申万菱信中小板指数分级证券投资基金招募说明书(第四次更新)(摘要)

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

【重要提示】

● 本基金基金合同已于2012年5月8日生效。

● 投资有风险,投资人申购基金时应认真阅读招募说明书。

● 基金的过往业绩并不预示其未来的表现。

● 本摘要根据本基金之基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《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》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

● 本招募说明书(更新)所载内容截止日为2014年5月8日,有关财务数据和净值表现截止日为2014年3月31日(财务数据未经审计)。

一、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,工商管理硕士,高级经济师。1980年起从事金融相关工作,先后任职于中国人民银行上海市分行,中国工商银行上海市分行组织处,上海申银证券有限公司,申银万国证券股份有限公司,申银万国(香港)有限公司。2004年至今任申万菱信基金管理有限公司(原申万巴黎基金管理管理有限公司)董事长。

杜平先生,董事,法学硕士,经济师。1989年至1993年先后任职于湖北省武汉市政府政策研究室,湖北省武汉市政府办公厅;1993年起从事金融相关工作,曾先后任职于交通银行总行秘书处、深圳分行,新加坡分行。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。

刘郎先生,董事,硕士研究生,副教授。曾在湖南邵阳学院和东南大学任教。1994年起从事金融相关工作,先后在泰阳证券公司任公司、万联证券任公司总裁。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8月在大通证券公司任副总经理。2007年9月至今任申银万国证券股份有限公司副总裁。

原田义久先生,董事,日本籍,大学学历。1987年4月至今在三菱UFJ信托银行株式会任职,曾任投资企划部次长、海外资产管理部副部长。现任三菱UFJ信托银行株式会社海外资产管理部部长。

陈志成先生,董事,日本籍,大学学历。1990年7月至今在三菱UFJ信托银行株式会社任职,历任中国业务科员、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,经济学博士,博士生导师,二级教授。曾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,博士研究生,教授。曾在四川外国语大学、日本长崎县立大学、日本千叶大学、早稻田大学任教;此后曾任职于日本菱南开发株式会社。2001年至今在中南大学任法学院教授,中日经济法研究所所长,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,硕士研究生,高级经济师。1969年开始工作,1984年进入金融行业,曾先后任职于中国工商银行总行、工商银行北京市分行等。2009年1月起退休。

李秀仑先生,独立董事,大学本科学历,高级经济师。1969年开始工作,曾先后任职于中国工商银行、上海农村信用合作社联合社、上海农村商业银行;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,监事会主席,大学学历,高级会计师、高级经济师。曾任职于上海市财政局、上海市财税二分局、上海市税务局、上海国际信托投资公司、上海国际集团有限公司等单位,2010年中至今在申银万国证券股份有限公司任党委委员、监事会主席。

代田秀雄先生,监事,日本籍,大学学历。1985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),历任投资企划部次长等职务,其中2008年6月至2012年5月曾任职于三菱日联资产管理有限公司,2012年6月起任三菱UFJ信托银行株式会社投资企划部部长。

王菲萍女士,监事,硕士研究生。曾在申银万国证券股份有限公司总裁办任法律顾问等职务,2004年加入申万菱信基金管理有限公司(原申万巴黎基金管理有限公司),现任监察稽核总部总监。王菲萍女士具备基金从业资格。

3、高级管理人员

姜国芳先生,董事长,相关介绍见董事会成员部分内容。

过振华先生,总经理,工商管理硕士。曾任职于中国工商银行上海分行、上海申银证券公司、申万泛达投资管理(亚洲)有限公司、申银万国证券股份有限公司等。2004年加入申万菱信基金管理有限公司(原申万巴黎基金管理管理有限公司),曾任公司督察员、副总经理,现任公司总经理。

欧庆铃先生,副总经理,理学博士,曾在华南理工大学应用数学系任教,此后曾任职于广州证券有限责任公司、金鹰基金管理有限公司和万家基金管理有限公司。2011年8月加入申万菱信基金管理有限公司,曾任申万菱信消费增长基金经理,现任公司副总经理、申万菱信新动力基金经理。

4、督察长

来肖贤先生,经济学硕士。曾任申万菱信基金管理有限公司监察稽核总部副总经理;在申万菱信基金管理有限公司任职之前,曾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。

5、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,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、申万菱信申万证券分级基金经理。

