

# 申万菱信沪深 300 指数增强型证券投资基金 招募说明书第一次更新（摘要）

基金管理人：申万菱信基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

## 【重要提示】

- 本基金由原申万菱信盛利强化配置混合型证券投资基金转型而来。《关于申万菱信盛利强化配置混合型证券投资基金转型有关事项的议案》经 2013 年 5 月 2 日申万菱信盛利强化配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会决议通过，并获中国证监会证监许可【2013】748 号文核准。由《申万菱信盛利强化配置混合型证券投资基金基金合同》修订而成的《申万菱信沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》已于 2013 年 6 月 7 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 12 月 7 日，有关基金的财务数据和净值表现截止日为 2013 年 9 月 30 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：壹亿伍仟万元人民币

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。

原田义久先生，董事，日本籍，大学学历。1987 年 4 月至今在三菱 UFJ 信托银行株式会社任职，曾任投资企划部次长、海外资产管理部副部长。现任三菱 UFJ 信托银行株式会社海外资产管理部部长。

陈志成先生，董事，日本籍，大学学历。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，大学学历，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，大学学历。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, 董事长, 相关介绍见董事会成员部分内容。

过振华先生, 公司总经理, 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、副总经理, 现任公司总经理。

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

刘忠勋先生, 上海大学金融学硕士, 曾任职于华泰证券股份有限公司, 2008 年加入本公司, 历任金融工程师, 产品与金融工程总部总监助理, 副总监(主持工作)。现任申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)基金经理、申万菱信沪深 300 指数增强型证券投资基金基金经理。

古平先生, 原盛利强化配置基金基金经理, 原盛利强化配置基金转型后于 2013 年 6 月 7 日—2013 年 6 月 26 日任本基金基金经理。

### 6、投资决策委员会委员名单

本委员会由以下人员组成: 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。

公司分管投资的副总经理为本委员会主席，分管投资的副总经理或其被授权人为本委员会召集人，投资管理总部总监或其被授权人为本委员会秘书，负责协调统筹本委员会的各项事宜。

本公司董事长、总经理、督察长、监察稽核总部总监、风险管理总部总监作为非执行委员，有权列席本委员会的任何会议。非执行委员不参与投票表决。

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

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

成立时间：1984 年 1 月 1 日

法定代表人：姜建清

注册资本：人民币 349,018,545,827 元

联系电话：010-66105799

联系人：赵会军

## 三、相关服务机构

### （一）基金份额销售机构

#### 1、直销机构

申万菱信基金管理有限公司直销中心

住所：上海市淮海中路 300 号香港新世界大厦 40 层

法定代表人：姜国芳

电话：+86 21 23261188

传真：+86 21 23261199

联系人：陈继红、李濮君

客户服务电话：400 880 8588（免长途话费）或 +86 21 962299

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

电子邮件：[service@swsmu.com](mailto:service@swsmu.com)

## 2、代销机构

(1)名称：中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

客户服务电话：95588

传真：010-66107738

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

(2)名称：中国建设银行股份有限公司

法定代表人：王洪章

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

(4)名称：交通银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

电话：021-58781234

传真：021-58408483

联系人：曹榕

客户服务电话：95559

网址：[www.bankcomm.com](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：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：董文标

客服电话：95568

联系人：陈翥

传真：010-57092611

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

客服电话：95558

联系人：金蕾

传真：010-65550827

网址：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

(9)名称：平安银行股份有限公司

注册办公所：广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号

法定代表人：孙建一

联系人：张莉

传真：021-50979507

客户服务电话：95511-3

网址：bank.pingan.com

(10)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

(11)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：储晓明

传真：021-33388224

联系人：高夫

客服电话：021-95523

公司网站：www.sywg.com

(12)名称：中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

联系人：权唐

开放式基金咨询电话：400-8888-108

开放式基金业务传真：010-65182261

公司网站：www.csc108.com

(13)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

(14)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：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：万建华

