申万巴黎添益宝债券型证券投资基金 2010年年度报告摘要

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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2010年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	申万巴黎添益宝债券	
交易代码	310378	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008年12月4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	294,914,110.32份	
下属分级基金的基金简称	申万巴黎添益宝债券A	申万巴黎添益宝债券B
下属分级基金的交易代码	310378	310379
报告期末下属分级基金的份额总额	117,544,273.61份	177,369,836.71份

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险和保持资产流动性的前提下,追求稳定的当期收入和总回报。
投资策略	在大类资产的配置上,本基金主要根据宏观经济与市场运行趋势的综合分析,决定在转债、债券、IPO/转债申购和现金资产上的资金分配。本基金的债券投资研究依托公司整体的债券研究平台,通过自上而下的宏观基本面和资金技术面分析,确定一个阶段对债券市场整体的把握,并确定投资组合的期限和策略。本基金主要利用信用分析对信用产品进行投资选择,信用分析包括信用评级体系和信用环境分析。在一级市场申购策略方面,本基金将研究首次发行股票及发行转债公司的基本面,估计上市后的合理价格,判断是否参与新股及转债的一级市场申购。
业绩比较基准	中债总指数(全价)
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。

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

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.swsmu.com
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

§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

单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2010年		2009年		2008年12月4日(基金合同生效日)至2008年12月31日	
	申万巴黎添益宝债券A	申万巴黎添益宝债券B	申万巴黎添益宝债券A	申万巴黎添益宝债券B	申万巴黎添益宝债券A	申万巴黎添益宝债券B
本期已实现收益	11,644,558.14	13,461,317.95	797,888.12	-1,958,537.25	412,916.30	670,069.84
本期利润	16,106,021.84	17,184,678.18	-927,892.13	-7,097,513.56	3,860,940.91	9,729,360.03
加权平均基金份额本期利润	0.1270	0.1061	-0.0039	-0.0112	0.0060	0.0058
本期基金份额净值增长率	13.63%	13.18%	1.79%	1.49%	0.60%	0.60%
3.1.2 期末数据和指标	2010年末		2009年末		2008年末	
	申万巴黎添益宝债券A	申万巴黎添益宝债券B	申万巴黎添益宝债券A	申万巴黎添益宝债券B	申万巴黎添益宝债券A	申万巴黎添益宝债券B
期末可供分配基金份额利润	0.0276	0.0200	0.0104	0.0069	0.0007	0.0004
期末基金资产净值	127,595,706.25	191,136,995.75	128,109,529.03	248,466,531.26	592,281,035.18	1,481,701,239.63
期末基金份额净值	1.086	1.078	1.024	1.021	1.006	1.006

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、2008年数据按基金合同生效当年实际存续期计算,未按完整自然年度进行折算。

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

申万巴黎添益宝债券A:

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	3.34%	0.32%	-2.98%	0.15%	6.32%	0.17%
过去六个月	8.58%	0.27%	-2.83%	0.12%	11.41%	0.15%
过去一年	13.63%	0.25%	-0.87%	0.10%	14.50%	0.15%
自基金合同生效起至今	16.36%	0.19%	-3.64%	0.11%	20.00%	0.08%

申万巴黎添益宝债券B:

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	3.27%	0.33%	-2.98%	0.15%	6.25%	0.18%
过去六个月	8.33%	0.26%	-2.83%	0.12%	11.16%	0.14%
过去一年	13.18%	0.25%	-0.87%	0.10%	14.05%	0.15%
自基金合同生效起至今	15.56%	0.19%	-3.64%	0.11%	19.20%	0.08%

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

申万巴黎添益宝债券型证券投资基金
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
(2008年12月4日至2010年12月31日)

申万巴黎添益宝债券A

申万巴黎添益宝债券B

注:根据本基金基金合同,本基金的投资比例为:债券类资产投资比例为基金资产的80%-100%;股票等权益类资产的投资比例为基金资产的0-15%;现金及到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%;股票限于新股申购、可转债转股获得,不在二级市场主动买入股票及权证。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 自基金合同生效以来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

申万巴黎添益宝债券型证券投资基金
自基金合同生效以来每年净值增长率图

申万巴黎添益宝债券A

申万巴黎添益宝债券B

注:上述图表中2008年数据按基金合同生效当年实际存续期计算,未按完整自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

