

申万菱信基金管理有限公司

申万菱信中证申万证券行业指数分级 证券投资基金更新招募说明书 (2020年第1号)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 2014 年 3 月 13 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。
- 本次招募说明书（更新）所载内容中基金管理人、相关服务机构信息截止日为 2020 年 7 月 24 日，基金托管人信息截止日为 2020 年 6 月 30 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2020 年 6 月 30 日（财务数据未经审计），其他信息截止日为 2019 年 10 月 31 日。

目 录

一、基金管理人	4
二、基金托管人	8
三、相关服务机构	9
四、基金的名称	40
五、基金的类型	40
六、基金的投资目标	41
七、基金的投资范围	41
八、基金的投资策略	41
九、业绩比较基准	42
十、风险收益特征	43
十一、基金投资组合报告	43
十二、基金的业绩	48
十三、基金的费用与税收	49
十四、对招募说明书本次更新部分的说明	51

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

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：赵鹏

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。

刘义伟先生，董事，硕士研究生，中级经济师。2003 年起从事金融相关工作，曾任职于中国工商银行总行资金运营部、金融市场部，申万宏源证券有限公司固定收益交易总部，现任申万宏源证券有限公司资产管理事业部总经理。

杨正平先生，董事，大学本科学历。1992 年起从事金融相关工作，曾任职于合肥市建设银行，申银万国证券股份有限公司，申万宏源证券有限公司安徽分公司，现任申万宏源证券有限公司零售客户事业部副总经理（主持工作）兼零售

客户事业部经纪业务总部总经理。

安田敬之先生，董事，日本籍，大学学历。1987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），曾任职于市场国际部、伦敦分行、海外资产管理事业部、受托财产企划部等，现任海外资产管理事业部常务执行役員。

福井雄介先生，董事，日本籍，大学学历。1996年4月至今任职于三菱UFJ信托银行株式会社，曾任职于高松分行、企业金融部、信用投资部、纽约分行、海外资产管理事业部等，现任资产管理事业部国际协同战略室室长。

汪涛先生，董事，硕士研究生。2003年起从事金融相关工作，曾任职于汇丰银行、新加坡华侨银行、渣打银行、宁波银行、永赢基金管理有限公司、平安基金管理有限公司等。2020年3月加入申万菱信基金管理有限公司，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。曾任职于中国农业银行总行、韩国釜山分行、万事达卡国际组织、FEXCO 国际商务、跨界创新平台（COIN）、汉德产业促进资本，现任社会价值投资联盟（深圳）常务理事兼创始秘书长。

白硕先生，独立董事，博士研究生。曾任职于沈阳航空工程学院、北京大学、中国科学院计算技术研究所、国家计算机网络信息安全管理中心、上海证券交易所等。现任上海丹渥智能科技有限公司董事长。

余卫明先生，独立董事，大学本科学历。曾任职于湖南省民政干部中等专业学校、中南工业大学，现任中南大学法学院教授。

2、监事会成员

刘震先生，监事会主席，博士研究生。1997年7月起从事金融相关工作，曾任职于申万宏源证券有限公司（原申银万国证券股份有限公司）研发中心、计统部、办公室，现任申万菱信基金管理有限公司监事会主席、党总支副书记，兼任申万菱信（上海）资产管理有限公司执行监事。

增田义之先生，监事，日本籍，硕士研究生。1989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），曾任职于资产运用部、股票运用部、指数战略运用部、受托财产企划部等，现任资产管理事业部部长。

葛诚亮先生，职工监事，硕士研究生。2011年2月加入申万菱信基金管理有限公司，从事风险管理工作，现任风险管理部负责人。

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，现任组织与人力资源部负责人。

3、高级管理人员

刘郎先生，相关介绍见董事会成员部分。

汪涛先生，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。

周小波先生，硕士研究生。2006 年起从事金融相关工作，曾任职于上海申银万国证券研究所有限公司、太平资产管理有限公司。2020 年 5 月加入申万菱信基金管理有限公司，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、现任基金经理

王赟杰先生，博士研究生。2011 年起从事金融相关工作，曾任职于海通期货、华鑫证券、海富通基金、中信建投证券等，2020 年 3 月加入申万菱信基金，现任申万菱信深证成指分级证券投资基金、申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金、申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金、申万菱信中小板指数证券投资基金（LOF）、申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金、申万菱信上证 50 交易型开放式指数发起式证券投资基金、申万菱信中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金、申万菱信中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。

