

# 申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金招募说明书 (第五次更新)摘要

基金管理人：申万菱信基金管理有限公司  
基金托管人：中国农业银行股份有限公司

## 【重要提示】

- 本基金基金合同已于 2015 年 6 月 19 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 19 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）。申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金 招募说明书更新（摘要）

## 1 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 .....	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 .....	30
八、基金的投资策略 .....	31
九、业绩比较基准 .....	32
十、风险收益特征 .....	33
十一、基金投资组合报告 .....	33
十二、基金的业绩 .....	37
十三、基金的费用与税收 .....	38
十四、对招募说明书本次更新部分的说明 .....	40 申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金 招募说明书更新（摘要）

## 1 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：刘郎  
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

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，曾任职于申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金 招募说明书更新（摘要）

### 1

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，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。曾任高盛集团全球控制部高级分析申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金 招募说明书更新（摘要）

### 1

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。申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金 招募说明书更新（摘要）

#### 1

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

张少华先生，硕士研究生。1999 年开始从事证券相关工作，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，申万菱信量化小盘股票型证券投资基金、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基金经理，现任公司副总经理兼固定收益投资部总监，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。

荆一帆先生，硕士研究生。2012 年起从事金融相关工作，曾任职于华夏基金管理有限公司、国投瑞银基金管理有限公司，2017 年加入申万菱信基金管理有限公司，现任申万菱信沪深 300 价值指数证券投资基金、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，2015 年 6 月至 2017 年 6 月任本基金基金经理。

俞诚先生，2015 年 12 月至 2017 年 6 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、基金投资管理总部总监、研究总监、权益投资部总经理、量化投资部总经理、固定收益投资申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金 招募说明书更新（摘要）

#### 1

总部总监等。

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）基金托管人情况

#### 1、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：周慕冰

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：贺倩

### 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 申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金 招募说明书更新（摘要）

1

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：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：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 申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金 招募说明书更新（摘要）

1

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：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

(5) 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

(6)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 申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金 招募说明书更新（摘要）

1  
公司网站：www.gtja.com

(7)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

(8)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  
客户服务热线：95536  
网址：www.guosen.com.cn

(9)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

(10)名称：中信证券股份有限公司 申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金 招募说明书更新（摘要）

1  
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

(11)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

(12)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

(13) 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 申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金 招募说明书更新（摘要）

1  
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

(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：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

(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：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 申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金 招募说明书更新（摘要）

1  
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

(17) 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

(18) 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

(19)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 申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金 招募说明书更新（摘要）

1  
公司网址：www.cindasc.com

(20)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

(21) 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

(22) 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 申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金 招募说明书更新（摘要）

1

(23) 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

(24)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

(25)名称：平安证券股份有限公司  
住所：深圳市福田区金田路 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>

(26)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 申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金 招募说明书更新（摘要）

1  
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>

(27)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>

(28)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](http://www.hysec.com)

(29)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 申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金 招募说明书更新（摘要）

1  
联系人：吴阳  
电话：0531-68889155  
传真：0531-68889185  
客服电话：95538  
网址：[www.zts.com.cn](http://www.zts.com.cn)

(30)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](http://www.fcsc.com.cn)

(31)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](http://www.avicsec.com)



(32)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  
申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金 招募说明书更新（摘要）

1

(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

(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大厦 7 层、8 层  
办公地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新大厦 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：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

(36)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 申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金 招募说明书更新（摘要）

1

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

(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 号中国人寿大厦 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  
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 申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金 招募说明书更新（摘要）

1  
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：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

(42)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 申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金 招募说明书更新（摘要）

1

(43)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

(44)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

(45)名称：深圳众禄基金销售股份有限公司  
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](http://www.zlfund.cn)，基金买卖网 [www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

(46)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 申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金 招募说明书更新（摘要）

1  
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](http://www.1234567.com.cn)

(47)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：上海市浦东新区 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](http://www.ehowbuy.com)

(48) 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](http://www.fund123.cn)

(49)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 申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金 招募说明书更新（摘要）

1  
公司网站：[www.erichfund.com](http://www.erichfund.com)

(50)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](http://www.5ifund.com)

(51)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](http://www.myfund.com)

(52)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  
申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金 招募说明书更新（摘要）

1

(53)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

(54)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

(55)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

(56) 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 申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金 招募说明书更新（摘要）

1

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/>

(57)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

(58)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>

(59)名称：上海汇付基金销售有限公司 申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金 招募说明书更新（摘要）

1

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](http://www.chinapnr.com)

(60)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](http://www.jinqianwo.cn)

(61)名称：上海陆金所基金销售有限公司  
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 申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金 招募说明书更新（摘要）

1

网址：[www.lufunds.com](http://www.lufunds.com)

(62)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](http://www.dtfunds.com)

(63)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](http://www.yingmi.cn)

(64)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/>

申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金 招募说明书更新（摘要）

1

(65)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](http://www.cmiwm.com)

(66)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](http://www.hcjijin.com)

(67)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

网址：[www.danjuanapp.com](http://www.danjuanapp.com)

2、场内发售机构 申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金 招募说明书更新（摘要）

1

(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（具体名单可在深圳证券交易所网站查询）。

(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: 黎明

经办律师: 黎明、孙睿

(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 申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金 招募说明书更新(摘要)

1

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、基金的名称

申万菱信中证申万医药生物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平均跟踪误差不超过 0.35%,年跟踪误差不超过 4%,实现对中证申万医药生物指数的有效跟踪。

