



申万巴黎沪深300价值指数证券投资基金招募说明书(第二次更新)摘要

【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,投资者申购基金时应认真阅读招募说明书。
- 基金的过往业绩并不预示其未来的表现。
- 本摘要根据本基金之基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。
- 本招募说明书(更新)所载内容截止日为2011年3月10日,有关财务数据和净值表现截止日为2010年12月31日(财务数据未经审计)。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况
名称:申万菱信基金管理有限公司
住所:上海市淮海中路300号香港新世界大厦40楼(200021)
法定代表人:姜国芳
设立日期:2004年1月15日
批准设立机关及批准设立文号:中国证监会监督管理委员会,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
存续期限:长期
联系电话:+86-21-23261188
联系人:王菲菲
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

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

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

杜平先生,董事,1963年出生。经济师,法学硕士。1989年至1990年在湖北省武汉市政府政策研究室任科员,副主任科员,1990年底至1993年初在湖北省武汉市政府办公厅任副主任科员、主任科员,1993年初至1998年初在交通银行总行秘书处、条法处先后担任副主任科员、主任科员、党组书记。1998年起任交通银行深圳分行副行长,2000年7月任交通银行新加坡分行行长。2003年10月起加盟申银万国证券股份有限公司,任公司副总裁。

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

Max Dnilus先生,董事,1963年出生。巴黎工商联合商学院毕业;现任法国巴黎资产管理公司新兴市场与开发部主管;曾任法国巴黎银行固定收益基金经理,法国巴黎银行并购部,法国巴黎银行城市发展部和资产偿还部主管等。

毛应楼先生,独立董事,1937年出生。1961年至1985年任中国人民银行,曾任中国人民银行上海分行副行长。1985年至1991年任中国工商银行上海分行行长、党委书记,1991年至1999年任中国人民银行上海市分行行长、党组书记。1999年至2003年任上海证交所理事理事长、顾问。

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

袁恩植先生,独立董事,1938年出生。曾任社会科学院经济研究所研究室主任、所长,现任上海经济学会会长、上海社会科学院经济研究所顾问。
赵晋落先生,独立董事,1950年出生。曾任职于司法部香港中国法律服务所分所、香港何耀雄律师事务所、康达律师事务所。现任北京鑫隆律师事务所上海分所主任、律师。

0 监事会成员:

刘鸿儒先生,监事,1930年出生。全国政协经济委员会副主任,教授,博士生导师。1959年在莫斯科大学经济系研究生毕业,获副博士学位,回国后,先后任中国人民银行处长、局长,农业银行副行长、中国人民银行副行长、国家经济体制改革委员会副主任、中国证监会前任主任。
Jean Audibert先生,监事,1951年出生。1975年加入法国巴黎银行,先后在科威特、新加坡、泰国等地工作。1996年至2001年任法国巴黎银行总部国际贸易服务部门负责人。2001年至2005年任法国巴黎银行总管理理业务负责人。2005年至2008年任新韩巴黎资产管理(中国)有限公司总裁兼CEO。2009年1月至今,任法国巴黎资产管理(中国)亚洲新兴市场主席。

王厚贤先生,监事,申万菱信基金管理有限公司行政管理部负责人。1951年出生,研究生学历,自1978年起任职上海船舶研究设计院;1994年任职万国房地产开发公司任办公室主任;1999年任职申银万国证券股份有限公司人力资源部薪酬部经理。2004年1月加盟本公司。

0 高级管理人员

毛剑鸣先生,总裁,相关介绍见董事会成员部分。
赵晋落先生,副总裁,1964年出生,工商管理硕士。1983年至1990年任职于中国工商银行上海分行,1990年至1993年任上海申银证券公司国际业务部经理。1997年至1999年任申万信达投资管理(亚洲)有限公司联席总裁,1999年至2004年2月任申银万国证券股份有限公司国际业务总部副总经理。2004年3月至2005年2月任申万巴黎基金管理有限公司督察长。

0 督察长

朱自贤先生,1969年出生,经济学硕士;曾任本公司监察稽核总部副总经理;在本公司任职期间,曾任申银万国证券股份有限公司国际业务总部监察稽核部副经理、部门副经理。

6 基金经理

魏立先生,特许金融分析师(CFA),英国帝国理工大学管理学硕士。1997年起任上海华虹NEC电子有限公司工程师,自2004年起从事金融工作,先后任职于东方证券股份有限公司研究所、法国基金管理有限公司。2006年7月加入本公司,任投资管理总部高级分析师,2007年9月至2009年6月任申万巴黎新经济混合型证券投资基金基金经理助理。2009年6月起任申万巴黎增利增长股票证券投资基金基金经理,2009年9月至2010年11月任申万巴黎新经济混合型证券投资基金基金经理。2010年2月起同时任申万巴黎沪深300价值指数证券投资基金基金经理。

