

申万菱信沪深300价值指数证券投资基金

2013 第一季度 报告

2013年3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:二〇一三年四月十九日

1.1 重要提示

基金管理人、基金托管人及基金销售机构不存在虚假记载、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责任。
基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2013年4月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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,投资者有风险,投资人在投资前应仔细阅读本基金的招募说明书。
本报告中财务资料未经审计。
本报告日期为2013年1月1日起至3月31日止。

1.2 基金产品概况

基金名称	申万菱信沪深300价值指数
基金代码	310308
交易代码	310308
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年2月11日
跟踪标的基金名称	沪深300价值指数
跟踪标的基金的投资方式	通过严格的投资程序来跟踪指数化投资策略,力争跟踪标的基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪误差不得超过0.35%,年跟踪误差不得超过4%,实现与跟踪标的基金的有效跟踪。
投资目标	本基金管理人对沪深300价值指数进行跟踪,跟踪标的指数成份股及其权重和基金的跟踪投资比例,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整,以期在跟踪标的指数成份股及其权重发生变动时,能及时作出相应的调整,以跟踪标的指数的变动,力争实现基金净值增长率与跟踪标的指数的变动相一致。
投资策略	本基金采用被动式指数投资策略,力争跟踪标的指数的净值增长率,并严格控制跟踪误差。本基金的投资组合构建采用抽样复制法,力求实现基金净值增长率与跟踪标的指数的变动相一致。
业绩比较基准	沪深300价值指数收益率×95%+银行活期存款利率×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型基金和债券型基金。
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

作为跟踪投资的基金产品,沪深300价值指数基金继续维持既定的指数化投资策略,以严格控制跟踪误差为目标,跟踪标的指数的跟踪误差为投资目标,追求跟踪误差的最小化。
4.1 跟踪标的基金的投资策略
2013年第一季度沪深300价值指数跟踪误差为-1.65%,基金业绩基准表现为-1.52%,申万菱信沪深300价值指数跟踪误差为-1.57%,跟踪误差率为0.08%。
整个一季度,市场出现了明显的分化,在蓝筹股复苏的背景下,市场存在结构性的市场机会的看法被投资者所认可,市场改变了前期银行地产领涨,其他普涨的局面,从整体来看,小盘股开始启动,3月行业角度,医药、TMT、文化传媒和地产个股表现突出,同期整个一季度,市场对蓝筹股更多的关注通过沪深300价值指数平台,也体现了政策红利驱动下的蓝筹股上行势头和经济复苏的信心,就未来一个季度而言,市场保持稳健复苏的可能性较大,大盘风险因素依然未去,可能会出现一次反弹。

1.3 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况			
序号	投资组合	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	594,682,128.15	92.08
2	其中:股票	594,682,128.15	92.08
3	其中:债券	-	-
4	资产支持证券	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	13,000,000.00	2.01
7	其中:买入返售金融资产中的买入返售金融资产	-	-
8	银行存款和结算备付金合计	37,452,131.52	5.80
9	其他资产	723,027.74	0.11
10	合计	645,857,287.81	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股权投资组合			
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	45,221,476.58	7.05
C	制造业	117,177,834.64	18.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	27,614,321.42	4.30
E	建筑业	25,316,564.24	3.95
F	信息技术业	6,063,133.23	0.94
G	交通运输、仓储和邮政业	24,560,482.80	3.87
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,445,804.71	1.00
J	金融业	294,535,170.43	45.76
K	房地产业	47,467,230.10	7.40
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	建筑业、教育和文化艺术业	-	-
P	医药	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		594,682,128.15	92.08

5.3 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	600016	民生银行	4,864,592	46,894,666.88	7.31
2	600036	招商银行	3,043,742	38,442,461.46	5.99
3	601318	中国平安	721,580	30,149,396.69	4.70
4	601166	兴业银行	1,669,259	28,532,180.70	4.45
5	600000	浦发银行	2,416,369	24,417,230.78	3.81
6	600002	万科A	2,084,704	22,432,583.44	3.50
7	601028	交通银行	4,226,643	19,907,488.53	3.10
8	600030	中信证券	1,483,225	18,050,448.25	2.81
9	601088	中国神华	7,103,231	14,457,791.38	2.31
10	000051	格力电器	518,233	14,005,916.81	2.21

