申万菱信申银万国证券行业指数分级证券投资基金上市交易公告书

基金管理人:申万菱信基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
公告日期:2014年3月26日
上市日期:2014年3月31日

第一部分 重要声明与提示

《申万菱信申银万国证券行业指数分级证券投资基金上市交易公告书》(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)》、《深圳证券交易所交易规则》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制,申万菱信申银万国证券行业指数分级证券投资基金(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。

本基金托管人中国工商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2014年2月19日《中国证券报》、《上海证券报》的“申万菱信申银万国证券行业指数分级证券投资基金招募说明书”。本基金的招募说明书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:申万菱信申银万国证券行业指数分级证券投资基金

基金简称:申万菱信申银万国证券行业指数分级;场内简称:申万证券;基金代码:163113

基金简称:证券A份额;场内简称:证券A;交易代码:150171

基金简称:证券B份额;场内简称:证券B;交易代码:150172

二、基金类型:股票型

三、基金运作方式:契约型开放式。

四、本基金的基金份额包括申万菱信申银万国证券行业指数分级证券投资基金之基础份额(简称“申万证券份额”)、申万菱信申银万国证券行业指数分级证券投资基金之稳健收益类份额(简称“证券A份额”)与申万菱信申银万国证券行业指数分级证券投资基金之积极进取类份额(简称“证券B份额”)。证券A份额、证券B份额的基金份额比始终保持1:1的比例不变。

五、本基金的存续期限:不定期。

六、场外将通过基金管理人的直销中心及基金场外代销机构的代销网点发售(具体名单详见基金份额发售公告及新增代销机构的公告)。场内将通过深圳证券交易所内具有基金销售业务资格并经深圳证券交易所认可的会员单位发售(具体名单详见基金份额发售公告或相关业务公告)。本基金募集期结束前获得基金销售业务资格的会员单位也可代理场内基金份额的发售。基金发售结束后,投资者场外认购所得的全部份额将确认为申万证券份额;投资者场内认购所得的全部份额将按1:1 的比例确认为证券A 份额与证券B 份额。

《基金合同》生效后,申万证券份额设置单独的基金代码,只可以进行场内与场外的申购和赎回,但不上市交易。证券A份额与证券B份额交易代码不同,只可在深圳证券交易所上市交易,不接受单独的申购与赎回。

七、申万证券份额的申购与赎回:投资者可通过场外或场内两种方式对申万证券份额进行申购与赎回。申万证券份额场外申购和赎回业务的场所包括基金管理人的直销中心和基金管理人委托的场外销售机构,投资者可使用开放式基金账户,通过基金管理人、场外销售机构办理场外申购、赎回业务;申万证券份额场内申购与赎回的场所为深圳证券交易所内具有基金代销业务资格、经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的会员单位,投资者使用深圳证券账户,通过深圳证券交易所交易系统办理场内申购、赎回业务。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理申万证券份额的申购与赎回。证券A份额与证券B份额将不接受投资者的申购与赎回。

八、份额配对转换:份额配对转换是指本基金的申万证券份额与证券A份额、证券B份额之间的配对转换,包括分拆和合并两个方面。

分拆指基金份额持有人将其持有的每两份申万证券份额的场内份额申请转换成一份证券A份额与一份证券B份额的行为。

合并指基金份额持有人将其持有的每一份证券A份额与一份证券B份额进行配对申请转换成两份申万证券份额的场内份额的行为。

有关份额配对转换的具体规定请见本基金招募说明书以及相关公告。

九、定期份额折算:在每个运作周年,将证券A份额上一个运作周年结束日的基金份额参考净值超出本金1.0000元部分,折算为场内申万证券份额分配给证券A份额持有人。申万证券份额持有人持有的每两份申万证券份额将按一份证券A份额获得新增申万证券份额的分配。持有场外申万证券份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外申万证券份额的分配;持有场内申万证券份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内申万证券份额的分配。经过上述份额折算,证券A份额的基金份额参考净值和申万证券份额的基金份额净值将相应调整。有关定期份额折算的具体规定请见本基金招募说明书以及相关公告。

十、不定期份额折算:本基金除进行以上的定期份额折算外,在以下两种情况下也会进行不定期份额折算,即:当申万证券份额的基金份额净值大于或等于1.5000元时;当证券B份额的基金份额参考净值达到或跌破0.2500元时。有关不定期份额折算的具体规定请见本基金招募说明书以及相关公告。

