申万菱信新动力股票型证券投资基金

2013 年度 报告摘要

2013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：二〇一四年三月二十七日

§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2014年3月25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2013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	申万菱信新动力股票
基金主代码	310328
交易代码	310328
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年11月10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	4,391,515,881.58份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资受益于促进国民经济持续增长的新动力而具有高成长性和持续盈利增长潜力的上市公司，有效分享中国经济快速持续增长的成果；通过采用积极主动的分散化投资策略，在严密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收益。
投资策略	本基金是以股票投资为主的平衡型基金，采用主动投资管理模式。本基金采取"行业配置"与"个股选择"双线并行的投资策略。本基金采用双线并行的组合投资策略，'自上而下'地进行证券品种的一级资产配置，'自下而上'地精选个股。基于基础性宏观研究，由投资总监和基金经理首先提出初步的一级资产配置比例；同时，根据本基金管理人自主开发的主动式资产配置模型-AAAM(Active Asset Allocation Model)提示的一级资产配置建议方案，在进行综合的对比分析和评估后作出一级资产配置方案。通过基本面分析、综合分析影响企业持续发展的动力因素和其自身发展环境因素和市场分析，组合投资有高成长性和具备持续发展能力的上市公司股票，经严格的风险管理后，争取持续稳定的经风险调整后的优良回报。在本基金的投资管理过程中，基金管理人将跟随中国经济的发展，分析各个阶段中国经济的发展环境，对持续成长动力评估体系中的新动力指标和各指标评分权重进行适时地调整，以更适合当时的基金投资环境并挖掘各个阶段的最具持续成长性的上市公司股票进行投资。
业绩比较基准	天相成长100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，其风险和预期收益均高于平衡型基金，属于证券投资基金中的中高风险品种。本基金力争通过资产配置，精选个股等投资策略的实施和积极的风险管理而谋求中长期的较高收益。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		申万菱信基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	来肖贤	赵会军
	联系电话	021-23261188	010-66105799
	电子邮箱	service@swsmu.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008808588	95588
传真		021-23261199	010-66105798

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	2013年	2012年	2011年
本期已实现收益	242,686,870.64	-139,172,595.97	-377,146,691.97
本期利润	206,208,185.40	235,034,674.63	-1,077,007,595.12
加权平均基金份额本期利润	0.0499	0.0571	-0.2499
本期基金份额净值增长率	9.18%	10.99%	-32.66%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末	2012年末	2011年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0636	-0.1228	-0.0892
期末基金资产净值	2,779,245,334.62	2,359,249,707.61	2,175,126,346.61
期末基金份额净值	0.6329	0.5797	0.5223

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、上述基金业绩指标已扣除了基金的管理费、托管费和各项交易费用，但不包括持有人认/申购或交易基金的各项费用（例如：申购费、赎回费等），计入认/申购或交易基金的各项费用后，实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.23%	1.10%	-2.74%	0.86%	1.51%	0.24%
过去六个月	14.35%	1.16%	2.22%	1.03%	12.13%	0.13%
过去一年	9.18%	1.23%	-6.28%	1.14%	15.46%	0.09%
过去三年	-18.40%	1.31%	-9.36%	1.03%	-9.04%	0.28%
过去五年	28.08%	1.51%	34.35%	1.21%	-6.27%	0.30%
自基金合同生效起至今	150.69%	1.70%	155.53%	1.49%	-4.84%	0.21%

注：本基金的业绩基准指数=天相成长100指数收益率×80%+中信标普国债指数收益率×20%。其中：天相成长100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。

天相成长指数成份股选择主要指标为上市公司公开的最新的净利润增长、主营业务收入增长和主营业务利润增长，明确反映公司的成长性；天相成长100指数的样本股则是天相成长指数样本中规模最大、最具流动性的100家公司，在成长型股票的基础上充分考虑了指数的覆盖面、指数成份股的市值规模以及良好流动性的同时也充分考虑了指数成份股的行业代表、成份股所代表的上市公司的基本因素，适合作为关注成长性的投资基准。中信标普国债指数由中信标普指数信息服务有限公司发布，是中信标普债券系列指数中的一员，该指数市场影响力大，被基金业广泛用作衡量债券投资收益的评价基准。

