

# 申万菱信沪深 300 价值指数证券投资基金 招募说明书（第六次更新）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 2013 年 1 月 31 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2012 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

成立日期：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：持续经营

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，工商管理硕士，高级经济师。1980 年起从事金融相关工作，先后任职于中国人民银行上海市分行，中国工商银行上海市分行组织处，上海申银证券有限公司，申银万国证券股份有限公司，申银万国（香港）有限公司。2004 年至今任申万菱信基金管理有限公司（原申万巴黎基金管理管理有限公司）董事长。

杜平先生，董事，法学硕士，经济师。1989 年至 1993 年先后任职于湖北省武汉市政府政策研究室，湖北省武汉市政府办公厅；1993 年起从事金融相关工作，曾先后任职于交通银行总行秘书处、深圳分行，新加坡分行。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。

刘郎先生，董事，硕士研究生，副教授。曾在湖南邵阳学院和东南大学任教。1994 年

起从事金融相关工作，先后在泰阳证券公司任公司、万联证券任公司总裁。2006年6月至2007年1月在广州城市商学院担任主任。2007年1月至8月在大通证券公司任副总经理。2007年9月至今任申银万国证券股份有限公司副总裁。

宫永宪一先生，董事，日本籍。1982年4月至今在三菱UFJ信托银行株式会社任职，历任综合企划部副部长，经营企划部副部长，投资企划部副部长等职。现任三菱UFJ信托银行株式会社执行董事并兼任海外资产管理事业部部长。

陈志成先生，董事，日本籍。1990年7月至今在三菱UFJ信托银行株式会社任职，历任中国业务科员、中国业务科长、上海代表处首席代表，现任北京代表处首席代表。

冯根福先生，独立董事，经济学博士，博士生导师，二级教授。曾在陕西财经学院工作，历任陕西财院学报主编、陕西财院工商学院院长。2000年5月至今在西安交通大学经济与金融学院担任院长。

张军建先生，独立董事，博士研究生，教授。曾在四川外国语大学、日本长崎县立大学、日本千叶大学、早稻田大学任教；此后曾任职于日本菱南开发株式会社。2001年至今在中南大学任法学院教授，中日经济法研究所所长，中南大学信托与信托法研究中心主任；中国银行法学研究会常务理事；中美法律交流基金会信托法委员会副主席。

阎小平先生，独立董事，硕士研究生，高级经济师。1969年开始工作，1984年进入金融行业，曾先后任职于中国工商银行总行、工商银行北京市分行等。2009年1月起退休。

李秀仑先生，独立董事，大学本科学历，高级经济师。1969年开始工作，曾先后任职于中国工商银行、上海农村信用合作社联合社、上海农村商业银行；2009年1月至12月在市金融党委科学发展观活动任指导检查组二组组长；2010年1月起退休。

## (2) 监事会成员

蒋元真先生，监事会主席，高级会计师、高级经济师。曾任职于上海市财政局、上海市财税二分局、上海市税务局、上海国际信托投资公司、上海国际集团有限公司等单位，2010年中至今在申银万国证券股份有限公司任党委委员、监事会主席。

代田秀雄先生，监事，日本籍。1985年4月至今任职于三菱UFJ信托银行株式会社(原

三菱信托银行), 历任投资企划部次长等职务, 其中 2008 年 6 月至 2012 年 5 月曾任职于三菱日联资产管理有限公司, 2012 年 6 月起任三菱 UFJ 信托银行株式会社投资企划部部长。

王菲萍女士, 监事, 硕士研究生。曾在申银万国证券股份有限公司总裁办任法律顾问等职务, 2004 年加入申万菱信基金管理有限公司(原申万巴黎基金管理有限公司), 现任监察稽核总部总监。王菲萍女士具备基金从业资格。

### (3) 高级管理人员

姜国芳先生, 代任公司总经理, 相关介绍见董事会成员部分。

过振华先生, 公司副总经理, 工商管理硕士。曾任职于中国工商银行上海分行、上海申银证券公司、申万泛达投资管理(亚洲)有限公司、申银万国证券股份有限公司等。2004 年加入申万菱信基金管理有限公司(原申万巴黎基金管理管理有限公司), 曾任公司督察员, 现任公司副总经理。

欧庆铃先生, 公司副总经理, 理学博士, 曾在华南理工大学应用数学系任教, 此后曾任职于广州证券有限责任公司、金鹰基金管理有限公司和万家基金管理有限公司。2011 年 8 月加入申万菱信基金管理有限公司, 现任公司副总经理、申万菱信新动力、申万菱信消费增长基金经理。

