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：二〇一三年八月二十七日

申万菱信沪深300指数增强型证券投资基金

（原申万菱信盛利强化配置混合型证券投资基金转型）

【2013】半年度报告摘要

§ 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。本半年度报告于经三分之二以上独立董事签字同意，并经董事长签发。

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2013年8月26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。

本基金系原申万菱信盛利强化配置混合型证券投资基金转型而来。2013年3月30日至5月2日，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以通讯方式召开，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》。依据2013年6月7日中国证监会《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》（证监许可［2013］748号）核准，基金份额持有人大会决议生效。自2013年6月7日起，原《申万菱信盛利强化配置混合型证券投资基金基金合同》终止，《申万菱信沪深300指数增强型证券投资基金基金合同》生效，本基金正式更名为申万菱信沪深300指数增强型证券投资基金并开始按照新基金合同的规定进行运作。

本报告中，原申万菱信盛利强化配置混合型证券投资基金报告期自2013年1月1日至2013年6月6日止，申万菱信沪深300指数增强型证券投资基金报告期自2013年6月7日（基金合同生效日）至2013年6月30日止。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013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

申万菱信盛利强化配置混合型证券投资基金	
基金简称	申万菱信盛利强化配置混合
基金主代码	310318
交易代码	310318
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年11月29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	68,676,638.92
基金合同存续期	不定期
申万菱信沪深300指数增强型证券投资基金	
基金简称	申万菱信沪深300指数增强
基金主代码	310318
交易代码	310318
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年6月7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	57,752,706.02
基金合同存续期	不定期

注：1.表中，申万菱信盛利强化配置混合型证券投资基金报告期末基金份额总额为2013年6月6日基金份额余额。申万菱信沪深300指数增强型证券投资基金报告期末基金份额总额为2013年6月30日基金份额余额。

2.2基金产品说明

申万菱信盛利强化配置混合型证券投资基金	
投资目标	本基金为争取绝对收益概念的基金产品，其投资管理贯承本基金管理人的主动型投资管理模式，以积极主动和深入的研究为基础结合先进的投资组合模型，通过灵活的动态资产配置和组合保险策略，尽最大努力规避证券市场投资的系统性和波动性风险以尽可能保护投资本金安全，并分享股市上涨带来的回报，实现最优化的风险调整后的投资收益为目标，但本基金管理人并不对投资本金进行保本承诺。
投资策略	本基金采用主动型投资管理模式，以追求绝对收益并争取每基金年度战胜一年期定期存款利率为投资目标。本基金管理人在积极主动和深入的宏观研究分析和判断的基础上，结合自主开发的主动式资产配置模型进行资产配置；采用基于投资组合保险策略开发的资产再平衡模型，控制整体投资组合的可能损失；参考选时模型判断市场走势而决定是否调整投资组合或进行融资以适当扩大固定收益证券的投资规模以争取更好的收益，但以不超过基金资产净值的25%为限；在完成资产配置后，股票投资采用"行业配置"与"个股选择"双线并行的投资策略，由主动式行业矩阵模型确定行业配置，个股选择采取"自下而上"的选股过程，投资具有良好流动性的高成长性股票争取当期收益；固定收益证券投资使用利率预期策略、收益率曲线策略和久期策略进行组合管理。
业绩比较基准	银行一年期定期存款利率
风险收益特征	本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，其风险和预期收益均高于保本基金而低于平衡型基金，属于证券投资基金中的偏低风险品种。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稳定和可持续的绝对收益。
申万菱信沪深300指数增强型证券投资基金	
投资目标	本基金为增强型指数基金，通过数量化的投资方法与严格的投资纪律约束，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年化跟踪误差不超过7.75%，同时力求实现超越标的指数的业绩表现，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金在指数化投资的基础上通过数量化模型进行投资组合优化，在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下，力争获得超越标的指数的投资收益。
业绩比较基准	95%×沪深300指数收益率+1.5%（指年收益率，评价时按期间折算）。
风险收益特征	本基金为增强型指数基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