十一、证券A份额和证券B份额的终止运作:经基金份额持有人大会决议通过,证券A份额与证券B份额可申请终止运作。该基金份额持有人大会决议须经本基金所有份额以特别决议的形式表决通过,即须经参加基金份额持有人大会的申万证券份额、证券A份额与证券B份额各自的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。

十二、基金份额总额:截至2014年3月24日,本基金的基金份额总额为620,108,864.50份,其中,申万证券:518,196,612.50份,证券A:50,956,126.00份,证券B:50,956,126.00份。

十三、基金份额净值:截至2014年3月24日,申万证券份额净值为1.0005元,证券A份额净值为1.0020元,证券B份额净值为0.9990元。

十四、本次上市交易的基金份额简称:证券A、证券B

十五、本次上市交易的基金份额总额:证券A:50,956,126.00份;证券B:50,956,126.00份(截至2014年3月24日)

十六、本次上市交易的基金份额交易代码:证券A :150171;证券B :150172

十七、上市的证券交易所:深圳证券交易所

十八、上市交易日期:2014年3月31日

十九、基金管理人:申万菱信基金管理有限公司

二十、基金托管人:中国工商银行股份有限公司

二十一、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 基金的募集与上市交易

一、本次基金上市前基金募集情况

1、基金募集申请的核准机构和核准文号:中国证券监督管理委员会2014年1月26日证监许可【2014】141号文

2、基金运作方式:契约型开放式基金

3、基金合同期限:不定期

4、发售日期:2014年2月24日到2014年3月7日

5、发售价格:1.00元人民币

6、发售方式:本基金通过场外、场内两种方式公开发售

7、发售机构:

(1)场外销售机构:

1)直销机构

申万菱信基金管理有限公司直销中心和申万菱信网上交易。

2)代销机构

交通银行、上海浦发银行、上海农商银行、和讯、众禄、天天、好买、数米、长量、同花顺、展恒、国泰君安证券、中信建投证券、招商证券、中信证券、中国银河证券、海通证券、申银万国证券、长江证券、安信证券、中信证券(浙江)、中信万通证券、东吴证券、信达证券、光大证券、广州证券、中航证券、西部证券、天风证券。

(2)场内销售机构:

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

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通过深圳证券交易所系统办理本基金的场内认购业务。

8、验资机构名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)。

9、募集资金总额及入账情况

本次募集的募集有效认购总户数为3,968户,有效净认购总金额为619,927,009.03元人民币,认购资金的银行利息181,855.47元人民币,其中,场外认购缴存资金产生折算为基金份额的利息为173,603.47元人民币,场内认购缴存资金产生折算为基金份额的利息为8,252.00元人民币。本基金有效净认购总额619,927,009.03元人民币及场外认购缴存资金产生折算为基金份额的利息173,603.47元人民币已于2014年3月13日全额划入本基金在基金托管人中国工商银行股份有限公司开立的中万菱信申银万国证券行业指数分级证券投资基金托管专户;场内认购缴存资金产生折算为基金份额的利息8,252.00元人民币,已于下一季度银行结息日(2014年3月20日)划入本基金在基金托管人中国工商银行股份有限公司开立的中万菱信申银万国证券行业指数分级证券投资基金托管专户。

10、本基金募集备案情况:本基金于2014年3月13日验资完毕,2014年3月13日向中国证监会提交了验资报告,办理基金备案手续。根据证监会《关于中万菱信申银万国证券行业指数分级证券投资基金备案确认的函》(基金部函[2014]140号)的书面确认,本基金合同于2014年3月13日正式生效。

11、基金合同生效日:2014年3月13日。

12、基金合同生效日的基金份额总额:620,108,864.50份,其中,申万证券:518,196,612.50份,证券A:50,956,126.00份,证券B:50,956,126.00份。

二、本基金的日常申购、赎回业务安排

本基金管理人将于2014年3月31日起开始办理本基金的日常申购和赎回业务,具体业务办理时间等情况在开放申购和赎回公告中规定。

三、申万证券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【2014】113号

2、上市交易日期:2014年3月31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、基金简称:证券A份额、证券B份额

