申万菱信基金管理有限公司申万菱信定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同生效公告

公告送出日期:2013年3月30日

1.公告基本信息

基金名称	申万菱信定期开放债券型发起式证券投资基金
基金简称	申万菱信定期开放债券
基金主代码	163112
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年3月29日
基金管理人名称	申万菱信基金管理有限公司
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司
公告依据	《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规、《申万菱信定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》、《申万菱信定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书》

2.基金募集情况

基金募集申请获中国证监会核准的文号		基金部函【2013】232号
基金募集期间		自2013年3月4日 至2013年3月22日止
验资机构名称		普华永道中天会计师事务所有限公司
募集资金划入基金托管专户的日期		2013年3月28日
募集有效认购总户数（单位：）		11,321
募集期间净认购金额（单位：）		1,610,759,599.65
认购资金在募集期间产生的利息（单位：）		624,142.68
募集份额（单位：）	有效认购份额	1,610,759,599.65
	利息结转的份额	624,142.68
	合计	1,611,383,742.33
其中:募集期间基金管理人运用固有资金认购本基金情况	认购的基金份额（单位：）	10,003,600.36
	占基金总份额比例	0.62%
	其他需要说明的事项	基金管理人于2013年3月18日运用固有资金10,001,000.00元人民币认购本基金基金份额,认购费用1000元,与基金招募说明书公布的费率一致。基金管理人以上述固有资金作为本基金的发起资金，自本基金基金合同生效之日起，所认购的基金份额持有期限不低于三年。
其中:募集期间基金管理人的从业人员认购本基金情况	认购的基金份额（单位：）	1,383,221.77
	占基金总份额比例	0.09%
募集期限届满基金是否符合法律法规规定的办理基金备案手续的条件		是
向中国证监会办理基金备案手续获得书面确认的日期		2013年3月29日

注：1、按《申万菱信定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书》等法律文件的规定，投资者的认购资金在募集期间形成的利息收入折算成认购的基金份额，归投资者所有。认购资金利息以注册登记机构的确认结果为准。依中国证券登记结算有限责任公司有关规则，场内认购资金利息折算的基金份额保留至整数位，小数部分舍去，舍去部分计入基金财产；场外认购资金利息折算的基金份额保留至小数点后第2位，小数点第2位以后部分舍去，舍去部分计入基金财产。

2、按照有关法律规定，本基金合同生效前的律师费、会计师费、信息披露费由基金管理人承担。

3、基金管理公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金基金份额总量的区间为0至10万份（含）；本基金基金经理持有本基金基金份额总量的区间为0。

3 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理公司固有资金	10,003,600.36	0.62%	10,003,600.36	0.62%	三年
基金管理公司高级管理人员	–	–	–	–	
基金经理等人员	–	–	–	–	
基金管理公司股东	–	–	–	–	
其他	–	–	–	–	
合计	10,003,600.36	0.62%	10,003,600.36	0.62%	

注：上述份额总数均包括利息结转份额。

4.其他需要提示的事项

（1）申购、赎回开始日及业务办理时间

本基金以定期开放方式运作，自2013年3月29日基金合同生效之日起（包括基金合同生效之日）或自每一开放期结束之日次日起（包括该日）一年内，本基金封闭运作，不办理基金份额的申购赎回业务。

（2）开放日及开放时间

本基金转入开放期后，投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

（3）风险提示

本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资者投资于本公司管理的基金时应认真阅读基金合同、招募说明书等文件。

特此公告。

申万菱信基金管理有限公司关于以通讯方式召开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的第二次提示性公告

申万菱信基金管理有限公司已于2013年3月28日在《中国证券报》、《证券时报》及基金管理人网站发布了《申万菱信基金管理有限公司关于以通讯方式召开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的公告》，并于2013年3月29日在上述报纸和网站上发布了《关于以通讯方式召开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的第一次提示性公告》。为使本次基金份额持有人大会顺利召开，现将具体事宜提示如下：

一、召开会议基本情况

根据《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》和《申万菱信盛利强化配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，申万菱信盛利强化配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金管理人申万菱信基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，会议具体安排如下：

