

---

申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金  
**2010 年年度报告**  
2010 年 12 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：二〇一一年三月二十九日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2011 年 3 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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及其更新。

本报告期自 2010 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

§ 1	重要提示及目录 .....	1
1.1	重要提示 .....	1
§ 2	基金简介 .....	4
2.1	基金基本情况 .....	4
2.2	基金产品说明 .....	4
2.3	基金管理人和基金托管人.....	4
2.4	信息披露方式 .....	5
2.5	其他相关资料 .....	5
§ 3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	5
3.1	主要会计数据和财务指标.....	5
3.2	基金净值表现 .....	6
3.3	过去三年基金的利润分配情况.....	8
§ 4	管理人报告 .....	8
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	11
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
§ 5	托管人报告 .....	14
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2	托管人对报告期内本基金运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
§ 6	审计报告 .....	14
6.1	管理层对财务报表的责任.....	14
6.2	注册会计师的责任 .....	15
6.3	审计意见 .....	15
§ 7	年度财务报表 .....	16
7.1	资产负债表 .....	16
7.2	利润表 .....	17
7.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	18
7.4	报表附注 .....	19
§ 8	投资组合报告 .....	36
8.1	期末基金资产组合情况 .....	36
8.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	37
8.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	38
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	38
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
8.6	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.....	42
8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	42
8.8	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.....	42

---

8.9	投资组合报告附注 .....	42
§ 9	基金份额持有人信息 .....	43
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	43
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	43
§ 10	开放式基金份额变动 .....	43
§ 11	重大事件揭示 .....	44
11.1	基金份额持有人大会决议.....	44
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	44
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	44
11.4	基金投资策略的改变 .....	44
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	44
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	44
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	44
11.8	其他重大事件 .....	45
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息.....	48
§ 13	备查文件目录 .....	48
13.1	备查文件目录 .....	48
13.2	存放地点 .....	49
13.3	查阅方式 .....	49

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金
基金简称	申万巴黎盛利强化配置混合
基金主代码	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
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
报告期末基金份额总额	53,100,281.02 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为争取绝对收益概念的基金产品，其投资管理秉承本基金管理人的主动型投资管理模式，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。
投资策略	本基金采用主动型投资管理模式，以追求绝对收益并争取每基金年度战胜一年期定期存款利率为投资目标。本基金管理人在积极主动和深入的宏观研究分析和判断的基础上，结合自主开发的主动式资产配置模型进行资产配置；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；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；在完成资产配置后，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。
业绩比较基准	银行一年期定期存款利率
风险收益特征	本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，其风险和预期收益均高于保本基金而低于平衡型基金，属于证券投资基金中的偏低风险品种。本基金力争通过资产配置、精选个股等投资策略的实施和积极的风险管理而谋求稳定和可持续的绝对收益。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	申万菱信基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	来肖贤	赵会军
	联系电话	021-23261188	010-66105799
	电子邮箱	service@swsmu.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008808588	95588
传真		021-23261199	010-66105798
注册地址		上海市淮海中路300号香港新世界大厦40层	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		上海市淮海中路300号香港新世界大厦40层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		200021	100140
法定代表人		姜国芳	姜建清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.swsmu.com">http://www.swsmu.com</a>
基金年度报告备置地点	申万菱信基金管理有限公司 中国工商银行

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所有限公司	上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
注册登记机构	申万菱信基金管理有限公司	上海市淮海中路300号香港新世界大厦40层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2010 年	2009 年	2008 年
本期已实现收益	-567,138.08	9,836,854.96	-7,680,923.07
本期利润	-2,561,958.96	9,731,070.36	-10,306,694.43
加权平均基金份额本期利润	-0.0402	0.1134	-0.1031
本期加权平均净值利润率	-4.08%	11.07%	-10.28%
本期基金份额净值增长率	-2.67%	11.00%	-8.80%
3.1.2 期末数据和指标	2010 年末	2009 年末	2008 年末
期末可供分配利润	-119,123.46	3,425,771.50	-3,577,612.11
期末可供分配基金份额利润	-0.0022	0.0482	-0.0400
期末基金资产净值	52,981,157.56	75,279,828.87	86,972,620.20
期末基金份额净值	0.9978	1.0602	0.9729
3.1.3 累计期末指标	2010 年末	2009 年末	2008 年末

基金份额累计净值增长率	95.18%	100.54%	80.67%
-------------	--------	---------	--------

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）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/申购或交易基金的各项费用（例如：申购费、赎回费等），计入认/申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。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 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

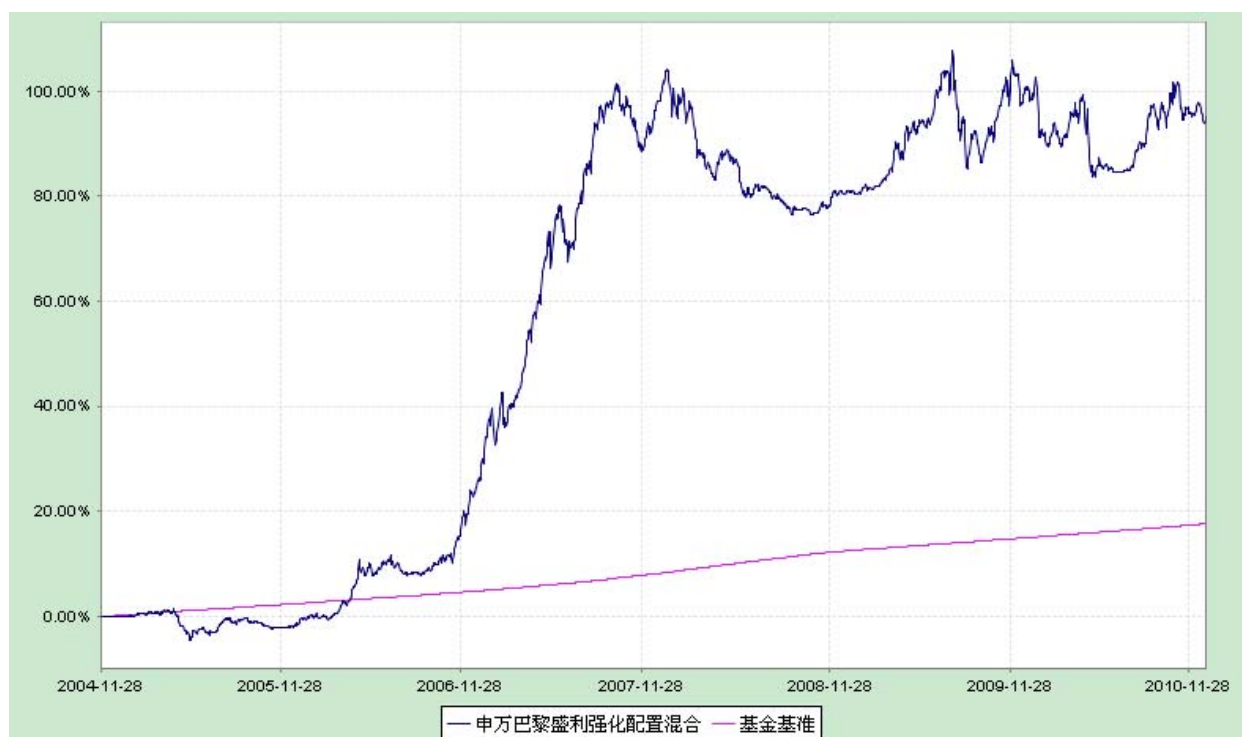
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.47%	0.60%	0.62%	0.00%	-1.09%	0.60%
过去六个月	5.67%	0.50%	1.19%	0.00%	4.48%	0.50%
过去一年	-2.67%	0.56%	2.30%	0.00%	-4.97%	0.56%
过去三年	-1.47%	0.54%	8.71%	0.00%	-10.18%	0.54%
过去五年	98.04%	0.60%	14.84%	0.00%	83.20%	0.60%
自基金合同生效起至今	95.18%	0.56%	17.65%	0.00%	77.53%	0.56%

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计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

申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2004 年 11 月 29 日至 2010 年 12 月 31 日）

