申万菱信基金管理有限公司申万菱信安鑫优选混合型证券投资基金招募说明书第二次更新（摘要）

基金管理人：申万菱信基金管理有限公司
基金托管人：华夏银行股份有限公司

【重要提示】

- 本基金基金合同已于2016年11月7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》、《公开募集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2017年11月7日，有关财务数据和净值表现截止日为2017年9月30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：刘郎
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
联系电话：+86-21-23261188
联系人：牛锐
股权结构：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

（二）主要人员情况

1、董事会成员

刘郎先生，董事长，硕士研究生，副教授。曾任湖南邵阳学院助教，东南大学系副主任、副教授。1994年起从事金融相关工作，历任泰阳证券有限责任公司党委副书记、总裁、董事，万联证券有限责任公司总裁、董事，广州城市职业学院商学部主任，大通证券股份有限公司党委委员、副总经理，申银万国证券股份有限公司副总经理，申万宏源证券有限公司副总经理。现任申万菱信基金管理公司董事长，兼任申万菱信（上海）资产管理有限公司董事长。

姜国芳先生，董事，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，申万宏源集团股份有限公司，申万菱信基金管理有限公司。

朱敏杰先生，董事，硕士研究生，经济师。1988年起从事证券相关工作，先后任职于万国证券公司，申银万国证券股份有限公司，现任申万宏源证券有限公司副总经理。

川上丰先生，董事，日本籍，大学学历。1990年4月至今在三菱UFJ信托银行株式会社（原三菱信托银行）任职，曾任投资企划部科长、海外资产管理事业部科长、次长、副部长等。现任三菱UFJ信托银行株式会社海外资产管理部部长。

增田义之先生，董事，日本籍，硕士研究生。1989年4月至今在三菱UFJ信托银行株式会社（原三菱信托银行）任职，历任资产运用部量化运用组科长、股票运用部次长、投资工学研究所董事、指数战略运用部部长、资产运用部部长，现任受托财产企划部部长兼资产运用部部长。

来肖贤先生，董事，经济学硕士，中级经济师。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、部门副经理等。2004年加入申万菱信基金管理有限公司，曾任监察稽核总部副总监、公司督察长、公司副总经理，现任公司总经理，兼任申万菱信（上海）资产管理有限公司董事。

白虹女士，独立董事，硕士研究生。曾任职于中国工商银行总行、韩国釜山分行、万事达卡国际组织、FEXCO国际商务等，2012年起任跨界创新平台（COIN）创始人兼CEO。

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。

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商开发株式会社。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。

2、监事会成员

徐志斌先生，监事会主席，硕士研究生。曾任高盛集团环球控制部高级分析师、项目经理、团队经理，高盛集团运营风险管理部欧洲区负责人、总监、执行董事，高盛集团市场风险管理部执行董事，中国建银投资有限责任公司风险管理部业务总监、高级业务总监、负责人，宏源证券股份有限公司副总经理，申万宏源证券有限公司副总经理、首席风险官，现任申万宏源证券有限公司党委委员、副总经理，兼任申银万国投资有限公司董事长、申银万国创新投资有限公司董事长。

杉崎千雄先生，监事，日本籍，大学学历。1988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，2014年4月起任受托财产企划部副部长。

牛锐女士，职工监事，博士研究生，曾任职于申银万国证券股份有限公司、中国证监会上海监管局、中金公司、国泰基金等公司。2013年加入申万菱信基金管理有限公司，现任监察稽核总部总监。

葛菲斐女士，职工监事，大学本科学历，2006年加入申万菱信基金管理有限公司，曾任职于行政管理总部，主要从事行政管理、人力资源相关工作，现任人力资源总部总监助理，兼任申万菱信（上海）资产管理有限公司监事。

3、高级管理人员

刘郎先生，相关介绍见董事会成员部分。

来肖贤先生，相关介绍见董事会成员部分。

王伟先生，博士研究生。曾任职于申银万国证券股份有限公司。2003年加入申万巳黎基金管理有限公司筹备组，后正式加入申万菱信基金管理有限公司，历任市场部副总监、总监，首席市场官，现任公司副总经理，兼任申万菱信（上海）资产管理有限公司董事。