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合				
本基金本报告期末持有债券。				
5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细				
本基金本报告期末持有债券。				
5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细				
本基金本报告期末持有资产支持证券。				
5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细				
本基金本报告期末未持有权证。				
5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明				
5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细 根据本基金合同,本基金不得参与股指期货交易。				
5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策 根据本基金合同,本基金不参与股指期货交易。				
5.9 投资组合报告附注				
5.9.1 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。				
5.9.2 本基金投资的前十名证券没有涉及基金合同约定的备选股票。				
5.9.3 其他各项资产构成				

5.6 开放式基金份额变动

序号	项目	金额(元)
1	存出保证金	113,010.52
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	10,637.69
5	应收申购款	599,374.53
6	其他应收款	-
7	待转费用	-
8	预收	-
9	合计	723,027.74

5.7 股指期货交易情况

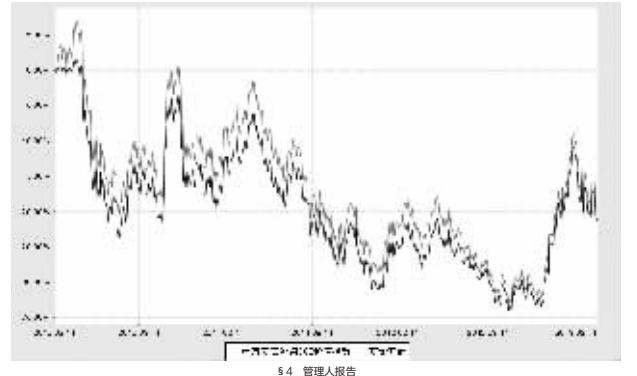
5.8 股指期货持仓和损益明细				
本基金本报告期末未持有股指期货持仓。				
5.9 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细				
根据本基金合同,本基金不得参与股指期货交易。				
5.10 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细				
根据本基金合同,本基金不得参与股指期货交易。				
5.11 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细				
根据本基金合同,本基金不得参与股指期货交易。				
5.12 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细				
根据本基金合同,本基金不得参与股指期货交易。				

5.8 股指期货交易情况

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细				
本基金本报告期末未持有股指期货。				
5.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细				
本基金本报告期末未持有权证。				
5.11 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五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。				
5.12 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细				
本基金本报告期末未持有债券。				

3.1 主要财务指标		单位:人民币元
主要财务指标	报告期(2013年1月1日至2013年3月31日)	
1.本期已实现收益	2,368,530.08	
2.本期利润	-603,173.91	
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0056	
4.期末基金资产净值	641,644,539.20	
5.期末基金份额净值	0.784	

3.2 基金净值表现	
3.2.1 本报告期间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	本基金本报告期基金份额净值增长率为-1.57%,业绩比较基准收益率为-1.52%,本基金本报告期基金份额净值增长率较业绩比较基准收益率高出0.05%。
3.2.2 本基金合同成立以来的基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比	本基金合同成立以来的基金资产净值增长率为-1.57%,业绩比较基准收益率为-1.52%,本基金合同成立以来的基金资产净值增长率较业绩比较基准收益率高出0.05%。



基金净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2009年2月11日至2013年3月31日)

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期间	证券从业年限	说明
张平	本基金基金经理	2010-12-12 - 13年	-	张平先生,复旦大学数量经济学硕士,曾任于申万菱信基金,2003年1月加入申万菱信基金管理有限公司(现名申万基金),曾任申万基金基金经理,现任申万基金基金经理,现任申万基金基金经理,现任申万基金基金经理,现任申万基金基金经理。

4.2 基金经理(或基金经理小组)简介
张平先生,复旦大学数量经济学硕士,曾任于申万菱信基金,2003年1月加入申万菱信基金管理有限公司(现名申万基金),曾任申万基金基金经理,现任申万基金基金经理,现任申万基金基金经理,现任申万基金基金经理,现任申万基金基金经理。
4.3 基金经理(或基金经理小组)简介
张平先生,复旦大学数量经济学硕士,曾任于申万菱信基金,2003年1月加入申万菱信基金管理有限公司(现名申万基金),曾任申万基金基金经理,现任申万基金基金经理,现任申万基金基金经理,现任申万基金基金经理,现任申万基金基金经理。
4.4 基金经理(或基金经理小组)简介
张平先生,复旦大学数量经济学硕士,曾任于申万菱信基金,2003年1月加入申万菱信基金管理有限公司(现名申万基金),曾任申万基金基金经理,现任申万基金基金经理,现任申万基金基金经理,现任申万基金基金经理,现任申万基金基金经理。

