

**申万菱信沪深 300 价值指数证券投资基金**  
**2011 年半年度报告**  
**2011 年 6 月 30 日**

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

报告送出日期：二〇一一年八月二十五日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2011 年 8 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

1	重要提示及目录.....	2
1.1	重要提示 .....	2
1.2	目录 .....	3
2	基金简介 .....	5
2.1	基金基本情况.....	5
2.2	基金产品说明.....	5
2.3	基金管理人和基金托管人.....	5
2.4	信息披露方式.....	6
2.5	其他相关资料.....	6
3	主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1	主要会计数据和财务指标.....	6
3.2	基金净值表现.....	7
4	管理人报告.....	8
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 .....	9
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	10
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明 .....	10
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	11
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	11
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	11
5	托管人报告.....	12
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....	12
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 ...	12
5.3	托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	12
6	半年度财务会计报告（未经审计） .....	12
6.1	资产负债表.....	12
6.2	利润表 .....	14
6.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4	报表附注 .....	15
7	投资组合报告.....	28
7.1	期末基金资产组合情况.....	28
7.2	期末按行业分类的股票投资组合 .....	29
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	30
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	32
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	34
7.6	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 .....	34
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 .....	34
7.8	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 .....	34
7.9	投资组合报告附注.....	34

8	基金份额持有人信息.....	35
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	35
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	35
9	开放式基金份额变动.....	35
10	重大事件揭示.....	35
10.1	基金份额持有人大会决议.....	35
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	35
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	36
10.4	基金投资策略的改变.....	36
10.5	报告期内改聘会计师事务所情况.....	36
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	36
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	36
10.8	其他重大事件.....	38
11	影响投资者决策的其他重要信息.....	39
12	备查文件目录.....	40
12.1	备查文件目录.....	40
12.2	存放地点.....	40
12.3	查阅方式.....	40

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	申万菱信沪深300价值指数证券投资基金
基金简称	申万菱信沪深300价值指数
基金主代码	310398
交易代码	310398
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年2月11日
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
报告期末基金份额总额	893,101,586.34份

### 2.2 基金产品说明

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。
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。
业绩比较基准	沪深300价值指数收益率 × 95% + 银行同业存款利率 × 5%
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		申万菱信基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露	姓名	来肖贤	赵会军
	联系电话	021-23261188	010-66105799

负责人	电子邮箱	service@swsmu.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008808588	95588
传真		021-23261199	010-66105798
注册地址		上海市淮海中路 300 号香港新世界大厦 40 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		上海市淮海中路 300 号香港新世界大厦 40 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200021	100140
法定代表人		姜国芳	姜建清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.swsmu.com
基金半年度报告备置地点	申万菱信基金管理有限公司 中国工商银行

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	申万菱信基金管理有限公司	上海市淮海中路 300 号香港新世界大厦 40 层

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-2,490,369.83
本期利润	-4,000,263.99
加权平均基金份额本期利润	-0.0049
本期加权平均净值利润率	-0.57%
本期基金份额净值增长率	1.67%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2011 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-133,675,337.53
期末可供分配基金份额利润	-0.1497
期末基金资产净值	759,426,248.81
期末基金份额净值	0.850
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2011 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-15.00%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、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/申购或交易基金的各项费用（例如：申购费、赎回费等），计入认/申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。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	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
过去一个月	0.35%	1.17%	-0.69%	1.15%	1.04%	0.02%
过去三个月	-4.28%	1.08%	-5.11%	1.08%	0.83%	0.00%
过去六个月	1.67%	1.17%	0.89%	1.18%	0.78%	-0.01%
过去一年	10.25%	1.35%	9.41%	1.34%	0.84%	0.01%
自基金成立起至今	-15.00%	1.41%	-11.72%	1.43%	-3.28%	-0.02%

注：本基金的业绩基准指数=95%×沪深 300 价值指数收益率+5%×银行同业存款利率。其中：沪深 300 价值指数作为衡量股票投资部分的业绩基准，银行同业存款利率作为衡量非股票投资部分的业绩基准。

本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，计算方式如下：

$\text{benchmark}(0) = 1000;$

$\% \text{benchmark}(t) = 95\% \times (\text{沪深 300 价值指数}(t) / \text{沪深 300 价值指数}(t-1) - 1) + 5\% \times \text{银行同业存款利率} / 365;$

$\text{benchmark}(t) = (1 + \% \text{benchmark}(t)) \times \text{benchmark}(t-1);$

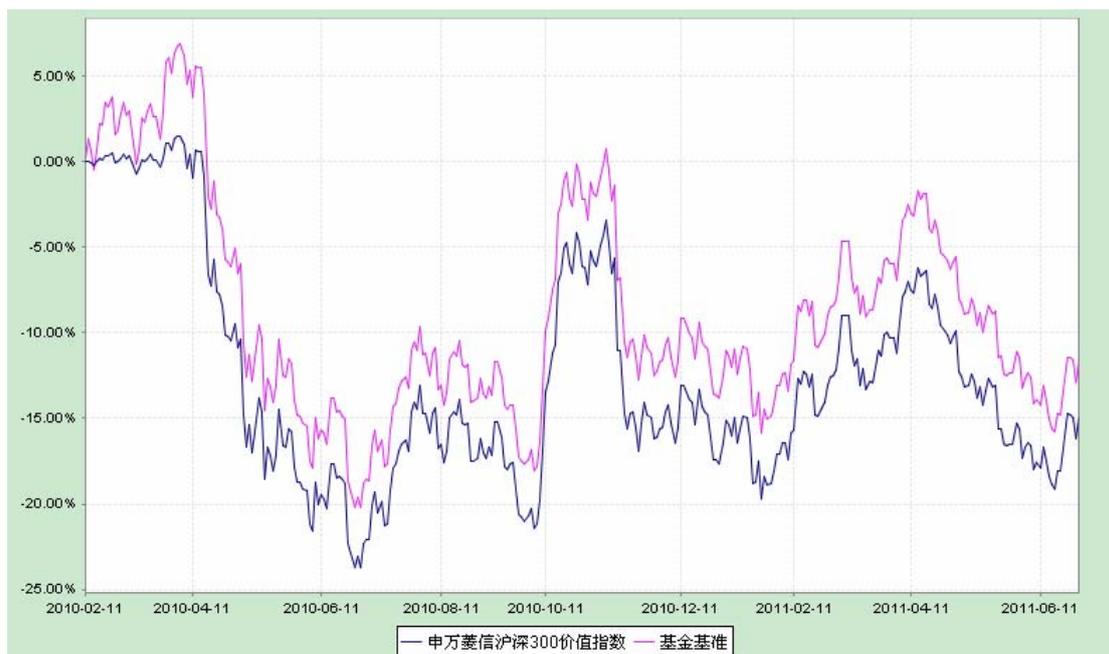
其中  $t=1, 2, 3, \dots$ 。

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

申万菱信沪深 300 价值指数证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2010 年 2 月 11 日至 2011 年 6 月 30 日)