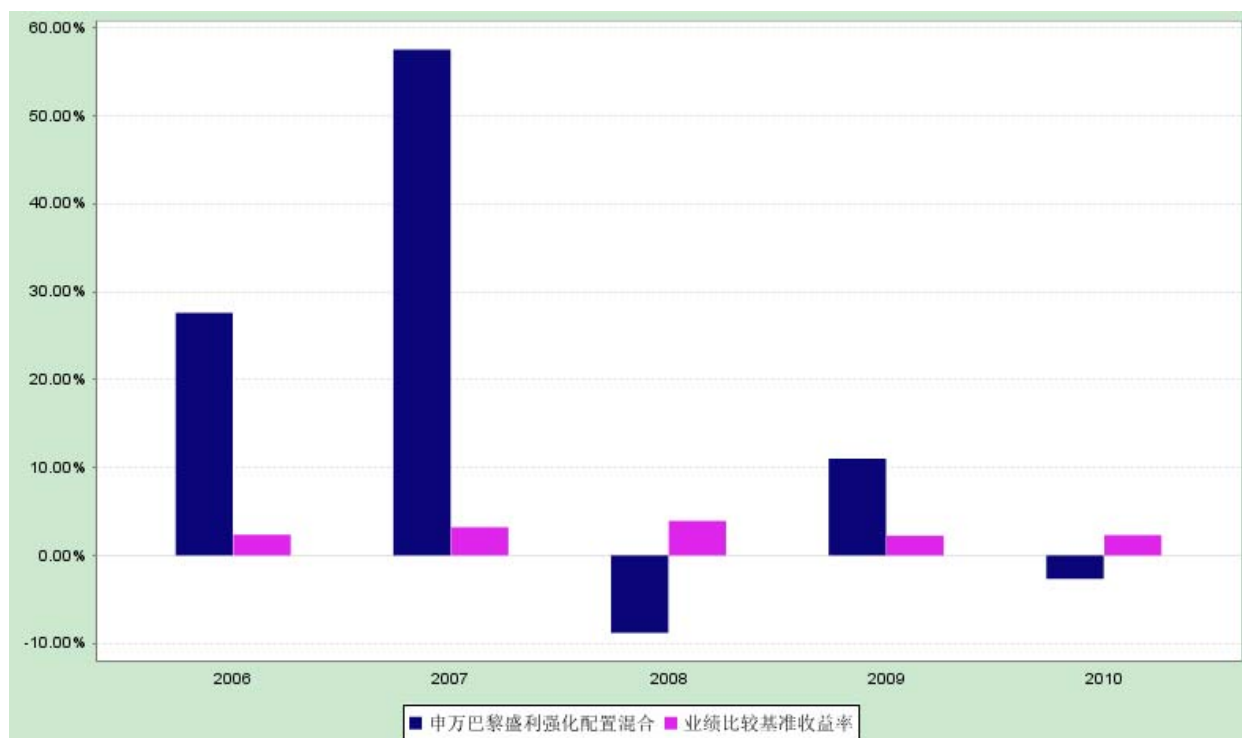


注：根据本基金基金合同，在一级资产配置层面，本基金原则上可能的资产配置比例为：固定收益证券 55%—100%，股票 0%—45%。在本基金合同生效后六个月内，达到上述比例限制。基金合同生效满 6 个月时，本基金已达到上述比例限制。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金

过去五年净值增长率图





### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

金额单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2010年	0.350	1,430,992.66	1,042,374.76	2,473,367.42	-
2009年	0.200	676,552.84	1,134,002.49	1,810,555.33	-
2008年	0.360	1,564,780.99	2,187,674.65	3,752,455.64	-
合计	0.910	3,672,326.49	4,364,051.90	8,036,378.39	-

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

申万巴黎基金管理有限公司是由申银万国证券股份有限公司和法国巴黎资产管理有限公司共同发起设立的一家中法合资基金管理公司。公司成立于 2004 年 1 月 15 日，注册地在中国上海，注册资本为 1.5 亿元人民币。在本报告期内，申银万国证券股份有限公司持有 67% 的股份，法国巴黎资产管理有限公司持有 33% 的股份。

公司成立以来业务增长迅速，在北京、广州先后建立了分公司。截至 2010 年 12 月 31 日，公司旗下管理了包括股票型、混合型、债券型和货币型在内的 10 只开放式基金，形成了完整而丰富的产品线。公司旗下基金管理资产规模超过 120 亿元，客户数超过 170 万户。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
古平	本基金基金经理	2010-10-18	-	2 年	特文特大学硕士。自 2004 年起从事金融工作，历任上海红顶金融工程研究中心债券研究员，上海太平资产管理有限公司债券研究员。2008 年 11 月加盟申万巴黎基金管理有限公司投资管理总部任债券分析师，2009 年 4 月至 2010 年 10 月任申万巴黎添益宝债券型证券投资基金基金经理助理，2009 年 11 月至 2010 年 10 月任申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金基金经理助理。2010 年 10 月起任申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金基金经理。
张维	本基金	2009-09-21	2010-11-24	6 年	英国华威大学经济与金融学硕士。自 2005

维	基金经 理				年起从事金融工作，历任北京天相投资顾问公司分析师。2007 年 3 月加盟申万巴黎基金管理有限公司投资管理总部任行业分析师，2009 年 6 月至 2009 年 9 月任申万巴黎盛利精选证券投资基金基金经理助理，2009 年 9 月至 2010 年 11 月任申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金基金经理。
---	----------	--	--	--	--

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》及其配套法规的规定，严格遵守基金合同约定，本着诚实信用、勤勉尽责等原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。

本基金投资运作符合法律法规和基金合同的规定,信息披露及时、准确、完整；本基金资产与本基金管理人与公司资产之间严格分开；没有发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为。在基金资产的管理运作中，无任何损害基金持有人利益的行为，并通过稳健经营、规范运作、规避风险，保护了基金持有人的合法权益。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

我司于 2004 年年底管理两只开放式基金开始，就着手讨论多基金公平交易问题。2004 年年底我司颁布了关于旗下基金交易情况的内部管理规则，包括《关于基金投资交叉交易行为的管理规则》、《关于基金投资公平交易行为的管理规则》、《标准交易指引》等，并且多次予以修订。原则上我司禁止日内多基金之间的反向交易，要求严格执行多基金日内的公平交易。

依据中国证监会 2008 年 3 月 20 日颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，我司已经完善了公平交易、异常交易等相关制度的修订，并建立系统以有效执行相关内容（包括建立了多组合同向交易和反向交易价差分析模块，并不断完善异常交易检查模块）。

依据要求，本期我司对于旗下多个组合进行了两两之间的公平交易检查，未发现可能导致不公平交易和利益输送的行为。

为确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严格禁止并切实防范利益输送行为，我司一方面不断优化投资决策和研究流程，强化内部风险控制，另一方面强化对投资管理人员行为规范和职业操守的日常教育培训，并加强投资管理人员个人及直系亲属投资行为的申报管理。

我司建立并实施了严格的投资授权制度、投资备选库管理制度和集中交易制度，来切实规范基金

经理投资决策行为。首先，基金经理只能在授权的范围内，依据投资策略会议决定的投资策略，结合投资决策委员会及分析师的资产及行业或板块配置的建议进行操作，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序；第二，基金经理只能投资纳入其管理基金的股票备选库中的股票，而且对于我司内部严格定义的重大投资决策，必须经投资决策委员会讨论备案后方可实施；第三，所有的投资指令必须通过集中交易室执行，集中交易室与投资部门相隔离。交易部必须确保日内公平交易的合规执行，执行结果须于当日报风险管理部独立检查。在上述基础上，我司内部控制部门（风险管理部和监察稽核部）还将通过对投资组合各项合规性指标的每日风险检查提示，以及对投资、研究、交易等全流程的独立的监察稽核，督促落实以上制度的措施，并促进投资运作的规范性。

