（上接B275版）

注：本基金为本报告期内转型的基金，无上年度可比期间对比数据。

7.2.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：申万菱信沪深300指数增强型证券投资基金

本报告期：2013年6月7日至2013年12月31日

单位：人民币元

项目		2013年6月7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）	68,676,638.92	1,482,313.30		70,158,952.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,927,187.17		2,927,187.17
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）	-28,735,415.37	-2,607,405.47		-31,342,820.84
其中：1.基金申购款	37,800,009.57	-110,285.01		37,689,724.56
2.基金赎回款	-66,535,424.94	-2,497,120.46		-69,032,545.40
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）	39,941,223.55	1,802,095.00		41,743,318.55

注：本基金为本报告期内转型的基金，无上年度可比期间对比数据。

报告附注为财务报表的组成部分

本报告页码从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

7.2.4报表附注

7.2.4.1 基金基本情况

申万菱信盛利强化配置混合型证券投资基金（原名为申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金，以下简称“盛利强化配置基金”）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[2004]158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《申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。盛利强化配置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690,340,263.28元，业经德勤华永会计师事务所有限公司德师报(验)字(04)第055号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金基金合同》于2004年11月29日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为690,462,261.09份基金份额，其中认购资金利息折合121,997.81份基金份额。盛利强化配置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”。盛利强化配置基金的基金管理人报请中国证监会备案，将申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金更名为申万菱信盛利强化配置混合型证券投资基金，并于2011年4月6日公告。

2013年5月2日，盛利强化配置基金基金份额持有人大会审议并通过了《关于申万菱信盛利强化配置混合型证券投资基金转型有关事项的议案》。经中国证监会证监许可[2013]748号《关于核准申万菱信盛利强化配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》核准，盛利强化配置基金基金份额持有人大会决议生效。根据基金份额持有人大会表决情况及中国证监会批复，基金管理人对盛利强化配置基金按照《申万菱信盛利强化配置混合型证券投资基金转型方案说明书》实施转型，将《申万菱信盛利强化配置混合型证券投资基金基金合同》修订为《申万菱信沪深300指数增强型证券投资基金基金合同》。《申万菱信沪深300指数增强型证券投资基金基金合同》自2013年6月7日起正式生效，原《申万菱信盛利强化配置混合型证券投资基金基金合同》自同一日起失效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《申万菱信沪深300指数增强型证券投资基金基金合同》和最新公布的《申万菱信沪深300指数增强型证券投资基金更新的招募说明书》的有关规定，申万菱信沪深300指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)的投资范围为：具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、权证、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金资产配置比例为：股票资产不低于基金资产净值的80%，其中投资于沪深300指数成份股、备选成份股的资产占股票资产的比例不低于80%。本基金的业绩比较基准为：95%×沪深300指数收益率+1.5%(指年收益率，评价时按期间折算)。

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。

7.2.4.2 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》、《申万菱信沪深300指数增强型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.2.4.4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。

7.2.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2013年6月7日(基金合同生效日)至2013年12月31日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2013年12月31日的财务状况以及2013年6月7日(基金合同生效日)至2013年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.2.4.4 重要会计政策和会计估计

7.2.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2013年6月7日（基金合同生效日)至2013年12月31日止期间。

7.2.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.2.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.2.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.2.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.2.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.2.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.2.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.2.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.2.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.2.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.2.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.2.4.4.13其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

7.2.4.5 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。

7.2.4.6 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[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《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，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。

7.2.4.7 关联方关系

7.2.4.7.1本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中国工商银行	基金托管人、基金代销机构
申万菱信基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
中银万国证券股份有限公司（以下简称“中银万国”）	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。

7.2.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.2.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.2.4.8.1.1股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	2013年6月7日至2013年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中银万国	192,600,845.45	53.91%

7.2.4.8.1.2应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	2013年6月7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
中银万国	172,280.75	53.51%	112,245.07	100.00%

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。

7.2.4.8.2关联方报酬

7.2.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	2013年6月7日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	278,269.89
其中：支付销售机构的客户维护费	34,775.08

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1.00%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*1.00%/当年天数。

7.2.4.8.2.2基金托管费

单位：人民币元

项目	2013年6月7日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	50,153.95

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值0.18%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*0.18%/当年天数。

7.2.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

7.2.4.8.4各关联方投资本基金的情况

7.2.4.8.4.1 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。

7.2.4.8.4.2 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。

7.2.4.8.5 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6月7日至2013年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	2,733,512.87	25,223.04