注：根据本基金基金合同，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。

## 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

申万菱信基金管理有限公司原名申万巴黎基金管理有限公司，是由国内大型综合类券商申银万国证券股份有限公司和三菱 UFJ 信托银行株式会社共同设立的一家中外合资基金管理公司。公司成立于 2004 年 1 月 15 日，注册地在中国上海，注册资本为 1.5 亿元人民币。其中，申银万国证券股份有限公司持有 67% 的股份，三菱 UFJ 信托银行株式会社持有 33% 的股份。

公司成立以来业务增长迅速，在北京、广州先后建立了分公司。截至 2011 年 6 月 30 日，公司旗下管理了包括股票型、混合型、债券型和货币型在内的 12 只开放式基金，形成了完整而丰富的产品线。公司旗下基金管理资产规模超过 120 亿元，客户数超过 170 万户。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		

张少华	本 基 金 基 金 经 理	2010-02-12	-	12 年	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(现名申万菱信)筹备组。2004 年 2 月加盟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、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，申万菱信沪深 300 价值指数型证券投资基金基金经理，2010 年 10 月起同时任申万菱信深证成指分级证券投资基金基金经理。2011 年 6 月起同时任申万菱信量化小盘股票型证券投资基金基金经理。
魏立	本 基 金 基 金 经 理	2010-02-11	2011-04-18	7 年	特许金融分析师(CFA)，上海交通大学工学学士，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 月任申万菱信新经济混合型证券投资基金基金经理助理。2009 年 6 月起任申万菱信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 月任申万菱信新经济混合型证券投资基金基金经理。2010 年 2 月至 2011 年 4 月任申万菱信沪深 300 价值指数型证券投资基金基金经理。

注：1、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。  
2、任职日期和离任日期均指公司作出决定之日。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》及其配套法规的规定，严格遵守基金合同约定，本着诚实信用、勤勉尽责等原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。

本基金投资运作符合法律法规和基金合同的规定，信息披露及时、准确、完整；本基金资产与本基金管理人与公司资产之间严格分开；没有发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为。在基金资产的管理运作中，无任何损害基金持有人利益的行为，并通过稳健经营、规范运作、规避风险，保护了基金持有人的合法权益。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

我司于 2004 年年底管理两只开放式基金开始，就着手讨论多基金公平交易问题。2004 年年底我司颁布了关于旗下基金交易情况的内部管理规则，包括《关于基金投资交叉交易行为的管理规则》、《关于基金投资公平交易行为的管理规则》、《标准交易指引》等，并且多次予以修订。原则上我司禁止日内多基金之间的反向交易，要求严格执行多基金日内的公平交易。

依据中国证监会 2008 年 3 月 20 日颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，我司已经完善了公平交易、异常交易等相关制度的修订，并建立系统以有效执行相关内容（包括建立了多组合同向交易和反向交易价差分析模块，并不断完善异常交易检查模块）。

依据要求，本期我司对于旗下多个组合进行了两两之间的公平交易检查，未发现可能导致不公平交易和利益输送的行为。

为确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严格禁止并切实防范利益输送行为，我司一方面不断优化投资决策和研究流程，强化内部风险控制，另一方面强化对投资管理人员行为规范和职业操守的日常教育培训，并加强投资管理人员个人及直系亲属投资行为的申报管理。

我司建立并实施了严格的投资授权制度、投资备选库管理制度和集中交易制度，来切实规范基金经理投资决策行为。首先，基金经理只能在授权的范围内，依据投资策略会议决定的投资策略，结合投资决策委员会及分析师的资产及行业或板块配置的建议进行操作，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序；第二，基金经理只能投资纳入其管理基金的股票备选库中的股票，而且对于我司内部严格定义的重大投资决策，必须经投资决策委员会讨论备案后方可实施；第三，所有的投资指令必须通过集中交易室执行，集中交易室与投资部门相隔离。交易部必须确保日内公平交易的合规执行，执行结果须于当日报风险管理部独立检查。在上述基础上，我司内部控制部门（风险管理部和监察稽核部）还将通过对投资组合各项合规性指标的每日风险检查提示，以及对投资、研究、交易等全流程的独立的监察稽核，督促落实以上制度的措施，并促进投资运作的规范性。

#### 4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

根据投资风格划分，我司旗下没有与本基金相似的投资组合。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

无。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

操作上，基金主要着眼于控制净值表现和业绩基准的偏差幅度。从实际运作效果来看，每日基金收益率的差和业绩基准的差控制在较小的区间。这得益于良好的仓位管理和个股（工商银行作为托管行不能投资）替代策略。期间工商银行涨幅为 9.58%，远远跑赢基准指数，为替代策略带来一定难度。今年以来年化跟踪误差和去年相比略有下降，目前控制在 1% 以内，达到契约的要求。实际运作结果观察，本报告期内基金净值小数位 3 位的计算方法、

成分股分红、工商银行作为权重靠前的成分股不能投资是贡献基金跟踪误差的主要来源。

作为被动投资的基金产品，沪深 300 价值指数基金将继续坚持既定的指数化投资策略，以严格控制基金相对目标指数的跟踪偏离为投资目标，追求跟踪误差的最小化。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2011 年上半年沪深 300 价值指数期间表现为 0.87%，基金业绩基准表现为 0.89%，基金净值期间表现为 1.67%，领先业绩基准 0.78%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2011 年上半年，沪深 A 股市场维持震荡格局。通胀能否得到有效控制，经济增长速度究竟会以怎样的情景放缓，对此市场分歧较大。大部分投资者选择了估值合理的行业和个股进行防御，而去年涨幅较大的小盘股一度调整空间较大。期间 B 股市场数次出现单日暴跌走势，也一定程度上影响了 A 股投资者。