### (4) 督察长

来肖贤先生, 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

张少华先生, 复旦大学数量经济学硕士。曾任职于申银万国证券, 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, 后正式加入本公司, 历任风险管理总部高级风险分析师、风险管理总部副总监、总监, 投资管理总部副总监, 现任申万菱信沪深 300 价值指数、申万菱信深证成指分级、申万菱信量化小盘, 申万菱信中小板指数分级基金经理。

魏立先生, 2010 年 2 月至 2011 年 4 月任本基金基金经理。

## (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：总经理、公司分管投资的副总经理、投资管理总部总监、研究总监、基金经理代表等。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：董事长、副总经理、督察长、监察稽核总部总监、风险管理总部总监和市场营销总部总监。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。

本公司总经理担任投资决策委员会主席，分管投资的副总经理担任投资决策委员会会议召集人，投资管理总部总监担任投资决策委员会秘书，负责协调统筹投资决策委员会的各项事宜。

## (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 349,018,545,827 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 李濮君

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：王均山

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：张建国（代行）

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：蒋超良

联系人：刘一宁

电话：010-85108227

传真：010-85109219

客户服务电话：95599

网址：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：陈铭铭

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、于慧

客户服务热线：95528

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

**(6) 名称：中国民生银行股份有限公司**

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市西城区西长安街 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：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)

**(10) 名称：平安银行股份有限公司**

注册办公所：广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号

法定代表人：肖遂宁

联系人：张莉

传真：(0755) 82080406

客户服务电话：95511

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



**(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：中信建投证券股份有限公司**

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：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：万建华

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：陈有安

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

**(18) 名称：广发证券股份有限公司**

注册地址：广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼（4301-4316 房）

办公地址：广东省广州天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、39、41、

42、43、44 楼

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

统一客户服务热线：95575 或致电各地营业网点

公司网站：广发证券网 <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](http://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](http://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](http://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](http://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

