申万菱信中证申万传媒行业投资指数分级证券投资基金招募说明书(第二次更新)摘要

基金管理人:申万菱信基金管理有限公司
基金托管人:上海银行股份有限公司

【重要提示】
● 本基金基金合同已于 2015 年 5 月 29 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 2016 年 5 月 29 日,有关基金的财务数据和净值表现截止日为 2016 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
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: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
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。
朱敏杰先生,董事,经济学硕士,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裁。
刘郎先生,董事,硕士研究生,副教授。曾任湖南邵阳学院助教,南京东南大学系副主任、副教授,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,现任申万宏源证券有限公司副总裁。
安田敬之先生,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(原三菱信托银行)任职,曾任市场国际部部长、伦敦分行分行长、执行役员。现任三菱 UFJ 信托银行株式会社海外资产管理部执行役员、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。
过振华先生,董事,工商管理硕士,经济师。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。
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。
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。
2、监事会成员
徐宜阳先生,监事会主席,硕士研究生、高级经济师、高级政工师。曾任天津大港石油管理局团委副书记、书记,天津大港石油管理局炼油厂党委副书记、纪委书记、副厂长,上海爱使股份有限公司党委书记、董事、总经理,上海证券有限责任公司党委委员、副总经理, 上海爱建股份有限公司党委委员、副总经理、董事会秘书,兼爱建证券有限责任公司党委书记、董事长,上海爱建信托投资有限责任公司副董事长等,现任申万宏源集团股份有限公司和申万宏源证券有限公司党委委员、纪委书记,申万宏源证券有限公司监事会主席。
杉崎千雄先生,监事,日本籍,大学学历。1988 年 4 月至今任职于三菱 UFJ 信托银行株式会社 (原三菱信托银行),历任投资企划部次长等职务,2014 年 4 月起任受托财产企划部副部长。
赵鲜女士,职工监事,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,任人力资源总部总监,兼任申万菱信(上海)资产管理有限公司监事。
牛锐女士,职工监事,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,现任监察稽核总部总监。
3、高级管理人员
姜国芳先生,相关介绍见董事会成员部分。
过振华先生,相关介绍见董事会成员部分。
来肖贤先生,经济学硕士,中级经济师,曾任职于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,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,法学硕士。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
张少华先生,硕士研究生。曾任职于申银万国证券,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,曾任风险管理总部总监,基金投资管理总部副总监、总监,申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)、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、申万菱信中小板指数分级证券投资基金、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基金经理,现任投资总监、投资管理总部总监,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基金经理。
袁英杰先生,硕士研究生。曾任职于兴业证券、申银万国证券研究所等,2013 年 5 月加入申万菱信基金管理有限公司,曾任高级数量研究员,基金经理助理,现任申万菱信深证成指分级证券投资基金、申万菱信中小板指数分级证券投资基金、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基金经理。
俞诚先生,经济学学士,金融风险管理师(FRM)。2009 年开始从事证券相关工作,2009 年 8 月加入申万菱信基金管理有限公司,历任产品与金融工程总部金融工程师,数量研究员,现任申万菱信沪深 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、申万菱信中小板指数分级证券投资基金、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 500 指数增强型证券投资基金基金经理。
5、投资决策委员会委员名单
投资决策委员会由下述执行委员组成: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、基金经理代表等。委员会执行委员在会议期间对所决策事项有投票权。
非执行委员有下列人员组成:董事长、副总经理、督察长、监察稽核总部总监、风险管理总部总监和市场营销总部总监。非执行委员对需决策事项可发表观点,但不参与决策事项的投票表决。
公司总经理担任投资决策委员会主席, 分管投资的副总经理担任投资决策委员会会议召集人,投资管理总部总监担任投资决策委员会秘书,负责协调统筹投资决策委员会的各项事宜。
6、上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一)基金托管人情况
1、基本情况
名称:上海银行股份有限公司(以下简称“上海银行”)
住所:上海市浦东新区银城中路 168 号
办公地址:上海市浦东新区银城中路 168 号
法定代表人:金煜
成立时间:1995 年 12 月 29 日
组织形式:股份有限公司
注册资本:人民币 54.04 亿元
存续期间:持续经营
基金托管业务批准文号:中国证监会 证监许可[2009]814 号
托管部门联系人:叶忆红
电话:021-68475888
传真:021-68476936

