申万菱信沪深300指数增强型证券投资基金招募说明书(第四次更新)摘要

基金管理人:申万菱信基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

【重要提示】

● 本基金由原申万菱信盛利强化配置混合型证券投资基金转型而来。《关于申万菱信盛利强化配置混合型证券投资基金转型有关事项的议案》经2013年5月2日申万菱信盛利强化配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会决议通过,并获中国证监会证监许可【2013】748号文核准。由《申万菱信盛利强化配置混合型证券投资基金基金合同》修订而成的《申万菱信沪深300指数增强型证券投资基金基金合同》已于2013年6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2015年6月7日,有关基金的财务数据和净值表现截止日为2015年3月31日(财务数据未经审计)。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况
名称:申万菱信基金管理有限公司
住所:上海市中山南路100号11层
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
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。2015年1月起任申万宏源集团股份有限公司副总经理,2004年1月起任申万菱信基金管理有限公司董事长。
杜平先生,董事,管理学博士,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月至2015年1月任申银万国证券股份有限公司副总裁。现任中国银河金融控股有限责任公司党委副书记、总经理。
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、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月至今任申万宏源证券有限公司(原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南开发株式会社。2001年至今在中南大学任法学院教授,中日经济法研究所所长,中南大学信托与信托法研究中心主任;中国银行法学研究会常务理事;中美法律交流基金会信托法委员会副主席。
阎小平先生,独立董事,硕士研究生,高级经济师。1969年开始工作,1984年进入金融行业,曾先后任职于中国工商银行总行、工商银行北京市分行等。2009年1月起退休。
李秀仑先生,独立董事,大学本科学历,高级经济师。1969年开始工作,曾先后任职于中国工商银行、上海农村信用合作社联合社、上海农村商业银行;2009年1月至12月在市金融党委科学发展观活动任指导检查组二组组长;2010年1月起退休。
2、监事会成员
蒋元真先生,监事会主席,大学学历,高级会计师、高级经济师。曾任职于上海市财政局、上海市财税二分局、上海市税务局、上海国际信托投资公司、上海国际集团有限公司等单位,2010年至2015年任申银万国证券股份有限公司监事会主席,2015年1月起任申万宏源集团股份有限公司监事会主席。
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,现任监察稽核总部副总监(主持工作)。
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,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,曾任公司督察员,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长。
欧庆铃先生,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股票型证券投资基金基金经理,现任公司副总经理、投资总监,申万菱信新动力股票型证券投资基金基金经理。
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年加入申万菱信基金管理有限公司,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,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。
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
金昉毅先生,德国康斯坦茨大学经济学博士,金融风险管理师、特许金融分析师。2008年起开始工作,曾任职于中央财经大学中国金融发展研究院,2011年1月加入申万菱信基金管理有限公司,历任高级研究员、基金经理助理等,现任申万菱信沪深300指数增强型证券投资基金、申万菱信沪深300价值指数证券投资基金、申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)基金经理。
刘忠勋先生,2013年5月至2014年11月任本基金基金经理。
古平先生,原申万菱信盛利强化配置混合型证券投资基金基金经理,原申万菱信盛利强化配置混合型证券投资基金转型后于2013年6月7日至2013年6月26日任本基金基金经理。
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、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,投资管理总部总监为本委员会秘书,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

