
申万菱信基金管理有限公司

申万菱信添益宝债券型证券投资基金 招募说明书（第十五次更新）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 2008 年 12 月 4 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 6 月 4 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）。

目 录

一、基金管理人.....	3
二、基金托管人.....	6
三、相关服务机构.....	7
四、基金的名称.....	30
五、基金的类型.....	30
六、基金的投资目标.....	30
七、基金的投资范围和投资对象.....	30
八、基金的投资策略.....	31
九、业绩比较基准.....	34
十、投资程序.....	34
十一、基金投资组合报告.....	36
十二、基金的业绩.....	39
十三、基金的费用与税收.....	42
十四、对招募说明书本次更新部分的说明.....	45

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：上海中山南路 100 号 11 楼

法定代表人：姜国芳

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

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、执行役員。现任三菱UFJ信托银行株式会社海外资产管理部执行役員、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，现任申万宏源证券有限公司副总经理兼首席风险官，申万宏源证券承销保荐有限公司和申万宏源西部证券有限公司合规总监。

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，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，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

叶瑜珍女士，法国格尔诺布勒第二大学硕士。2005 年加入申万菱信基金管理有限公司，历任风险分析师、信用分析师，基金经理助理等职务，现任申万菱信添益宝债券型证券投资基金、申万菱信可转换债券债券型证券投资基金，申万菱信收益宝货币市场基金基金经理。

周鸣女士，2009 年 6 月至 2013 年 7 月任本基金基金经理。

王成先生，2008 年 12 月至 2009 年 12 月任本基金基金经理。

5、投资决策委员会组成

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：洪渊

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构

申万菱信基金管理有限公司直销中心

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

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

公司网址：www.swsmu.com

客户服务中心电话：400 880 8588 或 86-21-962299

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：李紫钰

电话：010-85108753

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：陈秀良

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：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

(11) 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

(12) 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

(13)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

(14)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

(15)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

(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：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

(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：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

(23) 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

(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：400-800-8899

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

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

(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：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

(31) 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

(32) 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

(33) 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：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：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

(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

(39) 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

(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：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

(42) 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

(43) 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

(44) 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

(45) 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

(46) 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

(47) 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

(48) 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

(49) 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

(50) 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

(51)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

(52)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

(53)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

(54) 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

(55) 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

(56) 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

(57) 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

(58) 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

(59) 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

(60) 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>

(61)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/>

(62)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

(63)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

(64)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

(65)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

(66)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

(67)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>

(68)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

(69)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

（二）注册与过户登记人

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

法定代表人：姜国芳

电话：+86 21 23261188

传真：+86 21 23261199

联系人：李濮君

（三）律师事务所和经办律师

律师事务所：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：韩炯

电话：+86 21 31358666

传真：+86 21 31358600

经办律师：秦悦民、王利民

（四）会计师事务所和经办注册会计师

会计师事务所：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

本基金名称：申万菱信添益宝债券型证券投资基金

五、基金的类型

本基金的类型： 契约型开放式

基金类别： 债券型

六、基金的投资目标

在控制风险和保持资产流动性的前提下，追求稳定的当期收入和总回报。

七、基金的投资范围和投资对象

本基金主要投资于具有良好流动性的固定收益类品种，包括国债、金融债、公司债、企业债、次级债、可转换债券、资产支持证券、短期融资券、债券回购、央行票据、同业存款等以及法律法规或监管机构允许基金投资的其它金融工具。本基金不直接从二级市场买入股票或权证等权益类资产，但可以投资通过首次发行股票、增发新股、可转换债券转股以及权证行权等方式获得的股票资产，并可投资因股票派发或因投资分离交易可转债所产生的权证等资产。

法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金对债券类资产的投资比例不低于基金资产的 80%；对股票等权益类资产的投资比例不高于基金资产的 20%。现金及到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。

八、基金的投资策略

本基金奉行主动式投资管理，在价值分析的基础上，结合定性与定量分析，把握固定收益市场、股票首发或增发等低风险投资机会，通过积极的投资策略，在严格控制风险的前提下，力保本金稳妥并令资产获得长期稳定增值。

