# 申万菱信基金管理有限公司
# 申万菱信中证军工指数分级证券投资基金招募说明书(第八次更新)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2014年7月24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2018年7月24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
住所: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:中国证券监督管理委员会,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:赵鹏
股本结构: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。
铃木晃生先生,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,现任受托财产部门长、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。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,现任人力资源部负责人,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,历任风险管理部高级风险分析师、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,曾任监察稽核部总监,现任公司督察长。
4、基金经理
荆一帆先生,硕士研究生。2012年起从事金融相关工作,曾任职于华夏基金管理有限公司、国投瑞银基金管理有限公司。2017年01月加入申万菱信基金管理有限公司,现任申万菱信沪深300价值指数证券投资基金、申万菱信中证申万新兴健康产业主题投资指数证券投资基金(LOF)、申万菱信中证申万电子行业投资指数分级证券投资基金、申万菱信中证申万传媒行业投资指数分级证券投资基金、申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金、申万菱信中证军工指数分级证券投资基金基金经理。
俞诚先生,2015年12月至2017年12月任本基金基金经理。
袁英杰先生,2015年1月至2017年12月任本基金基金经理。
张少华先生,2014年7月至2015年12月任本基金基金经理。
5、投资决策委员会成员名单
投资决策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。
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

1、基本情况
名称:中国农业银行股份有限公司(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:周慕冰
成立日期: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
基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字[1998]23号
注册资本:32,479,411.7万元人民币
存续期间:持续经营
联系电话:010-66060069
传真:010-68121816
联系人:贺倩
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"伴你成长"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。自2010年起中国农业银行连续通过托管业务国际内控标准(ISAE3402)认证,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"。2012年荣获第十届中国财经风云榜"最佳资产托管银行"奖;2013年至2017年连续荣获上海清算所授予的"托管银行优秀奖"和中央国债登记结算有限责任公司授予的"优秀托管机构奖"称号;2015年、2016年荣获中国银行业协会授予的"养老金业务最佳发展奖"称号;2018年荣获中国基金报授予的公募基金20年"最佳基金托管银行"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,2014年更名为托管业务部/养老金管理中心,内设综合管理部、业务管理部、客户一部、客户二部、客户三部、客户四部、风险合规部、产品研发与信息技术部、营运一部、营运二部、市场营销部、内控监督部、账户管理部,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近240名,其中具有高级职称的专家30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
截止到2018年06月30日,中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共425只。

