

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) 更新招募说明书
(2019 年度) 摘要

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

【重要提示】

- 本基金基金合同已于 2012 年 5 月 8 日生效。申万菱信中小板指数证券投资基金（LOF）由申万菱信中小板指数分级证券投资基金五个运作周年分级运作期届满转换而成。根据《基金合同》的相关规定，原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）。2017 年 5 月 8 日，申万菱信中小板指数分级证券投资基金分级运作期结束，申万菱信中小板指数分级证券投资基金之稳健收益类份额（简称“中小板 A 份额”）、申万菱信中小板指数分级证券投资基金之积极进取类份额（简称“中小板 B 份额”）按照《基金合同》约定折算成场内申万菱信中小板指数分级证券投资基金之申万中小板份额，基金名称变更为“申万菱信中小板指数证券投资基金（LOF）”，转换后，基金份额仅包括申万中小板份额。本基金已于 2017 年 5 月 9 日完成基金转换，并已于 2017 年 5 月 10 日公告基金份额转换结果。
- 投资有风险，投资人申购基金时应认真阅读招募说明书。
- 基金的过往业绩并不预示其未来的表现。
- 本摘要根据本基金之基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《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》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。
- 本次招募说明书（更新）所载内容中基金管理人、会计师事务所相关信息截止日为 2019 年 11 月 30 日，其他信息截止日为 2019 年 10 月 31 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2019 年 9 月 30 日（财务数据未经审计）。

目 录

一、基金管理人	2
二、基金托管人	5
三、相关服务机构	8
四、 基金的名称	38
五、 基金的类型	38
六、 投资目标	38
七、 投资范围	39
八、 投资策略	39
九、 业绩比较基准	40
十、 风险收益特征	41
十一、 基金投资组合报告	41
十二、 基金的业绩	45
十三、基金的费用与税收	49
十四、对招募说明书本次更新部分的说明	52

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：申万菱信基金管理有限公司

注册地址：上海中山南路 100 号 11 层

办公地址：上海中山南路 100 号 11 层

邮政编码：200010

法定代表人：刘郎

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

联系人：牛锐

股本结构：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

（二）主要人员情况

1、董事会成员

刘郎先生，董事长，硕士研究生，副教授。曾任湖南邵阳学院助教，东南大学系副主任、副教授。1994 年起从事金融相关工作，历任泰阳证券有限责任公司党委副书记、总裁、董事，万联证券有限责任公司总裁、董事，广州城市职业学院商学部主任，大通证券股份有限公司党委委员、副总经理，申银万国证券股份有限公司副总经理，申万宏源证券有限公司副总经理。现任申万菱信基金管理有限公司董事长、代理总经理，兼申万菱信（上海）资产管理有限公司董事长。

刘义伟先生，董事，硕士研究生，中级经济师。2003 年起从事金融相关工作，曾任职于中国工商银行总行资金运营部、金融市场部，申万宏源证券有限公司固定收益交易总部，现任申万宏源证券有限公司资产管理事业部总经理。

杨正平先生，董事，大学本科学历。1992 年起从事金融相关工作，曾任职于合肥市建设银行，申银万国证券股份有限公司，申万宏源证券有限公司安徽分公司，现任申万宏源证券有限公司零售客户事业部副总经理（主持工作）。

安田敬之先生，董事，日本籍，大学学历。1987 年 4 月至今任职于三菱 UFJ 信托银行株式会社（原三菱信托银行），曾任职于市场国际部、伦敦分行、海外资产管理事业部、受托财产企划部等，现任海外资产管理事业部常务执行役員。

斋藤正宪先生，董事，日本籍，硕士研究生。1991 年 4 月至今任职于三菱 UFJ 信托银行株式会社（原三菱信托银行），曾任职于丸之内分行、资金外汇部、伦敦分行、证券投资部、投资企划部、海外资产管理事业部、海外客户营业部等，现任海外资产管理事业部部长。

来肖贤先生，董事，硕士研究生。曾任申银万国证券股份有限公司国际业务总部投资分析师、部门副经理等。2004 年加入申万菱信基金管理有限公司，曾任监察稽核总部副总监、公司督察长、公司副总经理、公司总经理，现任申万菱信基金管理有限公司董事，兼任申万菱信（上海）资产管理有限公司董事。

白虹女士，独立董事，硕士研究生。曾任职于中国农业银行总行、韩国釜山分行、万事达卡国际组织、FEXCO 国际商务、跨界创新平台（COIN）、汉德产业促进资本，现任社会价值投资联盟（深圳）常务理事兼创始秘书长。

WEI/SHANGJIN（魏尚进）先生，独立董事，美国籍，博士研究生。曾任职于哈佛大学肯尼迪政府学院、世界银行、国际货币基金组织等，现任哥伦比亚大学商学院金融学与经济学终身讲席教授。

余卫明先生，独立董事，大学本科学历。曾任职于湖南省民政干部中等专业学校、中南工业大学，现任中南大学法学院教授。

2、监事会成员

刘震先生，监事会主席，博士研究生。1997年7月至今任职于申万宏源证券有限公司（原申银万国证券股份有限公司），曾任职于研发中心、计统部、办公室，现任申万菱信基金管理有限公司监事会主席、党总支副书记，兼任申万菱信（上海）资产管理有限公司执行监事。

