申万菱信基金管理有限公司申万菱信中小板指数证券投资基金（LOF）上市交易公告书

基金管理人：申万菱信基金管理有限公司
基金托管人：中国农业银行股份有限公司
公告日期：2017年5月23日
上市日期：2017年5月26日

第一部分　重要声明与提示

《申万菱信中小板指数证券投资基金（LOF）上市交易公告书》（以下简称“本公告”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号（上市交易公告书的内容与格式）》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，申万菱信中小板指数证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）管理人的董事会及董事保证本公告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金托管人中国农业银行股份有限公司保证本公告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。中国证监会、深圳证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。

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

第二部分　基金概览

一、基金名称：申万菱信中小板指数证券投资基金（LOF）
基金简称：申万菱信中小板指数（LOF）
场内简称：申万中小
基金代码：163111
二、基金类型：股票型
三、基金运作方式：上市契约型开放式
四、本基金的存续期限：不定期
五、基金份额总额：截至2017年5月19日，本基金的基金份额总额为312,012,669.76份。
六、基金份额净值：截至2017年5月19日，本基金的基金份额净值为0.9863元。
七、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所
八、上市交易日期：2017年5月26日
九、基金管理人：申万菱信基金管理有限公司
十、基金托管人：中国农业银行股份有限公司
十一、本次上市交易的基金份额注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

第三部分　基金的历史、转型、日常申赎、上市交易和跨系统转托管

一、本基金的历史

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

申万菱信中小板指数分级证券投资基金的基金管理人为申万菱信基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。基金管理人于2012年5月8日获得中国证监会书面确认，《申万菱信中小板指数分级证券投资基金基金合同》生效，募集规模为784,503,291.30份（含利息结转的份额）。

二、本基金的转型

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

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

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

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

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

三、本基金的日常申购、赎回

本基金管理人于2017年5月10日开始办理本基金的日常申购、赎回业务。

四、本基金上市交易的主要内容

1、本基金上市交易的核准机构和核准文号：深证上【2017】325号
2、上市交易日期：2017年5月26日
3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所
投资者在深圳证券交易所务会员单位证券营业部均可参与基金交易。
4、基金场内简称：申万中小
5、基金交易代码：163111
6、本次上市交易份额：201,492,154.00份（截至2017年5月19日）
7、未上市交易份额的流通规定：未上市交易的份额托管在场外，持有人将其转托管至深圳证券交易所场内后即可上市流通。
8、基金资产净值的披露：基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露本基金的基金份额净值和基金份额累计净值。

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

五、本基金转托管的主要内容

基金份额持有人自2017年5月10日起可以开始办理本基金转托管业务，转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。

第四部分　持有人户数、持有人结构及前十名持有人

一、持有人户数

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

二、持有人结构

截至2017年5月19日，本基金场内份额持有人结构如下：

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

三、截至2017年5月19日，前十名场内基金份额持有人情况：

序号	持有人名称	持有份额	占场内基金总份额比例
1	中国对外经济贸易信托有限公司-光大稳健1号信托计划	33,396,348	16.57%
2	中国对外经济贸易信托有限公司-资产配置固定收益信托	14,449,243	7.17%
3	中国太平洋财产保险-传统-普通保险产品-013C-CT001深	9,491,412	4.71%
4	申万菱信基金-工商银行-中国工商银行股份有限公司私人银行部	5,311,405	2.64%
5	宋伟铭	5,146,092	2.55%
6	太平洋资管-建设银行-太平洋第三极稳定增值混合型产品	5,009,536	2.49%
7	太平洋资管-建设银行-太平洋智选换基FOF型产品	3,997,882	1.98%
8	叶宁	3,761,797	1.87%
9	张美芳	2,533,092	1.26%
10	中国太保集团股份有限公司-本级-集团自有资金-012G-ZY001深	2,355,176	1.17%
合计		85,450,983	42.41%

第五部分　基金主要当事人简介

一、基金管理人

1、公司概况
名称：申万菱信基金管理有限公司
法定代表人：刘郎
总经理：来肖贤
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十七个部门。其中，投研部门主要负责研究、投资管理、投资交易等工作；专户部门主要负责专户客户的开发及维护，专户资产的投资运作等工作；市场营销部门主要负责基金产品销售、营销和市场推广等工作；风控合规部门主要负责投资的事前、事中、事后风险、绩效评估和法务、合规等工作；后台运作部门主要负责会计估值与核算、注册登记等日常运营业务，信息系统的管理和维护，财务会计、行政管理，董事会和人力资源管理等工作。

