申万巴黎消费增长股票型证券投资基金 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	467,224,896.37份

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

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2010年	2009年6月12日(基金合同生效日)至2009年12月31日
本期已实现收益	62,339,007.01	45,198,132.37
本期利润	-23,199,351.26	212,960,704.47
加权平均基金份额本期利润	-0.0337	0.1569
本期基金份额净值增长率	1.23%	17.91%
3.1.2 期末数据和指标	2010年末	2009年末
期末可供分配基金份额利润	0.1046	0.0247
期末基金资产净值	540,859,208.22	1,322,034,353.38
期末基金份额净值	1.158	1.164

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、2009年数据按基金合同生效后基金实际存续期计算,未按整个自然年度进行折算。

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

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	4.32%	1.86%	5.21%	1.41%	-0.89%	0.45%
过去六个月	33.26%	1.60%	17.57%	1.24%	15.69%	0.36%
过去一年	1.23%	1.61%	-9.20%	1.26%	10.43%	0.35%
自基金合同生效起至今	19.36%	1.73%	6.25%	1.42%	13.11%	0.31%

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:

benchmark(0)=1000;

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

benchmark(t)=(1+%benchmark(t))*benchmark(t-1);

其中t=1,2,3,…。

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2010年12月31日)

注:根据本基金基金合同,本基金的投资比例为:股票资产的投资比例占基金资产的60%—95%;其中,投资于消费范畴行业的资产不低于股票资产的80%;权证的投资比例不超过基金资产净值的3%。债券资产的投资比例占基金资产的0%—35%;现金以及到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的5%。上述投资比例限制自基金合同生效6个月起生效。

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

申万巴黎消费增长股票型证券投资基金
自基金合同生效以来每年净值增长率图

注:2009年数据按基金合同生效后基金实际存续期计算,未按整个自然年度进行折算。

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	0.200	12,821,444.41	7,675,741.02	20,497,185.43	-
2009	0.150	8,430,011.33	6,428,797.99	14,858,809.32	-
合计	0.350	21,251,455.74	14,104,539.01	35,355,994.75	-

§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		
魏立	本基金基金经理	2009-06-12	-	7年	特许金融分析师(CFA),上海交通大学工学学士,英国帝国理工大学管理学硕士。1997年起任上海华虹NEC电子有限公司工程师,自2004年起从事金融工作,先后任职于东方证券股份有限公司研究所、富国基金管理有限公司。2006年7月加入本公司,任投资管理总部高级分析师,2007年9月至2009年6月任申万巴黎新经济混合型证券投资基金基金经理助理。2009年6月起任申万巴黎消费增长股票型证券投资基金基金经理,2009年9月至2010年11月任申万巴黎新经济混合型证券投资基金基金经理,2010年2月起同时任申万巴黎沪深300价值指数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年市场走势错综复杂,行业和个股行情分化严重。回顾本基金全年的操作,投资策略上经历过较大转变,年初行业配置比较均衡化,导致净值下滑较多,年中进行了结构化调整,随后三季度的净值上升较多,最终将上半年的被动局面有所改善。操作上的不足之处主要有:1)在明显结构分化的市场上仍较多地坚持了均衡配置;2)对一些重要事件触发的市场走势转变预期不够,比如股指期货和房地产调控政策的出台等;3)对各类资金纯博弈行为诱发的板块轮动或市场波动准备不充分。但随着经验的积累和研究的深入,继续保持平稳的心态、稳健操作,基金经理将力争为投资人带来持续的回报。

截止报告期末,基金对电子元器件、建筑建材和医药生物等行业的超配幅度较大,尤其看好其中的新能源、物联网、水泥和中药;而对房地产、有色金属和煤炭等行业的配置比例较低。

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1.23%,同期业绩基准为-9.20%,跑赢业绩基准10.43个百分点。

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年很可能在增长和调控中前行。上半年经济偏热、通胀偏高的可能性较大,一方面中国经济快速复苏,但另一方面将导致调控力度加大。预计上半年内调控的预期相对较强。作为"十二五规划"的开局之年,中西部地区和新兴产业的投资有望持续增长,特别是新技术改造传统产业值得关注。随着中国竞争力和国际地位的提升,先进制造业的出口在2011年将成为一个亮点,例如高铁技术等。而消费对经济的拉动作用将变得更加显著,收入增长计划、社保医保机制的改善、城镇化都为消费增长提供强劲动力,我们将看到中低端消费和奢侈品消费两翼齐飞的局面。