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。

7.2.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期本基金在承销期内无参与关联方承销证券的情况。

7.2.4.9 期末（2013年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.2.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截止本报告期末，本基金无认购新发/增发证券。

7.2.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截止本报告期末，本基金无暂时停牌等流通受限股票。

7.2.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

截止本报告期末，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。

7.2.4.10有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(b)以公允价值计量的金融工具

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

于2013年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39,610,667.28元，无属于第二层级和第三层级的余额。本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层级未发生重大变动。

对于持有的重大事项停牌股票，本基金将相关股票公允价值所属层级于停牌期间从第一层级转入第二层级，并于复牌后从第二层级转回第一层级。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 申万菱信盛利强化配置混合型证券投资基金（期末：2013年6月6日）

8.1.1 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	22,545,367.20	31.85
	其中：债券	22,545,367.20	31.85
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	19,445,259.22	27.47
	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	28,490,927.31	40.25
6	其他各项资产	307,911.97	0.43
7	合计	70,789,465.70	100.00

8.1.2期末按行业分类的股票投资组合

截止2013年6月6日（转型前）本基金未持有股票。

8.1.3 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

截止2013年6月6日（转型前）本基金未持有股票。

8.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.1.4.1累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

截止2013年6月6日（转型前）本基金未买入股票。

8.1.4.2累计卖出金额超出期末基金资产净值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	600028	中国石化	1,472,000.00	2.90
2	000562	宏源证券	500,000.00	0.99
3	600048	保利地产	456,800.00	0.90
4	601006	大秦铁路	246,000.00	0.49
5	300337	银邦股份	236,013.00	0.47
6	600019	宝钢股份	198,400.00	0.39
7	000887	中鼎股份	2,640.00	0.01

8.1.4.3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	-
卖出股票的收入（成交）总额	3,111,853.00

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。

8.1.5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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	2,524,367.20	3.60
5	企业短期融资券	20,021,000.00	28.54
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	22,545,367.20	32.13

8.1.6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	041364005	13科伦CP001	100,000	10,014,000.00	14.27
2	041353012	13齐峰CP001	100,000	10,007,000.00	14.26
3	122847	11甬交投	20,000	2,064,200.00	2.94
4	122009	08新湖债	4,240	460,167.20	0.66

8.1.7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

截止2013年6月6日（转型前）本基金未持有资产支持证券。

8.1.8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

截止2013年6月6日（转型前）本基金未持有权证。

8.1.9报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.1.9.1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。

8.1.9.2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。

8.1.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.1.10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同，本基金不得参与国债期货交易。

8.1.10.2 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。

8.1.10.3 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同，本基金不得参与国债期货交易。

8.1.11投资组合报告附注

8.1.11.1 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。

8.1.11.2 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。

8.1.11.3 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	4,252.84
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	303,659.13
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	307,911.97

8.1.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

截止2013年6月6日（转型前）本基金未持有处于转股期的可转换债券。

8.1.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

截止2013年6月6日（转型前）本基金未持有股票。

8.2 申万菱信沪深300指数增强型证券投资基金（期末：2013年12月31日）

8.2.1 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	39,610,667.28	92.74
	其中：股票	39,610,667.28	92.74
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	2,907,459.07	6.81
6	其他各项资产	191,738.56	0.45
7	合计	42,709,864.91	100.00

8.2.2期末按行业分类的股票投资组合

8.2.2.1指数投资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（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	386,582.40	0.93
C	制造业	13,724,621.66	32.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,693,384.58	4.06
F	批发和零售业	1,131,648.18	2.71
G	交通运输、仓储和邮政业	1,289,984.04	3.09
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	11,484,911.03	27.51
K	房地产业	1,496,128.43	3.58
L	租赁和商务服务业	439,740.00	1.05
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	469,140.10	1.12
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	32,116,140.42	76.94

8.2.2.2积极投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	5,965,801.21	14.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,109,369.65	2.66
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	419,356.00	1.00
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	7,494,526.86	17.95