龚丽丽女士，2017 年 12 月至 2020 年 7 月任本基金基金经理。

袁英杰先生，2015年1月至2017年12月任本基金基金经理。

俞诚先生，2015年12月至2017年12月任本基金基金经理。

张少华先生，2014年3月至2015年12月任本基金基金经理。

5、投资决策委员会委员名单

本委员会由以下人员组成：总经理、公司分管投资的副总经理、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、法律合规与审计部负责人、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：陈四清

注册资本：人民币 35,640,625.7089 万元

联系电话：010-66105799

联系人：郭明

(二) 主要人员情况

截至 2020 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2020年6月，中国工商银行共托管证券投资基金1094只。自2003年以来，本行连续十七年获得香港《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73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

(一) 场外发售机构

1、直销机构

申万菱信基金管理有限公司直销中心

住所：上海市中山南路 100 号 11 层

法定代表人：刘郎

电话：86-21-23261188

传真：86-21-23261199

联系人：陈晓琳

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) 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：陈四清

客户服务电话：95588

传真：010—66107738

网址：www.icbc.com.cn

(2) 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) 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：任德奇

联系人：曹榕

电话：021-58781234

客户服务电话：95559

网址：www.bankcomm.com

(4) 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市中山东一路 12 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：郑杨

传真：021-63230807

联系人：倪苏云、于慧

客户服务热线：95528

公司网站：www.spdb.com.cn

(5) 上海农村商业银行股份有限公司

注册地址：上海市黄浦区中山东二路 70 号

法定代表人：徐力

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)南京银行股份有限公司

注册地址：南京市玄武区中山路 288 号

办公地址：南京市白下区淮海路 50 号

法定代表人：胡升荣

传真：025-84544129

联系人：翁俊

客户服务电话：95302

网址：www.njcb.com.cn

(7)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：上海市静安区南京西路 768 号国泰君安大厦

法定代表人：贺青

电话：021-38676666

传真：021-38670666

客户服务热线：95521 / 4008888666

公司网站：www.gtja.com

(8)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，香港中环交易广场二期 18 楼

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

(9)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：0755-82133453

客户服务电话：95536

网址：www.guosen.com.cn

(10)招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福华一路 111 号

法定代表人：霍达

传真：0755-82944669

联系人：林生迎

客户服务热线：4008888111、95565

公司网站：www.newone.com.cn

(11)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：张佑君

电话：010-60838888

传真：010-60836029

联系人：顾凌

网址：www.cs.ecitic.com

(12)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 2-6 层

法定代表人：陈共炎

客户服务热线：4008888888

传真： 010-66568532

联系人： 邓颜

公司网址：www.chinastock.com.cn

(13)海通证券股份有限公司

注册地址： 上海市广东路 689 号

办公地址： 上海市广东路 689 号

法定代表人： 周杰

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

(14) 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： 杨玉成

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

(15)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： 李新华

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

(16) 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：黄炎勋

传真：0755-8282 5550

联系人：陈剑虹

统一客服电话：4008001001 95517

公司网站地址：www.essence.com.cn

(17) 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：张伟

联系人：庞晓芸

电话：025-83389999

传真：025-83387784

客服电话：95597 400-889-5597

网址：www.htsc.com.cn

(18) 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：姜晓林

客户服务电话：95548

网址: www.zxwt.com.cn

(19) 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: 0512-62601555

传真: 0512-62938812

客服电话: 95330

公司网址: www.dwzq.com.cn

(20) 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: 肖林

客服电话: 95321

公司网址: www.cindasc.com

(21) 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: 刘秋明

联系人: 刘晨、李芳芳

电话: 021-22169999

传真: 021-62151789

客户服务电话: 95525

公司网址: www.ebscn.com

(22) 中信证券华南股份有限公司

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：胡伏云

联系人：梁微

联系电话：020-88836999

传真：020-88836914

客户服务电话：95548

网址：www.gzs.com.cn

(23) 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 4008-918-918

传真：021-53686100-7008, 021-53686200-7008

网址：<https://www.shzq.com/>

(24) 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

(25) 浙商证券股份有限公司

注册地址：浙江省杭州市五星路201号

办公地址：浙江省杭州市五星路201号

邮政编码：310020

法定代表人：吴承根

传真：0571-87901955

客服电话：95345

网址：www.stocke.com.cn

(26)平安证券股份有限公司

住所：深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座第 22-25 层

办公地址：深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座第 22-25 层