1、一级资产配置策略

资产配置策略确定基金在各大类资产的投资比例，在本基金中是指基金总资产在转债、债券、新股/转债申购和现金证券的投资比例分配，资产配置是投资获利的决定性因素。从国内外情况来看，资产配置对总收益的贡献度超过 80%，对收益的波动解释超过 90%。

在大类资产的配置上，本基金主要根据宏观经济与市场运行趋势的综合分析，决定在转债、债券、新股/转债申购和现金资产上的资金分配。宏观经济分析将基于宏观经济运行状况、国家财政和货币政策等方面进行研究，着重于对中国经济的运行环境、中国经济的增长前景、行业发展的分化、企业盈利的增长趋势等问题进行考察与评估；市场运行趋势分析将主要集中在对市场估值水平、资金供给、市场信心、市场运行周期、市场政策等方面进行研究，以期对市场未来的运行情况进行判断与预测。

在对宏观经济与市场运行趋势进行综合判断后，结合基金的流动性要求，确定转债、债券、新股/转债申购和现金的资金配置比例。此外，回顾与调整是资产配置策略的一个重要组成部分。本基金按季度定期对基金的配置策略进行检视与调整，当遇到重大市场变化或政策变化时，本基金将及时对该事件进行评估并对资产配置策略进行调整，以确保资产配置策略能够及时对宏观经济与市场运行趋势的变化进行反应。

2、债券资产配置策略

（1）债券投资策略

本基金的债券投资研究依托公司整体的债券研究平台，通过自上而下的宏观基本面和资金技术面分析，确定一个阶段对债券市场整体的把握，并确定投资组合的

期限和策略。预期利率下降时，增加组合久期，以较多地获得债券价格上升带来的收益，预期利率上升时，减小组合久期，以规避债券价格下降的风险。另外，在久期确定的基础上，根据对收益率曲线形状变化的预测，采用子弹型策略、哑铃型策略或梯形策略，在长期、中期和短期债券间进行配置，以从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。

在自上而下的方法确定一个阶段的投资组合久期后，本基金采取自下而上的分析框架，包含信用分析、个券分析、创新金融工具和交易策略分析，由此形成和宏观层面相配套的微观层面的研究决策体系，最后形成具体的投资策略。根据国债、金融债、企业债等不同债券板块之间的相对投资价值分析，增持价值被相对低估的债券板块，减持价值被相对高估的债券板块，借以取得较高收益。随着债券市场的发展，本基金将加强对公司债、资产抵押债券等新品种的投资，主要通过信用风险的分析和管理的，获取超额收益。

（2）信用产品投资策略

本基金主要利用信用分析对信用产品进行投资选择，信用分析包括信用评级体系和信用环境分析。

1) 信用评级体系：本基金将建立内部信用评级制度，研究公司债券信用。研究员将根据国民经济运行的周期阶段，分析企业的市场地位、管理水平、发展趋势和财务状况等情况，最后综合评价出债券发行人信用风险，评价债券的信用级别，作为信用产品投资的研究支持基础。我们的评级体系采取自上而下的分析方法，从行业至公司。

2) 信用环境分析：信用产品与无风险品种之间的利差包括税收利差、流动性利差和信用利差。信用利差取决于债券的信用风险大小。流动性利差的影响因素则较为复杂，包括供求关系、产品的再融资能力、变现能力等。在新股申购收益率远高于其他固定收益品种的情况下，流动性利差有时远大于信用利差，从而成为影响信用产品收益率的主要因素。因此，信用产品的投资策略必须兼顾收益率与流动性。研究信用市场环境的变化，掌握并预测信用利差波动的规律，以此作为信用品种配置时机的重要依据。

