金转型并修改基金合同有关事项议案的说明》（见附件四）。

三、权益登记日

本次大会的权益登记日为 2020 年 9 月 9 日，即 2020 年 9 月 9 日下午交易时间结束后在本基金注册登记机构登记在册的本基金全体基金份额持有人（包括申万环保份额、申万环保 A 份额与申万环保 B 份额的基金份额持有人）均有权参加本次基金份额持有人大会。

四、投票方式

1、本次会议表决票见附件二。基金份额持有人可剪报、复印或登陆本基金管理人网站（www.swsmu.com）下载表决票。

2、基金份额持有人应当按照表决票的要求填写相关内容，其中：

（1）个人投资者自行投票的，需在表决票上签字，并提供本人开立持有本基金基金份额的申万菱信基金账户或深圳证券账户所使用的身份证件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）正反面复印件；

（2）机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章或经授权的业务公章（以下合称“公章”），并提供该机构的加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；

（3）合格境外机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章（如有）或由授权代表在表决票上签字（如无公章），并提供该授权代表的有效身份证件正反面复印件，该合格境外机构投资者所签署的授权委托书或者证明该授权代表有权代表该合格境外机构投资者签署表决票的其他证明文件，以及该合格境外机构投资者的加盖公章的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件、取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件；

（4）个人投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供基金份额持有人开立持有本基金基金份额的申万菱信基金账户或深圳证券账户所使用的身份证件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）正反面复印件，以及填妥的授权委托书原件（见附件三）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；

（5）机构投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供机构投资者的加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；

（6）合格境外机构投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供该合格境外机构投资者的加盖公章的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件、取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件，以及填妥的授权委托书原件（见附件三）；如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；

（7）以上各项中的公章、批文、开户证明及登记证书，以基金管理人的认可为准。

3、基金份额持有人或其代理人需将填妥的表决票和所需的相关文件于前述表决票收取时间内（以收到时间为准），通过专人送交或邮寄的方式，提交给本基金管理人。

本基金管理人的联系方式如下：

收件人：申万菱信基金管理有限公司 产品与创新业务部

收件地址：上海市中山南路 100 号 10 层 1004 室

联系人：赵兵

电话：021-23261188

邮政编码：200010

请在信封表面注明：“申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

五、计票

1、本次通讯会议的计票方式为：由本基金管理人授权的两名监督员在基金托管人（中国农业银行股份有限公司）授权代表的监督下在本次通讯会议表决截止日期后 2 个工作日内统计全部有效表决，并由公证机构对其计票过程予以公证并形成决议；

2、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在其对应的份额级别内拥有平等的投票权，即申万环保份额、申万环保 A 份额和申万环保 B 份额的基金份额持有人合法持有的每一基金份额在其对应的份额级别内享有平等的投票权。

3、表决票效力的认定如下：

（1）表决票填写完整清晰，所提供文件符合本公告规定，且在规定截止时间之前送达本基金管理人的，为有效表决票；有效表决票按表决意见计入相应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

（2）表决票上的表决意见未选、多选、模糊不清、相互矛盾或意见无法判断，但其他各项符合会议通知规定的视为弃权表决，弃权表决票计入对应的表决结果，其所代表的基金份额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。

（3）表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的，或未能提供有效证明持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的，或未能在截止时间之前送达基金管理人的，均为无效表决票；无效表决票不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

（4）基金份额持有人重复提交表决票的，如各表决票表决意见相同，则视为同一表决票。如各表决票表决意见不相同，则按如下原则处理：

ⅰ．送达时间不是同一天的，以最后送达的填写有效的表决票为准，先送达的表决票视为被撤回；

ⅱ．送达时间为同一天的，视为在同一表决票上做出了不同表决意见，计入弃权表决票；

ⅲ．送达时间按如下原则确定：专人送达的以实际递交时间为准，邮寄的以本基金管理人收到的时间为准。

六、决议生效条件

1、本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，有效的申万环保份额、申万环保 A 份额与申万环保 B 份额各自基金份额分别合计不少于在权益登记日对应级别基金总份额的 50%（含 50%）；

