

# 申万菱信消费增长股票型证券投资基金

## 2013 年半年度报告（摘要）

2013 年 6 月 30 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：二〇一三年八月二十七日

## 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。本半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 2013 年 8 月 26 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。

本年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2013 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                 |
|------------|-----------------|
| 基金简称       | 申万菱信消费增长股票      |
| 基金主代码      | 310388          |
| 交易代码       | 310388          |
| 基金运作方式     | 契约型开放式          |
| 基金合同生效日    | 2009年6月12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 | 370,534,774.24份 |
| 基金合同存续期    | 不定期             |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 本基金重点投资于消费拉动经济增长过程中充分受益的消费范畴行业，致力于寻找具有良好财务状况、较高核心价值与估值优势的优质上市公司进行投资，分享中国经济持续增长及增长方式变化带来的投资机会。在严格控制投资风险的前提下，保持基金资产的持续增值，为投资者获取超过业绩基准的长期投资收益。  |
| 投资策略   | 本基金秉承基金管理人擅长的双线并行的组合投资策略，‘自上而下’地进行证券品种的大类资产配置和行业选择配置，‘自下而上’地精选个股，构建组合。股票类资产与债券类资产的配置主要取决于两类资产未来的风险和收益。预期股票类资产的收益/风险比大于债券类资产的风险/收益比，相应增加股票类资产的投资。本基金管理人通过综合考察当前估值、未来增长、宏观经济政策等判断未来股票、债券的收益率，得到中长期的相对估值，再根据资金市值比等中短期指标确定资产小幅调整比例，制定资产组合调整方案，模拟不同方案的风险收益，最终得到合适的资产组合调整方案。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率×80%+中信标普国债指数收益率×20%   |
| 风险收益特征 | 本基金是一只进行主动投资的股票型证券投资基金，属于证券投资基金中的中较高风险、较高收益品种基金。   |

## 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        |

## 2.4 信息披露方式

|                      |   |
|----------------------|---|
| 登载基金半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> |
| 基金半年度报告备置地点          | 申万菱信基金管理有限公司<br>中国工商银行                                  |

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 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 | 报告期（2013年1月1日至2013年6月30日） |
|---------------|---------------------------|
| 本期已实现收益       | 25,356,847.90             |
| 本期利润          | -15,434,917.94            |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.0353                   |
| 本期基金份额净值增长率   | -4.81%                    |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2013年6月30日)          |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.2293                   |
| 期末基金资产净值      | 285,577,441.34            |
| 期末基金份额净值      | 0.771                     |

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<br>增长率① | 份额净值增长<br>率标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基准<br>收益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|--------------|--------------|-----------------|----------------|-------------------|--------|-------|
| 过去一个月        | -12.68%      | 1.72%           | -12.64%        | 1.51%             | -0.04% | 0.21% |
| 过去三个月        | -7.00%       | 1.32%           | -9.33%         | 1.17%             | 2.33%  | 0.15% |
| 过去六个月        | -4.81%       | 1.36%           | -9.84%         | 1.20%             | 5.03%  | 0.16% |
| 过去一年         | -1.41%       | 1.30%           | -7.67%         | 1.09%             | 6.26%  | 0.21% |
| 过去三年         | -7.07%       | 1.39%           | -8.80%         | 1.10%             | 1.73%  | 0.29% |
| 自基金成立<br>起至今 | -16.75%      | 1.51%           | -17.59%        | 1.21%             | 0.84%  | 0.30% |

注：本基金的业绩基准指数=沪深 300 股票指数收益率×80%+中信标普国债指数收益率×20%。  
其中：沪深 300 股票指数作为衡量股票投资部分的业绩基准，中信标普国债指数作为衡量基金债券投资部分的业绩基准。

