

申万菱信基金管理有限公司

申万菱信中小板指数证券投资基金（LOF）
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

公告日期：2017年5月23日

上市日期：2017年5月26日

目录

第一部分	重要声明与提示.....	3
第二部分	基金概览.....	4
第三部分	基金的历史、转型、日常申赎、上市交易和跨系统转托管.....	5
第四部分	持有人户数、持有人结构及前十名持有人.....	8
第五部分	基金主要当事人简介.....	10
第六部分	基金合同摘要.....	15
第七部分	基金财务状况.....	16
第八部分	基金投资组合.....	18
第九部分	重大事件揭示.....	22
第十部分	基金管理人承诺.....	23
第十一部分	基金托管人承诺.....	24
第十二部分	备查文件目录.....	25

第一部分 重要声明与提示

《申万菱信中小板指数证券投资基金（LOF）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）》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，申万菱信中小板指数证券投资基金（LOF）（以下简称“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保证本公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。中国证监会、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。

凡本公告未涉及的有关内容，请投资者详细查阅于 2016 年 12 月 22 日在《中国证券报》、《证券时报》刊登的本基金招募说明书（更新）。本基金的招募说明书（更新）同时发布在本公司网站（www.swsmu.com）。

第二部分 基金概览

一、基金名称：申万菱信中小板指数证券投资基金（LOF）

基金简称：申万菱信中小板指数（LOF）

场内简称：申万中小

基金代码：163111

二、基金类型：股票型

三、基金运作方式：上市契约型开放式

四、本基金的存续期限：不定期

五、基金份额总额：截至 2017 年 5 月 19 日，本基金的基金份额总额为 312,012,669.76 份。

六、基金份额净值：截至 2017 年 5 月 19 日，本基金的基金份额净值为 0.9863 元。

七、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所

八、上市交易日期：2017 年 5 月 26 日

九、基金管理人：申万菱信基金管理有限公司

十、基金托管人：中国农业银行股份有限公司

十一、本次上市交易的基金份额注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

第三部分 基金的历史、转型、日常申赎、上市交易和跨系统转托管

一、本基金的历史

申万菱信中小板指数证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）由申万菱信中小板指数分级证券投资基金分级运作期届满转换而成。申万菱信中小板指数分级证券投资基金经中国证监会 2012 年 2 月 16 日证监许可【2012】197 号文核准募集。

申万菱信中小板指数分级证券投资基金的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。基金管理人于 2012 年 5 月 8 日获得中国证监会书面确认，《申万菱信中小板指数分级证券投资基金基金合同》生效，募集规模为 784,503,291.30 份（含利息结转的份额）。

二、本基金的转型

根据《申万菱信中小板指数分级证券投资基金基金合同》的相关规定，申万菱信中小板指数分级证券投资基金分级运作期共包含五个运作周年。分级运作期结束，无需召开基金份额持有人大会，自动转换为上市开放式基金（LOF），基金名称变更为“申万菱信中小板指数证券投资基金（LOF）”。中小板A份额、中小板B份额按照各自的基金份额参考净值，以申万中小板份额的基金份额净值为基准，折算成场内申万中小板份额。本基金管理人于2017年3月23日在《中国证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所网站及本基金管理人网站上发布了《关于申万菱信中小板指数分级证券投资基金分级运作期到期与基金转换的公告》，于2017年5月3日在《中国证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所网站及本基金管理人网站上发布了《关于申万菱信中小板指数分级证券投资基金分级运作期到期后基金名称变更及到期折算基准日等事项的公告》、《关于申万菱信中小板指数分级证券投资基金分级运作期到期基金转换期间暂停申购、赎回、转换、定期定额投资及转托管业务的公告》和《关于申万菱信中小板指数分级证券投资基金之中小板A（150085）、中小板B（150086）终止上市的公告》。

本基金管理人对申万菱信中小板指数分级证券投资基金进行了五个运作周年分级运作期届满后的转换工作。份额转换结果如下表：

转换前的 基金份额	转换前份 额参考净 值（元）	转换前份额数 （份）	转换比例	转换后的基金 份额	转换后份额数 （份）
中小板 A	1.0500	111,945,818.00	1.079136691	申万菱信中小 板指数证券投 资基金（LOF）	120,804,839.00
中小板 B	0.8960	111,945,818.00	0.920863309	申万菱信中小 板指数证券投 资基金（LOF）	103,086,796.00