目前情况观察，上半年经济增长稳中微降，数据略超出一致预期。但是在经历六七月份通胀洪峰之后，下半年通胀数据是否能够有效下降还是会出现反复还需要观察。但是，下半年通胀下降应是大概率事件。随着通胀同比数据的放缓，预计货币政策收紧的力度和频率将同步放缓。如果经济继续保持良好的增长态势，市场的整体估值就有可能出现企稳回升。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人、本基金托管人和本基金聘请的会计师事务所参与本基金的估值流程，上述各方不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人按照有关法规确定的原则进行估值，将导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上的，即就拟采用的相关估值模型、假设及参数的适当性征求本基金托管人和本基金聘请的会计师事务所的意见。本基金聘请的会计师事务所对相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。

本基金管理人设立基金资产估值委员会，负责根据法规要求，尽可能科学、合理地制定估值政策，审议批准估值程序，并在特定状态下就拟采用的相关估值模型、假设及参数的适当性进行确认，以保护基金份额持有人的利益。

基金资产估值委员会由本基金管理人的总裁、分管副总裁、投资总监、基金会计主管、监察稽核总部和风险管理总部负责人组成。其中，代任总裁姜国芳先生，在资产管理和基金管理领域，拥有 15 年的高级管理人员经验。分管副总裁过振华先生，拥有 7 年的基金公司高级管理人员经验。代理投资总监施海仙女士，拥有 12 年的基金公司研究和投资管理经验。基金运营总部副总监李濮君女士，拥有 11 年的基金会计经验。监察稽核总部总监王菲萍女士，拥有 7 年的基金合规管理经验。风险管理总部副总监王瑾怡女士，拥有 6 年的基金风险管理经验。

基金经理不参与决定本基金估值的程序。本公司已与中央国债登记结算有限责任公司签订协议，采用其提供的估值数据对银行间债券进行估值。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内，本基金实现的可分配收益为-133,675,337.53 元，份额净值为 0.850 元，无

可分配收益。根据《基金合同》的约定及本基金的实际运作情况，本基金未进行收益分配。

## 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2011 年上半年，本基金托管人在对申万菱信沪深 300 价值指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2011 年上半年，申万菱信沪深 300 价值指数证券投资基金的管理人——申万菱信基金管理有限公司在申万菱信沪深 300 价值指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，申万菱信沪深 300 价值指数证券投资基金未进行利润分配。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对申万菱信基金管理有限公司编制和披露的申万菱信沪深 300 价值指数证券投资基金 2011 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：申万菱信沪深 300 价值指数证券投资基金

报告截止日：2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	50,822,317.40	46,751,037.22
结算备付金		19,698.76	106,544.71
存出保证金		196,259.57	267,988.34
交易性金融资产	6.4.7.2	708,797,504.11	588,795,811.97
其中：股票投资		708,797,504.11	588,795,811.97

基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	46,120.16
应收利息	6.4.7.5	7,766.43	8,460.64
应收股利		1,088,891.50	-
应收申购款		170,658.76	140,785.81
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		761,103,096.53	636,116,748.85
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2011年6月30日</b>	<b>上年度末 2010年12月31日</b>
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		603,974.92	809,159.53
应付管理人报酬		396,959.88	356,057.90
应付托管费		91,606.12	82,167.23
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	351,798.89	265,518.00
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	232,507.91	337,301.75
负债合计		1,676,847.72	1,850,204.41
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	893,101,586.34	759,068,852.00
未分配利润	6.4.7.10	-133,675,337.53	-124,802,307.56
所有者权益合计		759,426,248.81	634,266,544.44
负债和所有者权益总计		761,103,096.53	636,116,748.85

注：报告截止日 2011 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.850 元，基金份额总额 893,101,586.34 份。

## 6.2 利润表

会计主体：申万菱信沪深 300 价值指数证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010 年 2 月 11 日(基 金合同生效日)至 2010 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>-299,380.37</b>	<b>-187,873,492.90</b>
1.利息收入		192,020.77	1,093,632.69
其中：存款利息收入	6.4.7.11	171,308.51	711,403.55
债券利息收入		490.04	1,693.48
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		20,222.22	380,535.66
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		905,705.14	-14,775,420.79
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-8,691,622.27	-20,020,369.36
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	270,116.36	48,421.32
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	9,327,211.05	5,196,527.25
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-1,509,894.16	-174,453,122.25
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	112,787.88	261,417.45
<b>减：二、费用</b>		<b>3,700,883.62</b>	<b>3,690,336.85</b>
1. 管理人报酬		2,252,076.07	1,999,261.57
2. 托管费		519,709.87	461,368.07
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	656,926.30	1,036,699.19
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	272,171.38	193,008.02
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-4,000,263.99</b>	<b>-191,563,829.75</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-4,000,263.99</b>	<b>-191,563,829.75</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：申万菱信沪深 300 价值指数证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	759,068,852.00	-124,802,307.56	634,266,544.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-4,000,263.99	-4,000,263.99
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	134,032,734.34	-4,872,765.98	129,159,968.36
其中：1. 基金申购款	263,318,644.14	-19,458,888.11	243,859,756.03
2. 基金赎回款	-129,285,909.80	14,586,122.13	-114,699,787.67
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	893,101,586.34	-133,675,337.53	759,426,248.81
项目	上年度可比期间 2010 年 2 月 11 日（基金合同生效日）至 2010 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	925,168,028.22	-	925,168,028.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-191,563,829.75	-191,563,829.75
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-87,251,662.67	-465,690.62	-87,717,353.29
其中：1. 基金申购款	51,801,942.23	-5,656,003.18	46,145,939.05
2. 基金赎回款	-139,053,604.90	5,190,312.56	-133,863,292.34
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	837,916,365.55	-192,029,520.37	645,886,845.18

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：姜国芳，主管会计工作负责人：过振华，会计机构负责人：李濮君

