申万菱信价值优选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书第一次更新（摘要）

基金管理人:申万菱信基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司

【重要提示】
● 本基金基金合同已于2018年1月4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，并经中国证监会注册。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2018年7月4日,有关财务数据和净值表现截止日为2018年6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:021-23261188
联系人:赵鹏
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有限公司董事长,兼任申万菱信（上海）资产管理有限公司董事长。
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。
张克均先生,董事,硕士研究生。1990年起从事金融相关工作,曾任职于兴业银行厦门分行、申银万国证券股份有限公司， 现任申万宏源证券有限公司总经理助理。
铃木晃先生,董事,日本籍,大学学历。1982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,历任投资商品开发部副部长、部长、执行官,管理受托财产部门常务执行官、副部门长,现任管理受托财产部门常务执行官、受托财产副部门长、资产管理事业部副事业长。
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。
来肖贤先生,董事,硕士研究生,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。
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,兼任投资交易事业部总经理,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。
糠信英树先生,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）,曾任职于人事部、资产运用部、权益运用部、投资企划部,现任受托财产企划部副部长兼资产管理事业室长。
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,曾任监察稽核总部总监,现任综合办公室主任。
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,曾任人力资源总部总监助理,现任人力资源负责人,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年加入申万巴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。
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月加入申万巴黎基金筹备组,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。
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。
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
刘敦先生,硕士研究生。2008年起从事金融相关工作,曾任职于艾利士通资产管理有限公司、平安资产管理有限公司、申银万国证券研究所等。2015年3月加入申万菱信基金管理有限公司,曾任专户投资经理,现任指数与创新投资部负责人兼量化投资部负责人,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、申万菱信量化成长混合型证券投资基金、申万菱信价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
金昉毅先生,2018年1月至2018年3月任本基金基金经理。
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、权益研究部负责人、权益投资部负责人、量化投资部负责人、固定收益投资部负责人、指数与创新投资部负责人等。
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,权益研究部负责人为本委员会秘书,负责协调统筹本委员会的各项事宜。
本公司董事长、督察长、监察稽核部负责人、风险管理部负责人作为非执行委员,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）基金托管人概况
1、基本情况
名称:招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）
设立日期:1987年4月8日
注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
注册资本:252.20亿元
法定代表人:李建红
行长:田惠宇
资产托管业务批准文号:证监基金字[2002]83号
电话:0755—83199084
传真:0755—83195201
资产托管部信息披露负责人:张燕
2、发展概况
