# 申万菱信基金管理有限公司
# 申万菱信申银万国电子行业投资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:广发银行股份有限公司**

公告日期:2015年5月25日
上市日期:2015年5月28日

第一部分 重要声明与提示

《申万菱信申银万国电子行业投资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,申万菱信申银万国电子行业投资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。

本基金托管人广发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2015年4月18日《上海证券报》、《中国证券报》的“申万菱信申银万国电子行业投资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:申万菱信申银万国电子行业投资指数分级证券投资基金

基金简称:申万菱信申银万国电子行业投资指数分级;场内简称:申万电子;基金代码:163116

基金简称:申万电子A份额;场内简称:电子A;交易代码:150231

基金简称:申万电子B份额;场内简称:电子B;交易代码:150232

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电子行业投资指数分级证券投资基金之基础份额(以下简称“申万电子份额”)、申万菱信申银万国电子行业投资指数分级证券投资基金之稳健收益类份额(以下简称“申万电子A份额”)与申万菱信申银万国电子行业投资指数分级证券投资基金之积极进取类份额(以下简称“申万电子B份额”)。其中,申万电子A份额、申万电子B份额的基金份额配比始终保持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或相关业务公告)。场内将通过深圳证券交易所内具有基金代销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电子份额;投资者场内认购所得的全部份额将按1:1的比例确认为申万电子A 份额与申万电子B 份额。

基金合同生效后,申万电子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。申万电子A份额与申万电子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、申万电子份额的申购与赎回:投资者可通过场外或场内两种方式对申万电子份额进行申购与赎回。申万电子份额场外申购与赎回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;申万电子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。具体的销售网点参见本基金招募说明书“第五部分 相关服务机构”或由基金管理人在其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构,并予以公告。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电子份额的申购与赎回。

八、份额配对转换是指本基金的申万电子份额与申万电子A份额、申万电子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电子份额的场内份额申请转换成一份申万电子A份额与一份申万电子B份额的行为。

合并指基金份额持有人将其持有的每一份申万电子A份额与一份申万电子B份额进行配对申请转换成两份申万电子份额的场内份额的行为。

九、定期份额折算:在每个运作周年,将申万电子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, 折算为场内申万电子份额分配给申万电子A份额持有人。申万电子份额持有人持有的每两份申万电子份额将按一份申万电子A份额获得新增申万电子份额的分配。持有场外申万电子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电子份额的分配; 持有场内申万电子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电子份额的分配。经过上述份额折算,申万电子A份额的基金份额参考净值和申万电子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:当申万电子份额的基金份额净值大于或等于1.5000元时;当申万电子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、申万电子A份额和申万电子B份额的终止运作:经基金份额持有人大会决议通过,申万电子A份额与申万电子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电子份额、申万电子A份额与申万电子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2015年5月21日, 本基金的基金份额总额为594,747,003.98份,其中,申万电子:316,302,024.98份,电子A:139,222,489 份,电子B:139,222,490份。

十三、基金份额净值:截至2015年5月21日,申万电子份额净值为0.9999元,电子A份额净值为1.0011元,电子B份额净值为0.9987元。

十四、本次上市交易的基金份额简称:电子A、电子B

十五、本次上市交易的基金份额总额:电子A:139,222,489份;电子B:139,222,490份(截至2015年5月21日)

十六、本次上市交易的基金份额交易代码:电子A :150231;电子B :150232

十七、上市交易的证券交易所:深圳证券交易所

十八、上市交易日期:2015年5月28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:广发银行股份有限公司

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:2015年3月31日获中国证券监督管理委员会证监许可【2015】507号文核准募集

2、基金运作方式:上市契约型开放式

3、基金合同期限:不定期

4、发售日期:2015年4月21日到2015年5月8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

住所: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

法定代表人:姜国芳

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

电子邮件:service@swsmu.com

2)代销机构

(1)广发银行股份有限公司

注册地址:广州市越秀区东风东路713号

办公地址:广州市越秀区东风东路713号

法定代表人:董建岳

联系人:潘逸

电话:020-38322078

传真:020-87310955

客服热线:400-830-8003

网址:www.cgbchina.com.cn

(2)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:胡平西

客服电话:021-96 2999/4006 962 999

联系人:施传荣

传真:021-50105124

网址:www.srcb.com

(3)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:姜建清

客户服务电话:95588

传真:010-66107738

网址:www.icbc.com.cn

(4)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

客户服务热线:95528

公司网站:www.spdb.com.cn

(5)名称:国泰君安证券股份有限公司

注册地址:上海市浦东新区商城路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:万建华

电话:021-38676666

传真:021-38670666

客户服务热线:400-8888-666

(6)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

(7)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1012号国信证券大厦6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

