

---

# 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) 招募说明书(第十次更新) 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

二〇一七年六月

本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，  
但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

**【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。
- 本招募说明书（更新）所载内容截止日为 2017 年 5 月 8 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2017 年 3 月 31 日（财务数据未经审计）。

## 目录

一、 基金管理人.....	4
二、 基金托管人.....	8
三、 相关服务机构.....	9
四、 基金的名称.....	32
五、 基金的类型.....	32
六、 投资目标.....	32
七、 投资范围.....	33
八、 投资策略.....	33
九、 业绩比较基准.....	34
十、 风险收益特征.....	35
十一、 基金投资组合报告.....	35
十二、 基金的业绩.....	40
十三、 基金的费用与税收.....	41
十四、 对招募说明书本次更新部分的说明.....	44

## 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。2016 年 12 月起任申万菱信基金管理公司董事长。

姜国芳先生，董事，工商管理硕士，高级经济师。1980 年起从事金融相关

工作，先后任职于中国人民银行上海市分行，中国工商银行上海市分行组织处，上海申银证券有限公司，申银万国证券股份有限公司，申银万国（香港）有限公司，申万宏源集团股份有限公司，申万菱信基金管理有限公司。

朱敏杰先生，董事，硕士研究生，经济师。1988年起从事证券相关工作，先后任职于万国证券公司，申银万国证券股份有限公司，现任申万宏源证券有限公司副总经理。

川上丰先生，董事，日本籍，大学学历。1990年4月至今在三菱UFJ信托银行株式会社（原三菱信托银行）任职，曾任投资企划部科长、海外资产管理事业部科长、次长、副部长等。现任三菱UFJ信托银行株式会社海外资产管理部部长。

增田义之先生，董事，日本籍，硕士研究生。1989年4月至今在三菱UFJ信托银行株式会社（原三菱信托银行）任职，历任资产运用部量化运用组科长、股票运用部次长、投资工学研究所董事、指数战略运用部部长、资产运用部部长，现任受托财产企划部部长兼资产运用部部长。

来肖贤先生，董事，经济学硕士，中级经济师。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，现任公司总经理，兼任申万菱信（上海）资产管理有限公司董事长。

白虹女士，独立董事，硕士研究生。曾任职于中国工商银行总行、韩国釜山分行、万事达卡国际组织、FEXCO国际商务等，2012年起任跨界创新平台(COIN)创始人兼CEO。

阎小平先生，独立董事，硕士研究生，高级经济师。1969年开始工作，1984年进入金融行业，曾先后任职于中国工商银行总行、工商银行北京市分行等。2009年1月起退休。

张军建先生，独立董事，博士研究生，教授。曾在四川外国语大学、日本长崎县立大学、日本千叶大学、早稻田大学任教；此后曾任职于日本菱南开发株式会社。2001年至今在中南大学任法学院教授，中日经济法研究所所长，中南大

学信托与信托法研究中心主任；中国银行法学研究会常务理事；中美法律交流基金会信托法委员会副主席。

## 2、监事会成员

徐志斌先生，监事会主席，硕士研究生。曾任高盛集团环球控制部高级分析师、项目经理、团队经理，高盛集团运营风险管理部欧洲区负责人、总监、执行董事，高盛集团市场风险管理部执行董事，中国建银投资有限责任公司风险管理部业务总监、高级业务总监、负责人，宏源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，现任申万宏源证券有限公司副总经理兼首席风险官，申万宏源证券承销保荐有限公司和申万宏源西部证券有限公司合规总监。

杉崎干雄先生，监事，日本籍，大学学历。1988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），历任投资企划部次长等职务，2014年4月起任受托财产企划部副部长。

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，现任监察稽核总部总监。

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，现任人力资源总部总监助理，兼任申万菱信（上海）资产管理有限公司监事。

## 3、高级管理人员

刘郎先生，相关介绍见董事会成员部分。

来肖贤先生，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，兼任申万菱信（上海）资产管理有限公司董事。

张少华先生，硕士研究生。曾任职于申银万国证券股份有限公司。2003年1

月加入申万巴黎基金筹备组,后正式加入申万菱信基金管理有限公司,历任风险管理总部高级风险分析师、总监,基金投资管理总部基金经理、副总监,投资管理总部总监、基金经理,现任公司副总经理兼投资管理总部总监。

张丽红女士,硕士研究生。曾任职于中国工商银行股份有限公司,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,现任公司副总经理兼财务管理总部总监。

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

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,金融风险管理师(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。

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

投资决策委员会由下述人员组成：总经理、公司分管投资的副总经理、基金投资管理总部总监、研究总监、基金经理代表等。委员会执行委员在会议期间对所决策事项有投票权。

非执行委员有下列人员组成：董事长、副总经理、督察长、监察稽核总部总监、风险管理总部总监和市场营销总部总监。非执行委员对需决策事项可发表观点，但不参与决策事项的投票表决。

公司总经理担任投资决策委员会主席，分管投资的副总经理担任投资决策委员会会议召集人，投资管理总部总监担任投资决策委员会秘书，负责协调统筹投资决策委员会的各项事宜。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