### 6.4 报表附注

#### 6.4.1 基金基本情况

申万菱信沪深 300 价值指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2009]第 1191 号核准,由申万菱信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和本基金基金合同负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 925,091,640.13 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2010)第 041 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,本基金基金合同于 2010 年 2 月 11 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 925,168,028.22 份基金份额,其中认购资金利息折合 76,388.09 份基金份额。本基金的基金管理人为申万菱信基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和本基金基金合同的有关规定,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%。本基金的业绩基准指数=95%× 沪深 300 价值指数收益率+5%× 银行同业存款利率。

本财务报表由本基金的基金管理人申万菱信基金管理有限公司于 2011 年 8 月 25 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金基金合同和中国证监会允许的如财务报表附注 6.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2011 年 01 月 01 日至 2011 年 06 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2011 年 06 月 30 日的财务状况以及 2011 年 01 月 01 日至 2011 年 06 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本报告期,本基金未发生会计差错更正事项。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107 号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。

(2)基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20%的个人所得税,暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入,由上市公

司在向基金派发股息、红利时暂减按 50%计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20%代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
活期存款	50,822,317.40
定期存款	-
其他存款	-
合计	50,822,317.40

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	788,601,389.61	708,797,504.11	-79,803,885.50
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	788,601,389.61	708,797,504.11	-79,803,885.50

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

##### 6.4.7.4 买入返售金融资产

###### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

###### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

##### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2011 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	7,758.42
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	8.01
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-
合计	7,766.43

#### 6.4.7.6 其他资产

无余额。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	351,798.89
银行间市场应付交易费用	-
合计	351,798.89

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,341.63
预提费用	193,396.69
其他应付款	37,769.59
合计	232,507.91

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	759,068,852.00	759,068,852.00
本期申购	263,318,644.14	263,318,644.14
本期赎回（以“-”号填列）	-129,285,909.80	-129,285,909.80
本期末	893,101,586.34	893,101,586.34

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

## 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-52,225,831.06	-72,576,476.50	-124,802,307.56
本期利润	-2,490,369.83	-1,509,894.16	-4,000,263.99
本期基金份额交易产生的变动数	-9,196,072.60	4,323,306.62	-4,872,765.98
其中：基金申购款	-18,283,119.90	-1,175,768.21	-19,458,888.11
基金赎回款	9,087,047.30	5,499,074.83	14,586,122.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-63,912,273.49	-69,763,064.04	-133,675,337.53

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
活期存款利息收入	162,121.57
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	4,242.51
其他	4,944.43
合计	171,308.51

## 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
卖出股票成交总额	169,336,049.91
减：卖出股票成本总额	178,027,672.18
买卖股票差价收入	-8,691,622.27

## 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	3,442,606.40
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,172,000.00
减：应收利息总额	490.04
债券投资收益	270,116.36

## 6.4.7.14 衍生工具收益

无。

## 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
股票投资产生的股利收益	9,327,211.05
基金投资产生的股利收益	-
合计	9,327,211.05

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
1. 交易性金融资产	-1,509,894.16
——股票投资	-1,509,894.16
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-1,509,894.16

**6.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
基金赎回费收入	110,760.36
转换费收入	2,027.52
合计	112,787.88

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2、本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分组成，其中赎回费总额的 25% 归入转出基金的基金资产。

**6.4.7.18 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
交易所市场交易费用	656,926.30
银行间市场交易费用	-
合计	656,926.30

**6.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2011年1月1日至2011年6月30日
审计费用	34,712.18
信息披露费	158,684.51
指数使用费	69,294.69
银行汇划费	480.00
银行间帐户维护费	9,000.00
合计	272,171.38

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

根据申万菱信基金管理有限公司于 2011 年 3 月 4 日发布的公告, 经 2010 年度第二次股东会审议通过, 报中国证监会批准(证监许可[2011]106 号), 原公司外方股东法国巴黎资产管理有限公司将所持有的申万巴黎基金管理有限公司全部 33% 的股权转让给三菱 UFJ 信托银行株式会社。变更后的股东及持股比例分别为: 申银万国证券股份有限公司: 67%; 三菱 UFJ 信托银行株式会社: 33%。股权正式转让后, 三菱 UFJ 信托银行株式会社作为本基金新的关联方, 原股东法国巴黎资产管理有限公司与本基金不再有关联方关系。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
申万菱信基金管理有限公司	基金管理人 基金销售机构 基金注册登记机构
中国工商银行	基金托管人 基金代销机构
申银万国证券股份有限公司 (以下简称“申银万国”)	基金管理人的股东 基金代销机构

注: 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位: 人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年2月11日(基金合同生效日) 至2010年6月30日	
	成交金额	占当期股票成	成交金额	占当期股票成

		交总额的比例		交总额的比例
申银万国	97,107,496.45	20.76%	725,834,083.44	77.83%

#### 6.4.10.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付 佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
申银万国	82,540.98	20.94%	43,896.87	12.48%
关联方名称	上年度可比期间 2010年2月11日（基金合同生效日）至2010年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付 佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
申银万国	611,937.35	77.78%	334,634.46	80.95%

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。权证交易不计佣金。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011 年6月30日	上年度可比期间 2010年2月11日（基金合同生 效日）至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,252,076.07	1,999,261.57
其中：支付销售机构的客户维护费	562,110.09	520,403.51

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.65% 计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 \* 0.65% / 当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6 月30日	上年度可比期间 2010年2月11日（基金合同 生效日）至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	519,709.87	461,368.07

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费 = 前一日基金资产净值 \* 0.15% / 当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期和上年度可比期间内，本基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况。

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本期末和上年度末，除基金管理人之外的其他关联方，未发生投资本基金的情况。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年2月11日（基金合同生效日） 至2010年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	50,822,317.40	162,121.57	38,958,250.78	672,746.29

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内本基金在承销期内无参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2011年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发、增发而流通受限的证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值 单价	复牌 日期	复牌 开盘 单价	数量 (股)	期末 成本总额	期末估值总 额	备注
000959	首钢股份	2010-10-29	重大事项	4.42	-	-	327,471	1,692,631.80	1,447,421.82	-
600216	浙江医药	2011-06-27	重大事项	31.39	2011-07-04	32.60	73,177	2,587,367.09	2,297,026.03	-
600170	上海建工	2011-06-29	重大事项	15.59	2011-07-04	16.25	103,978	1,545,383.25	1,621,017.02	-
601998	中信银行	2011-06-29	配股停牌	4.75	2011-07-07	4.59	600,000	4,065,884.69	2,850,000.00	-