招商银行成立于1987年4月8日，是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行,总行设在深圳。自成立以来,招商银行先后进行了三次增资扩股,并于2002年3月成功地发行了15亿A股,4月9日在上交所挂牌（股票代码:600036）,是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006年9月又成功发行了22亿H股,9月22日在香港联交所挂牌交易（股票代码:3968）,10月5日行使H股超额配售,共发行了24.2亿H股。截至2018年3月31日,本集团总资产62,522.38亿元人民币,高级法下资本充足率15.51%,权重法下资本充足率12.79%。
2002年8月,招商银行成立基金托管部;2005年8月,经报中国证监会同意,更名为资产托管部,下设业务管理室、产品管理室、业务营运室、稽核监察室、基金外包业务室5个职能处室,现有员工81人。2002年11月,经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格,成为国内第一家获得该项业务资格上市银行;2003年4月,正式办理基金托管业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行,拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管（QFII）、合格境内机构投资者托管（QDII）、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管等业务资格。
招商银行确立“因势而变、先您所想”的托管理念和“财富所托、信守承诺”的托管核心价值,独创“6S托管银行”品牌体系,以“保护您的业务、保护您的财富”为历史使命,不断创新托管系统、服务和产品:在业内率先推出“网上托管银行系统”、托管业务综合系统和“6心”托管服务标准,首家发布私募基金绩效分析报告,开办国内首个托管银行网站,成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只FOF、第一只信托资金计划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金T+1到账、第一只境外银行QDII基金、第一只红利ETF基金、第一只“1+N”基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单TOT保管,实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变,得到了同业认可。
招商银行资产托管业务持续稳健发展,社会影响力不断提升,四度蝉联获《财资》“中国最佳托管专业银行”。2016年6月招商银行荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”,成为国内唯一获奖项国内托管银行;“托管通”获得国内《银行家》2016中国金融创新 “十佳金融产品创新奖”;7月荣膺2016年中国资产管理【金贝奖】“最佳资产托管银行” ;2017年6月再度荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”,“全功能网上托管银行2.0”荣获《银行家》2017中国金融创新“十佳金融产品创新奖”;8月荣膺国际财经权威媒体《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”,2018年1月获得中央国债登记结算有限责任公司 “2017年度优秀资产托管机构”奖项,同月招商银行“托管大数据平台风险管理系统”荣获2016-2017年度银监会系统“金点子”方案一等奖,以及中央金融团工委、全国金融青联第五届“双提升”金点子方案二等奖;3月招商银行荣获公募基金20年“最佳基金托管银行”奖。
（二）主要人员情况
李建红先生,本行董事长、非执行董事,2014年7月起担任本行董事、董事长。英国东伦敦大学工商管理硕士、吉林大学经济管理专业硕士,高级经济师。招商局集团有限公司董事长,兼任招商局国际有限公司董事会主席、招商局能源运输股份有限公司董事长、中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司董事长、招商局华建公路投资有限公司董事长和招商局资本投资有限责任公司董事长。曾任中国远洋运输（集团）总公司总裁助理、总经理办公室副总经理,招商局集团有限公司董事、总裁。
田惠宇先生,本行行长、执行董事,2013年5月起担任本行行长、本行执行董事。美国哥伦比亚大学公共管理硕士学位,高级经济师。曾于2003 年7 月至2013年5月历任上海银行副行长、中国建设银行上海市分行副行长、深圳市分行行长、中国建设银行零售业务总监兼北京市分行行长。
王良先生,本行副行长,货币银行学硕士,高级经济师。1991年至1995年,在中国科技国际信托投资公司工作;1995年6月至2001年10月,历任招商银行北京分行展览路支行、东三环支行行长助理、副行长、行长、北京分行风险控制部总经理;2001年10月至2006年3月,历任北京分行行长助理、副行长;2006年3月至2008年6月,任北京分行党委书记、副行长（主持工作）;2008年6月至2012年6月,任北京分行行长、党委书记;2012年6月至2013年11月,任招商银行总行行长助理兼北京分行行长、党委书记;2013年11月至2014年12月,任招商银行总行行长助理;2015年1月起担任本行副行长;2016年11月起兼任本行董事会秘书。
姜然女士,招商银行资产托管部总经理,大学本科毕业,具有基金托管人高级管理人员任职资格。先后供职于中国农业银行黑龙江省分行,华商银行,中国农业银行深圳市分行,从事信贷管理、托管工作。2002年9月加盟招商银行至今,历任招商银行总行资产托管部经理、高级经理、总经理助理等职。是国内首家推出的网上托管银行的主要设计、开发者之一,具有20余年银行信贷及托管专业从业经验。在托管产品创新、服务流程优化、市场营销及客户关系管理等领域具有深入的研究和丰富的实务经验。
（三）基金托管业务经营情况
截至2018年3月31日,招商银行股份有限公司累计托管364只开放式基金。

