申万菱信中小板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：中国农业银行股份有限公司
公告日期：2012年5月23日
上市日期：2012年5月28日

第一部分　重要声明与提示

《申万菱信中小板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，申万菱信中小板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，请投资者详细查阅刊登在2012年3月28日《中国证券报》、《证券时报》的“申万菱信中小板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：申万菱信中小板指数分级证券投资基金

基金简称：申万菱信中小板指数分级；场内简称：申万中小；基金代码：163111

基金简称：申万菱信中小板A份额；场内简称：中小板A；交易代码：150085

基金简称：申万菱信中小板B份额；场内简称：中小板B；交易代码：150086

二、基金类型：股票型

三、基金运作方式：契约型开放式。

四、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（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”）。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份额将按照《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。

本基金的分级运作期共包含五个运作周年。其中运作周年是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（简称为“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（简称为“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。

五、本基金的存续期限：不定期。

六、本基金通过场外、场内两种方式公开发售。基金发售结束后，场外认购的全部基金份额将确认为申万中小板份额；场内认购的全部基金份额按照1:1的比例自动分离为预期收益与风险不同的两种份额类别，即中小板A份额和中小板B份额。

《基金合同》生效后，申万中小板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。中小板A份额与中小板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、申万中小板份额的申购与赎回：投资者可在场内申购和赎回申万中小板份额，投资者可选择将其在场内申购的申万中小板份额按1:1的比例分拆成申小板A份额和中小板B份额。投资者也可按1:1的配比将其持有的中小板A份额和中小板B份额申请合并为场内的申万中小板份额。

投资者可在场外申购和赎回申万中小板份额。投资者不得申请将其场外申购的申万中小板份额进行分拆（《基金合同》另有规定的除外）。但投资者可将其持有的场外申万中小板份额跨系统转托管至场内并申请将其分拆成中小板A份额和中小板B份额后上市交易。

八、份额配对转换：份额配对转换是指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。

合并指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。

九、定期份额折算：在分级运作期内每个运作周年（第五个运作周年除外）的结束日，将中小板A份额在运作周年结束日的份额参考净值超出本金1.000元部分，折算为场内申万中小板份额分配给中小板A份额持有人。申万中小板份额持有人持有的每两份申万中小板份额将按一份中小板A份额获得新增申万中小板份额的分配。持有场外申万中小板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中小板份额的分配；持有场内申万中小板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中小板份额的分配。经过上述份额折算，中小板A份额的基金份额参考净值和申万中小板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：分级运作期内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：当申万中小板份额的基金份额净值连续10个交易日高于2.000元时；当中小板B份额的基金份额参考净值达到或跌破0.250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、分级运作期内中小板A份额和中小板B份额的终止运作：分级运作期内经基金份额持有人大会决议通过，中小板A份额与中小板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中小板份额、中小板A份额与中小板B份额各自的基金份额持有人或其代理人所持表决权的2/3以上（含2/3）通过方为有效。

中小板A份额与中小板B份额终止运作后，除非基金份额持有人大会决议另有规定的，中小板A份额、中小板B份额将全部转换成申万中小板份额的场内份额。

十二、基金份额总额：截至2012年5月21日，本基金的基金份额总额为784,503,291.30份，其中，申万中小：619,489,877.30份，中小板A：82,506,707.00份，中小板B：82,506,707.00份。

十三、基金份额净值：截至2012年5月21日，申万中小份额净值为1.001元，中小板A份额净值为1.003元，中小板B份额净值为0.999元。

十四、本次上市交易的基金份额简称：中小板A、中小板B

十五、本次上市交易的基金份额总额：中小板A：82,506,707.00份；中小板B：82,506,707.00份（截至2012年5月21日）

十六、本次上市交易的基金份额交易代码：中小板A：150085；中小板B：150086

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：2012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：中国农业银行股份有限公司

