

申万菱信基金管理有限公司

申万菱信沪深 300 指数增强型证券投资基金

招募说明书（第九次更新）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 2017 年 12 月 7 日，有关基金的财务

数据和净值表现截止日为 2017 年 9 月 30 日（财务数据未经审计）。

目录

一、基金管理人.....	3
二、基金托管人.....	7
三、相关服务机构.....	7
四、基金名称.....	32
五、基金类型.....	33
六、投资目标.....	33
七、投资范围.....	33
八、投资策略.....	33
九、业绩比较基准.....	36
十、风险收益特征.....	36
十一、基金投资组合报告.....	36
十二、基金的业绩.....	42
十三、基金的费用与税收.....	43
十四、对招募说明书本次更新部分的说明.....	46

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

成立日期：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

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、副部长，现任受托财产副部长、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，曾任监察稽核总部副总监、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。

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。

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，现任监察稽核部总监。

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，兼任电子商务部总监、申万菱信（上海）资产管理有限公司董事。

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，历任风险管理总部高级风险分析师、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，现任公司副总经理兼固定收益投资部总监。

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，曾任监察稽核总部总监，现任公司督察长。

4、基金经理

金昉毅先生，博士研究生。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、投资管理总部总监助理，申万菱信沪深 300 价值指数证券投资基金基金经理，现任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 指数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、申万菱信价值优享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，申万菱信深证成指分级证券投资基金、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，现任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、申万菱信中证申万新兴健康产业主题投资指数证券投资基金(LOF)、申万菱信沪深 300 指数增强型证券投资基金、申万菱信中证 500 指数优选增强型证券投资基金、申万菱信臻选 6 个月定期开放混合型证券投资基金、申万菱信智选一年期定期开放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、申万菱信价值优利混合型证券投资基金基金经理。

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，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：易会满

注册资本：人民币 35,640,625.71 万元

联系电话：010-66105799

联系人：郭明

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：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：易会满

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：周慕冰

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：王志刚

传真：010-58560666

网址：www.cmbc.com.cn

(8)名称：华夏银行股份有限公司

法定代表人：李民吉

办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

联系人：王者凡

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

住所：深圳市深南东路 5047 号

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：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

(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：北京市朝阳区门内大街 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 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

(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：广东省广州天河区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：010-66568292

联系人：邓颜

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：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

(21)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

(22)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

(23)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

(24)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

(25)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

(26)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

(27) 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、23 层、25 层-29 层

法定代表人：潘鑫军

联系人：胡月茹

传真：021-63326729

客户服务电话：021-95503

东方证券网站：www.dfzq.com.cn

(28)名称：光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 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

(29) 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

(30) 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

(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：平安证券股份有限公司

住所：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

办公地址：深圳市福田区中心区金田路 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>

(33)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

(34)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>

(35)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

(36)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

(37)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

(38)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

(39)名称：西部证券股份有限公司

注册地址：西安市东大街 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

(40)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

(41)名称：上海华信证券有限责任公司

住所：上海市黄浦区南京西路 399 号明天广场 22 楼

办公地址：上海市黄浦区南京西路 399 号明天广场 22 楼

法定代表人：郭林

客户服务电话：4008205999

传真：021-68776977-8951

网址：www.shhxzq.com

(42)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

(43)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

(44)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

(45)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

(46)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

(47)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

(48)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

(49)名称：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

(50)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

(51)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

(52)名称：申银万国期货有限公司

住所：上海市浦东新区东方路 800 号宝安大厦 7、8、10 楼

办公地址：上海市浦东新区东方路 800 号宝安大厦 7、8、10 楼

法定代表人：李建中

客户服务电话：400-888-7868

传真：021-50586045

网址：www.sywgqh.com

(53)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

(54) 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

(55) 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

(56) 名称：深圳众禄金融控股股份有限公司

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

(57) 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

(58) 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

(59) 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

(60) 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: 单丙焯

传真: 021-20691861

客服电话: 400-089-1289

公司网站: www.erichfund.com

(61) 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

(62) 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

(63) 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: 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