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	宋肖贤	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

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.swsmu.com
基金半年度报告备置地点	中万菱信基金管理有限公司 中国工商银行

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 申万菱信盛利强化配置混合型证券投资基金

3.1.1主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1.1期间数据和指标	2013年1月1日-2013年6月6日
本期已实现收益	1,686,283.59
本期利润	1,103,006.85
加权平均基金份额本期利润	0.0171
本期基金份额净值增长率	2.13%
3.1.1.2 期末数据和指标	2013年6月6日
期末可供分配基金份额利润	0.0216
期末基金资产净值	70,158,952.22
期末基金份额净值	1.0216

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。

3.1.2基金净值表现

3.1.2.1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

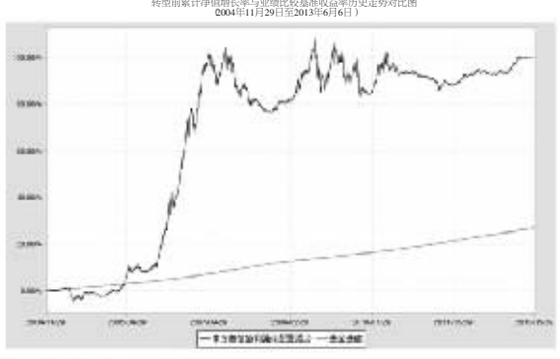
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.04%	0.01%	0.05%	0.00%	-0.09%	0.01%
过去三个月	0.18%	0.02%	0.55%	0.00%	-0.37%	0.02%
过去六个月	2.13%	0.10%	1.29%	0.00%	0.84%	0.10%
过去一年	3.45%	0.10%	2.81%	0.00%	0.64%	0.10%
过去三年	8.35%	0.24%	9.28%	0.00%	-0.93%	0.24%
自基金合同生效起至2013年6月6日	100.14%	0.48%	27.08%	0.00%	73.06%	0.48%

3.1.2.2 自基金合同生效至基金转型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

申万菱信盛利强化配置混合型证券投资基金

转型前累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2004年11月29日至2013年6月6日）



3.2申万菱信沪深300指数增强型证券投资基金

3.2.1主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.2.1.1期间数据和指标	2013年6月7日-2013年6月30日
本期已实现收益	-756,813.33
本期利润	-1,553,611.31
本期加权平均净值利润率	-2.96%
本期基金份额净值增长率	-4.58%
3.2.1.2 期末数据和指标	2013年6月30日
期末可供分配基金份额利润	-0.0252
期末基金资产净值	56,298,309.09
期末基金份额净值	0.9748

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

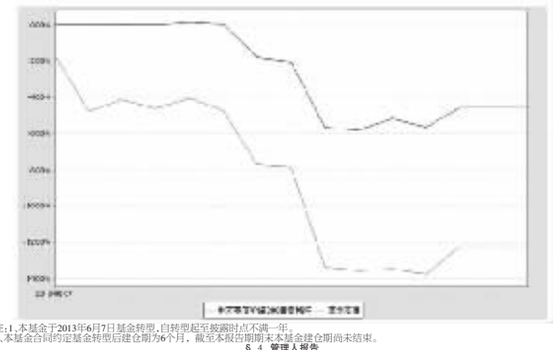
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金转型日（2013年6月7日）起至今	-4.58%	1.16%	-12.23%	2.00%	7.65%	-0.84%

3.2.2 自基金转型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

申万菱信沪深300指数增强型证券投资基金

转型后累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2013年6月7日至2013年6月30日）



注：1.本基金于2013年6月7日基金转型，自转型起至披露时点不满一年。

2.本基金合同约定基金转型后建仓期为6个月，截至本报告期期末本基金建仓期尚未结束。

§ 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投资组建的一家中外合资基金管理公司。公司成立于2004年11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。