电话：021-38676666

传真：021-38670666

客户服务热线：400-8888-666

(15)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：0755-82943636

联系人：林生迎

客户服务热线：4008888111、95565

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

(16)名称：中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈有安

客户服务热线：4008888888

传真：010-66568990

联系人：田薇

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

(17)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 [www.gf.com.cn](http://www.gf.com.cn)

(18)名称：光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闸路 1508 号

法定代表人：袁长清（代行）

联系人：刘晨、李芳芳

客户服务电话：4008888788、10108998

传真：021-68815009

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

(19)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：潘鑫军

联系人：吴宇

传真：021-63326173

客户服务电话：021-95503

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

(20)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)

(21)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

(22)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

(23)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：0755-82133952

客户服务电话：95536

网址：www.guosen.com.cn

(24)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)

(25)名称：国联证券股份有限公司

注册地址：江苏省无锡市县前东街 168 号

法定代表人：雷建辉

联系人：徐欣

传真：0510-82830162

客户服务电话：4008885288

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

(26)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](http://www.e5618.com)

(27)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](http://www.essence.com.cn)

(28)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)

(29)名称：东吴证券股份有限公司

住所：苏州工业园区星阳街 5 号东吴证券大厦

法定代表人：吴永敏

联系人：方晓丹

电话：0512-65581136

传真：0512-65588021

客服电话：4008601555

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

(30)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 29 号澳柯玛大厦 15 层

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层

法定代表人：杨宝林

联系人：吴忠超

客户服务电话：95548

传真：0532-85022605

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

(31)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)

(32)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：沈强传真：0571-87696598

客户服务电话：95548

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

(33)名称：华融证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 8 号

办公地址：北京市西城区金融大街 8 号

法定代表人：祝献忠

联系人：黄恒

联系电话：010-58568235

传真：010-58568062

客户服务电话：010-58568118

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

(34)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)

(35)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：刘闻川

传真：021-68778790

客服电话：400-820-9898

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

(36)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：张裕

传真：0571-26698533

客户服务电话：4000766123

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

(37)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)

(38)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：敖玲

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)

(39)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：童彩平

电话：0755-33227950

传真：0755-82080798

客户服务电话：4006-788-887

网址：众禄基金网 [www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn)，基金买卖网 [www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

(40)名称：浙江同花顺基金销售有限公司

注册办公地址：杭州市西湖区文二西路 1 号元茂大厦 903 室

法定代表人：凌顺平

联系人：杨翼

传真：0571-86800423

客户服务电话：4008-773-772，0571-88920897

网站：[www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

(41)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)

(42)名称：上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 9 楼

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)

(43)名称：北京展恒基金销售有限公司

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

法定代表人：闫振杰

联系人：宋丽冉

电话：010-62020088

传真：010-62020355

客服电话：4008886661

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

(44)名称：和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

联系人：严跃俊

电话：021-20835788

传真：021-20835879

客服电话：400-920-0022/ 021-20835588

网址：licaikexun.com

3、基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并予以公告。

#### （二）登记机构

名称：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 63353879

联系人：李濮君

#### （三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

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

联系人：安冬

经办律师：吕红、安冬

#### （四）审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

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: 王灵

经办注册会计师: 薛竞、王灵

## 四、基金名称

申万菱信沪深 300 指数增强型证券投资基金由申万菱信盛利强化配置混合型证券投资基金转型而成。

申万菱信盛利强化配置混合型证券投资基金于 2004 年 10 月 13 日经中国证监会证监基金字【2004】158 号文核准募集, 基金合同于 2004 年 11 月 29 日生效, 基金托管人为中国工商银行股份有限公司。申万菱信盛利强化配置混合型证券投资基金为争取绝对收益概念的基金产品, 以争取超越同期银行一年期定期存款利率为投资目标。其投资管理禀承主动型投资管理模式, 并采用基于投资组合保险策略开发的资产再平衡模型。在积极主动和深入的宏观研究分析和判断的基础上, 结合本基金管理人自主开发的主动式资产配置模型进行一级资产配置, 并参考选时模型判断市场走势而决定是否调整投资组合或进行融资以适当扩大固定收益证券的投资规模。