注：本基金截至 2011 年 06 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

截至本报告期末 2011 年 06 月 30 日止，本基金无债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额，无相关抵押债券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为指数型基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资等。与这些金融工具有关的风险，以及本基金管理人管理这些风险所采取的风险管理政策如下所述。

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数型基金，属于中高风险品种，采用完全复制策略，跟踪沪深 300 价值指数。本基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现与跟踪指数相同的风险收益目标。

本基金管理人已制定针对以上金融工具风险的管理政策和控制制度，并且形成了由本基金管理人在公司层面建立的风险管理委员会以及在董事会层面建立的风险控制委员会负责对与所投资金融工具相关的风险类型、管理政策和各种投资限制的定期回顾、评估和修改，本基金管理人的风险管理部门负责具体落实和日常跟踪的工作机制。

本基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制控制在可承受的范围内。

本基金面临的主要风险包括：信用风险、流动性风险和市场风险。与本基金相关的市场风险主要是利率风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指金融工具的一方到期无法履行约定义务致使本基金遭受损失的风险。本基金的信用风险主要来源于金融工具的发行者或是交易对手不能履行约定义务而产生。

对于发行者的信用风险控制，本基金管理人主要通过对其投资品种的信用等级评估来选择适当的投资对象来管理。于 2011 年 6 月 30 日，本基金未投资于企业债（2010 年 12 月 31 日：同），所以本基金管理人认为本基金与债券发行者有关的信用风险不重大。

本基金的银行存款存放在本基金的托管行—中国工商银行，因而本基金管理人认为与该银行相关的信用风险不重大。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成债券等投资品种的交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小，本基金管理人认为在交易所进行的交易涉及的信用风险不重大。

对于银行间债券等品种的交易，本基金管理人主要通过事前检查、控制交易对手信用及交割方式来管理风险。

##### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。

本基金的流动性风险主要来源于开放式基金每日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。

本基金管理人对于流动性风险管理的目标是监控基金组合流动性指标,确保市场出现剧烈波动时,基金仍能应付大量赎回和其他负债,灵活调整组合结构,而且不影响组合估值。

针对兑付赎回资金的流动性风险,本基金管理人对基金申购赎回状况进行严密监控和分析预测,保持基金投资组合中的流动性资产与之相匹配。此外,本基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款,设计了非常情况下赎回资金的处理模式,控制因开放模式带来的流动性风险,有效保障基金持有人利益。

针对投资交易品种变现的流动性风险,本基金管理人每日监控和预测本基金的各项流动性指标,包括组合持仓集中度指标、基金组合在短期内变现能力的综合指标、组合持仓中变现能力较差的品种的比例控制和受限制流通股票的总量控制,通过指标来持续地评估、选择、跟踪和控制基金投资的流动性风险。同时,本基金在需要时可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金,以缓解流动性风险。

本基金所持大部分交易性金融资产在证券交易所上市,其余是流动性较好的可在银行间同业市场交易的金融资产工具、银行存款和结算备付金,因此比较容易变现来满足投资者对于基金资产的赎回。除附注 6.4.12 所披露的流通受限不能自由转让的基金资产外,本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。从本基金资产和负债的情况来看,本基金管理人认为本基金面临的流动性风险较小。

本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息,可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险,包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。

于资产负债表日,本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息,因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款及结算备付金。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2011 年 6 月 30 日	1 个月以内	1 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	50,822,317.40	-	-	-	-	50,822,317.40
结算备付金	19,698.76	-	-	-	-	19,698.76
存出保证金	-	-	-	-	196,259.57	196,259.57
交易性金融资产	-	-	-	-	708,797,504.11	708,797,504.11
应收利息	-	-	-	-	7,766.43	7,766.43
应收股利	-	-	-	-	1,088,891.50	1,088,891.50

应收申购款	-	-	-	-	170,658.76	170,658.76
资产总计	50,842,016.16	-	-	-	710,261,080.37	761,103,096.53
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	603,974.92	603,974.92
应付管理人报酬	-	-	-	-	396,959.88	396,959.88
应付托管费	-	-	-	-	91,606.12	91,606.12
应付交易费用	-	-	-	-	351,798.89	351,798.89
其他负债	-	-	-	-	232,507.91	232,507.91
负债总计	-	-	-	-	1,676,847.72	1,676,847.72
利率敏感度缺口	50,842,016.16	-	-	-	708,584,232.65	759,426,248.81
上年度末2010年 12月31日	1个月以内	1个月-1 年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	46,751,037.22	-	-	-	-	46,751,037.22
结算备付金	106,544.71	-	-	-	-	106,544.71
存出保证金	-	-	-	-	267,988.34	267,988.34
交易性金融资产	-	-	-	-	588,795,811.97	588,795,811.97
应收利息	-	-	-	-	8,460.64	8,460.64
应收申购款	-	-	-	-	140,785.81	140,785.81
应收证券清算款	-	-	-	-	46,120.16	46,120.16
资产总计	46,857,581.93	-	-	-	589,259,166.92	636,116,748.85
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	809,159.53	809,159.53
应付管理人报酬	-	-	-	-	356,057.90	356,057.90
应付托管费	-	-	-	-	82,167.23	82,167.23
应付交易费用	-	-	-	-	265,518.00	265,518.00
其他负债	-	-	-	-	337,301.75	337,301.75
负债总计	-	-	-	-	1,850,204.41	1,850,204.41
利率敏感度缺口	46,857,581.93	-	-	-	587,408,962.51	634,266,544.44

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2011 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2010 年 12 月 31 日：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2010 年 12 月 31 日：同）。

**6.4.13.4.2 外汇风险**

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

**6.4.13.4.3 其他价格风险**

基金的其他价格风险是指以交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险，该风险可能与特定投资品种相关，也有可能与整体投资品种相关。本基金的市场价格风险主要来源于本基金投资的股权和债权工具的未来价格可能受到一般市场波动或是其他影响个别股权工具价值的特定风险影响。由于本基金是一只中高风险的指数型基金，沪深 300 价值指数成分股及其备选成分股的投资比例不低于基金资产净值的 90%，所以存在很高的其他价格风险。

