申万菱信沪深300价值指数证券投资基金招募说明书(第九次更新)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》、《公开募集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2014年8月11日,有关财务数据和净值表现截止日为2014年6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

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。

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商开发株式会社。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。

杉崎千雄先生,监事,日本籍,大学学历。1988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,2014年4月起任受托财产企划部副部长。

赵鲜女士,监事,硕士研究生。曾任职于申银万国证券股份有限公司,主要从事人力资源相关工作。2012年加入申万菱信基金管理有限公司,现任行政管理总部副总监,兼任申万菱信(上海)资产管理有限公司监事。

牛锐女士,监事,法学博士,曾任职于申银万国证券、中国证监会上海监管局、中金公司、国泰基金等公司,2013年加入申万菱信基金管理有限公司,现任监察稽核总部副总监。

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。

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,曾任申万菱信消费增长基金经理,现任公司副总经理、申万菱信新动力基金经理。

④)督察长

来肖贤先生,经济学硕士,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、部门副经理等。2004年加入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),曾任监察稽核总部副总经理,现任公司督察长。

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年加入本公司筹备组,后正式加盟,曾任风险管理总部总监、投资管理总部副总监,申万菱信量化小盘基金经理等,现任基金投资管理总部总监、量化投资部总经理,申万菱信沪深300价值、申万菱信深证成指分级、申万菱信中小板分级、申万菱信申万证券分级、申万菱信中证环保分级和申万菱信中证军工分级基金经理。

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

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

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:申浩波 李濮君

客户服务中心电话:+86 21 962299,或400 880 8588

网址:www.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

②)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

③)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

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

联系人:陈铭铭

客户服务电话:95559

网址:www.bankcomm.com

⑥)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

⑥)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:倪芳云、于慧

客户服务热线:95528

公司网站:www.spdb.com.cn

⑦)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:陈罡

传真:010-57092611

网址:www.cmbc.com.cn

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:上海农村商业银行股份有限公司

注册地址:上海市浦东新区银城中路8号中融碧玉蓝天15-20、22-27层

法定代表人:胡平西

客服电话:021-96 29994006 962 999

联系人:吴海平

传真:021-38523664

网址:www.sreb.com

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

⑫)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

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

⑭)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

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

⑯)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

⑰)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

⑱)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:宋明

公司网址:www.chinastock.com.cn

⑲)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(仅限),021-95553,或拨打各城市营业网点咨询电话

公司网站:www.htsec.com

⑳)名称:申银万国证券股份有限公司

注册地址:上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场45层

办公地址:上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场40层

法定代表人:储晓明

联系人:黄莹

电话:021-33389888

传真:021-33388224

客服电话:95523或4008895523

电话委托:021-962505

网址:www.sywg.com

㉑)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

㉒)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

㉓)名称:中信证券(浙江)有限责任公司

注册地址:浙江省杭州市解放东路29号迪凯银座22层

办公地址:浙江省杭州市解放东路29号迪凯银座22层

传真:0571-85106383

客户服务电话:95548

网址:www.bigsun.com.cn

㉔)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

㉕)名称:中信证券(山东)有限责任公司

注册地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼20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20层

法定代表人:杨宝林

客户服务电话:95548

网址:www.zxwt.com.cn

㉖)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

㉗)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

㉘)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

㉙)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:薛峰

联系人:刘晨、李芳芳

客服电话:95525

传真:021-68815009

公司网站:www.ebscn.com

㉚)名称:广州证券有限责任公司

注册地址:广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层

办公地址:广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层

法定代表人:刘东

联系人:林洁茹

联系电话:020-88836999

传真:020-88836654

客户服务电话:020-961303

网址:www.gzs.com.cn

㉛)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

㉜)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

㉝)名称:西部证券股份有限公司

注册地址:西安市东新街232号陕西信托大厦16-17层

法定代表人:刘建武

联系人:刘莹

传真:029-87406649

客户服务电话:95582

网站:www.westsecu.com

㉞)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

㉟)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

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:刘闻川

传真:021-68778790

客服电话:400-820-9898

公司网址:www.cnhbstock.com

㊲)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

㊳)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:翟璎

传真:027-87618863

客服电话:028-86711410

网址:www.tfzq.com

㊴)名称:深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#

办公地址:北京市西城区金融大街35号 国际企业大厦C座9层

法定代表人: 陈操

联系人:刘宝文

客服电话:400-850-7771

网址:https://t.jrj.com

㊵)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

传真:021-20835879

客服电话:400-920-0022/ 021-20835588

网址:licaike.hexun.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

㊷)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1、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,基金买卖网www.jjmmw.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