(8)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

(9)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

(10)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:010-66568990

联系人:宋明

公司网址:www.chinastock.com.cn

(11)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

(12) 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

(13)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:胡运钊

联系人:李良

传真:027-85481900

客户服务电话:95579或4008-888-999

网址:www.95579.com

(14)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:牛冠兴

传真:0755-82558355

联系人:余江

统一客服电话:4008001001

公司网站地址:www.essence.com.cn

(15)名称:中信证券(浙江)有限责任公司

注册地址:浙江省杭州市解放东路29号迪凯银座22层

办公地址:浙江省杭州市解放东路29号迪凯银座22层

传真:0571-85106383

客户服务电话:95548

网址:www.bigsun.com.cn

(16)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

(17)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:4008601555

公司网址:www.dwzq.com.cn

(18)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:400-800-8899

公司网址:www.cindasc.com

(19)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

法定代表人:薛峰

联系人:刘晨、李芳芳

客服电话:95525

传真:021-68815009

公司网站:www.ebscn.com

(20) 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: 林洁茹

联系电话: 020-88836999

传真: 020-88836654

客户服务电话:020-961303

网址: www.gzs.com.cn

(21) 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

(22)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:戴蕾

客服电话:400-8866-567

网址:www.avicsec.com

(23)名称:西部证券股份有限公司

注册地址:西安市东新街232号陕西信托大厦16-17层

法定代表人:刘建武

联系人:刘莹

传真:029-87406710

客户服务电话:95582

网站:www.westsecu.com

(24)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: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

(25)名称:华宝证券有限责任公司

注册地址:上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心57层

办公地址:上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心57层

代表法人:陈林

联系人:刘闻川

传真:021-68778790

客服电话:400-820-9898

公司网址:www.cnhbstock.com

(26)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:北京市西城区金融大街8号中国华融大厦A座3层

法定代表人:祝献忠

联系人:李慧灵

联系电话:010-58315221

传真:010-58568062

客户服务电话:400-898-9999

网址:www.hrsec.com.cn

(27)名称:天风证券股份有限公司

注册地址:中国湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦四楼

办公地址:武汉市江汉区唐家墩路32号国资大厦B座四楼

法定代表人:余磊

联系人:翟璟

传真:027-87618863

客服电话:028-86711410

网址:www.tfzq.com

(28)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

(29)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

(30)名称:深圳众禄基金销售有限公司

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,基金买卖网www.jjmmw.com

(31)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:上海市徐汇区龙田路195号3C座9楼

法定代表人:其实

联系人:潘世友

电话:021-54509998

传真:021-64385308

客户服务电话:400-1818-188

网址:www.1234567.com.cn

(32)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

上海市虹口区欧阳路196号(法兰桥创意园)26号楼2楼

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

(33)名称:杭州数米基金销售有限公司

注册地址:杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号

办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼

法定代表人:陈柏青

联系人:张裕

传真:0571-26698533

客户服务电话:4000766123

公司网址:www.fund123.com

(34)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:单丙烨

传真:021-20691861

客服电话:400-089-1289

公司网站:www.erichfund.com

(35)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

(36)名称:北京展恒基金销售有限公司

注册地址:北京市顺义区后沙峪镇安富街6号

法定代表人:闫振杰

联系人:宋丽冉

电话:010-62020088

传真:010-62020355

客服电话:4008886661

网址:www.myfund.com

(37)名称:万银财富(北京)基金销售有限公司

住所:北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼3201内3201单元

办公地址:北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼3201内3201单元

法定代表人:王斐

客户服务电话:400-081-6655

传真:010-59393074

网址:http://www.wy-fund.com

(38)名称:北京钱景财富投资管理有限公司

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:魏争

电话:010-57418829

传真:010-57569671

客户服务电话:400-678-5095

网址:www.niuji.net

(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、诚浩证券、川财证券、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、宏信证券、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、开源证券、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、太平洋证券、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9,204户, 有效净认购总金额为594,657,619.35元人民币,认购资金的银行利息89,384.63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76,405.63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12,979.00元人民币。本基金有效净认购总额 594,657,619.35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76,405.63元人民币已于2015年5月13日全额划入本基金在基金托管人广发银行股份有限公司开立的申万菱信申银万国电子行业投资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12,979.00元人民币,将于下一季度银行结息日(2015年6月20日)划入本基金在基金托管人广发银行股份有限公司开立的申万菱信申银万国电子行业投资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2015年5月13日验资完毕,2015年5月14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《关于申万菱信申银万国电子行业投资指数分级证券投资基金备案确认的函》(证券基金机构监管部部函[2015] 1365号)的书面确认,本基金合同于2015年5月14日正式生效。