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2012年2月16日证监许可〔2012〕197号文

2、基金运作方式：上市契约型开放式基金

3、基金合同期限：不定期

4、发售日期：2012年4月5日到2012年4月27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

中国农业银行股份有限公司，中国工商银行股份有限公司，中国建设银行股份有限公司，交通银行股份有限公司，上海浦东发展银行股份有限公司，中国民生银行股份有限公司，上海农村商业银行股份有限公司，南京银行股份有限公司，中银万国证券股份有限公司，中信建投证券股份有限公司，海通证券股份有限公司，国泰君安证券股份有限公司，招商证券股份有限公司，中国银河证券股份有限公司，广发证券股份有限公司，光大证券股份有限公司，国元证券股份有限公司，信达证券股份有限公司，中航证券有限公司，国信证券股份有限公司，华融证券股份有限公司，长江证券股份有限公司，国联证券股份有限公司，安信证券股份有限公司，中信证券股份有限公司，东吴证券股份有限公司，中信万通证券有限责任公司，中信证券（浙江）有限责任公司。

（2）场内销售机构：

1）直销机构：申万菱信基金管理有限公司直销中心。

2）申银万国证券股份有限公司及其他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）。

3）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有限公司。

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2,269户，有效净认购总金额为784,065,908.25元人民币，认购资金的银行利息437,383.05元人民币折算成基金份额已分别计入各基金持有人的基金账户，归各基金持有人所有。本次募集资金总额已于2012年5月7日全额划入本基金在基金托管人中国农业银行股份有限公司开立的申万菱信中小板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2012年5月7日验资完毕，2012年5月8日向中国证监会提交了验资报告，办理基金备案手续，并于2012年5月8日获得书面确认，本基金合同自该日起正式生效。

11、基金合同生效日：2012年5月8日。

12、基金合同生效日的基金份额总额：784,503,291.30份，其中，申万中小：619,489,877.30份，中小板A：82,506,707.00份，中小板B：82,506,707.00份。

二、本基金的日常申购、赎回业务安排

本基金管理人将于2012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、申万中小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〔2012〕132号

2、上市交易日期：2012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：申万菱信中小板A份额、申万菱信中小板B份额

场内简称：中小板A、中小板B

5、基金交易代码：中小板A：150085、中小板B：150086

6、本次上市交易份额（截止2012年5月21日）：中小板A：82,506,707.00份、中小板B：82,506,707.00份

7、未上市交易份额的流通规定：未上市交易的申万中小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中小板A和中小板B，分拆后的中小板A和中小板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：本基金分级运作期内，在中小板A份额、中小板B份额上市交易后，基金管理人于每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的申万中小板份额的基金份额净值和基金份额累计净值、中小板A份额与中小板B份额各自的基金份额参考净值。

分级运作期到期，本基金转换为上市开放式基金（LOF）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，披露本基金的基金份额净值和基金份额累计净值。

根据《基金法》，开放式基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此基金管理人对公布的基金净值负责。

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2012年5月21日，基金份额持有人户数为2269户，平均每户持有的基金份额为345,748.48份；其中，申万中小为1987户，平均每户持有的基金份额为311,771.45份；中小板A为282户，平均每户持有的基金份额为292,576.98份；中小板B为282户，平均每户持有的基金份额为292,576.98份。

二、持有人结构

截至2012年5月21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146,016,034.00份，占场内基金总份额的88.49%；场内个人投资者持有的基金份额为18,997,380.00份，占场内基金总份额的11.51%。

机构投资者持有的本次上市交易的中小板A份额为73,008,018份，占本次中小板A上市交易基金份额比例为88.49%；个人投资者持有的本次上市交易的中小板A份额为9,498,689份，占本次中小板A上市交易份额比例为11.51%。

机构投资者持有的本次上市交易的中小板B份额为73,008,016份，占本次中小板B上市交易基金份额比例为88.49%；个人投资者持有的本次上市交易的中小板B份额为9,498,691份，占本次中小板B上市交易份额比例为11.51%。

