

# 申万巴黎沪深 300 价值指数证券投资基金 招募说明书（第二次更新）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 2010 年 2 月 11 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》、《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 2011 年 3 月 10 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2010 年 12 月 31 日（财务数据未经审计）。

## 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：上海市淮海中路 300 号香港新世界大厦 40 楼（200021）

法定代表人：姜国芳

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：壹亿五仟万元人民币

存续期限：三十年

联系电话：-86-21-23261188

联系人：王菲萍

股本结构：申银万国证券股份有限公司持有 67% 的股权，三菱 UFJ 信托银行株式会社持有 33% 的股权。

### (二) 主要人员情况

#### (1) 董事会成员

姜国芳先生，董事长，1957 年出生。高级经济师，工商管理硕士。1980 年至 1984 年任职于中国人民银行上海市分行，1984 年至 1992 年任职于中国工商银行上海市分行组织处，1992 年至 1996 年任职于上海申银证券有限公司，董事副总经理、党委副书记。1996 年至 2004 年 2 月任申银万国证券股份有限公司执行副总裁，兼申银万国（香港）有限公司董事长。

毛剑鸣先生，董事，1969 年出生。美国肯特州立大学金融博士毕业。1992 年至 1994 年在阿克隆大学任经济系助教，1995 年至 1999 年在肯特州立大学金融系讲师，1999 年至 2002 年任 HFR 资产管理公司董事总经理。2002 年至 2007 年任富兰克林邓普顿基金集团副总裁及高级投资策略师。

杜平先生，董事，1963 年出生。经济师，法学硕士。1989 年至 1990 年在湖北省武汉

市政府政策研究室任科员、副主任科员，1990 年底至 1993 年初在湖北省武汉市政府办公厅任副市长秘书、主任科员。1993 年初至 1998 年初在交通银行总行秘书处、条法处先后担任副行长秘书、行长秘书、党组书记。1998 年起任交通银行深圳分行副行长，2000 年 7 月任交通银行新加坡分行行长。2003 年 10 月起加盟申银万国证券股份有限公司，任公司副总裁。

陆文清先生，董事，1958 年出生。高级经济师，硕士。1981 年至 1983 年任职于中国工商银行上海分行，1983 年至 1986 年任职于中国驻加蓬大使馆经参处。1986 年至 1990 年任职于中国工商银行上海信托投资公司，1990 年至 1996 年任上海申银证券公司总裁助理兼国际业务总部总经理，1996 年至今任职于申银万国证券股份有限公司，现任公司副总裁。

Max Diulius 先生，董事，1963 年出生。巴黎工商联合会商学院毕业；现任法国巴黎资产管理有限公司新兴市场与开发部主管；曾任法国巴黎银行固定收益基金经理，法国巴黎银行并购融资、法国巴黎银行公司发展部和资产偿还部主管等。

毛应樑先生，独立董事，1937 年出生。1961 年至 1985 年任职于中国人民银行，曾任中国人民银行上海分行副行长。1985 年至 1991 年任中国工商银行上海分行行长、党委副书记、书记，1991 年至 1999 年任中国人民银行上海市分行行长、党组书记。1999 年至 2003 年任上海证券交易所理事会理事长、顾问。

王大东先生，独立董事，1955 年出生。1984 年至 1988 年任中国驻法国大使馆二等秘书，1991 年至 1993 年国家行政学院筹建办公室处长，1994 年至 2000 年供职于法国雷诺汽车公司北京代表处，先后任副代表和首席代表。2001 年至 2004 年在法国雷诺卡车公司北京代表处任首席代表，2004 年至 2007 年任法国阿尔斯通（中国）投资公司副总裁，2007 年 9 月至今担任欧洲宇航防务集团中国公司副总裁。

袁恩桢先生，独立董事，1938 年出生。曾任社会科学院经济研究所研究室主任、所长，现任上海市经济学会会长、上海社会科学院经济研究所顾问。

赵霄洛先生，独立董事，1950 年出生。曾任职于司法部香港中国法律服务有限公司、香港何耀棣律师事务所、康达律师事务所。现任北京众鑫律师事务所上海分所主任、律师。

## **(2) 监事会成员 c**

刘鸿儒先生，监事，1930 年出生。全国政协经济委员会副主任，教授，博士生导师。1959 年在莫斯科大学经济系研究生毕业，获副博士学位，回国后，先后任中国人民银行的处长、局长、农业银行副行长、中国人民银行副行长、国家经济体制改革委员会副主任、中国证监会首任主席。