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)代销机构
(1)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:周慕冰
客户服务电话:95599
网址:www.abchina.com
(2)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
联系人:曹榕
电话:021-58781234
客户服务电话:95559
网址:www.bankcomm.com
(3)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
(4)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
(5)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
(6)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
(7)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
(8)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
(9)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
(10) 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
(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
公司网址:www.htsec.com
(12) 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
(13)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
(14)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
(15)名称:华泰证券股份有限公司
注册地址:南京市江东中路228号
办公地址:南京市建邺区江东中路228号华泰证券广场、深圳市福田区深南大道4011号港中旅大厦18楼
法定代表人:周易
联系人:庞晓芸
电话:0755-82492193
传真:0755-82492962
客服电话:95597
网址:www.htsc.com.cn
(16)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
(17)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
(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:95321
公司网址:www.cindasc.com
(19)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
(20) 名称:广州证券股份有限公司
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:邱三发
联系人: 梁微
联系电话: 020-88836999
传真: 020-88836654
客户服务电话:95396
网址: www.gzs.com.cn
(21) 名称:上海证券有限责任公司
住所:上海市黄浦区四川中路213号7楼
法定代表人:李俊杰
联系电话:021-53686888
客户服务电话:021-962518
传真:021-53686100-7008,021-53686200-7008
网址:www.962518.com
(22) 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
(23)名称: 浙商证券股份有限公司
注册地址: 浙江省杭州市西湖区杭大路1号黄龙世纪广场A座
办公地址:浙江省杭州市西湖区杭大路1号黄龙世纪广场A座6、7楼
邮政编码:310007
法定代表人:吴承根
传真:021-80106010
客服电话: 95345
网址:www.stocke.com.cn
(24)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
(25)名称:东莞证券股份有限公司
住所:广东省东莞市莞城区可园南路一号金源中心30楼
办公地址:广东省东莞市莞城区可园南路一号金源中心22楼
法定代表人:张运勇
客户服务电话:95328
传真:0769-22115712
网址:http://www.dgzq.com.cn
(26)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
(27)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
(28)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
(29)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
(30)名称:中航证券有限公司
注册地址:南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼
法定代表人:王宜四
联系人:史江蕊
客服电话:400-8866-567
网址:www.avicsec.com
(31)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
(32)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
(33)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
(34)名称:联讯证券股份有限公司
住所: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
(35)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
(36)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
(37)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
(38)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
(39)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
(40)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
(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
传真:021-20835879
客服电话:400-920-0022/ 021-20835588
网址:licaike.hexun.com
(42)名称:诺亚正行基金销售有限公司
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
(43)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
(44)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
(45)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
(46) 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
(47)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
(48)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
(49)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
(50)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:上海市虹口区东大名路1098号浦江金融世纪广场18F
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
(51)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
(52)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
(53)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
(54) 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/
(55)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
(56)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
(57)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
(58)名称:深圳富济基金销售有限公司
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
(59)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
(60)名称:大泰金石基金销售有限公司
注册地址: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
(61)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
(62)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/
(63)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
(64)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
(65)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
(66)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
(67)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
(68)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
(69)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
2、场内发售机构
(1)本基金的场内发售机构为深圳证券交易所内具有基金销售业务资格的会员单位,具体名单:爱建证券、安信证券、渤海证券、财达证券、财富证券、财富里昂、财通证券、长城证券、长江证券、川财证券、大通证券、大同证券、德邦证券、第一创业、东北证券、东方证券、东海证券、东莞证券、东吴证券、东兴证券、高华证券、方正证券、光大证券、广发证券、广州证券、国都证券、国海证券、国金证券、国开证券、国联证券、国盛证券、国泰君安、国信证券、国元证券、海通证券、恒泰长财、恒泰证券、红塔证券、宏源证券、宏信证券、华安证券、华宝证券、华创证券、华福证券、华林证券、华龙证券、华融证券、华泰联合、华泰证券、华西证券、华鑫证券、江海证券、金元证券、开源证券、联讯证券、民生证券、民族证券、南京证券、平安证券、齐鲁证券、日信证券、瑞银证券、山西证券、上海证券、申银万国、世纪证券、首创证券、天风证券、天源证券、万和证券、万联证券、西部证券、西藏同信、西南证券、厦门证券、湘财证券、新时代证券、信达证券、兴业证券、银河证券、银泰证券、英大证券、招商证券、浙商证券、中航证券、中金公司、中山证券、中投证券、中天证券、中信建投、中信浙江、中信山东、中信证券、中银证券、中邮证券、中原证券(排名不分先后)。
(2)本基金募集结束前获得基金销售业务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。
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代理销售本基金或变更上述代销机构,并及时公告。
二、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:周明
电话: 010-59378835
传真: 010-59378907
联系人:任瑞新
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
联系人姓名:孙睿
经办律师:孙睿、黎明
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
法定代表人姓名:杨绍信
电话:+86 -21-23238888
传真:+86-21-23238800
联系人姓名:赵钰
经办注册会计师姓名:薛竞、赵钰

四、基金的名称

本基金的名称:申万菱信中证军工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%,实现对中证军工指数的有效跟踪。

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、债券、权证、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。
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。
本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)占基金资产的比例为85%－95%,其中投资于股票的资产不低于基金资产的85%,投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%;每个交易日日终,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或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、投资策略

1、股票投资策略
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)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。
(2)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。
2、股指期货投资策略
本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货的投资。本基金投资股指期货将主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约,力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。

九、业绩比较基准

业绩比较基准为:95%×中证军工指数收益率+5%×银行同业存款利率。
本基金以中证军工指数为标的指数,原则上将不低于80%的非现金基金资产投资于标的指数成份股和备选成份股,不低于5%的资产投资于现金类资产,业内现金类资产收益率基本以银行同业存款利率为基准,故选用以上业绩比较基准可以有效评估本基金投资组合业绩,反映本基金的风格特点。
中证军工指数由中证指数有限公司编制并发布,选择业务领域涉及军工行业的相关上市公司股票作为指数样本股,包括十大军工集团旗下以军工为主营业务的上市公司以及其他军工类上市公司。军工行业主要包括航空、航天、船舶、兵器、核工业和军事电子等业务领域。
如果中证军工指数被停止编制或发布,或由其他指数替代(单纯更名除外),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本基金的目标指数,或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时,基金管理人可以依据审慎原则,在充分考虑基金份额持有人利益及履行适当程序的前提下,更换本基金的标的指数、业绩比较基准和投资对象,并依据市场代表性、流动性、与原标的指数的相关性等诸多因素选择确定新的标的指数,而无需召开基金份额持有人大会,基金管理人应与基金托管人协商一致后,报中国证监会备案并及时公告。