（3）套利策略

除了确定整体的投资策略和大类债券资产的比例之外，本基金管理人还努力把握市场上的无风险套利机会，增加盈利，控制风险，主要有下面几种方式：

1) 跨市场回购交易的套利操作。适当把握交易所和银行间回购市场之间的套利机

会，在银行间通过正回购低价融入资金，然后择机在交易所高价放出，从而在不占用自身资金的情况下，来获取相对低风险的套利收益。

2) 融资养券的套利操作。当债券市场上部分债券品种的收益率上升较快时，其与回购利率之间的利差也会相应扩大，本基金可以在银行间市场上通过滚动融资的方式买入较高收益率的债券并持有一段时间，以期获得债券收益与回购成本之间的套利收益。

3) 回购掉期的套利操作。一般情况下，长期回购利率较短期回购利率存在期限溢价，其利率水平相对短期回购要高，特别是当市场普遍预期未来货币市场利率将会上升或者波动性增大的环境下，这时候，投资需求者为了提前锁定未来融资风险，一般会增加长长期回购的融资需求并愿意支付较高溢价。在这种情况下，长长期回购利率较短期回购利率的利差就会扩大，两者之间或存在一定的套利空间。回购掉期套利策略就是利用不同期限回购利率的差异，在连续借入短期资金的同时，放出长长期资金，以获取无风险的利差收益。

（4）可转债投资策略

1) 结合公司分析及期权分析，寻找投资标的。分析转债公司基本面，确定转债期权的隐含波动率，结合转债的纯债价值确定转债价值，寻找低估的可转债。

2) 通过统计分析把握阶段性机会。结合转债的上市、进入转股期、赎回公告等事件发生前后的表现。

通过以上两方面研究寻找转债投资机会。

3、一级市场申购策略

本基金通过研究首次发行股票、增发新股及发行转债公司的基本面，估计上市后的合理价格，判断是否参与新股及转债的一级市场申购。同时，由于新股和转债申购收益率有差异，为提高基金申购收益率，本基金以 2006 年以来沪深市场发行上市的新股、可转债、可分离转债为样本，分析同时有新股、可转债、可分离转债发行时的影响申购收益率因素及规律，确定最优申购策略，并根据当时的一级市场情况进行灵活调整。