#### 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。申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金 招募说明书更新(摘要)

1

#### 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； 申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金 招募说明书更新（摘要）

### 1

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的权重进行购买时，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： $95\% \times \text{中证申万医药生物指数收益率} + 5\% \times \text{银行同业存款利率}$ 。

本基金以中证申万医药生物指数为标的指数，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。

中证申万医药生物指数由中证指数有限公司编制并发布，用以表征医药生物行业公司股票的整体走势，兼具价值尺度与投资标的的功能。

如果指数编制单位变更或停止标的指数的编制、发布或授权，或标的指数由其他指数替代、或由于指数编制方法的重大变更等事项导致本基金管理人认为标的指数不宜继续作为跟踪标的，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金管理人可以依据维护投资人合法权益的原则，在按监管部门要求履行适当程序后变更本基金的标的指数、业绩比较基准和基金名称。若变更标的指数、业绩比较基准对基金投资范围和投资策略无实质性影响（包括但不限于申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金 招募说明书更新（摘要）

### 1

指数编制单位变更、指数更名等事项），则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。若变更业绩比较基准、标的指数涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更业绩比较基准、标的指数召开基金份额持有人大会，并报中国证监会备案。

## 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。申万医药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；申万医药 A 份额，则具有预期风险低，预期收益低的特征；申万医药 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 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 790,748,775.93 92.16  
其中：股票 790,748,775.93 92.16  
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 -- 申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金 招募说明书更新（摘要）

1  
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 67,027,161.94 7.81  
7 其他各项资产 253,182.63 0.03  
8 合计 858,029,120.50 100.00

注：本基金未开通港股通交易机制投资于港股。

#### 2.1 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 659,789,252.23 77.30

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 31,093.44 0.00

E 建筑业 --

F 批发和零售业 82,260,922.07 9.64

G 交通运输、仓储和邮政业 25,571.91 0.00

H 住宿和餐饮业 --

I

信息传输、软件和信息技术服务业

17,468.03 0.00

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 5,849,491.20 0.69

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 42,730,976.55 5.01 申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金 招募说明书更新（摘要）

1

R 文化、体育和娱乐业 44,000.50 0.01

S 综合 --

合计 790,748,775.93 92.64

#### 2.2 报告期末按行业分类的沪股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 600276 恒瑞医药 1,126,632.00 67,519,055.76 7.91

2 600518 康美药业 1,978,398.00 39,726,231.84 4.65

3 000538 云南白药 347,074.00 31,479,611.80 3.69

4 600196 复星医药 670,267.00 22,916,428.73 2.68

5 000423 东阿阿胶 348,777.00 22,646,090.61 2.65

6 002252 上海莱士 993,750.00 20,679,937.50 2.42

7 601607 上海医药 769,099.00 18,258,410.26 2.14

8 000963 华东医药 324,004.00 15,898,876.28 1.86  
9 600867 通化东宝 796,220.00 15,367,046.00 1.80  
10 300003 乐普医疗 712,547.00 15,312,635.03 1.79

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序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申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金 招募说明书更新（摘要）

1

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

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 本期国债期货投资政策

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 本期国债期货投资评价

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 42,081.43

2 应收证券清算款 184,034.57

3 应收股利 -

4 应收利息 12,516.93

5 应收申购款 14,549.70

6 其他应收款 - 申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金 招募说明书更新（摘要）

1

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 253,182.63

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

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  
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  
自 2015 年 6 月  
19 日（基金合  
同生效日）至  
2015 年 12 月  
31 日  
2.89% 2.46%

-19.02%

2.95% 21.91% -0.49%  
2016 年 -13.78% 1.53% -12.67% 1.56% -1.11% -0.03%

2017 年 1 月 1  
日至 2017 年 9  
月 30 日

6.19% 0.60% 5.35% 0.62% 0.84% -0.02%

自基金合同生  
效日至 2017  
年 9 月 30 日

-5.8% 1.60% -25.50% 1.79% 19.70% -0.19%

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，但申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金 招募说明书更新（摘要）

1

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

申万菱信中证申万医药生物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 6 月 19 日至 2017 年 9 月 30 日）

申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金 招募说明书更新（摘要）

2

### 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：

$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$

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

基金管理费自基金合同生效次日起每日计算，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首日起 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：

$H = E \times 0.22\% \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金托管费 申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金 招募说明书更新（摘要）

3

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首日起 3 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，需根据与指数所有人中证指数有限公司签署的指数许可使用协议的约定向中证指数有限公司支付指数许可使用费。通常情况下，指数许可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：

$H = E \times \text{年费率} / \text{当年天数}$ ，本基金年指数使用费率为 0.02%

H 为每日应付的指数许可使用费

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费每日计算，逐日累计，按季支付。标的指数许可使用费的收取下限为每季人民币 5 万元（大写：伍万元整），计费区间不足一季度的，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指数许可使用费划付指令，经基金托管人复核后，于每年 1 月、4 月、7 月、10 月的前十（10）个工作日内从基金财产中一次性支付给中证指数有限公司上一季度的标的指数许可使用费。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。

除管理费、托管费、标的指数许可使用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； 申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金 招募说明书更新（摘要）

4

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 2017 年 9 月 30 日；
- 6、更新了基金的业绩部分，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 20 日至 2017 年 12 月 19 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 2 月 1 日