法定代表人：何之江

客户服务电话：95511

传真：0755-82435367

网址：<http://stock.pingan.com>

(27)东莞证券股份有限公司

住所：广东省东莞市莞城区可园南路一号金源中心 30 楼

办公地址：广东省东莞市莞城区可园南路一号金源中心 22 楼

法定代表人：陈照星

客户服务电话：95328

传真：0769-22115712

网址：<http://www.dgzq.com.cn>

(28)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：028-86122528

网址: <http://www.hxl68.com.cn>

(29) 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: 李琦

联系人: 王怀春

客户服务电话: 4008-000-562

传真: 010-88085195

网址: <http://www.swhysc.com/index.jsp>

(30) 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: 0531-68889038

传真: 0531-68889001

客服电话: 95538

网址: www.zts.com.cn

(31) 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: <https://www.firstcapital.com.cn/>

(32)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: 王晓峰

联系人: 史江蕊

客服电话: 95335 4008895335

网址: www.avicsec.com

(33)西部证券股份有限公司

注册地址: 陕西省西安市新城区东大街 319 号 8 幢 10000 室

法定代表人: 徐朝晖

联系人: 梁承华

传真: 029-87406409

客户服务电话: 95582

网站: <http://www.west95582.com/jdw/index.html>

(34)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: 沈如军

客户服务电话: 4009101166

传真: (+86-10) 6505 1166

网址: www.cicc.com

(35)中山证券有限责任公司

注册地址: 深圳市南山区粤海街道蔚蓝海岸社区创业路 1777 号海信南方大厦 21 层、22 层

办公地址: 深圳市南山区粤海街道蔚蓝海岸社区创业路 1777 号海信南方大

厦 21 层、22 层

法定代表人：林炳城

电话：0755-82943755

传真：0755-82960582

客户服务电话：4001-022-011 95329

网址：www.zszq.com

(36) 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

(37) 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 028-86690021

传真号码：028-86695681

(38) 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：张海文

联系人：李慧灵

联系电话：010-85556100

传真：010-85556155

客户服务电话：400-898-9999 95390

网址：www.hrsec.com.cn

(39)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：岑妹妹

电话：027-87617017

传真：027-87618863

客服热线：95391

(40)太平洋证券股份有限公司

住所：云南省昆明市盘龙区北京路926号同德广场写字楼31楼

办公地址：云南省昆明市盘龙区北京路926号同德广场写字楼31楼

法定代表人：李长伟

客户服务电话：400-665-0999 95397

传真：010-88321819 0871-68898100

网址：www.tpyzq.com

(41)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 95325

传真：029-81887060

网址：www.kysec.cn

(42) 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

(43) 中国中金财富证券有限公司

住所：办公地址：深圳市福田区益田路 6003 荣超商务中心 A 座 18-21 层及
第 04 层 01. 02. 03. 05. 11. 12. 13. 15. 16. 18. 19. 20. 21. 22. 23 单元

法定代表人：高涛

客服电话：95532/4006008008

网址：<https://www.ciccwm.com/ciccwmweb/>

(44) 万和证券股份有限公司

注册地址：海口市南沙路 49 号通信广场二楼

办公地址：深圳市福田区深南大道 7028 号时代科技大厦 20 层西厅

法定代表人：冯周让

客服电话：4008-882-882

网址：www.wanhesec.com.cn/

(45) 中国银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：刘连舸

客服电话：95566

(46) 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：孙永祥

客服电话：95351

公司网址：www.xcsc.com

(47) 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：刘加海

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) 中信证券(浙江)有限责任公司

注册地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 588 号恒鑫大厦主楼 19、20 层

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 588 号恒鑫大厦主楼 19、20 层

法定代表人：沈强

联系人：丁思聪

联系电话：0571-87112510

客户服务电话：96598

传真：0571-85106383

网址：www.bigsun.com.cn

(49) 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

(50) 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

(51) 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

(52) 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，基金买卖网 www.jjmmw.com

(53) 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

(54) 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

(55) 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

(56)上海长量基金销售有限公司

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

(57)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

(58)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

(59)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

(60) 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

(61) 浦领基金销售有限公司

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

办公地址：北京市朝阳区望京浦项中心 A 座 9 层 04-08

法定代表人：聂婉君

联系人：李艳

联系电话：010-59497361

传真：010-64788016

客服电话：400-012-5899

网址：www.zscffund.com

(62) 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

(63) 一路财富（北京）基金销售有限公司

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：北京市海淀区宝盛里宝盛南路1号院奥北科技园国泰大厦9层

