基金管理人:申万菱信基金管理有限公司

某会管理人的董事会 董事保证本报告所费资料不存在虚假记费 湿导性陈沐命重大遗漏 并对其内容的直定性 准确性 和完整任实用作列及董帝的法律责任。本年年度报告已经与今之二以上独立董举圣河宫,并由董非长鉴友。 基金任管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年8月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、 利润分配情况。以外会计报告、投资组合报告的资。保证复核内容不存在虚拟正裁、损导性能还被者重大遗漏。 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。

本半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 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

本报告中财务资料未经审计 本报告期自2012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			申万菱信添益宝债	
交易代码			3103	
基金运作方式		契约型开放		
基金合同生效日		2008年12月4		
基金管理人		申万菱信基金管理有限公		
基金托管人			中国工商银行股份有限公	
报告期末基金份额总额			350,488,461.24	
下属分级基金的基金简称		申万菱信添益宝债券A	申万菱信添益宝债券	
下属分级基金的交易代码		310378	3103	
报告期末下属分级基金的份额总额		144,798,327.82份	205,690,133.42	
40 A de EL Well				

2.2 基金产品1	2月
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 PD中转值申购和现金资产上的资金分配。本基金的债券投资研究依任公司整体的债券研究平台 通过自上师下的宏观基本而贸金按木面的分析,确定一份股对债券市场整体的逻辑,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,在一级市场申购额依方面、本基金将研究首次允分要"及发行专价公司 的基本和信用环境分析,在一级市场申购额依方面、本基金将研究首次允分要"及发行专行政公司的基本面"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	∃	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
	姓名	来肖贤	赵会军
信息披露负责人	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			

基金半年度报告备置地点

由万菱信添益宝债券/

万菱信基金管理有限公 中国工商银行 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元 1.1 期间数据和指标 7平均基金份额本期利 本期基金份额净值增长率 6.179 3.1.2 期末数据和指标 申万菱信添益宝债券A 期末可供分配基金份额利 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

2 上述基金业绩指标已扣除了基金的管理费 杆管费和各项交易费用 但不包括持有人认/由购或交易基金的各项费用

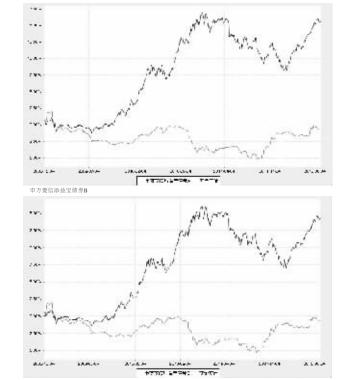
(例如:申购费、赎回费等),计入认/申购或交易基金的各项费用后,实际收益水平要低于所列数字

申万菱信添益宝	债券A					
阶段	份额净值增 长率①	份額爭值增长率标 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
过去一个月	0.19%	0.15%	-0.15%	0.10%	0.34%	0.05%
过去三个月	3.49%	0.13%	1.05%	0.11%	2.44%	0.02%
过去六个月	6.17%	0.19%	0.79%	0.09%	5.38%	0.10%
过去一年	3.12%	0.22%	3.78%	0.11%	-0.66%	0.11%
过去三年	16.04%	0.22%	0.94%	0.10%	15.10%	0.12%
自基金合同生效 起至今	15.57%	0.21%	-0.43%	0.11%	16.00%	0.10%
申万菱信添益宝	债券B					
If A. Ert.	份额净值增	份额净值增长率标	业绩比较基准	业绩比较基准收益率	(T) (M)	@ O

-0.15% 0.34% 0.04% 6.00% 5.21% 14.88% 0.22% 0.94% 13.94% 0.12% 14.20% -0.43% 0.11% 14.63%

申万菱信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2012年6月30日)



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人股票及权证。上述投资比例限制自基金合同生效6个月起生效

