
申万菱信沪深 300 价值指数证券投资基金
2011 年年度报告
2011 年 12 月 31 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：二〇一二年三月二十六日

§ 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 2012 年 3 月 19 日复核了本报告中的财务指标、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，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及其更新。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1	重要提示及目录	1
1.1	重要提示	1
§ 2	基金简介	4
2.1	基金基本情况	4
2.2	基金产品说明	4
2.3	基金管理人和基金托管人.....	4
2.4	信息披露方式	5
2.5	其他相关资料	5
§ 3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	5
3.1	主要会计数据和财务指标.....	5
3.2	基金净值表现	6
3.3	过去三年基金的利润分配情况.....	8
§ 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合规守信情况的说明.....	9
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	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	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	11
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
§ 5	托管人报告	14
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2	托管人对报告期内本基金运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
§ 6	审计报告	14
6.1	管理层对财务报表的责任.....	15
6.2	注册会计师的责任	15
6.3	审计意见	15
§ 7	年度财务报表	16
7.1	资产负债表	16
7.2	利润表	17
7.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	18
7.4	报表附注	19
§ 8	投资组合报告	36
8.1	期末基金资产组合情况	36
8.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	37
8.3	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.....	38
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
8.6	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.....	42
8.7	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.....	42
8.8	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.....	42

8.9	投资组合报告附注	42
§ 9	基金份额持有人信息	43
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	43
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	43
§ 10	开放式基金份额变动	43
§ 11	重大事件揭示	44
11.1	基金份额持有人大会决议.....	44
11.2	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.....	44
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	44
11.4	基金投资策略的改变	45
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	45
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	45
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	45
11.8	其他重大事件	46
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息.....	48
§ 13	备查文件目录	49
13.1	备查文件目录	49
13.2	存放地点	49
13.3	查阅方式	49

§ 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	1,363,270,926.82 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
信息披露负责人	姓名	来肖贤
	联系电话	021-23261188
	电子邮箱	service@swsmu.com
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》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.swsmu.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所有限公司	上海市陆家嘴环路1318号星展银行大厦6层
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2011 年	2010 年 2 月 11 日（基金合同生效日）至 2010 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-49,022,119.63	-55,965,510.84
本期利润	-191,858,495.20	-134,259,502.18
加权平均基金份额本期利润	-0.1914	-0.1617
本期加权平均净值利润率	-23.84%	-18.34%
本期基金份额净值增长率	-16.39%	-16.40%
3.1.2 期末数据和指标	2011 年末	2010 年末
期末可供分配利润	-409,719,879.24	-124,802,307.56
期末可供分配基金份额利润	-0.3005	-0.1644
期末基金资产净值	953,551,047.58	634,266,544.44
期末基金份额净值	0.699	0.836
3.1.3 累计期末指标	2011 年末	2010 年末
基金份额累计净值增长率	-30.10%	-16.40%

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
过去三个月	-3.85%	1.30%	-3.61%	1.29%	-0.24%	0.01%
过去六个月	-17.76%	1.30%	-17.80%	1.30%	0.04%	0.00%
过去一年	-16.39%	1.24%	-17.07%	1.24%	0.68%	0.00%
自基金合同生效起至今	-30.10%	1.38%	-27.44%	1.40%	-2.66%	-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：

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

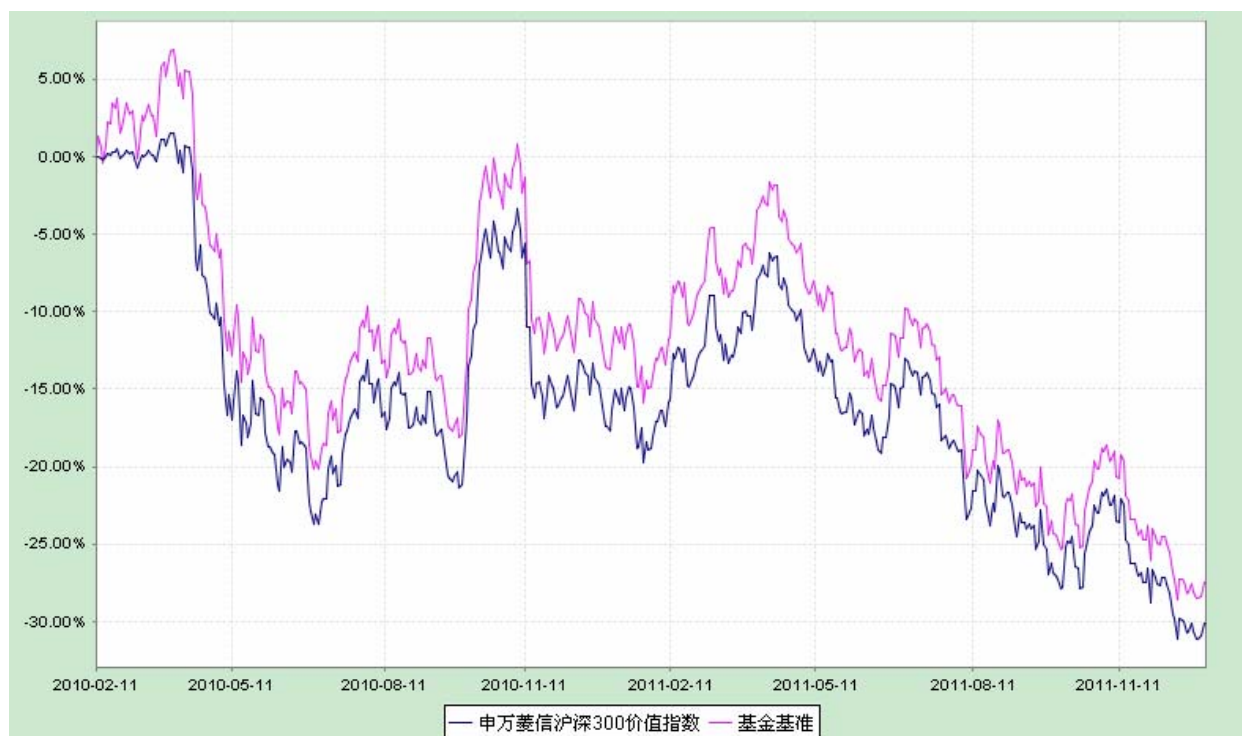
$$\% \text{benchmark}(t) = 95\% * (\text{沪深 300 价值指数}(t) / \text{沪深 300 价值指数}(t-1) - 1) + 5\% * \text{银行同业存款利率} / 365;$$