公司成立以来业务稳长迅速，在北京、广州先后建立了分公司。截至2013年6月30日，公司旗下管理了包括股票型、混合型、债券型、指数型和货币型在内的15只开放式基金，形成了较敢于投资的产品线。公司旗下基金管理资产规模超过158亿元，客户数超过201万户。

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		
古平	本基金基金经理	2010-10-18	2013-06-26	3年	古平先生，特文特大学硕士。曾任职于上海红顶金融工程研究中心，太平洋产管理有限公司。2008年加入本公司，历任债券分析师，申万菱信添益宝、申万菱信盛利强化配置基金经理助理，申万菱信沪深300指数增强基金经理，现任申万菱信稳益宝、申万菱信定期开放债券基金经理。
刘忠勋	本基金基金经理	2013-05-29	-	7年	刘忠勋先生，上海大学金融学硕士，曾任职于华泰证券股份有限公司，2008年加入本公司，历任金融工程师，产品与金融工程总部监助理，副总监（主持工作）。现任申万菱信量化小盘股票型证券投资基金（LOF）、申万菱信沪深300指数增强型证券投资基金基金经理。

注：1.任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日；若有基金投资决策委员会决议的，则以决议日起即任职、离任职日期为基金公司生效日。

2.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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在报告期内，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，严格遵守基金合同的约定，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正当权益。

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

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）环节的实施，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。

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控制和检控、价格占优的次数百分比统计、价差交易模拟法与组合收益率差异的比较等方法对本报告期以及连续四个季度期间的、不同时间窗口下的同向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，判断交易是否公平地提供了价格竞争。

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。

4.3.2 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，未发生被动调整下投资组合单日成交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说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2013年上半年，经济低位运行和资金的波动主导了季度内资本市场的行情，从经济数据反映的情况看，经济尚难言见底，通胀弱暂时可以不必担忧，而伴随央行公开市场操作逐日实施的开始，央行在季度的最后一个月面临市场极度"紧钱"的状况始终保持稳定的态度，只是在季度末资金利率极度紧张的情况下，通过窗口指导，稳定了这种紧张状况。经济数据持续走弱的不利，央行的坚定不动摇，使本市场上，债券市场的收益率持续下行，而最后一个月的"钱荒"使得各类收益率曲线陡峭化，快速上行，部分短期品种收益率上行超过了200个基点，资金紧张的状况超过了历史以往。而在资金紧张性紧张的带动下，除了债券市场出现大规模的调整，权益市场和与之密切关联的可转债也大幅下行。

本基金组合基于本报告期内组合的安排，在公开转型为沪深300指数增强基金组合之前，减持了权益品种，并通过适当加大固定收益证券的投资规模以争取更好的收益，但以不超过基金资产净值的25%为限；在完成资产配置后，股票投资采用"行业配置"与"个股选择"双线并行的投资策略，由主动式行业矩阵模型确定行业配置，个股选择采取"自下而上"的选股过程，投资具有良好流动性的高成长性股票争取当期收益；固定收益证券投资使用利率预期策略、收益率曲线策略和久期策略进行组合管理。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金自2013年1月1日至转型前一日即2013年6月6日的净值表现为2.13%，同期业绩比较基准表现为1.29%。