九、业绩比较基准

本基金业绩比较基准：中债总指数（全价）

十、投资程序

1、投资决策依据

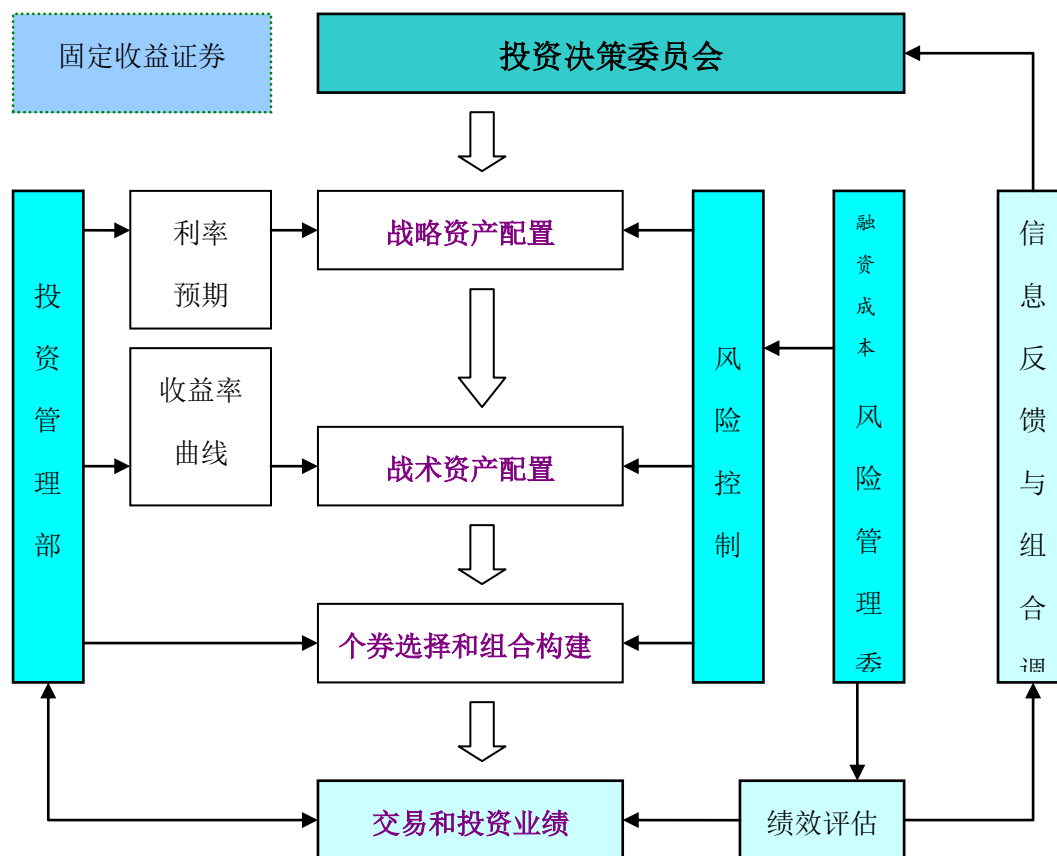
本基金管理人将主要依据下述因素决定基金资产配置和证券选择：

- （1）国家有关法律法规和本基金《基金合同》的有关规定；
- （2）国家宏观经济环境及其对证券市场的影响；
- （3）国家货币政策、财政政策以及证券市场政策对证券市场的影响；
- （4）证券市场资金供求状况以及证券市场的交易与估值状况；
- （5）在充分权衡固定收益证券各子类资产的收益、风险以及流动性的前提下做出

投资决策。

2、投资决策流程

本基金固定收益证券投资管理流程



资料来源：申万菱信基金管理有限公司

(1) 由投资决策委员会根据投资总监基于投资研究部和基金经理提供的长期策略分析报告而做的投资建议（资产配置方案），决策批准基金固定收益证券部分总体投资计划与投资政策；

(2) 固定收益证券投资战略配置，由投资研究部参考和利用公司外部，尤其是研究力量雄厚的国内第三方研究机构提供的研究报告，通过拜访国家有关部委和著名经济学家，了解国家宏观经济政策、财政政策、货币政策，经过筛选、归纳和整理，有宏观经济分析师定期或不定期地撰写宏观经济分析报告；

(3) 由固定收益分析师根据宏观经济形势和分析报告，采用利率预期策略等对未来利率走势作出判断后，对银行间市场和交易所市场两市场间的固定收益证券投资组合进行战略性配置；

(4) 固定收益证券投资战术配置，由基金固定收益分析师在战略配置基础上，根据整体宏观经济的发展趋势和债券市场未来的行情走势，采用利率免疫化、久期控制等债券投资策略对固定收益证券组合进行战术性配置与调整；

(5) 基金经理根据固定收益分析师的研究结果，确定在银行间市场和交易所市场的国债、中央银行票据、金融债、短期融资券、企业（公司）债、可转债、资产支持证券等品种的配置计划，构造投资组合方案，并形成具体投资指令后由交易部门实施；（模型试算）

(6) 所有投资决策过程均由风险控制与投资管理部门进行同步监控，并对投资结果进行绩效评价，其评价结果均将作为重要的反馈信息反馈到投资决策委员会与投资管理部门，以用来对投资策略进行调整，对基金投资组合的风险控制提出建议。

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	1,214,881.14	0.06
	其中：股票	1,214,881.14	0.06
2	固定收益投资	2,011,607,536.80	96.98
	其中：债券	2,011,607,536.80	96.98
	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	22,994,564.96	1.11
7	其他各项资产	38,517,215.72	1.86
8	合计	2,074,334,198.62	100.00

注：本基金未开通沪港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

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	-	-
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	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	446,204.24	0.03
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	-	-
K	房地产业	768,676.90	0.05
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	1,214,881.14	0.07

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	600067	冠城大通	116,290.00	768,676.90	0.05
2	000089	深圳机场	54,151.00	446,204.24	0.03