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

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 12 月 31 日）

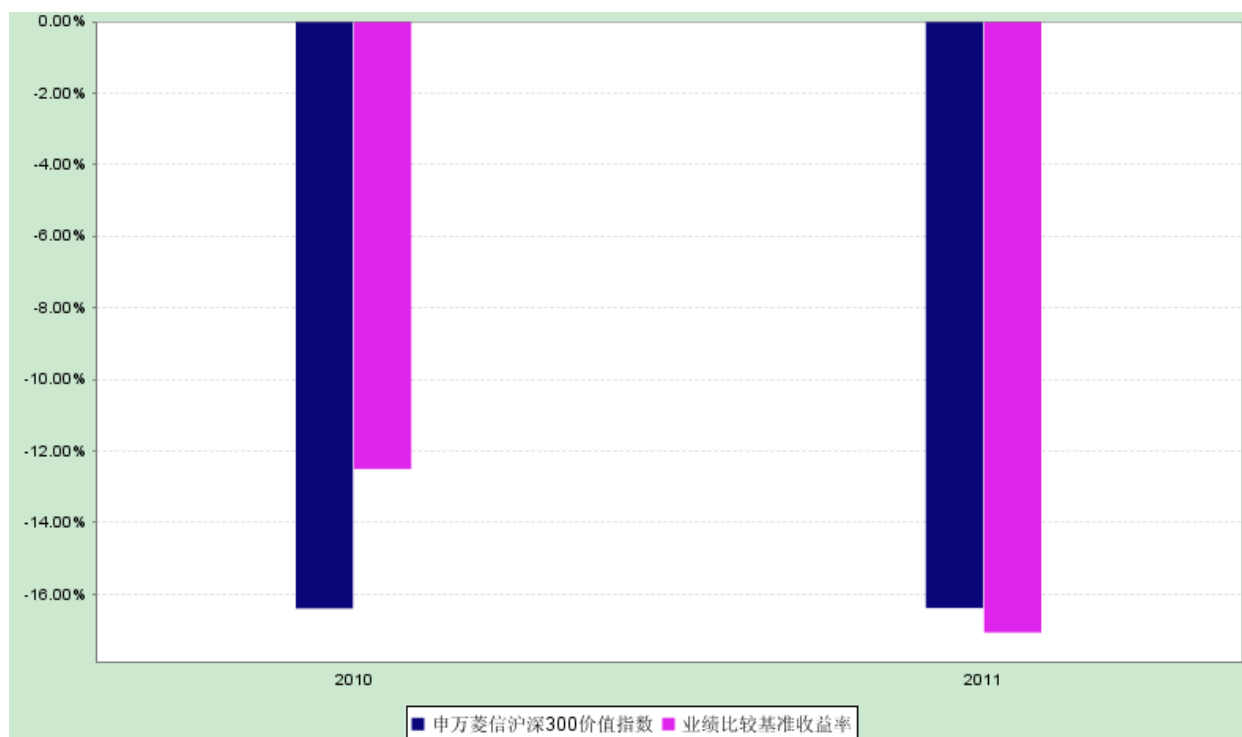


注：根据本基金基金合同，本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括沪深 300 价值指数成份股、备选成份股、新股（一级市场初次发行或增发）、现金或者到期日在一年以内的政府债券等。其中，沪深 300 价值指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的 90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。在本基金合同生效日起 3 个月内，达到上述比例限制。基金合同生效满 3 个月时，本基金已达到上述比例限制。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

申万菱信沪深 300 价值指数证券投资基金

自基金合同生效以来每年净值增长率图



注：本年数据按基金合同生效后基金实际存续期计算，未按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

自基金成立至本报告期末，本基金未进行利润分配。

§ 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 12 月 31 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 13 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 110 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	证券	说明
----	----	-----------	----	----

		（助理）期限		从业 年限	
		任职日期	离任日期		
张少华	本 基 金 经 理	2010-02-12	-	13 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 月正式加入本公司，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。

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

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司制定了《公平交易制度》，通过组织架构的设置、工作制度、流程和技术手段全面落实公平交易原则在具体业务（包括研究分析、投资决策、交易执行等）环节中的实现，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；同时，通过对投资交易行为的日常监控和事后分析评估来加强对公平交易过程和结果的监督。

在投资和研究方面，本公司设立了独立于公募基金投资、特定客户资产投资的研究总部，建立了

规范、完善的研究管理平台，确保公平地为各投资组合提供研究服务。

在交易执行方面，本公司的投资管理职能和交易执行职能相隔离，通过实行集中交易制度和公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。

在日常监控和事后分析评估方面，本公司风险管理总部开展日内和定期的工作对公平交易执行情况作整体监控和效果评估。风险管理总部通过对不同组合之间同向交易的价差率的假设检验、价格占优的次数百分比统计、价差交易模拟贡献与组合收益率差异的比较等方法对本报告期以及连续四个季度期间内、不同时间窗口下公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行了分析；对于场外交易，还特别对比了组合之间发生的同向交易的市场公允价格和交易对手，判断交易是否公平且是否涉及利益输送。

本公司通过事前的制度规范、事中的监控和事后的分析评估，严格执行了公平交易制度，公平对待了旗下各投资组合。本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况。

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

本公司制定了《异常交易监控报告制度》，明确定义了投资交易过程中出现的各种可能导致不公平交易和利益输送的异常交易类型，并规定且落实了异常交易的日常监控、识别以及事后的分析流程。

本报告期，未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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。

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，基金收益率和业绩基准收益率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。三位小数位净值计算的 2011 年年化跟踪误差略小于 1%，达到契约的要求。实际运作结果观察，本报告期内成分股分红、基金净值小数位 3 位的计算方法、工商银行作为权重靠前的成分股不能投资是贡献区间基金跟踪误差的主要来源。而基金净值小数位 3 位的计算方法越来越成为影响每日跟踪偏离的最大因素。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金 2011 年净值增长表现为，同期业绩比较基准表现为。2011 年沪深 300 价值指数期间表现为