本基金采取完全复制策略，即按照标的指数的成分股构成及其权重构建基金股票投资组合。当预期成分股发生调整，成分股发生分红、配股、增发等行为，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，本基金管理人会对投资组合进行适当调整，以便实现对跟踪误差的有效控制。

本基金管理人日常主要运用跟踪误差、标准差、beta 值、VAR 等指标对基金进行风险度量，有效监控基金的投资组合面临的市场价格风险。

**6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口**

金额单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日		上年度末 2010年12月31日	
	公允价值	占基金资产 净值比例(%)	公允价值	占基金资产净 值比例(%)
交易性金融资产-股票投资	708,797,504.11	93.33	588,795,811.97	92.83
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	708,797,504.11	93.33	588,795,811.97	92.83

**6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析**

假设	1. 以沪深300价值指数为基准衡量其他价格风险	
	2. 其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币）

	本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
基准上升5%	35,330,000.00	30,010,000.00
基准下降5%	-35,330,000.00	-30,010,000.00

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

##### (b) 以公允价值计量的金融工具

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

于 2011 年 06 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 700,582,039.24 元，第二层级的余额为 8,215,464.87 元，无属于第三层级的余额。本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层级未发生重大变动。

对于持有的重大事项停牌股票，本基金将相关股票公允价值所属层级于停牌期间从第一层级转入第二层级，并于复牌后从第二层级转回第一层级。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	708,797,504.11	93.13

	其中：股票	708,797,504.11	93.13
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	50,842,016.16	6.68
6	其他各项资产	1,463,576.26	0.19
7	合计	761,103,096.53	100.00

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	85,923,776.78	11.31
C	制造业	137,003,905.42	18.04
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	3,289,226.85	0.43
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	4,693,107.86	0.62
C5	电子	1,251,592.02	0.16
C6	金属、非金属	50,263,144.54	6.62
C7	机械、设备、仪表	72,291,366.52	9.52
C8	医药、生物制品	5,215,467.63	0.69
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	19,665,575.83	2.59
E	建筑业	29,698,896.14	3.91
F	交通运输、仓储业	42,691,385.78	5.62
G	信息技术业	11,103,571.50	1.46
H	批发和零售贸易	4,772,022.79	0.63
I	金融、保险业	338,323,148.24	44.55
J	房地产业	34,521,079.09	4.55
K	社会服务业	3,270,731.02	0.43
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	1,823,411.52	0.24
	合计	708,797,504.11	93.33

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	835,766	40,342,424.82	5.31
2	600036	招商银行	3,084,725	40,163,119.50	5.29
3	600016	民生银行	5,634,388	32,285,043.24	4.25
4	601328	交通银行	5,637,165	31,229,894.10	4.11
5	600000	浦发银行	2,791,824	27,471,548.16	3.62
6	601166	兴业银行	1,883,440	25,388,771.20	3.34
7	601088	中国神华	822,725	24,796,931.50	3.27
8	600030	中信证券	1,736,644	22,715,303.52	2.99
9	000002	万科A	2,414,526	20,402,744.70	2.69
10	600837	海通证券	2,052,008	18,509,112.16	2.44
11	601601	中国太保	784,097	17,555,931.83	2.31
12	601668	中国建筑	3,741,400	15,077,842.00	1.99
13	600585	海螺水泥	498,858	13,848,298.08	1.82
14	601006	大秦铁路	1,483,387	12,148,939.53	1.60
15	000001	深发展A	695,460	11,871,502.20	1.56
16	601939	建设银行	2,393,103	11,821,928.82	1.56
17	000651	格力电器	492,041	11,562,963.50	1.52
18	000157	中联重科	722,210	11,107,589.80	1.46
19	600050	中国联通	2,114,966	11,103,571.50	1.46
20	601169	北京银行	1,087,409	10,841,467.73	1.43
21	601857	中国石油	937,271	10,206,881.19	1.34
22	600900	长江电力	1,234,759	8,902,612.39	1.17
23	600104	上海汽车	461,098	8,640,976.52	1.14
24	000338	潍柴动力	188,406	8,559,284.58	1.13
25	600028	中国石化	1,038,694	8,548,451.62	1.13
26	600999	招商证券	446,808	8,212,331.04	1.08
27	600019	宝钢股份	1,310,497	7,902,296.91	1.04
28	601699	潞安环能	229,600	7,533,176.00	0.99
29	600015	华夏银行	683,457	7,429,177.59	0.98
30	600383	金地集团	1,115,039	7,147,399.99	0.94
31	601628	中国人寿	374,172	7,015,725.00	0.92
32	600795	国电电力	1,920,059	5,683,374.64	0.75
33	600690	青岛海尔	200,550	5,605,372.50	0.74
34	601988	中国银行	1,739,051	5,460,620.14	0.72
35	600188	兖州煤业	147,676	5,212,962.80	0.69
36	601390	中国中铁	1,279,099	5,103,605.01	0.67

37	600150	中国船舶	65,852	4,872,389.48	0.64
38	601919	中国远洋	571,024	4,733,788.96	0.62
39	000709	河北钢铁	1,029,232	4,652,128.64	0.61
40	601009	南京银行	518,413	4,650,164.61	0.61
41	601186	中国铁建	767,891	4,645,740.55	0.61
42	601898	中煤能源	456,586	4,565,860.00	0.60
43	000402	金融街	604,076	4,512,447.72	0.59
44	000937	冀中能源	173,084	4,387,679.40	0.58
45	600005	武钢股份	1,007,145	4,179,651.75	0.55
46	601666	平煤股份	294,494	4,125,860.94	0.54
47	600029	南方航空	525,476	4,119,731.84	0.54
48	601111	中国国航	415,164	3,981,422.76	0.52
49	000783	长江证券	354,898	3,822,251.46	0.50
50	000528	柳工	168,413	3,811,186.19	0.50
51	000825	太钢不锈	710,456	3,658,848.40	0.48
52	600660	福耀玻璃	349,749	3,623,399.64	0.48
53	600642	申能股份	707,748	3,588,282.36	0.47
54	600123	兰花科创	85,493	3,571,897.54	0.47
55	601818	光大银行	997,500	3,341,625.00	0.44
56	600177	雅戈尔	333,255	3,289,226.85	0.43
57	601117	中国化学	369,157	3,270,731.02	0.43
58	002142	宁波银行	287,744	3,130,654.72	0.41
59	000898	鞍钢股份	460,156	3,129,060.80	0.41
60	600009	上海机场	239,919	3,070,963.20	0.40
61	000778	新兴铸管	286,895	3,026,742.25	0.40
62	600153	建发股份	334,922	2,980,805.80	0.39
63	600664	哈药股份	185,888	2,918,441.60	0.38
64	601333	广深铁路	704,964	2,897,402.04	0.38
65	000800	一汽轿车	202,990	2,874,338.40	0.38
66	600741	华域汽车	257,748	2,868,735.24	0.38
67	601998	中信银行	600,000	2,850,000.00	0.38
68	601001	大同煤业	167,001	2,839,017.00	0.37
69	600166	福田汽车	315,750	2,740,710.00	0.36
70	600395	盘江股份	82,572	2,740,564.68	0.36
71	600219	南山铝业	289,385	2,723,112.85	0.36
72	000680	山推股份	151,497	2,664,832.23	0.35
73	002001	新和成	90,314	2,659,747.30	0.35
74	601808	中海油服	147,698	2,637,886.28	0.35
75	600418	江淮汽车	224,833	2,497,894.63	0.33
76	600376	首开股份	186,108	2,458,486.68	0.32
77	000625	长安汽车	260,595	2,384,444.25	0.31