本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，计算方式如下：

$$\text{benchmark}(0) = 1000;$$

$\% \text{benchmark}(t) = 80\% * (\text{沪深 300 股票指数}(t) / \text{沪深 300 股票指数}(t-1) - 1) + 20\% * (\text{中信标普国债指数}(t) / \text{中信标普国债指数}(t-1) - 1);$

$$\text{benchmark}(t) = (1 + \% \text{benchmark}(t)) * \text{benchmark}(t-1);$$

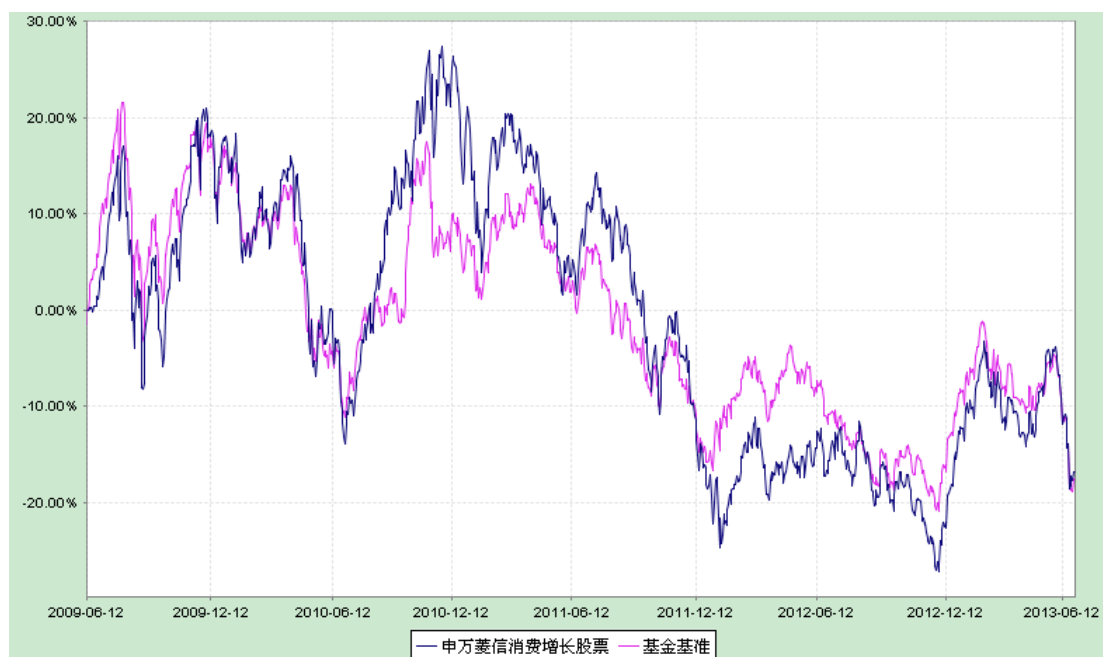
其中  $t=1, 2, 3, \dots$ 。

### 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

申万菱信消费增长股票型证券投资基金

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

(2009 年 6 月 12 日至 2013 年 6 月 30 日)



## 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

申万菱信基金管理有限公司原名申万巴黎基金管理有限公司，是由国内大型综合类券商申银万国证券股份有限公司和三菱 UFJ 信托银行株式会社共同设立的一家中外合资基金管理公司。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。其中，申银万国证券股份有限公司持有 67% 的股份，三菱 UFJ 信托银行株式会社持有 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 2013 年 6 月 30 日，公司旗下管理了包括股票型、混合型、债券型、指数型和货币型在内的 15 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 158 亿元，客户数超过 201 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 |        |   |
| 欧庆铃 | 本基金基金经理 | 2012-08-27      | -    | 14 年   | 欧庆铃先生，北京师范大学理学博士。曾任职于广州证券研究中心，金鹰基金管理有限公司，万家基金管理有限公司等。2011 年加入本公司，现任申万菱信新动力、申万菱信消费增长基金经理。              |
| 单黎鸣 | 本基金基金经理 | 2013-01-04      | -    | 15 年   | 单黎鸣先生，上海交通大学工商管理硕士，自 1997 年从事金融工作，曾任职于申银万国证券股份有限公司，国信证券股份有限公司，西京投资管理有限公司等。2010 年加入本公司，现任申万菱信消费增长基金经理。 |

注：1、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

2、任职日期和离任日期均指公司作出决定之日。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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及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。

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

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司制定了《公平交易制度》，通过组织结构的设置、工作制度、流程和技术手段全面落实公平交易原则在具体业务（包括研究分析、投资决策、交易执行等）环节中的实现，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；同时，通过对投资交易行为的日常监控和事后分析评估来加强对公平交易过程和结果的监督。