本基金管理人已根据《申万菱信中小板指数分级证券投资基金基金合同》约定，对中小板 A、中小板 B 的份额持有人的基金份额进行了计算，并由本基金管理人向中国证券登记结算有限责任公司提交份额变更登记申请。

本基金管理人于 2017 年 5 月 10 日在《中国证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所网站及本基金管理人网站发布了《关于申万菱信中小板指数分级证券投资基金分级运作期到期基金转换结果的公告》。

三、本基金的日常申购、赎回

本基金管理人于 2017 年 5 月 10 日开始办理本基金的日常申购、赎回业务。

四、本基金上市交易的主要内容

1、本基金上市交易的核准机构和核准文号：深证上【2017】325 号

2、上市交易日期：2017 年 5 月 26 日

3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所

投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。

4、基金场内简称：申万中小

5、基金交易代码：163111

6、本次上市交易份额：201,492,154.00 份(截至 2017 年 5 月 19 日)

7、未上市交易份额的流通规定：未上市交易的份额托管在场外，持有人将其转托管至深圳证券交易所场内后即可上市流通。

8、基金资产净值的披露：基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露本基金的基金份额净值和基金份额累计净

值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒体上。

五、本基金转托管的主要内容

基金份额持有人自 2017 年 5 月 10 日起可以开始办理本基金转托管业务，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。

第四部分 持有人户数、持有人结构及前十名持有人

一、持有人户数

截至 2017 年 5 月 19 日, 本基金份额持有人户数共计 13,758 户, 其中场内份额持有人户数为 12,050 户, 场内平均每户持有的基金份额为 16,721.34 份。

二、持有人结构

截至 2017 年 5 月 19 日, 本基金场内份额持有人结构如下:

场内机构投资者持有的基金份额为 90,173,469 份, 占场内基金总份额的 44.75%; 场内个人投资者持有的基金份额为 111,318,685 份, 占场内基金总份额的 55.25%。

三、截至 2017 年 5 月 19 日, 前十名场内基金份额持有人情况:

序号	持有人名称	持有份额	占场内基金总份额比例
1	中国对外经济贸易信托有限公司-光大稳健 1 号信托计划	33,395,348	16.57%
2	中国对外经济贸易信托有限公司-资产配置固定收益信托	14,449,243	7.17%
3	中国太平洋财产保险-传统-普通保险产品-013C-CT001 深	9,491,412	4.71%
4	申万菱信基金-工商银行-中国工商银行股份有限公司私人银行部	5,311,405	2.64%
5	宋伟铭	5,146,092	2.55%
6	太平洋资管-建设银行-太平洋第三极稳定增值混合型产品	5,009,536	2.49%

7	太平洋资管-建设银行-太平洋智选债基 FOF 型产品	3,997,882	1.98%
8	叶宁	3,761,797	1.87%
9	张美芳	2,533,092	1.26%
10	中国太保集团股份有限 公司-本级-集团自有资 金-012G-ZY001 深	2,355,176	1.17%
合计		85,450,983	42.41%

第五部分 基金主要当事人简介

一、基金管理人

1、公司概况

名称：申万菱信基金管理有限公司

法定代表人：刘郎

总经理：来肖贤

成立日期：2004年1月15日

注册资本：1.5亿元人民币

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

设立批准文号：中国证券监督管理委员会，证监基金字【2003】144号文

工商登记注册的法人营业执照注册号：100000400010467

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）。

存续期间：持续经营

2、股东及其出资比例：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。

3、内部组织结构及职能

公司设置了合理的组织结构，设有包括投研、专户、市场营销、合规风控和后台运作等共十七个部门。其中，投研部门主要负责研究、投资管理、投资交易等工作；专户部门主要负责专户客户的开发及维护，专户资产的投资运作等工作；市场营销部门主要负责基金产品销售、营销和市场推广等工作；风控合规部门主要负责投资的事前、事中、事后风险、绩效评估和法务、合规等工作；后台运作部门主要负责会计估值与核算、注册登记等日常运营业务，信息系统的管理和维护，财务会计、行政管理，董事会和人力资源管理等工作。