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:洪渊

三、相关服务机构

(一)基金份额销售机构
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:姜国芳
电话:+86 21 23261188
传真:+86 21 23261199
联系人:申浩波 李濮君
客户服务电话:400 880 8588(免长途话费)或 +86 21 962299
网址:www.swsmu.com
电子邮件:service@swsmu.com
2、代销机构
(1)名称:中国工商银行股份有限公司
住所:北京市西城区复兴门内大街55 号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街55 号
法定代表人:姜建清
客户服务电话:95588
传真:010-66107738
网址:www.icbc.com.cn
(2)名称:中国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:刘士余
联系人:张凯学
电话:010-85109230
传真:010-85109219
客户服务电话:95599
网址:www.abchina.com
(3)名称:中国建设银行股份有限公司
法定代表人:王洪章
注册地址:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
联系人:王琳
客户服务电话:95533
传真:010-66275654
网址:www.ccb.com
(4)名称:交通银行股份有限公司
住所:上海市浦东新区银城中路188号
办公地址:上海市银城中路188号
法定代表人:牛锡明
联系人:曹榕
电话:021-58781234
客户服务电话:95559
网址:www.bankcomm.com
(5)名称:中信银行股份有限公司
注册地址:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
办公地址:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
客服电话:95558
联系人:廉赵峰
传真:010-65550827
网址:bank.ecitic.com
(6)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
(7)名称:中国民生银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人:洪崎
客服电话:95568
联系人:王继伟
传真:010-57092611
网址:www.cmbc.com.cn
(8)名称:华夏银行股份有限公司
法定代表人:吴建
办公地址:北京市东城区建国门内大街22号
联系人:白炜
客户服务电话:95577
传真:010-85238680
网址:www.hxb.com.cn
(9)名称:平安银行股份有限公司
注册办公所:广东省深圳市罗湖区深南东路5047号
法定代表人:孙建一
联系人:张莉
传真:021-50979507
客户服务电话:95511-3
网址:bank.pingan.com
(10)名称:南京银行股份有限公司
注册地址:南京市白下区淮海路50号
办公地址:南京市白下区淮海路50号
法定代表人:林复
传真:025-84544129
联系人:翁俊
客户服务电话:4008896400
网址:www.njcb.com.cn
(11)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
(12)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
(13)名称:国信证券股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
办公地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦6楼
法定代表人:何如
联系人:周杨
传真:0755-82133952
客户服务电话:95536
网址:www.guosen.com.cn
(14)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
(15)名称:广发证券股份有限公司
注册地址:广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼(4301-4316房)
办公地址:广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼
法定代表人:孙树明
联系人:黄岚
统一客户服务热线:95575或致电各地营业网点
公司网站:广发证券网www.gf.com.cn
(16)名称: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
(17)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
(18)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
(19) 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
(20)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:李季
客户服务电话:4008-000-562
传真:010-88085195
网址:www.hysec.com
(21)名称:长江证券股份有限公司
注册地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人:胡运钊
联系人:李良
传真:027-85481900
客户服务电话:95579或4008-888-999
网址:www.95579.com
(22)名称: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
(23)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
(24)名称:国元证券股份有限公司
注册地址:安徽省合肥市寿春路179号
法定代表人:凤良志
传真:0551-2207965
联系人:李蔡
客户服务电话:400-8888-777,95578
网址:www.gyzq.com.cn
(25)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
(26)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
(27)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
(28)名称:东方证券股份有限公司
注册地址:上海市中山南路318号2号楼22层-29层
法定代表人:潘鑫军
联系人:吴宇
传真:021-63326173
客户服务电话:021-95503
东方证券网站:www.dfzq.com.cn
(29)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
(30) 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: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
(31) 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
(32)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:王宜四
联系人:戴蕾
客服电话:4008866567
网址:www.scstock.com
(33)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
(34)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
(35)名称:红塔证券股份有限公司
注册地址:昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼
办公地址:昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼
法定代表人:况雨林
联系人:高国泽
客户服务电话:0871-3577930
网址:www.hongtazq.com
(36)名称:中国民族证券有限责任公司
注册地址:北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼
办公地址:北京市朝阳区北四环中路27号盘古大观A座40F-43F
邮政编码:100101
法定代表人:赵大建
联系人:李微
客服电话:400-889-5618
公司网站:www.e5618.com
(37)名称:华宝证券有限责任公司
注册地址:上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心57层
办公地址:上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心57层
代表法人:陈林
联系人:刘闻川
传真:021-68778790
客服电话:400-820-9898
公司网址:www.cnhbstock.com
(38)名称:华融证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街8号
办公地址:北京市西城区金融大街8号
法定代表人:祝献忠
联系人:黄恒
联系电话:010-58568235
传真:010-58568062
客户服务电话:010-58568118
网址:www.hrsec.com.cn
(39)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
(40)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
(41)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10号庄胜广场中央办公楼东翼7层
法定代表人: 陈操
联系人:刘宝文
客服电话:400-166-1188
网址:8.jrj.com.cn
(42)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
(43)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
(44)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
(45)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
(46)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
(47)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
(48)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
(49)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
(50)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
(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:万银财富(北京)基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼3201内3201单元
办公地址:北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼3201内3201单元
法定代表人:王斐
客户服务电话:400-081-6655
传真:010-59393074
网址:http://www.wy-fund.com
(53)名称:北京钱景财富投资管理有限公司
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:魏争
电话:010-57418829
传真:010-57569671
客户服务电话:400-678-5095
网址:www.niuji.net
(54)名称:上海汇付金融服务有限公司
注册地址:上海市黄浦区西藏中路336号1807-5室
办公地址:上海市虹梅路1801号凯科国际大厦7楼
法定代表人: 张晶
联系人:周丹
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:fund.bundtrade.com
(55)名称:一路财富(北京)信息科技有限公司
注册地址:北京市西城区车公庄大街9号五栋大楼C座702室
办公地址:北京市西城区阜成门外大街2号万通新世界广场A座2208
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/
3、基金管理人可根据情况变更或增减销售机构,并予以公告。
(二)登记机构
名称:申万菱信基金管理有限公司
注册地址:上海中山南路100号11层
法定代表人:姜国芳
电话:+86 21 23261188
传真:+86 21 63353879
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
注册地址: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:安冬
经办律师:吕红、安冬
(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:赵钰
经办注册会计师:薛竞、赵钰