张少华先生，硕士研究生。曾任职于申银万国证券股份有限公司。2003年1月加入申万巳黎基金筹备组，后正式加入申万菱信基金管理有限公司，历任风险管理总部高级风险分析师、总监，基金投资管理总部基金经理、副总监，投资管理总部总监、基金经理，现任公司副总经理兼固定收益投资总部总监。

张丽红女士，硕士研究生。曾任职于中国工商银行股份有限公司，申银证券股份有限公司，申银万国证券股份有限公司。2004年加入申万菱信基金管理有限公司，历任财务管理总部总监、首席财务官兼财务管理总部总监，现任公司副总经理兼财务管理总部总监。

王菲萍女士，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，曾任监察稽核总部总监，现任公司督察长。

4、基金经理

叶瑜珍女士，硕士研究生，2005年加入申万菱信基金管理有限公司，先后担任风险分析师、信用分析师，基金经理助理等职务，现任申万菱信收益宝货币市场基金、申万菱信添益宝债券型证券投资基金、申万菱信可转换债券债券型证券投资基金、申万菱信安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基金经理。

蒲延杰先生，博士研究生。曾任职于中国工商银行总行资产管理部固定收益投资处，瑞银证券有限责任公司证券研究部。2015年7月加盟申万菱信基金管理有限公司，历任宏观、策略与中小盘高级研究员，申万菱信新动力混合型证券投资基金的基金经理助理，现任固定收益投资总部总监助理，申万菱信安鑫优选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、申万菱信多策略灵活配置混合型证券投资基金、申万菱信稳益宝债券型证券投资基金经理。

5、投资决策委员会委员名单

本委员会由以下人员组成：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、权益投资部总经理、量化投资部总经理、固定收益投资部总经理等。

公司总经理为本委员会主席，分管投资的副总经理为本委员会召集人，投资管理总部监监为本委员会秘书，负责协调统筹本委员会的各项事宜。

本公司董事长、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。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基本情况

名称： 华夏银行股份有限公司
住所： 北京市东城区建国门内大街22号（100005）
办公地址：北京市东城区建国门内大街22号（100005）
法定代表人：李民吉
成立时间：1992年10月14日
组织形式：股份有限公司
注册资本：10,685,572,211元人民币
批准设立机关和设立文号：中国人民银行[银复（1992）391号]
基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字[2005]25号
联系人：郑鹏
电话：（010）85238667
传真：（010）85238680

（二）主要人员情况

华夏银行资产托管部内设市场一室、市场二室、风险与合规管理室和运营室4个职能处室。资产托管部共有员工34人，高管人员拥有硕士以上学位或高级职称。

（三）基金托管业务经营情况

华夏银行于2005年2月23日经中国证券监督管理委员会和中国银行业监督管理委员会核准，获得证券投资基金托管资格，是《证券投资基金法》和《证券投资基金托管资格管理办法》实施后取得证券投资基金托管资格的第一家银行。自成立以来，华夏银行资产托管部本着“诚实信用、勤勉尽责”的行业精神，始终遵循“安全保管基金资产，提供优质托管服务”的原则，坚持以客户为中心的服务理念，依托严格的内控管理、先进的技术系统、优秀的业务团队、丰富的业务经验，严格履行法律和托管协议所规定的各项义务，为广大基金份额持有人和资产管理机构提供安全、高效、专业的托管服务，取得了优异业绩。截至2016年12月末，托管证券投资基金、券商资产管理计划、银行理财、资产支持专项计划、股权投资基金等各类产品合计819只，托管规模达到 21,732.58 亿元，同比增长66.34%。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

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：刘郎
电话：86-21-23261188
传真：86-21-23261199
联系人：陈继红
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、其他销售机构

(1)名称：华夏银行股份有限公司
法定代表人：李民吉
办公地址：北京市东城区建国门内大街22号
联系人：王者凡
客户服务电话：95577
传真：010-85238680
网址：www.hxb.com.cn

(2)名称：申银万国期货有限公司
住所：上海市浦东新区东方路800号宝安大厦7、8、10楼
办公地址：上海市浦东新区东方路800号宝安大厦7、8、10楼
法定代表人：李建中
客户服务电话：400-888-7868
传真：021-50586045
网址：www.sywgqh.com