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/>

(64) 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

(65) 上海联泰基金销售有限公司

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>

(66)上海汇付基金销售有限公司

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

(67)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岗厦社区金田路 3088 号中洲大厦 3203A 单元

办公地址：深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路 3088 号中洲大厦 3203A 单元

法定代表人：刘鹏宇

联系人：刘勇

联系电话：0755-83999907-8814

客户服务电话：0755-83999907

传真：0755-83999926

网址: www.fujifund.cn

(68) 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

(69) 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

(70) 珠海盈米基金销售有限公司

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

(71) 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/>

(72) 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

(73) 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.hcjjjin.com

(74) 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：北京市朝阳区创远路 34 号院融新科技中心 C 座 17 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

(75) 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

(76) 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

客户服务电话：95177

网址：www.snjijin.com

(77) 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

(78) 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

App：挖财宝

(79) 上海有鱼基金销售有限公司

注册地址：上海自由贸易试验区浦东大道 2123 号 3 层 3E-2655 室

办公地址：上海市徐汇区桂平路 391 号 B 座 19 层

法定代表人：林琼

电话：021-60907379

传真：021-60907397

联系人：徐海峥

客服电话：021-60907378

网址：www.youyufund.com

(80) 玄元保险代理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区张杨路 707 号 1105 室

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区张杨路 707 号 1105 室

法定代表人：马永谔

联系人：卢亚博

电话：021-50701053

传真：021-50701053

客户服务电话：021-50701053

网址：http://www.xyinsure.com/kfit_xybx

(81) 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

(82) 北京植信基金销售有限公司

注册地址：北京市密云县兴盛南路 8 号院 2 号楼 106 室-67

办公地址：北京市朝阳区惠河南路盛世龙源 10 号

法定代表人：于龙

客户服务电话：4006-802-123

网址：www.zhixin-inv.com

(83) 大连网金基金销售有限公司

注册地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室

办公地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室

法定代表人：樊怀东

客户服务电话：4000-899-100

网址：<http://www.yibaijin.com/>

(84) 北京虹点基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号裙房 2 层 222 单元

办公地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号裙房 2 层 222 单元

法定代表人：郑毓栋

客户服务电话：4006180707

网址：www.hongdianfund.com

(85) 江苏汇林保大基金销售有限公司

注册地址：南京市高淳区经济开发区古檀大道 47 号

办公地址：江苏省南京市鼓楼区中山北路 105 号中环国际 1413 室

法定代表人：吴言林

客户服务电话：025-66046166

网址：<http://www.huilinbd.com>

(86) 奕丰基金销售有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入住深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场 A 座 17 楼 1704 室

法定代表人：TEO WEE HOWE

客户服务电话：400-684-0500

网址：www.ifastps.com.cn

(87) 北京唐鼎耀华基金销售有限公司

注册地址：北京市延庆县延庆经济开发区百泉街 10 号 2 栋 236 室

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街 19 号 A 座 1505 室

法定代表人：张冠宇

客户服务电话：400-819-9868

网址：www.tdyhfund.com

(88) 东方财富证券股份有限公司

注册地址：西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城 10 栋楼

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座东方财富大厦

法定代表人：陈宏

传真：021-23586860

客户服务电话：95357

网址：<http://www.18.cn>

(89) 上海华夏财富投资管理有限公司

注册地址：上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 2 楼 268 室

办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

法定代表人：毛淮平

联系人：张静怡

电话：010-88066326

传真：010-63136184

客户服务电话：400-817-5666

网址：www.amcfortune.com/

(90) 北京度小满基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区上地十街 10 号 1 幢 1 层 101

办公地址：北京市海淀区上地信息路甲 9 号奎科科技大厦

法定代表人：张旭阳

电话：010-61952703

传真：010-61951007

客户服务电话：95055-4

网址：www.baiyingfund.com/

(91) 北京新浪仓石基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期（西扩）N-1、N-2
地块新浪总部科研楼 5 层 518 室

办公地址：北京市海淀区西北旺东路 10 号院东区 3 号楼为明大厦 C 座

法定代表人：赵芯蕊

联系人：赵芯蕊

电话：010-62675768

传真：010-62676582

客户服务电话：010-62675369

网址：www.xincai.com

(92) 海银基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 8 号 402 室

办公地址：上海市浦东新区银城中路 8 号 4 楼

法定代表人：巩巧丽

客服电话：400-808-1016

公司网站：www.fundhaiyin.com

(二) 场内发售机构

1、本基金的场内发售机构为基金管理人直销中心和具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位（具体名单可在深交所网站查询）。