#### **4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较**

根据投资风格划分，我司旗下没有与本基金相似的投资组合。

#### **4.3.3 异常交易行为的专项说明**

无。

### **4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明**

#### **4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析**

2010 是政策拐点之年，全年伴随信贷超预期，通胀高企，经济转型等诸多复杂的情况，国家货币政策从年初的适度宽松转向了回归稳健的道路；同时，国家对于地产行业的政策也随之发生了变化，全年贯彻了比较一致而持续的调控措施。市场在上半年出现了较大幅度的调整，以银行、地产为主的权重股出现了明显的调整，而符合国家经济转型方向并受到国家政策扶植的新兴产业则表现比较突出；三季度，市场在以美国第二轮定量宽松政策为刺激的流动性的推动下，走出了比较明显的反弹行情，周期行业表现非常强势，但是该轮反弹在央行对于四季度超预期的通胀的调控下遭到了抑制，大盘再次调头下行。

组合由于在上半年保持了较高的仓位，同时忽视了调控力度的猛烈程度，组合经历了较大的损失，之后组合基本把握了下半年的周期类股票的行情，同时也重点投资了一些受益于国家政策方向的如新能源、新技术、低碳经济等个股，组合收益一度有了比较明显的改观，但是由于对于年底再次猛烈的调控没有充分准备，组合的收益遭到了较大的损失，全年表现不够理想！谨向基金份额投资人致歉！

固定收益方面，全年始终坚持短久期策略，以保持流动性为主，收益符合预期。

#### **4.4.2 报告期内基金的业绩表现**

本基金 2010 年度净值增长率为-2.67%，同期业绩基准变现为 2.30%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

考虑到翘尾等其他因素，2011 年初通胀继续保持高位甚至创出新高的可能性依然存在，国家信贷政策继续收紧的可能性较高，包括利率手段和量化工具等手段都有继续实施的空间，流动性预期较 2010 年会更加紧张，因此总体上要做好防御的准备，同时继续关注市场调整过后估值回归合理、行业具备国家政策扶植背景的个股。

对于固定收益而言，2011 年在通胀从高企到逐渐稳定的过程中，会出现比较好的高票息债券的投资机会，在适当的时候会考虑增加组合的久期。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本公司经历了股权变更的特殊阶段，在此期间，公司内部控制体系依然保持其政策的连贯性、管理和控制标准的稳定性，从合规控制和风险管理两个方面均基本保证了公司业务的合规开展，保证了公司日常运营平稳。本报告期内监察稽核工作主要分为以下几个方面：

##### 1、合规培训及相关活动开展工作

由监察稽核部负责的合规培训工作，在 2010 年度基本覆盖了所有的重点领域，从针对 2010 年实施的监管新规——销售费用管理和基金业绩评价，到《证券业从业人员职业行为准则》和《基金公司反洗钱策略》，再到行业内的各项风险事件和涉及违法违规的案例分析等，监察稽核部对于合规培训的频度和质量都较以往明显提升。实施培训的方式也逐步多样化，有内部法务人员实施的法规培训、聘请外部律师事务所和审计事务所进行的案例讲解、通过网上 OA 系统的培训模块进行的测验。所有测验结果和培训材料、参加人员的记录均有存档。

##### 2、制度、流程建设与修订

(1) 本报告期内，监察稽核部根据中国证监会《证券投资基金销售管理办法》和《开放式证券投资基金销售费用管理规定》等办法结合中国证券业协会《证券投资基金销售人员执业守则》、《证券投资基金销售人员从业资质管理规则》等有关规定，制定了本公司《基金销售人员行为规范守则》。

(2) 根据基金估值工作的实际情况，监察稽核部修订了《基金资产估值委员会工作程序》，对于长期停牌证券在复牌后恢复市价法进行估值的条件和对估值方法调整的信息披露两个方面进行了程序调整。

(3) 结合本公司 LOF 基金的上线，监察稽核部负责协调制定了《LOF 基金业务流程》和《分级基金份额折算处理流程》。

(4) 为筹备基金股指期货业务，由督察长协调各相关部门共同制定了《股指期货业务管理办法》、

《股指期货投资管理及风险管理制度》、《股指期货业务风险控制制度》、《股指期货交易管理及执行细则》、《股值期货结算业务管理办法》、《股值期货投资之会计核算办法》以及《股指期货信息技术系统构建》等。

(5) 在反洗钱方面，监察稽核部根据本部报送可疑交易的实际情况，制定了《可疑交易报告分析实施细则》，对本公司报送可疑交易的标准进行了细化。

### 3、合规检查与稽核

监察稽核部定期（按季度）开展合规检查，内容涵盖移动通信工具对于限定人员在限定时间的管理、网络信息交流工具（MSN）记录、特定办公场所的监控记录。对于发现的一般性问题，监察稽核部要求相关部门予以改进，相关人员提交说明文件。对于检查中发现的重要线索或重大可疑事项，监察稽核部转入事件专项稽核项目。

对于其他日常经营中的业务程序和流程检查，监察稽核部依据检查项目列表项目按季度核查。检查项目列表内容根据监管要求和历史发现实行微调。检查报表和季度监察稽核报告一并上报监管机构。

本报告期内，稽核人员根据年度稽核计划对行政管理总部、信息技术总部和投资管理总部进行了内部稽核。对于稽核发现和改进建议分别与被稽核对象进行了反馈，同时形成正式稽核报告。对于本次稽核发现、结论和改进建议，监察稽核部予以持续跟踪被稽核对象的改善情况，并将在下次稽核活动中予以核查、确认。

监察稽核部负责协调公司各部门配合外部审计师开展内控审计工作，并在独立内控报告制作和完成后，分别安排管理层与审计师之间的访谈活动和意见反馈会议，通过这些过程帮助管理层充分认识公司业务管理和内控方面存在的缺陷和弱点，有助于公司的未来改进。

### 4、事件专项稽核与处理

本报告期间，监察稽核部单独、与风险管理部共同完成五项事件的专项稽核。回顾和检讨 2010 年针对这些事件的稽核活动，对于事件的调查过程、调查结论，以及后续的沟通、解决方案，对责任人员的认定和处理意见，都是基于审慎调查、客观反映、责任落实的原则。尤其是对于严重违规人员提出的处理方案建议，监察稽核部从对事件的调查过程、反馈意见、监察谈话这一系列工作，开展得有序、有据。

### 5、反洗钱工作

监察稽核部对于反洗钱的监控和对监管机构的报告已经处于日常和常态化，反洗钱专员基于系统平台负责对可疑交易进行日常监测和分析，对于持续跟踪对象，经过分析后，将系统自动监测交易的部分排出可疑名单，同时继续报送可疑交易。

本报告期内，监察稽核部根据《金融机构客户身份识别和客户身份资料及交易记录保存管理办法》

的规定对本公司高中等级风险客户结合近期交易行为进行定期审核，对部分反洗钱中等级风险客户的风险等级给出下调的建议。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人、本基金托管人和本基金聘请的会计师事务所参与本基金的估值流程，上述各方不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人按照有关法规确定的原则进行估值，将导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上的，即就拟采用的相关估值模型、假设及参数的适当性征求本基金托管人和本基金聘请的会计师事务所的意见。本基金聘请的会计师事务所对相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。

本基金管理人设立基金资产估值委员会，负责根据法规要求，尽可能科学、合理地制定估值政策，审议批准估值程序，并在特定状态下就拟采用的相关估值模型、假设及参数的适当性进行确认，以保护基金份额持有人的利益。

基金资产估值委员会由本基金管理人的总裁、分管副总裁、投资总监、基金会计主管、监察稽核总部和风险管理总部负责人组成。其中，总裁毛剑鸣先生，在资产管理和基金管理领域，拥有 12 年的高级管理人员经验。分管副总裁过振华先生，拥有 6 年的基金公司高级管理人员经验。代理投资总监施海仙女士，拥有 11 年的基金公司研究和投资管理经验。基金运营总部副总监李濮君女士，拥有 10 年的基金会计经验。监察稽核总部总监王菲萍女士，拥有 6 年的基金合规管理经验。风险管理总部总监助理(主持工作)王瑾怡女士，拥有 5 年的基金风险管理经验。