2、《关于申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金转型并修改基金合同有关事项的议案》应当经参加本次大会的申万环保份额、申万环保 A 份额、申万环保 B 份额各自基金份额持有人或其代理人所持该级基金份额表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方为有效；

3、本次基金份额持有人大会表决通过的事项，将由本基金管理人自通过之日起 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 日内在规定媒介上公告。法律法规另有规定的，从其规定。

七、本次大会相关机构

1、召集人：申万菱信基金管理有限公司

客服中心电话：400 880 8588（免长途话费）或 +86 21 962299

会务常设联系人：赵兵

联系电话：021-23261188

网址：www.swsmu.com

2、基金托管人：中国农业银行股份有限公司

3、律师事务所：上海市通力律师事务所

4、公证机构：上海市东方公证处

办公地址：上海市凤阳路 660 号

公证员：林奇

电话：021-62154848

邮政编码：200041

八、重要提示

1、如本次基金份额持有人大会未成功召开或议案未通过的，基金管理人将根据中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国证券监督管理委员会、国家外汇管理局联合发布的《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》的要求，于 2020 年底完成本基金的整改，取消分级运作机制，将申万环保 A 份额与申万环保 B 份额按照基金份额参考净值折算为申万环保份额。届时，基金管理人将相应变更基金名称、修改基金合同并就取消分级运作的安排进行公告。敬请投资者合理安排投资计划；

2、请持有人在提交表决票时，充分考虑邮寄在途时间，提前寄出表决票；

3、关于本次议案的说明见附件四《关于申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金转型并修改基金合同有关事项议案的说明》；

4、基金管理人将在发布本公告后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告，敬请基金份额持有人予以关注；

5、本基金申万环保 A 份额、申万环保 B 份额于基金持有人大会计票之日（2020 年 9 月 11 日）开市起开始停牌至基金持有人大会决议生效公告日 10:30 复牌。?敬请基金份额持有人关注本基金停牌期间的流动性风险；

6、本次基金份额持有人大会有关公告可通过本基金管理人网站查阅，投资者如有任何疑问，可致电本基金管理人咨询；

7、本公告的有关内容由申万菱信基金管理有限公司负责解释。

申万菱信基金管理有限公司
2020 年 8 月 12 日

附件一：《关于申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金转型并修改基金合同有关事项的议案》

附件二：《申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金基金份额持有人大会通讯表决票》

附件三：《申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金基金份额持有人大会授权委托书》

附件四：《关于申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金转型并修改基金合同有关事项议案的说明》

附件一：

关于申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金转型并修改基金合同有关事项的议案

申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金基金份额持有人：

根据市场环境变化，为更好地满足投资者需求，保护基金份额持有人的利益，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《申万菱信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”）有关规定，申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金管理人申万菱信基金管理有限公司经与基金托管人中国农业银行股份有限公司协商一致，决定召开本基金的基金份额持有人大会，提议对申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金按照《关于申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金转型并修改基金合同有关事项议案的说明》（见附件四）提出的方案实施转型。

为实施申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金转型方案，提议授权基金管理人办理本次基金转型的有关具体事宜，包括但不限于根据现时有效的法律法规的要求和《申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金基金合同》、《申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金托管协议》等法律文件和转型方案的有关内容对基金合同、托管协议、招募说明书进行必要的修改和补充，并在实施转型前披露修改后的基金法律文件；提议授权基金管理人在本基金转型实施前，制订转型方案并提前公告；提议授权基金管理人在本基金转型期间根据届时有效的相关规则暂停基金的申购、赎回等业务，终止上市并进行基金份额的转换以及其他有关本次基金转型的具体事宜。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定，基金管理人将在决议通过后，转型实施前预留不少于二十个开放日或交易日供基金份额持有人选择赎回、转出或卖出。

以上议案，请予审议。

基金管理人：申万菱信基金管理有限公司
2020 年 8 月 12 日

附件二：

申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金

基金份额持有人大会通讯表决票

基金份额持有人基本资料			
持有人姓名/名称			
持有人证件号码			
委托代理人姓名或名称			
委托代理人证件号码			
持有人基金账户号/证券账户号（本栏可不填写，若不填写，则本表决票所示表决意见将默认代表该基金份额持有人持有的全部份额的表决意见。）			
《关于申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金转型并修改基金合同有关事项的议案》的表决意见	同意	反对	弃权
个人基金份额持有人签字栏 签字： 日期：	机构基金份额持有人签章栏 单位公章： 日期：		