11、基金合同生效日:2015年5月14日。

12、基金合同生效日的基金份额总额:594,747,003.98份,其中,申万电子:316,302,024.98份,电子A:139,222,489份,电子B:139,222,490份。

二、本基金的日常申购、赎回业务安排

本基金管理人将于2015年5月28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、申万电子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【2015】221号

2、上市交易日期:2015年5月28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:申万电子A份额、申万电子B份额

场内简称:电子A、电子B

5、基金交易代码:电子A:150231、电子B:150232

6、本次上市交易份额(截止2015年5月21日):电子A:139,222,489份、电子B:139,222,490份

7、未上市交易份额的流通规定:未上市交易的申万电子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电子A和电子B, 分拆后的电子A和电子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,在申万电子A份额、申万电子B份额上市交易前或者开始办理申万电子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电子份额的基金份额净值、 申万电子A份额和申万电子B份额的基金份额参考净值。

在申万电子A份额、申万电子B份额上市交易后或者开始办理申万电子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, 披露开放日的申万电子份额的基金份额净值和基金份额累计净值、申万电子A份额和申万电子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电子份额的基金份额净值、申万电子A份额和申万电子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、申万电子份额的基金份额净值和基金份额累计净值、申万电子A份额和申万电子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2015年5月21日,基金份额持有人户数为9,204户,平均每户持有的基金份额为64,618.32份;其中,申万电子为8,531户,平均每户持有的基金份额为37,076.78份; 电子A为695户, 平均每户持有的基金份额为200,320.13份; 电子B为695户,平均每户持有的基金份额为200,320.13份。

二、持有人结构

截至2015年5月21日,本基金场内份额持有人结构如下:

机构投资者持有的本次上市交易的电子A份额为83,146,815份,占本次电子A上市交易基金份额比例为59.72%; 个人投资者持有的本次上市交易的电子A份额为56,075,674份,占本次电子A上市交易份额比例为40.28%。

机构投资者持有的本次上市交易的电子B份额为83,146,815份, 占本次电子B上市交易基金份额比例为59.72%;个人投资者持有的本次上市交易的电子B份额为56,075,675份,占本次电子B上市交易份额比例为40.28%。

三、截至2015年5月21日,前十名场内基金份额持有人情况:

| 序号 | 持有人名称(全称) | 持有电子A份额 | 占电子A份额比例 |
|---|---|---|---|
| 1 | 银河资本-邮储银行-青昀套利3号资产管理计划 | 25,000,486 | 17.96% |
| 2 | 西南证券股份有限公司 | 12,000,233 | 8.62% |
| 3 | 新华信托股份有限公司 | 10,000,194 | 7.18% |
| 4 | 银河资本-光大银行-银河资本-青昀1号资产管理计划 | 10,000,194 | 7.18% |
| 5 | 银河资本-光大银行-银河资本青昀套利2号资产管理计划 | 5,000,097 | 3.59% |
| 6 | 北京千石创富-华泰证券-艾方多策略对冲增强1号资产管理计划 | 4,000,077 | 2.87% |
| 7 | 北京千石创富-华泰证券-千石资本-艾方多策略对冲增强3号资产管理计划 | 4,000,077 | 2.87% |
| 8 | 朱小妹 | 2,515,048 | 1.81% |
| 9 | 李星影 | 2,500,389 | 1.80% |
| 10 | 银河资本-邮储银行-青昀套利4号资产管理计划 | 2,500,049 | 1.80% |
| 11 | 银河资本-邮储银行-青昀8号资产管理计划 | 2,500,049 | 1.80% |
| 合计 | | 80,016,893 | 57.47% |

| 序号 | 持有人名称(全称) | 持有电子B份额 | 占电子B份额比例 |
|---|---|---|---|
| 1 | 银河资本-邮储银行-青昀套利3号资产管理计划 | 25,000,486 | 17.96% |
| 2 | 西南证券股份有限公司 | 12,000,233 | 8.62% |
| 3 | 新华信托股份有限公司 | 10,000,194 | 7.18% |
| 4 | 银河资本-光大银行-银河资本-青昀1号资产管理计划 | 10,000,194 | 7.18% |
| 5 | 银河资本-光大银行-银河资本青昀套利2号资产管理计划 | 5,000,097 | 3.59% |
| 6 | 北京千石创富-华泰证券-艾方多策略对冲增强1号资产管理计划 | 4,000,078 | 2.87% |
| 7 | 北京千石创富-华泰证券-千石资本-艾方多策略对冲增强3号资产管理计划 | 4,000,078 | 2.87% |
| 8 | 朱小妹 | 2,515,049 | 1.81% |
| 9 | 李星影 | 2,500,388 | 1.80% |
| 10 | 北京千石创富-华泰证券-千石资本-艾方多策略对冲增强2号资产管理计划 | 2,500,049 | 1.80% |
| 11 | 银河资本-邮储银行-银河资本青昀套利7号资产管理计划 | 2,500,049 | 1.80% |
| 合计 | | 80,016,895 | 57.47% |