基金经理不参与决定本基金估值的程序。本公司已与中央国债登记结算有限责任公司签订协议，采用其提供的估值数据对银行间债券进行估值。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金于 2010 年 1 月 15 日实施收益分配，每 10 份基金份额派发红利 0.35 元。

截至 2010 年 12 月 31 日，本基金实现的可分配收益为-119,123.46 元，份额净值为 0.9978 元，无可分配收益。本报告期内，根据《基金合同》的约定及本基金的实际运作情况，本基金未进行收益分配。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

2010 年, 本基金托管人在对申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金的托管过程中, 严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定, 不存在任何损害基金份额持有人利益的行为, 完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2010 年, 申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金的管理人——申万菱信基金管理有限公司在申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上, 不存在任何损害基金份额持有人利益的行为, 在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内, 申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金对基金份额持有人进行了一次利润分配, 分配金额为 2,473,367.42 元。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对申万菱信基金管理有限公司编制和披露的申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金 2010 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查, 以上内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

普华永道中天审字(2011)第 20572 号  
申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人:

我们审计了后附的申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金(以下简称“申万巴黎强化配置基金”)的财务报表, 包括 2010 年 12 月 31 日的资产负债表、2010 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

### 6.1 管理层对财务报表的责任

按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财

务报表是申万巴黎强化配置基金的基金管理人申万菱信基金管理有限公司（原名为“申万巴黎基金管理有限公司”）管理层的责任。这种责任包括：

(1) 设计、实施和维护与财务报表编制相关的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报；

(2) 选择和运用恰当的会计政策；

(3) 作出合理的会计估计。

## 6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在实施审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范，计划和实施审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，我们考虑与财务报表编制相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

## 6.3 审计意见

我们认为，上述财务报表已经按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，在所有重大方面公允反映了申万巴黎强化配置基金 2010 年 12 月 31 日的财务状况以及 2010 年度的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天会计师事务所有限公司 注册会计师 薛竞 张鸿

上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

2011-03-28



## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金

报告截止日：2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	11,687,077.99	8,109,631.19
结算备付金		86,819.22	263,329.46
存出保证金		320,917.24	819,074.13
交易性金融资产	7.4.7.2	41,166,442.34	68,819,406.30
其中：股票投资		9,045,067.64	26,935,406.30
基金投资		-	-
债券投资		32,121,374.70	41,884,000.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	711,089.18	81,792.65
应收股利		-	-
应收申购款		20,755.43	7,791.88
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		53,993,101.40	78,101,025.61
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2010年12月31日</b>	<b>上年度末 2009年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	1,597,860.34
应付赎回款		6,384.69	119,702.39
应付管理人报酬		54,560.76	83,333.51
应付托管费		11,366.82	17,361.16
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	59,607.85	102,849.86
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	880,023.72	900,089.48
负债合计		1,011,943.84	2,821,196.74
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	53,100,281.02	71,004,273.03
未分配利润	7.4.7.10	-119,123.46	4,275,555.84
所有者权益合计		52,981,157.56	75,279,828.87
负债和所有者权益总计		53,993,101.40	78,101,025.61

注：报告截止日 2010 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9978 元，基金份额总额 53,100,281.02 份。。

## 7.2 利润表

会计主体：申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金

本报告期：2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2010年1月1日至20 10年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009 年12月31日
<b>一、收入</b>		<b>-590,126.09</b>	<b>12,114,704.20</b>
1. 利息收入		800,138.00	1,604,592.22
其中：存款利息收入	7.4.7.11	96,172.64	123,745.79
债券利息收入		694,751.77	1,480,846.43
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		9,213.59	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		598,175.36	10,578,913.51
其中：股票投资收益	7.4.7.12	542,652.75	9,628,064.97
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	13,627.43	739,328.44
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益	7.4.7.14	41,895.18	211,520.10
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	-1,994,820.88	-105,784.60
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	6,381.43	36,983.07
<b>减：二、费用</b>		<b>1,971,832.87</b>	<b>2,383,633.84</b>
1. 管理人报酬		755,341.50	1,052,432.17
2. 托管费		157,362.88	219,256.74
3. 销售服务费		-	-

4. 交易费用	7.4.7.17	626,773.59	674,392.96
5. 利息支出		31,468.90	18,243.97
其中：卖出回购金融资产支出		31,468.90	18,243.97
6. 其他费用	7.4.7.18	400,886.00	419,308.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-2,561,958.96</b>	<b>9,731,070.36</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-2,561,958.96</b>	<b>9,731,070.36</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金

本报告期：2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	71,004,273.03	4,275,555.84	75,279,828.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-2,561,958.96	-2,561,958.96
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-17,903,992.01	640,647.08	-17,263,344.93
其中：1. 基金申购款	7,127,404.28	-13,880.99	7,113,523.29
2. 基金赎回款	-25,031,396.29	654,528.07	-24,376,868.22
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-2,473,367.42	-2,473,367.42
五、期末所有者权益（基金净值）	53,100,281.02	-119,123.46	52,981,157.56
项目	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	89,396,376.51	-2,423,756.31	86,972,620.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	9,731,070.36	9,731,070.36
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-18,392,103.48	-1,221,202.88	-19,613,306.36
其中：1. 基金申购款	20,980,095.84	507,024.52	21,487,120.36
2. 基金赎回款	-39,372,199.32	-1,728,227.40	-41,100,426.72
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-1,810,555.33	-1,810,555.33
五、期末所有者权益（基金净值）	71,004,273.03	4,275,555.84	75,279,828.87

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：毛剑鸣，主管会计工作负责人：过振华，会计机构负责人：陈景新。

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2004]158号《关于同意申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金设立的批复》核准，由申万菱信基金管理有限公司(原名为“申万巴黎基金管理有限公司”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币690,340,263.28元，业经德勤华永会计师事务所有限公司德师报(验)字(04)第055号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金基金合同》于2004年11月29日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为690,462,261.09份基金份额，其中认购资金利息折合121,997.81份基金份额。

本基金的基金管理人为申万菱信基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同和最新公布的《申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金更新的招募说明书》的有关规定，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债券、银行间债券以及国务院证券监督管理机构规定的其他证券品种。本基金资产配置比例为：固定收益证券55%至100%，股票0%至45%。本基金的业绩比较基准为：一年期银行定期存款利率。

本财务报表由本基金的基金管理人申万菱信基金管理有限公司于2011年3月28日批准报出。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5号《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注7.4.4所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2010年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2010年12月31

日的财务状况以及 2010 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### **7.4.4 重要会计政策和会计估计**

##### **7.4.4.1 会计年度**

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### **7.4.4.2 记账本位币**

本基金的记账本位币为人民币。

##### **7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类**

###### **(1) 金融资产的分类**

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

###### **(2) 金融负债的分类**

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

##### **7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认**

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，应当单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

##### **7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则**

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易,但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具,如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场,采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。

#### **7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### **7.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### **7.4.4.8 损益平准金**

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### **7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量**

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

#### **7.4.4.10 费用的确认和计量**

本基金的管理人报酬包括管理费和业绩报酬。

管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分(包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等)为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分后的余额)。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### **7.4.4.12 分部报告**

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### **7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计**

##### **重要会计估计及其关键假设**

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(a)对于特殊事项停牌股票，根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，本基金采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票估值，通过停牌股票所处行业的行业指数变动以大致反映市场因素在停牌期间对于停牌股票公允价值的影响。上述指数收益法的关键假设包

括所选取行业指数的变动能在重大方面基本反映停牌股票公允价值的变动，停牌股票的发行者在停牌期间的各项变化未对停牌股票公允价值产生重大影响等。本基金自 2009 年 6 月 16 日起，采用中证协 (SAC)基金行业股票估值指数以取代原交易所发布的行业指数。

(b)在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期，本基金未发生会计政策变更事项。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期，本基金未发生会计估计变更事项。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本报告期，本基金未发生会计差错更正事项。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107 号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2)基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20%的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50%计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20%代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------



	2010 年 12 月 31 日	2009 年 12 月 31 日
活期存款	11,687,077.99	8,109,631.19
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	11,687,077.99	8,109,631.19