78	600216	浙江医药	73,177	2,297,026.03	0.30
79	000728	国元证券	195,978	2,214,551.40	0.29
80	601866	中海集运	596,500	2,171,260.00	0.29
81	600221	海南航空	294,569	2,103,222.66	0.28
82	600066	宇通客车	90,780	2,100,649.20	0.28
83	600808	马钢股份	595,455	2,072,183.40	0.27
84	600018	上港集团	530,969	2,070,779.10	0.27
85	000059	辽通化工	149,732	2,033,360.56	0.27
86	600895	张江高科	193,158	1,823,411.52	0.24
87	600500	中化国际	179,301	1,791,216.99	0.24
88	600508	上海能源	72,115	1,757,442.55	0.23
89	600717	天津港	208,884	1,708,671.12	0.22
90	601918	国投新集	138,108	1,679,393.28	0.22
91	600266	北京城建	110,905	1,669,120.25	0.22
92	600170	上海建工	103,978	1,621,017.02	0.21
93	600528	中铁二局	181,999	1,581,571.31	0.21
94	000027	深圳能源	197,786	1,491,306.44	0.20
95	000959	首钢股份	327,471	1,447,421.82	0.19
96	600269	赣粤高速	291,279	1,371,924.09	0.18
97	600026	中海发展	157,792	1,331,764.48	0.18
98	600971	恒源煤电	32,700	1,319,772.00	0.17
99	600183	生益科技	136,339	1,251,592.02	0.16
100	600004	白云机场	124,400	981,516.00	0.13

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000002	万科 A	20,050,180.42	3.16
2	601668	中国建筑	14,852,316.00	2.34
3	600036	招商银行	12,702,072.15	2.00
4	601318	中国平安	12,180,028.47	1.92
5	600837	海通证券	9,856,656.30	1.55
6	600585	海螺水泥	9,451,730.11	1.49
7	600016	民生银行	9,277,629.73	1.46
8	601166	兴业银行	9,010,047.34	1.42
9	600000	浦发银行	8,726,050.61	1.38
10	601328	交通银行	8,587,894.79	1.35
11	600383	金地集团	6,980,980.10	1.10

12	600030	中信证券	6,887,776.64	1.09
13	601088	中国神华	6,760,436.47	1.07
14	000157	中联重科	6,467,190.60	1.02
15	600895	张江高科	6,007,396.74	0.95
16	600999	招商证券	5,501,899.43	0.87
17	601601	中国太保	5,258,698.18	0.83
18	601919	中国远洋	4,693,368.55	0.74
19	600029	南方航空	4,049,158.70	0.64
20	601111	中国国航	3,999,712.73	0.63

## 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600585	海螺水泥	8,785,037.86	1.39
2	600348	阳泉煤业	8,590,365.02	1.35
3	600036	招商银行	7,616,631.90	1.20
4	601318	中国平安	7,523,967.94	1.19
5	600795	国电电力	6,750,756.08	1.06
6	600895	张江高科	6,357,563.49	1.00
7	600016	民生银行	5,992,770.93	0.94
8	000425	徐工机械	5,812,024.06	0.92
9	601788	光大证券	5,657,871.03	0.89
10	601166	兴业银行	5,318,849.70	0.84
11	600000	浦发银行	5,228,450.81	0.82
12	601088	中国神华	4,295,689.21	0.68
13	600030	中信证券	4,219,684.78	0.67
14	000024	招商地产	3,662,889.19	0.58
15	601601	中国太保	3,234,907.46	0.51
16	000157	中联重科	3,234,509.38	0.51
17	000562	宏源证券	2,911,035.00	0.46
18	601328	交通银行	2,896,617.44	0.46
19	600015	华夏银行	2,392,094.57	0.38
20	601006	大秦铁路	2,331,659.22	0.37

## 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	299,539,258.48
卖出股票的收入（成交）总额	169,336,049.91

注：“买入金额”、“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

**7.5 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。

**7.6 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。

**7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

**7.8 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。

**7.9 投资组合报告附注**

7.9.1 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。

7.9.2 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。

**7.9.3 期末其他各项资产构成**

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	196,259.57
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	1,088,891.50
4	应收利息	7,766.43
5	应收申购款	170,658.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,463,576.26

**7.9.4 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。

**7.9.5 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。

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人 户数 (户)	户均持有的基金份 额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
12,774	69,915.58	233,145,394.39	26.11%	659,956,191.95	73.89%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	480,612.59	0.05%

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期初基金份额总额	759,068,852.00
本报告期基金总申购份额	263,318,644.14
减：本报告期基金总赎回份额	129,285,909.80
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	893,101,586.34

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、根据本基金管理人 2011 年度股东会相关会议决议，选举姜国芳、杜平、刘郎、宫永宪一、陈志成为申万菱信第一届董事会之董事，选举冯根福、张军建、阎小平、李秀仑为申万菱信第一届董事会之独立董事，任期三(3)年。鉴于原任董事任期届满，毛剑鸣、陆文清、Max Diulus 不再担任申万菱信董事职务，毛应樑、王大东、袁恩楨、赵霄洛不再担任申万菱信独立董事职务。具体内容请参考本基金管理人于 2011 年 5 月 18 日发布的《申万菱信基