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
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: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: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
(2) 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
(3)名称:上海银行股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区银城中路 168 号
办公地址:上海市浦东新区银城中路 168 号
法定代表人:范一飞
联系人:汤征程
联系电话:021-68475521
开放式基金咨询电话:95594
开放式基金业务传真:021-68476111
网址:www.bankofshanghai.com
(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:400-8888-666/95521
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 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
(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: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
联系人: 唐岚
客户服务电话:4008-000-562
传真:010-88085195
网址:www.hysec.com
(14)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
(15)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
(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:400-800-8899
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
法定代表人:薛峰
联系人:刘晨、李芳芳
传真:021-22169134
客户服务电话:95525
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: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
(22)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:400-888-1888
传真:0755-23838999
网址:www.fcsc.com.cn
(23)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
(24)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
(25)名称:中山证券有限责任公司
注册地址:深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼 7 层、8 层
办公地址:深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼 7 层、8 层
法定代表人:黄扬录
联系人:刘军
电话:0755- 83734659
传真:0755-82960582
客户服务电话:4001-022-011
网址:www.zszq.com
(26)名称:华宝证券有限责任公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 100 号 57 层
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 100 号 57 层
代表法人:陈林
联系人:刘闻川
传真:021-20515593
客服电话:400-820-9898
公司网址:www.cnhbstock.com
(27)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
(28)名称:天风证券股份有限公司
天风证券股份有限公司
注册地址: 湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦 4 楼
办公地址:湖北省武汉市武昌区中南路 99 号保利广场 A 座 37 楼
法定代表人:余磊
联系人:杨晨
电话:027-87107535
传真:027-87618863
客服热线:4008005000
(29)名称:太平洋证券股份有限公司
住所:云南省昆明市青年路 389 号志远大厦 18 层
办公地址:北京市西城区北展北街 9 号华远企业号 D 座 3 单元
法定代表人:李长伟
客户服务电话:400-665-0999
传真:010-88321819
网址:www.tpyzq.com
(30)名称: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
(31)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
(32) 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
联系人:王芬
电话:021-53686888
传真:021-53686100-7008
客户服务电话:4008918918、021-962518
网址:www.shzq.com
(33)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
(34)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
网址:www.zts.com.cn
传真:0755-82492962
客服电话:95597
网址:www.htsc.com.cn
(35)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
(36)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
(37)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
(38)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
(39)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
(40)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
(41)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
(42)名称:深圳众禄金融控股股份有限公司
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
(43)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
(44)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
(45)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
(46)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
(47)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
(48)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
(49)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:沈继伟
联系人:赵沛然
电话:86-021-50583533
传真:86-021-50583633
客户服务电话:400-067-6266
(50)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:北京市朝阳区望京浦项中心 A 座 9 层 04-08,邮编:100102
法定代表人:李招弟
客户服务电话:400-059-8888
传真:010-64788105
网址:http://www.wy-fund.com
(51)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:高静
电话:010-59158281
传真:010-57569671
客户服务电话:400-893-6885
网址:www.qianjing.com
(52)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
(53)名称:上海陆金所资产管理有限公司
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元
法定代表人:郭坚
客户服务电话:400-821-9031
传真:021-22066653
网址:www.lufunds.com
(54)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
(55)名称:深圳富济财富管理有限公司
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室
办公地址:深圳市南山区高新南七道 12 号惠恒集团二期 418 室
法定代表人:齐小贺
联系人:陈勇军
电话:0755-83999907-806
传真:0755-83999926
客户服务电话:0755-83999913
网址:www.jinqianwo.cn
(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: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
(58)名称:大泰金石投资管理有限公司
住所:南京市建邺区江东中路 359 号国睿大厦一号楼 B 区 4 楼 A506 室
办公地址:上海市长宁区虹桥路 1386 号文广大厦 15 楼
法定代表人:袁顾明
客户服务电话:4009282266
传真:021-22268089
网址:www.dtfunds.com
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并经深圳证券交易所认可的会员单位(具体名单可在深交所网站查询)。
(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: 010-50938856
传真: 010-50938907
联系人:崔巍
(三)出具法律意见书的律师事务所
名称:上海市通力律师事务所
住所:上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼
办公地址:上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼
负责人:俞卫锋
电话:+86-21-31358666
传真:+86-21-31358600
联系人:孙睿
经办律师: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: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:陈玲、赵钰