4 管理人报告
4.1 基金管理人及基金经理情况
4.1. 基金管理人及其管理基金的经验
中万菱信基金管理有限公司原名中5万整基金管理有限公司,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,注册资本全为1.2亿元人民币。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2012年6月30日,公司旅下管理了包括股票型、混合
型、债券股和货币型在内的14只开放式基金,形成了完整而丰富的产品栈。公司旅下基金管理资产规模超过120亿元,客户数据1120万户。

管理人报告

		A4100 MEALE FLE 3 AL	,			
姓名	职务	任本基金的基金	を経理(助理)期 見	证券 从业	说明	
		任职日期	离任日期	年限		
周鸣	本基金基金经理	2009-06-25	-	11年	海华大学工商管理顺上,自2001年起从事金融工作,先后就 即于天相股资顺向公司 太平人各保险公司,太平条各保险公司等,从事基金投资、企业年金投资等工作。2009年6月起 司等,从事基金投资、企业年金投资等工作。2009年6月起 任中万菱信基金管理(2019年6月起 任中万菱信款位至货币市场基金基金经理(2011年12月起报任中万菱 官商学教政海外发活金基金经理。2011年12月起报任中万菱 信司特教政海外旁型企业投资基金基金经理。	

主: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

4.2 管理人对祝召则外不愈至近下理规可语而优别规则 报告期内、本基金管理人带越市气使委技》、促委投资基金法)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证用基金资产、在严格控制风险的基础上为持有人决束最大利益。 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 同严格分开,没有发生内需多及,提供加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,并通过急性经常,规范定作,规律风险、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

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,确保各投资组合在疾程投资信息,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邮后分析评估产规量公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。

台,确保公平规与各投资组合程供研究服务。 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,价差交易模取贡献与 组合收益率差异的比较等方法对本报告部队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 罗思西本语为对社价分。

平且是否涉及利益知道。 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,公平对待了放下各投资组合。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

4.3.2 并而必须行人即至项以时 本公司制定了(异常交易监控报告制度),明确定义了在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,并规定且落乎了异常交易的目常监控,识别以及事后的分析液程。 本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内,本公司所有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被超过该证券当日成交量的5%的情况有一次。投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易, +59%不公平公里自和4分检查。

未导致不公平交易和利益输送。 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

2012年上半年,宏观经济继续回落态势,GDP跌破8%,通胀压力明显减轻,CPI出现快速下降。随着经济和通胀双双回落, 宏观基调转的稳增长、货币政策经少量化。 安观基调转的稳增长、货币政策经少量化、土华央行下调存体系含金率两次,新放大量途迹性、同时重启降息,引申储方面。 一季度受到先行指标好转影响,收益率出现反弹,但最终经济企稳预期落空、随着二季度经济数据和通胀双双下行,利率债迎 来一被小牛市。信用债在上半年表现优异,随着液动性逐步震松,市场对途约风险的担忧有所减轻,处于高位的信用利差出现 明显收缩,其中中低等级信用债表现优于高等级信用债。转债方面,受正股波动影响,上半年转债市场缺乏趋势性机会,但存

在较为明显的结构性机会。而转债可质押政策的出台,使其开始具有融资功能。 本基金在2012年上半年优化了组合的持仓结构和久期,一季度增持信用债和可转债,适度拉长久期,而在二季度债券市 场上涨到一定阶段后,降低债券投资比例,缩短久期,并调整转债持仓结构,同时有选择性地参与新股和新债申贩

申万菱信添益宝债券型证券投资基金

2012 半年度 报告摘要

4.4.2根告期内基金的业绩表现 该基金A类报告期内净值表现为6.17%。同期业绩比较基准表现为0.79%。 该基金B类报告期内净值表现为6.00%。同期业绩比较基准表现为0.79%。