增田义之先生，监事，日本籍，硕士研究生。1989年4月至今任职于三菱UFJ信托银行株式会社（原三菱信托银行），曾任职于资产运用部、股票运用部、指数战略运用部、受托财产企划部等，现任资产管理事业部部长。

牛锐女士，职工监事，博士研究生，曾任职于申银万国证券股份有限公司、中国证监会上海监管局、中金公司、国泰基金等公司。2013年加入申万菱信基金管理有限公司，曾任职于监察稽核部、综合办公室，现任监察稽核部总监。

葛菲斐女士，职工监事，大学本科学历，2006年加入申万菱信基金管理有限公司，曾任职于行政管理总部，主要从事行政管理、人力资源相关工作，曾任人力资源总部总监助理，现任人力资源部负责人。

3、高级管理人员

刘郎先生，相关介绍见董事会成员部分。

王伟先生，博士研究生。曾任职于申银万国证券股份有限公司。2003年加入申万巴黎基金管理有限公司筹备组，后正式加入申万菱信基金管理有限公司，历任市场部副总监、总监，首席市场官，现任公司副总经理。

张丽红女士，硕士研究生。曾任职于中国农业银行股份有限公司，申银证券股份有限公司，申银万国证券股份有限公司。2004年加入申万菱信基金管理有限公司，历任财务管理总部总监、首席财务官兼财务管理总部总监，现任公司副总经理。

王菲萍女士，硕士研究生。曾在申银万国证券股份有限公司总裁办任法律顾问等职务。2004年加入申万菱信基金管理有限公司，曾任监察稽核总部总监，现任公司督察长。

4、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，现任申万菱信

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、申万菱信深证成指分级证券投资基金、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、申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金基金经理。

俞诚先生，2015 年 12 月至 2019 年 9 月任本基金基金经理

袁英杰先生，2015 年 1 月至 2018 年 10 月任本基金基金经理。

张少华先生，2012 年 5 月至 2015 年 12 月任本基金基金经理。

5、投资决策委员会委员名单

本委员会由以下人员组成：总经理、公司分管投资的副总经理、权益研究部负责人、权益投资部负责人、量化投资部负责人、固定收益投资部负责人、指数与创新投资部负责人等。

公司总经理为本委员会主席，分管投资的副总经理为本委员会召集人，权益研究部负责人为本委员会秘书，负责协调统筹本委员会的各项事宜。

本公司董事长、督察长、监察稽核部负责人、风险管理部负责人作为非执行委员，有权列席本委员会的任何会议。非执行委员不参与投票表决。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

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

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 2017 年连续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、2016 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；2018 年荣获中国基金报授予的公募基金 20 年“最佳基金托管银行”奖；2019 年荣获证券时报授予的“2019 年度资产托管银行天玑奖”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，目前内设综合管理部、业务管理部、客户一部、客户二部、客户三部、客户四部、风险合规部、产品研发与信息技术部、营运一部、营运二部、市场营销部、内控监管部、账户管理部，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 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 2019 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 486 只。

三、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：上海中山南路 100 号 11 层

法定代表人：刘郎

电话：+86-21-23261188

传真：+86-21-23261199

联系人：陈晓琳

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：中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：陈四清

客户服务电话：95588

传真：010-66107738

网址：www.icbc.com.cn

（2）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：周慕冰

客户服务电话：95599

网址：www.abchina.com

(3) 名称：中国建设银行股份有限公司

法定代表人：王洪章

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

联系人：王琳

客户服务电话：95533

传真：010-66275654

网址：www.ccb.com

(4) 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

联系人：曹榕

电话：021-58781234

客户服务电话：95559

网址：www.bankcomm.com

(5) 名称：上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 500 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：吉晓辉

传真：021-63604199

联系人：倪苏云、于慧

客户服务热线：95528

公司网站：www.spdb.com.cn

(6) 名称：中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：洪崎

客服电话：95568

联系人：王志刚

传真：010-58560666

网址：www.cmbc.com.cn

(7) 名称：平安银行股份有限公司

注册办公所：广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号

法定代表人：孙建一

联系人：张莉

传真：021-50979507

客户服务电话：95511-3

网址：bank.pingan.com

(8) 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：冀光恒

客服电话：021-96 2999/4006 962 999

联系人：李晨

传真：021-50105124

网址：www.srcb.com

(9) 名称：南京银行股份有限公司

注册地址：南京市白下区淮海路 50 号

办公地址：南京市白下区淮海路 50 号

法定代表人：林复

传真：025-84544129

联系人：翁俊

客户服务电话：4008896400

网址：www.njcb.com.cn

(10)名称：国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国(上海)自由贸易试验区商城路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：杨德红

电话：021-38676666

传真：021-38670666

客户服务热线：95521

公司网站：www.gtja.com

(11)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：北京市朝阳区门内大街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

(12)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1010号国际信托大厦21楼

法定代表人：何如

联系人：周杨

传真：0755-82133952

客户服务电话：95536

网址：www.guosen.com.cn

(13) 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

(14) 名称：广发证券股份有限公司

注册地址：广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼 (4301-4316 房)