2013 年 5 月 2 日申万菱信盛利强化配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会以通讯方式召开, 基金份额持有人大会审议并通过了《关于申万菱信盛利强化配置混合型证券投资基金转型有关事项的议案》, 经中国证监会核准, 基金份额持有人大会决议生效。根据基金份额持有人大会决议, 申万菱信盛利强化配置混合型证券投资基金转型为申万菱信沪深 300 指数增强型证券投资基金。

《申万菱信沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》和《申万菱信沪深 300 指数增强型证券投资基金托管协议》自 2013 年 6 月 7 日起正式生效, 原《申万菱信盛利强化配置混合型证券投资基金基金合同》和《申万菱信盛利强化配置混合型证券投资基金托管协议》自同一起失效。

## 五、基金类型

本基金的类型: 契约型开放式

## 六、投资目标

本基金为增强型指数基金，通过数量化的投资方法与严格的投资纪律约束，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%，同时力求实现超越标的指数的业绩表现，谋求基金资产的长期增值。

## 七、投资范围

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、权证、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例：本基金投资于股票资产不低于基金资产净值的 80%，其中，投资于沪深 300 指数成份股、备选成份股的资产占股票资产的比例不低于 80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保证现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。

## 八、投资策略

本基金在指数化投资的基础上通过数量化模型进行投资组合优化，在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下，力争获得超越标的指数的投资收益。

### （一）股票投资策略

#### 1、指数化投资策略

本基金将运用指数化的投资方法，通过控制对各成份股在标的指数中权重的偏离，实现跟踪误差控制目标，达到对标的指数的跟踪目标。

#### 2、指数增强策略

本基金主要通过申万菱信开发的企业价值评估模型、分析师预期模型与阿尔法等模型对股票进行综合评定，分析其投资价值，结合风险控制模型，对沪深

300 指数股票组合进行优化，力求获得稳定适度的超额收益。

#### （1）申万菱信企业价值评估模型

申万菱信企业价值评估模型是在传统估值模型的基础上，结合自身的实践经验，经过长时间研究检验而成；主要是通过历史、预测及经验数据，计算出股票的相对价值，获取股票的潜在投资价值信息。

#### （2）申万菱信分析师预期模型

申万菱信分析师预期模型是我司基于分析师预期数据，结合自身的实践经验，经过长时间研究检验而成；主要是通过对预测数据的全面分析，获取具有领先股价走势的盈利预测趋势信息。

#### （3）申万菱信阿尔法模型

申万菱信阿尔法模型是在申万菱信企业价值评估模型和申万菱信分析师预期模型评价的基础上，通过对不同市场环境下两模型合成效果的全面测试，形成具有稳定表现的阿尔法模型。

#### （4）风险控制模型

作为增强型指数基金，如何平衡跟踪误差最小化和超额收益最大化是增强型指数基金管理的最终目标，本基金将通过风险控制模型，有效将投资组合风险控制在预算范围内。本基金主要采取“跟踪误差”和“跟踪偏离度”这两个指标对投资组合进行监控与评估。

本基金的风控目标为：力争使本基金的净值增长率与业绩比较基准的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%

#### （5）模型的动态调整

数量化模型的研发是一个持续检验、修正与优化的动态过程。基金管理人将根据市场变化趋势以及后续深入持续的研究，定期或不定期地对数量化模型进行复核与检验，并对模型涉及的因子与策略进行修正与调整，不断改善模型的有效性与稳定性，以使得本基金能够有效的达成投资目标。

### 3、股票投资组合调整

#### （1）定期调整

本基金股票组合根据标的指数对其成份股的定期调整而进行相应的定期跟踪调整。中证指数公司原则上每半年审核一次沪深 300 指数成份股，本基金将根

据其公布的最新成份股情和相应权重，对股票投资组合进行及时调整。

#### (2) 不定期调整

1) 当成份股发生增发、送配等情况而影响成份股在指数中权重的行为时，本基金将根据指数公司的公告，进行相应调整；

2) 根据本基金的申购和赎回情况，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数；

3) 若个别成份股因停牌、流动性不足或法规限制等因素，使得基金管理人无法按照其所需标的指数权重进行购买时，基金管理人将综合考虑跟踪误差最小化和投资者利益等因素，确定调整策略。