(3)名称：国泰君安证券股份有限公司
注册地址：中国(上海)自由贸易试验区商城路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：杨德红
电话：021-38676666
传真：021-38670666
客户服务热线：95521
公司网站：www.gtja.com

(4)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

(5)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

(6)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

(7) 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：010-66568292
联系人：邓颜
公司网址：www.chinastock.com.cn

(8)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

(9) 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

(10)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：崔少华
联系人：奚博宇
传真：027-85481900
客户服务电话：95579或4008-888-999
网址：www.95579.com

(11)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：王连志
传真：0755-82558355
联系人：陈剑虹
统一客服电话：4008001001
公司网站地址：www.essence.com.cn

(12)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

(13)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：95330
公司网址：www.dwzq.com.cn

(14)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：95321
公司网址：www.cindasc.com

(15)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
办公地址：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
电话：021-22169999
传真：021-22169134
客户服务电话：95525
公司网址：www.ebscn.com

(16) 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

(17)名称：平安证券股份有限公司
住所：深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层
办公地址：深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层
法定代表人：詹露阳
客户服务电话：95511-8
传真：0755-82435367
网址：http://stock.pingan.com

(18)名称：华西证券股份有限公司
注册地址：四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦
办公地址：四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦
法定代表人：杨炯洋
联系人：周志茹
客户服务电话：95584或400 888 8818
传真：028-86150040
网址：http://www.hx168.com.cn

(19)名称：申万宏源西部证券有限公司
住所：新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室
办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室
法定代表人：韩志谦
联系人：王怀春
客户服务电话：4008-000-562
传真：010-88085195
网址：www.hysec.com

(20)名称：中泰证券股份有限公司
注册地址：山东省济南市市中区经七路86号
办公地址：山东省济南市市中区经七路86号
法定代表人：李玮
联系人：吴阳
电话：0531-68889155
传真：0531-68889185
客服电话：95538
网址：www.zts.com.cn

(21)名称：第一创业证券股份有限公司
住所：深圳市福田区福华一路115号投行大厦15-20楼
办公地址：深圳市福田区福华一路115号投行大厦15-20楼
法定代表人：刘学民
客户服务电话：95358
传真：0755-23838999
网址：www.fcsc.com.cn

(22)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：梁承华
传真：029-87406710
客户服务电话：95582
网站：www.westsecu.com

(23)名称：中国国际金融股份有限公司
住所：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
办公地址：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
法定代表人：丁学东
客户服务电话：4009101166
传真：010-85679203
网址：www.cicc.com.cn

(24)名称：上海华信证券有限责任公司
住所：上海市黄浦区南京西路399号明天广场22楼
办公地址：上海市黄浦区南京西路399号明天广场22楼
法定代表人：郭林
客户服务电话：4008205999
传真：021-68776977-8951
网址：www.shhxzq.com

(25)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

(26)名称：联讯证券股份有限公司
注册地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼
办公地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼
法定代表人：徐刚
客户服务电话：95564
传真：010-2119660
网址：www.lxsec.com

(27)名称：国金证券股份有限公司
办公地址：四川省成都市东城根上街95号
客服电话：95310
公司网址：www.gjzq.com.cn
联系人：刘婧漪、贾鹏
联系电话：028-86690057、028-86690058
传真号码：028-86690126

(28)名称：天风证券股份有限公司
天风证券股份有限公司
注册地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦4楼
办公地址：湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼
法定代表人：余磊
联系人：杨晨
电话：027-87107535
传真：027-87618863
客服热线：4008005000

(29)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

(30)名称：开源证券股份有限公司
住所：西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层
办公地址：西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层
法定代表人：李刚
客户服务电话：400-860-8866
传真：029-81887060
网址：www.kysec.cn

(31)名称：深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#
办公地址：北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦16层
法定代表人：杨懿
联系人：张燕
客服电话：400-166-1188
网址：8.jrj.com.cn

(32)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

(33)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

(34)名称：深圳众禄金融控股股份有限公司
注册地址：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元
办公地址：深圳市罗湖区梨园路8号HALO广场4楼
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