(6)投资决策委员会委员名单

本委员会由以下人员组成: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。

公司分管投资的副总经理为本委员会主席,分管投资的副总经理或其被授权人为本委员会召集人,投资管理总部总监或其被授权人为本委员会秘书,负责协调统筹本委员会的各项事宜。

本公司董事长、总经理、督察长、监察稽核总部总监、风险管理总部总监作为非执行委员,有权列席本委员会的任何会议。非执行委员不参与投票表决。

(7)上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一)基金托管人的基本情况

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:中国银监会银监复[2009]13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:010-68121510
传真:010-68121816
联系人:李芳菲

三、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1、场外发售机构

(1)直销机构

申万菱信基金管理有限公司直销中心
住所:上海市淮海中路300号香港新世界大厦40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、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

2、名称:中国建设银行股份有限公司
法定代表人:王洪章
注册地址:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
联系人:王琳
客户服务电话:95533
传真:010-66275654
网址:www.ccb.com

3、名称:中国农业银行股份有限公司
注册地址:北京市东城区建国门内大街69号
法定代表人:蒋超良
联系人:刘一宁
电话:010-85108227
传真:010-85109219
客户服务电话:95599
网址:www.abchina.com

4、名称:交通银行股份有限公司
住所:上海市浦东新区银城中路188号
办公地址:上海市银城中路188号
法定代表人:牛锡明
电话:021-58781234
传真:021-58408483
联系人:曹榕
客户服务电话:95559
网址:www.bankcomm.com

5、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
联系人:倪苏云、于慧
客户服务热线:95528
公司网站:www.spdb.com.cn

6、名称:中国民生银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人:董文标
客服电话:95568
联系人:陈霭
传真:010-57092611
网址:www.cmbc.com.cn

7、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:吴海平
传真:021-38523664
网址:www.srcb.com

8、名称:南京银行股份有限公司
注册地址:南京市白下区淮海路50号
办公地址:南京市白下区淮海路50号
法定代表人:林复
传真:025-84544129
联系人:翁俊
客户服务电话:4008896400
网址:www.njcb.com.cn

9、名称:申银万国证券股份有限公司
注册地址:上海市常熟路171号
法定代表人:储晓明
传真:021-33388224
联系人:高夫
客服电话:021-95523
公司网站:www.sywg.com

10、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

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: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

13、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

14、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

15、名称:广发证券股份有限公司
注册地址:广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼(4301-4316房)
办公地址:广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼
法定代表人:孙树明
联系人:黄岚
统一客户服务热线:95575或致电各地营业网点
公司网站:广发证券网www.gf.com.cn

16、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

17、名称:国元证券股份有限公司
注册地址:安徽省合肥市寿春路179号
法定代表人:凤良志
传真:0551-2207965
联系人:李蔡
客户服务电话:400-8888-777,95578
网址:www.gyzq.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:中航证券有限公司
注册地址:江西省南昌市抚河北路291号
法定代表人:杜航
联系人:戴蕾
客服电话:0791-6768763
网址:www.scstock.com

20、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:齐晓燕
传真:0755-82133952
客户服务电话:95536
网址:www.guosen.com.cn

21、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

22、名称:国联证券股份有限公司
注册地址:江苏省无锡市县前东街168号
法定代表人:雷建辉
联系人:徐欣
传真:0510-82830162
客户服务电话:4008885288
网址:www.glsc.com.cn

23、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

24、名称:中信证券股份有限公司
住所:广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦第A层
办公地址:北京朝阳区新源南路6号京城大厦
法定代表人:王东明
电话:010-84588266
传真:010-84865560
联系人:陈忠
网址:www.cs.ecitic.com

25、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:吴永敏
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

26、名称:中信万通证券有限责任公司
注册地址:青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15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号楼第20层
法定代表人:杨宝林
联系人:吴忠超
客户服务电话:95548
传真:0532-85022605
网址:www.zxwt.com.cn

27、名称:红塔证券股份有限公司
注册地址:昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼
办公地址:昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼
法定代表人:况雨林
联系人:高国泽
客户服务电话:0871-3577930
网址:www.hongtazq.com

28、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

29、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
法定代表人:祝献忠
联系人:黄恒
联系电话:010-58568235
传真:010-58568062
客户服务电话:010-58568118
网址:www.hrsec.com.cn