在投资和研究方面，本公司设立了独立于公募基金投资、特定客户资产投资的研究总部，建立了规范、完善的研究管理平台，确保公平地为各投资组合提供研究服务。

在交易执行方面，本公司的投资管理职能和交易执行职能相隔离，通过实行集中交易制度和公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。

在日常监控和事后分析评估方面，本公司风险管理总部开展日内和定期的工作对公平交易执行情况作整体监控和效果评估。风险管理总部通过对不同组合之间同向交易的价差率的假设检验、价格占优的次数百分比统计、价差交易模拟贡献与组合收益率差异的比较等方法对本报告期以及连续四个季度期间内、不同时间窗口下公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行了分析；对于场外交易，还特别对比了组合之间发生的同向交易的市场公允价格和交易对手，判断交易是否公平且是否涉及利益输送。

本公司通过事前的制度规范、事中的监控和事后的分析评估，严格执行了公平交易制度，公平对待了旗下各投资组合。本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司制定了《异常交易监控报告制度》，明确定义了投资交易过程中出现的各种可能导致不公平交易和利益输送的异常交易类型，并规定且落实了异常交易的日常监控、识别以及事后的分析流程。

本报告期，未发生我司旗下投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况以及其他可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2013 年上半年中国经济保持较弱态势，A 股市场，特别是主板市场，也反映了这种经济形势。

2013 上半年的经济弱势也明显地传导到了上市公司。在整个上半年券商盈利预测上调的行业只有为数不多的几个，如金融、电力和家电等。我们在年初的布局上也重点做了配置。但是，在今年极度分化的结构性行情中，这些行业的表现远远落后于创业板的上市公司。

作为一个消费主题基金我们始终关注消费领域的投资机会，相对非消费类的基金，我们也较注重这些领域的配置。但是由于消费作为后周期的行业，我们等待的投资机会在上半年始终没有出现。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金报告期内净值表现为-4.81%，同期业绩比较基准表现为-9.84%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在中国整体经济产能过剩且环保压力较大的前提下，传统产业很难再取得过去 10 年的高速增长，而符合未来发展趋势的新兴产业体量很难全面支持起中国经济。综合我们对经济趋势的判断和上半年以来各级政府在各种场合的言论，我们基本可以得到以下结论：1) 经济转型是不可逆转的趋势；2) 环境保护已经到了刻不容缓的地步；3) 转型不是一蹴而就的，在可以预见的未来我们的经济增长率是有政策保障的。

在这样的判断下，结合目前的经济的证券市场形势，我们认为下半年市场会表现比上半年略好，结构性的分化会趋于缓和。同时，我们坚定地认为扩大内需、促进消费将是我们国家转型的最优结构。为此我们在下半年会继续注重价值投资，以长期投资理念为主导，并时刻注意经济领域的动向，耐心等待时机，在估值低、有潜力的大型蓝筹公司和消费类公司中寻找合适的投资机会。

#### 4.6 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。

资产估值委员会由本基金管理人的总经理，分管基金运营的副总经理，基金运营总部、监察稽核总部、基金投资管理总部、风险管理总部等各总部总监组成。其中，总经理过振华先生，拥有近 9 年基金公司高级管理人员经验。基金运营由公司总经理过振华先生分管。基金投资管理总部总监欧庆铃先生，拥有近 11 年的基金公司研究和投资管理经验。基金运营总部总监李濮君女士，拥有 12 年的基金会计经验。监察稽核总部总监王菲萍女士，拥有 9 年的基金合规管理经验。风险管理总部副总监王瑾怡女士，拥有近 8 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。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

## **5 托管人报告**

### **5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明**

本报告期内，本基金托管人在对申万菱信消费增长股票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投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明**

本报告期内，申万菱信消费增长股票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菱信消费增长股票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，申万菱信消费增长股票型证券投资基金未进行利润分配。

### 5.3 托管人对本半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菱信消费增长股票型证券投资基金 2013 年半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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：申万菱信消费增长股票型证券投资基金