4、人员情况

截至2017年5月19日，我公司共有172名员工，其中博士6人、硕士109

人和本科 53 人，其他学历 4 人。

5、信息披露负责人：王菲萍

咨询电话：400 880 8588

6、基金管理业务情况

截止 2017 年 5 月 19 日，申万菱信基金管理有限公司旗下共管理 31 只开放式基金，分别为申万菱信盛利精选证券投资基金、申万菱信沪深 300 指数增强型证券投资基金、申万菱信新动力混合型证券投资基金、申万菱信收益宝货币市场基金、申万菱信新经济混合型证券投资基金、申万菱信竞争优势混合型证券投资基金、申万菱信添益宝债券型证券投资基金、申万菱信消费增长混合型证券投资基金、申万菱信沪深 300 价值指数证券投资基金、申万菱信深证成指分级证券投资基金、申万菱信稳益宝债券型证券投资基金、申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)、申万菱信可转换债券债券型证券投资基金、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、申万菱信中证军工指数分级证券投资基金、申万菱信多策略灵活配置混合型证券投资基金、申万菱信安鑫回报灵活配置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、申万菱信中证申万电子行业投资指数分级证券投资基金、申万菱信中证申万传媒行业投资指数分级证券投资基金、申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金、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)、申万菱信安鑫优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、申万菱信中证 500 指数优选增强型证券投资基金、申万菱信臻选 6 个月定期开放混合型证券投资基金、申万菱信智选一年期定期开放混合型证券投资基金和申万菱信量化成长混合型证券投资基金。

7、本基金基金经理

袁英杰先生，硕士研究生，曾任职于兴业证券、申银万国证券研究所等，2013 年 5 月加入申万菱信基金管理有限公司，曾任高级数量研究员，基金经理助理，现任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

保产业指数证券投资基金、申万菱信中证军工指数分级证券投资基金、申万菱信中证申万电子行业投资指数分级证券投资基金、申万菱信中证申万传媒行业投资指数分级证券投资基金、申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金、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)、申万菱信沪深300指数增强型证券投资基金、申万菱信中证500指数优选增强型证券投资基金、申万菱信臻选6个月定期开放混合型证券投资基金、申万菱信智选一年期定期开放混合型证券投资基金基金经理。

俞诚先生，经济学学士，FRM。2009年开始从事证券相关工作，2009年8月加入申万菱信基金管理有限公司，历任产品与金融工程总部金融工程师，数量研究员，现任申万菱信沪深300价值指数证券投资基金、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、申万菱信中证军工指数分级证券投资基金、申万菱信中证申万电子行业投资指数分级证券投资基金、申万菱信中证申万传媒行业投资指数分级证券投资基金、申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金、申万菱信中证500指数增强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：32,479,411.7万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

联系人：林葛

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，自2010年起中国农业银行连续通过托管业务国际内控标准（ISAE3402）认证，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”。2012年荣获第十届中国财经风云榜“最佳资产托管银行”称号；2013年至2015年连续三年荣获上海清算所授予的“托管银行优秀奖”和中央国债登记结算有限责任公司授予的“优秀托管机构奖”称号；2015年荣获中国银行业协会授予的“养老金业务最佳发展奖”称号。

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，2014年更名为托管业务部/养老金管理中心，内设综合管理处、证券投资基金托管处、委托资产托管处、境外资产托管处、保险资产托管处、风险管理处、技术保障处、营运中心、市场营销处、内控监管处、账户管理处，拥

有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工近 140 名，其中具有高级职称的专家 30 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。

3、基金托管业务经营情况

截止到 2016 年 12 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 349 只。

三、验资机构

会计师事务所：普华永道中天会计师事务所有限公司（现普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙））

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

经办注册会计师：薛竞、张鸿

第六部分 基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

第七部分 基金财务状况

深圳证券交易所所在本基金募集期间未收取任何费用，其他各基金销售机构根据本基金招募说明书设定的费率收取认购费。本基金募集结束后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

申万菱信中小板指数证券投资基金（LOF）2017年5月19日资产负债表（未经审计）如下：

资产	
资产：	
银行存款	20,578,570.95
存出保证金	91,144.25
交易性金融资产	291,657,658.02
其中：股票投资	291,657,658.02
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
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	31,585.12
应收股利	-
应收申购款	42,325.54
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产合计	312,401,283.88
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	-
应付赎回款	4,111,537.35
应付管理人报酬	137,480.49
应付托管费	28,275.92
应付销售服务费	-
应付交易费用	168,098.46
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	230,242.18
负债合计	4,675,634.40
所有者权益：	
实收基金	312,012,669.76
未分配收益	-4,287,020.28
所有者权益合计	307,725,649.48
负债和所有者权益合计	312,401,283.88

