

---

# 申万菱信基金管理有限公司

## 申万菱信量化成长混合型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：中国工商银行股份有限公司

### 【重要提示】

- 本基金基金合同已于 2017 年 3 月 10 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，并经中国证监会注册。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 2018 年 9 月 10 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2018 年 6 月 30 日（财务数据未经审计）。

## 目 录

一、基金管理人.....	1
二、基金托管人.....	4
三、相关服务机构.....	5
四、基金的名称.....	28
五、基金的类型.....	28
六、基金的投资目标.....	28
七、基金的投资范围和投资对象.....	29
八、基金的投资策略.....	29
九、业绩比较基准.....	32
十、风险收益特征.....	32
十一、基金投资组合报告.....	32
十二、基金的业绩.....	36
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.....	39

## 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：中国证监会证监基金字【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：021-23261188

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，兼任投资交

易事业部总经理，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。

糠信英树先生，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），曾任职于人事部、资产运用部、权益运用部、投资企划部，现任受托财产企划部副部长兼资产管理事业室长。

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，曾任监察稽核部总监，现任综合办公室主任。

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。

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。

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

刘敦先生，硕士研究生。2008年起从事金融相关工作，曾任职于艾利士通资产管理有限公司、平安资产管理有限公司、申银万国证券研究所等。2015年3月加入申万菱信基金管理有限公司，曾任专户投资经理，现任指数与创新投资部负责人兼量化投资部负责人，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、申万菱信量化成长混合型证券投资基金、申万菱信价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

金昉毅先生，2017年3月至2018年3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、权益研究部负责人、权益投资部负责人、量化投资部负责人、固定收益投资部负责人、指数与创新投资部负责人等。

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，权益研究部负责人为本委员会秘书，负责协调统筹本委员会的各项事宜。

本公司董事长、督察长、监察稽核部负责人、风险管理部负责人作为非执行委员，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：郭明

## （二）主要人员情况

截至 2018 年 6 月，中国工商银行资产托管部共有员工 212 人，平均年龄 33 岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

## （三）基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2018 年 6 月，中国工商银行共托管证券投资基金 874 只。自 2003 年以来，本行连续十五年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 61 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

## 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

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 10 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](http://www.swsmu.com)

电子邮件：[service@swsmu.com](mailto:service@swsmu.com)

## 2、其他销售机构

### (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](http://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](http://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

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](http://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：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](http://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：95521

公司网站：[www.gtja.com](http://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](http://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 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](http://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](http://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](http://www.cs.ecitic.com)

**(10) 名称：中国银河证券股份有限公司**

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈有安

客户服务热线：4008888888

传真：010-66568292

联系人：邓颜

公司网址：[www.chinastock.com.cn](http://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](http://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](http://www.swhysc.com)

**(13) 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](http://www.95579.com)

**(14) 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](http://www.essence.com.cn)

**(15) 名称：湘财证券股份有限公司**

注册地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

办公地点：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

法定代表人：林俊波

客服电话：400-888-1551

传真：021-68865680

公司网址：[www.xcsc.com](http://www.xcsc.com)

**(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

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](http://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](http://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](http://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

公司网址：[www.cindasc.com](http://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](http://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](http://www.gzs.com.cn)

**(22) 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](http://www.glsc.com.cn)

**(23) 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](http://www.stocke.com.cn)

**(24) 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>

**(25) 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>

**(26) 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)

**(27) 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)

**(28) 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](http://www.westsecu.com)



**(29) 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](http://www.zszq.com)

**(30) 名称：联讯证券股份有限公司**

住所：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼

办公地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼

法定代表人：徐刚

客户服务电话：95564

传真：010-2119660

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

**(31) 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](http://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

**(32) 名称：天风证券股份有限公司**

天风证券股份有限公司

注册地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦 4 楼

办公地址：湖北省武汉市武昌区中南路 99 号保利广场 A 座 37 楼

法定代表人：余磊

联系人：杨晨

电话：027-87107535

传真：027-87618863

客服热线：4008005000

**(33) 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](http://www.tpyzq.com)

**(34) 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](http://www.kysec.cn)

**(35) 名称：中泰证券股份有限公司**

注册地址：山东省济南市市中区经七路 86 号

办公地址：山东省济南市市中区经七路 86 号

法定代表人：李玮

联系人：吴阳

电话：0531-68889155

传真：0531-68889185

客服电话：95538

网址：[www.zts.com.cn](http://www.zts.com.cn)

**(36) 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](http://www.sywgqh.com)

**(37) 中信期货有限公司**

注册地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座 13 层 1301-1305 室、14 层

办公地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座 13 层 1301-1305 室、14 层

法定代表人：张皓

传真：010-57762999

联系人：韩钰

客户服务热线：400-990-8826

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

**(38) 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

**(39)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：licaikexun.com

**(40)名称：诺亚正行基金销售有限公司**

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](http://www.noah-fund.com)

