

---

# 申万菱信基金管理有限公司

## 申万菱信智能驱动股票型证券投资基金 招募说明书第一次 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 2018 年 6 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 12 月 13 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2018 年 9 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.....	6
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.....	30
八、基金的投资策略.....	31
九、业绩比较基准.....	34
十、风险收益特征.....	35
十一、基金投资组合报告.....	35
十二、基金的业绩.....	39
十三、基金的费用与税收.....	40
十四、对招募说明书本次更新部分的说明.....	42

## 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

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：赵鹏

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信托银行株式会社执行官、海外资产管理事业部部长。

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、跨界创新平台（COIN）创始人兼CEO、汉德产业促进资本董事总经理，现任社会价值投资联盟（深圳）常务理事兼创始秘书长。

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，现任申万宏源集团股份有限公司和申万宏源证券有限公司党委委员、申万宏源证券有限公司副总经理，兼任投资交易事业部总经理。

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、受托财产企划部，现任资产管理事业部部长。

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，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

卢扬先生，硕士研究生。2004年起从事金融相关工作，曾任中信建投证券行业分析师，中金公司行业分析师，上投摩根基金行业研究员、基金经理助理、基金经理。2016年11月加入申万菱信基金管理有限公司，现任权益投资部负责人，申万菱信新经济混合型证券投资基金、申万菱信行业轮动股票型证券投资基金、申万菱信智能驱动股票型证券投资基金基金经理。

张朋先生，硕士研究生，2012年起从事金融相关工作，曾任职于东方证券，光大证券。2015年1月加入申万菱信基金管理有限公司，曾任行业研究员，基金经理助理，现任申万菱信智能驱动股票型证券投资基金基金经理。

#### 5、投资决策委员会委员名单

投资决策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。

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

### 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

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分，总行设在北京。经国务院批准，中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于 2009 年 1 月 15 日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡，成为国内网点最多、业务辐射范围最广，服务领域最广，服务对象最多，业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外，中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉，每年位居《财富》世界 500 强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行，中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念，坚持审慎稳健经营、可持续发展，立足县域和城市两大市场，实施差异化竞争策略，着力打造“伴你成长”服务品牌，依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品，致力为广大客户提供优质的金融服务，与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行，经验丰富，服务优质，业绩突出，2004 年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007 年中国农业银行通过了美国 SAS70 内部控制审计，并获得无保留意见的 SAS70 审计报告。自 2010 年起中国农业银行连续通过托管业务国际内控标准（ISAE3402）认证，表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设，品牌声誉进一步提升，在 2010 年首届“‘金牌理财’TOP10 颁奖盛典”中成绩突出，获“最佳托管银行”奖。2010 年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。2012 年荣获第十届中国财经风云榜“最佳资产托管银行”称号；2013 年至 2017 年连续荣获上海清算所授予的“托管银行优秀奖”和中央国债登记结算有限责任公司授予的“优秀托管机构奖”称号；2015 年、2016 年荣获中国银行业协会授予的“养老金业务最佳发展奖”称号；2018 年荣获中国基金报授予的公募基金 20 年“最佳基金托管银行”奖。

中国农业银行证券投资基金托管部于 1998 年 5 月经中国证监会和中国人民银行批准成立，2014 年更名为托管业务部/养老金管理中心，内设综合管理部、业务管理部、客户一部、客户二部、客户三部、客户四部、风险合规部、产品研发与信息技术部、营运一部、营运二部、市场营销部、内控监管部、账户管理部，拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

## 2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工近 240 名，其中具有高级职称的专家 30 余名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有 20 年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。

## 3、基金托管业务经营情况

截止到 2018 年 9 月 30 日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共 419 只。

# 三、相关服务机构

## 一、基金份额发售机构

### 1、直销机构

名称：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](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：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](http://www.bankcomm.com)

**(4) 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

**(5) 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)

**(6) 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](http://www.cmbc.com.cn)

**(7) 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

**(8) 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)

**(9) 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)

**(10) 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)

**(11) 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)

**(12) 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)

**(13) 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)

**(14) 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：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](http://www.htsec.com)

**(15) 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)

**(16) 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)

**(17) 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：孙永祥

客服电话：95351

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

**(18) 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)

**(19) 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)

**(20) 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)

**(21) 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：周健男

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)

**(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](http://www.962518.com)

**(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](http://www.glsc.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：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)