报告截止日：2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产             | 本期末<br>2013 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2012 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------------------|--------------------------|
| 资 产：            |                        |                          |
| 银行存款            | 38,589,307.14          | 14,835,411.05            |
| 结算备付金           | 507,514.76             | 223,563.59               |
| 存出保证金           | 81,295.87              | 587,280.95               |
| 交易性金融资产         | 268,154,993.14         | 354,134,885.91           |
| 其中：股票投资         | 268,154,993.14         | 344,139,885.91           |
| 基金投资            | -                      | -                        |
| 债券投资            | -                      | 9,995,000.00             |
| 资产支持证券投资        | -                      | -                        |
| 衍生金融资产          | -                      | -                        |
| 买入返售金融资产        | -                      | -                        |
| 应收证券清算款         | 16,324,058.81          | 2,680,148.23             |
| 应收利息            | 6,194.89               | 181,707.68               |
| 应收股利            | 228,000.00             | -                        |
| 应收申购款           | 1,043,671.63           | 22,020.72                |
| 递延所得税资产         | -                      | -                        |
| 其他资产            | -                      | -                        |
| 资产总计            | 324,935,036.24         | 372,665,018.13           |
| 负 债 和 所 有 者 权 益 | 本期末<br>2013 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2012 年 12 月 31 日 |
| 负 债：            |                        |                          |
| 短期借款            | -                      | -                        |
| 交易性金融负债         | -                      | -                        |

|               |                |                |
|---------------|----------------|----------------|
| 衍生金融负债        | -              | -              |
| 卖出回购金融资产款     | -              | -              |
| 应付证券清算款       | -              | 211,477.78     |
| 应付赎回款         | 38,334,857.53  | 2,532,346.57   |
| 应付管理人报酬       | 423,667.02     | 429,372.34     |
| 应付托管费         | 70,611.17      | 71,562.07      |
| 应付销售服务费       | -              | -              |
| 应付交易费用        | 268,268.80     | 200,776.07     |
| 应交税费          | -              | -              |
| 应付利息          | -              | -              |
| 应付利润          | -              | -              |
| 递延所得税负债       | -              | -              |
| 其他负债          | 260,190.38     | 388,339.17     |
| 负债合计          | 39,357,594.90  | 3,833,874.00   |
| <b>所有者权益：</b> |                |                |
| 实收基金          | 370,534,774.24 | 455,246,774.12 |
| 未分配利润         | -84,957,332.90 | -86,415,629.99 |
| 所有者权益合计       | 285,577,441.34 | 368,831,144.13 |
| 负债和所有者权益总计    | 324,935,036.24 | 372,665,018.13 |

注：报告截止日 2013 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.771 元，基金份额总额 370,534,774.24 份。

## 6.2 利润表

会计主体：申万菱信消费增长股票型证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目               | 本期<br>2013 年 1 月 1 日至<br>2013 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2012 年 1 月 1 日至<br>2012 年 6 月 30 日 |
|------------------|--|---|
| <b>一、收入</b>      | <b>-11,274,229.10</b>                    | <b>12,880,671.87</b>                          |
| 1.利息收入           | 203,530.06                               | 292,419.90                                    |
| 其中：存款利息收入        | 82,858.90                                | 141,894.98                                    |
| 债券利息收入           | 93,895.89                                | 48,756.41                                     |
| 资产支持证券利息收入       | -  | -   |
| 买入返售金融资产收入       | 26,775.27                                | 101,768.51                                    |
| 其他利息收入           | -  | -   |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | 29,279,695.92                            | -31,441,559.50                                |
| 其中：股票投资收益        | 24,745,299.68                            | -34,129,121.15                                |
| 基金投资收益           | -  | -   |