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: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十四个部门。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2015年5月21日,我公司共有130名员工,其中博士6人、硕士68人和本科53人,其他学历3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2015年5月21日, 申万菱信基金管理有限公司旗下共管理18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、申万菱信定期开放债券型发起式证券投资基金、申万菱信申银万国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和申万菱信中证军工指数分级证券投资基金。

7、本基金基金经理

张少华先生,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,基金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总监,量化投资部总经理,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、申万菱信中证申万证券行业指数分级、申万菱信中证环保产业指数,申万菱信中证军工指数分级和申万菱信申银万国电子行业投资指数分级基金经理。

二、基金托管人

1、基本情况

名称:广发银行股份有限公司(以下简称“广发银行”)

住所:广州市越秀区东风东路713号

办公地址:广州市越秀区东风东路713号

法定代表人:董建岳

注册日期:1988 年7月8日

注册资本:154 亿元人民币

托管部门联系人:成蕾

电话:010-65169618

传真:010-65169564

2、主要人员情况

广发银行股份有限公司总行设资产托管部,是从事资产托管业务的职能部门,内设业务运行处、监督管理处、期货业务处和产品营销处,部门全体人员均具备本科以上学历和基金从业资格,部门经理以上人员均具备研究生以上学历。

总经理寻卫国先生,管理学博士研究生学历,中国注册会计师、高级会计师,从事托管工作十三年,具有丰富的托管业务经验,是我国第一批从事QFII资产托管业务的人员之一。曾担任大型国有商业银行资产托管部托管业务运作中心副处长、交易监督处处长等职务。2014年4月,经中国证监会核准资格,任广发银行资产托管部总经理职务。

3、基金托管业务经营情况

广发银行股份有限公司于2009年5月4日获得中国证监会、银监会核准开办证券投资基金托管业务,基金托管业务批准文号:证监许可[2009]363号。

截至2015年3月31日,广发银行共托管公募基金16只,总规模362.84亿元,分别为长安产业精选混合型发起式基金、英大领先回报混合型发起式基金、广发钱袋子货币市场基金、安信鑫发优选混合基金、国泰聚信价值优势混合基金、广发全球医疗保健指数基金、新华安享惠金定期开放债券基金、广发天天红发起式货币市场基金、中海惠丰纯债分级债券型基金、金鹰元安保本混合型基金、长安货币市场基金、中银主题策略股票型基金、长安沪深300非周期行业指数基金、中欧盛世成长分级股票型基金、中欧增强回报债券型基金及国寿安保场内实时申赎货币基金。

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:赵钰

经办注册会计师:薛竞、赵钰

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电子行业投资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。

申万菱信申银万国电子行业投资指数分级证券投资基金2015年5月21日资产负债表(未经审计)如下:

| 资产 | |
|---|---|
| 资产: | |
| 银行存款 | 594,734,024.98 |
| 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 | |
| 应收证券清算款 | |
| 应收利息 | 107,052.12 |
| 应收股利 | |
| 应收申购款 | |
| 递延所得税资产 | |
| 其他资产 | 13,445.31 |
| 资产合计 | 594,854,522.41 |
| 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 | 114,060.28 |
| 应付托管费 | 25,093.27 |
| 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 | 9,177.77 |
| 负债合计 | 148,331.32 |
| 所有者权益: | |
| 实收基金 | 594,747,003.98 |
| 未分配收益 | -40,812.89 |
| 所有者权益合计 | 594,706,191.09 |
| 负债和所有者权益合计 | 594,854,522.41 |

注:报告截止日2015年5月21日,申万菱信申银万国电子行业投资指数分级证券投资基金之基础级别(以下简称“申万电子”)份额净值0.9999元,申万菱信申银万国电子行业投资指数分级证券投资基金A类(以下简称“电子A”)份额净值1.0011元,申万菱信申银万国电子行业投资指数分级证券投资基金B类(以下简称“电子B”)份额净值0.9987元; 申万电子份额316,302,024.98份, 电子A基金份额139,222,489.00份,电子B基金份额139,222,490.00份。