4、人员情况

截至2017年5月19日，我公司共有172名员工，其中博士6人、硕士109人和本科53人，其他学历4人。

5、信息披露负责人：王菲萍
咨询电话：400 880 8588
6、基金管理业务情况

截止2017年5月19日，申万菱信基金管理有限公司旗下共管理31只开放式基金，分别为申万菱信盛利精选证券投资基金、申万菱信沪深300指数增强型证券投资基金、申万菱信新动力混合型证券投资基金、申万菱信收益宝货币市场基金、申万菱信新经济混合型证券投资基金、申万菱信竞争优势混合型证券投资基金、申万菱信添益宝债券型证券投资基金、申万菱信消费增长混合型证券投资基金、申万菱信沪深300价值指数证券投资基金、申万菱信深证成指分级证券投资基金、申万菱信稳益宝债券型证券投资基金、申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)、申万菱信可转换债券债券型证券投资基金、申万菱信中小板指数证券投资基金（LOF）、申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金、申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金、申万菱信中证军工指数分级证券投资基金、申万菱信多策略灵活配置混合型证券投资基金、申万菱信安鑫回报灵活配置混合型证券投资基金、申万菱信新能源汽车主题灵活配置混合型证券投资基金、申万菱信中证申万电子行业投资指数分级证券投资基金、申万菱信中证申万传媒行业投资指数分级证券投资基金、申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金、申万菱信中证500指数增强型证券投资基金、申万菱信中证申万新兴健康产业主题投资指数证券投资基金(LOF)、申万菱信金鑫优选混合型证券投资基金、申万菱信安鑫精选混合型证券投资基金、申万菱信中证500指数优选增强型证券投资基金、申万菱信臻选6个月定期开放混合型证券投资基金、申万菱信智选一年期定期开放混合型证券投资基金和申万菱信量化成长混合型证券投资基金。

7、本基金基金经理

袁英杰先生，硕士研究生，曾任职于兴业证券、申银万国证券研究所等，2013年5月加入申万菱信基金管理有限公司，曾任高级数量研究员，基金经理助理，现任申万菱信深证成指分级证券投资基金、申万菱信中小板指数证券投资基金（LOF）、申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金、申万菱信中证环保产业指数证券投资基金、申万菱信中证军工指数分级证券投资基金、申万菱信中证申万电子行业投资指数分级证券投资基金、申万菱信中证申万传媒行业投资指数分级证券投资基金、申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金、申万菱信中证500指数增强型证券投资基金、申万菱信沪深300指数证券投资基金、申万菱信中证500指数优选增强型证券投资基金、申万菱信臻选6个月定期开放混合型证券投资基金、申万菱信智选一年期定期开放混合型证券投资基金管理。

俞诚先生，经济学学士，FRM。2009年开始从事证券相关工作，2009年8月加入申万菱信基金管理有限公司，历任产品与金融工程总部金融工程师，数量研究员，现任申万菱信沪深300价值指数证券投资基金、申万菱信深证成指分级证券投资基金、申万菱信中小板指数证券投资基金（LOF）、申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金、申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金、申万菱信中证军工指数分级证券投资基金、申万菱信中证申万电子行业投资指数分级证券投资基金、申万菱信中证申万传媒行业投资指数分级证券投资基金、申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金、申万菱信中证500指数增强型证券投资基金基金经理。

二、基金托管人

1、基本情况
名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）
住所：北京市东城区建国门内大街69号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座
法定代表人：周慕冰
成立日期：2009年1月15日
批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13号
基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]23号
注册资本：32,479,411.7万元人民币
存续期间：持续经营
联系电话：010-66060069
传真：010-68121816
联系人：林葛