30、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

31、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

32、名称:广州证券有限责任公司
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:刘东
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

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:上海好买基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
办公地址:上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903-906室
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

35、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:张跃伟
客服电话:400-089-1289
公司网站:www.erichfund.com

36、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

37、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:0571-86800423
客户服务电话:4008-773-772,0571-88920897
网站:www.5ifund.com

38、名称:诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司
注册地址:上海市金山区廊下镇漕廊公路7650号205室
法定代表人:汪静波
联系人:方成
传真:021-38509777
客户服务电话:400-821-5399
网址:www.noah-fund.com

39、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

40、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

41、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
联系人:严跃俊
电话:021-20835788
传真:021-20835879
客服电话:400-920-0022/ 021-20835588
网址:licaike.hexun.com

2、场内发售机构

(1)本基金的场内发售机构为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)。

(2)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新增为本基金的场内发售机构。

(二)基金注册登记机构

名称:中国证券登记结算有限责任公司
注册地址:北京市西城区太平桥大街17号
办公地址:北京市西城区太平桥大街17号
邮政编码:100033
法定代表人:金颖
电话:010-66210988,010-59378888
传真:010-66210938
联系人:任瑞新

(三)律师事务所和经办律师

律师事务所:通力律师事务所
注册地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人:韩炯
电话:+86-21-31358666
传真:+86-21-31358600
联系人:安冬
经办律师:吕红、安冬

(四)会计师事务所和经办注册会计师

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

四、基金的名称

本基金的名称:申万菱信中小板指数分级证券投资基金

五、基金的类型

本基金的类型:契约型开放式

六、投资目标

本基金采取指数化投资方式,通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%,实现对中小板指数的有效跟踪。

七、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金投资于中小板指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产的90%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产的5%。

八、投资策略

本基金主要采用完全复制的方法进行投资,即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。

在标的指数成份股发生变动、增发、配股、分红等公司行为导致成份股的构成及权重发生变化时,由于交易成本、交易制度、个别成份股停牌或者流动性不足等原因导致本基金无法及时完成投资组合同步调整的情况下,基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合,追求尽可能贴近标的指数的表现。

1、资产配置策略

本基金原则上投资于中小板指数成份股和备选成份股将不低于90%的基金资产,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产的5%。本基金将根据市场的实际情况,适当调整基金资产的配置比例,以保证对标的指数的有效跟踪。

本基金将在《基金合同》生效之日起3个月的时间内达到上述规定的投资比例。

2、组合构建策略

本管理人构建投资组合的过程主要分为三步:确定目标组合、确定建仓策略和逐步调整。

(1)确定目标组合:本基金管理人根据完全复制成份股权重的方法确定目标组合。

(2)确定建仓策略:本基金管理人根据对成份股流动性的分析,确定合理的建仓策略。

(3)逐步调整:通过完全复制法最终确定目标组合之后,本基金管理人在规定时间内采用适当的手段调整实际组合直至达到跟踪标的指数的要求。

3、组合管理策略

(1)定期调整

本基金股票组合根据标的指数对其成份股的定期调整而进行相应的定期跟踪调整。

(2)不定期调整

1)当成份股发生增发、送配等情况而影响成份股在指数中权重的行为时,本基金将根据指数公司的公告,进行相应调整;

2)根据本基金的申购和赎回情况,对股票投资组合进行调整,从而有效跟踪标的指数;

3)若个别成份股因停牌、流动性不足或法规限制等因素,使得基金管理人无法按照其所占标的指数权重进行购买时,基金管理人将综合考虑跟踪误差最小化和投资者利益,决定部分持有现金或买入相关的替代性组合。

九、业绩比较基准

本基金以中小板指数为标的指数。

业绩比较基准为:95%×中小板指数收益率+5%×银行同业存款利率。

中小板指数,全称为中小企业板价格指数,指数代码为399005,是中国多层次证券市场的重要指数,该指数于2006年1月24日正式发布,兼具价值尺度与投资标的的功能。

如果中小板指数被停止发布或由其他指数替代或由于指数编制方法等重大变更导致该指数不宜继续作为目标指数,基金管理人可以依据维护投资者的合法权益的原则,在经基金托管人同意并履行适当程序后变更基金的标的指数和业绩比较基准。