十、风险收益特征

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。申万军工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;申万军工A份额,则具有预期风险低,预期收益低的特征;申万军工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。

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06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 | 1,019,717,918.88 | 90.98 |
| | 其中:股票 | 1,019,717,918.88 | 90.98 |
| 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 | 100,695,512.91 | 8.98 |
| 7 | 其他资产 | 439,526.19 | 0.04 |
| 8 | 合计 | 1,120,852,957.98 | 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

| 序号 | 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 | 946,920,036.44 | 84.75 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 71,559.85 | 0.01 |
| 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 | 72,645,096.45 | 6.50 |
| J | 金融业 | - | - |
| 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 | 81,226.14 | 0.01 |
| 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 | 1,019,717,918.88 | 91.27 |

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) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 601989 | 中国重工 | 23,658,821.00 | 95,581,636.84 | 8.55 |
| 2 | 000768 | 中航飞机 | 4,063,952.00 | 63,560,209.28 | 5.69 |
| 3 | 600893 | 航发动力 | 2,641,907.00 | 58,967,364.24 | 5.28 |
| 4 | 002179 | 中航光电 | 1,160,989.00 | 45,278,571.00 | 4.05 |
| 5 | 600879 | 航天电子 | 6,386,356.00 | 44,896,082.68 | 4.02 |
| 6 | 600482 | 中国动力 | 2,545,350.00 | 44,416,357.50 | 3.98 |
| 7 | 600760 | 中航沈飞 | 1,230,550.00 | 44,349,022.00 | 3.97 |
| 8 | 002465 | 海格通信 | 4,741,667.00 | 38,075,586.01 | 3.41 |
| 9 | 002268 | 卫 士 通 | 1,722,744.00 | 37,607,501.52 | 3.37 |
| 10 | 600038 | 中直股份 | 865,266.00 | 34,601,987.34 | 3.10 |

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投资。
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
本基金本报告期末未投资股指期货交易。
9.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金本报告期末投资股指期货交易。
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,本基金不能投资于国债期货。
10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
根据本基金基金合同,本基金不能投资于国债期货。
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,本基金不能投资于国债期货。
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的情形。本基金投资的前十名证券的发行主体除中国动力(600482.SH)外,在报告编制日前一年内没有受到公开谴责和处罚的情形。
上海证券交易所于2018年1月10日发布了"《关于对中国船舶重工集团动力股份有限公司及有关责任人予以纪律处分的决定》的公告"。经查明,公司未按要求及时披露2016年年度业绩预告和大额政府补助信息,上海证券交易所为此对公司予以通报批评。
中国动力为本基金的业绩基准"中证军工指数"的成份股,因为本基金为采用完全复制方式被动跟踪标的指数的基金产品,所以中国动力受到上海证券交易所批评的情形不会影响本基金的投资决策。
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 | 210,699.96 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 20,075.72 |
| 5 | 应收申购款 | 208,750.51 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 439,526.19 |

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。

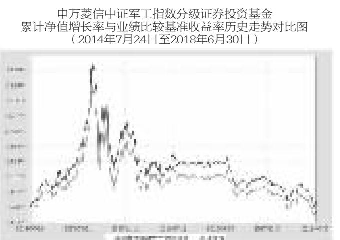
十二、基金的业绩

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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 2014年7月24日(基金合同生效日)至2014年12月31日 | 24.76% | 1.85% | 39.33% | 2.00% | -14.57% | -0.15% |
| 2015年 | 41.58% | 3.45% | 43.17% | 3.21% | -1.59% | 0.24% |
| 2016年 | -22.38% | 2.02% | -22.55% | 1.89% | 0.17% | 0.13% |
| 2017年 | -16.57% | 1.21% | -17.43% | 1.22% | 0.86% | -0.01% |
| 2018年1月1日至2018年6月30日 | -17.89% | 1.71% | -16.87% | 1.75% | -1.02% | -0.04% |
| 自基金合同生效起至2018年6月30日 | -6.08% | 2.28% | 6.05% | 2.18% | -12.13% | 0.10% |

