申万菱信申银万国证券行业指数分级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:中国工商银行股份有限公司

【重要提示】

- 本基金基金合同已于2014年3月13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2014年9月13日,有关基金的财务数据和净值表现截止日为2014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:上海市淮海中路300号香港新世界大厦40楼
法定代表人:姜国芳
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:牛锐
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信托银行株式会社任职,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。

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。

杉崎干雄先生,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。

赵鲜女士,监事,硕士研究生。曾任职于申银万国证券股份有限公司,主要从事人力资源相关工作。2012年加入申万菱信基金管理有限公司,现任行政管理总部副总监,兼任申万菱信(上海)资产管理有限公司监事。

牛锐女士,监事,法学博士,曾任职于申银万国证券、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,现任监察稽核总部副总监。

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。

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。

来肖贤先生,经济学硕士。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),曾任监察稽核总部副总经理,公司督察长,现任公司副总经理。

王伟先生,管理学博士。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(原申万巴黎基金管理有限公司),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)资产管理有限公司总经理。

4、督察长

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(原申万巴黎基金管理有限公司),曾任监察稽核总部总监,现任公司督察长。

5、现任基金经理

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年加入本公司筹备组,后正式加盟,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总监,量化投资部总经理,申万菱信沪深300价值、申万菱信深证成指分级、申万菱信中小板分级、申万菱信申万证券分级,申万菱信中证环保分级和申万菱信中证军工分级基金经理。

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、基金托管人概况

(一)基金情况

名称: 中国工商银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号
成立时间:1984年1月1日
法定代表人:姜建清
注册资本:人民币349,018,545,827元
联系电话:010-66105799
联系人:赵会军

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: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

2)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

3)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

4)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

5)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

6)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

7)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

8)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

9)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

10)名称:申银万国证券股份有限公司
注册地址:上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场45层
办公地址:上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场40层
法定代表人:储晓明
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
网址:www.sywg.com

11)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

12)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

13)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

14)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

15)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:4008601555
公司网址:www.dwzq.com.cn

16)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

17)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
公司网址:www.ebscn.com

18) 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

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: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:刘莹
传真:029-87406710
客户服务电话:95582
网站:www.westsecu.com

21)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

22)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

23)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

24)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

25)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
上海市虹口区欧阳路196号(法兰桥创意园)26号楼2楼
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

26)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

27)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

28)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

29)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

2、场内发售机构

(1)本基金的场内发售机构为具有基金销售业务资格的深圳证券交易所会员单位,具体名单为: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、诚浩证券、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、中信万通、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:张振波
经办注册会计师姓名:薛竞、张振波

四、基金的名称

申万菱信申银万国证券行业指数分级证券投资基金

五、基金的类型

上市契约型开放式

六、基金的投资目标

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%,实现对申银万国证券行业指数的有效跟踪。

七、基金的投资范围

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%;每个交易日日终在扣除股指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%的现金或到期日在一年以内的政府债券。

八、基金的投资策略

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%×申银万国证券行业指数收益率+5%×银行同业存款利率。

本基金以申银万国证券行业指数为标的指数,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主要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。

申银万国证券行业指数(801193)是申银万国行业股价系列指数旗下一只二级行业价格指数,是中国多层次证券市场的重要指数。该指数以沪深两市从事证券相关行业上市公司的股票作为其成份股,用以表征证券行业的整体股价变化,兼具价值尺度与投资标的的功能。

如果申银万国证券行业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。申万证券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;证券A份额,则具有预期风险低,预期收益低的特征;证券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2014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	154,616,354.75	91.48
	其中:股票	154,616,354.75	91.48
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	14,263,842.11	8.44
7	其他资产	143,559.62	0.08
8	合计	169,023,756.48	100.00

2 报告期末按行业分类的股票投资组合

A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	4,756,460.96	2.82
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	8,391,440.63	4.98
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	141,468,453.16	83.99
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	154,616,354.75	91.80

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	600030	中信证券	3,415,924	39,146,489.04	23.24
2	600837	海通证券	2,680,993	24,531,085.95	14.56
3	000776	广发证券	1,141,165	11,183,417.00	6.64
4	601901	方正证券	1,549,867	8,415,777.81	5.00
5	600739	辽宁成大	550,981	8,391,440.63	4.98
6	601688	华泰证券	1,055,597	7,938,089.44	4.71
7	600999	招商证券	666,504	6,738,355.44	4.00
8	600109	国金证券	303,249	6,025,557.63	3.58
9	601377	兴业证券	693,954	5,981,883.48	3.55
10	000783	长江证券	609,931	5,855,337.60	3.48