场内简称:证券A、证券B

5、基金交易代码:证券A:150171、证券B:150172

6、本次上市交易份额(截止2014年3月24日):证券A:50,956,126.00份、证券B:50,956,126.00份

7 、未上市交易份额的流通规定:未上市交易的申万证券办理跨系统转托管到场内(证券登记结算系统)后,可以向具有基金代销业务资格且符合深圳证券交易所风险控制要求的深圳证券交易所会员单位,根据基金合同配对转换的规定申请将份额分拆成证券A和证券B,分拆后的证券A和证券B可以在深圳证券交易所场内上市流通。

8、基金资产净值的披露:基金合同生效后,在证券A份额、证券B份额上市交易前或者开始办理申万证券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证券份额的基金份额净值、证券A份额与证券B份额的基金份额参考净值。

在证券A份额、证券B份额上市交易后或开始办理申万证券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,披露开放日的申万证券份额的基金份额净值和基金份额累计净值、证券A份额与证券B份额各自的基金份额参考净值。

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申万证券份额的基金份额净值、证券A份额与证券B份额各自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、申万证券份额的基金份额净值和基金份额累计净值、证券A份额与证券B份额各自的基金份额参考净值登载在指定媒体上。

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2014年3月24日,基金份额持有人户数为3,968户,平均每户持有的基金份额为156,277.44份;其中,申万证券为3,399户,平均每户持有的基金份额为152,455.61份;证券A为568户,平均每户持有的基金份额为89,711.49份;证券B为568户,平均每户持有的基金份额为89,711.49份。

二、持有人结构

截至2014年3月24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9,727,634.00 份,占场内基金总份额的9.55%;场内个人投资者持有的基金份额为92,184,618.00 份,占场内基金总份额的90.45%。

机构投资者持有的本次上市交易的证券A份额为4,863,818份, 占本次证券A上市交易基金份额比例为9.55%; 个人投资者持有的本次上市交易的证券A份额为46,092,308份, 占本次证券A上市交易份额比例为90.45%。

机构投资者持有的本次上市交易的证券B份额为4,863,816份, 占本次证券B上市交易基金份额比例为9.55%; 个人投资者持有的本次上市交易的证券B份额为46,092,310份, 占本次证券B上市交易份额比例为90.45%。

三、截至2014年3月24日,前十名场内基金份额持有人情况:

序号	持有人名称(全称)	持有证券A份额	占证券A份额比例
1	无锡市投资管理公司	3,800,259	7.46%
2	张云杰	1,010,135	1.98%
3	王光法	1,000,030	1.96%
4	陈秋	1,000,029	1.96%
5	何曲	1,000,029	1.96%
6	毕爱军	757,044	1.49%
7	张颖	700,040	1.37%
8	阎金铭	606,018	1.19%
9	宋恩尚	550,580	1.08%
10	王茜	527,535	1.04%
合计		10,951,699	21.49%

序号	持有人名称(全称)	持有证券B份额	占证券B份额比例
1	无锡市投资管理公司	3,800,258	7.46%
2	张云杰	1,010,134	1.98%
3	陈秋	1,000,029	1.96%
4	何曲	1,000,029	1.96%
5	王光法	1,000,028	1.96%
6	毕爱军	757,043	1.49%
7	张颖	700,041	1.37%
8	阎金铭	606,017	1.19%
9	宋恩尚	550,579	1.08%
10	王茜	527,536	1.04%
合计		10,951,694	21.49%

注:以上信息依据中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司提供的持有人信息编制。

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:姜国芳

总经理:过振华

设立日期:2004年1月15日

注册资本:15亿元人民币

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

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:10000040010467

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:申银万国证券股份有限公司持有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

公司设立了投资决策委员会和风险管理委员会等专业委员会。投资决策委员会负责指导基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。风险管理委员会负责全面评估公司的经营过程中的各项风险,并提出防范措施。