**(28) 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)

**(29) 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)

**(30) 名称：上海华信证券有限责任公司**

住所：上海市黄浦区南京西路 399 号明天广场 22 楼

办公地址：上海市黄浦区南京西路 399 号明天广场 22 楼

法定代表人：郭林

客户服务电话：4008205999

传真：021-68776977-8951

网址：www.shhxzq.com

**(31) 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

**(32) 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

**(33) 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

**(34) 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：岑妹妹

电话：027-87617017

传真：027-87618863

客服热线：4008005000

**(35) 名称：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)

**(36) 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](http://8.jrj.com.cn)

**(37) 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

**(38) 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

**(39) 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，基金买卖网 www.jjmmw.com

**(40) 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

**(41) 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

**(42) 名称：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

**(43) 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：单丙焱

传真：021-20691861

客服电话：400-089-1289

公司网站：www.erichfund.com

**(44) 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

**(45) 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

**(46) 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

**(47)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)

**(48)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)

**(49)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)

**(50) 名称：一路财富（北京）基金销售股份有限公司**

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/>

**(51) 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)

**(52) 名称：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>

**(53)名称：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](http://www.chinapnr.com)

**(54)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)

**(55)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)

**(56) 名称：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](http://www.yingmi.cn)

**(57) 名称：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/>

**(58) 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)

**(59) 名称：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

**(60) 名称：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

**(61) 名称：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

**（62）名称：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

**（63）名称：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（上海泰和经济开发区）

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

**（64）名称：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

**(65) 名称：泰诚财富基金销售（大连）有限公司**

注册地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号

办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号

法定代表人：林卓

联系人：张晓辉

电话：0411-88891212

传真：0411-84396536

客户服务电话：4000-411-001

网址：www.haojiyoujijin.com

**(66) 名称：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

**(67) 名称：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)

**（68）名称：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](http://www.zhixin-inv.com)

**（69）名称：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/>

**（70）名称：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](http://www.hongdianfund.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销售本基金或变更上述销售机构，并及时公告。具体请以各发售机构实际情况为准。

## 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：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：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

电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：赵钰

经办注册会计师：薛竞、赵钰

## 四、基金的名称

本基金名称：申万菱信智能驱动股票型证券投资基金

## 五、基金的类型

本基金的运作方式：契约型开放式

本基金类别：股票型证券投资基金

## 六、基金的投资目标

本基金通过重点投资于与新一轮科技进步和智能化相关的优质企业，把握全球科技进步和智能化革命带来的系统性投资机会，在控制风险并保持基金资产良好的流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。

## 七、基金的投资范围

本基金的投资范围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）。

本基金在履行适当程序后可以参与融资业务。

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。

本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于智能驱动主题相关的股票资产的比例不低于非现金基金资产的 80%；其中，每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金以及股票期权合约需缴纳的现金保证金后，本基金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

本基金将重点围绕我国经济周期动力机制与发展规律，研究我国国民经济发展过程中的结构化特征，捕捉新一轮科技进步和智能化相关的投资机会，采取自上而下的资产配置策略、行业配置策略与自下而上的个股选择策略相结合，精选智能驱动主题相关行业中具有核心竞争优势的个股，力求获取稳健的超额回报。

### 1、资产配置策略

本基金将根据主要的经济信号指标对国内外经济形势进行分析，判断经济所处的经济周期阶段、景气循环状况和未来运行趋势，基于投资时钟理论的资产配置模型等数量工具，分析和比较股票、债券等市场和不同金融工具的风险收益特征，估计各子资产类的相关性矩阵，并以此为依据，对基金整体资产配置比例进行确定。

### 2、股票投资策略

在经历了以 PC 为主要载体的互联网革命和智能手机为主要载体的移动互联网革命之后，我们预计全球正迎来新一轮智能化革命，智能化革命将深刻改变生产制造和人类生活的方方面面，即将到来的 5G 建设也会大大加速本轮智能化革命的进程。本基金将按照智能化进程的先后，择机重点投资于 5G 基础设施建设及智能制造、智能安防、智能汽车、智能家居、智能医疗、物联网、智慧生活以及其他智能化场景带来的投资机会。

#### （1）智能驱动主题界定

智能驱动是指由智能化、信息化、自动化、联网化等技术推动的，对于人类生产和生活各方面的改善和提升。具体而言智能驱动主题包含两个主要部分：

一是智能技术本身的建设和发展，包括信息网络基础设施建设、智能终端和联网终端、人工智能等各类智能应用的发展等。

二是智能技术和各个垂直行业的结合，由此带来各垂直行业生产方式的变化，生产效率和生产品质的提升，以及生产自动化和智能化的提升，如智能制造，智慧医疗等。智能技术和人们的生活相结合，则带来人们生活便利性和智能化的提升，如智能驾驶、智能家居等。

如果未来由于智能化在人类生产和生活各方面进度的深化和范围的扩张，或者政策变化等原因导致本基金智能驱动主题的覆盖范围发生变动，基金管理人可以在履行适当程序后适时对相关定义和股票池构建标准进行补充和修订。