银河沪深300价值指数证券投资基金

2013 第一季度 报告

2013 第一季度 报告

2013年3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:二〇一三年四月十九日

1.1 重要提示

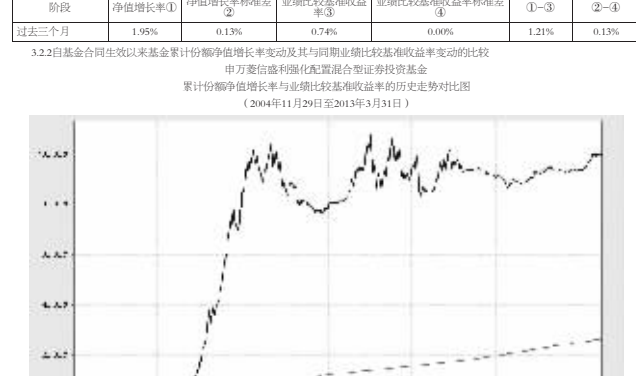
基金管理人、基金托管人及基金销售机构不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2013年4月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产,但不保证基金一定盈利。
基金的过往业绩并不代表其未来表现,投资者有风险,投资人在投资前应仔细阅读本基金的招募说明书。
本报告中财务资料未经审计。
本报告日期为2013年1月1日起至3月31日止。

1.2 基金产品概况

基金名称	申万菱信沪深300价值指数
基金代码	310318
交易代码	310318
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年11月29日
跟踪标的基金名称	沪深300价值指数
跟踪标的基金的投资方式	通过严格的投资程序来跟踪指数化投资策略,力争跟踪标的基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪误差不得超过0.35%,年跟踪误差不得超过4%,实现与跟踪标的基金的有效跟踪。
投资目标	本基金为争取对沪深300价值指数的基金产品,其投资管理要求基金管理人主动管理投资组合,力争实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪误差不得超过0.35%,年跟踪误差不得超过4%,实现与跟踪标的基金的有效跟踪。
投资策略	本基金采用被动式指数投资策略,力争跟踪标的指数的净值增长率,并严格控制跟踪误差。本基金的投资组合构建采用抽样复制法,力求实现基金净值增长率与跟踪标的指数的变动相一致。
业绩比较基准	沪深300价值指数收益率×95%+银行活期存款利率×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型基金和债券型基金。
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

3.1 主要财务指标		单位:人民币元
主要财务指标	报告期(2013年1月1日至2013年3月31日)	
1.本期已实现收益	1,262,797.18	
2.本期利润	953,396.66	
3.加权平均基金份额本期利润	0.0163	
4.期末基金资产净值	94,107,668.65	
5.期末基金份额净值	1.098	

3.2 基金净值表现	
3.2.1 本报告期间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	本基金本报告期基金份额净值增长率为1.96%,业绩比较基准收益率为1.96%,本基金本报告期基金份额净值增长率较业绩比较基准收益率高出0.00%。
3.2.2 本基金合同成立以来的基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比	本基金合同成立以来的基金资产净值增长率为1.96%,业绩比较基准收益率为1.96%,本基金合同成立以来的基金资产净值增长率较业绩比较基准收益率高出0.00%。



基金净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2004年11月29日至2013年3月31日)

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期间	证券从业年限	说明
张平	本基金基金经理	2010-10-18 - 3年	-	张平先生,复旦大学数量经济学硕士,曾任于申万菱信基金,2003年1月加入申万菱信基金管理有限公司(现名申万基金),曾任申万基金基金经理,现任申万基金基金经理,现任申万基金基金经理,现任申万基金基金经理。

4.2 基金经理(或基金经理小组)简介
张平先生,复旦大学数量经济学硕士,曾任于申万菱信基金,2003年1月加入申万菱信基金管理有限公司(现名申万基金),曾任申万基金基金经理,现任申万基金基金经理,现任申万基金基金经理,现任申万基金基金经理,现任申万基金基金经理。
4.3 基金经理(或基金经理小组)简介
张平先生,复旦大学数量经济学硕士,曾任于申万菱信基金,2003年1月加入申万菱信基金管理有限公司(现名申万基金),曾任申万基金基金经理,现任申万基金基金经理,现任申万基金基金经理,现任申万基金基金经理,现任申万基金基金经理。
4.4 基金经理(或基金经理小组)简介
张平先生,复旦大学数量经济学硕士,曾任于申万菱信基金,2003年1月加入申万菱信基金管理有限公司(现名申万基金),曾任申万基金基金经理,现任申万基金基金经理,现任申万基金基金经理,现任申万基金基金经理,现任申万基金基金经理。