公司目前下设基金投资管理总部、研究总部、专户资产管理总部、市场销售总部、营销管理总部、基金运营总部、交易总部、产品与金融工程总部、监察稽核总部、风险管理总部、信息技术总部、财务管理总部和行政管理总部共十三个部门。基金投资管理总部分为权益投资、固定收益投资和量化投资三个团队,负责根据投资决策委员会制定的原则以专业经营方式管理和运作基金资产。研究总部主要负责根据公司的发展战略和投资计划,开展宏观经济与政策研究,投资策略研究,国内外资本市场研究,国内泛资产管理行业及公司发展战略研究等。专户资产管理总部负责专户客户的开发及维护,专户资产的投资运作等。市场销售总部分为北京分公司、华东理财中心、广州分公司和西部理财中心,主要负责渠道销售和机构销售相关工作,渠道销售包括开发和维护代销渠道、管理和监督日常的代销业务,机构销售包括机构客户的开发与维护。营销管理总部负责市场推广、基金整合营销方案及客户服务,公司经营活动分析、行业及营销策略研究及渠道管理等。基金运营总部负责对基金的各项交易活动进行会计处理、注册登记、基金清算等工作。交易总部负责公募基金投资和专户资产投资的交易支持业务。产品与金融工程总部负责产品研究及新产品开发。监察稽核总部负责检查、监督和评价公司及各部门的合法合规情况、与监管机构联系和沟通、信息披露等工作。风险管理总部负责对投资交易过程中可能出现的风险进行研究和监控,同时进行基金绩效评价工作。信息技术总部负责公司信息系统的日常运行及维护。财务管理总部负责公司的财务预算、财务管理及会计核算工作。行政管理总部负责文书档案、后勤服务及人力资源等综合事务管理和公司董事会日常工作。基金管理人无任何受处罚记录。

4、人员情况

截至2014年2月28日,我公司共有108名员工,其中博士学位7人、硕士学位56人和学士学位41人。

5、信息披露负责人:来肖贤

咨询电话:400 880 8588

6、基金管理业务情况

截止2014年2月28日,申万菱信基金管理有限公司旗下共管理15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、申万菱信新动力股票型证券投资基金、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、申万菱信竞争优势股票型证券投资基金、申万菱信添益宝债券型证券投资基金、申万菱信消费增长股票型证券投资基金、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分级证券投资基金和申万菱信定期开放债券型发起式证券投资基金。

7、本基金基金经理

张少华,复旦大学数量经济学硕士。曾任职于申银万国证券,2003年1月加入申万巴黎基金管理有限公司(现名申万菱信)筹备组,后正式加入申万菱信基金管理有限公司,曾任风险管理总部总监,投资管理总部副总监,申万菱信量化小盘基金经理等,现任基金投资管理总部副总监,申万菱信沪深300价值指数、申万菱信深证成指分级、申万菱信中小板指数分级基金经理。

二、基金托管人

1、基本情况

名称:中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)

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:姜建清

成立时间:1984年1月1日

批准设立机关和批准设立文号:国发【1983】146号

组织形式:股份有限公司

注册资本:人民币349,018,545,827元

存续期间:持续经营

基金托管资格批文及文号:中国证监会和中国人民银行证监基字【1998】3号

联系电话:010-66105799

传真:010-66105798

联系人:赵会军

2、主要人员情况

截至2013年12月末,中国工商银行资产托管部共有员工176人,平均年龄30岁,95%以上员工拥有大学本科以上学历,高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

3、基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者,中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来,秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨,依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队,严格履行资产托管人职责,为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务,展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、安心账户资金、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系,同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务,可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2013年12月,中国工商银行共托管证券投资基金358只。自2003 年以来,本行连续十年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的41项最佳托管银行大奖;是获得奖项最多的国内托管银行,优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

三、验资机构

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:张振波

经办注册会计师:薛竞、张振波

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

深圳证券交易所在申万菱信申银万国证券行业指数分级证券投资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。

申万菱信申银万国证券行业指数分级证券投资基金2014年3月24日资产负债表(未经审计)如下:

资产	
资产:	
银行存款	20,160,429.64
结算备付金	-
存出保证金	-
交易性金融资产	-
其中:股票投资	-
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	600,000,000.00
应收证券清算款	-
应收利息	485,820.54
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产合计	620,646,250.18
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	-
应付管理人报酬	186,921.91
应付托管费	41,122.82
应付销售服务费	-
应付交易费用	-
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	13,615.87
负债合计	241,660.60
所有者权益:	
实收基金	620,108,864.50
未分配收益	295,725.08
所有者权益合计	620,404,589.58
负债和所有者权益合计	620,646,250.18

注:报告截止日2014年3月24日,申万菱信申银万国证券行业指数分级证券投资基金之基础级别(以下简称“申万证券”)份额净值1.0005元,申万菱信申银万国证券行业指数分级证券投资基金A类(以下简称“证券A”)份额净值1.0020元,申万菱信申银万国证券行业指数分级证券投资基金B类(以下简称“证券B”)份额净值0.9990元;申万证券份额518,196,612.50份,证券A基金份额50,956,126.00份,证券B基金份额50,956,126.00份。