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；

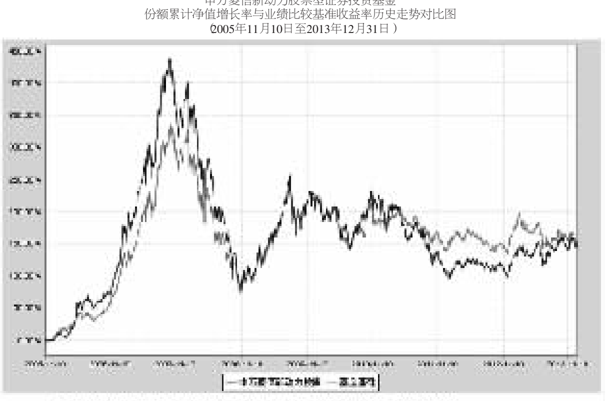
%benchmark (t) =80% *（天相成长100指数收益率 (t)/天相成长100指数收益率 (t-1)-1)+20% * (中信标普国债指数收益率 (t)/中信标普国债指数收益率 (t-1)-1)；

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

其中t=1,2,3,…。

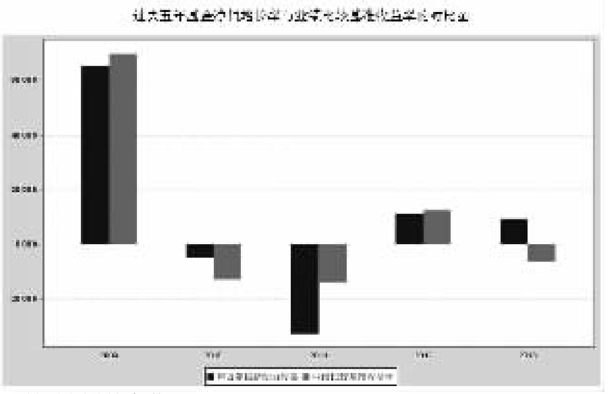
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

申万菱信新动力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
(2005年11月10日至2013年12月31日)



3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

申万菱信新动力股票型证券投资基金
过去五年基金每年净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



3.3过去三年基金的利润分配情况

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
2013	-	-	-	-	-
2012	-	-	-	-	-
2011	0.050	9,071,129.67	13,738,418.35	22,809,548.02	-
合计	0.050	9,071,129.67	13,738,418.35	22,809,548.02	-

§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，注册资本金为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200万户。

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、公司副总经理、公司投资总监	2011-11-22	-	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。
章锦涛	本基金基金经理助理	2011-06-01	-	7年	章锦涛先生，南开大学金融学硕士，2006年开始从事金融工作，历任国泰君安证券研究所研究员，2009年3月加入本公司，现任申万菱信新动力股票型证券投资基金基金经理助理。

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

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公平交易制度和控制方法

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。

在研究分析方面，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，规范了研究人员的投资建议、研究报告的发布流程，使各投资组合经理在获取投资建议的及时性、准确性及深度等方面得到公平对待。

在投资决策方面，首先，公司建立健全投资授权制度，明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限。投资决策委员会和投资总监等管理机构和人员不得对投资组合经理在授权范围内的投资活动进行干预。投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作必须经过严格的审批程序；其次，公司建立投资组合投资信息的管理及保密制度，除分管投资副总及投资总监等因业务管理的需要外，不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离；另外，公司还建立机制要求公募投资经理与特定客户资产投资经理互相隔离，且不能互相授权投资事宜。

在交易执行方面，本公司设立了独立于投资管理职能的交易总部，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；此外，本公司对于可能导致涉嫌不公平交易和利益输送的反向交易行为也制定并落实了严格的管理：（1）对于交易所公开竞价的同向交易，交易总部按照"时间优先、价格优先"的原则，采取"未委托数量比例法"，通过系统的公平交易模块实现公平交易；（2）对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，集中交易室按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；（3）对于银行间市场的现券交易，交易总部在银行间市场开展独立、公平的询价，并由风险管理部对交易价格的公允性（根据市场公认的第三方信息），交易对手和交易方式进行事前审核，确保交易得到公平和公允的执行。对于由于特殊原因不能参与以上提到的公平交易程序的交易指令，投资经理须提出申请并阐明具体原因，交由交易总监及风险管理总监进行严格的公平性审核；（4）严格禁止同一投资组合或不同投资组合之间在同一交易日内进行反向交易（除完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合外）。确因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生的不同投资组合之间的同日反向交易，相关投资经理须向风险管理委员会提供决策依据并留存记录备查。