-18.00%，基金业绩基准表现为-17.07%，基金净值期间表现为-16.39%，领先业绩基准约 0.68%。

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，国内通胀形势复杂，宏观经济数据平稳，资金面紧张，民间资金价格居高不下。美国经济弱势复苏，欧洲经济复苏形势依然严峻，欧洲主权国家债券问题解决进程缓慢，期间出现了诸多反复，海外市场动荡剧烈。全年来看，对市场负面影响巨大的“黑天鹅”事件不断，不断冲击原本弱势的市场。

回顾 2011 年，上证指数全年维持调整格局，期间反弹乏力，指数不断创出年内新低，日成交额萎缩。2011 年 10 月，中央政府预调微调的表态鼓舞了市场，然而“政策底”、“市场底”、“经济底”孰先孰后，情景复杂。目前市场的担忧主要集中在以下几点：1、目前呈现软着陆的经济局面，其持续性和复苏力度有多大，会否出现政策稳经济力度不够，出现再次探底格局；2、资金紧张的格局下，IPO 尤其是大公司的 IPO 对市场的冲击；3、新股发行制度改革对有中国特色的小市值品种高溢价的现象产生冲击，未来创业板的估值中枢如何定位，和沪深 300 的估值比较，不确定性仍然较大。

展望 2012 年，A 股整体估值水平已然较为合理，市场已然处于底部区域，然而市场参与者对未来的信心尚待修复。目前来看经济数据的平稳束缚了政策的可变性、结构性的资金面紧张依旧、国内物价水平仍然处于较高位置、民间资金价格居高不下等均制约了行情的发展。行情企稳回升仍然需要重点观察以下几点：经济复苏会否出现反复；通胀会否出现反复；流动性会否出现实质性的改善；高企的市场利率能否出现回落等。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2011 年度，本公司经历了股权与管理层变更的特殊阶段，在此期间，公司内部控制体系依然保持其政策的连贯性、管理和控制标准的稳定性，从合规控制和风险管理两个方面均基本保证了公司业务的合规开展，保证了公司日常运营平稳。本报告期内监察稽核工作主要分为以下几个方面：

1、合规培训及相关活动开展工作

由监察稽核部负责的合规培训工作，在 2011 年度基本覆盖了所有的重点领域，从“三条底线”、内幕信息到销售费用合规性管理，财务规范化处理，再到反洗钱以及行业内的各项风险事件和涉及违法违规的案例分析等，除此之外监察稽核总部还定期开展公司新员工的培训，通过培训增加新员工对于公司的了解程度，提高新员工作为基金从业人员的合法合规意识，帮助新员工可以尽快融入公司文化，开展各自业务。总体来说，本年度监察稽核部对于合规培训的频度和质量都较以往有所提升；实施培训的方式也逐步多样化，有内部法务人员实施的法规培训、聘请外部律师事务所和审计事务所进

行的案例讲解、通过网上 OA 系统的培训模块进行的测验。所有测验结果和培训材料、参加人员的记录均有存档，并作为员工年终考核成绩的一部分。

2、制度、流程建设与修订

2011 年度，监察稽核部的重点工作是对公司规章制度的梳理。公司原有的基本规章制度制定于公司成立之初，主要借鉴了当时外方股东的一些做法和文件，现公司成立已满 7 年，主要规章制度面临重新修订的必要，加上今年完成股东变更，监察稽核部以此为契机从 2011 年开始着手对公司基本的一些规章制度进行系统性的重新梳理。第一阶段完成了股东会、董事会、监事会、独立董事以及董事会下设各专业委员会工作规则的修订，上述制度于 2011 年 4 月经公司股东会审议通过。第二阶段完成了对管理层下设的各专业委员会工作规则的修订，上述规则于 2011 年 11 月经管理层会议审议通过。第三阶段完成了公司基本规章制度的修订（共计 15 项，包括自有资金投资的办法），于 2011 年 12 月经董事会审议通过。至此，公司层面的重要制度已全部修订完毕。下一阶段，监察稽核部将继续牵头组织公司相关业务部门对其他规章制度进行修订。除此之外公司还制定了涉及专户资产管理业务的各项业务和控制的整套制度。

3、日常合规检查与稽核

监察稽核部定期开展合规检查，以季度抽查为主，抽查主要内容涵盖移动通信工具对于限定人员在限定时间的管理、网络信息交流工具（MSN）记录、特定办公场所的监控记录。对于发现的一般性问题，监察稽核部要求相关部门予以改进，相关人员提交说明文件。对于检查中发现的重要线索或重大可疑事项，监察稽核部转入事件专项稽核项目。

对于其他日常经营中的业务程序和流程检查，监察稽核部依据检查项目列表项目按季度核查。检查项目列表内容根据监管要求和历史发现实行微调。检查报表和季度监察稽核报告一并上报监管机构。

本年度内，稽核人员根据年度稽核计划对基金运营总部、风险管理总部和市场营销总部进行了内部稽核。对于稽核发现和改进建议分别与被稽核对象进行了反馈，同时形成正式稽核报告。对于每次稽核发现、结论和改进建议，监察稽核部予以持续跟踪被稽核对象的改善情况，并将在下次稽核活动中予以核查、确认。

4、事件专项稽核与处理

根据监管部门的要求，今年在配合监管部门自查方面的重点工作主要集中在财务不规范和小金库问题上。根据监管部门的要求，针对财务不规范和小金库问题，监察稽核部与财务管理总部自 5 月以来，先后着手进行了自查、整改、问题治理、总结以及复查（即回头看）等多个环节。针对发现的财务不规范问题，进行了认真的整改，并提出了相应的制度优化措施。12 月底，监察稽核部与财务管理部共同对公司相关业务部门进行了财务规范问题培训。2012 年，公司针对此问题还将继续建立完善长

