申万菱信中小板指数分级证券投资基金招募说明书

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
二零一二年三月

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

申万菱信中小板指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)由申万菱信基金管理有限公司(以下简称“本公司”或“本基金管理人”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《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》、《申万菱信中小板指数分级证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)及其他有关规定募集,并经中国证监会2012年2月16日证监许可【2012】197号文核准募集。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准,但中国证监会对本基金作出的任何决定,均不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

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本基金财产,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。

基金的过往业绩并不预示其未来的表现。

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资者在投资本基金前,需充分了解本基金的产品特性,并承担基金投资中出现的各类风险,包括:因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险,基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险,本基金的特定风险(如分级运作期内中小板A份额与中小板B份额持有人的特有风险,基金份额的折溢价交易风险、运作终止风险、份额配对转换及份额折算风险等)等等。

本基金的分级运作期为自《基金合同》生效之日(含《基金合同》生效之日)起五个运作周年的时间区间。分级运作期内本基金的基金份额包括申万菱信中小板指数分级证券投资基金之基础份额(简称“申万中小板指数”)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”)与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”)。其中中小板A份额、中小板B份额的基金份额比始终保持1:1的比例不变。分级运作期结束,中小板A份额、中小板B份额转按照《基金合同》约定折算成场内申万中小板份额,本基金转换为上市开放式基金(LOF),基金份额仅包括申万中小板份额。

本基金场外认购首次单笔认购最低金额为人民币50,000元,(含认购费、下同),追加认购的单笔认购最低金额为人民币50,000元。本基金通过具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位进行场内认购的单笔最低认购份额为50,000份,超过50,000份的须是1,000份的整数倍,且每笔认购最大不得超过99,999,000份。在本基金分级运作期内,申万中小板份额单笔申购(包括场外申购和场内申购)的最低金额为人民币50,000元(含申购费);分级运作期结束本基金转为上市开放式基金(LOF)后,申万中小板份额单笔申购(包括场外申购和场内申购)的最低金额为人民币1,000元(含申购费);投资者当期分配的基金收益转购基金份额时,不受此最低申购金额的限制。

投资者在进行投资决策前,请仔细阅读本基金的招募说明书及《基金合同》。

一、绪言

《申万菱信中小板指数分级证券投资基金招募说明书》(以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”)依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《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》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》及其他相关法律法规及《申万菱信指数分级证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)编写。

本基金管理人承诺本招募说明书不存在任何重大遗漏,并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。

本基金是根据本招募说明书所载明的资料募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息,或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书由本基金管理人根据《基金合同》编写,并经中国证监会核准,主要向投资者披露本基金及与本基金相关事项的信息,是投资者拟以选择及决定是否投资于本基金的要约邀请文件。《基金合同》是规定《基金合同》当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资者自依据《基金合同》取得基金份额,即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人,其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。投资者按照法律法规和《基金合同》的规定享有权利、承担义务。本基金投资者法定了解本基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅《基金合同》。

二、释义

在本招募说明书中,除非文意另有所指,下列词语或简称具有如下含义:

1、基金或本基金:指申万菱信中小板指数分级证券投资基金。

2、基金管理人或本基金管理人:指申万菱信基金管理有限公司。

3、基金托管人或本基金托管人:指中国农业银行股份有限公司。

4、《基金合同》:指《申万菱信中小板指数分级证券投资基金基金合同》及对《基金合同》的任何有效修订和补充。

5、托管协议:指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《申万菱信中小板指数分级证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充。

6、招募说明书或本招募说明书:指《申万菱信中小板指数分级证券投资基金招募说明书》及其定期的更新。

7、基金份额发售公告:指《申万菱信中小板指数分级证券投资基金份额发售公告》。

8、上市交易公告书:指《申万菱信中小板指数分级证券投资基金之中小板A份额与中小板B份额上市交易公告书》。《申万菱信中小板指数分级证券投资基金(LOF)上市交易公告书》。

9、法律法规:指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对《基金合同》当事人有约束力的决定、决议、通知等。

10、《基金法》:指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过,自2004年6月1日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时作出的修订。

11、《销售办法》:指中国证监会2011年6月9日颁布、同年10月1日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订。

12、《信息披露办法》:指中国证监会2004年6月8日颁布、同年7月1日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及对其不时作出的修订。