张少华先生,复旦大学数量经济学硕士,自1999年起从事金融工作,1999年7月至2003年1月在上海万国证券股份有限公司任职,2003年1月加入申万巴黎基金管理有限公司筹备组,2004年2月加盟申万巴黎基金管理有限公司,历任风险管理总部高级风险分析师,风险管理总部副总监,2009年3月起任风险管理总部总监,2010年2月起任投资管理总部副总监,申万巴黎沪深300价值指数证券投资基金基金经理,2010年10月起同时任申万巴黎中证指数分级证券投资基金基金经理。

6 投资决策委员会组成

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

非执行董事有下列人员组成:研究负责人、宏观及策略分析师、基金经理、组合投资管理。非执行董事对需决策事项可发表意见,但不参与决策事项的投票表决。

本公司总裁担任投资决策委员会主任,投资总监担任投资决策委员会会议召集人。

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

0 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
设立日期:1985年4月1日
注册资本:人民币334,018,826.02元
联系人:赵会军
联系电话:010-66105799

三、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1、直销机构
申万菱信基金管理有限公司直销中心
申万菱信基金管理有限公司
注册地址:中国上海淮海中路300号40层
法定代表人:姜国芳
电话:+86 21 23261188
传真:+86 21 23261199
联系人:浦剑悦 陈景新
客户服务中心电话:+86 21 962299,或400 880 8588

2、代销机构

0 名称:中国工商银行股份有限公司
法定代表人:姜建清
注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号
联系人:刘亚伟
客户服务电话:95588
传真:+86 10 66107914
网址:www.icbc.com.cn

0 名称:中国建设银行股份有限公司
法定代表人:郭树清
注册地址:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
联系人:王琳
客户服务电话:95533
传真:010 66275654
网址:www.ccb.com

0 名称:中国农业银行股份有限公司
注册地址:北京市东城区建国门内大街69号
法定代表人:项俊波
传真:+86-10-85109219
客户服务电话:95599
网址:www.abchina.com

0 名称:交通银行股份有限公司
住所:上海市浦东新区银城中路188号
办公地址:上海市银城中路188号
法定代表人:胡怀邦
电话:021 58781234
传真:021 58408842
联系人:曹榕
客户服务电话:95559
网址:http://www.bankcomm.com/

0 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

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

办公地址:上海市中山路12号
法定代表人:姜建清
电话:021 63604199
联系人:倪亦云、袁露云
客户服务热线:95528
公司网站:www.spilb.com.cn

0 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:陆虹霞
传真:010-83914283
网址:www.cmbc.com.cn

0 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:金雷
传真:+86-10-65550827
网址:http://bank.ecitic.com

0 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:郑翔
客户服务电话:95577
传真:010-85238680
网址:www.hxb.com.cn

0 名称:深圳发展银行股份有限公司
注册地址:广东省深圳市罗湖区深南东路5047号
法定代表人:法兰克纽曼 Frank N.Newman)
联系人:李海
电话:0755 82080406
客户服务电话:95501
网址:www.sdb.com.cn

0 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:胡晋才
客服电话:021-962999
联系人:吴海平
传真:021-50105124
网址:www.srb.com

0 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: 林夏
传真:025-85441219
联系人:俞俊
客户服务电话:4008896400

0 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:邵卫斌
客服电话:021-962505
公司网站:www.sw2000.com.cn

0 名称:中信建投证券有限责任公司
注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址:北京市朝阳区门内大街118号
法定代表人:张佑君
联系人:权静
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

0 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:金荣、李奕鸣
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

0 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:杨国平
传真:021-38670161
客户服务热线:4008888666
公司网站:www.gtja.com

0 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
客户服务电话:4008881111 95565
公司网站:www.newone.com.cn

0 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:陈荣
联系人:邵卫斌
客户服务电话:4008888888
传真:+86 101-66588116
联系人:田薇
公司网站:www.chinastock.com.cn

0 名称:广发证券股份有限公司
住所:广东省天河区北路183号大都会广场43楼
办公地址:广东广州天河北路大都会广场18、19、36、38、41和42楼
法定代表人:王志伟
电话:95575或致电各营业网点
传真:020 87555305
联系人:邵卫斌
公司网站:www.gf.com.cn

0 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

0 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

0 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
联系人:李黎
客户服务电话:400-8888-777 , 95578
网址:www.gyzq.com.cn

0 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
公司网站:www.cindasc.com

0 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:戴静
客服电话:0791-6768763
网址:www.scstock.com

0 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

0 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:胡运涛
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

0 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:翟建锋
联系人:徐渝
传真:0510-82830162
客户服务电话:4008885288
网址:www.glsc.com.cn

0 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:翟建锋
联系人:徐渝
传真:0510-82830162
客户服务电话:4008885288
网址:www.glsc.com.cn

0 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:翟建锋
联系人:徐渝
传真:0510-82830162
客户服务电话:4008885288
网址:www.glsc.com.cn

0 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:翟建锋
联系人:徐渝
传真:0510-82830162
客户服务电话:4008885288
网址:www.glsc.com.cn