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分，总行设在北京。经国务院批准，中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于2009年1月15日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡，成为国内网点最多、业务辐射范围最广，服务领域最广，服务对象最多，业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外，中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉，每年位居《财富》世界500强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行，中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念，坚持审慎稳健经营、可持续发展，立足县域和城市两大市场，实施差异化竞争策略，着力打造“伴你成长”服务品牌，依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品，致力为广大客户提供优质的金融服务，与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行，经验丰富，服务优质，业绩突出，2004年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007年中国农业银行通过了美国SAS70内部控制审计，并获得无保留意见的SAS70审计报告，自2010年起中国农业银行连续通过托管业务国际内控标准（ISAE3402）认证，表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设，品牌声誉进一步提升，在2010年首届“‘金牌理财’TOP10颁奖盛典”中成绩突出，获“最佳托管银行”奖。2010年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。2012年荣获第十届中国财经风云榜“最佳资产托管银行”称号；2013年至2015年连续三年荣获上海清算所授予的“托管银行优秀奖”和中央国债登记结算有限责任公司授予的“优秀托管机构奖”称号；2015年荣获中国银行业协会授予的“养老金业务最佳发展奖”称号。

中国农业银行证券投资基金托管部于1998年5月经中国证监会和中国人民银行批准成立，2014年更名为托管业务部/养老金管理中心，内设综合管理处、证券投资基金托管处、委托资产托管处、境外资产托管处、保险资产托管处、风险管理处、技术保障处、营运中心、市场营销处、内控监管处、账户管理处，拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工近140名，其中具有高级职称的专家30余名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有20年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。

3、基金托管业务经营情况

截止到2016年12月31日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共349只。

三、验资机构

会计师事务所：普华永道中天会计师事务所有限公司（现普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙））
注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
法定代表人姓名：杨绍信
电话：+86-21-23238888
传真：+86-21-23238800
经办注册会计师：薛竞、张鸿

第六部分　基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

第七部分　基金财务状况

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

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

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

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

第八部分　基金投资组合

截止到2017年5月19日，申万菱信中小板指数证券投资基金（LOF）的投资组合如下：

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	291,657,658.02	93.36
	其中：股票	291,657,658.02	93.36
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	20,578,570.95	6.59
6	其他各项资产	165,054.91	0.05
7	合计	312,401,283.88	100.00

注：本基金未开通沪港通交易机制投资于港股。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,707,069.84	0.55
B	采矿业	-	-
C	制造业	203,057,950.00	65.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	10,067,078.86	3.27
F	批发和零售业	8,014,975.50	2.60
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	29,684,120.42	9.65
J	金融业	19,151,263.93	6.22
K	房地产业	3,840,695.00	1.25
L	租赁和商务服务业	8,739,617.60	2.84
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,549,490.72	0.83
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	4,845,396.15	1.57
S	综合	-	-
	合计	291,657,658.02	94.78

5.2.2报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金未开通沪港通交易机制投资于港股。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002415	海康威视	589,335	15,664,524.30	5.09
2	002450	康得新	476,782	9,511,800.90	3.09
3	002304	洋河股份	109,776	9,078,475.20	2.95
4	002024	苏宁云商	763,331	8,014,975.50	2.60
5	002241	歌尔股份	348,291	6,196,096.89	2.01
6	002142	宁波银行	351,930	6,088,389.00	1.98
7	002456	欧菲光	152,967	5,919,822.90	1.92
8	002466	天齐锂业	127,421	5,694,444.49	1.85
9	002230	科大讯飞	189,988	5,576,147.80	1.81
10	002008	大族激光	171,449	5,544,660.66	1.80

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

根据本基金基金合同，本基金不得参与股指期货交易。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金基金合同，本基金不得参与股指期货交易。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货交易。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货交易。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

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

5.11.2基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3其他资产构成

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

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

第九部分　重大事件揭示

本基金自转换至上市交易期间未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

第十部分　基金管理人承诺

本基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、《基金合同》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、深圳证券交易所的监督管理。

（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

第十一部分　基金托管人承诺

基金托管人就本基金上市交易后履行托管人职责做出如下承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，设立专门的基金托管部，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员负责基金财产托管事宜。

（二）根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。

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

（四）基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，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）《申万菱信中小板指数分级证券投资基金基金合同》
（三）《申万菱信中小板指数分级证券投资基金基金托管协议》
（四）《申万菱信中小板指数分级证券投资基金招募说明书》
（五）法律意见书
（六）基金管理人业务资格批件、营业执照
（七）基金托管人业务资格批件、营业执照