Jean Audibert 先生，监事，1951 年出生。1975 年加入法国巴黎银行，先后在科威特、新加坡、韩国等地工作。1996 年至 2001 年任法国巴黎银行总部国际贸易服务部门负责人。2001 年至 2005 年任法国巴黎银行总部现金管理业务负责人。2005 年至 2008 年任新韩巴黎资产信托管理有限公司总裁兼 CEO。2009 年 1 月至今，任法国巴黎资产管理有限公司亚洲新兴市场主席。

王厚谊先生，监事，申万菱信基金管理有限公司行政管理总部负责人。1951 年出生，研究生学历。自 1978 年起任职上海船舶研究设计院；1994 年任职万国房地产开发公司任办公室主任；1997 年任职申银万国证券股份有限公司人力资源总部薪酬部经理。2004 年 1 月加盟本公司。

### **(3) 高级管理人员**

毛剑鸣先生，总裁，相关介绍见董事会成员部分。

过振华先生，副总裁，1964 年出生，工商管理硕士。1983 年至 1990 年任职于中国工商银行上海分行，1990 年至 1993 年任上海申银证券公司国际业务部经理。1997 年至 1999 年任申万泛达投资管理（亚洲）有限公司联席总裁，1999 年至 2004 年 2 月任申银万国证券股份有限公司国际业务总部副总经理。2004 年 3 月至 2005 年 2 月任申万巴黎基金管理有限公司督察长。

### **(4) 督察长**

来肖贤先生，1969 年出生，经济学硕士；曾任本公司监察稽核总部副总经理；在本公司任职之前，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。

### **(5) 基金经理**

魏立先生，特许金融分析师(CFA)，英国帝国理工大学管理学硕士。1997 年起任上海华虹 NEC 电子有限公司工程师，自 2004 年起从事金融工作，先后任职于东方证券股份有限公司研究所、富国基金管理有限公司。2006 年 7 月加入本公司，任投资管理总部高级分析师，2007 年 9 月至 2009 年 6 月任申万巴黎新经济混合型证券投资基金基

金经理助理。2009年6月起任申万巴黎消费增长股票型证券投资基金基金经理,2009年9月至2010年11月任申万巴黎新经济混合型证券投资基金基金经理,2010年2月起同时任申万巴黎沪深300价值指数型证券投资基金基金经理。

张少华先生,复旦大学数量经济学硕士。自1999年起从事金融工作,1999年7月至2003年1月在申银万国证券股份有限公司任职,2003年1月加入申万巴黎基金管理有限公司筹备组。2004年2月加盟申万巴黎基金管理有限公司,历任风险管理总部高级风险分析师、风险管理总部副总监,2009年3月起任风险管理总部总监,2010年2月起任投资管理总部副总监,申万巴黎沪深300价值指数型证券投资基金基金经理,2010年10月起同时任申万巴黎深证成指分级证券投资基金基金经理。