效机制，并积极防范新问题的出现。

5、对公司重大运营风险点进行了系统整理和评估

结合行业整体情况以及公司历年来内外部检查和审计中发现的问题，在 2011 年度，监察稽核部对公司重大运营风险点进行了系统性的梳理，在征求各业务部门的意见的基础上制定了相应的一线控制和二线控制措施。与此同时，也整理了行业及公司的详细运营风险案例。作为公司风险控制部门，今后监察稽核部将以重大运营风险点为基础，每半年进行一次抽查和回顾，并加强对各一线控制部门的培训和沟通反馈。

6、反洗钱工作

根据人民银行、中国证监会等主管部门的要求，持续落实反洗钱工作的各项要求。年内，本部结合系统中所反映的客户资料以及历年可疑交易报送的实际情况，对中高风险等级客户进行了回顾和风险等级调整。同时，监察稽核部草拟了与各代销机构的反洗钱专门协议，督促各代销机构签署。目前已有约 1/3 余代销机构与我公司签署了反洗钱协议。反洗钱制度建设也进一步完善。

4.7 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。

资产估值委员会由本基金管理人的总经理，分管基金运营的副总经理，基金运营总部、监察稽核总部、基金投资管理总部、风险管理总部等各总部总监组成。其中，总经理于东升先生，拥有 2 年以上基金公司高级管理人员经验。分管基金运营的副总经理过振华先生，拥有 7 年的基金公司高级管理人员经验。基金投资管理总部总监欧庆铃先生，拥有 9 年的基金公司研究和投资管理经验。基金运营总部总监李濮君女士，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 8 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。

4.8 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-409,719,879.24 元，份额净值为 0.699 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，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运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2011 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 审计报告

普华永道中天审字(2012)第 20370 号

申万菱信沪深 300 价值指数证券投资基金

(原名为申万巴黎沪深 300 价值指数证券投资基金)全体基金份额持有人：

我们审计了后附的申万菱信沪深 300 价值指数证券投资基金(原名为申万巴黎沪深 300 价值指数证券投资基金，以下简称“申万菱信沪深 300 基金”)的财务报表，包括 2011 年 12 月 31 日的资产负债表、2011 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是申万菱信沪深 300 基金的基金管理人申万菱信基金管理有限公司(原名为申万巴黎基金管理有限公司)管理层的责任。这种责任包括:

(1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表, 并使其实现公允反映;

(2)设计、执行和维护必要的内部控制, 以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则, 计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序, 以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断, 包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时, 注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制, 以设计恰当的审计程序, 但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性, 以及评价财务报表的总体列报。

我们相信, 我们获取的审计证据是充分、适当的, 为发表审计意见提供了基础。

6.3 审计意见

我们认为, 上述申万菱信沪深 300 基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制, 公允反映了申万菱信沪深 300 基金 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年度的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天会计师事务所有限公司 注册会计师 薛竞

张鸿

上海市陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 层

2012-03-23

§ 7 年度财务报表

7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	74,740,754.44	46,751,037.22
结算备付金		199,664.22	106,544.71
存出保证金		345,910.51	267,988.34
交易性金融资产	7.4.7.2	889,744,437.37	588,795,811.97
其中：股票投资		889,744,437.37	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	46,120.16
应收利息	7.4.7.5	12,516.07	8,460.64
应收股利		-	-
应收申购款		17,415,434.55	140,785.81
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		982,458,717.16	636,116,748.85
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		27,156,472.38	-
应付赎回款		223,305.62	809,159.53
应付管理人报酬		524,962.98	356,057.90
应付托管费		121,145.33	82,167.23
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	443,645.00	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	7.4.7.8	438,138.27	337,301.75
负债合计		28,907,669.58	1,850,204.41
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	1,363,270,926.82	759,068,852.00
未分配利润	7.4.7.10	-409,719,879.24	-124,802,307.56
所有者权益合计		953,551,047.58	634,266,544.44
负债和所有者权益总计		982,458,717.16	636,116,748.85

注：1、报告截止日 2011 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.699 元，基金份额总额 1,363,270,926.82 份。

2、本基金为上年度内基金合同生效的基金，上年度对比数据报告期为 2010 年 2 月 11 日至 2010 年 12 月 31 日。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2011年1月1日至 2011年12月31日	上年度可比期间 2010年2月11日（基金合同 生效日）至2010年12月31日
一、收入		-183,333,176.01	-126,799,598.53
1. 利息收入		431,181.57	1,236,880.14
其中：存款利息收入	7.4.7.11	401,530.57	854,651.00
债券利息收入		1,962.11	1,693.48
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		27,688.89	380,535.66
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-41,113,071.38	-50,235,788.03
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-53,240,049.33	-60,491,978.90
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	269,644.59	48,421.32
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	11,857,333.36	10,207,769.55
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-142,836,375.57	-78,293,991.34
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	185,089.37	493,300.70
减：二、费用		8,525,319.19	7,459,903.65
1. 管理人报酬		5,188,842.76	4,217,265.28
2. 托管费		1,197,425.30	973,215.05
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	1,570,357.36	1,827,471.03
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	568,693.77	441,952.29
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-191,858,495.20	-134,259,502.18
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-191,858,495.20	-134,259,502.18

7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31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）	-	-191,858,495.20	-191,858,495.20
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）	604,202,074.82	-93,059,076.48	511,142,998.34
其中：1. 基金申购款	826,641,685.04	-131,903,475.60	694,738,209.44
2. 基金赎回款	-222,439,610.22	38,844,399.12	-183,595,211.10
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）	1,363,270,926.82	-409,719,879.24	953,551,047.58
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12月31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）	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 （本期利润）	-	-134,259,502.18	-134,259,502.18
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）	759,068,852.00	9,457,194.62	768,526,046.62
其中：1. 基金申购款	1,104,646,700.53	-16,751,945.99	1,087,894,754.54
2. 基金赎回款	-345,577,848.53	26,209,140.61	-319,368,707.92

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）	759,068,852.00	-124,802,307.56	634,266,544.44

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

申万菱信沪深 300 价值指数证券投资基金(原名为申万巴黎沪深 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”)2009 年 11 月 18 日证监许可[2009]1191 号文件核准，由申万菱信基金管理有限公司(原名为“申万巴黎基金管理有限公司”)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人民币 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。