13、《运作办法》:指中国证监会2004年6月29日颁布、同年7月1日实施的《证券投资基金运作管理办法》及对其不时作出的修订。

14、分级运作期:本基金分级运作期共包含五个运作周年。分级运作期到期,本基金将按照《基金合同》约定转换为上市开放式基金(LOF),中小板A份额、中小板B份额将按照《基金合同》约定折算成场内申万中小板份额。

15、运作周年:指分级运作期内自某运作周年开始日起至该运作周年结束日止的运作期间。《基金合同》生效之日为第一个运作周年的开始日,其他运作周年的开始日为上一个运作周年结束日的次日。第一、第二、第三及第四个运作周年的结束日为其开始日至满一周年的最后一日(简称“对应日”),若某运作周年的对应日为非工作日,则该运作周年的结束日顺延至其对应日之后的第一个工作日,第五个运作周年的结束日为基金合同生效之日至满五周年的最后一日(简称“五周年日”),若五周年日为非工作日,则第五个运作周年的结束日顺延至五周年日之后的第一个工作日。

假设本基金的《基金合同》生效之日为2012年2月16日,则第一个运作周年的开始日为2012年2月16日,第一个运作周年的对应日为2013年2月15日,若该对应日为工作日,则该对应日即为结束日;若该对应日为非工作日,则第一个运作周年的结束日顺延至2013年2月15日之后的第一个工作日。本基金的五周年日为2017年2月15日,若五周年日为工作日,则第五个运作周年的结束日即为2017年2月15日;若五周年日为非工作日,则第五个运作周年的结束日顺延至2017年2月15日之后的第一个工作日。

16、分级运作期到期日:指第五个运作周年的结束日。

17、分级运作期到期时基金转换:指分级运作期到期时,本基金将按照《基金合同》约定转换为上市开放式基金(LOF)的行为。转换后基金名称变更为“申万菱信中小板指数分级证券投资基金(LOF)”。

18、申万中小板份额:指申万菱信中小板指数分级证券投资基金之基础份额。

19、中小板A份额:指分级运作期内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。

20、中小板B份额:指分级运作期内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。

21、基金份额分级:指在分级运作期内本基金的基金份额包括申万菱信中小板指数分级证券投资基金之基础份额、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与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,中小板A份额、中小板B份额的基金份额比始终保持1:1的比例不变。

22、年基准收益率:指本基金为中小板A份额设定的每个运作周年应得的收益率,中小板A份额的年基准收益率=一年期银行定期存款利率(税后)×3.50%,其中,一年期银行定期存款利率是指每个运作周年的第一天中国人民银行公布并执行的金融机构人民币一年期整存整取基准年利率。年基准收益率除以运作周年的实际天数为日基准收益率,其对应的日分配金额称为日基准收益,日基准收益以面值1,000元为基准来取单利进行计算。

23、中国:指中华人民共和国,就《基金合同》而言,不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区。

24、中国证监会:指中国证券监督管理委员会。

25、银行业监督管理机构:指中国人民银行和中国银行业监督管理委员会。

26、《基金合同》当事人:指受《基金合同》约束,根据《基金合同》享有权利并承担义务的法律主体,包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。

27、个人投资者:指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人。

28、机构投资者:指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经政府有关部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织。

29、合格境外机构投资者:指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理办法》及其他相关法律法规规定的条件,经中国证监会批准可投资于中国证券市场,并取得国家外汇管理局额度批准的中国境外的机构投资者。

30、基金投资者:指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者,以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者的合称。

31、基金份额持有人:指依招募说明书和《基金合同》合法取得基金份额的基金投资者。

32、基金销售业务:指基金管理人或销售机构宣传推介基金、发售基金份额、办理基金份额的申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务。

33、销售机构:指直销机构和代销机构。

34、直销机构:指申万菱信基金管理有限公司。

35、代销机构:指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件,取得基金代销业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议,代为办理基金销售业务的机构,以及可通过深圳证券交易所交易系统办理基金销售业务的会员单位。

36、会员单位:指深圳证券交易所会员单位。

37、基金销售网点:指直销机构的直销中心及代销机构的代销网点。

38、登记业务:指基金登记、存管、过户、清算和结算业务,具体内容包括基金投资者基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等。

39、登记机构:指办理登记业务的机构。基金的登记机构为申万菱信基金管理有限公司或接受申万菱信基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构,本基金的登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。

40、上市交易所:指深圳证券交易所。

41、基金账户:指登记机构为基金投资者开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户。

42、基金交易账户:指销售机构为基金投资者开立的、记录基金投资者通过该销售机构办理交易业务而引起的基金份额的变动及结余情况的账户。

43、《基金合同》生效之日:指基金募集达到法律法规规定及《基金合同》规定的条件,基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕,并获得中国证监会书面确认的日期。