#### **(6) 投资决策委员会组成**

投资决策委员会由下述执行委员组成:总裁、副总裁、投资总监、基金经理代表、组合投资经理代表。委员会执行委员在会议期间对所决策事项有投票权。

非执行委员有下列人员组成:研究负责人、宏观及策略分析师、基金经理、组合投资经理。非执行委员对需决策事项可发表观点,但不参与决策事项的投票表决。

本公司总裁担任投资决策委员会主席,投资总监担任投资决策委员会会议召集人。

本公司董事长、督察长和风险管理总监和首席金融工程师有权列席投资决策委员会的任何会议。

#### **(7) 上述人员之间不存在近亲属关系。**

## **二、基金托管人**

名称:中国工商银行股份有限公司

住所:北京市西城区复兴门内大街55号

办公地址:北京市西城区复兴门内大街55号

法定代表人:姜建清

成立时间:1984年1月1日

注册资本:人民币334,018,850,026元

联系人:赵会军

联系电话：010-66105799

### 三、相关服务机构

#### (一) 基金份额发售机构

##### 1、直销机构

申万菱信基金管理有限公司直销中心

申万菱信基金管理有限公司

注册地址：中国上海淮海中路 300 号 40 层

法定代表人：姜国芳

电话：+86 21 23261188

传真：+86 21 23261199

联系人：浦剑悦 陈景新

客户服务中心电话：+86 21 962299 ,或 400 880 8588

##### 2、代销机构

###### (1) 名称：中国工商银行股份有限公司

法定代表人：姜建清

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

联系人：刘业伟

客户服务电话：95588

传真：+86 10 66107914

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

###### (2) 名称：中国建设银行股份有限公司

法定代表人：郭树清

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

联系人：王琳

客户服务电话：95533

传真：(010) 66275654

网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

**(3) 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：项俊波

传真：+86-10-85109219

客户服务电话：95599

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

**(4) 名称：交通银行股份有限公司**

住所：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市银城中路 188 号

法定代表人：胡怀邦

电话：(021) 58781234

传真：(021) 58408842

联系人：曹榕

客户服务电话：95559

网址：<http://www.bankcomm.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、虞谷云

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：北京市西城区西长安街 88 号

法定代表人：董文标

客服电话：95568

联系人：陆红霞

传真：010-83914283

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

**(7) 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

法定代表人：孔丹

客服电话：95558

联系人：金蕾

传真：+86-10-65550827

网址：<http://bank.ecitic.com>

**(8) 名称：华夏银行股份有限公司**

法定代表人：吴建

办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

联系人：郑鹏

客户服务电话：95577

传真：010-85238680

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

**(9) 名称：深圳发展银行股份有限公司**

注册办公所：广东省深圳市罗湖区深南东路 5 0 4 7 号

法定代表人：法兰克纽曼 (Frank . N . Newman)

联系人：姜聃

传真：(0755) 82080406

客户服务电话：95501

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

**(10) 名称：上海农村商业银行股份有限公司**

注册地址：上海市浦东新区浦东大道 981 号



法定代表人：胡平西

客服电话：021-962999

联系人：吴海平

传真：021-50105124

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

**(11) 名称：南京银行股份有限公司**

注册地址：南京市白下区淮海路 50 号

办公地址：南京市白下区淮海路 50 号

法定代表人：林复

传真：025-84544129

联系人：翁俊

客户服务电话：4008896400

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

**(12) 名称：申银万国证券股份有限公司**

注册地址：上海市常熟路 171 号

法定代表人：丁国荣

传真：+86 21 54035333

联系人：邓寒冰

客服电话：021-962505

公司网站：[www.sw2000.com.cn](http://www.sw2000.com.cn)

**(13) 名称：中信建投证券有限责任公司**

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：张佑君

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)

**(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：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

**(15) 名称：国泰君安证券股份有限公司**

注册地址：上海市浦东新区商城路 618 号

办公地址：上海浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 层

法定代表人：祝幼一

传真：021-38670161

客户服务热线：4008888666

公司网站：www.gtja.com

**(16) 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：+86 755 82943636

联系人：林生迎

客户服务热线：4008888111、95565

公司网站：www.newone.com.cn

**(17) 名称：中国银河证券股份有限公司**

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：顾伟国

客户服务热线：400 8888 888

传真：+86 010-66568116

联系人：田薇

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

**(18) 名称：广发证券股份有限公司**

住所：广东省天河北路 183 号大都会广场 43 楼

办公地址：广东广州天河北路大都会广场 18、19、36、38、41 和 42 楼

法定代表人：王志伟

电话：95575 或致电各营业网点

传真：(020) 87555305

联系人：黄岚

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

**(19) 名称：光大证券股份有限公司**

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：徐浩明

联系人：刘晨、李芳芳

客户服务电话：400 8888 788、10108998

传真：021-68815009

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

**(20) 名称：东方证券股份有限公司**

注册地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层-29 层

法定代表人：王益民

联系人：吴宇

传真：021-63326173

客户服务电话：+86-21-95503

东方证券网站：[www.dfzq.com.cn](http://www.dfzq.com.cn)