展览至105以16日前19年间农地方000mg。则即亚明L15亿款需用农地分0.109%。 4.5 管理人对宏观经济。证券市场及行业等的简要展理 展望2012年下半年,中国宏观政策开始转向稳增长,随着降准和降息等一系列宽松政策的出台,经济继续加速下行的压力明显缓解。外围经济方面,上半年晚它围扰的希腊问题获得暂时性解决。短期内再度概定的概率有所降低。而受到普遍关注及当时美国收益中国、预计也将在两党的合作上解字中表得够定,从通能走势着,上半年晚的西京来,下跌的大宗商品价格以及棚尾等因素共同推动了CP快速下行。下半年尤其是三季度通胀水平预计仍会处于偏低的位置,四季度随着经济转级,通胀水平存在小幅反弹的压力,但高度有限。资金方面,下半年为汇占故预计均接续线慢慢增长,而公开市场到期资金量低速,在它

松的货币政策环境下,央行仍会通过下调存款准备金率进行对冲,资金面仍将保持较为宽松的状态。相比上半年,债券市场上涨的推动力有所减弱。利率债方面,经济加速下行的阶段已过,而收益率处于较低的水平,向下突破的空间有限,利率债投资 6.60过速20万年7月60元。 "平市60万亩",上平50万年2个11万亩之产。 "100年20万元,100年 本基金管理人2012年下半年将在保持组合流动性的基础上,继续调整优化组合持仓结构,精选个券,把握转债市场投资机会,此外还将有选择性地参与债券一级市场申购。

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

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 并在结

完成主命是人以上则「由证如过去,则自他给心体本名。"小师村子,后是他的庄山直以来,并以此他由直往作,才不安 定状态下政机平用的相关估值模型,但以及多数的适当性进行的机,以保护基金的拥持有人的利益。 邮,基金投资管理总 资产估值来员会由本基金管理人的包经理,分管基金运营的副总经理,基金运营运部、监察辖核企制 成品管理总部等各名部总型组成。其中,总是用于东升先生,拥有近年基金公司高级管理。例管基金运营的副总 经理过版华先生,拥有8年的基金公司高级管理人员经验。基金投资管理总部总监政庆岭先生,拥有近10年的基金公司研究和

起难以探中光生。例前3年中的基金公司成於日本人內亞語。基金於於日本此称也呈现大學光生。例前2日(D中的基金公司所允和 投资管理经验。K险管理总部副总监王维传女士。拥有近7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。 47 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《证券投资基金运作管理办法》及本基金的基金合同等规定,本基金本报告期实施利润分配1次,符合相关法规及基

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

3.1 报告则均平益率在当人理除于语语化产明 2012年上半年、本基金任党人在对申万豪信益宣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,完全尽职尽贵地履行了基金托管人应尽的

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 52. 社會人对报告期內不基金投資症作趣現可信。净值计算、利润分配等的仓的设明 2012年上半年,由万菱信部並信務参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添益宣债券 型证券投资基金的投资运作。基金资产净值计算、基金份额中助赎回价格计算、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台间的规定进行。本报告期内,申万菱信添益宣债券型证券投资 基金对基金份额持有人利任了一次利润分配。效配金额为1.(41,293.80元。 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

本托管人依法对中万菱信基金管理有限公司编制和坡震的申万菱信添益宝债券型证券投资基金2012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。

半年度财务会计报告 (未经审计)

24 "			73 34 114	10" July 10" 10" 7"	 200,000	9
tiz 45	44 L	ш.	2012年	6月30日		
1IX I	MX III	П:	20124-1	0/130/11		