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。其中日常监控包括了日内不定点对交易各环节的抽查监控；对非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程进行审核和监控；以及对银行间债券交易过程中投资组合与交易对手之间议价交易的交易方式和交易价格的公允性进行审查。事后分析评估上，风险管理总部在每个季度和每年度的《公平交易执行报告》中，对不同组合间同一投资标的、临近交易日的同向交易和反向交易的合理性开展分析评估。

4.3.2公平交易制度的执行情况

对于场内同向交易，我们采集了本报告期内本公司旗下两两投资组合在相同时间窗口下（日内、3日内和5日内）同买或者同卖场内同一证券时两者买卖均价存在的差异（即价差率）序列，然后按两两组合归类计算平均价差率。首先，假设两两组合在本报告期的价差率呈正态分布且平均价差率为0，我们进行了95%的置信度、假设平均价差率为0的T检验，若通过该假设检验，则我们认为该两两组合的交易得到了公平的执行；对于未通过假设检验的情况，我们还计算了两两组合价差占优次数比例、价差交易模拟贡献、组合收益率差异和模拟输送比例占收益率差的比例等指标；若综合以上各项指标，认为仍存在一定的嫌疑，则我们将进一步对该两两组合同向买卖特定场内证券的时点、价格、数量等作分析，来判断是否存在重大利益输送的可能性。

对于场外同向交易，我们分析了本报告期内不同时间窗口内（日内、3日内和5日内）两两组合同向交易的价差率、对比市场公允价格和交易对手，未发现利益输送的情况。

对于反向交易，我们根据交易价格、交易频率、交易数量等进行了综合分析，未发现异常情况。

综合而言，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。

4.3.3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的说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2013年中国经济处于窄幅波动过程中，一、二季度下行，三季度略有回升，四季度平稳；通胀方面，CPI一、二季度较低，三季度上行到3%以上，四季度平稳。流动性方面，由于政府把经济转型和防止债务风险放在更加重要的位置，全年出台了多项清理影子银行、压缩银行同业业务以及清理地方平台债务的措施；而央行始终保持偏紧的货币政策，全年资金利率处于较高水平，并在半年末、三季度和年末均出现大幅上升的情况。股票市场在改革和转型的背景下，一边是中小盘成长股的持续上涨，创业板、中小盘指数分别上涨82.73%、17.54%，主要是互联网、传媒、信息服务、新型消费电子等行业在转型预期下有良好的成长性，获得了资金的不断追捧；另一边是强周期股、金融地产等转型受损股的震荡下跌，沪深300指数全年下跌7.65%，主要是经济基本面的持续偏弱和政策面对相关行业的不断打压。整个市场形成了分化极度严重的格局。

本基金在本年度仍然坚持价值型投资理念，基于对金融、地产、汽车、家电等低估值优势企业的内在价值已经严重低估的判断，虽然我们无法判断短期是否股价回归内在价值，但作为中长期的投资价值已经非常突出，这些行业的优质股票是本基金的基本配置。由于对市场的阶段性偏好和基金短期收益考虑，我们选择了部分成长性个股进行策略性投资，主要集中在医药生物、大众消费、军工电子、文化传媒等行业，基于自下而上的逻辑，选择行业前景向好、具备较高成长性和合理估值。由于管理人的价值偏好，对成长股的投资比例始终处于较低的状态，所以虽然本基金净值增长大幅超越了沪深300代表的市场平均回报率，但在同类型基金净值增长率排名中处于中偏后水平。本管理人认为，只有持续地创造出超越基金业绩基准的投资业绩，才能为基金持有人创造稳定可靠的投资回报。