**(21) 名称：国元证券股份有限公司**

注册地址：安徽省合肥市寿春路 179 号

法定代表人：凤良志

传真：0551-2207965

联系人：李蔡

客户服务电话：400-8888-777 , 95578

网址：www.gyzq.com.cn

**(22) 名称：信达证券股份有限公司**

注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人：张志刚

联系人：唐静

客服电话：400-800-8899

公司网址：www.cindasc.com

**(23) 名称：中航证券有限公司**

注册地址：江西省南昌市抚河北路291号

法定代表人：杜航

联系人：戴蕾

客服电话：0791 - 6768763

网址：www.scstock.com

**(24) 名称：国信证券股份有限公司**

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦6楼

法定代表人：何如

联系人：齐晓燕

传真：0755-82133302

客户服务电话：95536

网址：www.guosen.com.cn

**(25) 名称：长江证券股份有限公司**

注册地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

联系人：李良

传真：027-85481900

客户服务电话：95579 或 4008-888-999

网址：[www.95579.com](http://www.95579.com)

**(26) 名称：国联证券股份有限公司**

注册地址：江苏省无锡市县前东街 168 号

法定代表人：雷建辉

联系人：徐欣

传真：0510-82830162

客户服务电话：4008885288

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

**(二) 基金注册登记机构**

申万菱信基金管理有限公司

注册地址：上海淮海中路 300 号，香港新世界大厦 40 层

法定代表人：姜国芳

电话：+86 21 23261188

传真：+86 21 23261199

联系人：陈景新

**(三) 律师事务所和经办律师**

律师事务所：通力律师事务所

注册地址：上海市银城中路 68 号，时代金融中心 19 楼

负责人：韩炯

电话：+86 21 31358666

传真：+86 21 31358600

经办律师：秦悦民、王利民

**(四) 会计师事务所和经办注册会计师**

会计师事务所：普华永道中天会计师事务所有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1233 号汇亚大厦 1604-1608 室

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：张鸿

经办注册会计师姓名：汪棣、张鸿

## 四、基金的名称

本基金名称：申万巴黎沪深 300 价值指数型证券投资基金

## 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%，实现对沪深 300 价值指数的有效跟踪。

## 七、基金的投资范围和投资对象

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括沪深300价值指数成份股、备选成份股、新股（一级市场初次发行或增发）、现金或者到期日在一年以内的政府债券等。其中，沪深300价值指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

本基金还可投资于法律法规或监管机构允许基金投资的其他金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

## 八、基金的投资策略

本基金主要采取完全复制法进行投资，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但在因特殊情况（如流动性不足）导致无法获得足够数量的股票时，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，追求尽可能贴近目标指数的表现。

特殊情况主要是指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基金无法及时完成投资组合的同步调整，基金管理人需要采用其他合理的投资方法构建尽可能贴近目标指数的基金组合。

在法律法规许可时，基金管理人可运用股票期货、期权等相关金融衍生工具，以提高投资效率，更好达到本基金的投资目标。基金管理人运用上述金融衍生工具必须是出于追求基金充分投资、减少交易费用、降低跟踪误差的目的，不得将之应用于投机目的或用作杠杆工具放大基金的投资。本基金投资于股票期货、期权等相关金融衍生工具必须经过投资决策委员会的批准。

## 九、业绩比较基准

本基金以沪深 300 价值指数为标的指数。

业绩比较基准为： $95\% \times \text{沪深 300 价值指数增长率} + 5\% \times \text{银行同业存款利率}$ 。

## 十、基金投资组合报告

本投资组合报告所载数据截止日为 2010 年 12 月 31 日，本报告中所列财务数据未经审计。

### 一、基金投资组合报告

#### 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	588,795,811.97	92.56

	其中：股票	588,795,811.97	92.56
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	46,857,581.93	7.37
6	其他各项资产	463,354.95	0.07
7	合计	636,116,748.85	100.00

## 2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	80,058,511.87	12.62
C	制造业	118,251,164.14	18.64
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	3,307,100.16	0.52
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	1,692,081.75	0.27
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	40,799,062.04	6.43
C7	机械、设备、仪表	65,139,962.19	10.27
C8	医药、生物制品	5,806,921.20	0.92



C99	其他制造业	1,506,036.80	0.24
D	电力、煤气及水的生产和供应业	23,696,543.42	3.74
E	建筑业	14,041,608.18	2.21
F	交通运输、仓储业	24,138,520.58	3.81
G	信息技术业	10,283,759.30	1.62
H	批发和零售贸易	3,924,826.45	0.62
I	金融、保险业	302,585,877.76	47.71
J	房地产业	7,622,693.90	1.20
K	社会服务业	2,651,416.37	0.42
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	1,540,890.00	0.24
	合计	588,795,811.97	92.83