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	7,069,400.00	0.44
2	央行票据	-	-
3	金融债券	213,093,000.00	13.13
	其中：政策性金融债	213,093,000.00	13.13
4	企业债券	769,986,416.80	47.43
5	企业短期融资券	280,709,000.00	17.29
6	中期票据	735,083,000.00	45.28
7	可转债（可交换债）	5,666,720.00	0.35
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,011,607,536.80	123.90

5 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	150212	15国开12	1,000,000.00	101,710,000.00	6.26
2	122395	15富力债	510,000.00	53,244,000.00	3.28
3	1282471	12青城投MTN1	500,000.00	52,095,000.00	3.21
4	101461020	14北大荒MTN001	500,000.00	52,000,000.00	3.20
5	1382056	13北车集MTN1	500,000.00	51,865,000.00	3.19

6 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序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

根据本基金基金合同，本基金不得参与股指期货交易。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金基金合同，本基金不得参与股指期货交易。

10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 本期国债期货投资政策

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 本期国债期货投资评价

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	19,273.11
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	38,496,748.97
5	应收申购款	1,193.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	38,517,215.72

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113008	电气转债	3,802,240.00	0.23
2	128009	歌尔转债	1,520,640.00	0.09
3	110030	格力转债	343,840.00	0.02

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. 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

申万菱信添益宝债券A基金：

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
2008年12月04日(基金合同生效日)至2009年12月31日	2.40%	0.11%	-2.80%	0.12%	20%	-0.01%
2010年	13.63%	0.25%	-0.87%	0.10%	14.50%	0.15%
2011年	-6.45%	0.24%	2.52%	0.11%	-8.97%	0.13%
2012年	7.56%	0.15%	-0.67%	0.07%	8.23%	0.08%

2013年	2.50%	0.24%	-5.28%	0.11%	7.78%	0.13%
2014年	16.66%	0.24%	7.48%	0.15%	9.18%	0.09%
2015年	7.45%	0.45%	4.51%	0.12%	2.94%	0.33%
2016年1月1日至3月31日	1.27%	0.06%	0.27%	0.10%	1.00%	-0.04%
自基金合同生效日至2016年3月31日	52.34%	0.26%	4.68%	0.11%	47.66%	0.15%

申万菱信添益宝债券B基金：

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
2008年12月04日(基金合同生效日)至2009年12月31日	2.10%	0.12%	-2.80%	0.12%	4.90%	0.00%
2010年	13.18%	0.25%	-0.87%	0.10%	14.05%	0.15%
2011年	-6.77%	0.23%	2.52%	0.11%	-9.29%	0.12%
2012年	7.20%	0.15%	-0.67%	0.07%	7.87%	0.08%
2013年	2.14%	0.23%	-5.28%	0.11%	7.42%	0.12%
2014年	17.00%	0.25%	7.48%	0.15%	9.52%	0.10%
2015年	7.12%	0.45%	4.51%	0.12%	2.61%	0.33%
2016年1月1日至3月31日	1.19%	0.06%	0.27%	0.10%	0.92%	-0.04%
自基金合同生效日至2016年3月31日	49.60%	0.26%	4.68%	0.11%	44.92%	0.15%