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9.18%，同期业绩比较基准表现为-6.28%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2014年，我们判断中国经济增速仍将处在7%至8%之间的窄幅波动中，全年很可能是缓慢下行的过程；而通胀可能低位波动，比较平稳。货币政策方面，上半年保持偏紧的状态，下半年随着经济增速的下行，可能向略松方面微调。改革方面的政策是今年政策的主旋律，会不断为股票市场创造出主题投资机会。股票市场趋势判断上，上半年仍然是结构分化的市场，在流动性偏紧和经济偏弱的格局下，大盘蓝筹股难以呈现趋势性上涨；但下半年随着中小板、创业板新股巨量供应增加，以及货币政策的微幅调整，蓝筹股可能呈现探底回升趋势。

本基金仍将坚持将保险、券商、汽车、家电和部分估值合理消费品中的优势企业作为基本配置，因为我们认为这些行业已经反映了过度悲观的预期，其中优质的企业价值已经严重低估，一旦经济和市场环境过度悲观预期扭转，股票价格将回归其应有的内在价值；并且我们判断这种条件在今年出现是大概率事件。本基金为获取短期的投资收益，也将实行对成长股进行策略性投资的策略，主要关注的成长性行业是医药生物、新兴消费电子、文化传媒、新能源汽车、军工等。

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，直接分管基金运营工作，拥有9年的基金公司高级管理人员经验。基金投资管理总部总监欧庆铃先生，拥有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，拥有近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新动力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

本报告期内，申万菱信新动力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新动力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，申万菱信新动力股票型证券投资基金未进行利润分配。

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菱信新动力股票型证券投资基金2013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（2014）第20380号

申万菱信新动力股票型证券投资基金

（原名为申万巴黎新动力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菱信新动力股票型证券投资基金（原名为"申万巴黎新动力股票型证券投资基金"，以下简称"申万菱信新动力基金"）的财务报表，包括2013年12月31日的资产负债表、2013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

编制和公允列报财务报表是申万菱信新动力基金的基金管理人申万菱信基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

（1）按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会（以下简称"中国证监会"）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，并使其实现公允反映；

（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在执行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中国注册会计师职业道德守则，计划和执行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，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，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，上述申万菱信新动力基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了申万菱信新动力基金 2013年12月31日的财务状况以及2013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（特殊普通合伙）
注册会计师 薛竞
注册会计师 张振波
上海市陆家嘴环路1318号星展银行大厦6层
2014-03-27

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：申万菱信新动力股票型证券投资基金
报告截止日：2013年12月31日

单位：人民币元

资 产	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
资 产：		
银行存款	337,042,446.10	345,434,159.25
结算备付金	2,033,051.45	672,687.84
存出保证金	781,345.92	584,527.00
交易性金融资产	2,198,955,014.28	2,018,412,567.42
其中：股票投资	2,198,955,014.28	2,018,412,567.42
基金投资	-	-
债券投资	-	-
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	248,232,941.50	-
应收利息	111,983.18	76,236.52
应收股利	-	-
应收申购款	39,913.69	34,095.45
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,787,196,696.12	2,365,214,273.48
负债和所有者权益	本期末 2013年12月31日	上年度末 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	-	-
应付赎回款	1,609,981.44	1,073,216.93
应付管理人报酬	3,410,400.14	2,785,288.89
应付托管费	568,400.00	464,214.81
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,626,068.01	471,238.59
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	736,511.91	1,170,606.65
负债合计	7,951,361.50	5,964,565.87
所有者权益：		
实收基金	2,418,721,291.17	2,241,607,991.18
未分配利润	360,524,043.45	117,641,716.43
所有者权益合计	2,779,245,334.62	2,359,249,707.61
负债和所有者权益总计	2,787,196,696.12	2,365,214,273.48