#### (二) 债券投资策略

在债券投资部分，将根据当前宏观经济形势、金融市场环境，通过有效的投资组合体现债券市场战略投资与战术投资的结合，并积极运用基于债券研究的各种投资分析技术，寻找有利的市场投资机会。通过债券品种的动态配置与优化配比，动态调整固定收益证券组合的久期、银行间市场和交易所市场的投资比重，并相应调整不同债券品种间的配比，在较低风险条件下获得稳定投资收益。

#### (三) 股指期货投资策略

基金管理人可运用股指期货以提高投资效率，从而更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。此外，本基金还将运用股指期货来对冲特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理，如预期大额申购赎回、大量分红等，以及对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险。

#### (四) 其他金融衍生工具投资策略

当法律法规或监管机构允许时，本基金将以控制风险、提高投资效率和降低跟踪误差为目的对权证等其他金融衍生工具进行谨慎投资，以期更好的实现基金的投资目标。

## 九、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为： $95\% \times$  沪深 300 指数收益率 $+1.5\%$ （指年收益率，

评价时按期间折算)。

本基金股票资产跟踪的标的指数为沪深 300 指数。沪深 300 指数是由上海和深圳证券市场中选取 300 只 A 股作为样本编制而成的中国 A 股市场指数，覆盖了大部分流通市值，其成份股票为中国 A 股市场中代表性强、流动性高的股票，能够反映 A 股市场整体走势。

如果沪深 300 指数被停止编制及发布，或由其他指数替代（单纯更名除外），或由于指数编制方法等重大变更导致该指数不宜继续作为本基金的标的指数，基金管理人可以依据维护投资者的合法权益的原则，在经基金托管人同意后变更基金的标的指数和业绩比较基准，而无需基金份额持有人大会审议。

## 十、风险收益特征

本基金为增强型指数基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

## 十一、基金投资组合报告

本投资组合报告所载数据截止日为 2013 年 9 月 30 日，本报告中所列财务数据未经审计。

### 1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	49,734,288.83	92.94
	其中：股票	49,734,288.83	92.94
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	3,676,481.23	6.87
6	其他各项资产	98,703.56	0.18
7	合计	53,509,473.62	100.00

## 2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 2.1 积极投资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	采矿业	-	-
C	制造业	7,307,183.93	13.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	882,576.39	1.68
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	8,189,760.32	15.58

### 2.2 指数投资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	采矿业	1,797,478.14	3.42
C	制造业	14,507,046.10	27.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,888,186.70	3.59
E	建筑业	1,580,617.80	3.01
F	批发和零售业	1,825,315.83	3.47
G	交通运输、仓储和邮政业	2,180,101.94	4.15
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,433,166.31	2.73
J	金融业	12,051,814.27	22.92
K	房地产业	2,451,034.30	4.66
L	租赁和商务服务业	1,332,022.72	2.53
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	497,744.40	0.95
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	41,544,528.51	79.02

### 3. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	600016	民生银行	234,929	2,245,921.24	4.27
2	600036	招商银行	186,636	2,038,065.12	3.88
3	601166	兴业银行	155,154	1,733,070.18	3.30
4	600000	浦发银行	164,800	1,662,832.00	3.16
5	600837	海通证券	121,286	1,517,287.86	2.89

#### 3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	601877	正泰电器	55,580	1,243,324.60	2.36
2	000786	北新建材	61,923	1,030,398.72	1.96
3	000726	鲁 泰 A	123,467	1,014,898.74	1.93
4	600612	老凤祥	40,677	1,005,535.44	1.91
5	002063	远光软件	47,527	882,576.39	1.68