办公地址：广东省广州天河区天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、39、41、42、43、44 楼

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

统一客户服务热线：95575 或致电各地营业网点

公司网站：广发证券网 www.gf.com.cn

(15) 名称：中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场 (二期) 北座

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：王东明

电话：010-60838888

传真：010-60833739

联系人：顾凌

网址：www.cs.ecitic.com

(16) 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：010-66568292

联系人：邓颜

公司网址：www.chinastock.com.cn

(17) 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

(18) 名称：申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：李梅

联系人：黄莹

电话：021-33389888

传真：021-33388224

客服电话：95523 或 4008895523

电话委托：021-962505

公司网址：www.swhysc.com

(19) 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：崔少华

联系人：奚博宇

传真：027-85481900

客户服务电话：95579 或 4008-888-999

网址：www.95579.com

(20) 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：王连志

传真：0755-82558355

联系人：陈剑虹

统一客服电话：4008001001

公司网站地址：www.essence.com.cn

(21) 名称：国元证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市寿春路 179 号

法定代表人：凤良志

传真：0551-2207965

联系人：李蔡

客户服务电话：400-8888-777，95578

网址：www.gyzq.com.cn

(22) 名称：华泰证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路 228 号

办公地址：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场、深圳市福田区深南大道 4011 号港中旅大厦 18 楼

法定代表人：周易

联系人：庞晓芸

电话：0755-82492193

传真：0755-82492962

客服电话：95597

网址：www.htsc.com.cn

(23)名称：中信证券(山东)有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 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 20 层