投资策略上,基金经理对2011年行情保持谨慎。调控压力、流动性收紧、中小市值股票的解禁潮、较大规模的融资等都是影响投资者心理的因素。这些因素遇到2011年这样一个经济转型、新增长点尚不够清晰的年度,对行情上涨的限制力度相比以往可能更大。出于这样的考虑,基金经理将更加稳健地操作、耐心寻找和等待机会。明显的投资机会可能存在于:1)超跌后的消费、医药、新兴产业;2)有业绩支撑的主题投资:高铁、物联网等;3)低估值周期性行业的波段行情。然而,影响市场走势的因素是多种多样的,操作上更需要做的事情就是及时总结和更新配置思路。

目前我们持续关注的投资领域包括:1)稳定增长的医药、食品饮料和家用电器;2)估值水平大幅下降后的新兴产业:新能源汽车、智能电网、信息技术;3)可选消费类:汽车和零部件;4)产能扩张有限而需求旺盛的行业:比如水泥。

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。

4.7 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18日实施收益分配,每10份基金份额派发红利0.20元。

截至2010年12月31日,本基金实现的可分配收益为48,882,870.40元,每基金份额可分配利润为0.1046元。根据《基金合同》的约定及本基金的实际运作情况,本基金管理人已于2011年1月11日实施年度收益分配,按每10份基金份额派发红利人民币0.50元。

§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巴黎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,申万巴黎消费增长股票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20,497,185.43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消费增长股票型证券投资基金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20578号

申万巴黎消费增长股票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消费增长股票型证券投资基金(以下简称"申万巴黎消费增长基金")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消费增长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消费增长基金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年3月28日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:申万巴黎消费增长股票型证券投资基金
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	35,682,741.59	224,345,394.76
结算备付金		1,964,835.62	1,817,181.13
存出保证金		981,093.55	1,876,622.24
交易性金融资产	7.4.7.2	502,046,482.34	1,152,943,906.16
其中:股票投资		502,046,482.34	1,152,943,906.16
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		97,175.09	-
应收利息	7.4.7.5	6,651.68	23,300.67
应收股利		-	-
应收申购款		2,898,315.92	2,021,637.68
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		543,677,295.79	1,383,028,042.64
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		-	-
应付证券清算款		-	47,172,805.70
应付赎回款		396,317.09	10,482,803.57
应付管理人报酬		694,012.66	1,329,928.04
应付托管费		115,668.77	221,654.68
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,221,134.46	1,446,989.27
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	390,954.59	339,508.00
负债合计		2,818,087.57	60,993,689.26
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	467,224,896.37	1,135,827,982.46
未分配利润	7.4.7.10	73,634,311.85	186,206,370.92
所有者权益合计		540,859,208.22	1,322,034,353.38
负债和所有者权益总计		543,677,295.79	1,383,028,042.64

注:1. 报告截止日2010年12月31日,基金份额净值1.158元,基金份额总额467,224,896.37份。

2. 比较财务报表的实际编制期间为2009年6月12日(基金合同生效日)至2009年12月31日。

7.2 利润表

会计主体:申万巴黎消费增长股票型证券投资基金
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6月12日(基金合同生效日)至2009年12月31日
一、收入		-2,315,353.52	236,463,668.00
1.利息收入		562,482.27	1,079,606.44
其中:存款利息收入	7.4.7.11	538,901.85	1,050,210.60
债券利息收入		-	395.84
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		23,580.42	29,000.00
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		81,514,365.21	66,058,975.61
其中:股票投资收益	7.4.7.12	78,521,056.64	63,046,319.49
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	274,849.46
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	2,993,308.57	2,737,806.66
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	7.4.7.16	-85,538,358.27	167,762,572.10
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	1,146,157.27	1,562,513.85
减:二、费用		20,883,997.74	23,502,963.53
1.管理人报酬		10,917,183.86	11,940,869.62
2.托管费		1,819,530.67	1,990,144.96
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	7.4.7.18	7,748,362.21	9,266,290.45
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用	7.4.7.19	398,921.00	305,658.50
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-23,199,351.26	212,960,704.47
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列		-23,199,351.26	212,960,704.47

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:申万巴黎消费增长股票型证券投资基金
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)	1,135,827,982.46	186,206,370.92	1,322,034,353.38
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-23,199,351.26	-23,199,351.26
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)	-668,603,086.09	-68,875,522.38	-737,478,608.47
其中:1.基金申购款	257,951,129.91	23,907,843.62	281,858,973.53
2.基金赎回款	-926,554,216.00	-92,783,366.00	-1,019,337,582.00
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)	-	-20,497,185.43	-20,497,185.43
五、期末所有者权益(基金净值)	467,224,896.37	73,634,311.85	540,859,208.22
项目	上年度可比期间 2009年6月12日(基金合同生效日)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)	1,464,221,007.90	-	1,464,221,007.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	212,960,704.47	212,960,704.47
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)	-328,393,025.44	-11,895,524.23	-340,288,549.67
其中:1.基金申购款	797,764,680.58	91,624,341.94	889,389,022.52
2.基金赎回款	-1,126,157,706.02	-103,519,866.17	-1,229,677,572.19
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)	-	-14,858,809.32	-14,858,809.32
五、期末所有者权益(基金净值)	1,135,827,982.46	186,206,370.92	1,322,034,353.38