8.2.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

8.2.3.1期末指数投资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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	市值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	166,377	1,811,845.53	4.34%
2	601318	中国平安	41,973	1,751,533.29	4.20%
3	600352	浙江龙盛	101,205	1,337,930.10	3.21%
4	600030	中信证券	93,504	1,192,176.00	2.86%
5	000423	东阿阿胶	29,433	1,164,369.48	2.79%
6	600016	民生银行	150,642	1,162,956.24	2.79%
7	601601	中国太保	59,300	1,098,829.00	2.63%
8	000581	威孚高科	34,958	1,076,706.40	2.58%
9	000651	格力电器	32,747	1,069,517.02	2.56%
10	600066	宇通客车	60,880	1,069,052.80	2.56%

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。

8.2.3.2期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002063	远光软件	57,037	1,109,369.65	2.66%
2	000726	鲁 泰A	100,112	1,054,179.36	2.53%
3	600761	安徽合力	81,978	991,114.02	2.37%
4	601877	正泰电器	39,321	978,306.48	2.34%
5	000786	北新建材	50,000	875,000.00	2.10%

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。

8.2.4报告期内股票投资组合的重大变动

8.2.4.1累计买入金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	5,206,759.07	12.47%
2	000786	北新建材	5,154,113.56	12.35%
3	601166	兴业银行	4,322,397.00	10.35%
4	600009	上海机场	4,184,387.21	10.02%
5	000651	格力电器	4,029,466.62	9.65%
6	600016	民生银行	3,911,965.00	9.37%
7	601318	中国平安	3,845,592.20	9.21%
8	000423	东阿阿胶	3,380,068.09	8.10%
9	601117	中国化学	3,362,945.75	8.06%
10	600030	中信证券	3,352,238.00	8.03%
11	600000	浦发银行	3,334,288.00	7.99%
12	000895	双汇发展	3,273,515.35	7.84%
13	601888	中国国旅	3,263,128.12	7.82%
14	601939	建设银行	3,244,147.68	7.77%
15	000581	威孚高科	3,119,150.18	7.47%
16	601877	正泰电器	3,105,929.25	7.44%
17	002081	金 螳 螂	3,023,632.46	7.24%
18	000726	鲁 泰A	2,931,852.43	7.02%
19	600060	海信电器	2,902,732.74	6.95%
20	600066	宇通客车	2,859,225.00	6.85%
21	600352	浙江龙盛	2,858,281.36	6.85%
22	000001	平安银行	2,829,427.35	6.78%
23	600332	白云山	2,821,838.16	6.76%
24	600104	上汽集团	2,780,506.91	6.66%
25	600309	万华化学	2,720,821.84	6.52%
26	601928	凤凰传媒	2,556,828.50	6.13%
27	000024	招商地产	2,549,286.06	6.11%
28	600588	用友软件	2,537,467.94	6.08%
29	002353	杰瑞股份	2,432,923.99	5.83%
30	000002	万 科A	2,240,991.30	5.37%
31	601006	大秦铁路	2,231,700.22	5.35%
32	000858	五 粮 液	2,197,124.19	5.26%
33	002063	远光软件	2,187,223.50	5.24%
34	600027	华电国际	2,170,158.08	5.20%
35	600837	海通证券	2,156,163.00	5.17%
36	600886	国投电力	2,077,890.00	4.98%
37	601988	中国银行	2,045,228.00	4.90%
38	600196	复星医药	2,032,586.51	4.87%
39	600011	华能国际	2,023,000.00	4.85%
40	000625	长安汽车	2,010,722.95	4.82%
41	600761	安徽合力	1,955,244.59	4.68%
42	000869	张 裕A	1,857,430.58	4.45%
43	000999	华润三九	1,830,548.68	4.39%
44	601169	北京银行	1,813,570.92	4.34%
45	600887	伊利股份	1,792,182.69	4.29%
46	600406	国电南瑞	1,753,744.00	4.20%
47	000527	美的电器	1,736,599.53	4.16%
48	000069	华侨城A	1,713,461.50	4.10%
49	601808	中海油服	1,698,649.56	4.07%
50	600900	长江电力	1,689,061.31	4.05%
51	600739	辽宁成大	1,611,302.00	3.86%
52	601299	中国北车	1,487,068.00	3.56%
53	000800	一汽轿车	1,444,394.00	3.46%
54	600664	哈药股份	1,359,959.31	3.26%
55	601668	中国建筑	1,293,799.00	3.10%
56	600138	中青旅	1,287,353.00	3.08%
57	600153	建发股份	1,283,193.00	3.07%
58	600612	老凤祥	1,249,843.31	2.99%
59	601699	潞安环能	1,248,720.00	2.99%
60	002142	宁波银行	1,212,386.00	2.90%
61	601601	中国太保