经中国证监会证监许可[2011]106 号文件批准，申万巴黎基金管理有限公司已于 2011 年 3 月 3 日完成相关工商变更登记手续，并于 2011 年 3 月 4 日变更公司名称为“申万菱信基金管理有限公司”。公司报请中国证监会备案，将申万巴黎沪深 300 价值指数证券投资基金更名为申万菱信沪深 300 价值指数证券投资基金，并于 2011 年 4 月 6 日公告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、本基金基金合同和最新公布的《申万菱信沪深 300 价值指数证券投资基金招募说明书》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。本基金的投资资产配置比例为：将不低于 90%的基金资产净值投资于沪深 300 价值指数成份股和备选成份股，其中备选成份股投资比例不高于 15%，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 5%。本基金以沪深 300 价值指数为标的指数，业绩比较基准为：95%×沪深 300 价值指数增长率+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 2012 年 03 月 23 日批准报出。

7.4.2 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》、本基金基金合同和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2011 年度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 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。比较财务报表的实际编制期间为 2010 年 2 月 11 日(基金合同生效日)至 2010 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购

或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分(包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等)为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分后的余额)。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

重要会计估计及其关键假设

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(a)对于特殊事项停牌股票，根据中国证监会公告[2008]38 号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，本基金采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票估值，通过停牌股票所处行业的行业指数变动以大致反映市场因素在停牌期间对于停牌股票公允价值的影响。上述指数收益法的关键假设包括所选取行业指数的变动能在重大方面基本反映停牌股票公允价值的变动，停牌股票的发行者在停牌期间的各项变化未对停牌股票公允价值产生重大影响等。本基金自 2009 年 6 月 16 日起，采用中证协(SAC)基金行业股票估值指数以取代原交易所发布的行业指数。

(b)在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期，本基金未发生会计政策变更事项。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期，本基金未发生会计估计变更事项。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
活期存款	74,740,754.44	46,751,037.22
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	74,740,754.44	46,751,037.22

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,110,874,804.28	889,744,437.37	-221,130,366.91
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	1,110,874,804.28	889,744,437.37	-221,130,366.91
项目	上年度末 2010 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	667,089,803.31	588,795,811.97	-78,293,991.34
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	667,089,803.31	588,795,811.97	-78,293,991.34

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产**7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

无余额。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
应收活期存款利息	12,426.17	8,423.34
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	89.90	37.30
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	12,516.07	8,460.64

7.4.7.6 其他资产

无余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
交易所市场应付交易费用	443,645.00	265,518.00
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	443,645.00	265,518.00

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	712.77	3,049.60
应付指数使用费	47,425.50	34,252.15

预提费用	390,000.00	300,000.00
合计	438,138.27	337,301.75

7.4.7.9 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12月31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	826,641,685.04	826,641,685.04
本期赎回（以“-”号填列）	-222,439,610.22	-222,439,610.22
本期末	1,363,270,926.82	1,363,270,926.82

注：本期申购含红利再投资和转换转入份额，本期赎回含转换转出份额。

7.4.7.10 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	-49,022,119.63	-142,836,375.57	-191,858,495.20
本期基金份额交易产生的变动数	-43,571,570.66	-49,487,505.82	-93,059,076.48
其中：基金申购款	-59,737,125.38	-72,166,350.22	-131,903,475.60
基金赎回款	16,165,554.72	22,678,844.40	38,844,399.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-144,819,521.35	-264,900,357.89	-409,719,879.24

7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间 2010年2月11日（基金合同生效日） 至2010年12月31日
活期存款利息收入	381,419.58	810,571.24
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	11,872.12	39,121.95
其他	8,238.87	4,957.81
合计	401,530.57	854,651.00

7.4.7.12 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12月31日	上年度可比期间 2010年2月11日（基金合同生效日） 至2010年12月31日
----	-----------------------------	--

卖出股票成交总额	338,088,592.49	357,239,146.72
减：卖出股票成本总额	391,328,641.82	417,731,125.62
买卖股票差价收入	-53,240,049.33	-60,491,978.90

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2 011年12月31日	上年度可比期间 2010年2月11日（基金合同 生效日）至2010年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	4,872,606.70	9,140,114.80
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,601,000.00	9,090,000.00
减：应收利息总额	1,962.11	1,693.48
债券投资收益	269,644.59	48,421.32

7.4.7.14 衍生工具收益

无。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31 日	上年度可比期间 2010年2月11日（基金合同生效 日）至2010年12月31日
股票投资产生的股利收益	11,857,333.36	10,207,769.55
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	11,857,333.36	10,207,769.55

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2011年1月1日至2011年12月31 日	上年度可比期间 2010年2月11日（基金合同生效 日）至2010年12月31日
1. 交易性金融资产	-142,836,375.57	-78,293,991.34
——股票投资	-142,836,375.57	-78,293,991.34
——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	-142,836,375.57	-78,293,991.34

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年2月11日（基金合同生效日） 至2010年12月31日
基金赎回费收入	181,720.07	385,864.57
转换费收入	3,369.30	13,348.44
其他	-	94,087.69
合计	185,089.37	493,300.70

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。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年2月11日（基金合同生效日）至20 10年12月31日
交易所市场交易费用	1,570,357.36	1,827,471.03
银行间市场交易费用	-	-
合计	1,570,357.36	1,827,471.03

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31 日	上年度可比期间 2010年2月11日（基金合同生效日） 至2010年12月31日
审计费用	70,000.00	100,000.00
信息披露费	320,000.00	200,000.00
银行间帐户维护费	18,000.00	10,500.00
指数使用费	159,656.77	129,761.97
银行汇划费	1,037.00	790.32
其他	-	900.00
合计	568,693.77	441,952.29

注：本基金的指数使用费从基金财产中列支。在通常情况下，指数许可使用费按前一日的基金资产净值的 0.02% 的年费率计提，逐日累计，每季支付一次。若季度指数使用费下限(人民币 5 万元)大于按基金资产净值提取的季度指数使用费，超过部分由基金管理人自行承担。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中国工商银行	基金托管人 基金代销机构
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
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
三菱 UFJ 信托银行株式会社	基金管理人的股东