### (一) 基金托管人情况

#### 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

### 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: 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](http://www.swsmu.com)

电子邮件: [service@swsmu.com](mailto: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: 易会满

客户服务电话: 95588

传真: 010-66107738

网址: [www.icbc.com.cn](http://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](http://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](http://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](http://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](http://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](http://www.cmbc.com.cn)

**(7) 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](http://www.srcb.com)

**(8) 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](http://www.njcb.com.cn)

**(9)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](http://www.gtja.com)

**(10)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](http://www.csc108.com)

**(11)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](http://www.guosen.com.cn)

**(12)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](http://www.newone.com.cn)

**(13) 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](http://www.gf.com.cn)

**(14) 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](http://www.cs.ecitic.com)

**(15) 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](http://www.chinastock.com.cn)

**(16) 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](http://www.htsec.com)

**(17) 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](http://www.swhysc.com)

**(18) 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

**(19)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

**(20)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](http://www.gyzq.com.cn)

**(21)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](http://www.htsc.com.cn)

**(22)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](http://www.zxwt.com.cn)

**(23)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](http://www.dwzq.com.cn)

**(24)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](http://www.cindasc.com)

**(25)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: 上海市静安区新闻路 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](http://www.ebscn.com)

**(26) 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](http://www.gzs.com.cn)

**(27) 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](http://www.962518.com)

**(28) 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](http://www.glsc.com.cn)

**(29) 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](http://www.stocke.com.cn)

**(30) 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>

**(31) 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>

**(32)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](http://www.hysec.com)

**(33)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](http://www.zts.com.cn)

**(34)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](http://www.fcsc.com.cn)

**(35)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](http://www.avicsec.com)

**(36)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](http://www.westsecu.com)

**(37)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](http://www.cicc.com.cn)

**(38)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大厦 7 层、8 层

办公地址: 深圳市南山区科技中一路西华强高新大厦 7 层、8 层

法定代表人: 黄扬录

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](http://www.zszq.com)

**(39)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](http://www.hongtazq.com)

**(40)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](http://www.lxsec.com)

**(41)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.gjzq.com.cn](http://www.gjzq.com.cn)

联系人: 刘婧漪、贾鹏

联系电话: 028-86690057、028-86690058

传真号码: 028-86690126

**(42) 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](http://www.cnhbstock.com)

**(43) 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](http://www.hrsec.com.cn)

**(44) 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

**(45)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](http://www.tpyzq.com)

**(46)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](http://www.kysec.cn)

**(47)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](http://8.jrj.com.cn)

**(48)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](http://licaike.hexun.com)

**(49)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](http://www.noah-fund.com)

**(50)名称: 深圳众禄金融控股股份有限公司**

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](http://www.zlfund.cn), 基金买卖网 [www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

**(51)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](http://www.1234567.com.cn)

**(52) 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](http://www.ehowbuy.com)

**(53) 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](http://www.fund123.cn)

**(54) 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](http://www.erichfund.com)

**(55) 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](http://www.5ifund.com)

**(56)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](http://www.myfund.com)

**(57)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：上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼

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

**(58)名称：宜信普泽投资顾问(北京)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](http://www.yixinfund.com)

**(59)名称: 众升财富(北京)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

法定代表人: 李招娣

联系人: 李艳

联系电话: 010-59497361

传真: 010-64788016

客服电话: 400-059-8888

网址: [www.zscffund.com](http://www.zscffund.com)

**(60)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](http://www.chtfund.com)

**(61)名称: 一路财富(北京)信息科技有限公司**

注册地址: 北京市西城区车公庄大街 9 号五栋大楼 C 座 702 室

办公地址: 北京市西城区阜成门外大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208

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/>

**(62)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](http://www.qianjing.com)

**(63)名称: 上海联泰资产管理有限公司**

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: [www.66zichan.com](http://www.66zichan.com)

**(64)名称: 上海汇付金融服务有限公司**

注册地址: 上海市黄浦区中山南路100号19层

办公地址: 上海市黄浦区中山南路100号19层

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](http://www.chinapnr.com)

**(65)名称: 深圳富济财富管理有限公司**

注册地址: 深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室  
办公地址: 深圳市南山区高新南七道12号惠恒集团二期418室  
法定代表人: 刘鹏宇  
联系人: 陈勇军  
电话: 0755-83999907-806  
传真: 0755-83999926  
客户服务电话: 0755-83999913  
网址: [www.jinqianwo.cn](http://www.jinqianwo.cn)

**(66)名称: 上海陆金所资产管理有限公司**

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](http://www.lufunds.com)

**(67)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359号国睿大厦一号楼B区4楼A506室  
办公地址: 上海市长宁区虹桥路1386号文广大厦15楼  
法定代表人: 袁顾明  
客户服务电话: 4009282266

传真: 021-22268089

网址: [www.dtfunds.com](http://www.dtfunds.com)

**(68)名称: 珠海盈米财富管理有限公司**

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](http://www.yingmi.cn)