1、会议召开方式：通讯方式。

2、表决票收取时间：自2013年3月30日起，至2013年5月2日17:00止（以收到表决票的时间为准）。

二、会议审议事项

《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》（附件三）

三、权益登记日

本次大会的权益登记日为2013年3月29日，该日下午交易时间结束后，在申万菱信基金管理有限公司登记在册的本基金全体基金份额持有人均有权参与本次会议的表决。

四、表决票的填写和寄交方式

1、本次会议表决票见附件一。基金份额持有人可剪报、复印或登陆本基金管理人网站（www.swsmu.com）下载表决票。

2、基金份额持有人应当按照表决票的要求填写相关内容，其中：

（1）个人持有人自行投票的，需在表决票上签字，并提供本人开立持有本基金基金份额的申万菱信基金账户所使用的身份证件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）复印件；

（2）机构持有人自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章或经授权的业务公章（以下合称“公章”），并提供加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；

（3）个人持有人委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供基金份额持有人开立持有本基金基金份额的申万菱信基金账户所使用的身份证件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）复印件，以及填妥的授权委托书原件（见附件二）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证复印件；如代理人为机构，还需提供代理人加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；

（4）机构持有人委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供基金份额持有人加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等），以及填妥的授权委托书原件（见附件二）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证复印件；如代理人为机构，还需提供代理人加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

3、基金份额持有人或其代理人需将填妥的表决票和所需的相关文件于前述表决票收取时间内（以收到时间为准），通过专人送交或邮寄的方式，提交给本次大会公证机构。

本次大会公证机构的联系方式如下：

公证机关：北京市方正公证处

地址：北京市西城区阜外大街7号国投大厦三层

联系人：王顺心　贺颖

联系电话：010-68096201；010-68096216；

邮政编码：100037

请在信封表面注明：“申万菱信盛利强化配置基金基金份额持有人大会表决专用”。

五、计票

1、本次通讯会议的计票方式为：由本基金管理人派出的两名代表在基金托管人（中国工商银行股份有限公司）派出的一名代表的监督下在表决截止日期第二天统计全部有效表决票，并由公证机构对其计票过程予以公证并形成决议；

2、基金份额持有人所持的每份基金份额有一票表决权；

3、表决票效力的认定如下：

（1）表决票填写完整清晰，所提供文件符合本会议通知规定，且在截止时间之前送达公证机构的，为有效表决票；有效表决票按表决意见计入相应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

（2）表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，弃权表决票计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。表决票上的表决意见未选，签字或盖章部分填写不完整、不清晰的，或未能提供有效证明持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的，或未能在截止时间之前送达公证机构的，均为无效表决票。无效表决票不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

（3）基金份额持有人重复提交表决票的，如各表决票表决意见相同，则视为同一表决票。如各表决票表决意见不相同，则按如下原则处理：

1）送达时间不是同一天的，以最后送达的填写有效的表决票为准，先送达的表决票视为被撤回；

2）送达时间为同一天的，视为在同一表决票上做出了不同表决意见，计入弃权表决票；

3）送达时间按如下原则确定：专人送达的以实际递交时间为准，邮寄的以公证员收到的时间为准。

六、决议条件

1、如提交有效表决票的基金份额持有人或其代理人所对应的基金份额占本基金在权益登记日基金总份额的50%以上（含50%），则本次通讯开会视为有效；

2、本次议案应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的50%（含50%）以上通过方为有效；

3、基金份额持有人大会表决通过的事项，将由本基金管理人在自通过之日起5日内报中国证监会核准或者备案，基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