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《关于核准申万巴黎消费增长股票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《申万巴黎消费增长股票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,《申万巴黎消费增长股票型证券投资基金基金合同》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《申万巴黎消费增长股票型证券投资基金基金合同》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("申万菱信")	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司("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("申银万国")	基金管理人的股东、基金代销机构
法国巴黎资产管理有限公司	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6月12日(基金合同生效日)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	336,693,268.79	6.89%	2,049,447,247.82	32.13%

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	283,676.19	6.96%	50,085.12	4.10%
关联方名称	上年度可比期间 2009年6月12日(基金合同生效日)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	1,732,881.73	32.43%	452,829.11	31.29%

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。

7.4.8.2 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6月12日(基金合同生效日)至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	10,917,183.86	11,940,869.62
其中:支付销售机构的客户维护费	3,202,868.09	3,349,074.10

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。

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6月12日(基金合同生效日)至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,819,530.67	1,990,144.96

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。

7.4.8.3 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。

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

本报告期,本基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.8.4.2 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6月12日(基金合同生效日)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	35,682,741.59	503,611.43	224,345,394.76	1,003,912.68

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。

7.4.9 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
	2010-01-18	2010-01-19	0.200	12,821,444.41	7,675,741.02	20,497,185.43	-
合计	-	-	0.200	12,821,444.41	7,675,741.02	20,497,185.43	-

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
300157	恒泰艾普	2010-12-29	2011-01-07	网上申购流通受限	57.00	57.00	500	28,500.00	28,500.00	-

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

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
600991	广汽长丰	2010-10-28	重大事项	13.85	2011-03-23	15.00	1,929,907	23,546,795.08	26,729,211.95	-
600518	康美药业	2010-12-28	配股停牌	19.71	2011-01-06	17.29	1,051,587	11,506,375.70	20,726,779.77	-

注:本基金截至2010年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被长期停牌的股票,该类股票将在所公布的事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

7.4.10.3 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。

7.4.11 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454,590,490.62元,第二层级的余额为47,455,991.72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1,106,079,408.44元,第二层级的余额为46,864,497.72元,无属于第二层和第三层级的余额)。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	502,046,482.34	92.34
	其中:股票	502,046,482.34	92.34
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	37,647,577.21	6.92
6	其他各项资产	3,983,236.24	0.73
7	合计	543,677,295.79	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	-	-
B	采掘业	3,999,837.52	0.74
C	制造业	331,236,871.27	61.24
C0	食品、饮料	34,545,217.83	6.39
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	3,425,343.60	0.63
C4	石油、化学、塑胶、塑料	37,115,068.14	6.86
C5	电子	3,508,000.00	0.65
C6	金属、非金属	70,989,066.70	13.13
C7	机械、设备、仪表	125,409,481.74	23.19
C8	医药、生物制品	43,674,377.46	8.07
C99	其他制造业	12,570,315.80	2.32
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	29,600,724.56	5.47
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	56,922,139.46	10.52
H	批发和零售贸易	38,716,233.47	7.16
I	金融、保险业	29,399,760.00	5.44
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	12,170,916.06	2.25
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	502,046,482.34	92.82

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	000541	佛山照明	2,287,721	37,953,291.39	7.02
2	000417	合肥百货	1,748,482	33,920,550.80	6.27
3	601318	中国平安	523,500	29,399,760.00	5.44
4	600991	广汽长丰	1,929,907	26,729,211.95	4.94
5	600406	国电南瑞	369,928	26,657,011.68	4.93
6	600425	青松建化	1,309,910	26,525,677.50	4.90
7	002035	华帝股份	1,702,540	26,355,319.20	4.87
8	000869	张裕A	261,355	25,079,625.80	4.64
9	000527	美的电器	1,350,000	23,490,000.00	4.34
10	002161	远望谷	630,000	21,993,300.00	4.07