|                            |                       |                     |
|----------------------------|-----------------------|---------------------|
| 债券投资收益                     | 15,070.00             | 127,022.11          |
| 资产支持证券投资收益                 | -                     | -                   |
| 衍生工具收益                     | -                     | -                   |
| 股利收益                       | 4,519,326.24          | 2,560,539.54        |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      | -40,791,765.84        | 43,956,981.01       |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          | -                     | -                   |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 34,310.76             | 72,830.46           |
| <b>减：二、费用</b>              | <b>4,160,688.84</b>   | <b>5,664,422.85</b> |
| 1. 管理人报酬                   | 2,724,413.89          | 3,023,808.02        |
| 2. 托管费                     | 454,068.96            | 503,968.07          |
| 3. 销售服务费                   | -                     | -                   |
| 4. 交易费用                    | 784,525.20            | 1,937,625.26        |
| 5. 利息支出                    | -                     | -                   |
| 其中：卖出回购金融资产支出              | -                     | -                   |
| 6. 其他费用                    | 197,680.79            | 199,021.50          |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> | <b>-15,434,917.94</b> | <b>7,216,249.02</b> |
| 减：所得税费用                    | -                     | -                   |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   | <b>-15,434,917.94</b> | <b>7,216,249.02</b> |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：申万菱信消费增长股票型证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 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）                        | 455,246,774.12                             | -86,415,629.99  | 368,831,144.13 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -  | -15,434,917.94  | -15,434,917.94 |
| 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）      | -84,711,999.88                             | 16,893,215.03   | -67,818,784.85 |
| 其中：1. 基金申购款                            | 8,828,516.56                               | -1,566,375.55   | 7,262,141.01   |
| 2. 基金赎回款                               | -93,540,516.44                             | 18,459,590.58   | -75,080,925.86 |
| 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） | -  | -               | -              |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 370,534,774.24                             | -84,957,332.90  | 285,577,441.34 |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 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）                        | 546,286,788.86                             | -126,907,816.68 | 419,378,972.18 |

|  |                |                 |                |
|--|----------------|-----------------|----------------|
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -              | 7,216,249.02    | 7,216,249.02   |
| 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)      | -80,735,475.79 | 17,989,081.16   | -62,746,394.63 |
| 其中：1. 基金申购款                            | 14,439,388.26  | -3,313,144.16   | 11,126,244.10  |
| 2. 基金赎回款                               | -95,174,864.05 | 21,302,225.32   | -73,872,638.73 |
| 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) | -              | -               | -              |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                        | 465,551,313.07 | -101,702,486.50 | 363,848,826.57 |

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：过振华，主管会计工作负责人：过振华，会计机构负责人：李濮君

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

申万菱信消费增长股票型证券投资基金(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”)证监许可[2009]第 310 号文件核准，由申万菱信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和本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 1,464,103,233.64 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2009)第 097 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，本基金基金合同于 2009 年 6 月 12 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,464,221,007.90 份基金份额，其中认购资金利息折合 117,774.26 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》和本基金基金合同的有关规定，本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括在中华人民共和国境内依法发行上市的股票、国债、金融债、企业债、回购、央行票据、可转换债券、权证、资产支持证券以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 X 80% + 中信标普国债指数收益率 X 20%。

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 2013 年 8 月 27 日批准报出。

### 6.4.2 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》、本基金基金合同和在财务报表附注6.4.4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。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2013年01月01日至2013年6月30日止期间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2013年6月30日的财务状况以及2013年01月01日至2013年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明。

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 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。

#### 6.4.6 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[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》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)对基金取得的股票股息红利收入、企业债券利息收入,由上市公司、债券发行企业在向基金派发股息红利、债券利息时代扣代缴个人所得税。自2013年1月1日起,对基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税,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。

#### 6.4.7 关联方关系

##### 6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无。

##### 6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称         | 与本基金的关系               |
|---------------|-----------------------|
| 中国工商银行        | 基金托管人、基金代销机构          |
| 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 |
| 申银万国证券股份有限公司  | 基金管理人的股东、基金代销机构       |
| 三菱UFJ信托银行株式会社 | 基金管理人的股东              |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2013年1月1日至2013年6月30日 |                  | 上年度可比期间<br>2012年1月1日至2012年6月30日 |                  |
|-------|----------------------------|------------------|---------------------------------|------------------|
|       | 成交金额                       | 占当期股票成交<br>总额的比例 | 成交金额                            | 占当期股票成交<br>总额的比例 |
| 申银万国  | 131,294,181.54             | 26.37%           | 193,878,214.13                  | 15.46%           |