法定代表人：杨宝林

客户服务电话：95548

网址：www.zxwt.com.cn

(24)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：范力

联系人：方晓丹

电话：0512-65581136

传真：0512-65588021

客服电话：95330

公司网址：www.dwzq.com.cn

(25)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：95321

公司网址：www.cindasc.com

(26) 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

办公地址：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

电话：021-22169999

传真：021-22169134

客户服务电话：95525

公司网址：www.ebscn.com

(27) 名称：广州证券股份有限公司

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：邱三发

联系人：梁微

联系电话：020-88836999

传真：020-88836654

客户服务电话：95396

网址：www.gzs.com.cn

(28) 名称：上海证券有限责任公司

住所：上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼

法定代表人：李俊杰

联系电话：021-53686888

客户服务电话：021-962518

传真：021-53686100-7008，021-53686200-7008

网址：www.962518.com

(29) 名称：国联证券股份有限公司

注册地址：江苏省无锡市金融一街 8 号 7-9 层

法定代表人：姚志勇

联系人：沈刚

传真：0510-82830162

客户服务电话：95570

网址：www.glsc.com.cn

(30) 名称：浙商证券股份有限公司

注册地址：浙江省杭州市西湖区杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 座

办公地址：浙江省杭州市西湖区杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 座 6、7 楼

邮政编码：310007

法定代表人：吴承根

传真：021-80106010

客服电话：95345

网址：www.stocke.com.cn

(31) 名称：平安证券股份有限公司

住所：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

办公地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

法定代表人：詹露阳

客户服务电话：95511-8

传真：0755-82435367

网址：<http://stock.pingan.com>

(32) 名称：东莞证券股份有限公司

住所：广东省东莞市莞城区可园南路一号金源中心 30 楼

办公地址：广东省东莞市莞城区可园南路一号金源中心 22 楼

法定代表人：张运勇

客户服务电话：95328

传真：0769-22115712

网址：<http://www.dgzq.com.cn>

(33) 名称：华西证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦

办公地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦

法定代表人：杨炯洋

联系人：周志茹

客户服务电话：95584 或 400 888 8818

传真：028-86150040

网址：<http://www.hx168.com.cn>

(34) 名称：申万宏源西部证券有限公司

住所：新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

法定代表人：韩志谦

联系人：王怀春

客户服务电话：4008-000-562

传真：010-88085195

网址：www.hysec.com

(35) 名称：中泰证券股份有限公司

注册地址：山东省济南市市中区经七路 86 号

办公地址：山东省济南市市中区经七路 86 号

法定代表人：李玮

联系人：吴阳

电话：0531-68889155

传真：0531-68889185

客服电话：95538

网址：www.zts.com.cn

(36)名称：第一创业证券股份有限公司

住所：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 15-20 楼

办公地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 15-20 楼

法定代表人：刘学民

客户服务电话：95358

传真：0755-23838999

网址：www.fcsc.com.cn

(37)名称：中航证券有限公司

注册地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

法定代表人：王宜四

联系人：史江蕊

客服电话：400-8866-567

网址：www.avicsec.com

(38)名称：西部证券股份有限公司

注册地址：西安市东大街 232 号陕西信托大厦 16-17 层

法定代表人：刘建武

联系人：梁承华

传真：029-87406710

客户服务电话：95582

网站：www.westsecu.com

(39) 名称：中国国际金融股份有限公司

住所：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

法定代表人：丁学东

客户服务电话：4009101166

传真：010-85679203

网址：www.cicc.com.cn

(40) 名称：中山证券有限责任公司

注册地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼7层、8层

办公地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼7层、8层

法定代表人：林炳城

联系人：刘军

电话：0755-83734659

传真：0755-82960582

客户服务电话：4001-022-011

网址：www.zszq.com

(41) 名称：红塔证券股份有限公司

注册地址：昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼

办公地址：昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼

法定代表人：况雨林

联系人：高国泽

客户服务电话：0871-3577930

网址：www.hongtazq.com

(42) 名称：联讯证券股份有限公司

住所：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼

办公地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四

楼

法定代表人：徐刚

客户服务电话：95564

传真：010—2119660

网址：www.lxsec.com

(43)名称：国金证券股份有限公司

办公地址：四川省成都市东城根上街 95 号

客服电话：95310

公司网址：www.gjq.com.cn

联系人：刘婧漪、贾鹏

联系电话：028-86690057、028-86690058

传真号码：028-86690126

(44)名称：华宝证券有限责任公司

注册地址：中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 100 号 57 层

办公地址：中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 100 号 57 层

代表法人：陈林

联系人：刘闻川

传真：021-20515593

客服电话：400-820-9898

公司网址：www.cnhbstock.com

(45)名称：华融证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 8 号

办公地址：北京市朝阳区朝阳门北大街 18 号中国人保寿险大厦 12 层

法定代表人：祝献忠

联系人：李慧灵

联系电话：010-85556100

传真：010-58568062

客户服务电话：400-898-9999

网址：www.hrsec.com.cn

(46)名称：天风证券股份有限公司

天风证券股份有限公司

注册地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦4楼

办公地址：湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼

法定代表人：余磊

联系人：杨晨

电话：027-87107535

传真：027-87618863

客服热线：4008005000

(47)名称：太平洋证券股份有限公司

住所：云南省昆明市青年路389号志远大厦18层

办公地址：北京市西城区北展北街9号华远企业号D座3单元

法定代表人：李长伟

客户服务电话：400-665-0999

传真：010-88321819

网址：www.tpyzq.com

(48)名称：开源证券股份有限公司

住所：西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层

办公地址：西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层

法定代表人：李刚

客户服务电话：400-860-8866

传真：029-81887060

网址：www.kysec.cn

(49) 名称：中信期货有限公司

注册地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座 13 层
1301-1305 室、14 层

办公地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座 13 层
1301-1305 室、14 层

法定代表人：张皓

传真：010-57762999

联系人：韩钰

客户服务热线：400-990-8826

公司网站：www.citicsf.com

(50) 名称：中国中金财富证券有限公司

住所：深圳市福田区益田路 6003 荣超商务中心 A 座 18-21 层

办公地址：深圳市福田区益田路 6003 荣超商务中心 A 座 18-21 层

法定代表人：高涛

客服电话：95532/4006008008

网址：www.china-invs.cn

(51) 名称：万和证券股份有限公司

注册地址：海口市南沙路 49 号通信广场二楼

办公地址：深圳市福田区深南大道 7028 号时代科技大厦 20 层西厅

法定代表人：冯周让

客服电话：4008-882-882

(50) 名称：深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

办公地址：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 16 层

法定代表人：杨懿

联系人：张燕

客服电话：400-166-1188

网址：8.jrj.com.cn

(51)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

传真：021-20835879

客服电话：400-920-0022/ 021-20835588

网址：licaike.hexun.com

(52)名称：诺亚正行基金销售有限公司

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

(53)名称：深圳众禄基金销售股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

办公地址：深圳市罗湖区梨园路 8 号 HALO 广场 4 楼

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

(54)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：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座

法定代表人：其实

联系人：潘世友

电话：021-54660526

传真：021-54660501

客户服务电话：400-1818-188

网址：www.1234567.com.cn

(55)名称：上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

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

(56)名称：蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

住所：杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 栋 202 室

办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6F

法定代表人：陈柏青

联系人：韩爱彬

客服电话：4000-766-123

公司网址：www.fund123.cn

(57)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：单丙焯

传真：021-20691861

客服电话：400-089-1289

公司网站：www.erichfund.com

(58) 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：0571-88910240

客户服务电话：4008-773-772，0571-88920897

网站：www.5ifund.com

(59) 名称：北京展恒基金销售股份有限公司

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街6号

办公地址：北京市朝阳区安苑路15-1号邮电新闻大厦2层

法定代表人：闫振杰

联系人：马林

电话：010-59601366-7024

传真：010-62020355

客服电话：4008188000

网址：www.myfund.com

(60) 名称：上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路5475号1033室

办公地址：上海市虹口区东大名路1098号浦江金融世纪广场18F

法定代表人：李兴春

联系人：赵沛然

电话：86-021-50583533

传真：86-021-50583633

客户服务电话：400-921-7755

(61) 名称：宜信普泽（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809

办公地址：北京市朝阳区建国路 88 号 SOHO 现代城 C 座 1809

法定代表人：沈伟桦

联系人：程刚

客户服务电话：400-6099-200

网址：www.yixinfund.com

(62) 名称：浦领基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼 A 座 9 层 908 室

办公地址：北京市朝阳区望京浦项中心 A 座 9 层 04-08

法定代表人：聂婉君

联系人：李艳

联系电话：010-59497361

传真：010-64788016

客服电话：400-012-5899 网址：www.zscffund.com

(63) 名称：北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 39 号第一上海中心 C 座 6 层