注：报告截止日2013年12月31日，基金份额净值0.6329元，基金份额总额4,391,515,881.58份。

7.2 利润表

会计主体：申万菱信新动力股票型证券投资基金
本报告期：2013年1月1日至2013年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
一、收入	260,008,032.24	280,995,347.81
1.利息收入	3,686,850.74	4,034,818.84
其中：存款利息收入	2,739,194.85	2,666,892.39
债券利息收入	7,507.20	8,326.86
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	940,148.69	1,359,599.59
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	292,531,046.51	-97,257,302.11
其中：股票投资收益	256,043,208.38	-119,701,777.43
基金投资收益	-	-
债券投资收益	619,220.90	173,563.14
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	35,868,617.23	22,270,912.18
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-36,478,685.24	374,207,270.60
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	268,820.23	10,560.48
减：二、费用	53,799,846.84	45,960,673.18
1.管理人报酬	37,797,521.01	33,537,906.17
2.托管费	6,299,586.81	5,589,651.09
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	9,260,175.67	6,391,904.92
5.利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	442,563.35	441,211.00
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	206,208,185.40	235,034,674.63
减：所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列	206,208,185.40	235,034,674.63

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：申万菱信新动力股票型证券投资基金
本报告期：2013年1月1日至2013年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013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)	2,241,607,991.18	117,641,716.43	2,359,249,707.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	206,208,185.40	206,208,185.40
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)	177,113,299.99	36,674,141.62	213,787,441.61
其中：1.基金申购款	606,724,456.58	81,027,003.47	687,751,460.05
2.基金赎回款	-429,611,156.59	-44,352,861.85	-473,964,018.44
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)	2,418,721,291.17	360,524,043.45	2,779,245,334.62
项目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012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)	2,293,483,311.06	-118,356,964.45	2,175,126,346.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	235,034,674.63	235,034,674.63
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)	-51,875,319.88	964,006.25	-50,911,313.63
其中：1.基金申购款	66,076,695.17	-149,051.41	65,927,643.76
2.基金赎回款	-117,952,015.05	1,113,057.66	-116,838,957.39
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)	2,241,607,991.18	117,641,716.43	2,359,249,707.61

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

7.4 报表附注

7.4.1基金基本情况

申万菱信新动力股票型证券投资基金（原名为申万巴黎新动力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"）证监基金字［2005］159号文核准，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《申万巴黎新动力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人民币669,540,171.18元，业经德勤华永会计师事务所有限公司德师报（验）字（05）第0043号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《申万巴黎新动力股票型证券投资基金基金合同》于2005年11月10日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为669,603,985.69份基金份额，其中认购资金利息折合63,814.51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。

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，申万巴黎基金管理有限公司已于2011年3月3日完成相关工商变更登记手续，并于2011年3月4日变更公司名称为"申万菱信基金管理有限公司"。本基金的基金管理人报请中国证监会备案，将申万巴黎新动力股票型证券投资基金更名为申万菱信新动力股票型证券投资基金，并于2011年4月6日公告。

根据《申万巴黎新动力股票型证券投资基金招募说明书》和《关于申万巴黎新动力股票型证券投资基金基金份额拆分比例的公告》的有关规定，本基金于2007年4月18日进行了基金份额拆分，拆分比例为1:1.815664620（保留到小数点后9位），并于2007年4月19日进行了变更登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《申万菱信新动力股票型证券投资基金基金合同》和最新公布的《申万菱信新动力股票型证券投资基金更新的招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为：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和上市交易的各类股票、债券、货币市场工具以及经中国证监会批准的允许证券投资基金投资的其他金融工具。资产配置比例为：股票60%至95%，其中投资于受益于促进国民经济持续增长的新动力而具有高成长性和持续盈利增长潜力的上市公司股票的比例不低于80%；债券5%至40%，其中现金和到期日在一年以内的政府债券为基金净资产的5%以上。本基金的业绩比较基准为：天相成长100指数收益率×80%+中信标普国债指数收益率×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2014年3月27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"）、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《申万菱信新动力股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监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2013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2013年12月31日的财务状况以及2013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

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

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［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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

（2）对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（3）对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起，对基金从上市公司取得的股息红利所得，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。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%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。

（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
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（以下简称"申银万国"）	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。

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 2013年1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012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	1,197,476,787.73	19.70%	206,302,145.21	4.98%

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 2013年1月1日至2013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	1,089,393.37	19.90%	452,821.88	27.86%
关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012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	178,011.15	5.03%	-	-

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 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	37,797,521.01	33,537,906.17
其中：支付销售机构的客户维护费	6,069,680.16	5,796,358.96

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 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	6,299,586.81	5,589,651.09