资产	本期末 2012年6月30日	上年度末 2011年12月31日	
资产:			
银行存款	71,185,034.15	9,591,286.92	
结算备付金	302,372.56	158,298.48	
存出保证金	273,232.32	304,572.40	
交易性金融资产	279,029,380.08	175,429,052.57	
其中:股票投资	5,118,156.00	13,792,459.60	
基金投资	_	_	
债券投资	273,911,224.08	161,636,592.97	
资产支持证券投资	_	_	
衍生金融资产	_	_	
买人返售金融资产	43,500,000.00	_	
应收证券清算款	_	_	
应收利息	5,955,077.99	3,469,083.07	
应收股利	_	_	
应收申购款	16,303,445.49	_	
递延所得税资产	_	_	
其他资产	_	_	
资产总计	416,548,542.59	188,952,293.44	
负债和所有者权益	本期末 2012年6月30日	上年度末 2011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	-	15,000,000.00	
应付证券清算款	42,838,877.54	-	
应付赎回款	379,000.04	77,680.63	
应付管理人报酬	129,124.63	89,940.39	
应付托管费	43,041.55	29,980.12	
应付销售服务费	40,474.86	34,140.56	
应付交易费用	10,426.35	2,702.80	
应交税费	-	-	
应付利息	-	4,004.00	
应付利润	-	-	
递延所得税负债	-	_	
其他负债	160,545.56	320,034.19	
负债合计	43,601,490.53	15,558,482.69	
所有者权益:			
实收基金	350,488,461.24	171,895,482.75	
未分配利润	22,458,590.82	1,498,328.00	
所有者权益合计	372,947,052.06	173,393,810.75	
负债和所有者权益总计	416,548,542.59	188,952,293.44	

额净值1.061元,基金份额为205,690,133.42份,基金份额总额350,488,461.24份

会计主体,电万菱信添益宝债券型证券投资基金

本报告期:2012年1月1日至2012年6月30日		单位:人民币元
项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
一、收入	10,938,749.45	-7,569,227.27
1.利息收入	4,227,326.61	4,606,375.05
其中:存款利息收入	87,402.90	76,532.78
债券利息收入	4,128,311.48	4,529,842.27
资产支持证券利息收入	-	-
买人返售金融资产收人	11,612.23	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益 假失以""填列)	-7,551,531.10	3,597,586.63
其中:股票投资收益	-8,119,513.25	3,882,884.96
基金投资收益	-	-
债券投资收益	534,997.15	-378,993.17
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	32,985.00	93,694.84
3.公允价值变动收益 假失以 ""号填列)	14,256,556.60	-15,810,694.79
4.汇兑收益 假失以""号填列)	-	-
5.其他收入 假失以 ""号填列)	6,397.34	37,505.84
减:二、费用	1,308,109.79	1,882,085.43
1.管理人报酬	536,743.79	802,817.50
2.托管费	178,914.57	267,605.83
3.销售服务费	192,909.26	283,350.15
4.交易费用	25,251.72	26,099.20
5.利息支出	213,520.21	330,725.43
其中:卖出回购金融资产支出	213,520.21	330,725.43
6.其他费用	160,770.24	171,487.32
三、利润总额(亏损总额以""号填列)	9,630,639.66	-9,451,312.70
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以""号填列)	9,630,639.66	-9,451,312.70

本报告期:2012年1月1日至2012年6月30日

			单位:人民币元	
项目	本期 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 煁金净值)	171,895,482.75	1,498,328.00	173,393,810.75	
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	9,630,639.66	9,630,639.66	
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)	178,592,978.49	12,370,916.96	190,963,895.45	
其中:1.基金申购款	223,252,730.20	13,883,521.19	237,136,251.39	
2.基金赎回款	-44,659,751.71	-1,512,604.23	-46,172,355.94	
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 (争值减少以""号填列)	-	-1,041,293.80	-1,041,293.80	
五、期末所有者权益 煁金净值)	350,488,461.24	22,458,590.82	372,947,052.06	
项目	2011:	上年度可比期间 年1月1日至2011年6月	30⊟	
	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)	294,914,110.32	23,818,591.68	318,732,702.00	
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-9,451,312.70	-9,451,312.70	
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)	-84,460,780.10	-5,976,750.58	-90,437,530.68	
其中:1.基金申购款	53,277,380.52	3,977,587.13	57,254,967.65	
2.基金赎回款	-137,738,160.62	-9,954,337.71	-147,692,498.33	
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 停值减少以""号填列)	-	-	-	
五、期末所有者权益 偡金净值)	210,453,330.22	8,390,528.40	218,843,858.62	