法定代表人：梁越

联系人：马鹏程

电话：86-010-58845304

传真：86-021-58845306

客户服务电话：4008-980-618

网址：www.chtfund.com

(64) 名称：一路财富（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区阜成门外大街 2 号 1 幢 A2208 室

办公地址：北京市海淀区宝盛里宝盛南路 1 号院奥北科技园国泰大厦 9 层

法定代表人：吴雪秀

联系人：段京璐

电话：010-88312877

传真：010-88312099

客户服务电话：400-001-1566

网址：<http://www.yilucaifu.com/>

(65)名称：北京钱景基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012

办公地址：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012

法定代表人：赵荣春

联系人：高静

电话：010-59158281

传真：010-57569671

客户服务电话：400-893-6885

网址：www.qianjing.com

(66)名称：上海联泰基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 号楼 3 层

法定代表人：燕斌

联系人：陈东

电话：021-52822063

传真：021-52975270

客服电话：4000-466-788

网址：<http://www.66zichan.com>

(67)名称：上海汇付基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区中山南路 100 号 19 层

办公地址：上海市宜山路 700 号普天信息产业园 2 期 C5 栋汇付天下总部大楼 2 楼

法定代表人：金佶

联系人：陈云卉

电话：021-33323999

传真：8621-33323837

客户服务电话：400 820 2819

手机客户端：天天盈基金

网址：www.chinapnr.com

(68)名称：深圳富济基金销售有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道金田路中洲大厦 35 层 01B、02/03/04 单位

办公地址：深圳市福田区福田街道金田路中洲大厦 35 层 01B、02/03/04 单位

法定代表人：刘鹏宇

联系人：刘勇

联系电话：0755-83999907-8814

客户服务电话：0755-83999907

传真：0755-83999926

网址：www.fujifund.cn

(69)名称：上海陆金所基金销售有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

法定代表人：郭坚

客户服务电话：400-821-9031

传真：021-22066653

网址：www.lufunds.com

(70) 名称：大泰金石基金销售有限公司

住所：南京市建邺区江东中路 222 号南京奥体中心现代五项馆 2105 室

办公地址：上海市浦东新区峨山路 505 号东方纯一大厦 15 楼

法定代表人：袁顾明

客户服务电话：4009282266

传真：021-20324199

网址：www.dtfunds.com

(71) 名称：珠海盈米基金销售有限公司

住所：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼
B1201-1203

法定代表人：肖雯

客户服务电话：020-89629066

传真：020-89629011

网址：www.yingmi.cn

(72) 名称：北京肯特瑞基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村东路 66 号 1 号楼 22 层 2603-06