### （2）行业配置策略

本基金采取自上而下行业配置和自下而上的个股选择相结合的配置策略。在本基金所覆盖的上述行业中，智能化进程在不同时期的不同行业是会有先后之别的，本基金会追踪智能化在不同行业的具体进程，特定时期重点受益的行业会优先考虑，同时结合行业估值水平、盈利增长前景、资本市场认知程度和预期差等做综合考量，确定不同时期的最优行业配置。

### （3）个股选择策略

作为一支智能化革命指向性的基金，本基金将首先考察相关个股在智能化大潮中所处的位置，那些为智能化革命提供基础设施建设、拥有先进的技术能够推动智能化发展的公司，以及在各垂直细分行业，能够受益于智能化进程的公司，或者是随着智能化进展而诞生诸多创新应用的公司将被优先考虑纳入本基金股票池。

公司治理和管理层的驱动力也是重要考量因素，股权结构是否合理，管理层是否有意愿为股东持续创造价值，管理层的尽责程度和战略规划能力、团队执行力的优劣，企业内部控制的制订和执行情况，企业对于新技术、新商业模式的理解和反应能力等。

企业拥有的战略资源和竞争优势，对于企业能否取得成功也有重大影响，这些包括企业的技术水平、研发能力、市场份额、客户结构等；从竞争格局角度看，良好的竞争格局是很大的加分项，本基金将尽量避免投资竞争格局不断恶化的公司。

稳健的财务水平是个股选择的重要参考，公司应具备基本稳定的收入和利润增长，

波动正常的毛利率和费用率水平，清晰的现金流流向，并且各项财务数据具备一定的可预测性。

最后，在智能化革命的背景下，理想的标的应该具备清晰的成长性和足够大的成长空间，拥有明确的成长路径。

### 3、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。

### 4、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。

### 5、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。

### 6、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。

#### 7、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。

#### 8、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。

#### 9、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，基金管理人将对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。

#### 10、国债期货投资策略

本基金将按照相关法律法规的规定，根据风险管理的原则，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，基金管理人将对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： $85\% \times \text{中证 800 指数收益率} + 15\% \times \text{中证综合债指数收益率}$

本基金选择中证 800 指数和中债综合指数分别作为基金股票资产和债券、货币市场工具等其他资产的业绩比较基准。中证 800 指数由中证 500 和沪深 300 指数成份股组成，综合反映中国 A 股市场大中小市值公司的股票价格表现。该指数样本对沪深市场的覆盖度高，具有良好的市场代表性。中债综合指数的选样债券的信用类别覆盖全面，期限构成宽泛。选用上述业绩比较基准能够忠实反映本基金的风险收益特征。

如果今后法律法规发生变化，或者证券市场中有其他代表性更强或者更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，与基金托管人协商一致，并按监管部门要求履行适当程序以后变更业绩比较基准并及时公告，该等变更无需召开基金份额持有人大会。如果本基金业绩比较基准所参照的指数在未来不再发布或市场上出现其他代表性更强、更加适用于本基金的业绩比较基准的指数时，本基金管理人可以在与基金托管人协商一致，并按相关监管部门要求履行相关手续后，依据维护基金份额持有人合法权益的原则，选取相似的或可替代的指数作为业绩比较基准的参照指数，而无需召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在指定媒介公告。

## 十、风险收益特征

本基金是股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

## 十一、基金投资组合报告

本投资组合报告所载数据截止日为 2018 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
----	----	-------	--------

			产的比例(%)
1	权益投资	40,840,750.49	32.45
	其中：股票	40,840,750.49	32.45
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	40,000,000.00	31.78
	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	44,984,262.45	35.74
7	其他各项资产	46,440.21	0.04
8	合计	125,871,453.15	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	32,479,446.01	25.93
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	2,325,692.00	1.86
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	-	-
J	金融业	5,397,017.48	4.31
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	638,595.00	0.51
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	40,840,750.49	32.61

## 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	600183	生益科技	423,490.00	4,459,349.70	3.56
2	000333	美的集团	97,300.00	4,093,411.00	3.27
3	002916	深南电路	43,400.00	3,094,854.00	2.47
4	300258	精锻科技	218,900.00	2,902,614.00	2.32
5	601799	星宇股份	53,600.00	2,806,496.00	2.24
6	601318	中国平安	39,500.00	2,705,750.00	2.16
7	600036	招商银行	87,692.00	2,691,267.48	2.15
8	002475	立讯精密	171,600.00	2,646,072.00	2.11
9	000963	华东医药	55,400.00	2,325,692.00	1.86
10	603228	景旺电子	36,926.00	2,008,035.88	1.60

## 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持有股指期货。

##### **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持有股指期货。

#### **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**

本基金本报告期末未持国债期货。

##### **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的情形。本基金投资的前十名证券的发行主体除招商银行(600036.SH)外，在报告编制日前一年内没有受到公开谴责和处罚的情形。