十、风险收益特征

在分级运作期内,本基金虽为股票型指数基金,但由于采取了基金份额分级的结构设计,不同的基金份额具有不同的风险收益特征。申万中小板份额为常规指数基金份额,具有预期风险较高、预期收益较高的特征,其预期风险和预期收益水平均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金;中小板A份额,则具有预期风险低,预期收益低的特征;中小板B份额由于利用杠杆投资,则具有预期风险高,预期收益高的特征。

分级运作期结束,本基金转换为上市开放式基金(LOF),具有预期风险较高、预期收益较高的特征,其预期风险和预期收益水平均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

十一、基金投资组合报告

本投资组合报告所载数据截止日为2014年3月31日,本报告中所列财务数据未经审计。

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	635,384,217.06	93.67
	其中:股票	635,384,217.06	93.67
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	37,243,268.98	5.49
7	其他资产	5,711,352.59	0.84
8	合计	678,338,838.63	100.00

2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	11,373,707.74	1.69
B	采矿业	7,861,357.28	1.17
C	制造业	435,681,447.94	64.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,007,107.04	0.30
E	建筑业	31,006,558.13	4.61
F	批发和零售业	42,119,643.91	6.26
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	59,263,903.81	8.81
J	金融业	21,599,555.40	3.21
K	房地产业	11,338,501.75	1.69
L	租赁和商务服务业	8,487,210.06	1.26
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	4,645,224.00	0.69
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	635,384,217.06	94.44

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	002024	苏宁云商	4,317,325	30,307,621.50	4.50
2	002415	海康威视	1,391,017	24,273,246.65	3.61
3	002594	比亚迪	403,881	19,430,714.91	2.89
4	002241	歌尔声学	757,088	19,381,452.80	2.88
5	002230	科大讯飞	362,895	16,330,275.00	2.43
6	002353	杰瑞股份	262,844	15,823,208.80	2.35
7	002202	金风科技	1,632,675	15,330,818.25	2.28
8	002236	大华股份	536,121	15,327,699.39	2.28
9	002450	康得新	747,174	14,838,875.64	2.21
10	002065	东华软件	332,183	13,406,905.88	1.99

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。

8 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。

9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

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。

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。

10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 本基金投资国债期货的投资政策

根据本基金基金合同,本基金不得参与国债期货交易。

10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据本基金基金合同,本基金不得参与国债期货交易。

10.3 本基金投资国债期货的投资评价

根据本基金基金合同,本基金不得参与国债期货交易。

11 投资组合报告附注

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,或在报告编制日前一年内没有受到公开谴责和处罚的情形。

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。

11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	201,397.62
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	10,063.47
5	应收申购款	5,499,891.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,711,352.59

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。

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情况。

十二、基金的业绩

本基金的过往业绩不代表未来表现。

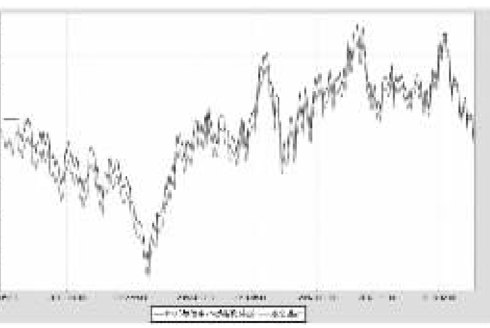
1. 净值增长率与业绩比较基准收益率比较:

阶段	基金份额净值增长率①	基金份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2012年度	-8.60%	1.20%	-11.06%	1.25%	2.46%	-0.05%
2013年度	15.20%	1.46%	16.80%	1.46%	-1.60%	0.00%-
2014年1月1日至2014年3月31日	-8.13%	1.45%	-7.32%	1.46%	-0.81%	-0.01%
自基金合同生效起2014年3月31日	-3.27%	1.37%	-3.72%	1.39%	0.45%	-0.02%

注:上述基金业绩指标已扣除了基金的管理费、托管费和各项交易费用,但不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如:申购费、赎回费等),计入认购或交易基金的各项费用后,实际收益水平要低于所列数字。

2. 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

申万菱信中小板指数分级证券投资基金
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2012年5月8日至2014年3月31日)



注:本基金基金合同约定建仓期为基金合同生效之日起3个月。本基金已在基金合同生效之日起3个月内,使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