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

申万菱信中证军工指数分级证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2014年7月24日至2018年6月30日)



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、标的指数许可使用费;
4、基金上市费用及年费;
5、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用;
6、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;
7、基金份额持有人大会费用;
8、基金的证券、期货交易费用或结算而产生的费用;
9、基金的银行汇划费用;
10、账户开户费用和账户维护费;
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、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1.00%年费率计提。管理费的计算方法如下:
H＝E×1.00%÷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
基金管理费自基金合同生效次日起每日计算,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款指令,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、公休假等,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0.22%的年费率计提。托管费的计算方法如下:
H＝E×0.22%÷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
基金托管费自基金合同生效次日起每日计算,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款指令,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取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。
3、基金合同生效后标的指数许可使用费
本基金作为指数基金,需根据与指数所有人中证指数有限公司签署的指数许可使用协议的约定向中证指数有限公司支付指数许可使用费。通常情况下,指数许可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×年费率/当年天数 ,本基金年指数使用费率为0.02%
H为每日应付的指数许可使用费
E为前一日的基金资产净值
基金合同生效后的指数许可使用费每日计算,逐日累计,按季支付。标的指数许可使用费的收取下限为每季人民币5万元(大写:伍万元整),计费区间不足一季度的,根据实际天数按比例计算。由基金管理人向基金托管人发送指数许可使用费划付指令,经基金托管人复核后,于每年1月、4月、7月、10月的前十(10)个工作日内从基金财产中一次性支付给中证指数有限公司上一季度的标的指数许可使用费。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。
如果指数使用许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整,本基金将采用调整后的方法或费率计算指数许可使用费。基金管理人将在招募说明书更新或其他公告中披露基金最新适用的方法。
除管理费、托管费、标的指数许可使用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,列入基金费用。
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。

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所载内容的截止日期;
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、更新了本基金的投资组合报告部分,数据截止日期为2018年6月30日;
6、更新了本基金的业绩部分,数据截止日期为2018年6月30日;
7、在"其他应披露事项"一章,列举了本基金自2018年1月25日至2018年7月24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
2018年9月6日

## 申万菱信基金管理有限公司
## 关于旗下部分基金新增济安财富(北京)基金销售有限公司为代销机构并开通定期定额投资、转换业务并参加济安财富(北京)基金销售有限公司开展的费率优惠活动的公告

为更好地满足广大投资者的理财需求,经与济安财富(北京)基金销售有限公司(以下简称"济安财富")协商一致,申万菱信基金管理有限公司(以下简称"本公司")决定自2018年9月10日起,旗下部分基金新增济安财富为代销机构并开通定期定额投资、转换业务,并参加济安财富开展的费率优惠活动。详情如下:
一、适用基金范围

| 基金名称 | 基金代码 |
|---|---|
| 申万菱信中证申万电子行业投资指数分级证券投资基金 | 163116 |
| 申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金 | 163118 |
| 申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF) | 163110 |
| 申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金 | 163113 |
| 申万菱信深证成指分级证券投资基金 | 163109 |
| 申万菱信中小板指数证券投资基金(LOF) | 163111 |
| 申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金 | 163114 |
| 申万菱信中证军工指数分级证券投资基金 | 163115 |
| 申万菱信中证申万新兴健康产业主题投资指数证券投资基金(LOF) | 163119 |
| 申万菱信安鑫回报灵活配置混合型证券投资基金(A类) | 001201 |
| 申万菱信多策略灵活配置混合型证券投资基金(A类) | 001148 |
| 申万菱信新能源汽车主题灵活配置混合型证券投资基金 | 001156 |
| 申万菱信沪深300价值指数证券投资基金 | 310398 |
| 申万菱信沪深300指数增强型证券投资基金 | 310318 |
| 申万菱信竞争优势混合型证券投资基金 | 310368 |
| 申万菱信可转换债券债券型证券投资基金 | 310518 |
| 申万菱信盛利精选证券投资基金 | 310308 |
| 申万菱信收益宝货币市场基金(A类/B类) | 310338/310339 |
| 申万菱信稳益宝债券型证券投资基金 | 310508 |
| 申万菱信消费增长混合型证券投资基金 | 310388 |
| 申万菱信新动力混合型证券投资基金 | 310328 |
| 申万菱信新经济混合型证券投资基金 | 310358 |
| 申万菱信中证500指数增强型证券投资基金 | 002510 |
| 申万菱信安鑫优选混合型证券投资基金(A类/C类) | 003493/003512 |
| 申万菱信安鑫精选混合型证券投资基金(A类/C类) | 003601/003602 |
| 申万菱信中证500指数优选增强型证券投资基金 | 003986 |
| 申万菱信量化成长混合型证券投资基金 | 004135 |
| 申万菱信价值优利混合型证券投资基金 | 004951 |
| 申万菱信行业轮动股票型证券投资基金 | 005009 |
| 申万菱信价值优先混合型证券投资基金 | 004769 |
| 申万菱信价值优选灵活配置混合型证券投资基金 | 005370 |
| 申万菱信量化驱动混合型证券投资基金 | 005418 |
| 申万菱信智能驱动股票型证券投资基金 | 005825 |