第八部分 基金投资组合

截止到2015年5月21日, 申万菱信申银万国电子行业投资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 | | |
| | 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 | 594,734,024.98 | 99.98 |
| 6 | 其他各项资产 | 120,497.43 | 0.02 |
| 7 | 合计 | 594,854,522.41 | 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 | 107,052.12 |
| 5 | 应收申购款 | |
| 6 | 其他应收款 | |
| 7 | 待摊费用 | |
| 8 | 其他 | 13,445.31 |
| 9 | 合计 | 120,497.43 |

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.cn) 进行公开披露,并已报送相关监管部门备案。

1、2015年4月18日, 刊登于基金管理人网站的申万菱信申银万国电子行业投资指数分级证券投资基金基金合同;

2、2015年4月18日,刊登于《中国证券报》、《上海证券报》及基金管理人网站的申万菱信申银万国电子行业投资指数分级证券投资基金基金合同摘要;

3、2015年4月18日, 刊登于基金管理人网站的申万菱信申银万国电子行业投资指数分级证券投资基金基金托管协议;

4、2015年4月18日,刊登于《中国证券报》、《上海证券报》及基金管理人网站的申万菱信申银万国电子行业投资指数分级证券投资基金基金份额发售公告;

5、2015年4月18日,刊登于《中国证券报》、《上海证券报》及基金管理人网站的申万菱信申银万国电子行业投资指数分级证券投资基金招募说明书;

6、2015年4月21日,刊登于《中国证券报》、《上海证券报》及基金管理人网站的申万菱信申银万国电子行业投资指数分级证券投资基金上网发售提示性公告;

7、2015年4月21日,刊登于《中国证券报》、《上海证券报》及基金管理人网站的关于旗下部分开放式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;

8、2015年4月27日,刊登于《中国证券报》、《上海证券报》及基金管理人网站的关于旗下申万菱信申银万国电子行业投资指数分级证券投资基金新增中国工商银行股份有限公司为代销机构的公告;

9、2015年5月16日,刊登于《中国证券报》、《上海证券报》及基金管理人网站的申万菱信申银万国电子行业投资指数分级证券投资基金基金合同生效公告。

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)《申万菱信申银万国电子行业投资指数分级证券投资基金基金合同》

(三)《申万菱信申银万国电子行业投资指数分级证券投资基金托管协议》

(四)《申万菱信申银万国电子行业投资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
2015年5月25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:上海市中山南路100号11层

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、申万电子份额的基金份额净值、申万电子A份额和申万电子B份额的基金份额参考净值,确定申万电子份额申购、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活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:广发银行股份有限公司

住所:广州市越秀区东风东路713号

法定代表人:董建岳

成立时间:1988年7月8日

批准设立机关和批准设立文号:广东省工商行政管理局440000000046541

组织形式:股份有限公司

注册资本:154亿元人民币

存续期间:持续经营

基金托管资格批文及文号:中国证监会、中国银监会《关于核准广东发展银行证券投资基金托管资格的批复》,证监许可[2009]363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、期货账户、为基金办理证券、期货交易资金清算;

(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;对所托管的不同的基金分别设置账户,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、证券账户和期货账户等投资所需账户,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予以保密,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、申万电子份额的基金份额净值、申万电子A份额和申万电子B份额的基金份额参考净值、申万电子份额申购、赎回价格;

(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; 如果基金管理人有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15年以上;

(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管理人、基金份额持有人依法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、依法被撤销或者被依法宣告破产时,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法律法规和基金合同规定履行自己的义务,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议;

(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。

(下转B006版)

## 关于申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金不定期折算业务期间停复牌的公告

根据《申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定,申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)以2015年5月22日为折算基准日办理不定期份额折算业务,申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金B份额(以下简称“环保B”,基金代码:150185)于2015年5月25日暂停交易,于2015年5月26日9:30至10:30暂停交易一小时,并将于2015年5月26日上午10:30恢复交易。

根据深圳证券交易所《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》,本基金完成份额折算后的次一交易日为环保B复牌首日,当日即时行情显示的环保B前收盘价为前一交易日环保B的份额净值(四舍五入至0.001元),即2015年5月26日即时行情显示的环保B的前收盘价为环保B 2015年5月25日的份额净值,2015年5月26日当日环保B可能出现交易价格大幅波动的情形。敬请投资者注意投资风险。

本基金份额折算业务规则详见2015年5月22日刊登于《中国证券报》、《证券时报》与基金管理人网站(www.swsmu.com)的《关于申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金办理不定期折算业务的公告》。

截至目前,除上述份额折算事项外,本基金运作正常,无其他应披露而未披露的重大信息。

特此公告。

申万菱信基金管理有限公司
2015年5月25日