三、截至2012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）	持有中小板A份额	占中小板A份额比例	持有中小板B份额	占中小板B份额比例
1	红塔证券股份有限公司	12500868	15.15%	12500868	15.15%
2	国信-中行-国信"金理财"经典组合基金集合资产管理计划	10001528	12.12%	10001527	12.12%
3	海通证券股份有限公司	10000694	12.12%	10000694	12.12%
4	中国银河证券股份有限公司	10000694	12.12%	10000694	12.12%
5	国元证券股份有限公司	5000694	6.06%	5000694	6.06%
6	中银万国证券股份有限公司	5000694	6.06%	5000694	6.06%
7	民生证券有限责任公司	5000694	6.06%	5000694	6.06%
8	华创证券有限责任公司	5000694	6.06%	5000694	6.06%
9	渤海证券-建行-滨海1号民生价值集合资产管理计划	5000694	6.06%	5000694	6.06%
10	渤海证券-建行-滨海2号转型成长集合资产管理计划	3000417	3.64%	3000416	3.64%
合计		70507671	85.46%	70507669	85.46%

注：以上信息依据中国证券登记结算有限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：姜国芳

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。

公司目前下设投资管理总部、专户资产管理总部、市场营销总部、基金运营总部、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等部门。投资管理总部分为投资团队和研究团队，投资团队又细分为股票投资、固定收益投资和量化投资。投资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，研究团队负责宏观、策略、行业研究和上市公司调研、数量化投资等研究工作，为公司的投资决策提供有效支持。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。市场营销总部分为渠道销售团队、机构销售团队、市场发展与客户服务团队及营销支持团队。渠道销售团队负责开发和维护代销渠道、管理和监督日常的代销业务，机构销售团队负责机构客户的开发与维护，市场发展与客户服务团队负责市场推广、基金整合营销方案及客户服务，营销支持团队负责公司经营活动分析、行业及营销策略研究及渠道管理。基金运营总部负责基金交易，并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。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、信息披露及公司董事会的日常工作。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。基金管理人无任何受处罚记录。

4、人员情况

截至2012年4月30日，我公司共有118名员工，其中博士学位7人、硕士学位52人和学士学位53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2012年4月30日，申万菱信基金管理有限公司旗下共管理14只开放式基金，分别为申万菱信盛利精选证券投资基金、申万菱信盛利强化配置混合型证券投资基金、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。

7、本基金基金经理

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月加入申万巴黎基金管理有限公司（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。

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（以下简称“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：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〕256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

联系电话：010-63201510

传真：010-63201816

联系人：李芳菲

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“忠你成长”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，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”。

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，2004年9月更名为托管业务部，内设养老金管理中心、技术保障处、营运中心、委托资产托管处、保险资产托管处、证券投资基金托管处、境外资产托管处、综合管理处、风险管理处，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130名，其中高级会计师、高级经济师、高级工程师、律师等专家10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

（下转D18版）

申万菱信基金管理有限公司 申万菱信中小板指数分级证券投资基金开放日常申购（赎回、跨系统转托管）业务公告

公告送出日期：2012年5月23日

1.公告基本信息

基金名称	申万菱信中小板指数分级证券投资基金		
基金简称	申万菱信中小板指数分级（场内简称：申万中小）		
基金主代码	163111		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2012年5月8日		
基金管理人名称	申万菱信基金管理有限公司		
基金托管人名称	中国农业银行股份有限公司		
基金注册登记机构名称	中国证券登记结算有限责任公司		
公告依据	《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》”）和《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》”）		
申购起始日	2012年5月28日		
赎回起始日	2012年5月28日		
下属分级基金的基金简称	申万中小	中小板A	中小板B
下属分级基金的交易代码	163111	150085	150086
下属分级基金的前端交易代码	-	-	-
下属分级基金的后端交易代码	-	-	-
该分级基金是否开放申购、赎回（转换、定期定额投资）	是	否	否