十三、基金的费用与税收

(一)基金费用的种类

1、基金管理人的管理费;
2、基金托管人的托管费;
3、基金的指数使用费;
4、基金上市费用;
5、《基金合同》生效后的信息披露费用;
6、基金份额持有人大会费用;
7、《基金合同》生效后与基金有关的会计师费、律师费和诉讼费;
8、基金的证券交易费用;
9、基金的银行汇划费用;
10、证券账户开户费用和银行账户维护费;
11、按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

(二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、分级运作期内基金管理人的管理费

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下:

H=E×年管理费率/当年天数,本基金年管理费率为1.00%

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

2、分级运作期内基金托管人的托管费

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下:

H=E×年托管费率/当年天数,本基金年托管费率为0.22%

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

3、分级运作期到期后,本基金将转换为“申万菱信中小板指数证券投资基金(LOF)”,基金管理费按前一日基金资产净值的0.65%的年费率计提,基金托管费按前一日基金资产净值的0.12%的年费率计提。计算方法同上。上述变更可不经基金份额持有人大会决议,在报中国证监会备案后,提前在临时公告或更新的招募说明书中予以说明。

4、基金的指数使用费

本基金作为指数基金,需根据与深圳证券信息有限公司签署的指数使用许可协议的约定向深圳证券信息有限公司支付指数使用费。通常情况下,指数使用费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下:

H= E×年指数使用费率/当年天数,本基金年指数使用费率为0.02%

H为每日应计提的指数使用费

E为前一日的基金资产净值

本基金《基金合同》生效之日所在季度的指数使用费,按实际计提金额收取,不设下限。自《基金合同》生效之日所在季度的下一季度起,指数使用费收取下限为每季度5万元,即不足5万元时按照5万元收取。

若季度指数使用费下限(人民币5万元)大于按基金资产净值提取的季度指数使用费(正常指数使用费),则超过部分(即:人民币5万元减去该季度正常指数使用费)由基金管理人自行承担,不得作为基金费用在基金财产中列支。

指数使用费每日计算,逐日累计,按季支付。基金管理人和深圳证券信息有限公司双方自每季结束之日起10个工作日内确定该季度指数许可费金额。基金管理人应在每个季度结束后且收到深圳证券信息有限公司的有效商业发票后的10个工作日内向深圳证券信息有限公司支付上一季度指数使用许可费。由基金管理人向基金托管人发送划付指令,经基金托管人复核后从基金财产中一次性支付给深圳证券信息有限公司。

5、上述“(一)基金费用的种类”中4-11项费用,根据有关法规及相应协议的规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;
2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;
3、《基金合同》生效前的相关费用;
4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十四、对招募说明书本次更新部分的说明

本招募说明书(更新)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》及其它有关法律法规的要求,并根据基金管理人在《基金合同》生效后对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新,主要更新的内容如下:

1、更新了基金管理人的部分信息;
2、更新了基金托管人的部分信息;
3、更新了代销机构的部分信息;
4、更新了投资组合报告,数据截止日期为2014年3月31日;
5、更新了基金的业绩部分,数据截止日期为2014年3月31日;
6、更新了托管协议内容摘要中的托管人经营范围;
7、在“其他应披露事项”一章,列举了本基金自2013年11月9日至2014 年5月8日发布的有关公告。

十五、其它应披露事项

自2013年11月9日至2014年5月8日,与本基金和本基金管理人有关的公告如下:

1、2013年12月19日,刊登于《中国证券报》和《证券时报》的关于新增广州证券责任有限公司为代销机构并开通旗下部分基金定期定额投资业务及实施网上交易申购费率优惠活动的公告;

2、2013年12月19日,刊登于《中国证券报》和《证券时报》的关于新增浙江同花顺基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构并开通定期定额投资、转换业务及实施网上交易费率优惠活动的公告;

3、2013年12月23日,刊登于《中国证券报》和《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第三次更新;

4、2014年1月2日,刊登于《中国证券报》和《证券时报》的关于旗下开放式基金2013年年度最后一个交易日基金资产净值和基金份额净值的公告;

5、2014年1月21日,刊登于《中国证券报》和《证券时报》的申万菱信中小板指数分级证券投资基金2013年第4季度报告;