关于表决票的填写说明：

1、请就审议事项表示“同意”、“反对”或“弃权”并在相应表决栏内划“√”，同一议案只能表示一项意见。

2、若基金份额持有人或其代理人未作特别说明，则以上表决意见是持有人或其代理人就持有人持有的本基金全部份额做出的表决意见。

3、本表决票的“持有人基金账户号/证券账户号”一栏中，“基金账户号”指持有申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金场外份额的基金账户号，“证券账户号”指持有申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金场内份额的证券账户号。

同一基金份额持有人拥有多个此类账户号且需要按照不同账户持有基金份额分别行使表决权的，应当填写基金账户号/证券账户号，其他情况可不必填写。

持有人基金账户号/证券账户号空白、多填、错填、无法识别等情况，将被默认为代表此基金份额持有人所持有的申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金所有份额。

4、表决票上的表决意见未选、多选、模糊不清、相互矛盾或意见无法判断，但其他各项符合会议通知规定的视为弃权表决，弃权表决票计入对应的表决结果，其所代表的基金份额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。

5、表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的，或未能提供有效证明持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的，或未能在截止时间之前送达基金管理人的，均为无效表决票；无效表决票不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

6、本表决票可剪报、复印或按以上格式自制，在填写完整并签字盖章后均为有效。

附件三：

申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金

基金份额持有人大会授权委托书

兹委托[ ]先生(女士)或[ ]单位代表本人(本单位)参加投票截止日为 2020 年 9 月 10 日 17:00 止召开的申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金基金份额持有人大会，并代为全权行使对所有议案的表决权，表决意见以受托人/代理人的表决意见为准。授权有效期自签署日起至本次基金份额持有人大会会议结束之日止。本授权不得转授权。若申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金重新召开审议相同议案的持有人大会的，除本人(本单位)重新作出授权之外，本授权继续有效。

委托人(个人持有人签字/机构持有人盖章)：

委托人证件号码(个人持有人身份证号/机构持有人营业执照注册号)：

受托人/代理人(个人受托人签字/机构受托人盖章)：

受托人/代理人证件号码(个人受托人身份证号/机构受托人营业执照注册号)：

委托日期：2020 年 月 日

附注：

1、此授权委托书可剪报、复印或按以上格式自制，在填写完整并签字盖章后均为有效。

2、受托人/代理人的表决意见代表委托人在权益登记日所持全部基金份额的表决意见。

附件四：

关于申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金转型并修改基金合同有关事项议案的说明

一、重要提示

（一）申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）于 2014 年 5 月 30 日成立，申万环保 A 份额和申万环保 B 份额于 2014 年 6 月 16 日起在深圳证券交易所上市交易，申万菱信基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）为本基金的基金管理人。鉴于目前基金市场需求的变化，为维护基金份额持有人利益，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《申万菱信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》”）的有关规定，本基金管理人申万菱信基金管理有限公司经与基金托管人中国农业银行股份有限公司协商一致，决定以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议《关于申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金转型并修改基金合同有关事项的议案》。

（二）本次申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金转型事宜属原注册事项的实质性调整，经基金管理人向中国证监会申请，已经中国证监会准予变更注册。中国证监会对本次基金变更注册所作的任何决定或意见，均不表明其对本次基金合同转型方案或本基金的价值或投资者的收益做出实质性判断或保证。

（三）本次基金份额持有人大会需要由本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人或其代理人所代表的有效申万环保份额、申万环保 A 份额与申万环保 B 份额各自基金份额分别合计占权益登记日对应的各级别基金总份额的 50%以上（含 50%）方可召开；同时，本次转型方案需经参加本次大会的申万环保份额、申万环保 A 份额、申万环保 B 份额各自基金份额持有人或其代理人所持该级基金份额表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方为有效，存在无法获得基金份额持有人大会表决通过的可能；

（四）本次基金份额持有人大会表决通过的事项，本基金管理人自通过之日起 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 日内在规定媒介上公告。法律法规另有规定的，从其规定。