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
本基金本报告期末未投资股指期货。
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投资股指期货。
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 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	107,576.88
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,007.69
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	32,975.05
8	其他	-
9	合计	143,559.62

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。

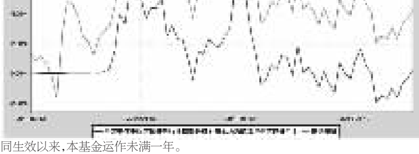
1. 净值增长率与业绩比较基准收益率比较:

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
最近一个月	-0.14%	0.96%	-0.37%	0.98%	0.23%	-0.02%
最近三个月	0.20%	1.17%	3.02%	1.34%	-2.82%	-0.17%
自基金合同生效起至2014年6月30日	0.28%	1.06%	4.31%	1.39%	-4.03%	-0.33%

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

申万菱信申银万国证券行业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3月13日至2014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%;每个交易日日终在扣除股指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%的现金或到期日在一年以内的政府债券。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、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前2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前2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, 需根据与上海申银万国证券研究所有限公司签署的指数使用许可协议的约定向上海申银万国证券研究所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

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50,000元,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基金标的指数许可使用费划付指令,经基金托管人复核后于每一季度末结束后的10 个工作日内将上季度标的指数许可使用费从基金财产中一次性支付给标的指数许可方。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、绪言、释义中运作办法的信息;
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、更新了代销机构的部分信息;
5、更新了律师事务所和会计师事务所的部分信息;
6、增加了投资组合报告,数据截止日期为2014年6月30日;
7、增加了基金的业绩部分,数据截止日期为2014年6月30日;
8、更新了对基金份额持有人的服务;
9、在"其他应披露事项"一章,列举了本基金自2014年3月13日至2014年9月13日发布的有关公告。

十五、其它应披露事项

自2014年3月13日至2014年9月13日,与本基金和本基金管理人有关的公告如下:

1、2014年3月15日,刊登于《中国证券报》和《上海证券报》的申万菱信申银万国证券行业指数分级证券投资基金基金合同生效公告;

2、2014年3月26日,刊登于《中国证券报》和《上海证券报》的关于申万菱信申银万国证券行业指数分级证券投资基金开通份额配对转换业务的公告;

3、2014年3月26日,刊登于《中国证券报》和《上海证券报》的申万菱信申银万国证券行业指数分级证券投资基金开放日常申购、赎回业务公告;

4、2014年3月26日,刊登于《中国证券报》和《上海证券报》的申万菱信申银万国证券行业指数分级证券投资基金上市交易公告书;

5、2014年3月31日,刊登于《中国证券报》和《上海证券报》的申万菱信申银万国证券行业指数分级证券投资基金之申万证券A份额、申万证券B份额上市交易提示性公告;

6、2014年5月26日,刊登于《中国证券报》和《上海证券报》的关于申万菱信申银万国证券行业指数分级证券投资基金在浙江同花顺基金销售有限公司开通定期定额投资业务并参加网上交易费率优惠活动的公告;

7、2014年6月16日,刊登于《中国证券报》和《上海证券报》的关于申万菱信申银万国证券行业指数分级证券投资基金参加部分代销机构申购及定期定额申购费率优惠活动的公告;

8、2014年6月16日,刊登于《中国证券报》和《上海证券报》的申万菱信申银万国证券行业指数分级证券投资基金基金开放日常转换、定期定额投资业务的公告;

9、2014年6月18日,刊登于《中国证券报》和《上海证券报》的申万菱新基金管理有限公司关于网上直销费率优惠的公告;

10、2014年7月1日,刊登于《中国证券报》和《上海证券报》的关于旗下部分开放式基金继续参加交通银行股份有限公司开展的网上银行和手机银行基金申购费率优惠活动的公告;

11、2014年7月1日,刊登于《中国证券报》和《上海证券报》的关于旗下开放式基金2014年半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;

12、2014年7月19日,刊登于《中国证券报》和《上海证券报》的申万菱信申银万国证券行业指数分级证券投资基金2014年第2季度报告;

13、2014年8月26日,刊登于《中国证券报》和《上海证券报》的申万菱信申银万国证券行业指数分级证券投资基金2014年半年度报告正文及摘要。

签署日期:2014年10月10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10月27日

申万菱信基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加同花顺基金开展的申购费率优惠活动的公告

为答谢广大投资者长期以来的信任与支持,经与浙江同花顺基金销售有限公司(以下简称"同花顺基金")协商一致,申万菱信基金管理有限公司(以下简称"本公司")决定旗下部分开放式基金自2014年10月29日起参加同花顺基金开展的申购费率优惠活动。现将有关事项公告如下:

一、适用基金范围

序号	基金名称	基金代码
1	申万菱信申银万国证券行业指数分级证券投资基金	163113
2	申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金	163114
3	申万菱信中证军工指数分级证券投资基金	163115

二、优惠活动时间

自2014年10月29日起持续进行,具体优惠活动期间为每个星期三的交易时间。活动结束时间以同花顺基金的公告为准,届时本公司不再另行公告。

三、优惠活动内容

活动期间,投资者通过同花顺基金网上交易系统申购(不含基金定投和转换业务)本公司上述开放式基金(前端收费模式),其申购费率享有2折优惠。原申购费率高于0.6%的,享受费率2折优惠,若优惠折扣后费率低于0.3%,则按0.3%执行。若该基金原申购费率适用于固定费用的,则执行该基金的固定费用,不再享有费率折扣。

四、重要提示

1、本优惠活动的折扣费率以同花顺基金的规定为准。本优惠活动解释权归同花顺基金所有,且其有权对上述优惠活动内容进行变更,本公司不再另行公告。有关优惠活动的具体规定如有变化,以同花顺基金的最新公告为准,敬请投资者关注。

2、本优惠活动仅适用于处于正常申购期的基金产品的申购手续费,不包括基金定投业务及基金转换业务等其他业务的基金手续费。

3. 上述基金申购费率以各基金基金合同、招募说明书及相关最新公告为准。投资者投资于各基金前请认真阅读本公司旗下各基金的基金合同、招募说明书等法律文件。

五、投资者可通过以下途径咨询有关详情:

1、浙江同花顺基金销售有限公司
咨询电话:4008-773-772
网站:www.5ifund.com
2、申万菱信基金管理有限公司
客服电话: 400 880 8588(免长途话费)或021-962299
网址: www.swsmu.com

六、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,敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

申万菱信基金管理有限公司
2014年10月27日

安信永利信用定期开放债券型证券投资基金2014年第一次分红公告

公告送出日期:2014年10月27日

1、公告基本信息

基金名称		安信永利信用定期开放债券型证券投资基金	
基金简称		安信永利信用债券	
基金主代码		000310	
基金合同生效日		2013年11月08日	
基金管理人名称		安信基金管理有限责任公司	
基金托管人名称		中国农业银行股份有限公司	
公告依据		《证券投资基金信息披露管理办法》、《安信永利信用定期开放债券型证券投资基金基金合同》、《安信永利信用定期开放债券型证券投资基金招募说明书》等	
收益分配基准日		2014年10月20日	
有关年度分红次数的说明		本次分红为2014年第一次分红	
下属分级基金的基金简称		安信永利信用债券A	安信永利信用债券C
下属分级基金的交易代码		000310	000335
截止基准日下属分级基金的相关指标	基准日下属分级基金份额净值(单位:元)	1.115	1.111
	基准日下属分级基金可供分配利润(单位:元)	18,330,447.13	5,649,604.19
	截止基准日下属分级基金按照基金合同约定的分红比例计算的应分配金额(单位:元)	5,499,134.14	1,694,881.26
本次下属分级基金分红方案(单位:元/10份基金份额)		0.90	0.90

注:在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为4次,每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的30%,若基金合同生效不满3 个月可不进行收益分配。

2、与分红相关的其他信息

权益登记日	2014年10月31日
除息日	2014年10月31日
现金红利发放日	2014年11月04日
分红对象	权益登记日登记在册的本基金份额持有人。
红利再投资相关事项的说明	选择红利再投资的投资者,其红利再投资时的基金份额净值基准日为2014年10月31日;红利再投资的基金份额可赎回起始日为2014年11月04日。
税收相关事项的说明	根据财政部、国家税务总局的财税字【2002】128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》,对投资者(包括个人投资者和机构投资者)从基金分配中取得的收入,暂不征收个人所得税和企业所得税。
费用相关事项的说明	本基金本次分红免收分红手续费;选择红利再投资方式的投资者其红利再投资的基金份额免收申购费用。

3、其他需要提示的事项

(1)权益登记日(2014年10月31日)申购或转换转入的基金份额不享有本次分红权益,赎回或转换转出的基金份额享有本次分红权益。

(2)选择现金红利方式的投资者的红利款将于2014年11月04日自基金托管账户划出。

(3) 选择红利再投资方式的投资者所转换的基金份额将以2014年10月31日的基金份额净值为计算基准确定再投资份额, 红利再投资所转换的基金份额于2014年11月03日直接划入其基金账户,2014年11月04日起投资者可以查询本次分红情况。