### 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资产支持证券。

### 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. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

### 8.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

## 9. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 9.1 本基金投资国债期货的投资政策

根据本基金基金合同，本基金不得参与国债期货交易。

### 9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据本基金基金合同，本基金不得参与国债期货交易。

### 9.3 本基金投资国债期货的投资评价

根据本基金基金合同，本基金不得参与国债期货交易。

## 10. 投资组合报告附注

10.1 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。

10.2 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。

### 10.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	56,528.21
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	11,354.40
4	应收利息	876.47
5	应收申购款	29,944.48
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	98,703.56

### 10.4 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。

### 10.5 报告期末前五名股票中存在流通受限情况的说明

#### 10.5.1 期末指数投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

## 10.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

## 十二、基金的业绩

本基金的过往业绩不代表未来表现。

### 1. 净值增长率与业绩比较基准收益率比较：

#### 1.1 截止至2013年6月6日基金转型前

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
2004年11月29日（基 金合同生效日）至 2005年12月31日	-1.44%	0.24%	2.45%	0.00%	-3.89%	0.24%
2006年	27.59%	0.45%	2.35%	0.00%	25.24%	0.45%
2007年	57.53%	0.84%	3.21%	0.00%	54.32%	0.84%
2008年	-8.80%	0.44%	3.93%	0.00%	-12.73%	0.44%
2009年	11.00%	0.60%	2.25%	0.00%	8.75%	0.60%
2010年	-2.67%	0.56%	2.30%	0.00%	-4.97%	0.56%
2011年	-3.35%	0.14%	3.28%	0.00%	-6.63%	0.14%
2012年	3.88%	0.12%	3.25%	0.00%	0.63%	0.12%
自基金合同生效日至 2013年6月6日	100.14%	0.48%	27.08%	0.00%	73.06%	0.48%

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。

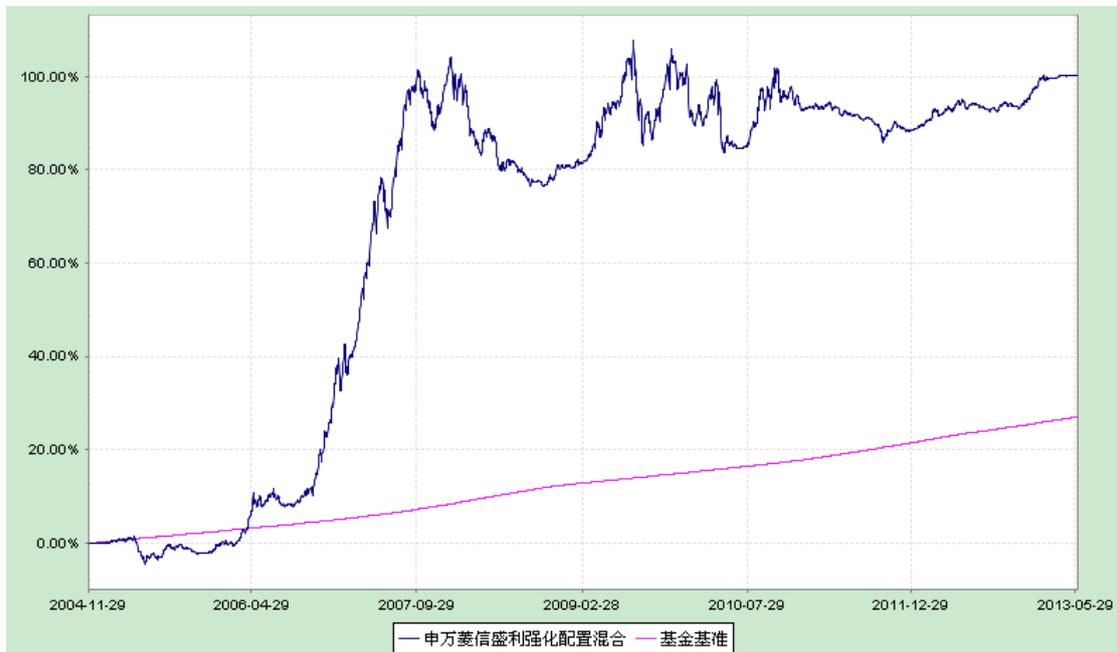
#### 1.2 自2013年6月7日基金转型后

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
2013年6月7日（基金 转型日）至2013年9 月30日	2.62%	0.53%	-3.97%	0.29%	6.59%	0.24%