### 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	601318	中国平安	759,514	42,654,306.24	6.72
2	600036	招商银行	2,803,343	35,910,823.83	5.66
3	601328	交通银行	4,718,739	25,858,689.72	4.08
4	600016	民生银行	5,120,753	25,706,180.06	4.05
5	600000	浦发银行	1,951,716	24,181,761.24	3.81
6	601166	兴业银行	950,969	22,870,804.45	3.61
7	600030	中信证券	1,578,216	19,869,739.44	3.13
8	601088	中国神华	747,673	18,474,999.83	2.91
9	601601	中国太保	712,601	16,318,562.90	2.57
10	601169	北京银行	988,275	11,305,866.00	1.78

#### 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名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名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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 8 投资组合报告附注

8.1 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。

8.2 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。

#### 8.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	267,988.34
2	应收证券清算款	46,120.16
3	应收股利	-
4	应收利息	8,460.64
5	应收申购款	140,785.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	463,354.95

#### 8.4 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。

#### 8.5 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。

## 十一、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	基金份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	-	-
最近一个月	-0.24%	1.21%	-0.02%	1.18%	-0.22%	0.03%
最近三个月	4.24%	1.71%	4.64%	1.70%	-0.40%	0.01%
最近六个月	8.43%	1.50%	8.45%	1.48%	-0.02%	0.02%
自基金合同生效起至今	-16.40%	1.52%	-12.50%	1.56%	-3.90%	-0.04%

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

申万巴黎沪深 300 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的历史走势对比图

（2010 年 2 月 11 日至 2010 年 12 月 31 日）



注：1) 自基金合同生效日至本报告期末，本基金运作时间未满一年；

2) 根据本基金合同，本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括沪深 300 价值指数成份股、备选成份股、新股（一级市场初次发行或增发）、现金或者到期日在一年以内的政府债券等。其中，沪深 300 价值指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的 90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。在本基金合同生效日起 3 个月内，达到上述比例限制。基金合同生效满 3 个月时，本基金已达到上述比例限制。

## 十二、基金的费用与税收

### （一）与基金运作有关的费用

#### 1、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）基金份额持有人大会费用；
- （5）基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- （6）基金的证券交易费用；

(7) 基金的银行汇划费用；

(8) 基金的指数使用费

(9) 按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金资产中扣除。

## 2、基金管理人的管理费计提方法、计提标准和支付方式

基金管理费按前一日基金资产净值的 0.65% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.65\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

## 3、基金托管人的托管费计提方法、计提标准和支付方式

基金托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数，其中：}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金资产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述 1、基金费用的种类中第 3 - 8 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

## (二) 与基金销售有关的费用

### 1、认购费用

本基金份额的认购采取金额认购的方式，认购费率最高不超过认购金额的 1%，在认购时收取并由投资者承担，按认购金额分段设定如下：

认购金额(元)	认购费率
---------	------

100 万以下	1%
100 万（含）~ 500 万	0.6%
500 万（含）~ 1000 万	0.2%
1000 万（含）以上	1000 元/笔

## 2、申购费用

本基金份额的申购费率最高不超过申购金额的 1.2%，在申购时收取并由投资者承担，按申购金额分段设定如下：

申购金额(元)	申购费率
100 万以下	1.2%
100 万（含）~ 500 万	0.8%
500 万（含）~ 1000 万	0.2%
1000 万（含）以上	1000 元/笔

## 3、赎回费用

本基金份额的赎回费率最高不超过 0.5%，按持有时间分段设定如下：

持有时间	赎回费率
1 年以下	0.5%
1 年（含 1 年）至 2 年	0.25%
2 年以上（含 2 年）	0%

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

### （三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

#### **（四）费用调整**

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率。

调高基金管理费率、基金托管费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率、基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 2 日在至少一种指定媒体和基金管理人网站上公告。