注：报告截止日 2017 年 5 月 19 日，基金份额净值 0.9863 元，基金份额总额 312,012,669.76 份。

第八部分 基金投资组合

截止到 2017 年 5 月 19 日，申万菱信中小板指数证券投资基金（LOF）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	291,657,658.02	93.36
	其中：股票	291,657,658.02	93.36
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	20,578,570.95	6.59
6	其他各项资产	165,054.91	0.05
7	合计	312,401,283.88	100.00

注：本基金未开通沪港通交易机制投资于港股。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	1,707,069.84	0.55
B	采矿业	-	-
C	制造业	203,057,950.00	65.99

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	10,067,078.86	3.27
F	批发和零售业	8,014,975.50	2.60
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	29,684,120.42	9.65
J	金融业	19,151,263.93	6.22
K	房地产业	3,840,695.00	1.25
L	租赁和商务服务业	8,739,617.60	2.84
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,549,490.72	0.83
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	4,845,396.15	1.57
S	综合	-	-
	合计	291,657,658.02	94.78

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金未开通沪港通交易机制投资于港股。

5.3 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	002415	海康威视	589,335	15,664,524.30	5.09
2	002450	康得新	476,782	9,511,800.90	3.09
3	002304	洋河股份	109,776	9,078,475.20	2.95
4	002024	苏宁云商	763,331	8,014,975.50	2.60
5	002241	歌尔股份	348,291	6,196,096.89	2.01
6	002142	宁波银行	351,930	6,088,389.00	1.98
7	002456	欧菲光	152,967	5,919,822.90	1.92
8	002466	天齐锂业	127,421	5,694,444.49	1.85

9	002230	科大讯飞	189,988	5,576,147.80	1.81
10	002008	大族激光	171,449	5,544,660.66	1.80

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 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

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

根据本基金基金合同，本基金不得参与股指期货交易。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金基金合同，本基金不得参与股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货交易。

5.10.2 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投资国债期货交易。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编辑日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	91,144.25
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	31,585.12
5	应收申购款	42,325.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	165,054.91

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

第九部分 重大事件揭示

本基金自转换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事件。

第十部分 基金管理人承诺

本基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺：

（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、深圳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。

第十一部分 基金托管人承诺

基金托管人就本基金上市交易后履行托管人职责做出如下承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，设立专门的基金托管部，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。

（二）根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，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、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。

（三）基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，并在限期内，随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。

（四）基金托管人发现基金管理人重大违规行为，将立即报告中国证监会，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。

第十二部分 备查文件目录

以下备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅：

- （一）中国证监会核准基金募集的文件
- （二）《申万菱信中小板指数分级证券投资基金基金合同》
- （三）《申万菱信中小板指数分级证券投资基金托管协议》
- （四）《申万菱信中小板指数分级证券投资基金招募说明书》
- （五）法律意见书
- （六）基金管理人业务资格批件、营业执照
- （七）基金托管人业务资格批件、营业执照

申万菱信基金管理有限公司

2017年5月23日

附件：基金合同摘要

一、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

1、基金管理人简况

名称：申万菱信基金管理有限公司

注册地址：上海市淮海中路 300 号香港新世界大厦 40 楼

办公地址：上海市淮海中路 300 号香港新世界大厦 40 楼

邮政编码：200021

法定代表人：姜国芳

成立时间：2004 年 1 月 15 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：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

2、基金管理人的权利和义务

（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) 依法募集基金；

2) 自《基金合同》生效之日起，依照有关法律法规和《基金合同》的规定独立运用并管理基金财产；

3) 依照《基金合同》获得基金管理人报酬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) 召集基金份额持有人大会

6) 根据《基金合同》及有关法律法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》及国家有关法律法规规定，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，拒绝或暂停受理申万中小板份额申购、赎回和转换申请；
- 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) 根据国家有关规定，在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金融资；
- 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、转换和非交易过户的业务规则；
- 17) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

(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) 依法募集基金，办理或者委托经由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财产分

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资产净值，申万中小板份额的基金份额净值、分级运作期内中小板 A 份额与中小板 B 份额的基金份额参考净值，分级运作期内中小板 A 份额与中小板 B 份额终止运作后的份额转换比例，分级运作期到期中小板 A 份额与中小板 B 份额的到期折算比例；

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、半年度和年度基金报告；

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，不得泄露基金投资计划、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，不得向他人泄露；