(35)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：上海市徐汇区宛平南路88号金座
法定代表人：其实
联系人：潘世友
电话：021-54660526
传真：021-54660501
客户服务电话：400-1818-188
网址：www.1234567.com.cn

(36)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
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

(37) 蚂蚁(杭州)基金销售有限公司
住所：杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1栋202室
办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座6F
法定代表人：陈柏青
联系人：韩爱彬
客服电话：4000-766-123
公司网址：www.fund123.cn

(38)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

(39)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

(40)名称：北京展恒基金销售股份有限公司
注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街6号
办公地址：北京市朝阳区安苑路15-1号邮电新闻大厦2层
法定代表人：闫振杰
联系人：马林
电话：010-59601366-7024
传真：010-62020355
客服电话：4008188000
网址：www.myfund.com

(41)名称：上海利得基金销售有限公司
注册地址：上海市宝山区蕴川路5475号1033室
办公地址：上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼
法定代表人：李兴春
联系人：赵沛然
电话：86-021-50583533
传真：86-021-50583633
客户服务电话：400-921-7755

(42)名称：宜信普泽投资顾问(北京)有限公司
注册地址：北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809
办公地址：北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座1809
法定代表人：沈伟桦
联系人：程刚
客户服务电话：400-6099-200
网址：www.yixinfund.com

(43)名称：众升财富(北京)基金销售有限公司
注册地址：北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼 A 座 9 层 908 室
法定代表人：李招娣
联系人：李艳
联系电话：010-59497361
传真：010-64788016
客服电话：400-876-9988
网址：www.zscffund.com

(44)名称：北京恒天明泽基金销售有限公司
注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室
办公地址：北京市朝阳区亮马桥路39号第一上海中心C座6层
法定代表人：梁越
联系人：马鹏程
电话：86-010-58845304
传真：86-021-58845306
客户服务电话：4008-980-618
网址：www.chtfund.com

(45)北京汇成基金销售有限公司
注册地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108
办公地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108
法定代表人：王伟刚
联系人：李瑞真
电话：010-56282140
传真：010-62680827
客户服务电话：400-619-9059
网址：www.hcjijin.com

(46)名称：一路财富(北京)信息科技股份有限公司
注册地址：北京市西城区阜成门外大街2号1幢A2208室
办公地址：北京市西城区阜成门外大街2号1幢A2208室
法定代表人：吴雪秀
联系人：段京璐
电话：010-88312877
传真：010-88312099
客户服务电话：400-001-1566
网址：http://www.yilucaifu.com/

(47)名称：北京钱景基金销售有限公司
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：高静
电话：010-59158281
传真：010-57569671
客户服务电话：400-893-6885
网址：www.qianjing.com

(48)名称：上海联泰资产管理有限公司
注册地址：中国(上海)自由贸易试验区富特北路277号3层310室
办公地址：上海市长宁区福泉北路518号8号楼3层
法定代表人：燕斌
联系人：陈东
电话：021-52822063
传真：021-52975270
客服电话：4000-466-788
网址：www.66zichan.com

(49)名称：上海汇付金融服务有限公司
注册地址：上海市黄浦区中山南路100号19层
办公地址：上海市宜山路700号普天信息产业园2期C5栋汇付天下总部大楼2楼
法定代表人：金佶
联系人：陈云卉
电话：021-33323999
传真：8621-33323837
客户服务电话：400 820 2819
手机客户端：天天盈基金
网址：www.chinapnr.com

(50)名称：深圳富济财富管理有限公司
注册地址：深圳市福田区福田街道金田路中洲大厦35层01B、02、03、04单位
办公地址：深圳市福田区福田街道金田路中洲大厦35层01B、02、03、04单位
法定代表人：刘鹏宇
联系人：刘勇
电话：0755-83999907-8814
传真：0755-83999926
客户服务电话：0755-83999907
网址：www.jinqianwo.cn

(51)名称：上海陆金所资产管理有限公司
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
法定代表人：郭坚
客户服务电话：400-821-9031
传真：021-22066653
网址：www.lufunds.com

(52)名称：大泰金石基金销售有限公司
住所：南京市建邺区江东中路222号南京奥体中心现代五项馆2105室
办公地址：上海市浦东新区峨山路505号东方纯一大厦15楼
法定代表人：袁顾明
客户服务电话：4009282266
传真：021-20324199
网址：www.dtfunds.com