申万菱信基金管理有限公司
2017年5月23日

附件：基金合同摘要

一、基金管理人、基金托管人及基金份额持有人的权利与义务

（一）基金管理人

1、基金管理人简况
名称：申万菱信基金管理有限公司
注册地址：上海市淮海中路300号香港新世界大厦40楼
办公地址：上海市淮海中路300号香港新世界大厦40楼
邮政编码：200021
法定代表人：姜国芳
成立时间：2004年1月15日
批准设立机关：中国证券监督管理委员会
批准设立文号：中国证监会证监基金字【2003】144号文
组织形式：有限责任公司
注册资本：壹亿伍仟万元人民币
存续期限：持续经营
联系电话：+86-21-23261188

2、基金管理人的权利和义务

（1）根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

1）依法募集基金；
2）自《基金合同》生效之日起，依照有关法律法规和《基金合同》的规定独立运用并管理基金财产；
3）依照《基金合同》获得基金管理人报酬以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
4）销售基金份额；
5）召集基金份额持有人大会
6）根据《基金合同》及有关法律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，拒绝或暂停受理申万中小板份额申购、赎回和转换申请；
12）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
13）根据国家有关规定，在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金融资；
14）以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
15）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
16）在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户的业务规则；
17）法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

（2）根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

1）依法募集基金，办理或者委托经由证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
2）办理基金备案手续；
3）自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；
4）配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
5）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金财产分别管理，分别记账，进行证券投资；
6）除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
7）依法接受基金托管人的监督；
8）采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，申万中小板份额的基金份额净值、分级运作期内中小板A份额与中小板B份额的基金份额参考净值，分级运作期内中小板A份额与中小板B份额终止运作后的份额转换比例，分级运作期到期中小板A份额与中小板B份额的到期折算比例；
9）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
10）编制季度、半年度和年度基金报告；
11）严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
12）保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；
13）按照《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
14）按相关规定受理申万中小板份额的申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
15）依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
16）按规定保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料15年以上；
17）确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的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，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
21）监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
22）当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方有关基金事务的行为承担责任；
23）以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
24）基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后30 日内退还认购基金认购人；
25）执行生效的基金份额持有人大会的决定；
26）建立并保存基金份额持有人名册；
27）法律法规、《基金合同》规定的以及中国证监会要求的其他义务。

（二）基金托管人

1、基金托管人简况
名称：中国农业银行股份有限公司
住所：北京市东城区建国门内大街69号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座
法定代表人：蒋超良
成立时间：2009年1月15日
批准设立机关和批准设立文号：国发【1979】056号
组织形式：股份有限公司
注册资本：32,479,411.7万元人民币
存续期间：持续经营
基金托管资格批文及文号：《关于核准中国农业银行证券投资基金托管人资格的批复》，中国证监会证监基字【1998】23号

2、基金托管人的权利和义务

（1）根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

1）自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；
2）依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用；
3）监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人有违反《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，提名新任基金管理人；
7）法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

（2）基金托管人的义务

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

1）以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；
2）设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
3）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同基金财产分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；
4）除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
5）保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
6）按规定开设基金财产的资金账户和证券账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
7）保守基金商业秘密。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；
8）复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和申万中小板份额的基金份额净值、分级运作期内中小板A份额与中小板B份额的基金份额参考净值，分级运作期内中小板A份额与中小板B份额终止运作后的份额转换比例，分级运作期到期中小板A份额与中小板B份额到期折算比例；
9）办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
10）对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人有未执行《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不少于15年；
12）建立并保存基金份额持有人名册；
13）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
14）依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
15）依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；
16）按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；
17）参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
18）面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会和银行监督机构，并通知基金管理人；
19）因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
20）按规定监督基金管理人按照法律法规规定和《基金合同》履行其义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；
21）执行生效的基金份额持有人大会的决定；
22）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

（三）基金份额持有人

基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，基金投资者自依据《基金合同》取得的基金份额，即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。

分级运作期内，本基金除中小板A份额与中小板B份额的基金份额参考净值计算、《基金合同》终止时的基金清算财产分配、中小板A份额与中小板B份额终止运作后的份额转换外，本基金每份基金份额具有同等的合法权益。分级运作期结束，本基金转换为上市开放式基金（LOF）后，本基金每份基金份额具有同等的合法权益。

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关法律法规的规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

（1）分享基金财产收益；
（2）参与分配清算后的剩余基金财产；
（3）在分级运作期内依法转让其持有的中小板A份额和中小板B