注：1、申万菱信中小板指数分级证券投资基金以下简称“本基金”。

2、根据本基金基金合同等法律文件的规定，投资者可通过场外或场内两种方式对申万中小板份额进行申购与赎回，中小板A份额、中小板B份额不接受投资者的申购与赎回。

2.日常申购、赎回（转换、定期定额投资）业务的办理时间

本基金为投资者办理申购、赎回业务的开放日为上海证券交易所、深圳证券交易所的交易日，具体办理时间为前述交易所的交易时间，但本公司根据法律法规、中国证监会的要求或本基金基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。由于各销售机构系统及业务安排等原因，开放日的具体办理时间投资者应以各销售机构规定的具体时间为准。

投资人在上述开放日之外的日期和时间提出申购、赎回申请的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。

3.日常申购业务

3.1申购金额限制

1、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）；

2、分级运作期到期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。

3、基金管理人、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司可以根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述申购金额限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案。

3.2申购费率

3.2.1前端收费

申购金额（M）	申购费率	备注
申购金额<1,000,000.00	1.20%	
申购金额<5,000,000.00，申购金额>=1,000,000.00	0.70%	
申购金额>=5,000,000.00	1000元/笔	

注：1、申购金额单位：元。

2、本基金的申购费用由基金申购人承担，应在投资者申购申万中小板份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

3、分级运作期内申万中小板份额的场内申购费率由基金代销机构比照场外申购费率执行。

4、分级运作期结束本基金转换为上市开放式基金（LOF）后，申万中小板份额的场内和场外申购费率保持不变。

5、基金管理人可以在《基金合同》约定的范围内调整费率或收费方式，基金管理人依照有关规定于新的费率或收费方式实施日前在指定媒体上公告。

6、对特定交易方式（如网上交易、电话交易等），基金管理人履行适当程序后可以采用低于柜台交易方式的基金申购费率。

7、基金管理人可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情况下根据市场情况制定基金促销计划，针对基金投资者定期和不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以按中国证监会要求履行必要手续后，对基金投资者适当调整基金申购费率。

3.3其他与申购相关的事项

T日提交的有效申请，在正常情况下，登记机构在T+1日内（包括该日）为投资者对该交易的有效性进行确认，基金投资者应在T+2日后（包括该日）及时到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功，则申购款项退还给基金投资者。

4.日常赎回业务

4.1赎回份额限制

1、赎回的最低份额为1,000份基金份额，基金账户中基金份额不足1,000份的，应一次性赎回。

2、基金管理人、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司可以根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述赎回数量限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案。

4.2赎回费率

持有期限（N）	赎回费率
持有期限<1.00（年）	0.50%
持有期限<2.00，持有期限>=1.00（年）	0.25%
持有期限>=2.00（年）	0.00%

注：1、分级运作期内申万中小板份额的场内赎回费率为固定0.50%。

2、分级运作期结束本基金转换为上市开放式基金（LOF）后，申万中小板份额的场内和场外赎回费率保持不变。

申万中小板赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。不低于赎回费总额的25%应归于基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。

3、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，基金管理人依照有关规定于新的费率或收费方式实施日前在指定媒体上公告。

4、对特定交易方式（如网上交易、电话交易等），基金管理人履行适当程序后可以采用低于柜台交易方式的基金赎回费率。

5、基金管理人可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情况下根据市场情况制定基金促销计划，针对基金投资者定期和不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以按中国证监会要求履行必要手续后，对基金投资者适当调整基金赎回费率。

4.3其他与赎回相关的事项

1、若某笔份额减少类业务导致基金份额持有人在销售机构（网点）单个交易账户保留的基金份额余额不足100份的，基金管理人有权对该基金份额持有人持有的本基金份额做全部赎回处理（份额减少类业务指赎回、转换转出、非交易过户、转托管转出等业务，具体种类以中登公司相关业务规则为准）。

2、T日提交的有效申请，在正常情况下，登记机构在T+1日内（包括该日）为投资者对该交易的有效性进行确认，基金投资者应在T+2日后（包括该日）及时到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。

销售机构对申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申请的确认以登记机构的确认结果为准。

3、投资者T日赎回申请成功后，基金管理人将通过基金注册登记机构及其相关基金销售机构在T+7日（包括该日）内将赎回款项划往基金份额持有人账户。在发生巨额赎回的情形时，款项的支付办法参照《基金合同》的有关条款处理。