#### **（五）基金的税收**

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

### 十三、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》、《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、更新了基金经理的部分信息；
- 2、变更了基金管理人的名称及股权结构；
- 3、变更了基金托管人的部分信息；
- 4、变更了代销机构的部分信息；
- 5、更新了投资组合报告，数据截止日期为 2010 年 12 月 31 日；
- 6、更新了基金的业绩部分，数据截止日期为 2010 年 12 月 31 日；

7、在“其他应披露事项”一章，列举了本基金自 2010 年 9 月 1 日至 2011 年 3 月 10 日发布的有关公告。



## 十四、其它应披露事项

自 2010 年 9 月 1 日至 2011 年 3 月 10 日，与本基金和本基金管理人有关的公告如下：

1、2010 年 9 月 3 日，刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》的本公司关于恢复对旗下基金持有的“深发展 A”与“中国平安”股票进行市价估值的公告。

2、2010 年 9 月 4 日，刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》的本公司关于旗下基金对长期停牌的股票变更估值方法的提示性公告。

3、2010 年 9 月 16 日，刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》的本公司关于旗下开放式基金新增国联证券股份有限公司为代销机构并实施申购（含定期定额投资）费率优惠的公告。

4、2010 年 9 月 17 日，刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》的本公司关于恢复对旗下基金持有的“佛山照明”股票进行市价估值的公告。

5、2010 年 9 月 29 日，刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》的本公司关于旗下部分开放式基金继续参加中国农业银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告。

6、2010 年 9 月 30 日，刊登于《中国证券报》和《证券时报》的本基金招募说明书第一次更新（摘要）。

7、2010 年 9 月 30 日，刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》的本公司关于恢复对旗下基金持有的“赛马实业”股票进行市价估值的公告。

8、2010 年 10 月 14 日，刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》的本公司关于旗下基金对长期停牌的股票变更估值方法的提示性公告。

9、2010 年 10 月 27 日，刊登于《中国证券报》和《证券时报》的本基金 2010 年第三季度报告。

10、2010 年 10 月 27 日，刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》的本公司关于运用自有资金申购旗下收益宝货币市场基金的公告。

11、2010 年 11 月 1 日，刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》的本公司关于运用自有资金申购旗下收益宝货币市场基金的公告。

12、2010 年 11 月 2 日，刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》的本公司关于恢复对旗下基金持有的“中航重机”股票进行市价估值的公告。

13、2010年11月4日，刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》的本公司关于运用自有资金申购旗下收益宝货币市场基金的公告。

14、2010年11月9日，刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》的本公司关于旗下基金对长期停牌的股票变更估值方法的提示性公告。

15、2010年12月24日，刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》的本公司关于旗下开放式基金新增华夏银行股份有限公司为代销机构并实施申购（含定期定额投资）费率优惠的公告。

16、2010年12月30日，刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》的本公司关于旗下开放式基金继续参加深圳发展银行开展基金申购费率优惠活动的公告。

17、2010年12月30日，刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》的本公司关于旗下部分开放式基金继续参加交通银行开展的网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告。

18、2010年12月30日，刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》的本公司关于旗下部分开放式基金参加中国工商银行开展的“2011倾心回馈”基金定投优惠活动的公告。

19、2010年12月31日，刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》的本公司关于调整在交通银行定期定额投资旗下部分开放式基金起点金额的公告。

20、2011年1月4日，刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》的本公司关于旗下开放式基金2010年度最后一个交易日基金资产净值和基金份额净值的公告。

21、2011年1月20日，刊登于《中国证券报》和《证券时报》的本基金2010年第四季度报告。

22、2011年2月10日，刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》的本公司关于开通中国工商银行网上直销交易并实施申购费率优惠的公告。

23、2011年2月25日，刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》的本公司关于旗下开放式基金新增安信证券股份有限公司为代销机构并实施网上交易申购费率优惠的公告。

24、2011年3月4日，刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》的本公司关于股权变更及公司更名的公告。

25、2011年3月7日，刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》的本公司关于旗下开放式基金参加光大证券股份有限公司开展的网上定期定额申购费率优惠活动的公告。

26、2011年3月7日，刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》的本公司关于提请投资者及时更新客户身份基本信息及更新已过期身份证明文件的公告。

27、2011年3月9日，刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》的本公司关于旗下开放式基金新增中国民族证券有限责任公司为代销机构的公告。

**签署日期：2011年3月11日**

**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**

**2011年3月28日**