申万菱信中证军工指数分级证券投资基金招募说明书(第三次更新)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2016年1月24日,有关财务数据和净值表现截止日为2015年12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。

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,曾任万国证券公司交易部业务员、静安营业部副经理、交易部兼计财部经理、总裁助理兼发展研究中心主任,申银万国证券国债总部总经理、计划统筹总部总经理兼发展协调办公室主任、总裁助理兼计划统筹总部总经理,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。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(原三菱信托银行)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、申万迈达投资管理(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。

杉崎于雄先生,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(住持工作)。

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年加入申万巳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

袁英杰先生,上海交通大学应用数学硕士。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,上海海事大学经济学学士,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

(一)基金托管人基本情况

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:刘士余

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:林葛

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:姜国芳

电话:86-21-23261188

传真:86-21-23261199

联系人:申浩波 李潢君

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@wsmu.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: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

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:胡平西

客服电话:021-96 2999/4006 962 999

联系人:施传荣

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:400-8888-66695521

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:何加

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:010-66568990

联系人:宋明

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

公司网站: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:李巍

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: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

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:4008601555

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

客服电话:95525

传真:021-68815009

公司网站: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: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

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:戴蕾

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

27)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

28)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

29)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

30)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

31)名称:上海证券有限责任公司

住所:上海市黄浦区西藏中路336号

法定代表人:龚德雄

联系人:许曼华

电话:021-53519888

传真:021-53519888

客户服务电话:4008918918、021-962518

网址:www.shzq.com

32)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

33)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

34)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

35)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

36)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

37)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

38)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

39)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

40)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

41)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

42)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

43)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

44)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

45)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

46)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

47)名称:万银财富(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

48)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/

49)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

50)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:张品

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

51)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

52)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

53)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

54)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

55)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

2、场内发售机构

(1)本基金的场内发售机构为具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位(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代销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。

(二)基金注册登记机构

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:陈玲、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、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。

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2015年12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	3,728,391,686.91	90.73
	其中:股票	3,728,391,686.91	90.73
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	372,693,954.50	9.07
7	其他资产	8,458,750.22	0.21
8	合计	4,109,544,391.63	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	3,439,862,532.01	86.03
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	36,348,963.36	0.91
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	233,865,506.34	5.85
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	18,314,685.20	0.46
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	3,728,391,686.91	93.25

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	35,995,908.00	338,361,535.20	8.46
2	600271	航天信息	2,967,012.00	212,052,347.64	5.30
3	600893	中航动力	3,535,969.00	159,224,684.07	3.98
4	000748	长城信息	6,162,722.00	152,095,978.96	3.80
5	002465	海格通信	7,786,753.00	129,960,907.57	3.25
6	000768	中航飞机	5,023,691.00	124,436,826.07	3.11
7	600118	中国卫星	2,682,078.00	114,095,598.12	2.85
8	600150	中国船舶	3,125,663.00	108,866,842.29	2.72
9	600839	四川长虹	16,754,510.00	97,008,612.90	2.43
10	600482	风帆股份	1,704,035.00	80,174,846.75	2.01

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持股指期货交易。

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持股指期货交易。

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	4,792,841.91
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	85,812.46
5	应收申购款	3,580,095.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,458,750.22

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细