二、基金转型方案要点及基金合同修改内容要点

（一）变更基金名称

基金名称由“申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金”变更为“申万菱信中证环保产业指数型证券投资基金（LOF）”。

（二）不再设置基金份额的分级、折算与配对转换机制

“申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金”拟转型为“申万菱信中证环保产业指数型证券投资基金（LOF）”，转型后由分级基金变为股票型指数基金，运作方式变为上市型约型开放式（LOF），因此不再设置基金份额的分级、折算与配对转换机制。

（三）基金份额的终止上市

本基金份额持有人大会决议生效后，本基金管理人将按照深圳证券交易所业务规则申请申万环保 A 份额和申万环保 B 份额终止上市交易。

（四）变更后基金的基本情况

1、基金名称：申万菱信中证环保产业指数型证券投资基金（LOF）

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（LOF）

4、基金标的指数：中证环保产业指数及其未来可能发生的变更或基金管理人按照基金合同约定更换的其他指数。

5、基金存续期限：不定期

6、基金份额的类别

本基金根据申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取前端申购费的，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类；不收取前后端申购费，而从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类。A 类、C 类基金份额分别设置代码，分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。

（五）变更后基金的基金份额的上市交易

1、基金份额上市

申万菱信中证环保产业指数型证券投资基金（LOF）基金合同生效后，具备下列条件的，基金管理人可依据《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》，向深圳证券交易所申请本基金某类或多类基金份额上市：

（1）基金募集金额不低于 2 亿元；

（2）基金份额持有人不少于 1,000 人；

（3）《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》规定的其他条件。

基金上市前，基金管理人应与深圳证券交易所签订上市协议书。基金获准在深圳证券交易所上市的，基金管理人应按照相关规定发布基金上市交易公告书。

2、上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市

上市基金份额的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》等的相关规定执行。

当本基金发生深圳证券交易所相关规定所规定的因不再具备上市条件而应当终止上市的情形时，本基金变更为跟踪标的指数的非上市的开放式指数基金，基金名称变更为“申万菱信中证环保产业指数型证券投资基金”，而无需召开基金份额持有人大会审议。基金转型并终止上市后，对于本基金场内份额的处理规则由基金管理人提前制定并公告。

若届时本基金管理人已有以该指数作为标的指数的指数基金，则基金管理人将本着维护基金份额持有人合法权益的原则，履行适当的程序后与该指数基金合并或者选取其他合适的指数作为标的指数。

3、在不违反法律法规及不损害基金份额持有人利益的前提下，在履行适当程序后，本基金可以申请在包括境外交易所在内的其他证券交易所上市交易，而无需召开基金份额持有人大会审议。

（六）变更后基金的存续

申万菱信中证环保产业指数型证券投资基金（LOF）基金合同生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当在 10 个工作日内中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会。

（七）变更后基金的投资目标、投资范围、投资策略、投资限制、标的指数、业绩比较基准、风险收益特征

1、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平均跟踪误差不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%，实现对标的指数的有效跟踪。

2、投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。

为更好地实现基金的投资目标，本基金可能会少量投资于国内依法发行上市的非成份股（包括主板、中小板、创业板及其他依法发行、上市的股票）、债券（含国债、央行票据、金融债、次级债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、可转债及分离交易可转债、可交换债券、地方政府债等）、货币市场工具、债券回购、银行存款、同业存单、股指期货、国债期货、股票期权、资产支持证券以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）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金可以参与融资和转融通证券出借业务。

在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且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、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等；

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。

3、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

本基金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 * roman i 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 * roman ii 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 * roman iii 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）其他金融工具投资策略

本基金可以投资于债券和资产支持证券等固定收益类工具，固定收益类资产投资的目的是有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。

本基金为提高投资效率更好地达到本基金的投资目标，在风险可控的前提下，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，本着谨慎原则，参与股指期货和国债期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。本基金主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金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。此外，本基金还将运用股指期货来对冲特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理，如在基金出现巨额或较大申购赎回时，通过股指期货及时进行加仓或减仓，迅速的进行仓位调整，以达成申购赎回对基金运作带来的影响最小化的目的。