13) 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；

14) 按相关规定受理申万中小板份额的申购和赎回申请，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记录、账册、报表和其他相关资料 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，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》规定履行义务，基金托管人违反《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者实施其他法律行为；

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 日内退还认购基金认购人；

25) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

26) 建立并保存基金份额持有人名册；

27) 法律法规、《基金合同》规定的以及中国证监会要求的其他义务。

（二）基金托管人

1、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

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：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：国发【1979】056 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：《关于核准中国农业银行证券投资基金托管人资格的批复》，中国证监会证监基字【1998】23号

2、基金托管人的权利和义务

（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，提名新任基金管理人；

7) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

（2）基金托管人的义务

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，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；对所托管的不同基金财产分别设置账户，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，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应予保密，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和申万中小板份额的基金份额净值、分级运作期内中小板 A 份额与中小板 B 份额的基金份额参考净值，分级运作期内中小板 A 份额与中小板 B 份额终止运作后的份额转换比例，分级运作期到期中小板 A 份额与中小板 B 份额到期折算比例；
- 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、半年度和年度基金报告出具意见，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不少于 15 年；
- 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份额持有人依法自行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、破产或者由接管人接管其资产时，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照法律法规规定和《基金合同》履行其义务，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定；

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》取得的基金份额，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。

分级运作期内，本基金除中小板 A 份额与中小板 B 份额的基金份额参考净值计算、《基金合同》终止时的基金清算财产分配、中小板 A 份额与中小板 B 份额终止运作后的份额转换外，本基金每份基金份额具有同等的合法权益。分级运作期结束，本基金转换为上市开放式基金（LOF）后，本基金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》及其他有关法律法规的规定，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）在分级运作期内依法转让其持有的中小板 A 份额和中小板 B 份额或者申请赎回其持有的申万中小板份额；在分级运作期结束后依法转让其持有的申万中小板份额或者申请赎回其持有的申万中小板份额。

（4）按照规定要求召开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）法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关法律法规的规定，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、《基金合同》和招募说明书所规定的费用；

（5）在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决议；

（8）返还在基金交易过程中因各种原因获得的不当得利；

（9）法律法规、中国证监会规定的以及《基金合同》约定的其他义务。

（四）本基金合同当事人各方的权利义务以《基金合同》为依据，不因基金账户名称而有所改变。

二、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。

分级运作期内基金份额持有人大会的审议事项应分别由申万中小板份额、中小板 A 份额与中小板 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级别内拥有平等的投票权。

分级运作期结束，本基金无需召开基金份额持有人大会，自动转换为上市开放式基金（LOF）。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（但本基金在分级运作期结束后转换为上市开放式基金（LOF）除外）；
 - （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）分级运作期内单独或合计代表申万中小板份额、中小板 A 份额与中小板 B 份额各自基金份额 10% 以上（以上含本数，下同）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）或分级运作期结束后单独或合计代表申万中小板份额基金份额 10% 以上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；
 - （12）对《基金合同》当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；
 - （13）分级运作期内终止中小板 A 份额与中小板 B 份额的运作；
 - （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、出现以下情形之一的，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）在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整申万中小板基金份额的申购费率、调低申万中小板基金份额赎回费率；
 - （4）因相应的法律法规发生变动而应当对《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）按照法律法规或《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。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。

2、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，应当自行召集。

3、分级运作期内单独或合计代表申万中小板份额、中小板 A 份额与中小板 B 份额各自基金份额 10% 以上（以上含本数，下同）的基金份额持有人，或分级运作期结束后单独或合计代表申万中小板份额基金份额 10% 以上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，分级运作期内单独或合计代表申万中小板份额、中小板 A 份额与中小板 B 份额各自基金份额 10% 以上的基金份额持有人，或分级运作期结束后单独或合计代表申万中小板份额基金份额 10% 以上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。

4、分级运作期内单独或合计代表申万中小板份额、中小板 A 份额与中小板 B 份额各自基金份额 10% 以上的基金份额持有人，或分级运作期结束后单独或合计代表申万中小板份额基金份额 10% 以上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，而基金管理人、基金托管人都不召集的，分级运作

期内单独或合计代表申万中小板份额、中小板 A 份额与中小板 B 份额各自基金份额 10% 以上的基金份额持有人，或分级运作期结束后单独或合计代表申万中小板份额基金份额 10% 以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。

5、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，召集人必须于会议召开日前 30 日在指定媒体公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