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:（021）23261188
传真:（021）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: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:冀光恒
客服电话:021-96 2999/4006 962 999
联系人:李晨
传真:021-50105124
网址:www.srcb.com
(2)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
(3)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
(4)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1010号国际信托大厦21楼
法定代表人:何如
联系人:周杨
传真:0755-82133952
客户服务电话:95536
网址:www.guosen.com.cn
(5)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
(6) 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
(7)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
(8) 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
(9)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
(10)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
(11)名称:湘财证券股份有限公司
注册地址:湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼
办公地点:湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼
法定代表人:林俊波
客服电话:400-888-1551
传真:021-68865680
公司网址:www.xcsc.com
(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: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
(17)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
(18)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
(19)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
(20)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
(21)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
(22)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
(23)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
(24)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:北京市朝阳区朝阳门北大街18号中国人保寿险大厦12层
法定代表人:祝献忠
联系人:李慧灵
联系电话:010-85556100
传真:010-58568062
客户服务电话:400-898-9999
网址:www.hrsec.com.cn
(25)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
(26)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
(27)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
(28)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
(29)名称:深圳众禄基金销售股份有限公司
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
(30)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
(31)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
(32) 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
(33)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
(34)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
(35)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
(36)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
(37)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
(38)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
(39)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
(40) 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/
(41)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
(42)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:http://www.66zichan.com
(43)名称:上海汇付基金销售有限公司
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
(44)名称:上海陆金所基金销售有限公司
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
(45)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
(46)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
(47)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/
(48)名称:中民财富基金销售（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
（49）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
（50）北京蛋卷基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
办公地址:北京市朝阳区阜通东大街望京SOHO T3 A座19层
法定代表人: 钟斐斐
联系人:袁永姣
电话:010-61840688
传真:010-61840699
客户服务电话:4000-618-518
网址:www.danjuanapp.com
（51）上海大智慧基金销售有限公司
注册地址:中国（上海）自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102单元
办公地址:中国（上海）自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102、1103单元
法定代表人:申健
联系人:印强明
电话:021-20219988
传真:021-20219923
客户服务电话:021-20292031
网址:www.wg.com.cn
（52）南京苏宁基金销售有限公司
注册地址:南京市玄武区苏宁大道1号
办公地址:南京市玄武区苏宁大道1号
法定代表人: 刘汉青
联系人:王锋
电话:025-66996699-887226
传真:
客户服务电话:95177
网址:www.snjijin.com
（53）上海基煜基金销售有限公司
注册地址:上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室（上海泰和经济发展区）
办公地址:上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1503室
法定代表人:王翔
联系人:吴鸿飞
电话:021-65370077
传真:021-55085991
客户服务电话:4008-205-369
网址:www.jiyufund.com.cn
（54）上海挖财基金销售有限公司
注册地址:中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室
办公地址:中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室
法定代表人: 冷飞
联系人:李娟
电话:021-50810687
传真:021-58300279
客户服务电话:021-50810673
网址:www.wacaijijin.com
App:挖财宝
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:021-23261188
传真:021-23261199
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:021-31358666
传真:021-31358600
联系人:陆奇
经办律师:黎明、陆奇
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:021-23238888
传真:021-23238800
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:申万菱信价值优选灵活配置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
基金类别:混合型