6、2014年3月27日,刊登于《中国证券报》和《证券时报》的申万菱信中小板指数分级证券投资基金2013年年度报告;

7、2014年3月28日,刊登于《中国证券报》和《证券时报》的关于旗下部分开放式基金继续参加中国工商银行股份有限公司开展的个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告;

8、2014年4月21日,刊登于《中国证券报》和《证券时报》的申万菱信中小板指数分级证券投资基金2014年第1季度报告;

9、2014年4月28日,刊登于《中国证券报》和《证券时报》的关于申万菱信中小板指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务的提示性公告;

10、2014年4月30日,刊登于《中国证券报》和《证券时报》的关于申万菱信中小板指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务的公告;

11、2014年4月30日,刊登于《中国证券报》和《证券时报》的关于中小板A定期份额折算后次日前收盘价调整的提示性公告。

签署日期:2014年6月6日

以上内容仅为摘要,须与本《招募说明书》(更新)(正文)所载之详细资料一并阅读。

申万菱信基金管理有限公司
2014年6月21日

证券代码:600139 股票简称:西部资源 公告编号:临2014-066号

四川西部资源控股股份有限公司关于投资设立控股子公司的公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在虚假记载、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。

重要提示

●投资标的名称:恒龙汽车有限公司(暂定名,具体名称以工商机关的核准为准,以下简称“恒龙汽车”)

●投资金额:四川西部资源控股股份有限公司(以下简称“西部资源”或“公司”)以自有资金出资人民币4,000万元,占恒龙汽车注册资本的80%。

一、对外投资概述

1、按照公司的战略规划调整及转型安排,为进一步推进公司新能源产业布局,公司与江苏恒能汽车投资有限公司(以下简称“恒能汽车”)签署《关于设立恒龙汽车有限公司的出资协议》,拟与其共同出资5,000万元设立恒龙汽车,其中,公司以自有资金出资4,000万元,占注册资本的80%。

2、公司已于2014年6月19日召开第八届董事会第九次会议,审议通过了《关于投资设立控股子公司的议案》,并授权公司管理层负责办理该公司设立的具体事宜,该议案无需提交股东大会审议通过。

3、本次投资不构成关联交易,不构成《上市公司重大资产重组管理办法》规定的重大资产重组。

二、投资主体的基本情况

公司董事会已对其他投资主体的基本情况及其履约能力进行了必要的尽职调查。

(一)其他投资主体基本情况

名称:江苏恒能汽车投资有限公司
住所:阜宁经济开发区香港路999号
法定代表人:陶琳娜
注册资本:1,000万元人民币
公司类型:有限责任公司(自然人独资)
经营范围:汽车产业投资;汽车新能源投资;汽车及零部件销售;汽车技术研发及信息咨询;汽车展览展示服务。(依据须经批准的项目,经相关部门批准后方可开展经营活动)

(二)恒能汽车与公司之间不存在关联关系,亦不存在产权、业务、资产、债权债务、人员等方面的其它关系。

三、拟设立公司的基本情况

公司名称:恒龙汽车有限公司
注册资本:5,000万元人民币
公司住所:江苏省阜宁县
企业类型:有限责任公司
经营范围:汽车技术研发、汽车及部件销售等
出资比例:

出资人	出资方式	出资额	出资比例
四川西部资源控股股份有限公司	货币	4,000万元	80%
江苏恒能汽车投资有限公司	货币	1,000万元	20%

以上信息以工商行政管理部门的最终核准和登记为准。

四、协议的主要内容

1、各出资方的出资安排

根据双方约定,恒龙汽车注册资本为5,000万元,其中,西部资源以货币方式出资4,000万元,恒能汽车以货币方式出资1,000万元。

自协议签署后五个工作日内,恒能汽车应依法足额向恒龙汽车履行完1,000万元的货币出资义务,西部资源应向恒龙汽车完成货币出资2,000万元,剩余货币出资即2,000万元应在协议签署后的二十个工作日完成。

2、恒能汽车保证,自本协议生效之日起不得从事或投资与新设公司存在竞争关系的业务。

五、本次投资的目的及对公司的影响

公司本次战略规划调整及转型,将以锂矿石为原材料基础,以终端汽车为主要切入点,逐步实现锂电池材料、锂电池组装、新能源汽车开发、制造和销售一体化的完整产业链布局及包括西南地区、长三角地区、珠三角地区等区域的全区域布局。