**(27) 名称：中国民族证券有限责任公司**

公司名称：中国民族证券有限责任公司

注册地址：北京市西城区金融街5号新盛大厦A座6-9层

办公地址：北京市西城区金融街5号新盛大厦A座6-9层

邮政编码：100140

法定代表人：赵大建

联系人：李微

客服电话：400-889-5618

公司网站：www.e5618.com

**(28) 名称：安信证券股份有限公司**

注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元

办公地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元

深圳市福田区深南大道2008号中国凤凰大厦1栋9层

法定代表人：牛冠兴

传真：0755-82558355

联系人：余江

统一客服电话：4008001001

公司网站地址：www.essence.com.cn

**(29) 名称：中信证券股份有限公司**

住所：广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦第A层

办公地址：北京朝阳区新源南路6号京城大厦

法定代表人：王东明

电话：010-84588266

传真：010-84865560

联系人：陈忠

网址: [www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

**(30) 名称: 东吴证券股份有限公司**

住所: 苏州工业园区翠园路 181 号商旅大厦 17—21 层

法定代表人: 吴永敏

联系人: 方晓丹

电话: 0512 65581136

传真: 0512 65588021

客服电话: 0512 33396288

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

**(31) 名称: 中信万通证券有限责任公司**

注册地址: 青岛市崂山区苗岭路 2 9 号澳柯玛大厦 1 5 层

办公地址: 青岛市崂山区深圳路 2 2 2 号青岛国际金融广场 1 号楼第 2 0 层

法定代表人: 张智河

联系人: 吴忠超

客户服务电话: 0532-96577

传真: 0532-85022605

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

**(32) 名称: 红塔证券股份有限公司**

注册地址: 昆明市北京路 155 号附 1 号红塔大厦 9 楼

办公地址: 昆明市北京路 155 号附 1 号红塔大厦 9 楼

法定代表人: 况雨林

联系人: 高国泽

客户服务电话: 0871-3577930

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

**(33) 名称: 中信证券(浙江)有限责任公司**

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

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

法定代表人: 沈强

联系人：周研

传真：0571-87696598

客户服务电话：0571-96598

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

**(34) 名称：华融证券股份有限公司**

注册地址：北京市西城区月坛北街 26 号

办公地址：北京市西城区金融大街 8 号 A 座 3、5 层

法定代表人：丁之锁

联系人：梁宇

传真：010-58568062

客户服务电话：010-58568118

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

**(35) 名称：天风证券股份有限公司**

注册地址：中国湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦四楼

办公地址：武汉市江汉区唐家墩路 32 号国资大厦 B 座四楼

法定代表人：余磊

联系人：翟璟

传真：027-87618863

客服电话：028-86711410

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

**(36) 名称：华宝证券有限责任公司**

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 57 层

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 57 层

代表法人：陈林

联系人：汪明丽

传真：021-68777723

客服电话：400-820-9898

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

**(37) 名称：杭州数米基金销售有限公司**

注册地址：杭州市余杭区仓前街道海曙路东 2 号

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人：陈柏青

联系人：周燕漫

传真：0571-26698533

客户服务电话：4000766123

公司网址：[www.fund123.com](http://www.fund123.com)

**(38) 名称：上海好买基金销售有限公司**

注册地址：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室

法定代表人：杨文斌

联系人：张茹

客服电话：400-700-9665

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

**(39) 名称：上海长量基金销售投资顾问有限公司**

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人：张跃伟

联系人：沈雯斌

联系电话 021-58788678-8201

传真：021-58787698

客服电话：400-089-1289

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

**(40) 名称：深圳众禄基金销售有限公司**

注册（办公）地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

法定代表人：薛峰

联系人：汤素娅



电话：0755—33227953

传真：0755—82080798

客户服务电话：4006—788—887

网址：众禄基金网 [www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn)

基金买卖网 [www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

**(41) 名称：浙江同花顺基金销售有限公司**

注册办公地址：杭州市西湖区文二西路1号元茂大厦903室

法定代表人：李晓涛

联系人：杨翼

传真：(0571) 86800423

客户服务电话：(0571) 88920897

网站：[www.ijijin.cn](http://www.ijijin.cn)

**(42) 名称：诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司**

注册地址：上海市金山区廊下镇漕廊公路7650号205室

法定代表人：汪静波

联系人：方成

传真：021-38509777

客户服务电话：400-821-5399

网址：[www.noah-fund.com](http://www.noah-fund.com)

**(43) 名称：上海天天基金销售有限公司**

注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层

法定代表人：其实

联系人：潘世友

电话：021-54509998

传真：021-64385308

客户服务电话：400-1818-188

网址：[www.1234567.com.cn](http://www.1234567.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：李濮君

## **(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 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

法定代表人姓名：杨绍信

电话：+86 -21-23238888

传真：+86-21-23238800

联系人姓名：王灵

经办注册会计师姓名：薛竞、王灵

## **四、基金的名称**

本基金的名称：申万菱信沪深 300 价值指数证券投资基金

## 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 2012 年 12 月 31 日，本报告中所列财务数据未经审计。

### 1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	772,401,703.49	92.89
	其中：股票	772,401,703.49	92.89
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	13,000,000.00	1.56
	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	45,267,612.22	5.44
6	其他各项资产	888,181.13	0.11
7	合计	831,557,496.84	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	63,986,731.03	7.71
C	制造业	154,572,044.39	18.63
C0	食品、饮料	1,794,300.91	0.22
C1	纺织、服装、皮毛	2,908,479.80	0.35
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	9,618,932.85	1.16
C5	电子	5,198,622.00	0.63
C6	金属、非金属	43,402,089.54	5.23
C7	机械、设备、仪表	82,060,581.81	9.89
C8	医药、生物制品	9,589,037.48	1.16
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	32,567,653.87	3.93
E	建筑业	31,202,749.95	3.76
F	交通运输、仓储业	30,930,558.90	3.73
G	信息技术业	8,177,809.50	0.99
H	批发和零售贸易	4,425,038.78	0.53
I	金融、保险业	376,154,025.59	45.33
J	房地产业	61,031,557.93	7.36
K	社会服务业	4,480,656.56	0.54
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	4,872,876.99	0.59
	合计	772,401,703.49	93.09

### 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	600036	招商银行	3,894,702	53,552,152.50	6.45
2	600016	民生银行	6,224,621	48,925,521.06	5.90

3	601318	中国平安	923,317	41,817,026.93	5.04
4	601166	兴业银行	2,080,740	34,727,550.60	4.19
5	600000	浦发银行	3,084,279	30,596,047.68	3.69
6	000002	万科A	2,700,220	27,326,226.40	3.29
7	601328	交通银行	5,408,315	26,717,076.10	3.22
8	600030	中信证券	1,897,900	25,355,944.00	3.06
9	601088	中国神华	908,910	23,040,868.50	2.78
10	601601	中国太保	866,235	19,490,287.50	2.35