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	8,795,213.48	9,045,067.64	249,854.16
债券	交易所市场	2,669,491.00	2,524,374.70
	银行间市场	29,742,570.00	29,597,000.00
	合计	32,412,061.00	32,121,374.70
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	41,207,274.48	41,166,442.34	-40,832.14
项目	上年度末 2009 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	24,982,937.56	26,935,406.30	1,952,468.74
债券	交易所市场	2,014,000.00	2,016,000.00
	银行间市场	39,868,480.00	39,868,000.00
	合计	41,882,480.00	41,884,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	66,865,417.56	68,819,406.30	1,953,988.74

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
应收活期存款利息	2,294.82	5,981.53
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	30.40	92.10
应收债券利息	708,729.36	75,684.42
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
其他	34.60	34.60
合计	711,089.18	81,792.65

**7.4.7.6 其他资产**

无余额。

**7.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
交易所市场应付交易费用	59,310.85	102,599.86
银行间市场应付交易费用	297.00	250.00
合计	59,607.85	102,849.86

**7.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
应付券商交易单元保证金	500,000.00	500,000.00
应付赎回费	23.72	89.48
预提费用	380,000.00	400,000.00
合计	880,023.72	900,089.48

**7.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	71,004,273.03	71,004,273.03
本期申购	7,127,404.28	7,127,404.28
本期赎回（以“-”号填列）	-25,031,396.29	-25,031,396.29
本期末	53,100,281.02	53,100,281.02

注：本期申购含红利再投资和转换转入份额，本期赎回含转换转出份额。

**7.4.7.10 未分配利润**

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,425,771.50	849,784.34	4,275,555.84
本期利润	-567,138.08	-1,994,820.88	-2,561,958.96
本期基金份额交易产生的变动数	579,632.06	61,015.02	640,647.08
其中：基金申购款	-30,096.95	16,215.96	-13,880.99
基金赎回款	609,729.01	44,799.06	654,528.07
本期已分配利润	-2,473,367.42	-	-2,473,367.42
本期末	964,898.06	-1,084,021.52	-119,123.46

**7.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
活期存款利息收入	92,159.54	119,717.04
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	2,594.35	2,660.78
其他	1,418.75	1,367.97
合计	96,172.64	123,745.79

**7.4.7.12 股票投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
卖出股票成交总额	212,525,908.53	219,315,191.37
减：卖出股票成本总额	211,983,255.78	209,687,126.40
买卖股票差价收入	542,652.75	9,628,064.97

**7.4.7.13 债券投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	167,626,048.30	177,698,232.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	166,416,646.69	173,948,318.13
减：应收利息总额	1,195,774.18	3,010,585.43

债券投资收益	13,627.43	739,328.44
--------	-----------	------------

**7.4.7.14 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31 日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31 日
股票投资产生的股利收益	41,895.18	211,520.10
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	41,895.18	211,520.10

**7.4.7.15 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31 日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31 日
1. 交易性金融资产	-1,994,820.88	-105,784.60
——股票投资	-1,702,614.58	1,585,955.40
——债券投资	-292,206.30	-1,691,740.00
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-1,994,820.88	-105,784.60

**7.4.7.16 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
基金赎回费收入	5,647.81	32,161.86
基金转换费收入	733.62	1,137.99
其他	-	3,683.22
合计	6,381.43	36,983.07

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2、本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分组成，其中赎回费总额的 25% 归入转出基金的基金资产。

**7.4.7.17 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
----	-----------------------------	----------------------------------

交易所市场交易费用	625,473.59	673,142.96
银行间市场交易费用	1,300.00	1,250.00
合计	626,773.59	674,392.96

**7.4.7.18 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31 日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	320,000.00	340,000.00
债券帐户维护费	18,000.00	18,000.00
银行汇划费	2,886.00	1,308.00
合计	400,886.00	419,308.00

**7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****7.4.8.1 或有事项**

无。

**7.4.8.2 资产负债表日后事项**

无。

**7.4.9 关联方关系**

关联方名称	与本基金的关系
申万菱信基金管理有限公司	基金管理人 基金销售机构 基金注册登记机构
中国工商银行	基金托管人 基金代销机构
申银万国证券股份有限公司（以下简称“申银万国”）	基金管理人的股东 基金代销机构
法国巴黎资产管理公司	基金管理人的股东

注：1. 经中国证监会证监许可[2011]106号《关于核准申万巴黎基金管理有限公司变更股权、公司名称及修改章程的批复》批准，三菱 UFJ 信托银行株式会社受让法国巴黎资产管理持有的申万巴黎基金管理有限公司 33% 的股权。出资比例变更后，申银万国与三菱 UFJ 信托银行株式会社分别占公司注册资本的 67% 和 33%。相关工商变更登记手续于 2011 年 3 月 3 日完成，公司名称变更为“申万菱信基金管理有限公司”。

2. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****7.4.10.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总 额的比例	成交金额	占当期股票成 交总额的比例
申银万国	113,758,815.09	28.02%	270,128,936.31	60.77%

#### 7.4.10.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
申银万国	96,613.01	28.56%	17,164.96	28.94%
关联方名称	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
申银万国	228,685.69	61.66%	68,904.50	67.16%

注：(1)上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券交易不计佣金。

(2)该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月3 1日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理费	755,341.50	1,052,432.17
其中：支付销售机构的客户维护费	144,341.16	155,284.89

注：支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值\*1.20%/当年天数。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月 31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31 日
当期发生的基金应支付的托管费	157,362.88	219,256.74

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月

底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值\*0.25%/当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期和上年度可比期间未与关联方进行的银行同业间市场进行的债券现券交易和债券回购业务。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期和上年度可比期间内，本基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况。

##### 7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本期末和上年度末，除基金管理人之外的其他关联方，未发生投资本基金的情况。

#### 7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	11,687,077.99	92,159.54	8,109,631.19	119,717.04

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期和上年度可比期间内，本基金在承销期内未参与关联方承销证券买卖。

#### 7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日	每 10 份 基金份额分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	利润分配 合计	备注
1	2010-01-15	2010-01-18	0.350	1,430,992.66	1,042,374.76	2,473,367.42	-
合计	-	-	0.350	1,430,992.66	1,042,374.76	2,473,367.42	-

#### 7.4.12 期末（2010年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证券名称	成功 认购日	可流 通日	流通受 限类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 (单位：股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备 注
601933	永辉超市	2010-12-09	2011-03-15	新股网 下申购	23.98	31.24	4,946	118,605.08	154,513.04	-
601890	亚星锚链	2010-12-17	2011-03-28	新股网	22.50	21.50	15,593	350,842.50	335,249.50	-

				下申购						
--	--	--	--	-----	--	--	--	--	--	--

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金截至 2010 年 12 月 31 日止未持有因公布重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

截至本报告期末 2010 年 12 月 31 日止，本基金无债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额，无相关抵押债券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

本基金为混合型基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、权证投资等。与这些金融工具有关的风险，以及本基金管理人管理这些风险所采取的风险管理政策如下所述。

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，属于偏低风险品种，本基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益高于保本基金而低于平衡型基金”的风险收益目标。

本基金管理人已制定针对以上金融工具风险的管理政策和控制制度，并且形成了由本基金管理人在公司层面建立的风险管理委员会以及在董事会层面建立的风险控制委员会负责对与所投资金融工具相关的风险类型、管理政策和各种投资限制的定期回顾、评估和修改，本基金管理人的风险管理部门负责具体落实和日常跟踪的工作机制。

本基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

本基金面临的主要风险包括：信用风险、流动性风险和市场风险。与本基金相关的市场风险主要是利率风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指金融工具的一方到期无法履行约定义务致使本基金遭受损失的风险。本基金的信用



风险主要来源于金融工具的发行者或是交易对手不能履行约定义务而产生。

对于发行者的信用风险控制，本基金管理人主要通过通过对投资品种的信用等级评估来选择适当的投资对象来管理。于 2010 年 12 月 31 日，由于本基金未投资于企业债(2009 年 12 月 31 日：同)，所以本基金管理人认为本基金与债券发行者有关的信用风险不重大。