44、《基金合同》终止日:指《基金合同》规定的《基金合同》终止事由出现后,基金财产清算完毕,清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期。

45、基金募集期限:指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间,最长不得超过3个月。

46、存续期:指《基金合同》生效至终止之间的不定期期限。

47、工作日:指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日。

48、日:指公历日。

49、月:指公历月。

50、T日:指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日。

51、T+n日:指自T日起第n个工作日(不包含T日)。

52、开放日:指为基金投资者办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日。

53、开放时间:指开放日基金投资者申购、赎回或其他交易的时间段。

54、销售场所:指场外销售场所和场内销售场所,分别简称“场外”和“场内”。

55、场外:指通过深圳证券交易所交易系统外的销售机构办理本基金基金份额的认购(场外认购的全部份额将确认为申万中小板份额)、申万中小板份额申购和赎回的场所。

56、场内:指通过深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位利用深圳证券交易所交易系统办理本基金相关基金份额的认购、申购、赎回和上市交易的场所。

57、认购:指在基金募集期间,基金投资者通过场内或场外申请购买基金份额的行为。

58、申购:指在基金存续期内,基金投资者通过场内或场外申请购买申万中小板份额的行为。

59、赎回:指在基金存续期内基金投资者持有人按《基金合同》规定的条件和销售网点规定的手续,通过场内或场外向基金管理人卖出申万中小板份额的行为。

60、巨额赎回:指本基金单个开放日,基金净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过上一开放日基金总份额10%的情形。

61、登记系统:指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记系统,通过场外销售机构认购、申购的基金份额登记在登记系统。

62、证券登记结算系统:指中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统,通过场内会员单位认购、申购或买入的基金份额登记在证券登记结算系统。

63、上市交易:指投资者通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖基金份额的行为。

64、场外份额:指登记在登记系统下的基金份额。

65、场内份额:指登记在证券登记结算系统下的基金份额。

66、基金转换:指基金份额持有人按照《基金合同》和基金管理人届时有效公告规定的条件,申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的行为。

67、系统内转托管:指基金份额持有人将其持有的基金份额在登记系统内不同销售机构(或上交所席位)之间或证券登记结算系统内不同会员单位(交易单元)之间进行转托管的行为。

68、跨系统转托管:指基金份额持有人将其持有的基金份额在登记系统和证券登记结算系统之间进行转托管的行为。

69、份额配对转换:指根据《基金合同》约定,在分级运作期内本基金的申万中小板份额与中小板A份额、中小板B份额之间的配对转换,包括分拆与合并两个方面。

70、分拆:指在分级运作期内根据《基金合同》的约定,基金份额持有人将其持有的每一份申万中小板份额的场内份额申请转换成一份中小板A份额与一份中小板B份额的行为。

71、合并:指在分级运作期内根据《基金合同》的约定,基金份额持有人将其持有的每一份中小板A份额与一份中小板B份额进行配对申请转换成两份申万中小板份额的场内份额的行为。

72、分级运作期到期基金份额的折算:指分级运作期到期,将中小板A份额、中小板B份额按照各自的份额参考净值与申万中小板份额净值之比折算成场内申万中小板份额的行为。

73、中小板指数:指中小企业板价格指数,指数代码为399005,发布于2006年01月24日。

74、定期定额投资计划:指投资者通过有关销售机构提出申请,约定每期申购日、扣款金额及扣款方式,由销售机构于每期约定扣款日在投资者指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式。

75、元:指人民币元。

76、基金收益:指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、证券持有期间的公允价值变动、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约。

77、基金资产总值:指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和。

78、基金资产净值:指基金资产总值减去基金负债后的价值。

79、基金资产估值:指计算评估基金资产和负债的价值,以确定基金资产净值的过程。

80、指定媒体:指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒体。

81、《业务规则》:指申万菱信基金管理有限公司、深圳证券交易所和中国证券登记有限责任公司的相关业务规则,是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则,由基金管理人和基金投资者共同遵守。

82、不可抗力:指《基金合同》当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件。

三、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

联系人:王菲萍

股本结构: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

(二)主要人员情况

1、董事会成员

姜国芳先生,董事长,1957年出生,高级经济师,工商管理硕士。1980年至1984年任职于中国人民银行上海市分行,1984年至1992年任职于中国工商银行上海市分行组织处,1992年至1996年任职于上海中银证券有限公司,董事副总经理,党委副书记。1996年至2004年2月任中银万国证券股份有限公司执行副总裁,兼中银万国(香港)有限公司董事长。