第八部分 基金投资组合

截止到2014年3月24日,申万菱信申银万国证券行业指数分级证券投资基金的投资组合如下:

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	-	-
	其中:股票	-	-
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	600,000,000.00	96.67
	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	20,160,429.64	3.25
6	其他各项资产	485,820.54	0.08
7	合计	620,646,250.18	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8、投资组合报告附注

8.1 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,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.2 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。

8.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	485,820.54
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	485,820.54

8.4 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。

8.5 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。

第九部分 重大事件揭示

本基金以下信息披露事项均已通过指定报刊以及基金管理人网站(www.swsmu.com) 进行公开披露,并已报送相关监管部门备案。

1、2014年2月19日,刊登于《中国证券报》、《上海证券报》的申万菱信申银万国证券行业指数分级证券投资基金合同;

2、2014年2月19日,刊登于《中国证券报》、《上海证券报》的申万菱信申银万国证券行业指数分级证券投资基金合同摘要;

3、2014年2月19日,刊登于《中国证券报》、《上海证券报》的申万菱信申银万国证券行业指数分级证券投资基金份额发售公告;

4、2014年2月19日,刊登于《中国证券报》、《上海证券报》的申万菱信申银万国证券行业指数分级证券投资基金托管协议;

5、2014年2月19日,刊登于《中国证券报》、《上海证券报》的申万菱信申银万国证券行业指数分级证券投资基金招募说明书;

6、2014年2月24日,刊登于《中国证券报》、《上海证券报》的申万菱信申银万国证券行业指数分级证券投资基金上网发售提示性公告;

7、2014年2月27日,刊登于《中国证券报》、《上海证券报》的关于旗下申万菱信申银万国证券行业指数分级证券投资基金新增上海浦东发展银行股份有限公司为代销机构的公告。

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有重大违规行为,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)《申万菱信申银万国证券行业指数分级证券投资基金基金合同》

(三)《申万菱信申银万国证券行业指数分级证券投资基金托管协议》

(四)《申万菱信申银万国证券行业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

2014年3月26日

附件:基金合同摘要

第一部分 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

(一)基金管理人简况

名称:申万菱信基金管理有限公司

住所:上海市淮海中路300号香港新世界大厦40楼

法定代表人:姜国芳

设立日期: 2004年1月15日

批准设立机关及批准设立文号:中国证券监督管理委员会,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

(二)基金管理人的权利与义务

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)依法募集资金;

(2)自基金合同生效之日起,根据法律法规和基金合同独立运用并管理基金财产;

(3)依照基金合同收取基金管理费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)按照规定召集基金份额持有人大会;

(6)依据基金合同及有关法律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规定决定基金收益的分配方案;

(11)在基金合同约定的范围内,拒绝或暂停受理申购与赎回申请;

(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)在法律法规允许的前提下,为基金的利益依法为基金进行融资、融券;

(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、转换等业务规则;

(17)法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

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)依法募集资金,办理或者委托经中国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、赎回和注销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、申万证券份额的基金份额净值、证券A份额和证券B份额的基金份额参考净值,确定申万证券份额申购、赎回的价格;

(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,不向他人泄露;

(13)按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基金收益;

(14)按规定受理申购与赎回申请,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会计账册、报表、记录和其他相关资料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条件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时,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自己的义务,基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时,基金管理人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,应当对第三方处理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日内退还基金认购人;

(25)执行生效的基金份额持有人大会的决议;

(26)建立并保存基金份额持有人名册;

(27)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。

二、基金托管人

(一)基金托管人简况

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

法定代表人:姜建清

成立时间:1984年1月1日

批准设立机关和批准设立文号: 国务院 《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》(国发【1983】146号)

组织形式:股份有限公司

注册资本:人民币349,018,545,827元

存续期间:持续经营

基金托管资格批文及文号:中国证监会和中国人民银行证监基字【1998】3号

(二)基金托管人的权利与义务

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,如发现基金管理人有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,提名新的基金管理人;

(7)法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

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门,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

(下转B011版)

申万菱信基金管理有限公司关于申万菱信申银万国证券行业指数分级证券投资基金开通份额配对转换业务的公告

根据《申万菱信申银万国证券行业指数