本基金的银行存款存放在本基金的托管行 - 中国工商银行，因而本基金管理人认为与该银行相关的信用风险不重大。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成债券等投资品种的交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小，本基金管理人认为在交易所进行的交易涉及的信用风险不重大。

对于银行间债券等品种的交易，本基金管理人主要通过事前检查和控制交易对手信用及交割方式来管理风险。

#### **7.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险主要来源于开放式基金每日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。

本基金管理人对于流动性风险管理的目标是监控基金组合流动性指标，确保市场出现剧烈波动时，基金仍能应付大量赎回和其他负债，灵活调整组合结构，而且不影响组合估值。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人对基金申购赎回状况进行严密监控和分析预测，保持基金投资组合中的流动性资产与之相匹配。此外，本基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款，设计了非常情况下赎回资金的处理模式，控制因开放模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

对于交易所交易品种变现的流动性风险，本基金管理人每日监控和预测本基金投资品种的流动性指标，主要包括基金投资品种在短时间内变现能力的指标、组合持仓中变现能力较差的品种的比例控制和受限制流通股票的总量控制，通过指标来持续地评估、选择、跟踪和控制基金投资的流动性风险。对于银行间债券投资，本基金管理人通过跟踪和控制投资品种与市价的偏离度来实现。此外，本基金在需要时可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金，以缓解流动性风险。

本基金所持大部分交易性金融资产在证券交易所上市，其余是流动性较好的可在银行间同业市场交易的金融资产工具、银行存款和结算备付金，因此比较容易变现来满足投资者对于基金资产的赎回。除附注 7.4.12 所披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。从本基金资产和负债的情况来看，本基金管理人认为本基金面临的流动性风险较小。

本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。于资产负债表日，本基金持有的利率敏感性资产主要是银行存款和固定利率债券投资。根据本基金产品性质，生息资产占基金资产比重较大(55% 至 100%)，因此本基金面临的利率风险较大。

对于固定利率类金融工具，面临由于市场利率走高而导致的债券资产的市场价格低于购买成本的风险。

对于浮动利率类金融工具，主要面临两方面利率风险：第一，每个付息期间内面临由于市场利率走高而导致的债券资产的市场价格低于购买成本的风险；第二，每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流的影响的风险。

本基金管理人内部设置对投资债券的久期限制，并根据投资组合保险策略不断调整投资组合内长期债券的投资比例，并结合定期对利率水平的预测等方法对上述利率风险进行管理。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2010年12月31 日	1个月以内	1-3 个月	3个月 -1年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	11,687,077.99	-	-	-	-	11,687,077.99
结算备付金	86,819.22	-	-	-	-	86,819.22
存出保证金	98,780.49	-	-	-	222,136.75	320,917.24
交易性金融资产	-	29,597,000.00	-	2,524,374.70	9,045,067.64	41,166,442.34
应收利息	-	-	-	-	711,089.18	711,089.18
应收申购款	-	-	-	-	20,755.43	20,755.43
资产总计	11,872,677.70	29,597,000.00	-	2,524,374.70	9,999,049.00	53,993,101.40
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	6,384.69	6,384.69

应付管理人报酬	-	-	-	-	54,560.76	54,560.76
应付托管费	-	-	-	-	11,366.82	11,366.82
应付交易费用	-	-	-	-	59,607.85	59,607.85
其他负债	-	-	-	-	880,023.72	880,023.72
负债总计	-	-	-	-	1,011,943.84	1,011,943.84
利率敏感度缺口	11,872,677.70	29,597,000.00	-	2,524,374.70	8,987,105.16	52,981,157.56
上年度末2009年 12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	8,109,631.19	-	-	-	-	8,109,631.19
结算备付金	263,329.46	-	-	-	-	263,329.46
存出保证金	98,780.49	-	-	-	720,293.64	819,074.13
交易性金融资产	-	39,868,000.00	2,016,000.00	-	26,935,406.30	68,819,406.30
应收利息	-	-	-	-	81,792.65	81,792.65
应收申购款	-	-	-	-	7,791.88	7,791.88
资产总计	8,471,741.14	39,868,000.00	2,016,000.00	-	27,745,284.47	78,101,025.61
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	119,702.39	119,702.39
应付管理人报酬	-	-	-	-	83,333.51	83,333.51
应付托管费	-	-	-	-	17,361.16	17,361.16
应付交易费用	-	-	-	-	102,849.86	102,849.86
其他负债	-	-	-	-	900,089.48	900,089.48
应付证券清算款	-	-	-	-	1,597,860.34	1,597,860.34
负债总计	-	-	-	-	2,821,196.74	2,821,196.74
利率敏感度缺口	8,471,741.14	39,868,000.00	2,016,000.00	-	24,924,087.73	75,279,828.87

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 市场利率曲线向上、向下平行移动 50 个基点		
	2. 其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日

	市场利率平行上升 50 个基点	-140,000.00	-40,000.00
	市场利率平行下降 50 个基点	150,000.00	40,000.00

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

基金的其他价格风险是指以交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险，该风险可能与特定投资品种相关，也有可能与整体投资品种相关。本基金的市场价格风险主要来源于本基金投资的股权或债券等工具的未来价格可能受到一般市场波动或是其他影响个别工具价值的特定风险影响。

本基金管理人采用主动型投资管理模式，在宏观研究分析和判断的基础上，采用基于投资组合保险策略开发的资产再平衡模型来完成资产配置；在完成资产配置后，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以及自下而上选择个股。此外，结合宏观及微观环境的变化，定期或不定期对投资策略、资产配置、基金资产投资组合进行修正，来主动应对可能发生的其他价格风险。

此外，本基金管理人在构建基金资产配置和资产投资组合的基础上，每日测算股票等风险资产的仓位并控制在根据投资组合保险策略计算的风险资产仓位限制内，同时还建立事前和事后跟踪误差等多种定量的方法对基金进行风险度量，控制整体投资组合的可能损失，来测试基金持有风险资产的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制，争取将风险控制在可承受的范围内。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日		上年度末 2009 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	9,045,067.64	17.07	26,935,406.30	35.78
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	9,045,067.64	17.07	26,935,406.30	35.78

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 以申万 300 指数为基准衡量其他价格风险
----	--------------------------

2. 其他市场变量保持不变			
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
	1. 基准上升 5%	410,000.00	1,260,000.00
2. 基准下降 5%	-410,000.00	-1,260,000.00	

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

##### (b) 以公允价值计量的金融工具

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

于 2010 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 11,569,442.34 元，第二层级的余额为 29,597,000.00 元，无属于第三层级的余额(2009 年 12 月 31 日：第一层级的余额为 28,493,956.30 元，第二层级的余额为 40,325,450.00 元，无属于第三层级的余额)。本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层级未发生重大变动。

对于持有的重大事项停牌股票，本基金将相关股票公允价值所属层级于停牌期间从第一层级转入第二层级，并于复牌后从第二层级转回第一层级(2009 年度：同)。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比
----	----	----	----------

			例 (%)
1	权益投资	9,045,067.64	16.75
	其中：股票	9,045,067.64	16.75
2	固定收益投资	32,121,374.70	59.49
	其中：债券	32,121,374.70	59.49
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	11,773,897.21	21.81
6	其他各项资产	1,052,761.85	1.95
7	合计	53,993,101.40	100.00

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,616,431.00	3.05
B	采掘业	860,400.00	1.62
C	制造业	3,727,205.54	7.03
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	228,480.00	0.43
C4	石油、化学、塑胶、塑料	331,221.04	0.63
C5	电子	22,255.00	0.04
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	1,241,249.50	2.34
C8	医药、生物制品	1,904,000.00	3.59
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	1,242,918.06	2.35
H	批发和零售贸易	940,513.04	1.78
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	657,600.00	1.24
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-