本基金自转型日即2013年6月7日至2013年6月30日的净值表现为-4.58%，同期业绩比较基准表现为-12.23%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2013年下半年经济仍将处于调整的格局，总体上看，既不会出现经济大幅回落，也不太可能回到传统模式下的经济高速长模式。基于这一判断，现行的货币政策和财政政策不会出现重大的调整，微调、有限度的调整倒是很符合其代具有趋势导向意义的大幅调整，符合国家新政策的行业将会因政策大力推动，而面临较大的机会，而面临较大压力的产业和公司则会出现较大的调整过程中的"阵痛"。具体到资本市场，经济调结构的过程将会加速推进和改造传统产业生长空间，新兴产业生长大影响；对于固定收益类资产，调整结构过程中资金面和行业基本面仍将主导债券投资。下半年体可能偏紧的资金面使得利率债尤其是长期利率债甚以出现持续的趋势性行情，而比较乐观的通胀预期使得长债持续大跌的可能性也不大；信用债方面，调结构过程中的部分行业可能还会继续面临见底的过程，信用风险发生的概率将会大大增加，低评级的债券下半年面临较为严峻的形势。对于权益投资来说，调结构并稳经济的政策取向也会使得经济不会大幅下行，总体上权益市场可能维持一个震荡的行情。

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审计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，即就相关果用的相关估值模型、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，并在特定状态下就相关事项的相关估值模型、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负责人组成，其中，总经理由股东方代表、拥有证券投资基金从业资格管理人从业经验、具有证券投资管理经验的总部负责人担任委员主席，其他成员均为具有证券投资基金从业资格管理人从业经验、具有证券投资管理经验的总部负责人，拥有证券投资基金从业资格管理人从业经验、具有证券投资管理经验的公司分管基金运营的副总经理、基金运营总部总监、监察稽核总部总监、基金投资管理总部总监、风险管理总部总监、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负责人组成，其中，总经理由股东方代表、拥有证券投资基金从业资格管理人从业经验、具有证券投资管理经验的公司分管基金运营的副总经理、基金运营总部总监、监察稽核总部总监、基金投资管理总部总监、风险管理总部总监担任委员主席，其他成员均为具有证券投资基金从业资格管理人从业经验、具有证券投资管理经验的总部负责人。

本报告期内，基金经理参与估值委员会的人员分别为：王蓉女士，拥有12年的基金会计经验。监察稽核总部总监王静安士，拥有9年的基金风险管理经验。风险管理总部总监王梅仙女士，拥有13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。本公司已与中国证券投资基金业估值专业委员会签订协议，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

本基金本报告期内，原申万菱信盛利强化配置混合型证券投资基金以2013年1月15日为权益登记日，向权益登记日在本公司登记在册的本基金全体基金份额持有人持有的每10份基金份额分配0.015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

本报告期内，本基金托管人在对申万菱信沪深300指数增强型证券投资基金（原申万菱信盛利强化配置混合型证券投资基金转型）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，申万菱信沪深300指数增强型证券投资基金（原申万菱信盛利强化配置混合型证券投资基金转型）的管理人——申万菱信基金管理有限公司在申万菱信沪深300指数增强型证券投资基金（原申万菱信盛利强化配置混合型证券投资基金转型）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，申万菱信沪深300指数增强型证券投资基金（原申万菱信盛利强化配置混合型证券投资基金转型）的基金份额持有人进行了一次利润分配，分配金额为73,197,33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菱信沪深300指数增强型证券投资基金（原申万菱信盛利强化配置混合型证券投资基金转型）2013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。

6.1 申万菱信盛利强化配置混合型证券投资基金

6.1.1资产负债表

会计主体：申万菱信盛利强化配置混合型证券投资基金
报告截止日：2013年6月6日

单位：人民币元

资 产	基金转型前 2013年6月6日	上年度末 2012年12月31日
资 产：		
银行存款	28,036,381.86	3,367,447.36
结算备付金	454,545.45	-
存出保证金	4,252.84	298,387.35
交易性金融资产	22,545,367.20	41,428,910.05
其中：股票投资	-	3,020,585.00
基金投资	-	-
债券投资	22,545,367.20	38,408,325.05
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	19,445,259.22	-
应收证券清算款	-	325,451.69
应收利息	303,659.13	811,402.61
应收股利	-	-
应收申购款	-	5,954,275.87
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	70,789,465.70	52,185,874.93
负债和所有者权益	基金转型前 2013年6月6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	-	660,329.54
应付管理人报酬	13,844.69	45,799.40
应付托管费	2,884.32	9,541.54
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,948.66	3,594.16
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	611,835.81	761,135.46
负债合计	630,513.48	1,480,400.10
所有者权益：		
实收基金	68,676,638.92	50,613,008.83
未分配利润	1,482,313.30	92,466.00
所有者权益合计	70,158,952.22	50,705,474.83
负债和所有者权益总计	70,789,465.70	52,185,874.93