5. 基金销售机构

5.1 场外销售机构

5.1.1 直销机构

申万菱信基金管理有限公司直销中心

地址：上海市淮海中路300号香港新世界大厦40楼（200021）

电话：400 880 8588（免长途话费）或021-962299

传真：+86-21 63353816

5.1.2 场外非直销机构

中国农业银行股份有限公司，中国工商银行股份有限公司，中国建设银行股份有限公司，交通银行股份有限公司，上海浦东发展银行股份有限公司，中国民生银行股份有限公司，上海农村商业银行股份有限公司，南京银行股份有限公司，中银万国证券股份有限公司，中信建投证券股份有限公司，海通证券股份有限公司，国泰君安证券股份有限公司，招商证券股份有限公司，中国银河证券股份有限公司，广发证券股份有限公司，光大证券股份有限公司，国元证券股份有限公司，信达证券股份有限公司，中航证券有限公司，国信证券股份有限公司，华融证券股份有限公司，长江证券股份有限公司，国联证券股份有限公司，安信证券股份有限公司，中信证券股份有限公司，东吴证券股份有限公司，中信万通证券有限责任公司，中信证券（浙江）有限责任公司。

5.2 场内销售机构

中银万国证券股份有限公司及其他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）。

以上各销售机构的地址、联系方式、工作日办理业务的具体时间和其它有关信息、规定等事项，请以各销售机构在当地媒体上刊登的公告或各销售网点的公告为准。

若增加新的直销网点或者新的代销机构，基金管理人将及时公告，敬请投资者留意。

6 基金份额净值公告/基金收益公告的披露安排

开始办理日常申购、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，披露开放日的申万中小板份额的基金份额净值和基金份额累计净值、中小板A份额与中小板B份额各自的基金份额参考净值。

分级运作期内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中小板份额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、申万中小板份额的基金份额净值和基金份额累计净值、中小板A份额与中小板B份额各自的基金份额参考净值登载在指定媒体上。

分级运作期到期，本基金转换为上市开放式基金（LOF）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，披露本基金的基金份额净值和基金份额累计净值。

分级运作期到期，本基金转换为上市开放式基金（LOF）后，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。

7.其他需要提示的事项

1、系统内转托管和跨系统转托管业务

本基金的基金份额采用分系统登记的原则。场外认购/或申购买入的申万中小板份额登记在登记系统基金份额持有人开放式基金账户下；场内认购、申购买入的申万中小板份额或上市交易的基金份额登记在证券登记结算系统基金份额持有人证券账户下。

分级运作期内，登记在证券登记结算系统中的申万中小板份额可以申请场内赎回；登记在登记系统中的申万中小板份额可申请场外赎回。

分级运作期内，登记在证券登记结算系统中的中小板A份额、中小板B份额只能在深圳证券交易所上市交易，不能直接申请场内赎回。

分级运作期结束本基金转换为上市开放式基金（LOF）后，登记在证券登记结算系统中的申万中小板份额可以申请场内赎回，也可以上市交易；登记在登记系统中的申万中小板份额可申请场外赎回。

为保证基金份额持有人的利益，基金管理人向深圳证券交易所、中国登记结算有限公司提出申请，自2012年5月28日起开通申万中小板份额系统内转托管和跨系统转托管业务。

（1）系统内转托管

系统内转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在登记系统内不同销售机构（网点）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。

基金份额登记在登记系统的基金份额持有人在变更办理申万中小板份额赎回业务的销售机构（网点）时，须办理已持有申万中小板份额的系统内转托管。

基金份额登记在证券登记结算系统的基金份额持有人在分级运作期内变更办理中小板A份额、中小板B份额上市交易、申万中小板份额场内赎回的会员单位（交易单元）或在分级运作期结束后变更办理申万中小板份额场内上市交易、赎回的会员单位（交易单元）时，须办理已持有基金份额的系统内转托管。