本基金将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，运用股票期权等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以提高投资效率，管理基金投资组合风险水平，以更好地实现本基金的投资目标。

本基金在参与融资业务时将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资业务。参与融资业务时，本基金将力争利用融资的杠杆作用，降低因申购造成基金仓位较低带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

为更好实现投资目标，在加强风险防范和坚持审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场情况、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性情况等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、期限和比例。

本基金管理人运用上述金融衍生工具必须是出于追求基金充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差的目的，不得应用于投机交易目的。

若相关法律法规发生变化时，基金管理人对上述金融衍生工具投资管理从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。未来如法律法规或监管机构允许基金投资其他金融衍生工具，本基金将在履行适当程序后，纳入投资范围并制定相应投资策略。

4、投资限制

（1）组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

1）本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；

2）每个交易日日终，在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，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）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%，进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

10）基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

11）本基金参与股指期货、国债期货交易后，依据下列标准建构组合：

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

②在任何交易日日终，持有的买入股指期货、国债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）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

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

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

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

⑥在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；

⑦在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%；

⑧本基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定；

⑨在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债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 30%；

12）本基金参与股票期权交易依据下列标准建构组合：

①因未平仓的股票期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的 10%；

②开仓卖出认购股票期权的，应持有足额标的证券；开仓卖出认沽期权的，应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物；

③未平仓的股票期权合约面值不得超过基金资产净值的 20%。其中，合约面值按照行权价乘以合约乘数计算；

13）若本基金参与融资的，在任何交易日日终，本基金融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；

14）本基金参与转融通证券出借交易的资产不得超过基金资产净值的 30%，出借期限在 10 个交易日以上的出借证券应纳入第 17）条所述的流动性受限资产的范围；参与出借业务的单只证券不得超过本基金持有该证券总量的 50%；证券出借的平均剩余期限不得超过 30 天，平均剩余期限按照市值加权平均计算；最近 6 个月内日均基金资产净值不得低于 2 亿元；

15）本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%，但完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的，不受前述限制；

16）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%，但完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的，不受前述限制；

17）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该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

18）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；

19）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）、7）、14）、17）、18）项外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。因证券市场波动、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不符合上述第 14）条规定的，基金管理人不得新增出借业务。法律法规另有规定的从其规定。

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

法律法规或监管部门取消或调整上述限制，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或按照调整后的规定执行，且该等事项无需召开基金份额持有人大会。

（2）禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

1）承销证券；

2）违反规定向他人贷款或者提供担保；

3）从事承担无限责任的投资；

4）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。

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

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

5、基金标的指数

本基金的标的指数为中证环保产业指数及其未来可能发生的变更或基金管理人按照基金合同约定更换的其他指数。

6、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为中证环保产业指数收益率 × 95%+ 银行活期存款利率（税后）× 5%。

如果指数编制单位更改以上指数名称、停止或变更以上指数的编制或发布，或以上指数由其他指数替代、或由于指数编制方法等重大变更导致以上指数不宜继续作为业绩比较基准，或市场上出现其他代表性更强、更加适用于本基金的业绩比较基准时，本基金管理人可以根据本基金的投资范围和投资策略，在取得基金托管人同意，按照监管部门要求履行适当程序后调整基金的业绩比较基准并及时公告，而无须召开基金份额持有人大会审议。

7、风险收益特征

本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

本基金为被动式投资的股票型指数基金，跟踪中证环保产业指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

（八）变更后的基金资产估值

1、证券交易所上市的非固定收益品种的估值

交易所上市的非固定收益品种（包括股票等），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、交易所市场交易的固定收益品种的估值

（1）对在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（另有规定的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

（2）对在交易所市场上市交易的可转换债券，按估值日收盘价减去可转换债券收盘价中所含债券应收利息（税后）后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或证券发行人未发生影响证券价格的重大事件，按最近交易日债券收盘价减去最近交易日债券收盘价中所含的债券应收利息（税后）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或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，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）交易所上市实行全价交易的债券（可转债除外），选取第三方估值机构提供的估值全价减去估值全价中所含的债券应收利息（税后）得到的净价进行估值；

（4）对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券，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。

3、银行间市场交易的固定收益品种，选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。

4、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