2. 自《基金合同》生效以来基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准的变动比较。

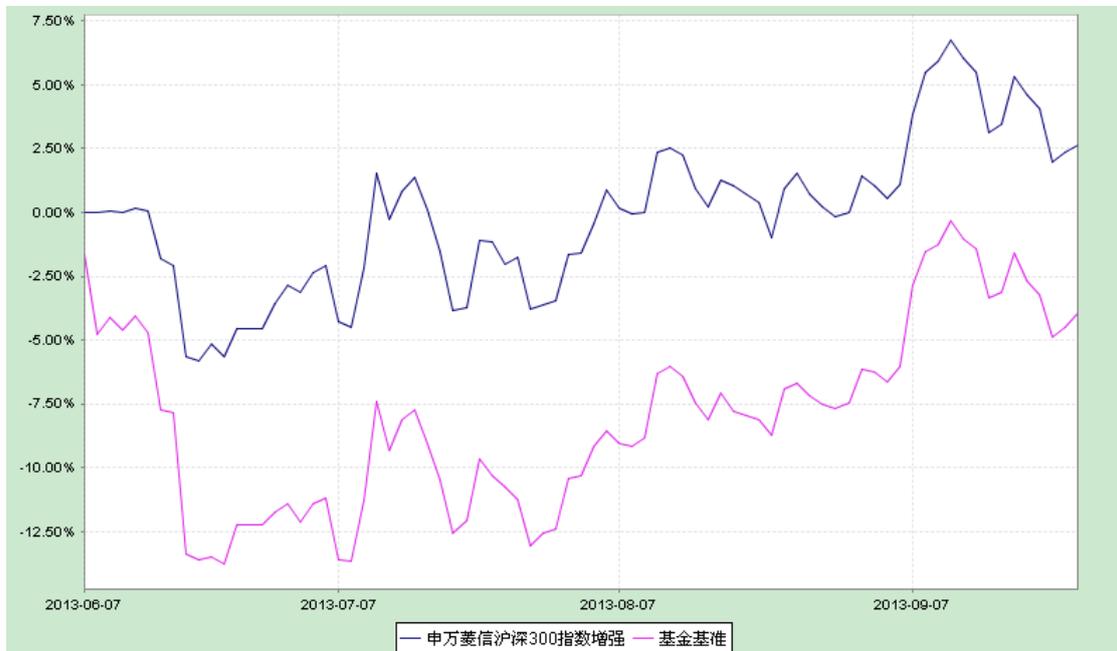
## 转型前累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2004年11月29日至2013年6月6日)



## 转型后累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2013年6月7日至2013年9月30日)



注：1、本基金于2013年6月7日基金转型，自转型起至披露时点不满一年。

2、本基金合同约定基金转型后建仓期为6个月，截至本报告期末本基金建仓期尚未结束。

## 十三、基金的费用与税收

### （一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金的指数使用费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、证券账户开户费用、银行间交易账户维护费和银行账户维护费；
- 10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

### （二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.0% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.0\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 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、公休假等，支付日期顺延。

#### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.18% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.18\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

### 3、基金的指数使用费

本基金作为增强指数基金，在《基金合同》生效后将按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费计提方法支付指数许可使用费。

通常情况下，指数使用费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年指数使用费率} / \text{当年天数}$ ，本基金年指数使用费率为 0.016%

H 为每日应计提的指数使用费

E 为前一日的基金资产净值

指数使用费每日计算，逐日累计，按季支付，自《基金合同》生效日起，基金管理人应于每年 1 月、4 月、7 月、10 月的前 10 个工作日内向中证指数有限公司支付上一季度的指数使用费。指数使用费的收取下限为每季度人民币 5 万元，计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。