六、基金的投资目标

本基金采用数量化的投资方法精选个股，严格按照纪律执行，力争获取长期稳定的超越业绩比较基准的投资回报。

七、基金的投资范围和投资对象

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（包括主板、中小板、创业板及其他依法发行、上市的股票）、权证、股指期货、国债期货、股票期权、债券（含国债、央行票据、金融债、公开发行的次级债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、可转债及分离交易可转债的纯债部分、可交换债券、地方政府债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单等固定收益类资产及现金，以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相关规定)。
本基金可以参与融资业务。
如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。
基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例为0%～95%;其中,本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

八、基金的投资策略

本基金采用数量化技术对投资策略进行优化，将特定的投资思想和理念通过具体指标与参数的设定体现在数量模型中,坚持以数量化的方式进行投资,充分发挥数量化投资的优势,保持投资策略的一致性与有效性。
1、股票投资策略
（1）多因子ALPHA选股模型
本基金管理人对上市公司的财务数据和市场指标数据进行统计分析，筛选出最有效的成份因子，寻求ALPHA来源,构建选股模型。
本基金采用的因子指标主要分为三大类:
1）市场面因子
本基金管理人认为,市场面因子对市场的反应比较直接,比基本分析更能反应实际市场的局部现象;在一个非完全有效的市场中,这些因子对选择股票的表现具有一定的正面贡献。本基金主要采用的市场面因子包括换手率和相对强弱指标等。
2）成长因子
本基金通过量化统计模型，建立企业成长因子库,根据历史表现,将直接能反映超额收益的成长因子作为本基金的成份因子。本基金入库的成长因子主要包含主营业务增长率,净利润增长率等。
3）估值因子
本基金管理人认为,估值是投资中最困难也是最重要的部分,它直接体现着持股的安全边际与风险;估值因子是本模型中相当重要的指标,按传统基本面投资思想,上市公司的历史表现和分析师的未来预期都会最终反映在估值因子中。为了更合理的对公司的估值进行评价,本基金采用多种估值方法构建估值因子体系，主要的参考估值指标包括市盈率、市净率、市销率和市现率等。
通过多因子ALHPA选股模型的评估,筛选出本基金的核心股票池。
（2）组合优化模型
基于核心股票池,本基金将根据基金的规模,选择合适的股票数量构建投资组合,通过组合优化模型决定各股票的加权方式与调仓频率等。本基金的组合优化模块,包括股票流动性评价、风险价值(VaR)以及动量/反转策略等。
（3）模型的动态调整
数量化模型的研发是一个持续检验、修正与优化的动态过程。基金管理人将根据市场变化趋势以及后续深入持续的研究，定期或不定期地对投资模型进行复核与检验,并对模型涉及的因子与策略进行修正与调整,不断改善模型的有效性与稳定性,以使得本基金能够持续的完成投资目标。
2、债券投资策略
在债券投资部分,将根据当前宏观经济形势、金融市场环境,通过有效的投资组合体现债券市场战略投资与战术投资的结合，并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,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,在较低风险条件下获得稳定投资收益。
3、股指期货投资策略
基金管理人可运用股指期货以提高投资效率，从而更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货的投资,以管理投资组合的系统性风险,改善组合的风险收益特性。此外,本基金还将运用股指期货来对冲特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理,如在基金出现巨额或较大申购赎回时,通过股指期货及时进行加仓或减仓,迅速的进行仓位调整,以达成申购赎回对基金运作带来的影响最小化的目的。
4、权证投资策略
本基金在进行权证投资时,将通过对权证标的证券基本面的研究,并结合权证定价模型寻求其合理估值水平,主要考虑运用的策略包括:杠杆策略、价值挖掘策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、卖空保护性的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略等。
本基金将充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征,通过资产配置、品种与类属选择,谨慎进行投资,追求较稳定的当期收益。
5、资产支持证券投资策略
在严格控制投资风险的前提下,本基金将从信用风险、流动性风险、利率风险、税收因素和提前还款因素等方面综合评估资产支持证券的投资品种，选择低估的品种进行投资。
6、可转换债券投资策略
可转换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性,具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。本基金将选择公司基本素质优良、其对应的基础证券有着较高上涨潜力的可转换债券进行投资，并采用期权定价模型等数量化估值工具评定其投资价值,以合理价格买入并持有。
7、融资投资策略
本基金将在充分考虑风险和收益特征的基础上,审慎参与融资交易。本基金将基于对市场行情和组合风险收益的的分析，确定投资时机、标的证券以及投资比例。若相关融资业务法律法规发生变化,本基金将从其最新规定,以符合上述法律法规和监管要求的变化。
8、股票期权投资策略
本基金将按照风险管理的原则参与股票期权交易。本基金将结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求,以套期保值为目的,确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。
若相关法律法规发生变化时,基金管理人对股票期权投资管理从其最新规定,以符合上述法律法规和监管要求的变化。未来如法律法规或监管机构允许基金投资其他期权品种，本基金将在履行适当程序后，纳入投资范围并制定相应投资策略。
9、国债期货投资策略
本基金将按照相关法律法规的规定,以套期保值为目的,结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析,对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平等指标进行跟踪监控,力求实现基金资产的中长期稳定增值。
若相关法律法规发生变化时,基金管理人对期货投资管理从其最新规定,以符合上述法律法规和监管要求的变化。

九、业绩比较基准

业绩比较基准为:50%×沪深300指数收益率 ＋ 50%×中证综合债指数收益率
如果今后法律法规发生变化，或者证券市场中有其他代表性更强或者更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则,与基金托管人协商一致,并按监管部门要求履行适当程序以后变更业绩比较基准并及时公告,该等变更无需召开基金份额持有人大会。如果本基金业绩比较基准所参照的指数在未来不再发布时，基金管理人可以按相关监管部门要求履行相关手续后,依据维护基金份额持有人合法权益的原则,选取相似的或可替代的指数作为业绩比较基准的参照指数,而无需召开基金份额持有人大会。