为完善公司在长三角地区的新能源汽车市场布局,公司与恒能汽车共同出资设立恒龙汽车,并在上海等其他地方开设分公司,负责恒龙汽车的销售业务,发挥市场先入优势,同时也将为公司增加新的利润增长点。

六、备查文件

1、公司第八届董事会第九次会议决议

特此公告

四川西部资源控股股份有限公司
董 事 会
2014年6月21日

证券代码:601231 证券简称:环旭电子 公告编号:临2014-040

环旭电子股份有限公司关于变更保荐机构及保荐代表人的公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其内容的真实、准确和完整承担个别及连带责任。

经中国证券监督管理委员会证监许可[2012]74号文批准,环旭电子股份公司(以下简称"公司")于2012年2月成功向社会首次公开发行人民币普通股(A股)10,680万股,长城证券有限责任公司(以下简称"长城证券")为公司首次公开发行股票的保荐机构。据《证券发行上市保荐业务管理办法》、《上海证券交易所股票上市规则》、《上海证券交易所上市公司募集资金管理办法》等规定,长城证券履行持续督导义务,持续督导期限至2014年12月31日终止。公司于2014年5月5日召开2014年第一次临时股东大会审议通过了《关于公司向特定对象非公开发行A股股票方案的议案》,并于2014年6月19日与中信证券股份有限公司(以下简称"中信证券")签署了《关于非公开发行人民币普通股(A股)并上市之承销及保荐协议》,聘请中信证券担任公司2014年非公开发行股票的保荐机构。中信证券委派陈淑绵女士、戴佳明先生担任公司2014年非公开发行股票的保荐代表人,具体负责本次非公开发行股票的保荐工作及股票上市后的持续督导工作,持续督导期限为公司本次非公开发行股票上市当年剩余时间及其后一个完整会计年度。

鉴于公司2012年首次公开发行股票持续督导期尚未结束,根据《证券发行上市保荐业务管理办法》规定,公司2012年首次公开发行股票持续督导职责由中信证券承继。中信证券委派陈淑绵女士、戴佳明先生负责具体督导工作。

特此公告。

环旭电子股份有限公司
2014年6月21日

易方达基金管理有限公司关于旗下基金认购2014年河北顺德投资集团有限公司公司债券的公告

易方达基金管理有限公司(以下简称“本公司”)所管理的易方达投资级信用债债券型证券投资基金、易方达稳健收益债券型证券投资基金、易方达裕丰回报债券型证券投资基金、易方达增强回报债券型证券投资基金、易方达裕惠回报债券型证券投资基金参加了2014年河北顺德投资集团有限公司公司债券的认购。此次发行的主承销商广发证券股份有限公司为本公司非控股股东。

根据中国证监会《证券投资基金信息披露管理办法》等有关规定,本公司将旗下基金获配数量及获配价格披露如下表:

基金名称	获配数量(张)	获配价格(元/张)
易方达投资级信用债债券型证券投资基金	200,000	100
易方达稳健收益债券型证券投资基金	200,000	100
易方达裕丰回报债券型证券投资基金	200,000	100
易方达增强回报债券型证券投资基金	300,000	100
易方达裕惠回报债券型证券投资基金	300,000	100

特此公告。

易方达基金管理有限公司
2014年6月21日

证券代码:002712 证券简称:思美传媒 公告编号:2014-025

思美传媒股份有限公司关于股东进行股票质押式回购交易的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

思美传媒股份有限公司(以下简称"公司")近日接到公司股东吴红心先生(持有公司股份6,715,137股,持股5%以上)的通知,吴红心先生与东莞证券有限责任公司(以下简称"东莞证券")进行股票质押式回购交易,具体情况如下:

吴红心先生将其持有公司3,130,000股股份以股票质押式回购交易的方式质押给东莞证券,初始交易日为2014年6月12日,回购交易日为2015年2月11日,质押期间该股份予以冻结不能转让。

截止本公告日,吴红心先生共持有公司股份6,715,137股,占公司股本总额的7.87%;累计质押其持有的公司股份3,570,000股,占其持有本公司股份总数的53.16%,占公司总股本的4.18%。

特此公告。

思美传媒股份有限公司董事会
2014年6月20日