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

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

7.4.8.4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

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

7.4.8.4.2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2013年1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间2012年1月1日至2012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-活期存款	337,042,446.10	2,569,527.66	345,434,159.25	2,422,165.11
中国工商银行-定期存款	-	108,325.00	-	186,538.33
合计	337,042,446.10	2,677,852.66	345,434,159.25	2,608,703.44

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期末（2013年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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
600195	中牧股份	2013-10-21	2014-10-16	非公开发行	12.22	12.97	3,000,000	36,660,000.00	38,910,000.00	-

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。

7.4.9.2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
002022	科华生物	2013-12-20	重大事项	16.82	2014-01-27	18.50	1,000,000	15,956,412.92	16,820,000.00	-

注：本基金截至2013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。

7.4.9.3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。

7.4.10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

（i）金融工具公允价值计量的方法

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）。

（ii）各层次金融工具公允价值

于2013年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层级的余额为2,143,225,014.28元，属于第二层级的余额为55,730,000.00元，无第三层级的余额（2012年12月31日：一层级的余额为1,893,428,263.17元，属于第二层级的余额为124,984,304.25元，无第三层级的余额）。

（iii）公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层级；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层级还是第三层级。

（iv）第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

（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	2,198,955,014.28	78.89
	其中：股票	2,198,955,014.28	78.89
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	339,075,497.55	12.17
6	其他各项资产	249,166,184.29	8.94
7	合计	2,787,196,696.12	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	40,392,647.68	1.45
B	采矿业	-	-
C	制造业	933,099,743.06	33.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	33,116,659.50	1.19
F	批发和零售业	95,669,396.82	3.44
G	交通运输、仓储和邮政业	2,097,455.98	0.08
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	39,120,000.00	1.41
J	金融业	624,783,565.04	22.48
K	房地产业	254,852,791.45	9.17
L	租赁和商务服务业	41,182,000.00	1.48
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	61,675,754.75	2.22
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	15,605,000.00	0.56
R	文化、体育和娱乐业	57,360,000.00	2.06
S	综合	-	-
	合计	2,198,955,014.28	79.12

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	601318	中国平安	3,000,000	125,190,000.00	4.50
2	601628	中国人寿	7,499,948	113,474,213.24	4.08
3	000333	美的集团	2,068,200	103,410,000.00	3.72
4	601601	中国太保	5,499,752	101,910,404.56	3.67
5	600000	浦发银行	10,000,000	94,300,000.00	3.39
6	600104	上汽集团	6,499,778	91,906,860.92	3.31
7	000024	招商地产	4,004,932	83,222,486.96	2.99
8	600873	梅花集团	12,747,209	79,542,584.16	2.86
9	600837	海通证券	6,999,907	79,238,947.24	2.85
10	600208	新湖中宝	23,668,169	75,738,140.80	2.73

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	600000	浦发银行	175,124,588.12	7.42
2	601788	光大证券	109,748,320.43	4.65
3	601601	中国太保	99,190,292.27	4.20
4	600837	海通证券	98,404,184.92	4.17
5	601628	中国人寿	88,064,242.80	3.73
6	600030	中信证券	85,891,960.99	3.64
7	000333	美的集团	84,120,000.00	3.57
8	600104	上汽集团	80,628,536.17	3.42
9	601166	兴业银行	77,944,158.50	3.30
10	601318	中国平安	73,080,212.93	3.10
11	601928	凤凰传媒	69,383,863.58	2.94
12	600873	梅花集团	66,826,903.29	2.83
13	600195	中牧股份	58,161,155.88	2.47
14	002005	德豪润达	57,260,071.79	2.43
15	600048	保利地产	56,706,508.56	2.40
16	600406	国电南瑞	54,654,515.31	2.32
17	600208	新湖中宝	54,215,477.89	2.30
18	000888	峨眉山A	49,858,855.79	2.11
19	002234	民和股份	49,074,186.51	2.08
20	601566	九牧王	47,936,503.93	2.03
21	000338	潍柴动力	47,835,251.54	2.03