十、风险收益特征

本基金是混合型基金，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。

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2018年6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	67,321,745.77	91.07
	其中:股票	67,321,745.77	91.07
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	6,549,092.81	8.86
7	其他各项资产	51,648.36	0.07
8	合计	73,922,486.94	100.00

注: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	3,409,254.00	4.64
C	制造业	27,467,896.58	37.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,737,184.85	2.36
E	建筑业	3,110,890.00	4.23
F	批发和零售业	1,723,393.00	2.34
G	交通运输、仓储和邮政业	1,722,078.00	2.34
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,570,799.00	2.14
J	金融业	22,101,845.20	30.06
K	房地产业	4,120,555.00	5.60
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	81,226.14	0.11
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	276,624.00	0.38
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	67,321,745.77	91.55

2.2报告期末按行业分类的港股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)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	63,000.00	3,690,540.00	5.02
2	600519	贵州茅台	4,300.00	3,145,278.00	4.28
3	000333	美的集团	43,208.00	2,256,321.76	3.07
4	000651	格力电器	45,200.00	2,131,180.00	2.90
5	600016	民生银行	239,800.00	1,678,600.00	2.28
6	002304	洋河股份	12,200.00	1,605,520.00	2.18
7	600276	恒瑞医药	20,410.00	1,546,261.60	2.10
8	600585	海螺水泥	46,000.00	1,540,080.00	2.09
9	601328	交通银行	256,800.00	1,474,032.00	2.00
10	601288	农业银行	417,000.00	1,434,480.00	1.95

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序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。
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序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
本基金本报告期末未持有股指期货。
9.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金本报告期末未持有股指期货。
10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
10.1 本期国债期货投资政策
本基金本报告期末未持有国债期货。
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持有国债期货。
10.3 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末未持有国债期货。
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受到公开谴责、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其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	46,582.80
2	应收证券清算款	2,659.05
3	应收股利	-
4	应收利息	1,348.08
5	应收申购款	1,058.43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	51,648.36

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的情况。

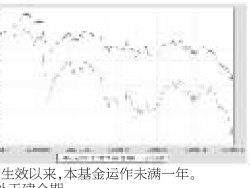
十二、基金的业绩

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
2018年01月04日（基金合同生效日）至2018年6月30日	-13.45%	1.08%	-5.59%	0.58%	-7.86%	0.50%

2. 自基金合同生效以来基金累计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

申万菱信价值优选混合型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2018年1月4日至2018年6月30日)



注:1）自基金合同生效以来,本基金运作未满一年。
2）本基金目前正处于建仓期。

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、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用;
4、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费;
5、基金份额持有人大会费用;
6、基金的证券、期货交易费用或结算而产生的交易费用;
7、基金的银行汇划费用;
8、账户开户费用和账户维护费;
9、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、基金管理人的管理费
本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.20%年费率计提。管理费的计算方法如下:
H＝E×1.20%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值
基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起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、公休日或不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延。
2、基金托管人的托管费
本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下:
H＝E×0.10%÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日的基金资产净值
基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延。
除管理费、托管费之外的前述第一款约定的其他费用由基金管理人和基金托管人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基金当期费用。
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。
鉴于基金管理人为本基金的利益投资、运用基金财产过程中，可能因法律法规、税收政策的要求而成为纳税义务人,就归属于基金的投资收益、投资回报和/或本金承担纳税义务。因此,本基金运营过程中由于上述原因发生的增值税等税负,仍由本基金财产承担，届时基金管理人与基金托管人可能通过本基金财产账户直接缴付，或划付至基金管理人账户并由基金管理人依据税务部门要求完成税款申报缴纳。投资人在收取本基金中归属于投资人份额的投资收益时,获得的金额为基金管理人扣除相应增值税、附加税等税负后的不含税金额。
如在本基金运作过程中,相关税收法律、法规被修订或替代,上述纳税义务及申报缴纳方式应以修订或替代后的有效税收法律、法规为准。

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》、《公开募集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、更新了重要提示中本招募说明书内容的截止日期;
2、更新了基金管理人的部分信息;
3、更新了基金托管人的部分信息;
4、更新了相关服务机构的部分信息;
5、更新的基金份额的申购和赎回的部分信息;
6、更新了投资组合报告,数据截止日期为2018年6月30日;
7、更新了基金的业绩部分,数据截止日期为2018年6月30日;
8、在“其他应披露事项”一章,列举了本基金自2018年1月4日至2018年7月4日发布的有关公告。
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关于申万菱信中证申万传媒行业投资指数分级证券投资基金之申万传媒A份额（150233）、申万传媒B份额（150234）终止上市的公告