金管理有限公司关于董事变更的公告》及 2011 年 6 月 29 日发布的《申万菱信基金管理有限公司关于独立董事变更的公告》。

2、经本基金管理人第一届董事会 2011 年第一次会议审议通过，同意免去毛剑鸣先生公司总经理职务，由姜国芳先生代为履行总经理职务，代为履行期限不超过 90 日。具体内容请参考本基金管理人于 2011 年 5 月 4 日发布的《申万菱信基金管理有限公司关于由姜国芳先生代为履行公司总经理职务的公告》。

3、报告期内本基金基金托管人无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金管理人的基金投资策略严格遵循本基金《招募说明书》中披露的基本投资策略，未发生显著的改变。

### 10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

报告期内本基金未发生改聘会计师事务所情况。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
西部证券股份有限公司	1	130,628,895.78	27.93%	111,034.58	28.17%	-
申银万国证券股份有限公司	2	97,107,496.45	20.76%	82,540.98	20.94%	-

长江证券股份有限公司	1	81,006,175.23	17.32%	68,854.91	17.47%	-
瑞银证券有限责任公司	1	66,621,157.51	14.24%	56,627.63	14.37%	本期新增
国泰君安证券股份有限公司	2	26,394,422.05	5.64%	21,446.04	5.44%	-
国信证券股份有限公司	1	21,129,681.35	4.52%	17,167.91	4.36%	-
招商证券股份有限公司	1	20,289,122.42	4.34%	16,485.06	4.18%	-
中国国际金融有限公司	1	18,100,213.99	3.87%	14,706.51	3.73%	-
华泰联合证券有限责任公司	1	4,313,329.53	0.92%	3,504.66	0.89%	-
中信证券股份有限公司	1	2,089,526.38	0.45%	1,697.73	0.43%	-
红塔证券股份有限公司	1	101,900.00	0.02%	86.61	0.02%	-
华创证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
平安证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中国建银投资证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
长城证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
五矿证券有限公司	1	-	-	-	-	-

注：交易单元选择的标准：1、经营行为规范，在近一年内无重大违规行为；2、公司财务状况良好；3、有良好的内控制度，在业内有良好的声誉；4、有较强的研究能力，能及时、

全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；5、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2011-01-04
2	申万巴黎沪深300价值指数证券投资基金2010年第四季度报告	《中国证券报》、《证券时报》	2011-01-20
3	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2011-02-10
4	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2011-02-25
5	关于股权变更及公司更名的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2011-03-04
6	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2011-03-07
7	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2011-03-07
8	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2011-03-09
9	关于开通汇付天下“天天盈”网上直销交易并实施申购费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2011-03-11
10	申万巴黎沪深300价值指数基金招募说明书第二次更新（摘要）	《中国证券报》、《证券时报》	2011-03-28
11	申万巴黎沪深300价值指数证券投资基金2010年年度报告	《中国证券报》、《证券时报》	2011-03-29
12	关于变更直销中心银行账户信息的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2011-04-01
13	关于旗下开放式基金继续参加中国工商银行股份有限公司开展的个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2011-04-01

14	基金管理公司名称、基金名称变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2011-04-06
15	关于参加“华夏银行?盈基金2011”网上银行基金申购优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2011-04-06
16	关于基金管理公司名称、基金名称变更公告的内容更正公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2011-04-19
17	关于免去申万菱信沪深300价值指数证券投资基金基金经理的公告	《中国证券报》、《证券时报》	2011-04-20
18	申万菱信沪深300价值指数证券投资基金2011年第一季度报告	《中国证券报》、《证券时报》	2011-04-21
19	申万菱信沪深300价值指数证券投资基金基金经理变更公告	《中国证券报》、《证券时报》	2011-04-21
20	关于由姜国芳先生代为履行公司总经理职务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2011-05-04
21	关于旗下开放式基金新增中信证券股份有限公司为代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2011-05-09
22	关于董事变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2011-05-18
23	关于延续中国工商银行网上直销交易申购、定期定额投资等费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2011-06-03
24	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2011-06-17
25	关于旗下部分开放式基金继续参加交通银行股份有限公司开展的网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2011-06-29
26	关于独立董事变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2011-06-29
27	关于旗下开放式基金2011年半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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2011-07-01
28	关于旗下开放式基金参加中信银行股份有限公司开展的个人网银、移动银行申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2011-07-02
29	申万菱信沪深300价值指数证券投资基金2011年第二季度报告	《中国证券报》、《证券时报》	2011-07-21

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人已于2011年3月4日发布《申万巴黎基金管理有限公司关于股权变更及公司更名的公告》，原公司外方股东法国巴黎资产管理有限公司将所持有的申万巴黎基金管理

有限公司全部 33% 的股权转让三菱 UFJ 信托银行株式会社。变更后的股东及持股比例分别为：申银万国证券股份有限公司：67%；三菱 UFJ 信托银行株式会社：33%。同时公司名称由“申万巴黎基金管理有限公司”变更为“申万菱信基金管理有限公司”。

经基金托管人同意，并报请中国证监会批准，本基金管理人已于 2011 年 4 月 6 日发布《基金管理公司名称、基金名称变更公告》，本基金的名称也已改为申万菱信沪深 300 价值指数证券投资基金。

## 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

基金合同；  
招募说明书及其定期更新；  
发售公告；  
成立公告；  
开放日常交易业务公告；  
定期报告；  
其他临时公告。

### 12.2 存放地点

上述备查文件中基金合同、招募说明书及其定期更新、基金发售公告和基金成立公告均放置于本基金管理人及基金托管人的住所；开放日常交易业务公告、定期报告和其他临时公告放置于本基金管理人的住所。本基金管理人住所地址为：中国上海淮海中路 300 号香港新世界大厦 40 层。

### 12.3 查阅方式

上述文件均可到本基金管理人的住所进行查阅，也可在本基金管理人的网站进行查阅，查询网址：[www.swsmu.com](http://www.swsmu.com)。

申万菱信基金管理有限公司  
二〇一一年八月二十五日