##### 6.4.8.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2013年1月1日至2013年6月30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<br>额的比例 |
| 申银万国  | 117,065.88                      | 26.26%     | 80,334.15  | 29.95%           |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2012年1月1日至2012年6月30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<br>额的比例 |
| 申银万国  | 163,850.29                      | 15.63%     | 163,850.29 | 17.01%           |

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。权证交易不计佣金。

(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。

##### 6.4.8.2 关联方报酬

##### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2013年1月1日至2013年6月30日 | 上年度可比期间<br>2012年1月1日至2012年6月30日 |
|----|----------------------------|---------------------------------|
|    | 当期发生的基金应支付的管理费             | 2,724,413.89                    |

|                 |            |            |
|-----------------|------------|------------|
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 735,899.09 | 758,218.83 |
|-----------------|------------|------------|

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 1.50%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\*1.50%/当年天数。

#### 6.4.8.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                   | 上年度可比期间              |
|----------------|----------------------|----------------------|
|                | 2013年1月1日至2013年6月30日 | 2012年1月1日至2012年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 454,068.96           | 503,968.07           |

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。

#### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.8.4.1 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。

##### 6.4.8.4.2 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。

#### 6.4.8.5 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                   |           | 上年度可比期间              |            |
|--------|----------------------|-----------|----------------------|------------|
|        | 2013年1月1日至2013年6月30日 |           | 2012年1月1日至2012年6月30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 | 38,589,307.14        | 79,274.20 | 34,950,434.96        | 130,565.13 |

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。

#### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间在承销期内未参与关联方承销证券买卖。

#### 6.4.9 期末（2013年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发、增发而流通受限的证券。

##### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码   | 股票名称 | 停牌日期       | 停牌原因   | 期末估值单价 | 复牌日期       | 复牌开盘单价 | 数量(股)   | 期末成本总额       | 期末估值总额       | 备注 |
|--------|------|------------|--------|--------|------------|--------|---------|--------------|--------------|----|
| 300027 | 华谊兄弟 | 2013-06-05 | 重大资产重组 | 28.55  | 2013-07-24 | 31.41  | 300,000 | 5,279,312.62 | 8,565,000.00 | -  |

注：本基金截至 2013 年 06 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。



### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

截至本报告期末 2013 年 6 月 30 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。

### 6.4.10 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 2013 年 06 月 30 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 259,589,993.14 元, 属于第二层级的余额为 8,565,000.00 元, 无属于第三层级的余额。本基金本期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。

(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。

## 7 投资组合报告

### 7.1 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     | 268,154,993.14 | 82.53         |
|    | 其中: 股票   | 268,154,993.14 | 82.53         |
| 2  | 固定收益投资   | -              | -             |
|    | 其中: 债券   | -              | -             |
|    | 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      | 39,096,821.90  | 12.03  |
| 6 | 其他各项资产            | 17,683,221.20  | 5.44   |
| 7 | 合计                | 324,935,036.24 | 100.00 |

## 7.2 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         | 4,179,025.26   | 1.46         |
| B  | 采矿业              | -              | -            |
| C  | 制造业              | 113,985,448.97 | 39.91        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 11,748,000.00  | 4.11         |
| E  | 建筑业              | -              | -            |
| F  | 批发和零售业           | 13,524,492.73  | 4.74         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 17,522,745.68  | 6.14         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 17,515,935.72  | 6.13         |
| J  | 金融业              | 51,875,194.24  | 18.17        |
| K  | 房地产业             | 25,033,780.50  | 8.77         |
| 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  | 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        | 12,770,370.04  | 4.47         |
| S  | 综合               | -              | -            |
|    | 合计               | 268,154,993.14 | 93.90        |

## 7.3 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

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  | 600009 | 上海机场 | 1,470,029 | 17,522,745.68 | 6.14         |
| 2  | 600406 | 国电南瑞 | 1,173,204 | 17,515,935.72 | 6.13         |
| 3  | 600036 | 招商银行 | 1,500,000 | 17,400,000.00 | 6.09         |
| 4  | 000895 | 双汇发展 | 420,032   | 16,146,030.08 | 5.65         |
| 5  | 002305 | 南国置业 | 1,710,034 | 14,107,780.50 | 4.94         |
| 6  | 600016 | 民生银行 | 1,600,000 | 13,712,000.00 | 4.80         |

|    |        |      |           |               |      |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 7  | 000527 | 美的电器 | 1,063,991 | 13,214,768.22 | 4.63 |
| 8  | 601318 | 中国平安 | 361,024   | 12,549,194.24 | 4.39 |
| 9  | 600011 | 华能国际 | 2,200,000 | 11,748,000.00 | 4.11 |
| 10 | 000024 | 招商地产 | 450,000   | 10,926,000.00 | 3.83 |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于申万菱信基金管理有限公司网站的半年度报告正文。