0 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:翟建锋
联系人:徐渝
传真:0510-82830162
客户服务电话:4008885288
网址:www.glsc.com.cn

0 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:翟建锋
联系人:徐渝
传真:0510-82830162
客户服务电话:4008885288
网址:www.glsc.com.cn

0 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:翟建锋
联系人:徐渝
传真:0510-82830162
客户服务电话:4008885288
网址:www.glsc.com.cn

0 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:翟建锋
联系人:徐渝
传真:0510-82830162
客户服务电话:4008885288
网址:www.glsc.com.cn

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:陈景新
公司网站:www.spilb.com.cn

0 名称:通力律师事务所
注册地址:北京市西城区德胜门内大街19楼
负责人:郭朝晖
电话:+86 21 31358666
传真:+86 21 31358600
经办律师:秦悦民、王利民

0 会计师事务所和经办注册会计师
会计师事务所:普华永道中天会计师事务所有限公司
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1233号汇亚大厦1604-1608室
办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
法定代表人姓名:杨劲松
电话:+86-21-23238888
传真:+86-21-23238800
联系人姓名:张鸿
经办注册会计师姓名:汪稼、张鸿

0 名称:中银国际证券股份有限公司
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:金雷
传真:+86-10-65550827
网址:http://bank.ecitic.com

0 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:郑翔
客户服务电话:95577
传真:010-85238680
网址:www.hxb.com.cn

0 名称:深圳发展银行股份有限公司
注册地址:广东省深圳市罗湖区深南东路5047号
法定代表人:法兰克纽曼 Frank N.Newman)
联系人:李海
电话:0755 82080406
客户服务电话:95501
网址:www.sdb.com.cn

0 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:胡晋才
客服电话:021-962999
联系人:吴海平
传真:021-50105124
网址:www.srb.com

0 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: 林夏
传真:025-85441219
联系人:俞俊
客户服务电话:4008896400

0 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:邵卫斌
客服电话:021-962505
公司网站:www.sw2000.com.cn

0 名称:中信建投证券有限责任公司
注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址:北京市朝阳区门内大街118号
法定代表人:张佑君
联系人:权静
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

0 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:金荣、李奕鸣
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

0 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:杨国平
传真:021-38670161
客户服务热线:4008888666
公司网站:www.gtja.com

0 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
客户服务电话:4008881111 95565
公司网站:www.newone.com.cn

0 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:陈荣
联系人:邵卫斌
客户服务电话:4008888888
传真:+86 101-66588116
联系人:田薇
公司网站:www.chinastock.com.cn

0 名称:广发证券股份有限公司
住所:广东省天河区北路183号大都会广场43楼
办公地址:广东广州天河北路大都会广场18、19、36、38、41和42楼
法定代表人:王志伟
电话:95575或致电各营业网点
传真:020 87555305
联系人:邵卫斌
公司网站:www.gf.com.cn

0 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

0 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

0 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
联系人:李黎
客户服务电话:400-8888-777 , 95578
网址:www.gyzq.com.cn

0 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
公司网站:www.cindasc.com

0 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:戴静
客服电话:0791-6768763
网址:www.scstock.com

0 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

0 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:胡运涛
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

0 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:翟建锋
联系人:徐渝
传真:0510-82830162
客户服务电话:4008885288
网址:www.glsc.com.cn

0 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:翟建锋
联系人:徐渝
传真:0510-82830162
客户服务电话:4008885288
网址:www.glsc.com.cn

0 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:翟建锋
联系人:徐渝
传真:0510-82830162
客户服务电话:4008885288
网址:www.glsc.com.cn

0 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:翟建锋
联系人:徐渝
传真:0510-82830162
客户服务电话:4008885288
网址:www.glsc.com.cn

0 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:翟建锋
联系人:徐渝
传真:0510-82830162
客户服务电话:4008885288
网址:www.glsc.com.cn

0 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:翟建锋
联系人:徐渝
传真:0510-82830162
客户服务电话:4008885288
网址:www.glsc.com.cn

0 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:翟建锋
联系人:徐渝
传真:0510-82830162
客户服务电话:4008885288
网址:www.glsc.com.cn

注:1)自基金合同生效日至本报告期末,本基金运作时间未满一年;

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

十二、基金的费用与税收

(一)与基金运作有关的费用
1、基金费用的种类:
Q 基金管理人的管理费;
Q 基金托管人的托管费;
Q 基金合同生效后与基金相关的信息披露费用;
Q 基金份额持有人大会费用;
Q 基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费;
Q 基金的证券交易费用;
Q 基金的银行汇划费用;
Q 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财产中扣除。
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 ×0.65% × 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 ×0.15% × 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付。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。
上述基金费用的种类中第8-8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
1000元以下	1%
1000元-5000元	0.6%
5000元-10000元	0.2%
10000元以上	1000元/笔

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
1000元以下	1.2%
1000元-5000元	0.8%
5000元-10000元	0.2%
10000元以上	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年以上-2年	0.25%
2年以上(含2年)	0%