1、申万巴黎添益宝债券A

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	0.765	4,175,166.06	3,295,630.47	7,470,796.53	-
2009	-	-	-	-	-
2008	-	-	-	-	-
合计	0.765	4,175,166.06	3,295,630.47	7,470,796.53	-

2、申万巴黎添益宝债券B

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	0.765	8,970,085.98	3,771,932.35	12,742,018.33	-
2009	-	-	-	-	-
2008	-	-	-	-	-
合计	0.765	8,970,085.98	3,771,932.35	12,742,018.33	-

§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,注册资本金为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		
周鸣	本基金基金经理	2009-06-25	-	10年	清华大学工商管理硕士。自2001年起从事金融工作,先后就职于天相投资顾问公司、太平人寿保险公司、太平养老保险公司等,从事基金投资、企业年金投资等工作。2009年5月加盟申万巴黎基金管理有限公司投资管理总部,2009年6月起任申万巴黎收益宝货币市场基金基金经理及申万巴黎添益宝债券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遵规守信情况的说明

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证券备选库中的证券,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日常风险检查提示,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年度中国宏观经济平稳较快增长,向好势头不断巩固,但通胀压力增大,货币政策逐步回归常态化。央行综合应用提高存款准备金率和上调基准利率等工具加强流动性管理,全年债券市场收益率整体呈现先抑后扬态势。具体来看,在2010年初监管层对信贷进行严格控制后,金融系统的充裕流动性以及市场对经济增长和通胀预期的变动在1至8月推动利率和信用产品收益率大幅下行;进入到9月份之后,由于信贷控制的放松、宏观经济的反弹,债券收益率开始缓慢上行,至10月份,由于通货膨胀持续走高,受提高存款准备金和加息等政策的冲击,市场通胀预期和进一步加息预期空前高涨,收益率加速上升,至11月末,收益率已经大大超过年初高点;进入12月后,由于部分配置型机构的进场,收益率趋于高位企稳;总体来说全年收益率曲线平坦化上行态势显著。转债市场方面,随着两行以及其他转债的发行上市,市场容量大幅增加,个券随着正股出现波段操作的机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金在2010年的投资操作中积极调控组合久期,结合对市场的预判,在波动过程中灵活调整各类资产的配置比例,不断优化持仓结构。此外,基金秉持谨慎原则,在深入研究的基础上择优参与新债、新股、转债IPO。截至2010年12月31日,添益宝基金A全年收益率为13.63%,同期业绩基准表现为-0.87%,在银河63只同类可比基金中排名第3;添益宝基金B全年收益率为13.18%,同期业绩基准表现为-0.87%,在银河63只同类可比基金中排名第4。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2011年,中国经济增长前景较为乐观,而通胀压力依然突出,长期实际负利率的格局需要修正,货币政策面临进一步紧缩,这将是影响债券市场收益率走势的主因。但从积极因素看,2011年随着保险机构保费收入持续增长,基金公司新募债券型基金规模扩大,央行对银行信贷管控的加强等,各类机构对债券的刚性配置需求仍然较高。在经历了2010年四季度的调整后,部分债券品种的绝对收益率已处于相对较高水平,逐渐进入配置区间。转债市场方面,2011年一级市场将不断扩容,其间蕴含投资机会,同时二级市场个券也存在波段操作及条款博弈的机会。

鉴于此,本基金管理人2011年将采取更为积极灵活的操作策略,在控制组合久期的基础上,优化资产配置和组合持仓结构,等待收益率上行之后的配置性机会,适时把握转债二级市场个券的波段性投资机会,同时充分利用组合的融资功能谨慎参与优质新股、新债和转债的一级市场申购。

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。

4.7 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19日实施收益分配,添益宝债券A每10份基金份额派发红利0.065元;添益宝债券B每10份基金份额派发红利0.065元。2010年12月24日实施第二次收益分配,添益宝债券A每10份基金份额派发红利0.700元;添益宝债券B每10份基金份额派发红利0.700元。

截至2010年12月31日,添益宝债券A实现的可分配收益为3,247,920.51元,每基金份额可分配利润为0.0276元。添益宝债券B实现的可分配收益为3,543,093.88元,每基金份额可分配利润为0.0200元。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,本基金不存在应分配但尚未实施的利润。

§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

2010年,本基金托管人在对申万巴黎添益宝债券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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2010年,申万巴黎添益宝债券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添益宝债券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,申万巴黎添益宝债券型证券投资基金对基金份额持有人进行了两次利润分配,分配金额为20,212,814.86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添益宝债券型证券投资基金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20577号