七、本次大会相关机构

1、召集人：申万菱信基金管理有限公司

联系电话：400 880 8588（免长途话费）或 +86 21 962299

网址：www.swsmu.com

2、基金托管人：中国工商银行股份有限公司

3、见证律师：上海市通力律师事务所

4、公证机构：北京市方正公证处

八、重要提示

1、关于本次议案的说明见《申万菱信盛利强化配置混合型证券投资基金转型方案说明书》（附件四）；

2、请持有人在提交表决票时，充分考虑邮寄在途时间，提前寄出表决票；

3、本次基金份额持有人大会有关公告可通过本基金管理人网站查阅，投资者如有任何疑问，可致电本基金管理人咨询；

4、本通知的有关内容由申万菱信基金管理有限公司负责解释。

附件一：

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通讯表决票

基金份额持有人基本资料	
持有人姓名或名称：	
申万菱信基金账户号：（如有多个，请逐一填写）	
持有人证件类型及证件号码：	
如为代理人代为投票，请填写	
代理人姓名或名称：	
代理人证件类型及证件号码：	
表决意见：《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》	
同意	
反对	
弃权	
签字或盖章（若为持有人委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章）	
基金份额持有人或代理人签字/盖章： 年 月 日	

（本表决票可剪报、复印或按以上格式自制，在填写完整并签字盖章后均为有效）

关于表决票的填写说明：

1、表决票填写完整清晰，所提供文件符合本会议通知规定，且在截止时间之前送达公证机构的，为有效表决票；有效表决票按表决意见计入相应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

2、如表决票上的表决意见模糊不清或相互矛盾，则视为弃权表决，但计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。表决票上的表决意见未选，签字或盖章部分填写不完整、不清晰的，或未能提供有效证明持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的，或未能在截止时间之前送达公证机构的，均为无效表决票；无效表决票不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

3、基金份额持有人重复提交表决票的，如各表决票表决意见相同，则视为同一表决票；如各表决票表决意见不相同，则按如下原则处理：

（1）送达时间不是同一天的，以最后送达的填写有效的表决票为准，先送达的表决票视为被撤回；

（2）送达时间为同一天的，视为在同一表决票上做出了不同表决意见，计入弃权表决票；

（3）送达时间按如下原则确定：专人送达的以实际递交时间为准，邮寄的以公证员收到的时间为准。

附件二：

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授权委托书

兹委托_____先生／女士／单位代表本人／本单位出席于___年__月__日召开的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，并代为全权行使对所有议案的表决权。本授权不得转授权。

委托人（签字/盖章）：

委托人证件类型及证件号码：

委托人申万菱信基金账户号：

受托人（签字/盖章）：

受托人证件类型及证件号码：

委托日期：2013年 月 日

（本授权委托书可剪报、复印或按以上格式自制，在填写完整并签字盖章后均为有效）

附件三：

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

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：

为维护基金份额持有人利益，提高产品的市场竞争力，根据《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》和《申万菱信盛利强化配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金管理人经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，提议对申万菱信盛利强化配置混合型证券投资基金（以下简称“盛利强化配置基金”）实施转型。《申万菱信盛利强化配置混合型证券投资基金转型方案说明书》见附件。

为实施盛利强化配置基金转型方案，提议授权基金管理人办理本次盛利强化配置基金转型的有关具体事宜，并可在不涉及基金合同当事人权利义务关系变化或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下对《申万菱信盛利强化配置混合型证券投资基金基金合同》等法律文件进行必要的修改和补充。

上述议案，请予审议。

基金管理人：申万菱信基金管理有限公司

2013年3月28日

附件四：

申万菱信盛利强化配置混合型证券投资基金
转型方案说明书

一、重要提示

（一）鉴于目前本基金管理人旗下的申万菱信盛利强化配置混合型证券投资基金（以下简称“盛利强化配置基金”或“本基金”）风险收益特征已经不能切合当前投资者需求，为维护基金份额持有人利益，使本基金的风格特征更加鲜明，更加有利于投资者把握配置需求，根据《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》和《申万菱信盛利强化配置混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，基金管理人经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，决定召开基金份额持有人大会，讨论关于盛利强化配置基金转型有关事项的议案。

（二）本次盛利强化配置基金转型议案应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的50%（含50%）以上通过方为有效，因此存在无法获得相关持有人大会表决通过的可能。

（三）持有人大会表决通过的事项需报告中国证监会，自中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。中国证监会对本次盛利强化配置基金转型方案所作的任何决定或意见，均不表明其对本次转型方案、基金的价值或投资者的收益做出实质性判断或保证。