中国银行保险监督管理委员会在2018年5月4日发布了“中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表”。经查明，招商银行股份有限公司由于内控管理严重违反审慎经营规则等多个违法违规事实而受到中国银行保险监督管理委员会的行政处罚，处罚款6570万元，没收违法所得3.024万元。

本基金管理人认为上述警示不会对招商银行的投资价值构成影响，因此也不影响基金管理人招商银行的投资决策。

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	14,101.44
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	29,333.28
5	应收申购款	3,005.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	46,440.21

### 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	000333	美的集团	4,093,411.00	3.27	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：

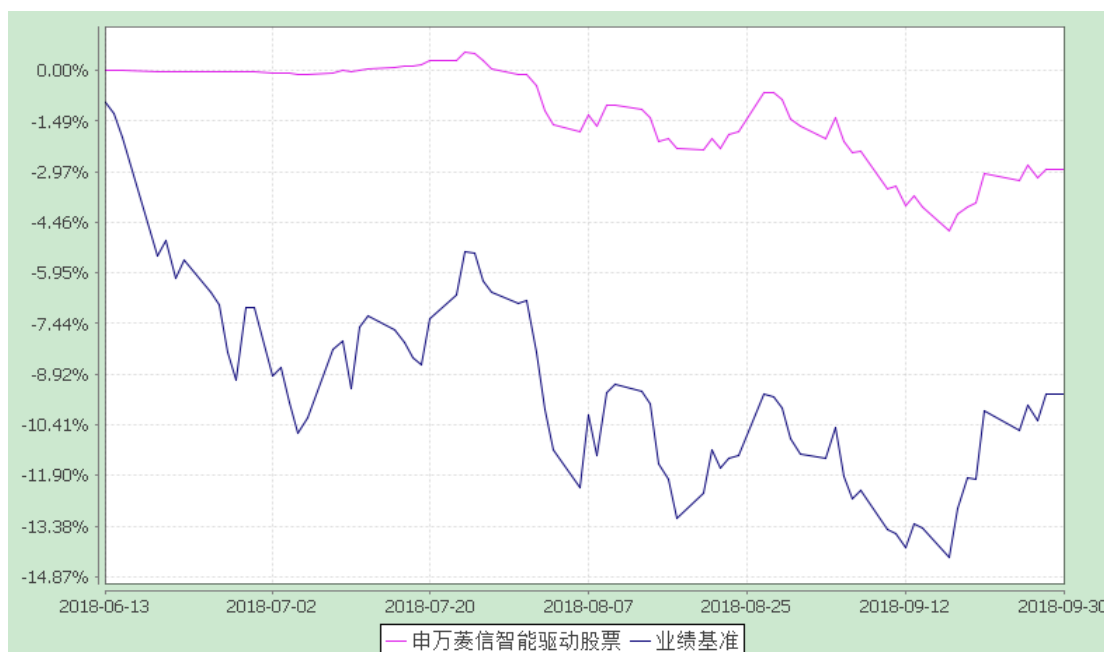
阶段	基金份额净值增长率①	基金份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2018年6月13日（基金合同生效日）	-2.89%	0.35%	-9.52%	1.17%	6.63%	-0.82%

至 2018 年 9 月 30 日						
----------------------	--	--	--	--	--	--

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

申万菱信智能驱动股票型证券投资基金  
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2018年6月13日至2018年9月30日)



注：1) 自基金合同生效以来，本基金运作未满一年。

2) 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、休息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、休息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条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，按费用实际支出金额列入基金当期费用。

### 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项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

鉴于基金管理人为本基金的利益投资、运用基金财产过程中，可能因法律法规、税收政策的要求而成为纳税义务人，就归属于基金的投资收益、投资回报和/或本金承担纳税义务。因此，本基金运营过程中由于上述原因发生的增值税等税负，仍由本基金财产承担，届时基金管理人与基金托管人可能通过本基金财产账户直接缴付，或划付至基金管理人账户并由基金管理人依据税务部门要求完成税款申报缴纳。投资人在收取本基金中归属于投资人份额的投资收益时，获得的金额为基金管理人扣除相应增值税、附加税等税负后的不含税金额。

如在本基金运作过程中，相关税收法律、法规被修订或替代，上述纳税义务及申报缴纳方式应以修订或替代后的有效税收法律、法规为准。

## 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 2018 年 9 月 30 日；
- 6、更新了基金的业绩部分，数据截止日期为 2018 年 9 月 30 日；
- 7、更新了风险揭示的部分信息；
- 8、在“其他应披露事项”一章，列举了本基金自 2018 年 6 月 13 日至 2018 年 12 月 13 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。