**(69)北京肯特瑞财富投资管理有限公司**

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/>

**(70)名称: 中民财富管理(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](http://www.cmiwm.com)

### (71)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.hcjijin.com](http://www.hcjijin.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：韩炯

电话：+86-21-31358666

传真：+86-21-31358600

联系人：安冬

经办律师：吕红、安冬

### (四) 会计师事务所和经办注册会计师

会计师事务所：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

联系人：赵钰

经办注册会计师：陈玲、赵钰

## 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%。

## 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： $95\% \times \text{中小板指数收益率} + 5\% \times \text{银行同业存款利率}$ 。

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平均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

## 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 2017 年 3 月 31 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	352,355,662.57	92.71
	其中：股票	352,355,662.57	92.71
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	26,755,378.22	7.04
7	其他资产	938,313.38	0.25
8	合计	380,049,354.17	100.00

注：本基金未开通沪港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

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	2,422,035.33	0.64
B	采矿业	-	-
C	制造业	241,455,792.68	64.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	12,521,556.66	3.33
F	批发和零售业	9,813,238.00	2.61
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	37,078,772.85	9.86
J	金融业	25,565,507.05	6.80
K	房地产业	4,089,852.62	1.09
L	租赁和商务服务业	10,468,065.58	2.78
M	科学研究和技术服务业	16,930.16	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	2,937,821.92	0.78

0	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	5,986,089.72	1.59
S	综合	-	-
	合计	352,355,662.57	93.70

### 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	465,007.00	14,833,723.30	3.94
2	002304	洋河股份	129,907.00	11,351,273.66	3.02
3	002450	康得新	564,279.00	10,789,014.48	2.87
4	002024	苏宁云商	903,365.00	9,756,342.00	2.59
5	002230	科大讯飞	224,857.00	7,892,480.70	2.10
6	002142	宁波银行	416,580.00	7,673,403.60	2.04
7	002241	歌尔股份	206,173.00	7,018,128.92	1.87
8	002456	欧菲光	181,047.00	6,854,439.42	1.82
9	002673	西部证券	364,183.00	6,657,265.24	1.77
10	002466	天齐锂业	150,829.00	6,515,812.80	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

根据本基金基金合同, 本基金不得参与股指期货交易。

#### 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。

### 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 本基金投资的前十名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。本基金投资的前十名证券的发行主体除西部证券(002673.SH)外, 在报告编制日前一年内没有受到公开谴责和处罚的情形。

西部证券于2016年8月2日收到了中国证监会湖北监管局下发的《关于对西部证券股份有限公司湖北分公司采取责令增加内部合规检查次数的监管措施的决定》。中国证监会湖北监管局认定, 西部证券湖北分公司在防范和控制风险的内部控制制度在运行中存在缺陷, 规范负责人行为的监督机制不够完善。中国证监会湖北监管局为此要求西部证券采取相应的整改措施。

此外, 西部证券于2016年8月30日收到了中国证监会陕西监管局下发《关

于对西部证券股份有限公司采取出具警示函措施的决定》。中国证监会陕西监管局认定，西部证券在担任宝信国际融资租赁有限公司（以下简称“宝信租赁”）于2015年7月7日公开发行的15宝信债受托管理机构过程中，未能在债券存续期内持续有效督导宝信租赁履行信息披露义务。中国证监会陕西监管局为此对西部证券采取出具警示函的行政监管措施。

西部证券为本基金的业绩基准“中小板指数”的成份股，因为本基金为采用完全复制方式被动跟踪标的指数的基金产品，所以西部证券受到监管机构警示的情形不会影响本基金的投资决策。

**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	73,463.07
2	应收证券清算款	825,515.83
3	应收股利	-
4	应收利息	5,743.66
5	应收申购款	33,590.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	938,313.38

### **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**

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002673	西部证券	6,657,265.24	1.77	重大事项

## 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:

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
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 3 月 31 日	4.28%	0.77%	4.03%	0.77%	0.25%	0.00%
自基金合同生效起 2017 年 3 月 31 日	38.61%	1.76%	39.78%	1.71%	-1.17%	0.05%

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

申万菱信中小板指数证券投资基金(LOF)(原申万菱信中小板指数分级证券投资基金)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

(2012 年 5 月 8 日至 2017 年 3 月 31 日)





### 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。

#### 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》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求,并根据基金管理人在《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、更新了重要提示中本基金转型的部分信息;
- 2、更新了重要提示中本招募说明书所载内容的截止日期;
- 3、变更了基金管理人的部分信息;
- 4、更新了基金托管人的部分信息;
- 5、更新了相关服务机构的部分信息;
- 6、更新了本基金的投资组合报告,数据截止日期为2017年3月31日;
- 7、更新了本基金的业绩部分,数据截止日期为2017年3月31日;
- 8、在“其他应披露事项”一章,列举了本基金自2016年11月9日至2017年5月8日发布的有关公告。

以上内容仅为摘要,须与本《招募说明书》(更新)(正文)所载之详细资料一并阅读。

申万菱信基金管理有限公司

2017年6月21日