《申万菱信中证申万传媒行业投资指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）于2015年5月29日生效,根据《基金合同》的相关规定,申万菱信中证申万传媒行业投资指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金份额包括申万菱信中证申万传媒行业投资指数分级证券投资基金之基础份额 （基金简称“申万传媒份额”;场内简称“申万传媒”;基金代码“163117”）、申万菱信中证申万传媒行业投资指数分级证券投资基金之稳健收益类份额（基金简称“申万传媒A份额”;场内简称“传媒业A”;基金代码“150233”）与申万菱信中证申万传媒行业投资指数分级证券投资基金之积极进取类份额 （基金简称 “申万传媒B份额”;场内简称“传媒业B”;基金代码“150234”）。其中,申万传媒A份额、申万传媒B份额于2015年6月10日开始在深圳证券交易所上市交易。
根据本基金《基金合同》的相关规定,《基金合同》生效后,如本基金出现连续60个工作日基金资产净值低于5000万元的情形,本基金将根据《基金合同》的约定进入清算程序并终止,而无需召开基金份额持有人大会审议。截至2018年8月15日日终,本基金连续60个工作日基金资产净值低于5000万元,触发了本基金《基金合同》约定的基金合同终止条款,本基金已于2018年8月16日依法进入基金财产清算程序。基金管理人申万菱信基金管理有限公司已向深圳交易所申请终止申万传媒A份额、申万传媒B份额上市交易,并获得深圳证券交易所《终止上市通知书》(深证上[2018]380号)的同意。现将本基金之申万传媒A份额、申万传媒B份额的终止上市相关事项公告如下:
一、终止上市基金的基本信息
申万菱信中证申万传媒行业投资指数分级证券投资基金之申万传媒A份额:场内简称“传媒业A”,交易代码:150233
申万菱信中证申万传媒行业投资指数分级证券投资基金之申万传媒B份额:场内简称“传媒业B”,交易代码:150234
终止上市日:2018年8月22日
二、基金份额终止上市后续事项说明
本基金依据《基金合同》约定的情形终止,本基金管理人将根据相关法律法规、基金合同等规定成立基金财产清算小组,履行基金财产清算程序,基金财产清算相关事项详见本基金管理人于2018 年 8 月 16日发布的《关于申万菱信中证申万传媒行业投资指数分级证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》。
投资者若希望了解详情,请登陆本公司网站:www.swsmu.com或者拨打本公司客服电话:400880 8588（免长途话费）或021-962299。
特此公告。