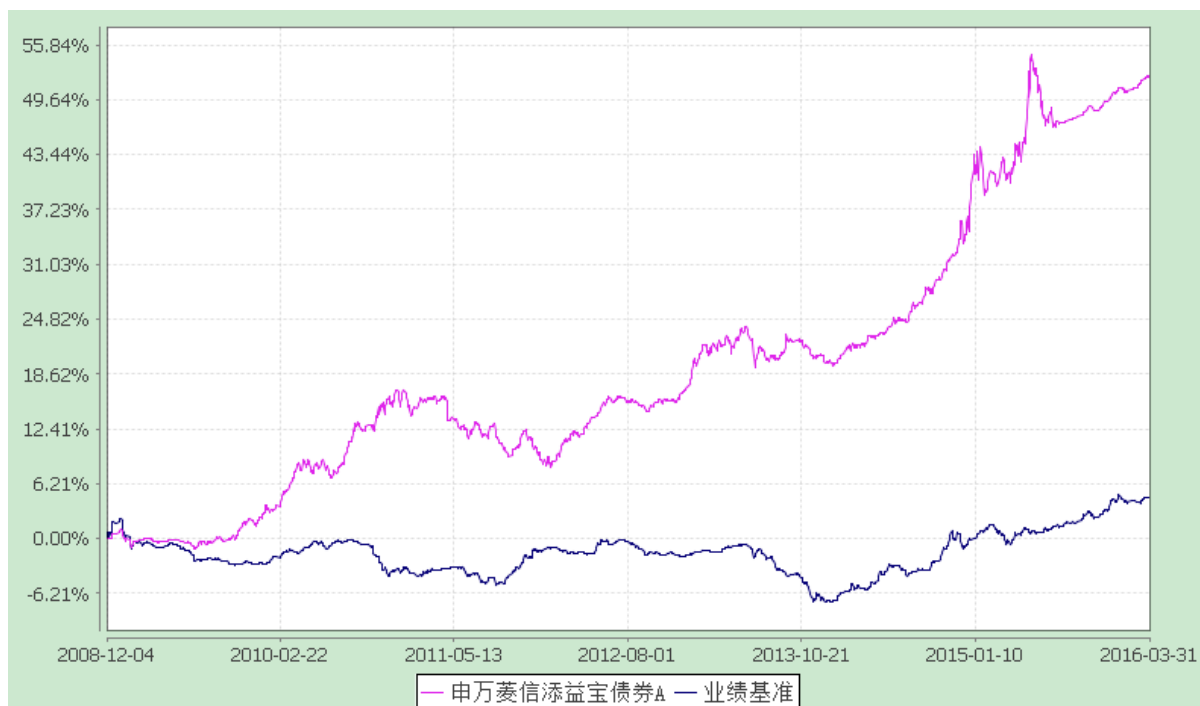
注：上述基金业绩指标已扣除了基金的管理费、托管费和各项交易费用，但不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：申购费、赎回费等），计入认购或交易基金的各项费用后，实际收益水平要低于所列数字。

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

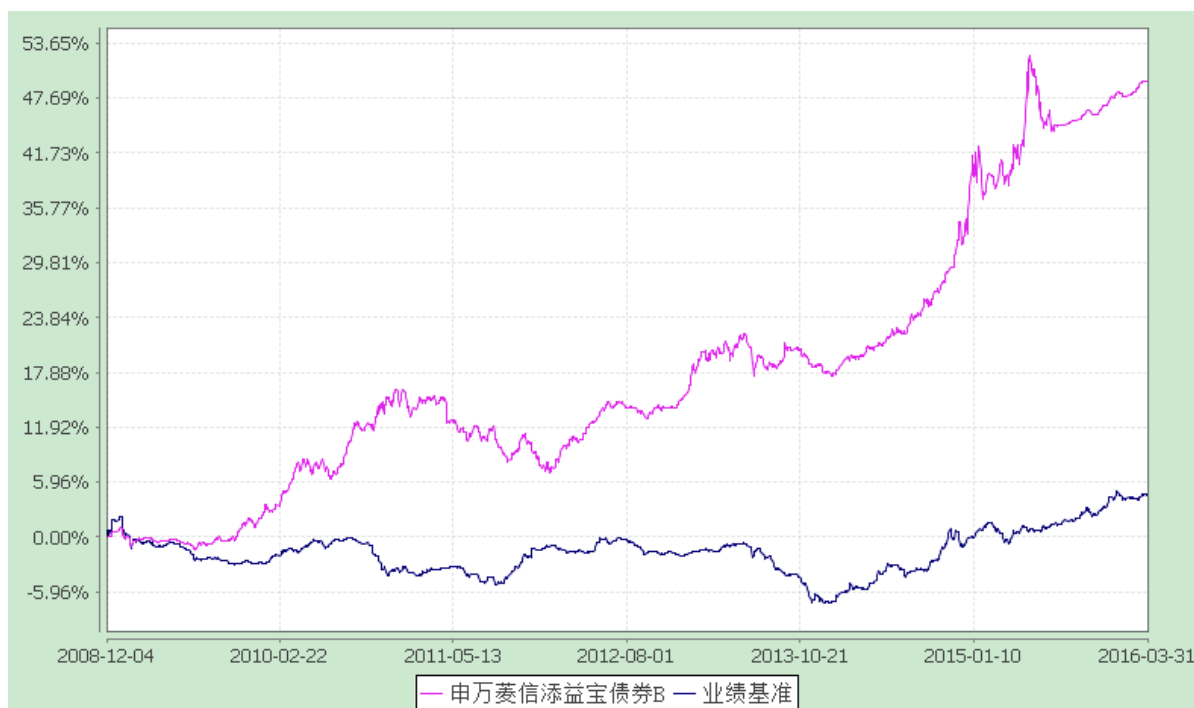
申万菱信添益宝债券型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

