

## 申万菱信沪深300价值指数证券投资基金

## [2013] 第四季度报告

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:2014年1月21日

重要提示:

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、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。

基金托管人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,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。投资有风险,投资者在作出投资决策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。

本报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

§ 1 基金产品概况

基金简称:申万菱信沪深300价值指数证券投资基金

基金主代码:310398

交易代码:310398

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2010年2月11日

报告期末基金份额总额:650,881,748.88份

投资目标:本基金采取指数投资方式,通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,力争把握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%,跟踪误差不超过4%,实现对沪深300价值指数的有效跟踪。

投资策略:本基金主要采取完全复制法进行投资,即按照标的指数的成份股及其权重构建基金的股票投资组合,并根据标的指数的成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整,在因特殊情形(如流动性不足)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人运用其他可行的方法为构建本基金的实际投资组合,追求尽可能与标的指数的表现相一致。

业绩比较基准:沪深300价值指数收益率×95%+银行存款利率×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,其风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金。

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

§ 2 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2013年10月1日-2013年12月31日)

1.本期已实现收益 -7,937,521.31

2.本期利润 -7,946,313.47

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0124

4.期末基金份额净值 474,944,545.47

5.期末基金份额净值 0.7297

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)和扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.上述基金业绩指标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申购基金的各项费用(例如:申购费、赎回费等),计入认购或申购交易基金的各项费用后,实际收益水平将低于所列示的数值。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本基金报告期内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

阶段 净值增长(%) 净值增长(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准(%) ①(%) ②(%) ③(%) ④(%)

过去三个月 -1.67% 1.08% -1.59% 1.08% -0.08% 0.00%

3.2.2 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金累计净值增长率=基金资产净值增长率-同期银行存款利率×5%。

注:本基金累计净值增长率=基金资产净值增长率-同期银行存款利率×5%。