- （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、采用通讯方式开会并进行表决的情况下，由召集人决定通讯方式和书面表决方式，并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、书面表达意见的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书面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书面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书面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书面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或通讯开会方式召开，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其代表出席，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拒不派代表列席的，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）分级运作期内，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，有效的申万中小板份额、中小板 A 份额与中小板 B 份额的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50% 以上（含 50%，下同）；分级运作期结束后，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，有效的申万中小板份额的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50% 以上（含 50%，下同）；

（2）亲自出席会议者持有基金份额持有人凭证、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》及会议通知的规定，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、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》规定公布会议通知后，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，基金管理人或

基金托管人经通知拒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基金份额持有人所持有的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50% 以上（含 50%）；

（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表，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和委托人的代理投票授权委托书等文件符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与登记注册机构记录相符；

会议通知公布前报中国证监会备案。

（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开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改，应当在基金份额持有人大会召开日前及时公告。

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，则由分级运作期内出席大会的申万中小板份额、中小板 A 份额与中小板 B 份额各自基金份额持有人（含代理人）以所代表的基金份额 50% 以上（含 50%）或分级运作期结束出席大会的申万中小板份额持有人（含代理人）以所代表的基金份额 50% 以上（含 50%）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）通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下，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构监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。

（六）表决

分级运作期内申万中小板份额、中小板 A 份额与中小板 B 份额的基金份额持有人所持每份基金份额在其对应份额级别内享有平等的表决权。分级运作期结束后，基金份额持有人持有的每份申万中小板份额享有平等的表决权。

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基金份额持有人及其代理人所持表决权的 50%（含 50%）以上通过方为有效，除下列 2 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

特别决议须经出席会议的基金份额持有人及代理人所持表决权的 2/3 以上（含 2/3）通过方为有效；转换基金运作方式（本基金分级运作期结束转换为上市开放式基金（LOF）除外）、更换基金管理人或者基金托管人、分级运作期内终止中小板 A 份额与中小板 B 份额的运作、终止《基金合同》必须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和代理人中选举三名基金份额持有人担任监票人。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，重新清点仅限一次。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、通讯方式开会

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。

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意见的计票进行监督的，不影响计票效力及表决结果。

（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 日内报中国证监会核准或者备案。

基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效，并在生效后方可执行。

基金份额持有人大会决议应自生效之日起 2 个工作日内在指定媒体上公告。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定。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。

三、基金收益分配原则、执行方式

（一）收益分配原则

1、本基金分级运作期内的收益分配原则

在本基金分级运作期内，本基金（包括申万中小板份额、中小板 A 份额、中小板 B 份额）不进行收益分配。

2、本基金分级运作期结束转换为上市开放式基金（LOF）的收益分配原则

（1）在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%；

（2）本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。

登记在场外的基金份额，投资者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；

登记在场内的基金份额，投资者只能选择现金分红这一收益分配方式，具体收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。

（3）基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

（4）每一基金份额享有同等分配权；

（5）法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

（二）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。

（三）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 个工作日内在指定媒体公告并报中国证监会备案。

基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日。

（四）基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所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。

四、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、基金的指数使用费；
- 4、基金上市费用；
- 5、《基金合同》生效后的信息披露费用；
- 6、基金份额持有人大会费用；

- 7、《基金合同》生效后与基金有关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 8、基金的证券交易费用；
- 9、基金的银行汇划费用；
- 10、证券账户开户费用和银行账户维护费；
- 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、分级运作期内基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年管理费率} / \text{当年天数}$ ，本基金年管理费率为 1.00%

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，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付指令，经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、休息日，支付日期顺延。

2、分级运作期内基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年托管费率} / \text{当年天数}$ ，本基金年托管费率为 0.22%

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，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付指令，经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托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

3、分级运作期到期后，本基金将转换为“申万菱信中小板指数证券投资基

金（LOF）”，基金管理费按前一日基金资产净值的 0.65% 的年费率计提，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.12% 的年费率计提。计算方法同上。上述变更可不经基金份额持有人大会决议，在报中国证监会备案后，提前在临时公告或更新的招募说明书中予以说明。

4、基金的指数使用费

本基金作为指数基金，需根据与深圳证券信息有限公司签署的指数使用许可协议的约定向深圳证券信息有限公司支付指数使用费。通常情况下，指数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：