二、基金转换业务
经与济安财富协商一致,自2018年9月10日起,本公司将同时在济安财富开通申万菱信盛利精选证券投资基金、申万菱信沪深300指数增强型证券投资基金、申万菱信新动力混合型证券投资基金、申万菱信收益宝货币市场基金(A类/B类)、申万菱信新经济混合型证券投资基金、申万菱信竞争优势混合型证券投资基金、申万菱信消费增长混合型证券投资基金、申万菱信沪深300价值指数证券投资基金、申万菱信稳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、申万菱信多策略灵活配置混合型证券投资基金(A类)、申万菱信安鑫回报灵活配置混合型证券投资基金(A类)、申万菱信新能源汽车主题灵活配置混合型证券投资基金、申万菱信中证500指数增强型证券投资基金、申万菱信安鑫优选混合型证券投资基金(A类/C类)、申万菱信安鑫精选混合型证券投资基金(A类/C类)、申万菱信中证500指数优选增强型证券投资基金、申万菱信量化成长混合型证券投资基金、申万菱信价值优利混合型证券投资基金、申万菱信行业轮动股票型证券投资基金、申万菱信价值优先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、申万菱信量化驱动混合型证券投资基金、申万菱信智能驱动股票型证券投资基金之间的互相转换业务。
上述基金中登TA产品申万菱信深证成指分级证券投资基金、申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)、申万菱信中小板指数证券投资基金(LOF)、申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金、申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金、申万菱信中证军工指数分级证券投资基金、申万菱信中证申万电子行业投资指数分级证券投资基金、申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金、申万菱信中证申万新兴健康产业主题投资指数证券投资基金(LOF)之间的互相转换业务也同时开通。
具体业务规则请遵循济安财富的规定,各基金的相关费率请查阅各基金最新的招募说明书(更新)或登录本公司网站查询。
三、定期定额投资业务
定期定额申购业务是指投资者通过指定销售机构提出固定日期和固定金额的扣款和申购申请,由指定销售机构在约定扣款日为投资者自动完成扣款及基金申购申请的一种交易方式。
(一)适用基金范围
自2018年9月10日起,本公司将同时在济安财富办理上述基金(除申万菱信收益宝货币市场基金(B类))的定期定额投资业务。
(二)适用投资者范围
中华人民共和国境内的个人投资者(法律法规禁止购买证券投资基金者除外)。
(三)申请方式
1、凡申请办理定期定额投资业务的投资者须首先开立本公司开放式基金账户(适用于自建TA产品申万菱信盛利精选证券投资基金、申万菱信沪深300指数增强型证券投资基金、申万菱信新动力混合型证券投资基金、申万菱信收益宝货币市场基金(A类)、申万菱信新经济混合型证券投资基金、申万菱信竞争优势混合型证券投资基金、申万菱信消费增长混合型证券投资基金、申万菱信沪深300价值指数证券投资基金、申万菱信稳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、申万菱信多策略灵活配置混合型证券投资基金(A类)、申万菱信安鑫回报灵活配置混合型证券投资基金(A类)、申万菱信新能源汽车主题灵活配置混合型证券投资基金、申万菱信中证500指数增强型证券投资基金、申万菱信安鑫优选混合型证券投资基金(A类/C类)、申万菱信安鑫精选混合型证券投资基金(A类/C类)、申万菱信中证500指数优选增强型证券投资基金、申万菱信量化成长混合型证券投资基金、申万菱信价值优利混合型证券投资基金、申万菱信行业轮动股票型证券投资基金、申万菱信价值优先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