四、基金名称

申万菱信沪深300指数增强型证券投资基金

五、基金类型

本基金的类型:契约型开放式

六、投资目标

本基金为增强型指数基金,通过数量化的投资方法与严格的投资纪律约束,力争控制本基金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0.5%,年化跟踪误差不超过7.75%,同时力求实现超越标的指数的业绩表现,谋求基金资产的长期增值。

七、投资范围

本基金投资于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。
基金的投资组合比例:本基金投资于股票资产不低于基金资产净值的80%,其中,投资于沪深300指数成份股、备选成份股的资产占股票资产的比例不低于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,应当保证现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。

八、投资策略

本基金在指数化投资的基础上通过数量化模型进行投资组合优化,在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下,力争获得超越标的指数的投资收益。
(一)股票投资策略
1、指数化投资策略
本基金将运用指数化的投资方法,通过控制对各成份股在标的指数中权重的偏离,实现跟踪误差控制目标,达到对标的指数的跟踪目标。
2、指数增强策略
本基金主要通过申万菱信开发的企业价值评估模型、分析师预期模型与阿尔法等模型对股票进行综合评定,分析其投资价值,结合风险控制模型,对沪深300指数股票组合进行优化,力求获得稳定适度的超额收益。
(1)申万菱信企业价值评估模型
申万菱信企业价值评估模型是在传统估值模型的基础上,结合自身的实践经验,经过长时间研究检验而成;主要是通过历史、预测及经验数据,计算出股票的相对价值,获取股票的潜在投资价值信息。
(2)申万菱信分析师预期模型
申万菱信分析师预期模型是我司基于分析师预期数据,结合自身的实践经验,经过长时间研究检验而成;主要是通过对预测数据的全面分析,获取具有领先股价走势的盈利预测趋势信息。
(3)申万菱信阿尔法模型
申万菱信阿尔法模型是在申万菱信企业价值评估模型和申万菱信分析师预期模型评价的基础上,通过对不同市场环境下两模型合成效果的全面测试,形成具有稳定表现的阿尔法模型。
(4)风险控制模型
作为增强型指数基金,如何平衡跟踪误差最小化和超额收益最大化是增强型指数基金管理的最终目标,本基金将通过风险控制模型,有效将投资组合风险控制在预算范围内。本基金主要采取"跟踪误差"和"跟踪偏离度"这两个指标对投资组合进行监控与评估。
本基金的风控目标为:力争使本基金的净值增长率与业绩比较基准的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%,年化跟踪误差不超过7.75%
(5)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,定期或不定期地对数量化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,以使得本基金能够有效的达成投资目标。
3、股票投资组合调整
(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。中证指数公司原则上每半年审核一次沪深300指数成份股,本基金将根据其公布的最新成份股情和相应权重,对股票投资组合进行及时调整。
(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需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等因素,确定调整策略。
(二)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。
(三)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,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,如预期大额申购赎回、大量分红等,以及对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险。
(四)其他金融衍生工具投资策略
当法律法规或监管机构允许时,本基金将以控制风险、提高投资效率和降低跟踪误差为目的对权证等其他金融衍生工具进行谨慎投资,以期更好的实现基金的投资目标。