二、转型方案要点

（一）基金名称变更

基金名称由“申万菱信盛利强化配置混合型证券投资基金”变更为“申万菱信沪深300指数增强型证券投资基金”（以下简称“沪深300指数增强基金”）。

（二）基金类型变更

由混合型基金变更为股票型基金。

（三）调整基金的投资

对盛利强化配置基金原《基金合同》中投资目标、投资范围、投资策略、投资限制、业绩标准、基金管理人代表基金份额持有人利益行使股东权利的处理原则及方法等内容进行了调整，新增了风险收益特征和基金的融资融券部分，并删除了投资理念、投资程序、风险管理和基金的融资等部分表述。

调整前为：

“一、投资目标

本基金为争取绝对收益概念的基金产品，其投资管理禀承本基金管理人的主动型投资管理模式。

本基金管理人以积极主动和深入的研究为基础结合先进的投资组合模型，通过灵活的动态资产配置和组合保险策略，尽最大努力规避证券市场投资的系统性和波动性风险以尽可能保护投资本金安全，并分享股市上涨带来的回报，实现最优化的风险调整后的投资收益为目标，但本基金管理人并不对投资本金进行保本承诺。

二、投资范围和投资对象

根据法律法规的规定，本基金的投资范围为在中华人民共和国境内依法发行上市交易的股票和固定收益证券以及国务院证券监督管理机构规定的其他证券品种和法律法规允许的金融工具。

具体投资对象将根据公司研究成果以及流动性分析，以优质债券与央行票据和具有优秀成长性和投资价值并具良好流动性的上市公司股票为主。

在一级资产配置层面，本基金原则上可能的资产配置比例为：固定收益证券55%－100%，股票0%－45%。因基金规模或市场变化等因素导致投资组合不符合上述规定的，基金管理人应在合理的期限内调整基金的投资组合，以符合上述限定。法律法规另有规定时，从其规定。

三、投资理念

构成本基金管理人投资哲学的两个关键要点为：

(1)在证券市场投资工具欠完备的情形下，动态资产配置与分散投资法是降低总体投资风险与取得合理投资回报的有效手段；

(2)采用风险管理工具监控和准确跟踪投资组合风险。

四、投资策略

本基金采用主动型投资管理模式，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，以配置基金总资产在股票、固定收益证券的比例；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以争取更好的收益，但以不超过基金资产净值的25%为限；采用基于投资组合保险策略开发的资产再平衡模型，控制整体投资组合的可能损失。

股票投资采用“行业配置”与“个股选择”双线并行的投资策略，由主动式行业矩阵模型确定行业配置，个股选择采取“自下而上”的选股过程，投资具有良好流动性的高成长性股票争取当期收益；固定收益证券投资使用利率预期策略、收益率曲线策略和久期策略进行组合管理。

本基金为追求绝对收益，以战胜一年期定期存款利率为投资目标的基金产品。因此，本基金的投资操作应以争取正的投资收益为首要目标；一年期定期存款利率是一个相对稳定的基准，在有效控制基金跟踪误差的大前提下，基金的收益风险特征将会呈现一个长期稳健增长的态势。由此，在本基金运作过程中，风险控制乃为实现投资目标之关键所在，基金管理人应在控制风险最小的前提下追求收益。

此外，将本基金定位为追求绝对收益的产品的目的，是让基金管理人对资产配置有更大的主动权和灵活性。在投资的过程中，基金管理人必须严格遵循风险管理的限制，系统化地管理对各类资产的投资，特别是控制风险资产的投资进程。基金管理人将相对较大部分的基金资产投资于固定收益类证券，以获取相对稳定的利息收益，然后在市场形势有利的时候，再逐步加大对相对高风险、高收益的股票的投资比例，以提高基金的收益，并应在适当的时机实现股票的投资收益。相反，在市场存在较大的下跌风险时，本基金可以全面回避风险资产的投资，而主要通过固定收益证券的投资获取一定的收益。