**(41)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)

**(42) 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](http://www.1234567.com.cn)

**(43) 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](http://www.ehowbuy.com)

**(44) 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)

**(45) 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](http://www.erichfund.com)

**(46) 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)

**(47) 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)

**(48) 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：上海市虹口区东大名路 1098 号浦江金融世纪广场 18F

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

**(49) 名称：宜信普泽（北京）基金销售有限公司**

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

**(50) 名称：众升财富（北京）基金销售有限公司**

注册地址：北京市朝阳区望京东园四区 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](http://www.zscffund.com)

**(51) 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](http://www.chtfund.com)

**(52) 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/>

**(53) 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](http://www.qianjing.com)

**(54) 名称：上海联泰基金管理有限公司**

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：深圳富济基金销售有限公司**

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)

**(56) 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

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

**(57) 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

**(58) 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

**(59) 北京肯特瑞基金销售有限公司**

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/>

**(60) 名称：中民财富基金销售（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)

**(61) 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.hcjjin.com](http://www.hcjjin.com)

**(62) 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)

**(63) 上海大智慧基金销售有限公司**

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102 单元

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102、1103 单元

法定代表人：申健

联系人：印强明

电话：021-20219988

传真：021-20219923

客户服务电话：021-20292031

网址：www.wg.com.cn

**(64) 南京苏宁基金销售有限公司**

注册地址：南京市玄武区苏宁大道1号

办公地址：南京市玄武区苏宁大道1号

法定代表人：刘汉青

联系人：王锋

电话：025-66996699-887226

传真：

客户服务电话：95177

网址：www.snjijin.com

**(65) 上海基煜基金销售有限公司**

注册地址：上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室（上海泰和经济发展区）

办公地址：上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1503室

法定代表人：王翔

联系人：吴鸿飞

电话：021-65370077

传真：021-55085991

客户服务电话：4008-205-369

网址：www.jiyufund.com.cn

**(66) 上海挖财基金销售有限公司**

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03 室

法定代表人：冷飞

联系人：李娟

电话：021-50810687

传真：021-58300279

客户服务电话：021-50810673

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

App：挖财宝

### （67）济安财富（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼 3 层 307

办公地址：北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼 3 层 307

法定代表人：杨健

联系人：李海燕

电话：010-65309516

客户服务电话：400-673-7010

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

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销售机构，并及时公告。

## 二、登记机构

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

办公地址：上海市中山南路 100 号 11 层

邮政编码：200010

法定代表人：刘郎

电话：（021）23261188

传真：（021）23261199

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

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：（021）31358666

传真：（021）31358600

联系人：陆奇

经办律师：黎明、陆奇

### 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：薛竞、赵钰

## 四、基金的名称

本基金名称：申万菱信量化成长混合型证券投资基金

## 五、基金的类型

本基金的类型：契约型开放式

## 六、基金的投资目标

本基金采用数量化的投资方法精选个股，严格按照纪律执行，力争获取长期稳定的超越业绩比较基准的投资回报。

## 七、基金的投资范围和投资对象

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（包括主板、中小板、创业板及其他依法发行、上市的股票）、权证、股指期货、国债期货、股票期权、债券（含国债、央行票据、金融债、次级债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、可转债及分离交易可转债、可交换债券、地方政府债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单，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相关规定)。

本基金可以参与融资业务。

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：股票投资占基金资产的比例为 10%~95%；其中，本基金每个交易日日终，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

## 八、基金的投资策略

本基金采用数量化技术对投资策略进行优化，将特定的投资思想和理念通过具体指标与参数的设定体现在数量模型中，坚持以数量化的方式进行投资，充分发挥数量化投资的优势，保持投资策略的一致性与有效性。

### 1、股票投资策略

#### （1）多因子 ALPHA 选股模型

本基金管理人对上市公司的财务数据和市场指标数据进行统计分析，筛选出最有效的成份因子，寻求 ALPHA 来源，构建选股模型。

本基金采用的因子指标主要分为三大类：

#### 1) 市场面因子

本基金管理人认为，市场面因子对市场的反应比较直接，比基本分析更能反应实际市场的局部现象；在一个非完全有效的市场中，这些因子对选择股票的表现具有一定的正面贡献。本基金主要采用的市场面因子包括换手率和相对强弱指标等。

#### 2) 成长因子

本基金通过量化统计模型，建立企业成长因子库，根据历史表现，将直接能反映超额收益的成长因子作为本基金的成份因子。本基金入库的成长因子主要包含主营业务增长率、净利润增长率等。