报告附注为财务报表的组成部分。 本报告61至64,财务报表由下列负责人签署: 基金管理公司负责人、姜国芳,主管会计工作负责人,过模华,会计机构负责人;李祺君

6.4.1 基金基本情况

申万菱信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 甲刀要信節發重領穿架並穿投放金安似下網等"本產金")空中固址穿益管理象以至(以下網際"中国建造室")並且 即[2008]第104号安桂稿。由中五菱信基金管理有限公司依服(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,存载期限不定,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 经营华水道中天会计师事务所有限公司营华永道签字(2008)第189号或资报告予以验证、经同中国证监会备案,本基金基金 台同于2008年12月4日正元生火、基金合同生业日的基金份额金额为2,379,22,306,66份基金份额,其中认购金和息折合 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。

根据本基金基金合同和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 根据本基金基金合同和基金招募设明书并权中国址监会各案。本基金目录集则起根据认明。用购费用取取方式的印象 将基金份额分为不同的宏则。在投资者认购,时购基金时收取认购。中购费用。除力表基金份额,不收取认购,申购费用。而 是从本类则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,计算公式为计算日名类别基金资产净值除以计算日发售在外的该 类别基金份级应收数,投资人可自由选择申取集一类别的基金份领的"但各类别基金份级"包有不使相互转换。 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

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2012年8月28日批准报出

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XBRI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

76.33 准据企业会计准则及其他有关规定的声明 本基金2012年01月01日至2012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2012年6 月30日的财务状况以及2012年01月01日至2012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 重要会计政策和会计估计 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。

645 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。

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《关于股息经 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撰

(1)以安片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、赔免征营业税和企业所得税。 (3)对基金取得的企业债券参组收入,由受债券给企业在向基金展发利息时代和代徵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,在利收入,由上市公司在向基金展发股息,在利时暂减核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,买人股票不征收股票交易印花税。

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

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	本期 2012年1月1日至20	012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至	2011年6月30日
大味力石机	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	8,182,306.79	72.76%	0.00	0.00%
6.4.8.1.2应支付关联方向	内佣金			金额单位,人民币元

关联方名称 期末应付 佣金余额

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

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	536,743.79	802,817.50
其中:支付销售机构的客户维护费	105,106.70	175,637,39

2012年1月1日至2012年6月30日

			单位:人民币元		
	2012年	本期 F1月1日至2012年6月30日			
获得销售服务费的各关联方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费				
	申万菱信添益宝债券A	申万菱信添益宝债券B	合计		
中国工商银行	-	97,455.32	97,455.32		
申万菱信基金管理有限公司	-	51,235.54	51,235.54		
申银万国	-	29,763.64	29,763.6		
合计	-	178,454.50	178,454.50		
	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日				
获得销售服务费的各关联方名称	当期发生	的基金应支付的销售服务费			
	申万菱信添益宝债券A	申万菱信添益宝债券B	合计		
中国工商银行	-	146,410.43	146,410.43		
申万菱信基金管理有限公司	-	70,301.77	70,301.7		
申银万国	-	49,176.00	49,176.00		
合计	-	265,888.20	265,888.2		

本基金本报告期和上年度可比期间,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 申万菱信添益宝债券A

关联方名称	申万菱信添益宝债券A本期末 2012年6月30日		申万菱信添益宝债券A上年度末 2011年12月31日			
	持有的 基金份额	持有的基金份额占基金 总份额的比例	持有的 基金份额	持有的基金份额占基 金总份额的比例		
申银万国	28,062,675.40	19.38%	-	-		
申万菱信添益宝债券B 本期末和上年度末 险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 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011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	46,185,034.15	58,092.68	443,420.59	69,187.34

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 本基金在承销期内没有参与关联方承销证券的情况。

649 期末(2012年6月30日)本基金持有的流通受限证券 6-1. 加入即断板之增发证券而于期末持有的流通受限证券 6-1. 因以即断板之增发证券而于期末持有的流通受限证券 截至本报告期末止、本基金未持有因以购断发、增发而流通受限的证券。 6-4.2 则末身有的暂时停除等流通受限股票。 本基金本期末未持有暂时停降等流通受限的股票。