（2）跨系统转托管

跨系统转托管是指基金份额持有人将持有的申万中小板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。

申万中小板份额跨系统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。

2、本公告仅对本基金开始办理日常申购、赎回、系统内转托管和跨系统转托管业务等相关事项予以说明。投资者欲了解本基金的详细情况，请认真阅读2012年3月28日刊登在《中国证券报》及《证券时报》上的《申万菱信中小板指数分级证券投资基金招募说明书》及《申万菱信中小板指数分级证券投资基金基金合同（摘要）》，亦可登录本公司网站（www.swsmu.com）进行查询。

3、投资者可通过以下途径咨询：

申万菱信基金管理有限公司

网站：www.swsmu.com

客服电话：400 880 8588（免长途话费）或021-962299

4、本公告解释权归本公司所有。

5、风险提示：基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的招募说明书。

特此公告。

申万菱信基金管理有限公司 关于申万菱信中小板指数分级证券投资基金开通份额配对转换的公告

根据《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”）的相关规定，为向投资者提供更优质的服务，申万菱信基金管理有限公司（以下简称“本公司”）决定自2012年5月28日起，开通申万菱信中小板指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）的份额配对转换业务。具体事项公告如下：

一、份额配对转换业务

份额配对转换是指在本基金基金合同生效后中小板A份额、中小板B份额的存续期内，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，包括分拆和合并两个方面。

1、分拆。基金份额持有人将其持有的每两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。

2、合并。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。

二、份额配对转换的业务办理机构

投资者可以通过本公司直销中心及依据中国证券登记结算有限责任公司（简称“中登”）有关规定获得业务办理资格的深圳证券交易所会员单位办理份额配对转换业务，按照中登有关规定获得业务办理资格的深圳证券交易所会员单位名单可向本公司咨询。

截至2012年4月24日，具有配对转换业务资格的深圳证券交易所会员单位为：国泰君安证券、中信建投证券、国信证券、招商证券、广发证券、中信证券、银河证券、海通证券、华泰联合证券、中银万国证券、兴业证券、长江证券、安信证券、西南证券、金通证券、湘财证券、民生证券、国元证券、渤海证券、华泰证券、山西证券、中信万通证券、东兴证券、东吴证券、信达证券、东方证券、方正证券、长城证券、光大证券、广州证券、南京证券、上海证券、新时代证券、国联证券、浙商证券、平安证券、华安证券、国海证券、财富证券、东莞证券、中原证券、国都证券、东海证券、中银国际证券、恒泰证券、国盛证券、宏源证券、齐鲁证券、世纪证券、第一创业证券、江南证券、华林证券、德邦证券、西部证券、广发华福证券、中金公司、财通证券、华鑫证券、瑞银证券、中国建银投资证券、红塔证券、西藏证券、日信证券、联讯证券、江海证券、国金证券、中国民族证券、华宝证券、厦门证券、天风证券、大通证券。

三、份额配对转换的业务办理时间

深圳证券交易所交易日上午9:30-11:30和下午1:00-3:00（本公司公告暂停份额配对转换业务时除外）。

若深圳证券交易所交易时间更改或实际情况需要，本公司将对份额配对转换业务的办理时间进行相应调整并公告。

四、份额配对转换业务办理规则

1、投资者以中登深圳分公司A股账户或证券投资基金账户（以下简称“深市证券账户”）申报份额配对转换业务中的“分拆”或“合并”指令，申报前需备足对价，即投资者提出“合并”申请时，其所申报的深市证券账户上须有足够的、可交易的中小板A与中小板B基金份额；投资者提出“分拆”申请时，其所申报的深市证券账户上须有足够的、可交易的申万中小基金份额。

2、投资者通过业务办理机构提出份额配对转换申请的，统一以申万中小的基金代码“163111”作为申请指令的证券代码，以份额为单位进行“合并”或“分拆”申报。

3、“合并”或“分拆”每笔申请的份额数必须是偶数，投资者在业务办理机构提交的每笔申请份额不得低于1000份。