银河沪深300价值指数证券投资基金

2013 第一季度 报告

2013 第一季度 报告

2013年3月31日

1.1 重要提示

基金管理人、基金托管人及基金销售机构不存在虚假记载、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责任。
基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2013年4月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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,投资者有风险,投资人在投资前应仔细阅读本基金的招募说明书。
本报告中财务资料未经审计。
本报告日期为2013年1月1日起至3月31日止。

1.2 基金产品概况

基金名称	申万菱信沪深300价值指数
基金代码	310318
交易代码	310318
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年11月29日
跟踪标的基金名称	沪深300价值指数
跟踪标的基金的投资方式	通过严格的投资程序来跟踪指数化投资策略,力争跟踪标的基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪误差不得超过0.35%,年跟踪误差不得超过4%,实现与跟踪标的基金的有效跟踪。
投资目标	本基金为争取对沪深300价值指数的基金产品,其投资管理要求基金管理人主动管理投资组合,力争实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪误差不得超过0.35%,年跟踪误差不得超过4%,实现与跟踪标的基金的有效跟踪。
投资策略	本基金采用被动式指数投资策略,力争跟踪标的指数的净值增长率,并严格控制跟踪误差。本基金的投资组合构建采用抽样复制法,力求实现基金净值增长率与跟踪标的指数的变动相一致。
业绩比较基准	沪深300价值指数收益率×95%+银行活期存款利率×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型基金和债券型基金。
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

3.1 主要财务指标		单位:人民币元
主要财务指标	报告期(2013年1月1日至2013年3月31日)	
1.本期已实现收益	-1,464,031.51	
2.本期利润	-11,485,829.59	
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0155	
4.期末基金资产净值	445,970,717.33	
5.期末基金份额净值	0.773	

3.2 基金净值表现	
3.2.1 本报告期间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	本基金本报告期基金份额净值增长率为-1.53%,业绩比较基准收益率为-1.25%,本基金本报告期基金份额净值增长率较业绩比较基准收益率低出0.28%。
3.2.2 本基金合同成立以来的基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比	本基金合同成立以来的基金资产净值增长率为-1.53%,业绩比较基准收益率为-1.25%,本基金合同成立以来的基金资产净值增长率较业绩比较基准收益率低出0.28%。



基金净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2004年11月29日至2013年3月31日)

银河沪深300价值指数证券投资基金

2013 第一季度 报告

2013 第一季度 报告

2013年3月31日

1.1 重要提示

基金管理人、基金托管人及基金销售机构不存在虚假记载、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责任。
基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2013年4月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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,投资者有风险,投资人在投资前应仔细阅读本基金的招募说明书。
本报告中财务资料未经审计。
本报告日期为2013年1月1日起至3月31日止。

1.2 基金产品概况

基金名称	申万菱信沪深300价值指数
基金代码	519071
交易代码	519071
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年2月12日
跟踪标的基金名称	沪深300价值指数
跟踪标的基金的投资方式	通过严格的投资程序来跟踪指数化投资策略,力争跟踪标的基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪误差不得超过0.35%,年跟踪误差不得超过4%,实现与跟踪标的基金的有效跟踪。
投资目标	本基金管理人对沪深300价值指数进行跟踪,跟踪标的指数成份股及其权重和基金的跟踪投资比例,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整,以期在跟踪标的指数成份股及其权重发生变动时,能及时作出相应的调整,以跟踪标的指数的变动,力争实现基金净值增长率与跟踪标的指数的变动相一致。
投资策略	本基金采用被动式指数投资策略,力争跟踪标的指数的净值增长率,并严格控制跟踪误差。本基金的投资组合构建采用抽样复制法,力求实现基金净值增长率与跟踪标的指数的变动相一致。
业绩比较基准	沪深300价值指数收益率×95%+银行活期存款利率×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型基金和债券型基金。
基金管理人	银河基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

3.1 主要财务指标		单位:人民币元
主要财务指标	报告期(2013年1月1日至2013年3月31日)	
1.本期已实现收益	-1,464,031.51	
2.本期利润	-11,485,829.59	
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0155	
4.期末基金资产净值	445,970,717.33	