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,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 (1)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 (b)以公允价值计量的多趣工具 根据在公允伯住于量中对计量整体具有重大意义的最低巨级的输入值,公允价值层级可分为; 第一层级,相同资产或负值在活跃市场上(未经调整)的报价。 8二层级: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

#二层级;以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或危偿的输入值(不可观察输入值)。 于2012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197,220,380.08元,第二层级的 余额为81,809,000.00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

- 7。 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

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。

7.1 期末基金资产组合情况

			金额单位:人民币元
序号	项目	金額	占基金总资产的比例 %)
1	权益投资	5,118,156.00	1.23
	其中:股票	5,118,156.00	1.23
2	固定收益投资	273,911,224.08	65.76
	其中:债券	273,911,224.08	65.76
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买人返售金融资产	43,500,000.00	10.44
	其中:买断式回购的买人返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	71,487,406.71	17.16
6	其他各项资产	22,531,755.80	5.41
7	合计	416,548,542.59	100.00

			(%)
A	农、林、牧、渔业	-	
В	采掘业	-	
С	制造业	1,630,196.00	0.44
CO	食品、饮料	-	
C1	纺织、服装、皮毛	746,000.00	0.2
C2	木材、家具	-	
C3	造纸、印刷	-	
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	
C5	电子	-	
C6	金属、非金属	-	
C7	机械、设备、仪表	884,196.00	0.2
C8	医药、生物制品	-	
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	1,677,540.00	0.4
Н	批发和零售贸易	569,100.00	0.1
I	金融、保险业	-	
J	房地产业	-	
K	社会服务业	733,720.00	0.2
L	传播与文化产业	507,600.00	0.1
M	综合类	-	
	合计	5,118,156.00	1.3

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 段)	公允价值	占基金资产净值比 例 %)
1	300101	国腾电子	74,000	1,047,840.00	0.28
2	300105	龙源技术	32,400	884,196.00	0.24
3	002293	罗莱家纺	10,000	746,000.00	0.20
4	601888	中国国旅	26,000	733,720.00	0.20
5	002474	榕基软件	30,000	629,700.00	0.17
6	601933	永辉超市	21,000	569,100.00	0.15
7	300133	华策影视	40,000	507,600.00	0.14

7.4.1 累计平人会额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票组织

	金額单位:人民币元				
	序号	股票代码	股票名称	本期累计买人金额	占期初基金资产净值比例 %)
	1	601965	中国汽研	603,790.60	0.35
	2	603128	华贸物流	287,578.80	0.17
[3	002676	顺威股份	15,800.00	0.01
	4	002663	普邦园林	15,000.00	0.01
	5	300298	三诺生物	14,500.00	0.01
	6	300324	旋极信息	13,500.00	0.01
	7	300323	华灿光电	10,000.00	0.01
	8	002685	华东重机	4,995.00	0.00

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明知

					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 (%)
Ì	1	601258	庞大集团	7,294,816.84	4.21
Ī	2	300141	和顺电气	1,088,567.01	0.63
Ì	3	300133	华策影视	731,268.01	0.42
Ì	4	601965	中国汽研	539,746.55	0.31
Ī	5	002474	榕基软件	473,048.34	0.27
Ì	6	300070	碧水源	350,726.00	0.20
Ì	7	603128	华贸物流	347,743.40	0.20
Ī	8	600998	九州通	180,180.00	0.10
Ì	9	601336	新华保险	87,150.00	0.05
Ì	10	002557	治治食品	27,820.00	0.02
Ì	11	002612	朗姿股份	25,310.00	0.01
Ī	12	002663	普邦园林	20,445.00	0.01
Ì	13	300298	三诺生物	17,550.00	0.01
Ì	14	002676	顺威股份	15,210.00	0.01
Ì	15	300324	旋极信息	12,650.00	0.01
Ì	16	002539	新都化工	10,050.00	0.01
Ì	17	300323	华灿光电	9,715.00	0.01
Ì	18	002645	华宏科技	9,575.00	0.01