申万菱信添益宝债券 A



申万菱信添益宝债券 B



十三、基金的费用与税收

（一）与基金运作有关的费用

1、与基金运作有关的费用的种类：

- （1）、基金管理人的管理费；
- （2）、基金托管人的托管费；
- （3）、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
- （4）、基金份额持有人大会费用；
- （5）、基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- （6）、基金的证券交易费用；
- （7）、基金的银行汇划费用；
- （8）、销售服务费：本基金从 B 类基金份额的基金财产中计提销售服务费；
- （9）、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。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金资产中扣除。

2、基金管理人的管理费计提方法、计提标准和支付方式

基金管理费按前一日基金资产净值的 0.6% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，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 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、公休日等，支付日期顺延。

3、基金托管人的托管费计提方法、计提标准和支付方式

基金托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数，其中：}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，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 2 个工作日内从基金资产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

4、销售服务费计提方法、计提标准和支付方式

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费, B 类基金份额的销售服务费年费率为 0.35%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务,基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。

销售服务费按前一日 B 类基金资产净值的 0.35% 年费率计提。计算方法如下:

$$H = E \times 0.35\% \div \text{当年天数}$$

H 为 B 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 B 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令,基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中划出,由注册登记机构代收,注册登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

上述一、基金费用的种类中第 3—7 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。

(二) 与基金销售有关的费用

1、认购费用

本基金根据认、申购费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认、申购基金时收取认、申购费用的,称为 A 类基金份额;不收取认、申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 B 类基金份额。

A 类基金份额的认购采取金额认购的方式,认购费率最高不超过认购金额的 0.6%,在认购时收取并由认购人承担,按认购金额分段设定如下:

认购金额(元)	认购费率
100 万以下	0.60%
100 万(含)~500 万	0.40%
500 万(含)~1000 万	0.20%

1000 万（含）以上	1000 元
-------------	--------

2、申购费用

A 类基金份额的申购费率最高不超过 0.8%，在申购时收取并由申购人承担，按申购金额分段设定如下：

申购金额	申购费率	养老金客户特定申购费率
100 万以下	0.8%	0.32%
100 万（含）-500 万	0.5%	0.10%
500 万（含）-1000 万	0.3%	0.03%
1000 万（含）以上	1000 元/笔	500 元/笔

3、赎回费用

A 类与 B 类基金份额的赎回费率最高不超过 0.15%，按持有时间分段设定如下：

持有期限	赎回费率	养老金客户特定赎回费率
30 天以下	0.15%	0.0375%
30 天（含）-1 年以下	0.10%	0.025%
1 年（含）-2 年以下	0.05%	0.0125%
2 年以上（含 2 年）	0%	0%

本基金的赎回费在投资者赎回基金份额时收取，扣除赎回手续费后的余额归基金资产，赎回费归基金资产的部分为赎回费的 25%。

（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、会计师和律师费、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、基金销售费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率，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 2 日在至少一种指定媒体和基金管理人网站上公告并报中国证监会备案。

（五）基金的税收

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 2016 年 3 月 31 日；

- 6、更新了本基金的业绩部分，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 12 月 5 日至 2016 年 6 月 4 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 18 日