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 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  | 600016 | 民生银行  | 16,154,866.76 | 4.38            |
| 2  | 000527 | 美的电器  | 14,586,474.62 | 3.95            |
| 3  | 002269 | 美邦服饰  | 13,244,144.74 | 3.59            |
| 4  | 002305 | 南国置业  | 12,669,476.98 | 3.44            |
| 5  | 000024 | 招商地产  | 11,916,799.00 | 3.23            |
| 6  | 002277 | 友阿股份  | 9,695,787.60  | 2.63            |
| 7  | 601333 | 广深铁路  | 9,678,507.25  | 2.62            |
| 8  | 600089 | 特变电工  | 9,286,147.54  | 2.52            |
| 9  | 002022 | 科华生物  | 8,182,943.08  | 2.22            |
| 10 | 300027 | 华谊兄弟  | 7,920,552.73  | 2.15            |
| 11 | 600406 | 国电南瑞  | 7,365,008.30  | 2.00            |
| 12 | 002007 | 华兰生物  | 7,329,677.10  | 1.99            |
| 13 | 002385 | 大北农   | 7,140,625.30  | 1.94            |
| 14 | 300351 | 永贵电器  | 6,660,657.38  | 1.81            |
| 15 | 601566 | 九牧王   | 6,466,028.88  | 1.75            |
| 16 | 600428 | 中远航运  | 6,141,273.23  | 1.67            |
| 17 | 002458 | 益生股份  | 5,216,651.40  | 1.41            |
| 18 | 000581 | 威孚高科  | 5,060,423.45  | 1.37            |
| 19 | 600761 | 安徽合力  | 4,831,806.92  | 1.31            |
| 20 | 000539 | 粤电力 A | 4,553,258.60  | 1.23            |

##### 7.4.2 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  | 600000 | 浦发银行  | 24,390,087.53 | 6.61            |
| 2  | 000418 | 小天鹅 A | 20,883,748.11 | 5.66            |
| 3  | 000002 | 万科 A  | 16,583,667.05 | 4.50            |
| 4  | 002140 | 东华科技  | 15,857,275.91 | 4.30            |

|    |        |       |               |      |
|----|--------|-------|---------------|------|
| 5  | 600837 | 海通证券  | 15,285,239.40 | 4.14 |
| 6  | 601699 | 潞安环能  | 10,812,950.58 | 2.93 |
| 7  | 000338 | 潍柴动力  | 10,507,003.78 | 2.85 |
| 8  | 600312 | 平高电气  | 10,178,213.30 | 2.76 |
| 9  | 002269 | 美邦服饰  | 9,817,466.62  | 2.66 |
| 10 | 000951 | 中国重汽  | 8,509,687.59  | 2.31 |
| 11 | 600690 | 青岛海尔  | 8,436,530.67  | 2.29 |
| 12 | 000999 | 华润三九  | 8,191,922.72  | 2.22 |
| 13 | 601333 | 广深铁路  | 8,151,826.90  | 2.21 |
| 14 | 300351 | 永贵电器  | 7,418,579.93  | 2.01 |
| 15 | 600406 | 国电南瑞  | 7,402,709.54  | 2.01 |
| 16 | 000539 | 粤电力 A | 7,391,352.15  | 2.00 |
| 17 | 002277 | 友阿股份  | 6,919,410.85  | 1.88 |
| 18 | 600489 | 中金黄金  | 6,889,086.08  | 1.87 |
| 19 | 600809 | 山西汾酒  | 6,044,807.84  | 1.64 |
| 20 | 000919 | 金陵药业  | 5,688,068.89  | 1.54 |