#### 3) 估值因子

本基金管理人认为，估值是投资中最困难也是最重要的部分，它直接体现着持股的安全边际与风险；估值因子是本模型中相当重要的指标，按传统基本面投资思想，上市公司的历史表现和分析师的未来预期都会最终反映在估值因子中。为了更合理的对公司的估值进行评价，本基金采用多种估值方法构建估值因子体系，主要的参考估值指标包括市盈率、市净率、市销率和市现率等。

通过多因子 ALPHA 选股模型的评估，筛选出本基金的核心股票池。

#### (2) 组合优化模型

基于核心股票池，本基金将根据基金的规模，选择合适的股票数量构建投资组合，通过组合优化模型决定各股票的加权方式与调仓频率等。本基金的组合优化模块，包括股票流动性评价、风险价值(VaR)以及动量/反转策略等。

#### (3) 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，定期或不定期地对投资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，以使得本基金能够持续的完成投资目标。

### 2、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。

### 3、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，以套期保值为目的，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，如在基金出现巨额或较大申购赎回时，通过股指期货及时进行加仓或减仓，迅速的进行仓位调整，以达成申购赎回对基金运作带来的影响最小化的目的。

### 4、权证投资策略

本基金在进行权证投资时，将通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型寻求其合理估值水平，主要考虑运用的策略包括：杠杆策略、价值挖掘策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、卖空保护性的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略等。

本基金将充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，谨慎进行投资，追求较稳定的当期收益。

### 5、资产支持证券投资策略

在严格控制投资风险的前提下，本基金将从信用风险、流动性风险、利率风险、税收因素和提前还款因素等方面综合评估资产支持证券的投资品种，选择低估的品种进行投资。

### 6、可转换债券投资策略

可转换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。本基金将选择公司基本素质优良、其对应的基础证券有着较高上涨潜力的可转换债券进行投资，并采用期权定价模型等数量化估值工具评定其投资价值，以合理价格买入并持有。

### 7、融资投资策略

本基金将在充分考虑风险和收益特征的基础上，审慎参与融资交易。本基金将基于对市场行情和组合风险收益的分析，确定投资时机、标的证券以及投资比例。若相关融资业务法律法规发生变化，本基金将从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。

#### 8、股票期权投资策略

本基金将按照风险管理的原则参与股票期权交易。本基金将结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求，以套期保值为目的，确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。

若相关法律法规发生变化时，基金管理人股票期权投资管理从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。未来如法律法规或监管机构允许基金投资其他期权品种，本基金将在履行适当程序后，纳入投资范围并制定相应投资策略。

#### 9、国债期货投资策略

本基金将按照相关法律法规的规定，以套期保值为目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平等指标进行跟踪监控，力求实现基金资产的中长期稳定增值。

若相关法律法规发生变化时，基金管理人期货投资管理从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。

## 九、业绩比较基准

业绩比较基准为： $75\% \times \text{中证 500 指数收益率} + 25\% \times \text{中证综合债指数收益率}$ 。

## 十、风险收益特征

本基金是混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于中高预期收益和中高预期风险水平的投资品种。

## 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2018年06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	204,880,314.43	75.48
	其中：股票	204,880,314.43	75.48
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	35,000,000.00	12.89
	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	26,664,109.44	9.82
7	其他各项资产	4,887,053.53	1.80
8	合计	271,431,477.40	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 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	2,619,137.00	0.97
B	采矿业	5,975,560.26	2.21
C	制造业	127,973,328.71	47.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,353,405.65	2.72

E	建筑业	7,172,438.40	2.66
F	批发和零售业	10,827,420.39	4.01
G	交通运输、仓储和邮政业	4,978,504.00	1.84
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,899,656.00	2.56
J	金融业	3,837,744.00	1.42
K	房地产业	10,808,236.28	4.00
L	租赁和商务服务业	3,767,213.60	1.40
M	科学研究和技术服务业	775,853.00	0.29
N	水利、环境和公共设施管理业	2,306,113.14	0.85
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	9,585,704.00	3.55
S	综合	-	-
	合计	204,880,314.43	75.88

## 2.2 报告期末按行业分类的港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	600309	万华化学	63,100.00	2,866,002.00	1.06
2	002078	太阳纸业	294,200.00	2,850,798.00	1.06
3	002699	美盛文化	147,300.00	2,763,348.00	1.02
4	000596	古井贡酒	29,500.00	2,619,010.00	0.97
5	000418	小天鹅A	37,100.00	2,572,885.00	0.95
6	601628	中国人寿	111,200.00	2,504,224.00	0.93
7	000830	鲁西化工	144,700.00	2,471,476.00	0.92
8	601900	南方传媒	259,000.00	2,444,960.00	0.91
9	600519	贵州茅台	3,200.00	2,340,672.00	0.87

10	600019	宝钢股份	294,977.00	2,297,870.83	0.85
----	--------	------	------------	--------------	------