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2010年2月11日（基金合同生效日）至2010年 12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
申银万国	213,108,310.59	18.21%	864,945,484.44	61.07%

7.4.10.1.2 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12月31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	181,005.51	18.33%	97,035.84	21.87%
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12月31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	729,669.75	61.09%	6,847.57	2.58%

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31 日	上年度可比期间 2010年2月11日（基金合同生效 日）至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	5,188,842.76	4,217,265.28
其中：支付销售机构的客户维护费	1,051,018.03	1,118,173.19

注：支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.65% 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：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值*0.65%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31 日	上年度可比期间 2010年2月11日（基金合同生效 日）至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,197,425.30	973,215.05

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。

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自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自有资金投资本基金的情况。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 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12月31日		上年度可比期间 2010年2月11日（基金合同生效日） 至2010年12月31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	74,740,754.44	381,419.58	46,751,037.22	810,571.24

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。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期本基金在承销期内无参与关联方承销证券的情况。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2011 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601555	东吴证券	2011-12-06	2012-03-12	新股网下申购	6.50	6.57	63,310	411,515.00	415,946.70	-
300284	苏交科	2011-12-29	2012-01-10	新股网上申购	13.30	13.30	500	6,650.00	6,650.00	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金截至 2011 年 12 月 31 日止未持有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。

7.4.12.3 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 12 月 31 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。

7.4.13 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。

7.4.13.1 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，将风险控制在可接受的范围内。

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。

7.4.13.2 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 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券（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。

7.4.13.3 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、基金组合在短时间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 7.4.12 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2011年12月31日	1个月以内	1-3 个月	3个月 -1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	74,740,754.44	-	-	-	-	-	74,740,754.44
结算备付金	199,664.22	-	-	-	-	-	199,664.22
存出保证金	-	-	-	-	-	345,910.51	345,910.51
交易性金融资产	-	-	-	-	-	889,744,437.37	889,744,437.37
应收利息	-	-	-	-	-	12,516.07	12,516.07
应收申购款	-	-	-	-	-	17,415,434.55	17,415,434.55
资产总计	74,940,418.66	-	-	-	-	907,518,298.50	982,458,717.16
负债							

应付证券清算款	-	-	-	-	-	27,156,472.38	27,156,472.38
应付赎回款	-	-	-	-	-	223,305.62	223,305.62
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	524,962.98	524,962.98
应付托管费	-	-	-	-	-	121,145.33	121,145.33
应付交易费用	-	-	-	-	-	443,645.00	443,645.00
其他负债	-	-	-	-	-	438,138.27	438,138.27
负债总计	-	-	-	-	-	28,907,669.58	28,907,669.58
利率敏感度缺口	74,940,418.66	-	-	-	-	878,610,628.92	953,551,047.58
上年度末 2010年12月31日	1个月以内	1-3个月	3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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2011 年 12 月 31 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）。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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的市场价格风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 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	889,744,437.37	93.31	588,795,811.97	92.83
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	889,744,437.37	93.31	588,795,811.97	92.83

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）		
	相关风险变量的变动	本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
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	基准上升 5%	43,970,000.00	30,010,000.00
	基准下降 5%	-43,970,000.00	-30,010,000.00

7.4.14 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

(i) 金融工具公允价值计量的方法

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)。

(ii) 各层次金融工具公允价值

于 2011 年 12 月 31 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 889,744,437.37 元，属于第二层级和第三层级的余额(2010 年 12 月 31 日：第一层级 583,535,435.92 元，第二层级 5,260,376.05 元，无属于第三层级的余额)。

(iii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和债券的公允价值列入第一层级；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层级或第三层级。

(iv) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(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。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	889,744,437.37	90.56
	其中：股票	889,744,437.37	90.56
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	74,940,418.66	7.63
6	其他各项资产	17,773,861.13	1.81
7	合计	982,458,717.16	100.00

8.2 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	99,318,620.70	10.42
C	制造业	149,748,160.23	15.70
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	6,031,840.60	0.63
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	4,419,284.40	0.46
C5	电子	1,497,038.12	0.16
C6	金属、非金属	55,628,582.47	5.83
C7	机械、设备、仪表	74,742,597.94	7.84
C8	医药、生物制品	7,428,816.70	0.78
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	31,962,722.99	3.35
E	建筑业	27,018,408.48	2.83
F	交通运输、仓储业	44,142,883.34	4.63
G	信息技术业	16,831,959.44	1.77
H	批发和零售贸易	3,245,308.22	0.34
I	金融、保险业	448,077,379.04	46.99
J	房地产业	56,940,304.57	5.97
K	社会服务业	6,434,724.70	0.67
L	传播与文化产业	-	-

M	综合类	6,023,965.66	0.63
	合计	889,744,437.37	93.31

8.3 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	600036	招商银行	4,685,002	55,610,973.74	5.83
2	600016	民生银行	8,557,448	50,403,368.72	5.29
3	601318	中国平安	1,269,372	43,717,171.68	4.58
4	601328	交通银行	8,674,373	38,861,191.04	4.08
5	600000	浦发银行	4,240,154	35,998,907.46	3.78
6	601166	兴业银行	2,860,453	35,812,871.56	3.76
7	601088	中国神华	1,249,505	31,649,961.65	3.32
8	000002	万科A	3,667,386	27,395,373.42	2.87
9	600030	中信证券	2,609,160	25,334,943.60	2.66
10	601288	农业银行	8,895,400	23,305,948.00	2.44
11	601601	中国太保	1,190,873	22,876,670.33	2.40
12	600050	中国联通	3,212,206	16,831,959.44	1.77
13	601006	大秦铁路	2,252,970	16,807,156.20	1.76
14	601668	中国建筑	5,682,834	16,537,046.94	1.73
15	601939	建设银行	3,634,566	16,500,929.64	1.73
16	601169	北京银行	1,651,513	15,326,040.64	1.61
17	000001	深发展A	970,539	15,130,703.01	1.59
18	600015	华夏银行	1,297,558	14,571,576.34	1.53
19	600048	保利地产	1,352,239	13,522,390.00	1.42
20	601818	光大银行	4,595,707	13,235,636.16	1.39
21	601857	中国石油	1,344,969	13,099,998.06	1.37
22	000651	格力电器	747,183	12,918,794.07	1.35
23	000157	中联重科	1,664,383	12,799,105.27	1.34
24	600585	海螺水泥	757,677	11,857,645.05	1.24
25	600900	长江电力	1,813,758	11,535,500.88	1.21
26	600028	中国石化	1,577,465	11,326,198.70	1.19
27	601628	中国人寿	568,312	10,025,023.68	1.05
28	600104	上海汽车	700,269	9,901,803.66	1.04
29	600019	宝钢股份	1,990,307	9,652,988.95	1.01
30	000338	潍柴动力	286,696	9,030,924.00	0.95
31	600383	金地集团	1,694,031	8,385,453.45	0.88
32	600795	国电电力	2,916,106	8,135,935.74	0.85