杜平先生,董事,1963年出生,经济师,法学硕士,1989年至1990年在湖北省武汉市政策研究室任科员,副主任科员,1990年底至1993年初在湖北省武汉市政府办公厅任副市长秘书、主任科员。1993年初至1998年初在交通银行总行秘书处、条法处先后担任副行长秘书、行长秘书、党组秘书。1998年起任交通银行深圳分行副行长,2000年7月任交通银行新加坡分行行长。2003年10月起加盟申银万国证券股份有限公司,任公司副总裁。

刘郧先生,董事,1961年出生,副教授,硕士研究生。1982年至1983年在湖南邵阳学院物理系任教,1986年至1994年在东南大学哲学系担任系副主任。1994年至2003年底在泰阳证券公司任公司总裁。2004年任万家证券总裁。2006年6月至2007年1月在广州城市商学院担任主任。2007年1月至3月在大通证券公司担任副总经理。2007年5月至今担任申万菱信基金管理有限公司副总裁。

宫本荣一先生,董事,1960年出生,金融学硕士。1982年4月至今在三菱UFJ信托银行株式会社职,历任综合企划部副部长,经营企划部副部长,投资企划部副部长等职。现担任三菱UFJ信托银行株式会社执行董事并兼任海外资产管理事业部部长。

陈志成先生,董事,1955年出生,日本籍。1990年7月至今在三菱UFJ信托银行株式会社任职,历任中国业务科长、中国业务科长、上海代表处首席代表,现任北京代表处首席代表。

冯根福先生,独立董事,1957年出生,二级教授,博士生导师,经济学博士。1982年至2000年在陕西财经学院工作,历任陕西财院学报主编、陕西财院工商学院院长。2000年5月至今在西安交通大学经济与金融学院担任院长。

张军建先生,独立董事,1956年出生,教授,博士研究生。1983年至1988年在四川外国语大学任教。1988年至1990年在日本长崎县立大学任特聘讲师。1990年至1998年在日本千叶大学先后担任特聘讲师,客座教授和早稻田大学非常勤讲师。1998年-2000年在日本麦南开发株式会社中国事业部任部长兼法律顾问。2001年至今在中南大学法学院教授,中国经济法研究所长,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。

阎小平先生,独立董事,1948年出生,硕士研究生,高级经济师。1969年开始工作,1984年进入金融行业,1984年1月至2001年1月在中国工商银行人事部历任科员,副处长、处长、主任及副主任等职务;2001年1月至2008年12月在工商银行北京市分行历任副行长、副书记等职务;2009年1月起退休。

李秀全先生,独立董事,1956年出生,大学本科学历,高级经济师。1969年开始工作,1979年3月至1993年5月在工商银行上海分行卢湾和长宁支行历任会计、分理处主任、党委副书记、书记、行长等职务;1993年6月至2004年3月在工行上海分行历任总稽核、行长助理等职务;2004年5月至2005年8月在上海农村信用合作社联合社任党委书记、理事长;2005年9月至2008年12月在上海农村商业银行任党委书记、董事长;2009年1月至12月在市金融党委科学发展观活动任指导检查组二组组长;2010年1月起退休。

2、监事会成员

蒋元真先生,男,监事会主席,1953年出生,高级会计师、高级经济师。1983至1985年在上海市财政局企业财务一处任科员。1985年底至1987年在上海市财税二分局任副主任科员。1987至1998年在上海市税务局外税处历任副处长、处长。1998年至2000年在上海国际信托投资公司历任计财部经理、财务部经理、财务部副总经理。2000年-2010年在上海国际集团有限公司历任副总经理(其中:2003年-2010年在上海证券有限责任公司任董事长)2010年至今在中银万国证券股份有限公司任党委委员、监事会主席。

正冈利之先生,监事,1957年出生,日本籍。1982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),历任资产运用部次长、公共资金运用部次长、受托运用部部长,其中2005年6月至2010年6月曾任职于三菱基金管理公司,2011年6月起任三菱UFJ信托银行株式会社投资企划部部长。

王厚诚先生,监事,申万菱信基金管理有限公司行政管理总部负责人。1951年出生,研究生学历。自1978年起任职上海船舶研究设计院;1994年任职于国房地产开发公司任办公室主任;1997年任职中银万国证券股份有限公司人力资源总部薪酬部经理。2004年1月加盟本公司。