合计	9,045,067.64	17.07
----	--------------	-------

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000998	隆平高科	38,300	1,247,431.00	2.35
2	601766	中国南车	120,000	906,000.00	1.71
3	600348	国阳新能	30,000	860,400.00	1.62
4	600866	星湖科技	60,000	848,400.00	1.60
5	300101	国腾电子	7,501	810,558.06	1.53
6	002024	苏宁电器	60,000	786,000.00	1.48
7	000002	万科A	80,000	657,600.00	1.24
8	601607	上海医药	25,000	546,000.00	1.03
9	600079	人福医药	20,000	509,600.00	0.96
10	600406	国电南瑞	6,000	432,360.00	0.82
11	002086	东方海洋	20,000	369,000.00	0.70
12	601890	亚星锚链	15,593	335,249.50	0.63
13	002466	天齐锂业	6,008	331,221.04	0.63
14	002117	东港股份	8,000	228,480.00	0.43
15	601933	永辉超市	4,946	154,513.04	0.29
16	002506	超日太阳	500	22,255.00	0.04

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600256	广汇股份	6,926,019.00	9.20
2	600172	黄河旋风	5,170,350.44	6.87
3	600425	青松建化	5,115,842.00	6.80
4	600704	中大股份	4,898,532.00	6.51
5	002005	德豪润达	4,855,658.98	6.45
6	600351	亚宝药业	4,847,211.18	6.44
7	600157	永泰能源	3,622,297.00	4.81
8	601166	兴业银行	3,601,500.00	4.78
9	600673	东阳光铝	3,534,854.00	4.70

10	002079	苏州固锔	3,498,120.00	4.65
11	600379	宝光股份	3,482,176.66	4.63
12	002210	飞马国际	3,476,178.10	4.62
13	002351	漫步者	3,471,536.14	4.61
14	000338	潍柴动力	3,421,780.00	4.55
15	000778	新兴铸管	3,420,668.00	4.54
16	600845	宝信软件	3,300,672.02	4.38
17	600575	芜湖港	3,260,819.95	4.33
18	000591	桐君阁	3,088,501.61	4.10
19	600169	太原重工	2,932,793.23	3.90
20	600452	涪陵电力	2,904,000.00	3.86
21	002139	拓邦股份	2,868,205.56	3.81
22	600396	金山股份	2,836,621.19	3.77
23	600720	祁连山	2,798,773.00	3.72
24	600330	天通股份	2,760,514.00	3.67
25	601699	潞安环能	2,727,500.00	3.62
26	002324	普利特	2,659,236.88	3.53
27	600058	五矿发展	2,549,424.75	3.39
28	002249	大洋电机	2,471,646.34	3.28
29	000950	建峰化工	2,324,298.70	3.09
30	000878	云南铜业	2,311,031.64	3.07
31	600594	益佰制药	2,287,832.00	3.04
32	600812	华北制药	2,214,700.00	2.94
33	600795	国电电力	2,173,819.00	2.89
34	600337	美克股份	2,162,548.00	2.87
35	002241	歌尔声学	2,072,000.00	2.75
36	000790	华神集团	2,043,176.34	2.71
37	002271	东方雨虹	2,021,500.00	2.69
38	002437	誉衡药业	2,013,985.00	2.68
39	601168	西部矿业	1,925,900.00	2.56
40	600866	星湖科技	1,876,842.55	2.49
41	000541	佛山照明	1,842,500.00	2.45
42	600362	江西铜业	1,804,123.00	2.40
43	600489	中金黄金	1,745,633.73	2.32
44	000540	中天城投	1,704,886.00	2.26
45	600576	万好万家	1,653,314.01	2.20
46	002028	思源电气	1,622,641.00	2.16
47	002056	横店东磁	1,576,471.00	2.09
48	000151	中成股份	1,561,167.00	2.07
49	000998	隆平高科	1,549,000.00	2.06
50	600050	中国联通	1,519,000.00	2.02



51	002086	东方海洋	1,517,099.95	2.02
----	--------	------	--------------	------

## 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600256	广汇股份	8,697,607.28	11.55
2	600056	中国医药	4,795,287.57	6.37
3	600351	亚宝药业	4,610,482.30	6.12
4	002068	黑猫股份	4,569,698.50	6.07
5	002005	德豪润达	4,428,740.39	5.88
6	600704	中大股份	4,337,332.00	5.76
7	600172	黄河旋风	4,145,720.20	5.51
8	600425	青松建化	4,008,020.68	5.32
9	600571	信雅达	3,862,590.00	5.13
10	600379	宝光股份	3,783,467.76	5.03
11	600157	永泰能源	3,732,166.90	4.96
12	002079	苏州固锝	3,626,333.00	4.82
13	600673	东阳光铝	3,543,769.95	4.71
14	002139	拓邦股份	3,498,404.00	4.65
15	002351	漫步者	3,489,218.00	4.63
16	601166	兴业银行	3,435,015.04	4.56
17	000591	桐君阁	3,296,165.19	4.38
18	600990	四创电子	3,284,803.00	4.36
19	600575	芜湖港	3,186,609.30	4.23
20	600845	宝信软件	3,137,739.00	4.17
21	002210	飞马国际	3,130,844.00	4.16
22	000338	潍柴动力	3,084,620.00	4.10
23	000778	新兴铸管	3,042,310.32	4.04
24	600169	太原重工	2,953,539.62	3.92
25	600396	金山股份	2,910,890.77	3.87
26	601699	潞安环能	2,863,192.39	3.80
27	600720	祁连山	2,832,300.00	3.76
28	600330	天通股份	2,820,399.32	3.75
29	000961	中南建设	2,700,203.90	3.59
30	600452	涪陵电力	2,697,110.00	3.58
31	002324	普利特	2,675,904.59	3.55
32	600058	五矿发展	2,564,446.92	3.41
33	002249	大洋电机	2,506,510.00	3.33
34	600795	国电电力	2,415,000.00	3.21
35	600594	益佰制药	2,403,855.00	3.19

36	002217	联合化工	2,334,069.00	3.10
37	600050	中国联通	2,310,000.00	3.07
38	002437	誉衡药业	2,282,554.00	3.03
39	000950	建峰化工	2,273,520.24	3.02
40	601168	西部矿业	2,269,932.80	3.02
41	600812	华北制药	2,117,229.50	2.81
42	600837	海通证券	2,089,556.00	2.78
43	002241	歌尔声学	2,061,595.94	2.74
44	000878	云南铜业	2,028,715.00	2.69
45	002271	东方雨虹	1,992,884.00	2.65
46	600489	中金黄金	1,945,977.00	2.58
47	000541	佛山照明	1,904,812.50	2.53
48	600337	美克股份	1,867,389.50	2.48
49	000540	中天城投	1,780,000.00	2.36
50	600576	万好万家	1,741,836.92	2.31
51	000790	华神集团	1,730,865.00	2.30
52	600362	江西铜业	1,683,029.00	2.24
53	000762	西藏矿业	1,599,540.00	2.12
54	000151	中成股份	1,591,429.00	2.11
55	600111	包钢稀土	1,583,774.00	2.10
56	002340	格林美	1,571,000.00	2.09
57	002028	思源电气	1,565,548.72	2.08
58	000565	渝三峡 A	1,512,083.60	2.01

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	195,795,531.70
卖出股票的收入（成交）总额	212,525,908.53

注：“买入金额”、“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	2,524,374.70	4.76
2	央行票据	29,597,000.00	55.86
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-

4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	32,121,374.70	60.63

#### 8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	1001015	10 央票 15	200,000	19,576,000.00	36.95
2	0801026	08 央票 26	100,000	10,021,000.00	18.91
3	010303	03 国债(3)	26,990	2,524,374.70	4.76

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

#### 8.8 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。

#### 8.9 投资组合报告附注

**8.9.1** 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。

**8.9.2** 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。

#### 8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	320,917.24
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	711,089.18
5	应收申购款	20,755.43
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,052,761.85

#### 8.9.4 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。

#### 8.9.5 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情况。

### § 9 基金份额持有人信息

#### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
4,764	11,146.15	1,121,955.62	2.11%	51,978,325.40	97.89%

#### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	5,333.69	0.01%

### § 10 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	71,004,273.03
本报告期基金总申购份额	7,127,404.28
减：本报告期基金总赎回份额	25,031,396.29
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	53,100,281.02