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

㊹)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

㊺)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

㊻)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

客服电话:400-089-1289

公司网站:www.erichfund.com

㊼)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:0571-88910240

客户服务电话:4008-773-772、0571-88920897

网站:www.5ifund.com

㊽)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

㊾)名称:北京钱景财富投资管理有限公司

注册地址:北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012

办公地址:北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012

法定代表人:赵荣春

联系人:魏争

电话:010-57418829

传真:010-57569671

客户服务电话:400-678-5095

网址:www.niuji.net

(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:俞卫锋

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(特殊普通合伙)

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:张振波

经办注册会计师姓名:薛竞、张振波

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、基金的投资目标

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杆杠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%×沪深300价值指数增长率+5%×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2014年6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	345,900,019.23	92.66
	其中:股票	345,900,019.23	92.66
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	27,316,021.44	7.32
7	其他资产	75,354.52	0.02
8	合计	373,291,395.19	100.00

2 报告期末按行业分类的股票投资组合

A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	20,938,204.29	5.62
C	制造业	76,184,412.45	20.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	18,900,207.97	5.08
E	建筑业	15,679,788.87	4.21
F	批发和零售业	4,989,679.05	1.34
G	交通运输、仓储和邮政业	15,739,440.84	4.23
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,684,364.10	0.99
J	金融业	164,659,335.43	44.22
K	房地产业	22,830,725.99	6.13
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	2,293,860.24	0.62
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	345,900,019.23	92.90

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	601318	中国平安	643,865	25,329,649.10	6.80
2	600036	招商银行	2,220,297	22,735,841.28	6.11
3	600016	民生银行	3,646,733	22,646,211.93	6.08
4	601166	兴业银行	1,537,870	15,424,836.10	4.14
5	600000	浦发银行	1,505,703	13,626,612.15	3.66
6	000002	万 科A	1,302,289	10,769,930.03	2.89
7	000651	格力电器	323,646	9,531,374.70	2.56
8	601288	农业银行	3,493,869	8,804,549.88	2.36
9	601328	交通银行	2,112,286	8,195,669.68	2.20
10	000001	平安银行	768,544	7,616,271.04	2.05

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序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8 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。

9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

根据本基金基金合同,本基金不得参与股指期货交易。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金基金合同,本基金不得参与股指期货交易。

10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 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。

10.2 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。

10.3 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。

11 投资组合报告附注

11.1 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。

11.2 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。

11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	46,753.40
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,103.21
5	应收申购款	23,497.91
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	75,354.52

11.4 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。

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

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%
2013年度	-8.90%	1.43%	-11.12%	1.43%	2.22%	0.00%
2014年1月1日至2014年6月30日	-3.03%	0.96%	-4.06%	0.96%	1.03%	0.00%
自基金合同生效起至2014年6月30日	-29.24%	1.29%	-30.39%	1.30%	1.15%	-0.01%

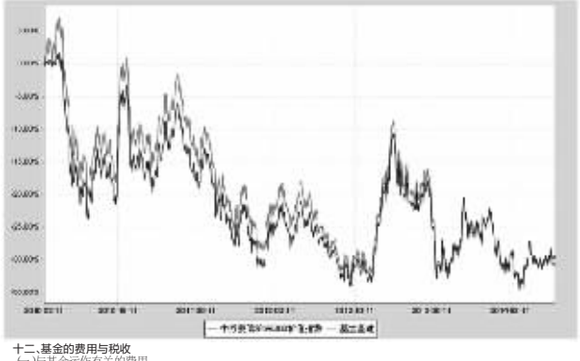
注:上述基金业绩指标已扣除了基金的管理费、托管费和各项交易费用,但不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如:申购费、赎回费等),计入认购或交易基金的各项费用后,实际收益水平要低于所列数字。

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2014年6月30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 ×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	对养老金客户实施特定申购费率
100万以下	1.2%	0.48%
100万(含)-500万	0.8%	0.16%
500万(含)-1000万	0.2%	0.02%
1000万(含)以上	1000元/笔	500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	对养老金客户实施特定赎回费率
1年以下	0.5%	0.125%
1年(含1年)至2年	0.25%	0.0625%
2年以上(含2年)	0%	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》、《公开募集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.更新了重要提示、绪言、释义中运作办法的信息;

2.更新了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2014年6月30日;

6.更新了基金的业绩部分,数据截止日期为2014年6月30日;

7.更新了对基金份额持有人的服务;

8.在"其他应披露事项"一章,列举了本基金自2014年2月12日至2014年8月11日发布的有关公告。

十四、其它应披露事项

自2014年2月12日至2014年8月11日,与本基金和本基金管理人有关的公告如下:

1.2014年3月27日,刊登于《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》的申万菱信沪深300价值指数证券投资基金招募说明书第八次更新;

2.2014年3月27日,刊登于《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》的申万菱信沪深300价值指数证券投资基金2013年年度报告;

3.2014