3、高级管理人员

于东升先生,总经理,1971年出生,经济学博士、EMBA。17年证券、基金从业经历,历任南方证券西安营业部总经理、计划财务管理总部副总经理;湘财证券华东管理总部总经理、市场总监;泰达荷银基金公司总经理助理、市场业务总监;汇添富基金管理有限公司首席市场官,副总经理。2011年9月加入申万菱信基金管理有限公司,同年11月起任本公司总经理。。

过振华先生,副总经理,1964年出生,工商管理硕士。19年银行、证券行业从业经历,曾任职于中国工商银行上海分行,此后历任上海申银证券公司国际业务部经理,申万泛达投资管理(亚洲)有限公司联席总裁,申银万国证券股份有限公司国际业务总部副总经理等职务。2004年加入申万菱信基金管理有限公司,历任公司督察长,2005年3月起任本公司副总经理。

欧庆铃先生,副总经理,投资总监,1965年出生,理学博士。11年证券、基金从业经历,历任华闽理工大学应用数学系副教授;广州证券有限责任公司研究中心常务副总经理;金鹰基金管理有限公司研究副总监、基金经理;万家基金管理有限公司基金经理、投资管理部总监。2011年8月加入申万菱信基金管理有限公司,2011年12月起任本公司副总经理、投资总监。

4、督察长

来肖强先生,督察长,1969年出生,经济学硕士。15年证券、基金从业经历,历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。2004年加入申万菱信基金管理有限公司,历任本公司监察稽核总部副总经理,2005年3月起任本公司督察长。

5、担任基金经理

张少华、复旦大学数量经济学硕士。自1999年起从事金融工作,1999年7月至2003年1月在申银万国证券股份有限公司任职,2003年1月加入申万菱信基金管理有限公司(现名申万菱信)筹备组。2004年2月正式加入本公司,历任风险管理总部高级风险分析师、风险管理总部副总监,2009年3月起任风险管理总部总监,2010年2月起任投资管理总部副总监,申万菱信沪深300价值指数型证券投资基金基金经理,2010年10月起同时任申万菱信深证成指分级证券投资基金基金经理。2011年6月起同时任申万菱信量化小盘股票型证券投资基金基金经理。

6、投资决策委员会委员名单

投资决策委员会由下述执行委员组成:总经理、公司分管投资的副总经理、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。

本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。

7、上述人员之间不存在近亲属关系。

(三)基金管理人的职责

1)根据《基金合同》及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;

2)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;

3)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;

4)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;

5)对基金财产进行核算并编制基金财务会计报告;

6)编制季度、半年度和年度基金报告;

7)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;

8)办理基金备案手续;

9)对所持有的每一基金份额持有人的姓名、证件号码和该基金份额的持有量建立并保管基金份额持有人名册;

10)按照《基金合同》及有关法律规定决定基金收益的分配方案;

11)依《基金合同》及有关法律规定决定基金收益的分配方案;

12)根据《基金合同》及有关法律规定,在基金资产净值的范围内,决定给予基金份额持有人数量合理的利益补偿方案,保证持有人的合法权益不受侵害,并报中国证监会备案;

13)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;

14)因违反《基金法》、《基金合同》及其他有关规定给基金财产或基金份额持有人造成损失的赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;

15)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》及国家有关法律规定,应星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;

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。

(四)基金管理人的义务包括但不限于:

1)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:

2)妥善保管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;

3)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份额的到期折算比例;

9)办理与基金财产运营有关的其他事宜。

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)根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)根据《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)履临解散、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份额之间的配对转换、中小板A份额与中小板B份额的上市交易份额转换外,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份额或者申请赎回其持有的申万中小板份额;在分级运作期结束后依法转让其持有的申万中小板份额或者申请赎回其持有的申万中小板份额。

4)按照规定要求召开基金份额持有人大会;

5)出席或者委派代表出席基金份额持有人大会,对基金份额持有人大会审议事项行使表决权;

6)查阅或者复制公开披露的基金信息资料;

7)监督基金管理人的投资运作;

8)对基金管理人、基金托管人、基金销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁;

9)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》及其他有关法律法规的规定,基金份额持有人的义务包括但不限于:

1)认真阅读并遵守《基金合同》;

2)了解所投资基金产品、了解自身风险承受能力,自行承担投资风险;

3)关注基金信息披露,及时行使权利和履行义务;