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期间未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金基金管理人在本报告期内无重大人事变动。

本基金基金托管人在本报告期内无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金管理人的基金投资策略严格遵循本基金《招募说明书》中披露的基本投资策略，未发生显著的改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金聘用普华永道中天会计师事务所有限公司负责基金审计事务，未发生改聘会计师事务所事宜。自本基金合同生效以来，普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金提供审计服务时间为 3 年。本报告期本基金应支付普华永道中天会计师事务所有限公司审计费 60,000 元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	----	------	-----------	----

	单元数量	成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券股份有限公司	2	129,286,824.25	31.85%	109,338.36	32.32%	-
申银万国证券股份有限公司	2	113,758,815.09	28.02%	96,613.01	28.56%	-
中信证券股份有限公司	1	54,242,584.45	13.36%	44,072.52	13.03%	-
中国建银投资证券有限责任公司	1	34,069,439.57	8.39%	27,681.49	8.18%	-
中国国际金融有限公司	1	32,428,153.67	7.99%	26,348.17	7.79%	-
国信证券股份有限公司	1	24,643,812.39	6.07%	20,023.35	5.92%	-
银河证券股份有限公司	1	7,298,171.00	1.80%	5,929.75	1.75%	-
长城证券有限责任公司	1	5,868,385.99	1.45%	4,768.00	1.41%	-
华泰联合证券有限责任公司	1	2,605,856.00	0.64%	2,117.35	0.63%	-
海通证券股份有限公司	1	1,732,405.00	0.43%	1,407.61	0.42%	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

注：交易单元选择的标准：1、经营行为规范，在近一年内无重大违规行为；2、公司财务状况良好；3、有良好的内控制度，在业内有良好的声誉；4、有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；5、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于旗下开放式基金 2009 年年度最后一个交易日基金资产净值和基金份额净值的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2010-01-04
2	申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金第十次招募说明书更新（摘要）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2010-01-12
3	关于申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金分红的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2010-01-13
4	关于参加深圳发展银行开展基金定投及申购费率优惠推广活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2010-01-15
5	关于旗下部分基金参与上海农村商业银行定投业务及网上银行申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2010-01-15
6	关于旗下部分基金在国信证券股份有限公司开通定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2010-01-18
7	申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金	《中国证券报》、《上海证券报》、	2010-01-22

	2009 年第四季度报告	《证券时报》、《证券日报》	
8	关于暂停向深圳证券交易所发送旗下部分基金基金净值数据的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2010-02-26
9	申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金 2009 年年度报告（摘要）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2010-03-31
10	关于调整旗下部分基金在上海浦东发展银行定期定额投资起点金额的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2010-04-07
11	关于旗下基金参加中国工商银行网上申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2010-04-07
12	申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金 2010 年第一季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2010-04-20
13	关于旗下开放式基金继续参加深圳发展银行开展基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2010-04-26
14	关于旗下基金对长期停牌的股票变更估值方法的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2010-04-28
15	关于恢复对旗下基金持有的“中信证券”股票进行市价估值的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2010-05-06
16	关于旗下开放式基金参加中信银行开展的个人网银申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2010-05-29
17	关于旗下开放式基金暂不参加中信银行定期定额投资费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2010-06-01
18	关于旗下基金在申银万国证券股份有限公司开通定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2010-06-07
19	关于旗下开放式基金新增华融证券股份有限公司为代销机构并实施申购（含定期定额投资）费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2010-06-10
20	关于旗下部分开放式基金参加交通银行开展的网上银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2010-07-01
21	关于旗下开放式基金 2010 年半年度最后一个交易日基金资产净值和基金份额净值的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2010-07-01
22	澄清公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2010-07-09
23	申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金第十一次招募说明书更新（摘要）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2010-07-12
24	申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金 2010 年第二季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2010-07-19
25	关于旗下开放式基金在信达证券股份有限公司开通定期定额投资业务并实施申购（含定期定额投资）费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2010-07-28
26	关于旗下基金对长期停牌的股票变更估值方法的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2010-07-29
27	关于旗下基金对长期停牌的股票变更估值方	《中国证券报》、《上海证券报》、	2010-08-03

	法的提示性公告	《证券时报》、《证券日报》	
28	关于旗下开放式基金参加海通证券股份有限公司开展的定期定额投资费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2010-08-06
29	关于旗下开放式基金参加交通银行股份有限公司开展的定期定额投资费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2010-08-16
30	关于旗下基金对长期停牌的股票变更估值方法的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2010-08-17
31	关于旗下部分开放式基金参加国泰君安证券股份有限公司开展的网上交易费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2010-08-17
32	关于恢复对旗下基金持有的“航空动力”股票进行市价估值的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2010-08-25
33	申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金 2010 年半年度报告（摘要）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2010-08-27
34	关于旗下开放式基金新增长江证券股份有限公司为代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2010-08-28
35	关于恢复对旗下基金持有的“深发展 A”与“中国平安”股票进行市价估值的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2010-09-03
36	关于旗下基金对长期停牌的股票变更估值方法的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2010-09-04
37	关于旗下开放式基金新增国联证券股份有限公司为代销机构并实施申购（含定期定额投资）费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2010-09-16
38	关于恢复对旗下基金持有的“佛山照明”股票进行市价估值的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2010-09-17
39	关于旗下部分开放式基金继续参加中国农业银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2010-09-29
40	关于恢复对旗下基金持有的“赛马实业”股票进行市价估值的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2010-09-30
41	关于旗下基金对长期停牌的股票变更估值方法的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2010-10-14
42	关于增聘申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金基金经理的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2010-10-19
43	申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金 2010 年第三季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2010-10-27
44	关于运用固有资金申购旗下收益宝货币市场基金的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2010-10-27
45	关于运用固有资金申购旗下收益宝货币市场基金的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2010-11-01
46	关于恢复对旗下基金持有的“中航重机”股票进行市价估值的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2010-11-02



47	关于运用自有资金申购旗下收益宝货币市场基金的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2010-11-04
48	关于旗下基金对长期停牌的股票变更估值方法的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2010-11-09
49	关于免去申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金基金经理的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2010-11-26
50	关于旗下开放式基金新增华夏银行股份有限公司为代销机构并实施申购（含定期定额投资）费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2010-12-24
51	关于旗下开放式基金继续参加深圳发展银行开展基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2010-12-30
52	关于旗下部分开放式基金继续参加交通银行开展的网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2010-12-30
53	关于旗下部分开放式基金参加中国工商银行开展的“2011 倾心回馈”基金定投优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2010-12-30
54	关于调整在交通银行定期定额投资旗下部分开放式基金起点金额的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2010-12-31

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

本公司已于 2011 年 3 月 4 日发布《申万巴黎基金管理有限公司关于股权变更及公司更名的公告》，原公司外方股东法国巴黎资产管理有限公司将所持有的申万巴黎基金管理有限公司全部 33% 的股权转让三菱 UFJ 信托银行株式会社。变更后的股东及持股比例分别为：申银万国证券股份有限公司：67%；三菱 UFJ 信托银行株式会社：33%。同时公司名称由“申万巴黎基金管理有限公司”变更为“申万菱信基金管理有限公司”。

本报告中所称“申万巴黎基金管理有限公司”现均指“申万菱信基金管理有限公司”。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

基金合同；

招募说明书及其定期更新；

发售公告；

成立公告；

开放日常交易业务公告；

定期报告；

其他临时公告。

### 13.2 存放地点

上述备查文件中基金合同、招募说明书及其定期更新、基金发售公告和基金成立公告均放置于本基金管理人及基金托管人的住所；开放日常交易业务公告、定期报告和其他临时公告放置于本基金管理人的住所。本基金管理人住所地址为：中国上海淮海中路 300 号香港新世界大厦 40 层。

### 13.3 查阅方式

上述文件均可到本基金管理人的住所进行查阅，也可在本基金管理人的网站进行查阅，查询网址：  
[www.swsmu.com](http://www.swsmu.com)。

申万菱信基金管理有限公司

二〇一一年三月二十九日