#### 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

代码	名称	持仓量	合约市值	公允价值变动	风险说明
IC1807	IC1807	14.00	14,526,400.00	-790,510.00	-
IC1809	IC1809	6.00	6,135,120.00	-898,000.00	-
IC1812	IC1812	2.00	2,003,360.00	12,960.00	-
公允价值变动总额合计					-1,675,550.00
股指期货投资本期收益					-750,659.71
股指期货投资本期公允价值变动					-1,675,550.00

##### 9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金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 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

##### 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持有国债期货。

### 10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 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，或在报告编辑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 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	4,846,036.77
2	应收证券清算款	343.37
3	应收股利	-
4	应收利息	28,867.53
5	应收申购款	11,805.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,887,053.53

### 11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002699	美盛文化	2,763,348.00	1.02	重大事项

## 十二、基金的业绩

本基金的过往业绩不代表未来表现。

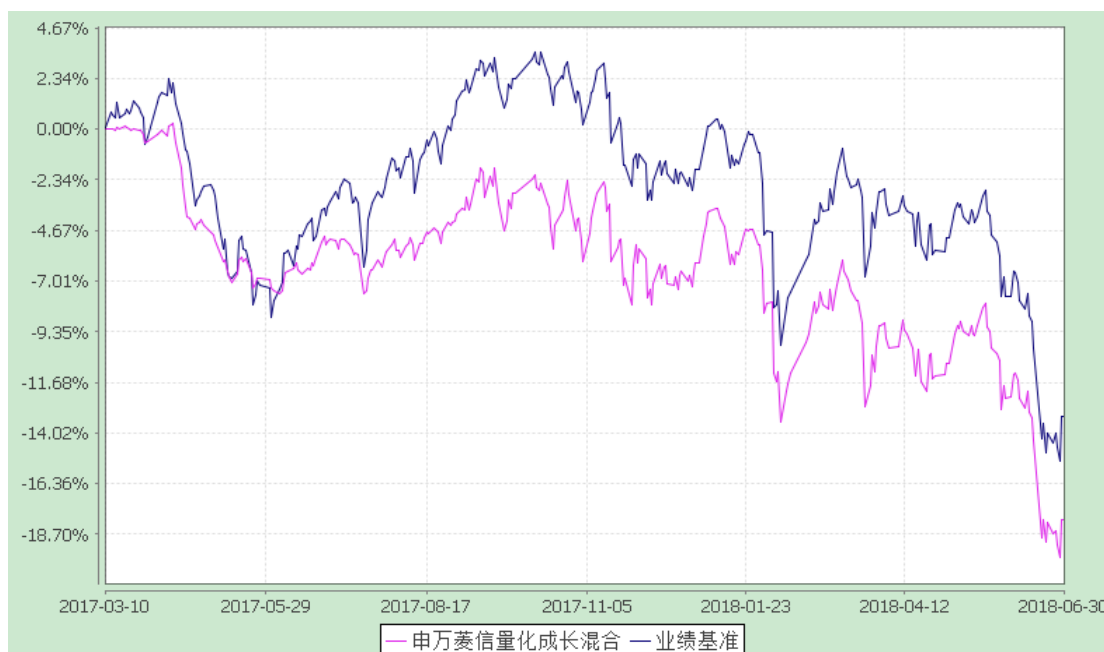
1、净值增长率与业绩比较基准收益率比较：

阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准收益 率标准差④	①—③	②—④
2017年3月 10日（基金合 同生效日）至 2017年12月 31日	-6.19%	0.63%	-1.87%	0.72%	-4.32%	-0.09%
2018年1月 1日至2018年 6月30日	-12.59%	1.12%	-11.59%	1.08%	-1.00%	0.04%
2017年3月 10日至 2018年6月 30日	-18.00%	0.84%	-13.24%	0.87%	-4.76%	-0.03%

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

申万菱信量化成长混合型证券投资基金  
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2017年3月10日至2018年6月30日)



注：本基金已在建仓期结束时，使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

### 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、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券、期货交易费用或结算而产生的交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、账户开户费用和账户维护费；
- 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。

#### 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 1.50% 年费率计提。管理费的计算方法



如下：

$$H=E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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日次日起每日计算，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、公休日或不可抗力致使无法按时支付的，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 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费自基金合同生效日次日起每日计算，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、公休日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

除管理费、托管费之外的前述第一款约定的其他费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入基金费用。

## 三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、基金合同生效前的相关费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

## 四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

#### 十四、对招募说明书本次更新部分的说明

本招募说明书（更新）依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》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 2018 年 6 月 30 日；
- 6、更新了基金的业绩部分，数据截止日期为 2018 年 6 月 30 日；
- 7、在“其他应披露事项”一章，列举了本基金自 2018 年 3 月 11 日至 2018 年 9 月 10 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 10 月 24 日