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	300070	碧水源	194,666,085.25	8.25
2	600000	浦发银行	121,999,614.72	5.17
3	600597	光明乳业	109,265,647.54	4.63
4	600030	中信证券	106,426,190.60	4.51
5	600837	海通证券	94,991,813.72	4.03
6	000338	潍柴动力	88,435,296.91	3.75
7	000937	冀中能源	72,046,720.44	3.05
8	000887	中鼎股份	70,818,496.64	3.00
9	000063	中兴通讯	69,512,790.55	2.95
10	601699	潞安环能	61,688,472.82	2.61
11	300020	银江股份	58,888,132.31	2.50
12	600588	用友软件	53,328,672.35	2.26
13	600089	特变电工	50,741,668.63	2.15
14	601166	兴业银行	50,548,810.45	2.14
15	600251	冠农股份	49,149,629.86	2.08
16	601628	中国人寿	46,322,952.52	1.96
17	600312	平高电气	45,624,544.84	1.93
18	600048	保利地产	45,571,715.19	1.93
19	601288	农业银行	45,143,819.68	1.91
20	000858	五 粮 液	44,749,570.47	1.90

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	3,039,701,908.60
卖出股票的收入(成交)总额	3,170,882,976.88

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.9.1 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。

8.9.2 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。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.10.1 本基金投资国债期货的投资政策

根据本基金基金合同，本基金不得参与国债期货交易。

8.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据本基金基金合同，本基金不得参与国债期货交易。

8.10.3 本基金投资国债期货的投资评价

根据本基金基金合同，本基金不得参与国债期货交易。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1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。

8.11.2 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。

8.11.3 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	781,345.92
2	应收证券清算款	248,232,941.50
3	应收股利	-
4	应收利息	111,983.18
5	应收申购款	39,913.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	249,166,184.29

8.11.4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可转换债券。

8.11.5期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
189,810	23,136.38	856,683,897.94	19.51%	3,534,831,983.64	80.49%

9.2 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
基金管理公司所有从业人员持有本基金	57,889.77	0%

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。

§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	4,069,951,600.51
本报告期基金总申购份额	1,101,606,124.41
减：本报告期基金总赎回份额	780,041,843.34
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	4,391,515,881.58

§11 重大事件揭示

11.1 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。

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

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、经本基金管理人第一届董事会2012年第四次会议审议通过，任命过振华先生为公司总经理。具体内容请参考本基金管理人于2013年3月1日发布的《申万菱信基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告》。

3、报告期内本基金基金托管人无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

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

报告期内，本基金聘用普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）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（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务时间为6年。本报告期本基金应支付普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计费100,000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

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	2	1,197,476,787.73	19.70%	1,089,393.37	19.90%	-
光大证券	2	969,969,323.69	15.95%	881,460.95	16.11%	-
中投证券	2	622,881,285.65	10.25%	562,810.23	10.28%	-
国信证券	2	555,748,183.81	9.14%	502,713.06	9.19%	-
天风证券	1	519,252,200.69	8.54%	459,487.60	8.40%	-
中信建投	1	355,213,344.08	5.84%	323,384.89	5.91%	-
民生证券	1	340,257,736.51	5.60%	301,094.93	5.50%	-
西南证券	1	300,480,728.66	4.94%	265,897.05	4.86%	本期新增
招商证券	1	188,969,686.63	3.11%	167,218.89	3.06%	-
华鑫证券	1	171,036,718.24	2.81%	155,710.09	2.84%	本期新增
广发证券	1	169,283,700.33	2.78%	149,798.87	2.74%	-
东兴证券	1	121,465,277.02	2.00%	107,484.85	1.96%	-
兴业证券	1	117,260,955.77	1.93%	103,764.14	1.90%	-
中信证券	1	115,291,654.12	1.90%	102,021.46	1.86%	-
浙商证券	1	105,966,704.24	1.74%	96,473.85	1.76%	-
红塔证券	2	72,948,171.29	1.20%	64,552.07	1.18%	-
国联证券	1	61,590,984.33	1.01%	56,072.11	1.02%	-
海通证券	1	60,987,935.07	1.00%	53,968.48	0.99%	-
华泰证券	1	30,802,892.98	0.51%	27,257.58	0.50%	-
中金公司	2	2,965,747.14	0.05%	2,624.40	0.05%	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	本期新增

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。

申万菱信基金管理有限公司
二〇一四年三月二十七日