(4)投资者如需设置或修改本次分红方式,请务必于权益登记日之前(即2014年10月31日之前,不含2014年10月31日),在本基金开放日的交易时间内到销售网点更改分红方式。投资者若未选择具体分红方式,本基金默认现金红利方式。

(5)投资者可在安信基金管理有限责任公司网站(www.essencefund.com)查询本次分红情况,也可向安信基金管理有限责任公司客户服务中心咨询(全国统一客户服务热线电话:4008-088-088)。

(6)投资者还可以到中国农业银行股份有限公司、张家港农村商业银行股份有限公司、安信证券股份有限公司、招商证券股份有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信万通证券有限责任公司、中信证券(浙江)有限责任公司、海通证券股份有限公司、东海证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、上海长量基金销售投资顾问有限公司、杭州数米基金销售有限公司、上海天天基金销售有限公司、和讯信息科技有限公司、北京增财基金销售有限公司等本基金的代销机构查询本基金本次分红的有关情况。

风险提示:本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财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。因基金分红导致基金份额净值变化,不会改变基金的风险收益特征,不会降低基金投资风险或提高基金投资收益。基金的过往业绩不代表未来表现,敬请投资者注意投资风险。

安信基金管理有限责任公司
2014年10月27日

证券代码:300227 证券简称:光韵达 公告编号:2014-038

深圳光韵达光电科技股份有限公司2014年第三季度报告披露提示性公告

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

特别提示:本公司2014年第三季度报告已于2014年10月27日在中国证监会指定的创业板信息披露网站上披露,敬请投资者注意查阅。

2014年10月24日,深圳光韵达光电科技股份有限公司(以下简称"公司")召开第二届董事会第二十六次会议,会议审议通过了公司2014年第三季度报告全文。为使投资者全面了解本公司的经营成果、财务状况及未来发展规划,公司《2014年第三季度报告全文》于2014年10月27日在中国证监会指定的创业板信息披露网站巨潮资讯网上披露。

网址:http://www.cninfo.com.cn

敬请广大投资者注意查阅。

特此公告。

深圳光韵达光电科技股份有限公司
董 事 会
二0一四年十月二十七日

证券代码:300109 证券简称:新开源 公告编号:2014-054

博爱新开源制药股份有限公司2014年第三季度报告提示性公告

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

博爱新开源制药股份有限公司2014年第三季度报告全文已于2014 年10 月27日在中国证监会指定的创业板信息披露网站上披露,请投资者注意查阅!

博爱新开源制药股份有限公司董事会
2014年10月27日

证券代码:300149 证券简称:量子高科 公告编号:2014-61

量子高科(中国)生物股份有限公司2014年第三季度报告披露的提示性公告

本公司及其董事会全体成员保证公告内容真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

量子高科(中国)生物股份有限公司2014年第三季度报告已于2014年10月27日在中国证监会指定的创业板信息披露网站上披露,请投资者注意查阅。

特此公告。

量子高科(中国)生物股份有限公司
董 事 会
2014年10月24日

证券代码:300132 证券简称:青松股份 公告编号:2014-085

福建青松股份有限公司2014年第三季度报告披露提示性公告

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

福建青松股份有限公司2014年第三季度报告已于2014年10月27日在中国证监会指定的创业板信息披露网站上披露, 请投资者注意查阅。

特此公告。

福建青松股份有限公司
董事会
二0一四年十月二十七日

证券代码:300127 证券简称:银河磁体 公告编号:2014-026

成都银河磁体股份有限公司2014年第三季度报告披露提示性公告

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。

特别提示:

成都银河磁体股份有限公司2014年第三季度报告于 2014 年10月27日在中国证监会指定的创业板信息披露网站巨潮资讯网(http://www.cninfo.com.cn)披露,请投资者注意查阅!

成都银河磁体股份有限公司
董事会
2014年10月23日

证券代码:300079 证券简称:数码视讯 公告编号:2014-045

北京数码视讯科技股份有限公司2014年第三季度报告披露提示性公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

北京数码视讯科技股份有限公司《2014年第三季度报告》于2014年10月27日在中国证监会指定的创业板信息披露网站上披露。敬请投资者注意查阅。

特此公告。

北京数码视讯科技股份有限公司
董事会
2014年10月24日