、申万菱信量化驱动混合型证券投资基金、申万菱信智能驱动股票型证券投资基金,已开户者除外)或中国证券登记结算有限责任公司(以下简称"中登")深圳开放式基金账户(适用于中登TA产品申万菱信深证成指分级证券投资基金、申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)、申万菱信中小板指数证券投资基金(LOF)、申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金、申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金、申万菱信中证军工指数分级证券投资基金、申万菱信中证申万电子行业投资指数分级证券投资基金、申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金、申万菱信中证申万新兴健康产业主题投资指数证券投资基金(LOF),已开户者除外),具体开户程序请遵循济安财富的规定。
2、已开立本公司开放式基金账户或中登深圳开放式基金账户的投资者到济安财富申请增开交易账号(已在济安财富开户者除外),并申请办理定期定额投资业务,具体办理程序请遵循济安财富的规定。
(四)扣款方式和扣款日期
投资者须遵循济安财富的基金定期定额投资业务规则,指定本人的人民币结算账户作为扣款账户;根据与济安财富的约定进行扣款。若遇非基金申购开放日则顺延至下一基金申购开放日。
(五)投资金额
投资者可与济安财富就申请开办基金定期定额投资业务约定每期申购金额,定期定额业务起点金额为人民币100元整。
(六)申购费率
详见"四、费率优惠"部分。
(七)交易确认
每月实际扣款日即为基金申购申请日,并以该日(T日)的基金份额资产净值为基准计算申购份额,申购份额将在T+1工作日确认成功后直接计入投资者的基金账户内。基金份额确认查询起始日为T+2工作日。
(八)已申购份额的赎回及赎回费率
投资者办理基金定期定额申购业务后,可以自T+2日起(T为申购申请日)随时办理基金的赎回。如无另行公告,定期定额投资业务已申购份额的赎回及赎回费率等同于正常的赎回业务。
(九)变更及终止
投资者通过济安财富申请办理,具体办理程序遵循济安财富的有关规定。
四、费率优惠
自2018年9月10日起,投资者通过济安财富申购(含定期定额申购)、认购及转换本公司旗下上述基金,认/申购费率不设折扣限制,具体折扣费率以济安财富公告为准。投资者通过济安财富办理上述转换业务时,转出与转入基金的申购补差费率不设折扣限制,原申购补差费率为固定费用的除外,具体申购补差费率以济安财富的最新业务通知为准。基金原费率请详见基金合同、招募说明书(更新)等法律文件,以及本公司发布的最新业务公告。
费率优惠期限内,如本公司新增通过济安财富代销的基金产品,则自该基金开放申购(含定期定额申购)或认购业务当日起,将同时参加相关业务(不含基金转换业务)费率优惠活动。该基金转换申购补差费率以本公司届时发布的相关公告为准。
五、重要提示
1、本费率优惠仅适用于在济安财富处于正常申购期的上述基金的前端收费模式的申购手续费(含定期定额申购业务产生的申购手续费)、处于基金募集期的基金认购费以及基金转换申购补差费,不包括基金赎回等其他业务的手续费。
2、本次所开通业务办理的相关规则及流程以济安财富的安排和规定为准,投资者欲了解各基金产品的详细情况,请仔细阅读各基金的基金合同、基金招募说明书(更新)等法律文件。
3、投资者应当充分了解基金定期定额投资和零存整取等储蓄方式的区别。定期定额投资是引导投资人进行长期投资、平均投资成本的一种简单易行的投资方式。但是定期定额投资并不能规避基金投资所固有的风险,不能保证投资者获得收益,也不是替代储蓄的等效理财方式。
4、投资者应认真阅读拟投资基金的《基金合同》、《招募说明书》等法律文件,了解所投资基金的风险收益特征,并根据自身情况购买与本人风险承受能力相匹配的产品。
5、费率优惠解释权归济安财富所有,有关费率优惠的具体规定如有变化,敬请留意济安财富最新公告。
六、投资者可通过以下途径了解或咨询相关情况