办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街 18 号院京东集团总部 A 座 17
层

法定代表人：陈超

联系人：赵德赛

电话：18600280556

传真：010-89188000

客户服务电话：4000988511

网址：<http://fund.jd.com/>

(73) 名称：中民财富基金销售（上海）有限公司

注册地址：上海市黄浦区中山南路 100 号 07 层

办公地址：上海市黄浦区中山南路 100 号 17 层

法定代表人：弭洪军

客户服务电话：400-876-5716

传真：021-63353736

网址：www.cmiwm.com

(74) 名称：北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108

办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108

法定代表人：王伟刚

联系人：李瑞真

电话：010-56282140

传真：010-62680827

客户服务电话：400-619-9059

网址：www.hcjjjin.com

(75) 名称：北京蛋卷基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

办公地址：北京市朝阳区阜通东大街望京 SOHO T3 A 座 19 层

法定代表人：钟斐斐

联系人：袁永姣

电话：010-61840688

传真：010-61840699

客户服务电话：4000-618-518

网址：www.danjuanapp.com

（76）名称：上海大智慧基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102 单元

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102、1103 单元

法定代表人：申健

联系人：印强明

电话：021-20219988

传真：021-20219923

客户服务电话：021-20292031

网址：www.wg.com.cn

（77）名称：南京苏宁基金销售有限公司

注册地址：南京市玄武区苏宁大道 1 号

办公地址：南京市玄武区苏宁大道 1 号

法定代表人：刘汉青

联系人：王锋

电话：025-66996699-887226

客户服务电话：95177

网址：www.snjijin.com

（78）名称：上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和经济发展区）

办公地址：上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室

法定代表人：王翔

联系人：吴鸿飞

电话：021-65370077

传真：021-55085991

客户服务电话：4008-205-369

网址：www.jiyufund.com.cn

（79）名称：上海挖财基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03 室

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03 室

法定代表人：冷飞

联系人：李娟

电话：021-50810687

传真：021-58300279

客户服务电话：021-50810673

网址：www.wacaijijin.com

App：挖财宝

（80）名称：泰诚财富基金销售（大连）有限公司

注册地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园 3 号

办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园 3 号

法定代表人：林卓

联系人：张晓辉

电话：0411-88891212

传真：0411-84396536

客户服务电话：40-0411-001

网址：www.haojiyoujijin.com

（81）名称：济安财富（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼 3 层 307

办公地址：北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼 3 层 307

法定代表人：杨健

联系人：李海燕

电话：010-65309516

客户服务电话：400-673-7010

网址：www.jianfortune.com

（82）名称：北京植信基金销售有限公司

注册地址：北京市密云县兴盛南路8号院2号楼106室-67

办公地址：北京市朝阳区惠河南路盛世龙源10号

法定代表人：于龙

客户服务电话：4006-802-123

网址：www.zhixin-inv.com

（83）名称：大连网金基金销售有限公司

注册地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦2层202室

办公地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦2层202室

法定代表人：樊怀东

客户服务电话：4000-899-100

网址：<http://www.yibaijin.com/>

（84）名称：北京虹点基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元

办公地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元

法定代表人：郑毓栋

客户服务电话：4006180707

网址：www.hongdianfund.com

（85）名称：上海有鱼基金销售有限公司

注册地址：上海自由贸易试验区浦东大道2123号3层3E-2655室

办公地址：上海市徐汇区桂平路 391 号 B 座 19 层

法定代表人：林琼

电话：021-60907379

传真：021-60907397

联系人：徐海峥

客服电话：021-60907378

网址：www.youyufund.com

(93) 腾安基金销售（深圳）有限公司

注册地址：深圳市海深港合作区前海一路 1 号 A 栋 201 室

办公地址：深圳市南山区海天二路 33 号腾讯滨海大厦 15 楼

法定代表人：刘明军

联系人：季雪纯

客服电话：95017(拨通后转 1 再转 8)

网站：：www.tenganxinxi.com 或 www.txfund.com

(86) 名称：玄元保险代理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区张杨路 707 号 1105 室

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区张杨路 707 号 1105 室

法定代表人：马永谔

联系人：卢亚博

电话：021-50701053

传真：021-50701053

客户服务电话：021-50701053

网址：http://www.xyinsure.com/kfit_xybx

(87) 名称：江苏汇林保大基金销售有限公司

[注册地址：南京市高淳区经济开发区古檀大道 47 号](#)

[办公地址：江苏省南京市鼓楼区中山北路 105 号中环国际 1413 室](#)

法定代表人：吴言林

客户服务电话：025-66046166

网址：<http://www.huilinbd.com>

（88）名称：奕丰基金销售有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入住深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室

法定代表人：TEO WEE HOWE

联系人：叶健

客户服务电话：400-684-0500

网址：www.ifastps.com.cn

（89）名称：西藏东方财富证券股份有限公司

注册地址：西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城10栋楼

办公地址：上海市徐汇区宛平南路88号金座东方财富大厦

法定代表人：陈宏

传真：021-23586860

客户服务电话：95357

网址：<http://www.18.cn>

（90）名称：上海华夏财富投资管理有限公司

注册地址：上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室

办公地址：北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层

法定代表人：毛淮平

联系人：张静怡

电话：010-88066326

传真：010-63136184

客户服务电话：400-817-5666

网址：www.amcfortune.com/

（91）名称：北京百度百盈基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区上地十街10号1幢1层101

办公地址：北京市海淀区上地信息路甲9号奎科科技大厦

法定代表人：张旭阳

电话：010-61952703

传真：010-61951007

客户服务电话：95055-4

网址：www.baiyingfund.com/

2、场内发售机构

（1）本基金的场内发售机构为具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位（具体名单可在深交所网站查询）。

（2）本基金募集结束前获得基金代销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。

（二）基金注册登记机构

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：010-66210988，010-59378888

传真：010-66210938

联系人：任瑞新

（三）律师事务所和经办律师

律师事务所：通力律师事务所

注册地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：俞卫锋

电话：+86-21-31358666

传真：+86-21-31358600

联系人：陈颖华

经办律师：黎明、陈颖华

（四）会计师事务所和经办注册会计师

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

四、 基金的名称

本基金名称：申万菱信中小板指数证券投资基金（LOF）

五、 基金的类型

本基金的类型： 契约型开放式

六、 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%，实现对中小板指数的有效跟踪。

七、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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

八、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、资产配置策略

本基金原则上投资于中小板指数成份股和备选成份股将不低于 90% 的基金资产，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%。本基金将根据市场的实际情况，适当调整基金资产的配置比例，以保证对标的指数的有效跟踪。

本基金将在《基金合同》生效之日起 3 个月的时间内达到上述规定的投资比例。

2、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。

3、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。

九、业绩比较基准

本基金以中小板指数为标的指数。

业绩比较基准为： $95\% \times$ 中小板指数收益率 $+5\% \times$ 银行同业存款利率。

中小板指数，全称为中小企业板价格指数，指数代码为 399005，是中国多层次证券市场的重要指数，该指数于 2006 年 1 月 24 日正式发布，兼具价值尺度与投资标的的功能。

如果中小板指数被停止发布或由其他指数替代或由于指数编制方法等重大变更导致该指数不宜继续作为目标指数，基金管理人可以依据维护投资者的合法权益的原则，在经基金托管人同意并履行适当程序后变更基金的标的指数和业绩比较基准。