2、本基金募集结束前获得基金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。

(三) 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: 010-59378835

传真: 010-59378907

联系人: 任瑞新

三、出具法律意见书的律师事务所

名称: 上海市通力律师事务所

住所: 上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址: 上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人: 俞卫锋

电话: +86-21-31358666

传真: +86-21-31358600

联系人: 陈颖华

经办律师: 黎明、陈颖华

四、审计基金财产的会计师事务所

名称: 毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)

注册地址: 北京市东城区东长安街 1 号东方广场 2 座办公楼 8 层

办公地址: 上海静安区南京西路 1266 号恒隆广场二期 16 楼

法定代表人: 邹俊

电话: (010) 8508 5000

传真: (010) 8508 5111

联系人：虞京京

经办注册会计师：王国蓓、虞京京

四、基金的名称

申万菱信中证申万证券行业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均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%,年跟踪误差不超过 4%,实现对中证申万证券行业指数的有效跟踪。

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。

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,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,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

1、股票投资策略

本基金主要采用完全复制的方法进行投资,即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。

在标的指数成份股发生变动、增发、配股、分红等公司行为导致成份股的构成及权重发生变化时,由于交易成本、交易制度、个别成份股停牌或者流动性不足等原因导致本基金无法及时完成投资组合同步调整的情况下,基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合,追求尽可能贴近标的指数的表现。

(1) 组合构建策略

本管理人构建投资组合的过程主要分为三步：确定目标组合、确定建仓策略和逐步调整。

1) 确定目标组合：本基金管理人根据完全复制成份股权重的方法确定目标组合。

2) 确定建仓策略：本基金管理人根据对成份股流动性的分析，确定合理的建仓策略。

3) 逐步调整：通过完全复制法最终确定目标组合之后，本基金管理人在规定时间内采用适当的手段调整实际组合直至达到跟踪标的指数的要求。

(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；

③若个别成份股因停牌、流动性不足或法规限制等因素，使得基金管理人无法按照其所占标的指数权重进行购买时，基金管理人将综合考虑跟踪误差最小化和投资者利益，决定部分持有现金或买入相关的替代性组合。

2、股指期货投资策略

本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资。本基金投资股指期货将主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

九、业绩比较基准

业绩比较基准为： $95\% \times \text{中证申万证券行业指数收益率} + 5\% \times \text{银行同业存款利率}$ 。

本基金以中证申万证券行业指数为标的指数，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。

如果中证申万证券行业指数被停止编制或发布，或由其他指数替代（单纯更名除外），或由于指数编制方法等重大变更导致该指数不宜继续作为本基金的目标指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，基金管理人可以依据审慎原则，在充分考虑基金份额持有人利益及履行适当程序的前提下，更换本基金的标的指数、业绩比较基准和投资对象，并依据市场代表性、流动性、与原标的指数的相关性等诸多因素选择确定新的标的指数，而无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应与基金托管人协商一致后，报中国证监会备案并及时公告。

十、风险收益特征

本基金虽为股票型指数基金，但由于采取了基金份额分级的结构设计，不同的基金份额具有不同的风险收益特征。申万证券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；证券 A 份额，则具有预期风险低，预期收益低的特征；证券 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。

根据 2017 年 7 月 1 日施行的《证券期货投资者适当性管理办法》，基金管理人和销售机构已对本基金重新进行风险测评，风险评级行为不改变本基金的实质性风险收益特征，但由于风险等级分类标准的变化，本基金的风险等级表述可能有相应变化，具体风险评级结果应以基金管理人和销售机构提供的评级结果为准。

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 2020 年 6 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	3,240,168,489.06	93.06
	其中:股票	3,240,168,489.06	93.06
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	222,988,976.21	6.40
7	其他各项资产	18,767,717.49	0.54
8	合计	3,481,925,182.76	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,256,825.39	0.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,097.57	0.00

J	金融业	3,236,886,799.78	93.72
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,240,168,489.06	93.82