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	600425	青松建化	71,822,882.86	5.43
2	600068	葛洲坝	54,950,163.44	4.16
3	600303	曙光股份	52,977,769.19	4.01
4	002035	华帝股份	51,152,442.70	3.87
5	600693	东百集团	45,299,473.48	3.43
6	000541	佛山照明	41,422,044.19	3.13
7	000887	中鼎股份	32,132,816.49	2.43
8	600879	航天电子	30,956,339.50	2.34
9	600694	大商股份	30,014,540.02	2.27
10	000551	创元科技	28,861,128.86	2.18
11	601999	出版传媒	28,130,890.92	2.13
12	600571	信雅达	27,630,178.41	2.09
13	600585	海螺水泥	25,078,300.00	1.90
14	000422	湖北宜化	24,944,940.74	1.89
15	002056	横店东磁	24,705,197.15	1.87
16	600765	中航重机	24,287,720.90	1.84
17	000837	秦川发展	23,621,224.74	1.79
18	600991	广汽长丰	23,546,795.08	1.78
19	600522	中天科技	23,541,902.48	1.78
20	600267	海正药业	21,364,605.73	1.62

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	002035	华帝股份	67,219,521.01	5.08
2	000965	天保基建	58,487,077.41	4.42
3	000568	泸州老窖	56,615,300.62	4.28
4	600997	开滦股份	56,057,033.40	4.24
5	600104	上海汽车	52,629,991.47	3.98
6	600303	曙光股份	51,514,539.64	3.90
7	600866	星湖科技	51,181,249.70	3.87
8	600571	信雅达	47,283,279.63	3.58
9	000422	湖北宜化	46,116,746.86	3.49
10	002239	金飞达	46,101,312.86	3.49
11	600348	国阳新能	45,574,390.23	3.45
12	600693	东百集团	44,930,462.50	3.40
13	600425	青松建化	44,245,442.06	3.35
14	600068	葛洲坝	38,924,078.39	2.94
15	600036	招商银行	37,182,816.80	2.81
16	600765	中航重机	36,555,568.08	2.77
17	000551	创元科技	34,663,178.33	2.62
18	600805	悦达投资	33,100,093.95	2.50
19	600030	中信证券	32,897,363.70	2.49
20	002056	横店东磁	32,646,115.54	2.47
21	601166	兴业银行	32,581,980.02	2.46
22	601999	出版传媒	29,448,854.01	2.23
23	601601	中国太保	29,103,778.37	2.20
24	000837	秦川发展	27,651,001.01	2.09
25	000157	中联重科	27,431,718.25	2.07
26	600694	大商股份	27,256,325.34	2.06
27	600809	山西汾酒	26,898,529.56	2.03

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	2,126,694,331.51
卖出股票的收入(成交)总额	2,770,564,053.70

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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	981,093.55
2	应收证券清算款	97,175.09
3	应收股利	-
4	应收利息	6,651.68
5	应收申购款	2,898,315.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,983,236.24

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

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	600991	广汽长丰	26,729,211.95	4.94	重大事项

§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
16,617	28,117.28	41,132,590.33	8.80%	426,092,306.04	91.20%

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	38,375.15	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	1,135,827,982.46
本报告期基金总申购份额	257,951,129.91
减:本报告期基金总赎回份额	926,554,216
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	467,224,896.37

§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2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

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	
长江证券股份有限公司	1	886,848,025.45	18.16%	753,819.96	18.50%	-
中信建投股份有限公司	1	524,220,683.23	10.73%	445,585.64	10.93%	-
招商证券股份有限公司	1	471,452,076.22	9.65%	383,059.38	9.40%	-
海通证券股份有限公司	2	458,810,035.09	9.39%	380,265.23	9.33%	-
西部证券股份有限公司	1	445,350,655.84	9.12%	378,544.40	9.29%	-
国泰君安证券股份有限公司	2	405,264,914.90	8.30%	344,474.05	8.45%	-
申银万国证券股份有限公司	2	336,693,268.79	6.89%	283,676.19	6.96%	-
国信证券股份有限公司	1	277,293,701.21	5.68%	225,302.50	5.53%	-
光大证券股份有限公司	1	243,431,055.18	4.98%	197,789.74	4.85%	-
中信证券股份有限公司	1	223,878,116.47	4.58%	181,902.94	4.46%	-
兴业证券股份有限公司	1	128,361,451.58	2.63%	104,294.42	2.56%	-
国金证券股份有限公司	1	124,877,418.94	2.56%	106,143.92	2.60%	-
长城证券有限责任公司	1	105,346,257.59	2.16%	85,595.36	2.10%	-
中国建银投资证券有限责任公司	1	99,792,525.95	2.04%	81,083.05	1.99%	-
平安证券有限责任公司	1	78,823,719.25	1.61%	64,044.86	1.57%	-
华泰联合证券有限责任公司	1	73,243,782.96	1.50%	59,511.85	1.46%	-
中国国际金融有限公司	1	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
五矿证券有限公司	1	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	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。

§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