申万巴黎添益宝债券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添益宝债券型证券投资基金(以下简称"申万巴黎添益宝基金")的财务报表,包括2010年12月31日的资产负债表、2010年度的利润表和所有者权益(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添益宝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添益宝基金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:申万巴黎添益宝债券型证券投资基金
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
资产:			
银行存款	7.4.7.1	25,058,413.74	28,142,818.40
结算备付金		579,701.90	1,737,704.81
存出保证金		251,257.38	208,333.35
交易性金融资产	7.4.7.2	296,927,412.45	336,983,934.92
其中:股票投资		32,755,701.36	25,743,509.82
基金投资		-	-
债券投资		264,171,711.09	311,240,425.10
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		-	80,000,000.00
应收利息	7.4.7.5	3,941,127.40	7,159,528.07
应收股利		-	-
应收申购款		1,205,015.71	7,026,563.63
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		327,962,928.58	461,258,883.18
负债和所有者权益	附注号	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
负债:			
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		5,000,000.00	80,000,000.00
应付证券清算款		3,443,802.90	-
应付赎回款		227,128.12	4,022,444.74
应付管理人报酬		127,825.03	153,490.83
应付托管费		42,608.35	51,163.63
应付销售服务费		45,981.31	53,977.20
应付交易费用	7.4.7.7	10,339.76	10,233.40
应交税费		-	-
应付利息		2,451.66	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	330,089.45	391,513.09
负债合计		9,230,226.58	84,682,822.89
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	294,914,110.32	368,490,086.45
未分配利润	7.4.7.10	23,818,591.68	8,085,973.84
所有者权益合计		318,732,702.00	376,576,060.29
负债和所有者权益总计		327,962,928.58	461,258,883.18

注:报告截止日2010年12月31日,A类基金份额净值1.086元,B类基金份额净值1.078元;基金份额总额294,914,110.32份,其中A类基金份额117,544,273.61份,B类基金份额177,369,836.71份。

7.2 利润表

会计主体:申万巴黎添益宝债券型证券投资基金
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
一、收入		38,305,780.00	2,678,626.24
1.利息收入		11,038,624.76	23,484,745.26
其中:存款利息收入	7.4.7.11	422,897.82	1,032,457.48
债券利息收入		10,600,050.01	22,186,747.38
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		15,676.93	265,540.40
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		18,955,277.31	-14,456,735.83
其中:股票投资收益	7.4.7.12	17,493,835.28	2,778,524.72
债券投资收益		1,305,156.99	-17,573,008.65
基金投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	272,033.67
股利收益	7.4.7.15	156,285.04	65,714.43
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	7.4.7.16	8,184,823.93	-6,864,756.56
4.汇兑收益(损失以"—"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	7.4.7.17	127,054.00	515,373.37
减:二、费用		5,015,079.98	10,704,031.93
1. 管理人报酬		1,868,853.53	5,366,784.25
2. 托管费		622,951.13	1,788,928.07
3. 销售服务费		609,699.96	2,274,711.14
4. 交易费用	7.4.7.18	144,912.56	38,782.77
5. 利息支出		1,405,080.36	846,816.62
其中:卖出回购金融资产支出		1,405,080.36	846,816.62
6. 其他费用	7.4.7.19	363,582.44	388,009.08
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		33,290,700.02	-8,025,405.69
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列		33,290,700.02	-8,025,405.69

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:申万巴黎添益宝债券型证券投资基金
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)	368,490,086.45	8,085,973.84	376,576,060.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	33,290,700.02	33,290,700.02
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)	-73,575,976.13	2,654,732.68	-70,921,243.45
其中:1.基金申购款	374,979,399.48	36,027,127.71	411,006,527.19
2.基金赎回款	-448,555,375.61	-33,372,395.03	-481,927,770.64
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)	-	-20,212,814.86	-20,212,814.86
五、期末所有者权益(基金净值)	294,914,110.32	23,818,591.68	318,732,702.00
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)	2,062,257,876.85	11,724,397.96	2,073,982,274.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-8,025,405.69	-8,025,405.69
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)	-1,693,767,790.40	4,386,981.57	-1,689,380,808.83
其中:1.基金申购款	368,137,679.92	1,785,280.33	369,922,960.25
2.基金赎回款	-2,061,905,470.32	2,601,701.24	-2,059,303,769.08
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)	368,490,086.45	8,085,973.84	376,576,060.29