(53)名称：珠海盈米财富管理有限公司
住所：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼B1201-1203
法定代表人：肖雯
客户服务电话：020-89629066
传真：020-89629011
网址：www.yingmi.cn

(54)北京肯特瑞财富投资管理有限公司
注册地址：北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06
办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街18号院京东集团总部A座17层
法定代表人：陈超
联系人：赵德赛
电话：18600280556
传真：010-89188000
客户服务电话：4000988511
网址：http://fund.jd.com/

(55)名称：中民财富管理(上海)有限公司
注册地址：上海市黄浦区中山南路100号07层
办公地址：上海市黄浦区中山南路100号17层
法定代表人：弭洪军
客户服务电话：400-876-5716
传真：021-63353736
网址：www.cmiwm.com

3、基金管理人可根据有关法律法规要求，根据实情，选择其他符合要求的机构销售本基金或变更上述销售机构，并及时公告。具体请以各发售机构实际情况为准。

（二）登记机构

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
办公地址：上海市中山南路100号11层
邮政编码：200010
法定代表人：刘郎
电话：86-21-23261188
传真：86-21-23261199
联系人：李濮君

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所
住所：上海市银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人：俞卫锋
电话：+86-21-31358666
传真：+86-21-31358600
联系人：孙睿
经办律师：黎明、孙睿

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：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：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

四、基金的名称

本基金的名称：申万菱信安鑫优选混合型证券投资基金

五、基金的类型

本基金的类型：契约型开放式

六、基金的投资目标

本基金在严格控制风险的前提下，通过积极主动的资产配置，充分挖掘和利用市场中潜在的投资机会，力求为基金份额持有人获取超过业绩比较基准的收益。

七、基金的投资范围和投资对象

本基金的投资对象是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、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、股指期货等权益类金融工具，以及债券等固定收益类金融工具（包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、可转换公司债券（含可分离交易可转债和可交换债券）、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、资产支持证券、次级债、债券回购、银行存款、货币市场工具等）及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（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。

本基金为混合型基金，基金投资组合中股票资产占基金资产的0%－50%；权证投资占基金资产净值的0%－3%；每个交易日日终在扣除股指期货保证金以后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。股指期货的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

八、基金的投资策略

1、资产配置策略

本基金充分发挥基金管理人的投资研究优势，通过对宏观经济基本面（包括经济运行周期、财政及货币政策、产业政策）、流动性水平（包括资金面供求情况、证券市场估值水平）的深入研究分析以及市场情绪的合理判断，紧密追踪股票市场、债券市场、货币市场三大类资产的预期风险和收益，并据此对本基金资产在股票、债券、现金之间的投资比例进行动态调整，谋求基金资产的长期稳健增值。

2、股票投资策略

本基金从商业模式、市场前景、竞争壁垒、财务状况等方面出发，优选具有竞争优势和估值优势的优质上市公司，力求在严格控制风险的前提下，获取长期持续稳健的投资收益。

（1）行业配置策略

本基金首先研究分析不同行业的盈利模式、与宏观经济周期的关系以及行业自身的生命周期，之后在判断当期宏观经济所处周期位置的基础上，结合行业的盈利模式，优选当期盈利增长最为确定及增速较快的行业，进行重点配置。

（2）个股投资策略

本基金在拟配置的行业内部通过定量与定性相结合的方法筛选个股。

定量的方法主要是通过对价值指标、成长指标、盈利指标等公开数据的细致分析，考察上市公司的盈利能力、盈利质量、成长能力、运营能力以及负债水平等方面，初步筛选出财务健康、成长性良好的优质股票。

定性的方法主要是在定量分析的基础上，由公司的研究人员采用案头研究和实地调研相结合的办法对拟投资公司的投资价值、核心竞争力、主营业务成长性、公司治理结构、经营管理能力、商业模式等进行定性分析以确定最终的投资目标。