(64)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

(65)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

(66)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

(67) 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/>

(68) 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

(69) 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>

(70) 名称：上海汇付金融服务有限公司

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

(71) 名称：深圳富济财富管理有限公司

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

(72) 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

(73)名称：大泰金石基金销售有限公司

住所：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

(74)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

(75)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/>

(76)名称：中民财富管理（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

(77) 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

(78) 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

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：刘郎

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： $95\% \times$ 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交易所中选取 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 2017 年 9 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	677,489,453.02	91.76
	其中：股票	677,489,453.02	91.76
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	59,575,540.57	8.07
7	其他各项资产	1,225,777.98	0.17
8	合计	738,290,771.57	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 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	260,327.60	0.04
B	采矿业	652,497.60	0.09
C	制造业	32,768,135.05	4.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	654,783.44	0.09
E	建筑业	-	-

F	批发和零售业	323,025.45	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	564,159.23	0.08
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	245,414.28	0.03
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	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	115,299.99	0.02
R	文化、体育和娱乐业	44,000.50	0.01
S	综合	-	-
	合计	35,627,643.14	4.84

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	30,162,143.84	4.10
C	制造业	184,983,631.05	25.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	41,372,735.67	5.63
F	批发和零售业	30,465,358.50	4.14
G	交通运输、仓储和邮政业	57,694,550.40	7.85

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	23,235,394.51	3.16
J	金融业	191,456,414.54	26.04
K	房地产业	74,074,545.08	10.07
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	8,417,036.29	1.14
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	641,861,809.88	87.28

2.3 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	002008	大族激光	256,400.00	11,179,040.00	1.52
2	000725	京东方 A	2,474,649.00	10,888,455.60	1.48
3	600690	青岛海尔	700,300.00	10,567,527.00	1.44
4	601088	中国神华	503,364.00	10,540,442.16	1.43
5	000338	潍柴动力	1,393,726.00	10,439,007.74	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	601992	金隅股份	1,432,200.00	9,094,470.00	1.24
2	000959	首钢股份	1,134,900.00	7,842,159.00	1.07
3	601717	郑煤机	182,746.00	1,421,763.88	0.19
4	603823	百合花	36,764.00	734,544.72	0.10
5	002859	洁美科技	16,665.00	628,770.45	0.09

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

代码	名称	持仓量	合约市值 (元)	公允价值变 动(元)	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计(元)					0.00

股指期货投资本期收益(元)	348,180.00
股指期货投资本期公允价值变动(元)	-228,480.00

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	293,595.84
2	应收证券清算款	140,101.76
3	应收股利	-
4	应收利息	10,632.28
5	应收申购款	781,448.10
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,225,777.98

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

11.5.1 期末指数投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前五名股票中不存在流通受限情况。

11.5.2 期末积极投资前五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	601717	郑煤机	1,421,763.88	0.19	重大事项
2	603823	百合花	734,544.72	0.10	锁定一年
3	002859	洁美科技	628,770.45	0.09	锁定一年

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	2.30%	1.26%	-6.59%	1.35%	8.89%	-0.09%

年 12 月 31 日						
2014 年	57.87%	1.19%	50.90%	1.15%	6.97%	0.04%
2015 年	19.24%	2.45%	7.28%	2.36%	11.96%	0.09%
2016 年	-1.84%	1.38%	-9.29%	1.33%	7.45%	0.05%
2017 年 1 月 1 日至 2017 年 09 月 30 日	18.40%	0.66%	16.37%	0.55%	2.03%	0.11%
自基金转型至 2017 年 09 月 30 日	123.81%	1.56%	59.62%	1.51%	64.19%	0.05%

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 2017 年 9 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、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：

$$H = E \times 1.0\% \div \text{当年天数}$$

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：

$$H = E \times 0.18\% \div \text{当年天数}$$

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：

$H = E \times \text{年指数使用费率} / \text{当年天数}$ ，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项纳税主体，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 2017 年 9 月 30 日；
- 6、更新了本基金的业绩部分，数据截止日期为 2017 年 9 月 30 日；

7、在“其他应披露事项”一章，列举了本基金自 2017 年 6 月 8 日至 2017 年 12 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

2018 年 1 月 20 日