报表附注为财务报表的组成部分

本报告从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

申万巴黎添益宝债券型证券投资基金(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[2008]第1104号《关于核准申万巴黎添益宝债券型证券投资基金募集的批复》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《申万巴黎添益宝债券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2,378,649,628.99元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字(2008)第189号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《申万巴黎添益宝债券型证券投资基金基金合同》于2008年12月4日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为2,379,022,309.66份基金份额,其中认购资金利息折合372,680.67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《申万巴黎添益宝债券型证券投资基金基金合同》和《申万巴黎添益宝债券型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案,本基金自募集期起根据认购、申购费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购基金时收取认购、申购费用的,称为A类基金份额;不收取认购、申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为B类基金份额。本基金A类和B类两种收费模式并存,由于基金费用的不同,本基金A类基金份额和B类基金份额分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额,但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《申万巴黎添益宝债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的固定收益类品种,包括国债、金融债、公司债、企业债、次级债、可转换债券、资产支持证券、短期融资券、债券回购、央行票据、同业存款等,以及参与新股申购等权益类品种和法律法规或监管机构允许基金投资的其他金融工具。本基金的业绩比较基准为中国债券总指数(全价)。

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》、《申万巴黎添益宝债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4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。

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 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。

7.4.5.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。

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 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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 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	31,395,052.83	47.64%	3,989,172.00	47.77%

7.4.8.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 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	25,887.20	48.01%	26.02	0.37%
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	3,390.95	48.89%	3,390.95	48.89%

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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 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管理费	1,868,853.53	5,366,784.25
其中:支付销售机构的客户维护费	323,187.35	1,687,787.14

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0.60%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*0.60%/当年天数。

7.4.8.2.2 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	622,951.13	1,788,928.07

注:支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值0.20%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:日基金托管费=前一日基金资产净值*0.20%/当年天数。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	申万巴黎添益宝债券A	申万巴黎添益宝债券B	合计
中国工商银行	-	347,960.34	347,960.34
申万菱信基金管理有限公司	-	145,637.84	145,637.84
申银万国	-	88,308.56	88,308.56
合计	-	581,906.74	581,906.74
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	申万巴黎添益宝债券A	申万巴黎添益宝债券B	合计
中国工商银行	-	2,168,724.76	2,168,724.76
申万菱信基金管理有限公司	-	71,370.92	71,370.92
申银万国	-	3,411.42	3,411.42
合计	-	2,243,507.10	2,243,507.10

注:添益宝债券B支付基金销售机构的销售服务费按前一日添益宝债券B的基金资产净值0.35%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给申万菱信基金管理有限公司,再由申万菱信基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。日销售服务费=添益宝债券B前一日基金资产净值*0.35%/当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行	9,977,823.59	-	-	-	-	-
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

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	
	申万巴黎添益宝债券A	申万巴黎添益宝债券B	申万巴黎添益宝债券A	申万巴黎添益宝债券B
期初持有的基金份额	-	-	19,999,000.00	-
期间申购/买入总份额	-	-	-	-
期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-	19,999,000.00	-
期末持有的基金份额	-	-	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	-	-

注:基金管理人申万菱信在本年度赎回本基金A类份额的交易委托申银万国办理,适用费率为0.10%。

7.4.8.4.2 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。

7.4.8.5 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 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	25,058,413.74	396,055.80	28,142,818.40	1,004,197.71

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。

7.4.8.6 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。

7.4.9 利润分配情况

申万巴黎添益宝债券A

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	2010-01-19	2010-01-20	0.065	285,781.11	481,987.75	767,768.86	-
2	2010-12-24	2010-12-27	0.700	3,889,384.95	2,813,642.72	6,703,027.67	-
合计	-	-	0.765	4,175,166.06	3,295,630.47	7,470,796.53	-

申万巴黎添益宝债券B

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	2010-01-19	2010-01-20	0.065	598,878.37	393,776.10	992,654.47	-
2	2010-12-24	2010-12-27	0.700	8,371,207.61	3,378,156.25	11,749,363.86	-
合计	-	-	0.765	8,970,085.98	3,771,932.35	12,742,018.33	-