3、债券投资策略

本基金将根据当前宏观经济形势、金融市场环境，积极运用基于债券研究的各种投资分析技术，寻找有利的市场投资机会。通过债券品种的动态配置与优化配比，在原则上遵循组合久期与封闭期适当匹配原则的同时，动态调整固定收益证券组合的久期、银行间市场和交易所市场的投资比重，并相应调整不同债券品种间的配比，以期在较低风险条件下获得较高的、稳定的投资收益。

（1）利率预期策略

主要是指根据国内外宏观经济走势与国家财政政策货币政策取向，同时考虑金融市场中市场短期利率水平和其他经济指标的走势，预测未来利率走势。在宏观经济上，基金管理人着重宏观经济运行质量、国内外经济相互间联系。在金融市场上，基金管理人着重分析金融市场资金流动与供求变化、金融市场短期利率水平的变动等。利率的未来走势将对债券市场整体行情产生最重要的影响，基金管理人将在利率预期的基础上对债券市场进行战略性资产配置。

（2）收益率曲线策略

未来利率走势将对不同到期期限的债券品种产生不同的影响，从而对市场的收益率曲线形状产生影响。收益率曲线策略是指通过考察市场收益率曲线的动态变化，从中总结归纳出债券市场波动特征，寻求在一段时间内获取因收益率曲线形状变化而导致的债券价格变化所产生的收益。在对组合久期整体调整的基础上，基金管理人将比较分析子弹策略、杠铃策略和梯子策略在不同市场环境下的表现，构建优化组合获取市场收益。

（3）信用债投资策略

信用债一般是指除国债、央行票据和政策性金融债之外的非国家信用的固定收益类金融工具，因此除上述投资策略以外，本基金还将结合以下投资策略分析信用债投资比例和进行信用债投资：

1）基于市场信用利差曲线的策略

市场信用利差曲线的变动主要取决于两个方面：其一是宏观经济环境的变化，当宏观经济环境良好时，企业盈利能力提升，现金流充裕，市场信用利差曲线便会收窄，反之则不然；其二是信用债市场容量、信用债结构、流动性等市场因子的变化趋势，当这些因素导致信用债市场供需关系发生变化时，便会影响到市场信用利差曲线的变动。本基金将综合考虑上述因子，预测信用债的市场信用利差水平，以动态调整信用债的投资比例。

2）基于信用债本身的信用分析策略

本基金基于信用债本身的信用分析策略主要是通过建立信用评级体系分析信用债的信用风险。研究员将根据债券发行人自身状况的变化，包括公司产权状况、法人治理结构、管理水平、经营状况、财务质量、抗风险能力等变化对信用级别产生的影响综合评价出债券发行人信用风险，评价债券的信用级别。同时，管理人通过分析任意时间段不同债券的历史利差情况，统计出历史利差的均值和波动度，从而挖掘相对价值被低估的信用债。

4、股指期货投资策略

本基金将以投资组合的避险保值和有效管理为目标，根据风险管理的原则，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，适当参与股指期货的投资。本基金将利用股指期货流动性好，交易成本低等特点，对冲特殊情况下的流动性风险，改善组合的风险收益特性；并在市场急速向上时，通过构建股指期货头寸迅速提高投资组合的仓位，以提高基金资产的整体收益。

5、资产支持证券投资策略

资产支持证券，定价受多种因素影响，包括市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、违约率等。本基金将深入分析上述基本面因素，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估其内在价值。

6、权证投资策略

本基金通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型及价值挖掘策略、价差策略、双向权证策略等寻求权证的合理估值水平，追求稳定的当期收益。

九、业绩比较基准

业绩比较基准为：30%×沪深300指数收益率 + 70%×中证综合债指数收益率。

十、风险收益特征

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。

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2017年9月30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	54,165,330.96	17.19
	其中：股票	54,165,330.96	17.19
2	固定收益投资	229,587,600.00	72.86
	其中：债券	229,587,600.00	72.86
	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	23,000,150.00	7.30
	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	5,302,731.42	1.68
7	其他各项资产	3,067,354.29	0.97
8	合计	315,123,166.67	100.00

本基金未开通港股通交易机制投资于港股。

2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	49,187,762.08	15.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	-	-
J	金融业	4,977,568.88	1.58
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	54,165,330.96	17.25

2.2报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金未开通港股通交易机制投资于港股。

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