九、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:95%×沪深300指数收益率+1.5%(指年收益率,评价时按期间折算)。
本基金股票资产跟踪的标的指数为沪深300指数。沪深300指数是由上海和深圳证券市场中选取300只A股作为样本编制而成的中国A股市场指数,覆盖了大部分流通市值,其成份股票为中国A股市场中代表性强、流动性高的股票,能够反映A股市场整体走势。
如果沪深300指数被停止编制及发布,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标的指数,基金管理人可以依据维护投资者的合法权益的原则,在经基金托管人同意后变更本基金的标的指数和业绩比较基准,而无需基金份额持有人大会审议。

十、风险收益特征

本基金为增强型指数基金,具有较高预期风险、较高预期收益的特征,其预期风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

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2015年3月31日,本报告中所列财务数据未经审计。
1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	363,742,160.21	75.99
	其中:股票	363,742,160.21	75.99
2	固定收益投资	3,073,200.00	0.64
	其中:债券	3,073,200.00	0.64
	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	57,109,816.60	11.93
7	其他资产	54,762,120.10	11.44
8	合计	478,687,296.91	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合
2.1 积极投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	797,820.89	0.19
B	采矿业	-	-
C	制造业	10,219,296.77	2.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,102,706.77	0.26
F	批发和零售业	2,215,786.38	0.52
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	1,807,565.32	0.43
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,200,784.40	0.28
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	17,343,960.53	4.10

2.2 指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	2,894.40	0.00
C	制造业	121,890,328.41	28.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,630,441.77	2.98
E	建筑业	27,572,038.33	6.52
F	批发和零售业	22,706,546.78	5.37
G	交通运输、仓储和邮政业	52,227,149.39	12.34
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,542.40	0.00
J	金融业	90,024,313.20	21.27
K	房地产业	12,260,967.71	2.90
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	1,187,574.09	0.28
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	5,894,403.20	1.39
S	综合	-	-
	合计	346,398,199.68	81.86

3. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细
3.1报告期末指数投资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	000776	广发证券	322,724	9,003,999.60	2.13
2	601336	新华保险	147,274	7,806,994.74	1.84
3	600029	南方航空	763,415	6,046,246.80	1.43
4	600655	豫园商城	410,315	6,027,527.35	1.42
5	600115	东方航空	849,600	6,015,168.00	1.42

3.2报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	000029	深深房A	104,872	1,200,784.40	0.28
2	002047	宝鹰股份	115,709	1,102,706.77	0.26
3	300043	互动娱乐	33,890	968,915.10	0.23
4	002023	海特高新	26,274	906,453.00	0.21
5	300054	鼎龙股份	39,508	896,831.60	0.21

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	3,073,200.00	0.73
	其中:政策性金融债	3,073,200.00	0.73
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	3,073,200.00	0.73