7.4.10 期末(2010年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.10.1 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
300156	天立环保	2010-12-29	2011-01-07	新股网上申购	58.00	58.00	500	29,000.00	29,000.00	-
300133	华策影视	2010-10-14	2011-01-26	新股网下申购	68.00	116.00	17,357	1,180,276.00	2,013,412.00	-
600998	九州通	2010-10-27	2011-02-09	新股网下申购	13.00	14.55	24,930	324,090.00	362,731.50	-
002494	华斯股份	2010-10-22	2011-02-09	新股网下申购	22.00	31.29	25,987	571,714.00	813,133.23	-
300141	和顺电气	2010-11-03	2011-02-14	新股网下申购	31.68	47.28	44,014	1,394,363.52	2,080,981.92	-
002505	大康牧业	2010-11-10	2011-02-18	新股网下申购	24.00	27.90	28,471	683,304.00	794,340.90	-
601933	永辉超市	2010-12-09	2011-03-15	新股网下申购	23.98	31.24	22,754	545,640.92	710,834.96	-
601126	四方股份	2010-12-28	2011-03-31	新股网下申购	23.00	31.11	26,982	620,586.00	839,410.02	-
601118	海南橡胶	2010-12-30	2011-04-07	新股网下申购	5.99	5.99	215,520	1,290,964.80	1,290,964.80	-

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。

7.4.10.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

7.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.10.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2010年12月31日止,本基金无银行间市场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。

7.4.10.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2010年12月31日止,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额5,000,000.00元,于2011年1月4日到期。该类交易要求本基金在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

7.4.11 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187,663,412.45元,第二层级的余额为109,264,000.00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194,140,934.92元,第二层级的余额为142,843,000.00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	32,755,701.36	9.99
	其中:股票	32,755,701.36	9.99
2	固定收益投资	264,171,711.09	80.55
	其中:债券	264,171,711.09	80.55
	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	25,638,115.64	7.82
6	其他各项资产	5,397,400.49	1.65
7	合计	327,962,928.58	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	2,924,236.50	0.92
B	采掘业	-	-
C	制造业	17,015,884.83	5.34
C0	食品、饮料	276,480.00	0.09
C1	纺织、服装、皮毛	1,565,863.23	0.49
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	15,150.00	0.00
C4	石油、化学、塑胶、塑料	2,152,205.66	0.68
C5	电子	4,536,174.00	1.42
C6	金属、非金属	394,560.00	0.12
C7	机械、设备、仪表	7,059,961.94	2.22
C8	医药、生物制品	1,015,490.00	0.32
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	1,191,166.43	0.37
E	建筑业	905,999.64	0.28
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	4,506,670.50	1.41
H	批发和零售贸易	1,637,566.46	0.51
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	2,560,765.00	0.80
L	传播与文化产业	2,013,412.00	0.63
M	综合类	-	-
	合计	32,755,701.36	10.28

8.3 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	300105	龙源技术	25,000	3,047,500.00	0.96
2	300101	国腾电子	28,000	3,025,680.00	0.95
3	300102	乾照光电	35,000	2,943,500.00	0.92
4	300141	和顺电气	44,014	2,080,981.92	0.65
5	300133	华策影视	17,357	2,013,412.00	0.63
6	002474	榕基软件	29,919	1,480,990.50	0.46
7	002458	益生股份	35,000	1,329,300.00	0.42
8	601118	海南橡胶	215,520	1,290,964.80	0.41
9	002479	富春环保	34,637	1,191,166.43	0.37
10	002482	广田股份	10,689	905,999.64	0.28

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年度报告正文。

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	300055	万邦达	2,815,736.16	0.75
2	300052	中青宝	2,343,000.00	0.62
3	300082	奥克股份	2,037,280.00	0.54
4	002437	誉衡药业	2,005,150.00	0.53
5	300102	乾照光电	1,946,835.00	0.52
6	002414	高德红外	1,873,976.00	0.50
7	300086	康芝药业	1,785,240.00	0.47
8	300077	国民技术	1,714,562.50	0.46
9	002353	杰瑞股份	1,621,375.00	0.43
10	002336	人人乐	1,526,663.30	0.41
11	300105	龙源技术	1,525,658.00	0.41
12	300070	碧水源	1,519,449.00	0.40
13	300141	和顺电气	1,394,363.52	0.37
14	002458	益生股份	1,323,120.00	0.35
15	601118	海南橡胶	1,290,964.80	0.34
16	300044	赛为智能	1,187,494.00	0.32
17	300133	华策影视	1,180,276.00	0.31
18	002474	榕基软件	1,107,003.00	0.29
19	002411	九九久	1,079,833.20	0.29
20	002345	潮宏基	1,040,292.00	0.28