十、 风险收益特征

在分级运作期内，本基金虽为股票型指数基金，但由于采取了基金份额分级的结构设计，不同的基金份额具有不同的风险收益特征。申万中小板份额为常规指数基金份额，具有预期风险较高、预期收益较高的特征，其预期风险和预期收益水平均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金；中小板 A 份额，则具有预期风险低，预期收益低的特征；中小板 B 份额由于利用杠杆投资，则具有预期风险高、预期收益高的特征。

分级运作期结束，本基金转换为上市开放式基金（LOF），具有预期风险较高、预期收益较高的特征，其预期风险和预期收益水平均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

根据 2017 年 7 月 1 日施行的《证券期货投资者适当性管理办法》，基金管理人和销售机构已对本基金重新进行风险测评，风险评级行为不改变本基金的实质性风险收益特征，但由于风险等级分类标准的变化，本基金的风险等级表述可能有相应变化，具体风险评级结果应以基金管理人和销售机构提供的评级结果为准。

十一、 基金投资组合报告

本投资组合报告所载数据截止日为 2019 年 9 月 30 日，本报告中所列财务数据未经审计。

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	145,502,253.45	92.19
	其中：股票	145,502,253.45	92.19
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	11,986,348.01	7.59
7	其他各项资产	342,679.84	0.22
8	合计	157,831,281.30	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

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	4,650,720.00	2.96
B	采矿业	-	-
C	制造业	88,812,504.69	56.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,146,373.00	0.73
E	建筑业	1,970,225.20	1.25
F	批发和零售业	3,972,464.76	2.53

G	交通运输、仓储和邮政业	3,610,793.60	2.30
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,431,277.00	11.09
J	金融业	12,494,150.46	7.95
K	房地产业	1,152,311.04	0.73
L	租赁和商务服务业	5,819,515.55	3.70
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	943,660.00	0.60
Q	卫生和社会工作	2,471,155.20	1.57
R	文化、体育和娱乐业	1,027,102.95	0.65
S	综合	-	-
	合计	145,502,253.45	92.55

2.2 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	002415	海康威视	282,351.00	9,119,937.30	5.80
2	002475	立讯精密	254,762.00	6,817,431.12	4.34
3	002142	宁波银行	202,799.00	5,112,562.79	3.25
4	002027	分众传媒	889,373.00	4,669,208.25	2.97
5	002304	洋河股份	44,701.00	4,648,904.00	2.96
6	002230	科大讯飞	126,640.00	4,034,750.40	2.57
7	002714	牧原股份	53,900.00	3,799,950.00	2.42
8	002594	比亚迪	66,580.00	3,247,772.40	2.07

9	002024	苏宁易购	276,616.00	2,865,741.76	1.82
10	002241	歌尔股份	154,962.00	2,724,231.96	1.73

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 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

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。

8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 本基金投资国债期货的投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货交易。

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。

10.3 本基金投资国债期货的投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货交易。

11 投资组合报告附注

11.1 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。本基金投资的前十大证券的发行主体除宁波银行（002142）外，在报告编制日前一年内，没有收到公开谴责和处罚的情形。

本报告编制日前一年内，宁波银行股份有限公司由于销售行为不合规、双录管理

不到位等多个违法违规事实而收到中国银行保险监督管理委员会及其派出机构的行政处罚，处以罚款。

本基金采用完全复制方式被动跟踪标的指数，上述证券为本基金业绩基准的成分股，所以不影响基金管理人对该证券的投资决策。

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。

11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	8,734.97
2	应收证券清算款	113,007.20
3	应收股利	-
4	应收利息	2,409.58
5	应收申购款	218,528.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	342,679.84

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。

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情况。

十二、 基金的业绩

本基金的过往业绩不代表未来表现。

1. 净值增长率与业绩比较基准收益率比较：

（1）申万菱信中小板指数分级证券投资基金

阶段	基金份额净值增长率①	基金份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④

		②		④		
2012年度	-8.60%	1.20%	-11.06%	1.25%	2.46%	-0.05%
2013年度	15.20%	1.46%	16.80%	1.46%	-1.60%	0.00%
2014年度	8.16%	1.19%	9.30%	1.20%	-1.14%	-0.01%
2015年度	51.21%	2.74%	51.15%	2.58%	0.06%	0.16%
2016年度	-22.81%	1.78%	-21.71%	1.70%	-1.10%	0.08%
2017年1月1日至2017年5月8日	-0.67%	0.78%	-0.89%	0.78%	0.22%	0.00%
自基金合同生效起至2017年5月8日	32.03%	1.75%	33.17%	1.69%	-1.14%	0.06%

(2) 申万菱信中小板指数证券投资基金（LOF）

阶段	基金份额净值增长率①	基金份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金转型日(2017年5月9日)起至2017年12月31日	16.59%	0.90%	16.97%	0.91%	-0.38%	-0.01%
2018年	-34.52%	1.53%	-36.14%	1.51%	1.62%	0.02%
2019年1月1日至2019年9月30日	27.25%	1.52%	26.17%	1.56%	1.08%	-0.04%
自基金转型日(2017年5月9日)起至2019年9月30日	-2.85%	1.39%	-5.75%	1.40%	2.90%	-0.01%