33	601988	中国银行	2,641,218	7,712,356.56	0.81
34	601699	潞安环能	348,663	7,377,709.08	0.77
35	601009	南京银行	787,404	7,307,109.12	0.77
36	601898	中煤能源	693,398	6,247,515.98	0.66
37	000709	河北钢铁	2,011,412	5,752,638.32	0.60
38	000402	金融街	917,436	5,550,487.80	0.58
39	600690	青岛海尔	610,325	5,450,202.25	0.57
40	600123	兰花科创	129,852	5,048,645.76	0.53
41	600188	兖州煤业	224,318	5,022,480.02	0.53
42	600642	申能股份	1,074,863	4,933,621.17	0.52
43	601390	中国中铁	1,942,690	4,895,578.80	0.51
44	600660	福耀玻璃	607,057	4,868,597.14	0.51
45	600177	雅戈尔	506,120	4,747,405.60	0.50
46	601666	平煤股份	447,285	4,727,802.45	0.50
47	000783	长江证券	628,886	4,496,534.90	0.47
48	600009	上海机场	365,014	4,467,771.36	0.47
49	600005	武钢股份	1,529,608	4,420,567.12	0.46
50	601186	中国铁建	1,166,264	4,420,140.56	0.46
51	601117	中国化学	747,523	4,260,881.10	0.45
52	601998	中信银行	1,042,720	4,212,588.80	0.44
53	000039	中集集团	326,747	4,198,698.95	0.44
54	600150	中国船舶	160,675	4,161,482.50	0.44
55	601111	中国国航	631,095	4,020,075.15	0.42
56	002142	宁波银行	436,971	4,002,654.36	0.42
57	601991	大唐发电	757,355	3,907,951.80	0.41
58	600029	南方航空	798,163	3,783,292.62	0.40
59	601333	广深铁路	1,070,720	3,768,934.40	0.40
60	600741	华域汽车	391,496	3,625,252.96	0.38
61	600881	亚泰集团	717,905	3,402,869.70	0.36
62	600115	东方航空	884,549	3,361,286.20	0.35
63	600066	宇通客车	137,761	3,259,425.26	0.34
64	601808	中海油服	224,354	3,250,889.46	0.34
65	600166	福田汽车	559,487	3,250,619.47	0.34
66	600153	建发股份	508,669	3,245,308.22	0.34
67	000825	太钢不锈	863,178	3,219,653.94	0.34
68	000898	鞍钢股份	698,788	3,179,485.40	0.33
69	000728	国元证券	372,058	3,162,493.00	0.33
70	601001	大同煤业	253,515	3,082,742.40	0.32
71	000528	柳工	247,384	2,886,971.28	0.30
72	600219	南山铝业	446,014	2,823,268.62	0.30
73	000800	一汽轿车	308,272	2,728,207.20	0.29

74	002001	新 和 成	137,500	2,703,250.00	0.28
75	000625	长安汽车	712,427	2,692,974.06	0.28
76	600160	巨化股份	134,200	2,690,710.00	0.28
77	600664	哈药股份	366,972	2,689,904.76	0.28
78	600649	城投控股	435,398	2,621,095.96	0.27
79	600395	盘江股份	125,388	2,589,262.20	0.27
80	601918	国投新集	210,304	2,340,683.52	0.25
81	000778	新兴铸管	363,086	2,320,119.54	0.24
82	601018	宁波港	969,947	2,318,173.33	0.24
83	601866	中海集运	901,536	2,190,732.48	0.23
84	600808	马钢股份	874,671	2,169,184.08	0.23
85	600008	首创股份	416,768	2,167,193.60	0.23
86	600266	北京城建	168,410	2,086,599.90	0.22
87	600508	上海能源	109,528	2,051,459.44	0.22
88	600418	江淮汽车	341,751	2,036,835.96	0.21
89	600216	浙江医药	102,346	2,035,661.94	0.21
90	600221	海南航空	447,888	2,006,538.24	0.21
91	000027	深圳能源	300,432	1,832,635.20	0.19
92	000059	辽通化工	227,444	1,728,574.40	0.18
93	600098	广州控股	234,020	1,617,078.20	0.17
94	600971	恒源煤电	113,626	1,503,271.98	0.16
95	600183	生益科技	207,346	1,497,038.12	0.16
96	600026	中海发展	239,683	1,418,923.36	0.15
97	601233	桐昆股份	109,500	1,284,435.00	0.13
98	600307	酒钢宏兴	310,036	1,165,735.36	0.12
99	600170	上海建工	131,414	1,165,642.18	0.12
100	601555	东吴证券	63,310	415,946.70	0.04
101	601336	新华保险	2,000	55,740.00	0.01
102	300284	苏交科	500	6,650.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	600036	招商银行	38,597,053.45	6.09
2	601318	中国平安	35,325,608.48	5.57
3	000002	万 科 A	33,363,727.63	5.26
4	600016	民生银行	31,880,550.88	5.03