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

|               |                |
|---------------|----------------|
| 买入股票的成本（成交）总额 | 218,930,705.47 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 278,879,202.08 |

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。

#### 7.5 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。

#### 7.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.7 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。

#### 7.8 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。

## 7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.9.1 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。

### 7.9.2 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。

## 7.10 投资组合报告附注

7.10.1 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。

7.10.2 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。

### 7.10.3 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   | 81,295.87     |
| 2  | 应收证券清算款 | 16,324,058.81 |
| 3  | 应收股利    | 228,000.00    |
| 4  | 应收利息    | 6,194.89      |
| 5  | 应收申购款   | 1,043,671.63  |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 17,683,221.20 |

### 7.10.4 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。

### 7.10.5 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的股票。

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 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<br>(户) | 户均持有的<br>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 |
| 13,440       | 27,569.55     | 22,452,577.56 | 6.06%  | 348,082,196.68 | 93.94% |

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|------------------|-----------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 19,944.48 | 0.0054%  |

注：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；本基金基金经理持有本基金基金份额总量的区间为 0。

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

|               |                |
|---------------|----------------|
| 本报告期期初基金份额总额  | 455,246,774.12 |
| 本报告期基金总申购份额   | 8,828,516.56   |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 93,540,516.44  |
| 本报告期基金拆分变动份额  | -              |
| 本报告期期末基金份额总额  | 370,534,774.24 |

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 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

- 1、经本基金管理人股东会决议，同意外方股东提名的董事由宫永宪一先生变更为原田义久先生；
- 2、报告期内本基金基金托管人无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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。

### 10.4 基金投资策略的改变

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。

### 10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

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。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元<br>数量 | 股票交易           |              | 应支付该券商的佣金  |            | 备注 |
|------|------------|----------------|--------------|------------|------------|----|
|      |            | 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 |    |
| 申银万国 | 2          | 131,294,181.54 | 26.37%       | 117,065.88 | 26.26%     | -  |
| 长江证券 | 1          | 122,731,927.79 | 24.65%       | 111,734.55 | 25.06%     | -  |
| 中投证券 | 1          | 58,780,918.56  | 11.81%       | 52,015.49  | 11.67%     | -  |
| 瑞银证券 | 1          | 52,764,175.43  | 10.60%       | 48,036.13  | 10.77%     | -  |
| 平安证券 | 1          | 42,259,736.85  | 8.49%        | 37,395.50  | 8.39%      | -  |
| 中金公司 | 1          | 33,739,565.00  | 6.78%        | 29,856.19  | 6.70%      | -  |
| 光大证券 | 1          | 29,996,582.31  | 6.03%        | 26,544.26  | 5.95%      | -  |
| 中信证券 | 1          | 26,242,820.07  | 5.27%        | 23,222.20  | 5.21%      | -  |
| 中信建投 | 1          | -              | -            | -          | -          | -  |
| 国金证券 | 1          | -              | -            | -          | -          | -  |
| 西部证券 | 1          | -              | -            | -          | -          | -  |
| 民生证券 | 1          | -              | -            | -          | -          | -  |
| 华泰证券 | 1          | -              | -            | -          | -          | -  |
| 北京高华 | 1          | -              | -            | -          | -          | -  |
| 银河证券 | 1          | -              | -            | -          | -          | -  |
| 五矿证券 | 1          | -              | -            | -          | -          | -  |
| 民族证券 | 1          | -              | -            | -          | -          | -  |
| 招商证券 | 1          | -              | -            | -          | -          | -  |
| 兴业证券 | 1          | -              | -            | -          | -          | -  |
| 华创证券 | 1          | -              | -            | -          | -          | -  |
| 红塔证券 | 1          | -              | -            | -          | -          | -  |
| 东兴证券 | 1          | -              | -            | -          | -          | -  |
| 东吴证券 | 1          | -              | -            | -          | -          | -  |
| 长城证券 | 1          | -              | -            | -          | -          | -  |
| 国泰君安 | 2          | -              | -            | -          | -          | -  |

|      |   |   |   |   |   |   |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 海通证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 齐鲁证券 | 1 | - | - | - | - | - |

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。

申万菱信基金管理有限公司  
二〇一三年八月二十七日