由于本基金将以基金年度为周期调整基准底线的风险控制水平并不同断地考察基金的投资绩效，在每个投资周期内，通过对固定收益证券和股票投资比例的动态调整，争取到本基金能够在承担较低风险的基础上获取高于银行存款利率的收益。

以数量化模型为基础的资产配置策略和严格的风险控制是本基金争取绝对收益的重要工具。灵活的主动式资产配置模型（AAAM）和选时模型（MTM）的合理应用是本基金提高收益的关键；而以投资组合保险技术和VAR值跟踪为基础的资产再平衡模型则是降低风险的关键。

五、投资程序

本基金管理人的投资决策程序基本包括：投资决策委员会决策、投资总监决策、构建备选池、研究选股及确认资产配置、建立投资组合、风险评估、信息反馈七个步骤。在本基金的投资管理过程中，这七个步骤的决策内容分配如下：

表1：投资决策程序

	步骤名称	主 要 内 容	负责人/部门
1	投资决策委员会决策	投资决策委员会是公司的最高投资决策层，对投资总监提交的投资策略和资产配置进行讨论，做出判断并形成决策报告，交由投资总监组织执行。	投资决策委员会
2	投资总监决策	投资总监根据基金经理和分析师的研究结果和建议，结合主动式资产配置模型提示的资产配置方案，拟定资产配置方案提交投资决策委员会批准，并负责贯彻执行已经形成决议的资产配置方案，同时负责在其授权范围内决定资产配置的调整。	投资总监
3	构建备选池	金融工程师负责建立股票池和固定收益证券备选池，以此作为深入研究的基础；就具体的投资工具和方法提出建议，与基金经理和分析师讨论如何完善量化模型。	金融工程师
4	研究个股和个券选择及确认资产配置	股票分析师根据投资总监下达的任务进行独立的研究工作，包括公司调研，建立财务模型及撰写投资报告等；固定收益分析师对宏观经济和利率变化趋势进行研究并撰写固定收益证券的投资建议报告。研究结果经投资会议讨论后达成结论，必要时做出修改并备案。	分析师
5	建立投资组合	基金经理根据投资总监下达的资产配置指令和投资会议作出的结论构建投资组合。在构建投资组合的过程中，基金经理必须严格遵守基金合同的投资限制及其他要求，同时其对组合调整的幅度必须在被授权的范围内进行。	基金经理
6	风险评估	风险管理委员会、监察稽核部和风险管理部执行监督、检查和风险评估等功能，并依风险评估结果建议投资部门调整投资组合以达到兼顾投资报酬及承受风险的最佳平衡点。	风险管理委员会 监察稽核部 风险管理部
7	信息反馈	基金经理与分析师根据有系统的公司调研、产业分析及宏观政策分析和风险管理部门不间断的绩效评估，适时反映最新信息并做出投资组合的及时调整，并向投资总监提交一级资产配置的调整建议。	基金经理 分析师 风险管理部

六、业绩标准

本基金定位于一个以绝对报酬率评估投资业绩的混合型基金，以争取超越同期银行一年期存款利率的收益为目标。

七、风险管理

本基金强调追求风险调整后的收益，这是本基金区别其他股票型基金的最大特点。因此，本基金管理人在进行主动型投资管理的过程中，将尤为关注风险管理。本基金管理人结合了外方股东法国巴黎资产管理公司的风险控制体系和中方股东中银万国证券股份有限公司的风险管理经验，根据国际化标准建立了完善的内部控制制度，严格规范投资流程，并引入了先进的投资风险管理和控制技术。

在内部控制制度方面，本基金管理人本着健全性、有效性、独立性、相互制约和成本效益原则，设立风险管理委员会、督察长、监察稽核部和专门的风险管理部，并由精通投资组合管理的专业人士全过程实施投资风险管理。

本基金管理人的投资决策程序基本包括：投资决策委员会决策、投资总监决策、构建备选池、研究选股及确认资产配置、建立投资组合、风险评估、信息反馈七个步骤，风险管理和控制渗透在其中的每一个步骤。

在投资风险控制技术方面，本基金的管理引入外方股东法国巴黎资产管理公司的技术，对整个投资过程，从投资组合的资产配置、行业配置到选股，都有不同的风险指标做全程紧密监控。