四、基金的名称

申万菱信中证申万传媒行业投资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%,实现对中证申万传媒行业投资指数的有效跟踪。

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。
基金的投资组合比例为: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
本基金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。
3、资产支持证券投资策略
在有效控制风险的前提下,本基金将对资产支持证券进行综合定价,选择低估的品种进行投资。本基金将重点对信用、流动性、利率、税收和提前还款等影响资产支持证券价值的因素进行分析, 并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型, 评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。

九、业绩比较基准

业绩比较基准为:95%×中证申万传媒行业投资指数收益率 +5%×银行同业存款利率。
本基金以中证申万传媒行业投资指数为标的指数, 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。
如果中证申万传媒行业投资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。申万传媒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;申万传媒 A 份额,则具有预期风险低,预期收益低的特征;申万传媒 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 2016 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	111,071,612.62	91.46
	其中:股票	111,071,612.62	91.46
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	10,098,277.97	8.32
7	其他各项资产	272,369.57	0.22
8	合计	121,442,260.16	100.00

2 报告期末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	-	-
C	制造业	4,968,348.27	4.15
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	576,531.00	0.48
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	66,717,949.00	55.66
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	6,531,168.14	5.45
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	722,413.68	0.60
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	31,555,202.53	26.33
S	综合	-	-
	合计	111,071,612.62	92.67

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	300104	乐视网	206,079.00	9,564,126.39	7.98
2	600637	东方明珠	326,233.00	9,346,575.45	7.80
3	300059	东方财富	196,800.00	8,718,240.00	7.27
4	300027	华谊兄弟	172,122.00	4,812,531.12	4.02
5	600804	鹏博士	198,444.00	4,212,966.12	3.51
6	002292	奥飞动漫	89,227.00	3,632,431.17	3.03
7	300315	掌趣科技	282,336.00	3,413,442.24	2.85
8	000917	电广传媒	200,823.00	3,283,456.05	2.74
9	000503	海虹控股	127,245.00	3,034,793.25	2.53
10	300058	蓝色光标	273,763.00	2,896,412.54	2.42

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
本基金本报告期末未投资股指期货交易。
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,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	49,815.86
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,405.94
5	应收申购款	220,147.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	272,369.57

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(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300104	乐视网	9,564,126.39	7.98	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.净值增长率与业绩比较基准收益率比较:

阶段	净值增长率①	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
2015年5月29日(基金合同生效日)至2015年12月31日	-28.62%	3.47%	-18.91%	3.24%	-9.71%	0.23%
2016年1月1日至2016年3月31日	-20.92%	3.58%	-19.00%	3.20%	-1.92%	0.38%
自基金合同生效起至2016年3月31日	-43.55%	3.50%	-34.32%	3.22%	-9.23%	0.28%

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
申万菱信中证申万传媒行业投资指数分级证券投资基金
累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015 年 5 月 29 日至 2016 年 3 月 31 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。

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、标的指数许可使用基点费;
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提,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 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提,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 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。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, 需根据与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定向中证指数有限公司的指定账户支付指数使用费。指数许可使用基点费按前一日的基金资产净值的万分之二(贰个基点)的年费率计提。计算方法如下:
H=E×年费率 / 当年天数
H 为每日应付的指数许可使用基点费
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基点费自基金合同生效次日起每日计提,逐日累计,按季支付。许可使用基点费的收取下限为每季度人民币 5 万元(大写:伍万圆),计费期间不足一季度的,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基点费划付指令,经基金托管人复核后于每一季度结束后的 10 个工作日内将上季度累计计提的标的指数许可使用费,按照指数使用许可协议的约定进行支付。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基点费的计算方法、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基点费。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、标的指数许可使用基点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、更新了投资组合报告,数据截止日期为 2016 年 3 月 31 日;
6、更新了基金的业绩部分,数据截止日期为 2016 年 3 月 31 日;
7、在“其他应披露事项”一章,列举了本基金自 2015 年 11 月 30 日至 2016 年 5 月 29 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
2016 年 7 月 12 日