10	002337	7676 K 00	27,820.00	0.02		
11	002612	朗姿股份	25,310.00	0.01		
12	002663	普邦园林	20,445.00	0.01		
13	300298	三诺生物	17,550.00	0.01		
14	002676	顺威股份	15,210.00	0.01		
15	300324	旋极信息	12,650.00	0.01		
16	002539	新都化工	10,050.00	0.01		
17	300323	华灿光电	9,715.00	0.01		
18	002645	华宏科技	9,575.00	0.01		
19	002685	华东重机	4,690.00	0.00		
4.3 买	.3 买人股票的成本总额及卖出股票的收入总额					

965,164.40

主,"平人会麵""走出会麵"均按平走成交会麵(成交单份季以成交數量)值列 不老麼相关交易费用

金额单位:人民币元

			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	2,139,200.00	0.57
2	央行票据	1	-
3	金融债券	40,576,000.00	10.88
	其中:政策性金融债	40,576,000.00	10.88
4	企业债券	160,850,561.08	43.13
5	企业短期融资券	10,116,000.00	2.71
6	中期票据	-	-
7	可转债	60,229,463.00	16.15
8	其他	-	-
9	合计	273,911,224.08	73.45

					金額甲位:人民巾兀
序号	债券代码	债券名称	数量 胀)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	120405	12农发05	200,000	20,094,000.00	5.39
2	122927	09海航债	180,880	18,583,611.20	4.98
3	110015	石化转债	171,600	17,144,556.00	4.60
4	122020	09复地债	133,860	13,981,677.00	3.75
5	122964	09龙湖债	134,330	13,970,320.00	3.75

7.7 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。 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

7.9.1 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调

7.9.2 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

7.9.3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	273,232.32
2	应收证券清算款	_
3	应收股利	-
4	应收利息	5,955,077.99
5	应收申购款	16,303,445.49
6	其他应收款	_
7	待摊费用	_
8	其他	_
9	合计	22,531,755.80

7.9.4 991	UPIN HINDER I ASSESSIBLE OF ASS	(MC IM 22 H/1 200		
				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	110015	石化转债	17,144,556.00	4.60
2	113001	中行转债	13,402,560.00	3.59
3	110018	国电转债	12,146,760.00	3.26
4	110016	川投转债	4,541,961.60	1.22
5	110013	国投转债	3,942,707.40	1.06
6	125731	美丰转债	2,303,440.00	0.62
7	110012	海运转债	2,274,930.00	0.61
8	125709	唐钢转债	1,308,360.00	0.35
9	110017	中海转债	1,171,560.00	0.31

7.9.5 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的情况 基金份额持有人信息

81 期末基金份额持有人户数及持有人结构 份额单位:伤

3,559 98,479.48 137,862,398.19 39.33% 212,626,063.05 注:"持有人户数"合计数小于各份额级别持有人户数的总和,是由于一

2,265.0

注:1、分级基金管理人的从业人员持有基金总份额比例的计算中,对下属分级基金,比例的分母采用各自级别的份额,对 合计数 比例的分母采用下属分级基金份额的合计数(即期末基金份额总额 2、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

144,798,327.82

开放式基金份额变动 本报告期期初基金份额总额 59,875,980.2 112,019,502.46 设告期基金总申购份额 19,640,975.8 25,018,775.8

重大事件揭示

本报告期期末基金份额总额

金额单位:人民币元

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通过及职工民主选举结果,同意外方股东提名的监事由正冈利之先生变更为代田秀雄先 生,原职工监事王厚谊先生变更为王菲萍女士 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。

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。 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

10.7.1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

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
		成交金額	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	8,182,306.79	72.76%	6,970.96	73.60%	-
招商证券	2	3,063,954.36	27.24%	2,500.46	26.40%	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	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 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

205,690,133.42