(3) 申万菱信中小板指数证券投资基金（LOF）C

阶段	净	净值增	业绩比	业绩比较基	①	②
----	---	-----	-----	-------	---	---

	值增长率①	长率标准差②	较基准收益率③	准收益率标准差④	—③	—④
自分级起 始日（2019年 8月8日）至 2019年9月30 日	7.91 %	1.13%	9.29%	1.17%	-1.3 8%	-0. 04%

注：上述基金业绩指标已扣除了基金的管理费、托管费和各项交易费用，但不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：申购费、赎回费等），计入认购或交易基金的各项费用后，实际收益水平要低于所列数字。

2. 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

（1）申万菱信中小板指数证券投资基金（LOF）累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

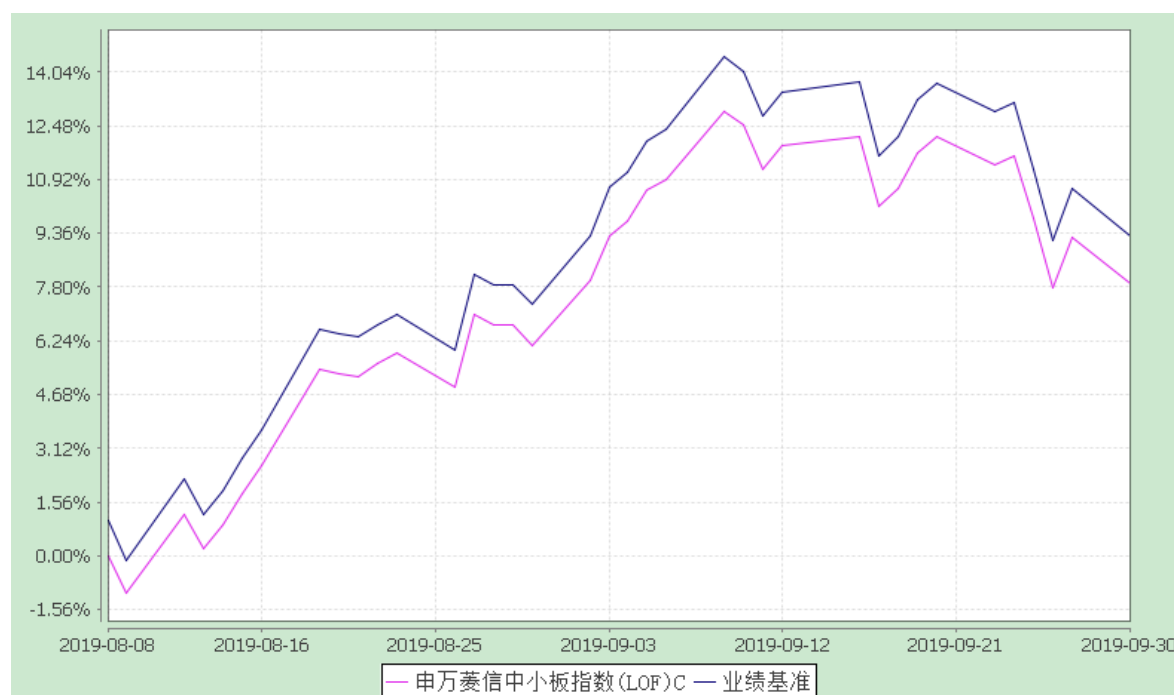
（2017年5月9日至2019年9月30日）

申万菱信中小板指数(LOF):



申万菱信中小板指数证券投资基金(LOF)C
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2019年8月8日至2019年9月30日)

申万菱信中小板指数(LOF)C:



十三、基金的费用与税收

（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、基金销售服务费；
- 4、基金的指数使用费；
- 5、基金上市费用；
- 6、《基金合同》生效后的信息披露费用；
- 7、基金份额持有人大会费用；
- 8、《基金合同》生效后与基金有关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 9、基金的证券交易费用；
- 10、基金的银行汇划费用；
- 11、证券账户开户费用和银行账户维护费；
- 12、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、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）”，本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.30%。销售服务费的计算方法如下：

$H = E \times \text{销售服务费率} / \text{当年天数}$ ，本基金 C 类基金份额年销售服务费率为 0.30%

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，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销售服务费划付指令，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登记机构，由登记机构代付给销售机构，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

5、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。

6、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纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十四、对招募说明书本次更新部分的说明

本招募说明书（更新）依据《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》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其它有关法律法规的要求，对基金管理人在《基金合同》生效后对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新，主要更新的内容如下：

- 1、根据 2019 年 9 月 1 日生效的《信息披露办法》及《基金合同》、《托管协议》的修改，更新《招募说明书》绪言、释义、基金申购赎回、基金的收益与分配、基金的会计与审计、基金的信息披露、法律文件摘要等章节内容。

- 2、更新基金管理人的部分信息；

- 3、更新基金托管人的部分信息；
- 4、更新相关服务机构的部分信息；
- 5、更新风险收益特征的部分信息；
- 6、更新本基金的投资组合报告，数据截止日期为 2019 年 9 月 30 日；
- 7、更新本基金的业绩部分，数据截止日期为 2019 年 9 月 30 日；
- 8、更新“其他应披露事项”。

以上内容仅为摘要，须与本《招募说明书》（更新）全文所载之详细资料一并阅读。