4)缴纳基金认购、申购款项及法律法规、《基金合同》和招募说明书所规定的费用;

5)在持有的基金份额范围内,承担基金亏损或者《基金合同》约定的有限责任;

6)不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动;

7)执行生效的基金份额持有人大会决议;

8)返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利;

9)法律法规、中国证监会规定的以及《基金合同》约定的其他义务。

(四)本基金合同当事人各方的权利义务以《基金合同》为依据,不因基金账户名称而有所改变。

二、基金份额持有人大会召集、议事规则及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成,基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。

分级运作期内基金份额持有人大会的审议事项应分别由申万中小板份额、中小板A份额与中小板B份额的基金份额持有人独立进行表决。基金份额持有人持有的每一基金份额在其对应的份额级别内拥有平等的投票权。

分级运作期结束,本基金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)。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

(一)召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的,应当召开基金份额持有人大会:

1)终止《基金合同》;

2)更换基金管理人;

3)更换基金托管人;

4)转换基金运作方式(但本基金在分级运作期结束后转换为上市开放式基金(LOF)除外);

5)提高基金管理人、基金托管人的报酬标准;

6)变更基金类别;

7)本基金与其他基金的合并;

8)变更基金投资目标、范围或策略;

9)变更基金份额持有人大会程序;

10)基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会;

11)分级运作期内单独或合计代表申万中小板份额、中小板A份额与中小板B份额各自基金份额10%以上(以上含本数,下同)的基金份额持有人(以基金管理人收到提议当日的基金份额计算,下同)或分级运作期结束后单独或合计代表申万中小板份额基金份额10%以上的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会;

12)对《基金合同》当事人权利、义务产生重大影响的其他事项;

13)分级运作期内终止中小板A份额与中小板B份额的运作;

14)法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

2、出现以下情形之一的,可以召集基金管理人和基金托管人协商后修改,不需召开基金份额持有人大会:

1)调低基金管理费、基金托管费;

2)法律法规要求增加的基金费用的收取;

3)在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整申万中小板份额的申购费率、调低申万中小板基金份额赎回费率;

4)因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改;

5)对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化;

6)按照法律法规或《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

(二)会议召集人及召集方式

1、除法律法规或《基金合同》另有约定外,基金份额持有人大会由基金管理人召集。基金管理人未按规定召集或者不能召集时,由基金托管人召集。

2、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的,应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集,并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的,应当自出具书面决定之日起60日内召开;基金管理人决定不召集,基金托管人仍认为有必要召开的,应当自行召集。

3、分级运作期内单独或合计代表申万中小板份额、中小板A份额与中小板B份额各自基金份额10%以上(以上含本数,下同)的基金份额持有人,或分级运作期结束后单独或合计代表申万中小板份额基金份额10%以上的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会的,应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集,并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的,应当自出具书面决定之日起60日内召开;基金管理人决定不召集,基金托管人仍认为有必要召开的,应当自行召集。

4、分级运作期内单独或合计代表申万中小板份额、中小板A份额与中小板B份额各自基金份额10%以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的,应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当收到书面提议之日起10日内决定是否召集,并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人;基金托管人决定召集的,应当自出具书面决定之日起60日内召开。

5、分级运作期内单独或合计代表申万中小板份额、中小板A份额与中小板B份额各自基金份额10%以上的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会,而基金管理人、基金托管人都不召集的,分级运作期内单独或合计代表申万中小板份额、中小板A份额与中小板B份额各自基金份额10%以上的基金份额持有人,或分级运作期结束后单独或合计代表申万中小板份额基金份额10%以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会,但应当至少提前30日向中国证监会备案。

5、基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的,基金管理人、基金托管人应当配合,不得阻碍、干扰。

6、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

(三)召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会,召集人必须于会议召开前30日在指定媒体公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容:

1)会议召开的时间、地点和会议形式;

2)会议拟审议的事项、议事程序和表决方式;

3)有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日;

4)授权委托证明的内容要求(包括但不限于代理人身份、代理权限和代理有效期限等),送达时间和地点;

5)会务常设联系人姓名及联系电话;

6)出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续;

7)召集人需要通知的其他事项。

2、采用通讯方式开会并进行表决的情况下,由召集人决定通讯方式和书面表决方式,并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表达意见的寄交的截止时间和收取方式。

3、如召集人为基金管理人,还应另行书面通知基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督;如召集人为基金托管人,则应另行书面通知基金管理人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的,不影响表决意见的计票效力。

(四)基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会方式召开,会议的召开