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	018001	国开1301	30,000	3,073,200.00	0.73

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

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IF1504	IF1504	18	21,888,360.00	527,748.00	-
公允价值变动总额合计(元)			527748.00		
股指期货投资本期收益(元)			1848841.72		
股指期货投资本期公允价值变动(元)			218398.28		

9.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金将运用股指期货进行套期保值以及流动性管理。在市场具有较为明显下跌风险时,基于风险管理的角度,在基金合同的限定内进行适度的套期保值,控制基金的下跌风险;由于基金的申购日及其资金到账日不具有同步性,基金的赎回也会被动提高基金股票资产的比例,本基金将运作股指期货对基金资产进行流动性管理,以减少大额申购赎回对基金运作带来的影响。
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
本基金本报告期末未投资国债期货。
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投资国债期货。
10.3 本基金投资国债期货的投资评价
本基金本报告期末未投资国债期货。
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 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,502,982.86
2	应收证券清算款	36,936,127.46
3	应收股利	-
4	应收利息	53,238.98
5	应收申购款	15,269,770.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	54,762,120.10

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

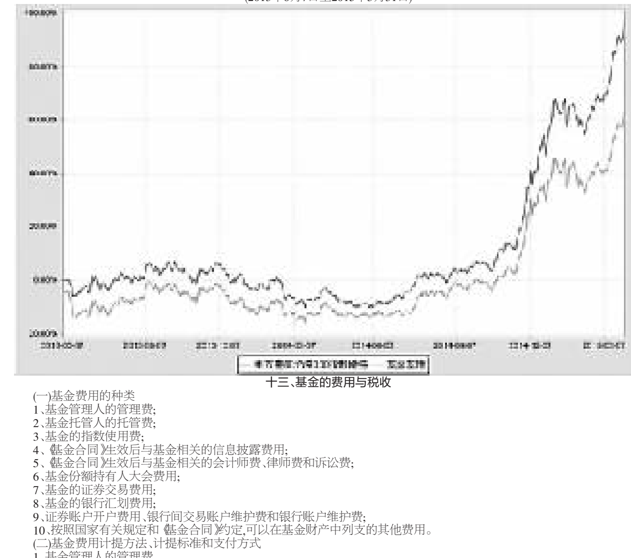
序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002047	宝鹰股份	1,102,706.77	0.26	重大事项

十二、基金的业绩

本基金的过往业绩不代表未来表现。
1、 自基金转型以来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
2013年6月7日(基金转型日)至2013年12月31日	2.30%	1.26%	-6.59%	1.35%	8.89%	-0.09%
2014年	57.87%	1.19%	50.90%	1.15%	6.97%	0.04%
2015年1月1日至2015年3月31日	20.43%	1.65%	14.34%	1.74%	6.09%	-0.09%
自基金转型至2015年3月31日	94.50%	1.28%	61.17%	1.30%	33.33%	-0.02%

2、自基金转型以来基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准的变动比较。
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2013年6月7日至2015年3月31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、基金的指数使用费;
4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;
6、基金份额持有人大会费用;
7、基金的证券交易费用;
8、基金的银行汇划费用;
9、证券账户开户费用、银行间交易账户维护费和银行账户维护费;
10、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1.0%年费率计提。管理费的计算方法如下:
H=E×1.0%÷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,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0.18%的年费率计提。托管费的计算方法如下:
H=E×0.18%÷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,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、基金的指数使用费
本基金作为增强指数基金,在《基金合同》生效后将按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费计提方法支付指数许可使用费。
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0.016%
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
指数使用费每日计算,逐日累计,按季支付,自《基金合同》生效日起,基金管理人应于每年1月、4月、7月、10月的前10个工作日内向中证指数有限公司支付上一季度的指数使用费。指数使用费的收取下限为每季度人民币5万元,计费期间不足一季度的,根据实际天数按比例计算。
若季度指数使用费下限大于按基金资产净值提取的季度指数使用费,则超过部分由基金管理人自行承担,不得作为基金费用在基金财产中列支。
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。
4、上述"一、基金费用的种类中第4-10项费用",根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。
(三)不列入基金费用的项目
下列费用不列入基金费用:
1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;
2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;
3、《基金合同》生效前的相关费用,包括但不限于验资费、会计师费、律师费和信息披露费用等费用;
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)费用调整
基金管理人和基金托管人协商一致后,可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。
调高基金管理费率、基金托管费率等费率,须召开基金份额持有人大会审议;调低基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率,无须召开基金份额持有人大会。
基金管理人必须最迟于新的费率实施日前依照《信息披露办法》的规定在指定媒体上公告。
(五)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2015年3月31日;
6、更新了本基金的业绩部分,数据截止日期为2015年3月31日;
7、在"其他应披露事项"一章,列举了本基金自2014年12月8日至2015年6月7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
2015年7月21日