申万菱信基金管理有限公司
2018年8月17日

申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的提示公告

根据《申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）关于不定期份额折算的相关规定,当申万环保B份额的基金份额参考净值达到或跌破0.2500元时，申万环保A份额 （场内简称: 环保A，基金代码:150184）、申万环保B份额（场内简称:环保B,基金代码:150185）、申万环保份额（场内简称:申万环保,基金代码:163114）将进行不定期份额折算。
由于近期A股市场波动较大,截至2018年8月16日,申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）之积极进取类份额（申万环保B份额）的基金份额净值接近基金合同规定的不定期份额折算的阀值0.2500元,在此提请投资者密切关注申万环保B份额近期净值的波动情况。
针对可能发生的不定期份额折算,本基金管理人特别提示如下:
一、本基金之申万环保A份额表现为低风险、收益相对稳定的特征。当发生合同规定的不定期份额折算时,份额折算后申万环保A份额与申万环保B份额的份额数始终保持1:1配比；份额折算前申万环保A份额持有人的资产与份额折算后其持有的申万环保A份额的资产及其持有的新增场内申万环保份额的资产之和相等;份额折算前申万环保A份额的持有人在份额折算后将持有申万环保A份额与新增场内申万环保份额。因此,持有人的风险收益特征将发生一定的变化,由持有单一的低风险收益特征份额变为同时持有低风险收益特征份额与较高风险收益特征份额的情况。
二、本基金之申万环保B份额表现为预期风险高、预期收益高的特征,当发生合同规定的不定期份额折算时,份额折算前申万环保B份额的资产与份额折算后申万环保B份额的资产相等。因此,持有人的风险收益特征将不发生变化,仍为持有单一的高风险收益特征份额。
三、申万环保A份额、申万环保B份额在折算前可能存在折溢价交易情形。不定期份额折算后,其折溢价率可能发生变化。特提请参与二级市场交易的投资者注意折溢价所带来的风险。
四、根据合同规定,折算基准日在触发阀值日后才能确定,因此折算基准日申万环保B份额的净值可能与触发折算的阀值0.2500元有一定差异。
本基金管理人的其他重要提示:
一、若本基金发生上述不定期份额折算情形,为保证折算期间本基金的平稳运作,本基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停申万环保A份额与申万环保B份额的上市交易和申万环保份额的申购及赎回等相关业务。届时本基金管理人将会对相关事项进行公告,敬请投资者予以关注。
投资者若希望了解基金不定期份额折算业务详情,请参阅基金合同及《申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金招募说明书》（以下简称 “招募说明书”）或者拨打本公司客服电话:400－880－8588（免长途话费）或021-962299。
二、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。本基金管理人提醒投资者知晓基金投资的“买者自负”原则,在做出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行承担。敬请投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的基金合同和招募说明书等相关法律文件。
特此公告。

申万菱信基金管理有限公司
二〇一八年八月十七日

申万菱信基金管理有限公司申万菱信安泰惠利纯债债券型证券投资基金基金合同生效公告

公告送出日期:2018年8月17日

1、公告基本信息

基金名称	申万菱信安泰惠利纯债债券型证券投资基金
基金简称	申万菱信安泰惠利纯债债券
基金主代码	005936
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年8月16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
公告依据	《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规、《申万菱信安泰惠利纯债债券型证券投资基金基金合同》、《申万菱信安泰惠利纯债债券型证券投资基金招募说明书》

2、基金募集情况

基金募集申请获中国证监会核准的文号		中国证监会证监许可【2018】631号
基金募集期间		自2018年7月9日至2018年8月10日止
验资机构名称		普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
募集资金划入基金托管专户的日期		2018年8月15日
募集有效认购总户数（单位:户）		1,912
募集期间净认购金额（单位:人民币元）		369,027,912.38
认购资金在募集期间产生的利息（单位:人民币元）		125,479.24
募集份额 （单位:份）	有效认购份额	369,027,912.38
	利息结转的份额	125,479.24
	合计	369,153,391.62
其中:募集期间基金管理人运用固有资金认购本基金情况	认购的基金份额（单位:份）	-
	占基金总份额比例	-
	其他需要说明的事项	无
其中:募集期间基金管理人的从业人员认购本基金情况	认购的基金份额（单位:份）	-
	占基金总份额比例	-
募集期限届满基金是否符合法律法规规定的办理基金备案手续的条件		是
向中国证监会办理基金备案手续获得书面确认的日期		2018年8月16日

注:按《申万菱信安泰惠利纯债债券型证券投资基金招募说明书》等法律文件的规定，本基金的有效认购款项在基金募集期间产生的利息在基金合同生效后将折算为基金份额,归基金份额持有人所有。利息转份额的具体数额以登记机构的记录为准。
本基金募集符合有关条件，本基金管理人已向中国证监会申请办理基金备案手续,并于2018年8月16日获确认,基金合同自该日起正式生效。基金合同生效之日起,本基金管理人正式开始管理本基金。
按照有关法律规定,本基金合同生效前的律师费、会计师费、信息披露费由基金管理人承担。
基金管理公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金基金份额总量的区间为0;本基金基金经理持有本基金基金份额总量的区间为0。
3 、其他需要提示的事项
基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理申购,具体业务办理时间在申购开始公告中规定。
基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理赎回,具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。
在确定申购开始与赎回开始时间后,基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告申购与赎回的开始时间。
风险提示:本公司承诺以诚实信用、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。投资者投资于本公司管理的基金时应认真阅读基金合同、招募说明书等文件。
特此公告。