若季度指数使用费下限大于按基金资产净值提取的季度指数使用费，则超过部分由基金管理人自行承担，不得作为基金费用在基金财产中列支。

如果指数使用许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数许可使用费。基金管理人将在招募说明书更新或其他公告中披露基金最新适用的方法。

4、上述“一、基金费用的种类中第 4—10 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。

### （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、会计师费、律师费和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、基金托管费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率，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依照《信息披露办法》的规定在指定媒体上公告。

#### （五）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 十四、对招募说明书本次更新部分的说明

本招募说明书（更新）依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《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、变更了释义中相关法规的信息；
- 2、基金管理人的部分信息；
- 3、更新了基金托管人的部分信息；

- 4、更新了代销机构的部分信息；
- 5、更新了投资组合报告，数据截止日期为 2013 年 9 月 30 日；
- 6、更新了基金的业绩部分，数据截止日期为 2013 年 9 月 30 日；
- 7、在“其他应披露事项”一章，列举了本基金自 2013 年 6 月 7 日至 2013 年 12 月 7 日发布的有关公告。

## 十五、其它应披露事项

自2013年6月7日至2013年12月7日，与本基金和本基金管理人有关的公告如下：

1、2013 年 6 月 8 日，刊登于《中国证券报》和《证券时报》的申万菱信沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同及摘要；

2、2013 年 6 月 8 日，刊登于《中国证券报》和《证券时报》的申万菱信沪深 300 指数增强型证券投资基金托管协议；

3、2013 年 6 月 8 日，刊登于《中国证券报》和《证券时报》的关于申万菱信盛利强化配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会决议生效暨恢复申购、赎回业务的公告；

4、2013 年 6 月 8 日，刊登于《中国证券报》和《证券时报》的申万菱信沪深 300 指数增强型证券投资基金转换费率调整的公告；

5、2013 年 6 月 27 日，刊登于《中国证券报》和《证券时报》的申万菱信沪深 300 指数增强型证券投资基金基金经理变更公告；

6、2013 年 7 月 1 日，刊登于《中国证券报》和《证券时报》的关于旗下开放式基金 2013 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；

7、2013 年 7 月 2 日，刊登于《中国证券报》和《证券时报》的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；

8、2013 年 7 月 11 日，刊登于《中国证券报》和《证券时报》的关于上海好买基金销售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；

9、2013 年 7 月 11 日，刊登于《中国证券报》和《证券时报》的关于旗下部分开放式基金新增和讯信息科技有限公司为代销机构并实施申购费率优惠活动的公告；

10、2013 年 7 月 12 日，刊登于《中国证券报》和《证券时报》的申万菱信沪深 300 指数增强型证券投资基金招募说明书（原申万菱信盛利强化配置混合型证券投资基金招募说明书变更）；

11、2013 年 7 月 17 日，刊登于《中国证券报》和《证券时报》的申万菱信沪深 300 指数增强型证券投资基金 2013 年第 2 季度报告；

12、2013 年 8 月 27 日，刊登于《中国证券报》和《证券时报》的申万菱信沪深 300 指数增强型证券投资基金 2013 年半年度报告正文及摘要；

13、2013 年 9 月 10 日，刊登于《中国证券报》和《证券时报》的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-招商地产；

14、2013 年 9 月 19 日，刊登于《中国证券报》和《证券时报》的关于恢复对旗下基金持有的招商地产股票进行市价估值的公告；

15、2013 年 10 月 25 日，刊登于《中国证券报》和《证券时报》的申万菱信沪深 300 指数增强型证券投资基金 2013 年第 3 季度报告；

16、2013 年 11 月 6 日，刊登于《中国证券报》和《证券时报》的关于旗下部分开放式基金参加浙江同花顺基金销售有限公司开展的双十一基金申购费率优惠活动的公告。

签署日期：2014年1月5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

2014 年 1 月 20 日