关于申万菱信中证军工指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间暂停申购、赎回、转换转入、转换转出及定期定额投资业务的公告

1.公告基本信息

基金名称	申万菱信中证军工指数分级证券投资基金		
基金简称	申万菱信中证军工指数分级		
基金主代码	163115		
基金管理人名称	申万菱信基金管理有限公司		
公告依据	《证券投资基金信息披露管理办法》、《申万菱信中证军工指数分级证券投资基金基金合同》、《申万菱信中证军工指数分级证券投资基金招募说明书》		
暂停相关业务的起始日、金额及原因说明	暂停申购起始日	2015年7月23日	
	暂停赎回起始日	2015年7月23日	
	暂停定期定额投资起始日	2015年7月23日	
	暂停转换转入起始日	2015年7月23日	
	暂停转换转出起始日	2015年7月23日	
	暂停申购、赎回、转换转入、转换转出及定期定额投资的原因说明	根据《申万菱信中证军工指数分级证券投资基金基金合同》的相关规定,本基金将以2015年7月23日为份额折算基准日对申万军工A份额、申万军工份额办理定期份额折算业务,为保证折算期间本基金的平稳运作,本基金管理人决定于2015年7月23日至2015年7月24日暂停本基金的申购、赎回、转换转入、转换转出及定期定额投资业务。	
恢复相关业务的起始日、金额及原因说明	恢复申购起始日	2015年7月27日	
	恢复赎回起始日	2015年7月27日	
	恢复定期定额投资日	2015年7月27日	
	恢复转换转入日	2015年7月27日	
	恢复转换转出日	2015年7月27日	
	恢复申购、赎回、转换转入、转换转出及定期定额投资的原因说明	本基金定期份额折算业务将于2015年7月24日办理完毕,因此本基金管理人决定于2015年7月27日起恢复本基金的申购、赎回、转换转入、转换转出及定期定额投资业务。	
下属分级基金的基金简称	申万军工	军工A级	军工B级
下属分级基金的交易代码	163115	150186	150187
该分级基金是否暂停申购、赎回、定期定额投资	是	否	否

2.其他需要提示的事项
(1)根据本基金基金合同的相关规定,本基金申万军工份额只可以进行场内与场外的申购和赎回,但不上市交易;下属分级份额中申万军工A份额与申万军工B份额只可在深圳证券交易所上市交易,不可单独进行申购或赎回。
(2)本公告仅对本基金办理定期份额折算业务期间申万军工份额暂停申购、赎回、转换转入、转换转出及定投业务的情况进行说明,投资者若希望了解本基金办理定期份额折算业务期间的转托管、配对转换、上市交易等其他业务办理的详细情况,请参阅本基金基金合同、招募说明书及本基金管理人发布的相关公告,或者通过以下任一途径咨询:
1)申万菱信基金管理有限公司网站:www.swsmu.com;
2)申万菱信基金管理有限公司客户服务热线:400 880 8588(免长途话费)或021-962299。
(3)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。投资者投资于上述基金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
2015年7月21日