5	600000	浦发银行	26,392,615.69	4.16
6	601166	兴业银行	26,208,896.22	4.13
7	601328	交通银行	24,392,669.25	3.85
8	601668	中国建筑	23,720,118.54	3.74
9	601288	农业银行	22,892,132.00	3.61
10	601088	中国神华	22,364,481.59	3.53
11	600837	海通证券	21,802,199.94	3.44
12	600030	中信证券	20,949,209.24	3.30
13	601117	中国化学	19,906,310.53	3.14
14	600585	海螺水泥	16,892,390.70	2.66
15	601601	中国太保	16,175,110.05	2.55
16	000157	中联重科	14,264,792.28	2.25
17	600048	保利地产	13,870,042.73	2.19
18	601818	光大银行	13,818,597.99	2.18
19	601006	大秦铁路	11,440,441.36	1.80
20	600383	金地集团	11,142,014.10	1.76

8.4.2 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	600837	海通证券	26,142,469.09	4.12
2	601117	中国化学	15,889,752.75	2.51
3	600036	招商银行	13,168,235.43	2.08
4	601318	中国平安	12,130,637.03	1.91
5	600016	民生银行	11,143,717.10	1.76
6	600585	海螺水泥	10,058,082.78	1.59
7	600999	招商证券	9,816,218.41	1.55
8	601166	兴业银行	9,180,595.21	1.45
9	600895	张江高科	9,122,093.77	1.44
10	600000	浦发银行	8,964,175.94	1.41
11	600348	阳泉煤业	8,590,365.02	1.35
12	601088	中国神华	7,655,617.10	1.21
13	600795	国电电力	7,546,950.37	1.19
14	600030	中信证券	7,071,943.42	1.11
15	601328	交通银行	6,736,604.79	1.06
16	000425	徐工机械	5,812,024.06	0.92
17	601788	光大证券	5,657,871.03	0.89
18	601601	中国太保	5,552,444.38	0.88
19	000937	冀中能源	5,265,323.02	0.83
20	601919	中国远洋	4,845,005.33	0.76

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	835,113,642.79
卖出股票的收入（成交）总额	338,088,592.49

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。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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。

8.9.2 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。

8.9.3 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	345,910.51
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	12,516.07

5	应收申购款	17,415,434.55
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,773,861.13

8.9.4 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。

8.9.5 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情况。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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
12,448	109,517.27	725,146,797.46	53.19%	638,124,129.36	46.81%

9.2 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	493,018.43	0.04%

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	759,068,852
本报告期基金总申购份额	826,641,685.04
减：本报告期基金总赎回份额	222,439,610.22
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,363,270,926.82

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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、袁恩桢、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、经本基金管理人股东会 2011 年第三次会议审议通过，同意外方股东提名的监事由塚原健二先生变更为正冈利之先生。

4、经本基金管理人第一届董事会 2011 年第二次会议审议通过，聘任于东升先生担任公司总经理职务。具体内容请参考本基金管理人于 2011 年 11 月 30 日发布的《申万菱信基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告》。

5、经本基金管理人第一届董事会 2011 年第二次会议审议通过，聘任欧庆铃先生担任公司副总经理职务。具体内容请参考本基金管理人于 2011 年 12 月 24 日发布的《申万菱信基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告》。

6、报告期内本基金基金托管人无重大人事变动。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金聘用普华永道中天会计师事务所有限公司负责基金审计事务，未发生改聘会计师事务所事宜。自本基金合同生效以来，普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金提供审计服务时间为 2 年。报告期内本基金应支付普华永道中天会计师事务所有限公司审计费 70000 元。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

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	
长江证券	1	385,581,225.46	32.95%	327,741.98	33.18%	-
申银万国	2	213,108,310.59	18.21%	181,005.51	18.33%	-
西部证券	1	130,628,895.78	11.16%	111,034.58	11.24%	-
红塔证券	1	107,281,065.65	9.17%	91,189.16	9.23%	-
瑞银证券	1	66,621,157.51	5.69%	56,627.63	5.73%	新增
国金证券	1	56,234,298.00	4.80%	47,798.20	4.84%	-
招商证券	1	49,141,269.35	4.20%	39,927.70	4.04%	-
国信证券	1	41,669,252.79	3.56%	33,856.36	3.43%	-
海通证券	2	27,909,532.63	2.38%	23,494.66	2.38%	-
国泰君安	2	26,394,422.05	2.26%	21,446.04	2.17%	-
中金公司	1	20,079,778.79	1.72%	16,314.93	1.65%	-
华泰联合	1	14,179,564.97	1.21%	11,520.97	1.17%	-
中信证券	1	12,424,236.17	1.06%	10,094.86	1.02%	-
光大证券	1	8,211,392.77	0.70%	6,671.71	0.68%	-
广发证券	1	7,628,513.74	0.65%	6,198.35	0.63%	新增
民生证券	1	2,004,362.40	0.17%	1,628.64	0.16%	新增

中信建投	1	1,260,893.93	0.11%	1,071.74	0.11%	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
北京高华	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-

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。

11.8 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》、	2011-04-01

		《证券时报》、《证券日报》	
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
30	关于旗下开放式基金新增东吴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》	2011-09-16
31	申万菱信沪深 300 价值指数基金招募说明书第三次更新（摘要）	《中国证券报》、《证券时报》	2011-09-24

32	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2011-09-29
33	关于恢复对旗下基金持有的南岭民爆股票进行市价估值的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2011-10-21
34	申万菱信沪深 300 价值指数证券投资基金 2011 年第三季度报告	《中国证券报》、《证券时报》	2011-10-25
35	关于基金行业高级管理人员变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2011-11-30
36	关于停止办理开放式基金账户类分红方式业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2011-12-07
37	关于旗下开放式基金新增中信万通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》	2011-12-14
38	关于基金行业高级管理人员变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2011-12-24
39	关于旗下部分开放式基金继续参加华夏银行开展的基金网银和定投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》	2011-12-29
40	关于旗下部分开放式基金继续参加深圳发展银行开展的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》	2011-12-29
41	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2011-12-29
42	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-华帝股份	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2011-12-29
43	关于旗下部分开放式基金继续参加中国工商银行开展的“2012 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》	2011-12-30

§ 12 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%。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《基金管理人名称、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。

§ 13 备查文件目录

13.1 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。

13.2 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：中国上海市淮海中路 300 号香港新世界大厦 40 层。

13.3 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.

申万菱信基金管理有限公司
二〇一二年三月二十六日