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

H 为每日应计提的指数使用费

E 为前一日的基金资产净值

本基金《基金合同》生效之日所在季度的指数使用费，按实际计提金额收取，不设下限。自《基金合同》生效之日所在季度的下一季度起，指数使用费收取下限为每季度 5 万元，即不足 5 万元时按照 5 万元收取。

若季度指数使用费下限（人民币 5 万元）大于按基金资产净值提取的季度指数使用费（正常指数使用费），则超过部分（即：人民币 5 万元减去该季度正常指数使用费）由基金管理人自行承担，不得作为基金费用在基金财产中列支。

指数使用费每日计算，逐日累计，按季支付。基金管理人和深圳证券信息有限公司双方自每季结束之日起 10 个工作日内确定该季度指数许可费金额。基金管理人应在每个季度结束后且收到深圳证券信息有限公司的有效商业发票后的 10 个工作日内向深圳证券信息有限公司支付上一季度指数使用许可费。由基金管理人向基金托管人发送划付指令，经基金托管人复核后从基金财产中一次性支付给深圳证券信息有限公司。

5、上述“（一）基金费用的种类”中 4-11 项费用，根据有关法规及相应协议的规定，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。

五、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（包括中小板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具（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。

本基金投资于中小板指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产的90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产的5%。

（二）投资限制

1、组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

（1）本基金投资于中小板指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产的90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产的5%；

（2）本基金财产参与股票发行申购，所申报的金额不超过本基金的总资产，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；

（3）本基金应在《基金合同》生效之日起3个月内使基金的投资组合比例符合《基金合同》的有关约定；

（4）法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

由于证券市场波动、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原因导致的投资组合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。

基金管理人应在《基金合同》生效之日起 3 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，符合中国证监会的规定，并履行信息披露义务。

如法律、行政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，且该等事项无需召开基金份额持有人大会。

六、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）基金资产净值、基金份额净值公告

《基金合同》生效后，在中小板 A 份额、中小板 B 份额上市交易前或者开始办理申万中小板份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和申万中小板份额的基金份额净值、中小板 A 份额与中小板 B 份额的基金份额参考净值。

在中小板 A 份额、中小板 B 份额上市交易或者开始办理申万中小板份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的申万中小板份额的基金份额净值和基金份额累计净值、中小板 A 份额与中小板 B 份额各自的基金份额参考净值。

分级运作期内基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和申万中小板份额的基金份额净值、中小板 A 份额与中小板 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的次日，将基金资产净值、申万中小板份额的基金份额净值和基金份额累计净值、中小板 A 份额与中小板 B 份额各自的基金份额参考净值登载在指定媒体上。

分级运作期到期，本基金转换为上市开放式基金（LOF）后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露本基金的基金份额净值和基金份额累计净值。

分级运作期到期，本基金转换为上市开放式基金（LOF）后，基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒体上。

七、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经中国证监会核准生

效后方可执行，自决议生效之日起在指定媒体公告。

（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，而在 6 个月内没有新的基金管理人、新的基金托管人承接的；
- 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 个工作日内成立基金清算小组，基金管理人组织基金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：基金清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金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，由基金清算小组统一接管基金财产；
- （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

1、分级运作期内清算时的基金清算财产分配

在分级运作期内，如果本基金发生基金财产清算的情形，则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，按照申万中小板份额、中小板 A 份额与中小板 B 份额各自的基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

分级运作期内经基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会核准，在本基金的中小板 A 份额与中小板 B 份额终止运作后，如果本基金进行基金财产清算，则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，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

2、分级运作期到期本基金转换为上市开放式基金（LOF）后的基金清算财产分配

本基金分级运作期到期转换为上市开放式基金（LOF）后，如果发生基金财产清算的情形，则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，按基金份额持有人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

对于因《基金合同》产生或与《基金合同》有关的争议，《基金合同》当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，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。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。

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。

本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

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》是约定基金当事人之间、基金与基金当事人之间权利义务关系的法律文件。

1、《基金合同》经基金管理人和基金托管人加盖公章以及双方法定代表人或法定代表人授权的代理人签字，在基金募集结束，基金备案手续办理完毕，并获中国证监会书面确认后生效。

2、《基金合同》的有效期自其生效之日起至该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，除上报相关监管部门一式二份外，基金管理人和基金托管人各持有二份。每份均具有同等的法律效力。

5、《基金合同》可印制成册，供基金投资者在基金管理人、基金托管人、代销机构和登记机构办公场所查阅。《基金合同》条款及内容应以《基金合同》正本为准。