#### 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	307,144.03
2	应收证券清算款	8,323.60
3	应收股利	-
4	应收利息	10,469.77
5	应收申购款	562,243.73
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	888,181.13

#### 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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000002	万科A	27,326,226.40	3.29	公告重大事项

## 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①	基金份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2010年2月11日（基金合同生效日）至2010年12月31日	-16.40%	1.52%	-12.50%	1.56%	-3.90%	-0.04%
2011年度	-16.39%	1.24%	-17.07%	1.24%	0.68%	0.00%
2012年度	14.59%	1.11%	12.50%	1.11%	2.09%	0.00%
自基金合同生	-19.90%	1.29%	-18.37%	1.31%	-1.53%	-0.02%

效起至 2012 年 12 月 31 日						
-------------------------	--	--	--	--	--	--

注：上述基金业绩指标已扣除了基金的管理费、托管费和各项交易费用，但不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：申购费、赎回费等），计入认购或交易基金的各项费用后，实际收益水平要低于所列数字。

## 2.自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

### 申万菱信沪深 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 2012 年 12 月 31 日）



## 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、更新了基金管理人的部分信息；
- 2、更新了基金托管人的部分信息；
- 3、更新了代销机构的部分信息；
- 4、更新了投资组合报告，数据截止日期为 2012 年 12 月 31 日；
- 5、更新了基金的业绩部分，数据截止日期为 2012 年 12 月 31 日；

6、在“其他应披露事项”一章，列举了本基金自 2012 年 9 月 1 日至 2013 年 1 月 31 日发布的有关公告。

## 十四、其它应披露事项

自 2012 年 9 月 1 日至 2013 年 1 月 31 日，与本基金和本基金管理人有关的公告如下：

1、2012 年 9 月 6 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投资光明乳业非公开发行股票的公告。

2、2012 年 9 月 12 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、2012 年 9 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。

4、2012 年 9 月 25 日，刊登于《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》的本基金招募说明书第五次更新（摘要）。

5、2012 年 10 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》的本公司关于旗下开放式基金新增深圳众禄基金销售有限公司为代销机构并实施申购费率优惠的公告。

6、2012 年 10 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》的本公司关于旗下开放式基金新增浙江同花顺基金销售有限公司为代销机构并实施申购费率优惠的公告。

7、2012 年 10 月 23 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平安银行股份有限公司为代销机构并实施申购费率优惠的公告。

8、2012 年 10 月 24 日，刊登于《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》的本基金 2012 年第 3 季度报告。

9、2012 年 11 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》的本公司关于旗下基金对长期停牌的股票变更估值方法的提示性公告。

10、2012 年 12 月 12 日，刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》的本公司关于开通支付宝账户进行网上直销业务的公告。

11、2012 年 12 月 21 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诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司为代销机构的公告。

12、2012 年 12 月 28 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工商银行开展的“2013 倾心回馈”基金定投优惠活动的公告。

13、2012 年 12 月 28 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 2013 年开始停止使用第一代身份证办理基金业务的公告。

14、2012 年 12 月 28 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平安银行开展的基金申购费率优惠活动的公告。

15、2012 年 12 月 28 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信建投证券开展的基金申购费率优惠活动的公告。

16、2012 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》的本公司关于停止受理第一代居民身份证办理基金业务的公告。

17、2013 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 2012 年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。

18、2013 年 1 月 5 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。

19、2013 年 1 月 9 日，刊登于《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》的本基金关于修改《申万菱信沪深 300 价值指数证券投资基金基金合同》的公告。

20、2013 年 1 月 15 日，刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》的本公司关于在广发证券股份有限公司开通旗下部分开放式基金定期定额投资业务并实施定期定额申购费率优惠活动的公告。

21、2013 年 1 月 22 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万科 A 股票进行市价估值的公告。

22、2013 年 1 月 22 日，刊登于《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》的本基金 2012 年第 4 季度报告。

23、2013 年 1 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上海天天基金销售有限公司为代销机构并实施申购费率优惠的公告。

24、2013 年 1 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上海天天基金销售有限公司为代销机构并实施申购费率优惠的

公告。

签署日期： 2013 年 3 月 13 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

2013 年 3 月 28 日