为体现本基金管理人把保护投资者利益放在首位，致力于为投资者创造更高的价值，设身处地的从投资者角度控制投资风险，以认真、积极、专业的精神与态度管理本基金，特设定本基金投资的基准底线，基金管理人应当在投资管理中利用基于投资组合保险策略和VAR值跟踪的资产再平衡模型控制基金的投资风险，以争取达到本基金的基金份额净值不能低于基准底线值的风险控制目标。

八、投资限制

基金管理人应依据有关法律法规及《基金合同》规定，运作管理本基金：

1、本基金投资组合应遵循下列规定：

(1)本基金持有1家上市公司股票的市值，不超过本基金资产净值的10%；

(2)本基金与由本基金管理人管理的其它基金持有1家公司发行的证券的总和，不超过该证券的10%；

(3)基金资产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不得超过基金总资产，本基金申报的股票数量不得超过拟发行股票的总量；

(4)在全国银行间同业市场中的债券回购最长时间为1年，债券回购到期后不展期；债券回购融入的资金余额不超过基金资产净值的40%；

(5)不得违反《基金合同》关于投资范围、投资策略和投资比例等约定；

(6)中国证监会规定的其它比例限制；

(7)上述比例受限于法律法规的不时修改和中国证监会不时颁布的规范性文件的规定。

2、禁止用本基金资产从事以下行为：

(1)承销证券；

(2)向他人贷款或者提供担保；

(3)从事承担无限责任的投资；

(4)买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；

(5)向基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；

(6)买卖与基金管理人及托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券；

(7)从事内幕交易、操纵证券市场交易价格及其他不正当的证券交易活动；

(8)届时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

九、基金管理人代表基金份额持有人利益行使股东权利的处理原则及方法

1、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；

2、有利于基金资产的安全与增值；

3、基金管理人按照法律法规的有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金投资者的利益。

十、基金的融资

本基金的融资应当按照届时有效的法律法规的规定进行。

在法律法规允许的前提下，本基金融入资金再投资于固定收益证券的最大比例为基金资产净值的25%。”

调整后为：

“一、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。

二、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%。

三、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。

四、投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）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%；

（2）本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的10%，但除非法律法规另有规定，本基金指数化投资部分不受此限制；

（3）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%，但除非法律法规另有规定，本基金指数化投资部分不受此限制；

（4）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；

（5）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的10%；

（6）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%；

（7）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的10%；

（8）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；

（9）本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；

（10）本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；

（11）本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；

（12）基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

（13）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%；

（14）本基金投资于股指期货，还应遵循如下投资组合限制：

1）在任何交易日日终，本基金持有的买入股指期货合约价值不超过基金资产净值的10%，卖出股指期货合约价值不超过基金持有的股票总市值的20%；

2）本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合《基金合同》关于股票投资比例的有关约定；

3）本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%。其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

4）本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%；

5）本基金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%；

（15）相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

本基金管理人应当按照中国金融期货交易所的要求向其报告所交易和持有的卖出期货合约情况、交易目的及对应的证券资产情况等。

因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，以达到规定的投资比例限制要求。法律法规另有规定的从其规定。

基金管理人应当自本《基金合同》生效之日起6 个月内使基金的投资组合比例符合《基金合同》的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

2、禁止行为

基金财产不得用于下列投资或者活动：

（1）承销证券；

（2）违反规定向他人贷款或者提供担保；

（3）从事承担无限责任的投资；

（4）买卖其他基金份额，但是国务院证券监督管理机构另有规定的除外；

（5）向基金管理人、基金托管人出资；

（6）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

（7）法律、行政法规和国务院证券监督管理机构及《基金合同》规定禁止的其他活动。

运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，符合国务院证券监督管理机构的规定，并履行信息披露义务。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，在履行适当程序后，本基金可不受上述规定的限制。

五、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：95%×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。

六、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。

七、基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

1、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；

2、有利于基金资产的安全与增值；

3、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益；

4、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金份额持有人的利益。

八、基金的融资融券

本基金可以根据届时有效