| 机构名称 | 网址 | 客服热线 |
|---|---|---|
| 济安财富(北京)基金销售有限公司 | www.jianfortune.com | 400-673-7010 |
| 申万菱信基金管理有限公司 | www.swsmu.com | 4008808588 |

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资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。敬请投资人注意投资风险。投资者投资前应认真阅读基金的基金合同、更新的招募说明书。
特此公告。

申万菱信基金管理有限公司
2018年9月6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9月5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
二〇一八年九月六日

## 申万菱信基金管理有限公司
## 关于调整部分基金在北京肯特瑞财富投资管理有限公司申购金额、赎回份额及最低持有份额下限的公告

为了答谢广大投资者的支持和厚爱,经与北京肯特瑞财富投资管理有限公司(以下简称"肯特瑞")协商一致,申万菱信基金管理有限公司(以下简称"本公司")决定自2018年9月10日起,针对肯特瑞销售平台降低部分基金申购金额、赎回份额及最低持有份额的限制,详情如下:
一、适用基金范围

| 基金名称 | 基金代码 |
|---|---|
| 申万菱信安鑫回报灵活配置混合型A类基金份额 | 001201 |
| 申万菱信多策略灵活配置混合型A类基金份额 | 001148 |
| 申万菱信新能源汽车主题灵活配置混合型证券投资基金 | 001156 |
| 申万菱信沪深300价值指数证券投资基金 | 310398 |
| 申万菱信沪深300指数增强型证券投资基金 | 310318 |
| 申万菱信竞争优势混合型证券投资基金 | 310368 |
| 申万菱信可转换债券债券型证券投资基金 | 310518 |
| 申万菱信盛利精选证券投资基金 | 310308 |
| 申万菱信收益宝货币市场基金A份额 | 310338 |
| 申万菱信稳益宝债券型证券投资基金 | 310508 |
| 申万菱信消费增长混合型证券投资基金 | 310388 |
| 申万菱信新动力混合型证券投资基金 | 310328 |
| 申万菱信新经济混合型证券投资基金 | 310358 |
| 申万菱信中证500指数增强型证券投资基金 | 002510 |
| 申万菱信安鑫优选混合型证券投资基金A类份额 | 003493 |
| 申万菱信安鑫优选混合型证券投资基金C类份额 | 003512 |
| 申万菱信安鑫精选混合型证券投资基金A类份额 | 003601 |
| 申万菱信安鑫精选混合型证券投资基金C类份额 | 003602 |
| 申万菱信中证500指数优选增强型证券投资基金 | 003986 |
| 申万菱信量化成长混合型证券投资基金 | 004135 |
| 申万菱信价值优利混合型证券投资基金 | 004951 |
| 申万菱信行业轮动股票型证券投资基金 | 005009 |
| 申万菱信价值优先混合型证券投资基金 | 004769 |
| 申万菱信价值优选灵活配置混合型证券投资基金 | 005370 |
| 申万菱信量化驱动混合型证券投资基金 | 005418 |
| 申万菱信智能驱动股票型证券投资基金 | 005825 |

二、申购金额、赎回份额及最低持有份额调整业务
1、自2018年9月10日起,投资者通过肯特瑞申购(含定期定额投资)、赎回本公司旗下上述基金,单笔最低申购(含定期定额投资)金额调整为10元人民币,基金最低赎回份额调整为10份,同时最低持有份额调整为0份。
2、最低限额调整期限内,如本公司新增通过肯特瑞代销的基金产品,自建TA基金产品同时适用上述最低申购金额(含定期定额投资)、赎回份额及最低持有份额的限制。中登TA基金产品不适用上述最低申购金额(含定期定额投资)、赎回份额及最低持有份额的限制。如有调整,具体以本公司届时发布的公告为准。
三、重要提示
1、上述事项业务办理的相关规则及流程以肯特瑞的安排和规定为准。
2、投资者应认真阅读拟投资基金的《基金合同》、《招募说明书》等法律文件,了解所投资基金的风险收益特征,并根据自身情况购买与本人风险承受能力相匹配的产品。
3、投资者应当充分了解基金定期定额投资和零存整取等储蓄方式的区别。定期定额投资是引导投资人进行长期投资、平均投资成本的一种简单易行的投资方式。但是定期定额投资并不能规避基金投资所固有的风险,不能保证投资者获得收益,也不是替代储蓄的等效理财方式。
4、本公告的解释权归本公司所有。
四、投资者可通过以下途径了解或咨询相关情况
1、北京肯特瑞财富投资管理有限公司
网站:fund.jd.com
客服电话:4000988511
2、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
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资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。敬请投资人注意投资风险。投资者投资前应认真阅读基金的基金合同、更新的招募说明书。
特此公告。

申万菱信基金管理有限公司
2018年9月6日