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	601668	中国建筑	5,693,854.63	1.51
2	300055	万邦达	4,242,034.70	1.13
3	002437	誉衡药业	2,461,018.50	0.65
4	002353	杰瑞股份	2,460,671.96	0.65
5	300052	中青宝	2,300,452.64	0.61
6	601788	光大证券	2,284,755.00	0.61
7	300037	新宙邦	2,108,144.68	0.56
8	300077	国民技术	2,029,762.81	0.54
9	002411	九九久	1,890,760.80	0.50
10	300082	奥克股份	1,763,311.58	0.47
11	002414	高德红外	1,699,710.38	0.45
12	002345	潮宏基	1,674,862.62	0.44
13	300086	康芝药业	1,666,784.49	0.44
14	300044	赛为智能	1,654,331.50	0.44
15	300070	碧水源	1,654,066.79	0.44
16	002336	人人乐	1,615,441.50	0.43
17	002320	海峡股份	1,561,175.00	0.41
18	002311	海大集团	1,430,557.33	0.38
19	002326	永太科技	1,430,210.32	0.38
20	002304	洋河股份	1,309,784.60	0.35

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	49,304,748.47
卖出股票的收入(成交)总额	65,896,868.52

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	13,804,496.00	4.33
2	央行票据	59,465,000.00	18.66
3	金融债券	29,783,000.00	9.34
	其中:政策性金融债	29,783,000.00	9.34
4	企业债券	92,709,917.75	29.09
5	企业短期融资券	20,016,000.00	6.28
6	可转债	48,393,297.34	15.18
7	其他	-	-
8	合计	264,171,711.09	82.88

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	0801023	08央票23	300,000	30,054,000.00	9.43
2	126012	08上港债	268,000	26,676,720.00	8.37
3	113001	中行转债	210,890	23,168,375.40	7.27
4	122964	09龙湖债	150,000	15,732,000.00	4.94
5	122020	09复地债	128,360	13,450,844.40	4.22

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	251,257.38
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,941,127.40
5	应收申购款	1,205,015.71
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,397,400.49

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113001	中行转债	23,168,375.40	7.27
2	110009	双良转债	3,650,237.60	1.15
3	125709	唐钢转债	2,738,000.00	0.86

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300141	和顺电气	2,080,981.92	0.65	网下申购锁定
2	300133	华策影视	2,013,412.00	0.63	网下申购锁定
3	601118	海南橡胶	1,290,964.80	0.41	网下申购锁定

§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

份额级别	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
申万巴黎添益宝债券A	1,678	70,050.22	63,257,355.59	53.82%	54,286,918.02	46.18%
申万巴黎添益宝债券B	2,121	83,625.57	69,140,345.36	38.98%	108,229,491.35	61.02%
合计	3,799	77,629.41	132,397,700.95	44.89%	162,516,409.37	55.11%

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	份额级别	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	申万巴黎添益宝债券A	2,265.05	0%
	申万巴黎添益宝债券B	1,091.06	0%
	合计	3,356.11	0%

§10 开放式基金份额变动

单位:份

项目	申万巴黎添益宝债券A	申万巴黎添益宝债券B
本报告期期初基金份额总额	125,075,421.93	243,414,664.52
本报告期基金总申购份额	142,494,018.94	232,485,380.54
减:本报告期基金总赎回份额	150,025,167.26	298,530,208.35
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	117,544,273.61	177,369,836.71

§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的情况

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

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	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	
申银万国证券股份有限公司	2	31,395,052.83	47.64%	25,887.20	48.01%	-
光大证券股份有限公司	1	13,524,894.11	20.52%	10,988.97	20.38%	-
中国建银投资证券有限责任公司	1	5,957,447.31	9.04%	4,840.48	8.98%	-
银河证券股份有限公司	1	3,465,390.33	5.26%	2,815.70	5.22%	-
中信证券股份有限公司	1	3,026,701.26	4.59%	2,459.16	4.56%	-
中国国际金融有限公司	1	2,816,554.38	4.27%	2,288.51	4.24%	-
海通证券股份有限公司	1	2,052,941.50	3.12%	1,667.99	3.09%	-
招商证券股份有限公司	2	2,032,445.60	3.08%	1,651.41	3.06%	-
长城证券有限责任公司	1	1,625,441.20	2.47%	1,320.66	2.45%	-
华泰联合证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
平安证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	新增

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。

§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"。

申万菱信基金管理有限公司
二〇一一年三月二十九日