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	600030	中信证券	22,776,563.00	549,142,933.93	15.90
2	601688	华泰证券	15,737,596.00	295,866,804.80	8.57
3	600837	海通证券	21,635,953.00	272,180,288.74	7.88
4	601211	国泰君安	12,057,551.00	208,113,330.26	6.03
5	600999	招商证券	7,645,497.00	167,818,659.15	4.86
6	000166	申万宏源	23,978,993.00	121,093,914.65	3.51
7	000776	广发证券	7,872,974.00	111,166,392.88	3.22
8	600958	东方证券	9,522,954.00	90,372,833.46	2.62
9	601377	兴业证券	12,469,573.00	85,416,575.05	2.47
10	601788	光大证券	5,196,119.00	83,449,671.14	2.42

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

本基金本报告期末未投资股指期货。

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。

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 本基金投资的前十大证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查的情形。

本基金投资的前十大证券的发行主体除华泰证券（601688.SH）、国泰君安（601211.SH）、广发证券（000776.SZ）外，在报告编制日前一年内，没有收到公开谴责和处罚的情形。

本报告编制日前一年内，华泰证券股份有限公司由于未按规定履行客户身份识别义务、在代销“聚潮资产-中科招商新三板 I 期 A, B 专项资管计划”过程中，

存在使用未经报备的宣传推介材料的情形等多个违法违规事实而被中国人民银行、中国证券监督管理委员会及其派出机构分别处以罚款、责令改正。

本报告编制日前一年内,国泰君安证券股份有限公司由于作为富贵鸟股份有限公司公开发行 2014 年公司债券的承销机构和受托管理人,在尽职调查和受托管理过程中未严格遵守执业规范,未能勤勉尽责地履行相关责任而被中国证券监督管理委员会及其派出机构出具警示函。

本报告编制日前一年内,广发证券股份有限公司由于在担任中铁宝盈广发新三板特定资产管理计划财务顾问过程中,存在对相关项目尽职调查、投资决策、投后管理不够审慎,内部业务授权管控不足等问题、以及对境外子公司风控缺失等违规事实而被中国证券监督管理委员会及其派出机构分别出具警示函、限制增加新业务种类 6 个月等行政监管措施。

本基金采用完全复制方式被动跟踪标的指数,上述证券为本基金业绩基准的成分股,所以不影响基金管理人对该证券的投资决策。

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	183,746.34
2	应收证券清算款	288,783.89
3	应收股利	-
4	应收利息	39,754.82
5	应收申购款	18,255,432.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,767,717.49

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. 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
自基金合同生 效起至 2014 年 12 月 31 日	158.97%	2.29%	187.36%	2.41%	-28.39%	-0.12%
2015 年	-29.75%	3.42%	-24.20%	3.52%	-5.55%	-0.10%
2016 年	-16.97%	2.09%	-17.24%	2.13%	0.27%	-0.04%
2017 年	-11.08%	0.99%	-11.55%	1.02%	0.47%	-0.03%
2018 年	-23.55%	1.76%	-24.68%	1.81%	1.13%	-0.05%
2019 年	40.49%	2.07%	43.16%	2.11%	-2.67%	-0.04%
2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	-5.77%	1.97%	-5.47%	2.01%	-0.30%	-0.04%
自基金合同生 效起至 2020 年 6 月 30 日	35.94%	2.21%	62.52%	2.27%	-26.58%	-0.06%

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

申万菱信中证申万证券行业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

(2014年3月13日至2020年6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、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 0.22% 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

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，需根据与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定向中证指数有限公司的指定账户支付指数许可使用基点费。通常情况下，指数许可使用基点费按前一日的基金资产净值的万分之二（贰个基点）的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应付的指数许可使用基点费

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基点费每日计算，逐日累计，按季支付。标

的指数许可使用基点费的收取下限为每季人民币 50,000 元，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基金标的指数许可使用基点费划付指令，经基金托管人复核后于每一季度结束后的 10 个工作日内将上季度标的指数许可使用基点费，按照指数使用许可协议的约定进行支付。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基点费的计算方法、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基点费。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、标的指数许可使用基点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》、《公开募集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，对基金管理人、基金托管人、相关服务机构等

信息进行更新，主要更新的内容如下：

- 1、更新基金管理人的部分信息；
- 2、更新基金托管人的部分信息；
- 3、更新相关服务机构的部分信息；
- 4、更新本基金的投资组合报告，数据截止日期为 2020 年 6 月 30 日；
- 5、更新本基金的业绩部分，数据截止日期为 2020 年 6 月 30 日；
- 6、更新“其他应披露事项”。

以上内容仅为摘要，须与本《招募说明书》(更新)全文所载之详细资料一并阅读。