注：截止至2013年06月06日（基金转型前一日），基金份额净值 1.0216元，基金份额总额 68,676,638.92份。

6.1.2利润表

会计主体：申万菱信盛利强化配置混合型证券投资基金
本报告期：2013年1月1日至2013年6月6日

单位：人民币元

项 目	基金转型前 2013年1月1日至2013年6月6日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、收入	1,695,366.56	1,846,631.88
1.利息收入	722,588.56	1,002,436.58
其中：存款利息收入	80,568.76	142,731.77
债券利息收入	494,439.86	849,589.81
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	147,579.94	10,115.00
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以"-"填列）	1,527,276.65	-218,048.62
其中：股票投资收益	444,436.00	-364,989.65
基金投资收益	-	-
债券投资收益	1,082,840.65	116,654.05
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	30,286.98
3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列）	-583,276.74	1,048,021.51
4.汇兑收益（损失以"-"号填列）	-	-
5.其他收入（损失以"-"号填列）	28,778.09	14,222.41
减：二、费用	592,359.71	566,009.60
1.管理人报酬	335,446.77	297,832.14
2.托管费	69,884.78	62,048.37
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	7,053.43	25,236.89
5.利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	179,974.73	180,892.20
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）	1,103,006.85	1,280,622.28
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以"-"号填列）	1,103,006.85	1,280,622.28

6.1.3所有权益（基金净值）变动表

会计主体：申万菱信盛利强化配置混合型证券投资基金
本报告期：2013年1月1日至2013年6月6日

单位：人民币元

项目	基金转型前 2013年1月1日至2013年6月6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）	50,613,008.83	92,466.00	50,705,474.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,103,006.85	1,103,006.85
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）	18,063,630.09	360,037.78	18,423,667.87
其中：1.基金申购款	47,774,650.31	932,731.41	48,707,381.72
2.基金赎回款	-29,711,020.22	-572,693.63	-30,283,713.85
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）	-	-73,197.33	-73,197.33
五、期末所有者权益（基金净值）	68,676,638.92	1,482,313.30	70,158,952.22
	上年度可比期间 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（基金净值）	52,532,951.88	-1,870,101.31	50,662,850.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,280,622.28	1,280,622.28
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）	-1,080,615.26	21,071.53	-1,059,543.73
其中：1.基金申购款	13,241,649.27	-287,971.53	12,953,677.74
2.基金赎回款	-14,322,264.53	309,043.06	-14,013,221.47
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）	51,452,336.62	-568,407.50	50,883,929.12

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告从6.1.5至6.4.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：过振华，主管会计工作负责人：过振华，会计机构负责人：李霞甘

6.1.4报表附注

6.1.4.1 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（以下简称"本基金"）系由申万菱信盛利强化配置混合型证券投资基金（以下简称"原基金"）转型而来。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依照《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，存续期限不设。首次募集期间共募集了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。本基金基金合同于2013年6月6日生效。

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。

依据2013年6月7日中国证监会《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》（证监许可［2013］748号）核准，基金份额持有人大会决议生效，自2013年6月7日起，原《申万菱信盛利强化配置混合型证券投资基金基金合同》终止，《申万菱信沪深300指数增强型证券投资基金基金合同》生效，本基金正式更名为申万菱信沪深300指数增强型证券投资基金并开始按照新基金合同的规定进行运作。

根据《证券入民法和国证券投资基金法》和最新公布的《申万菱信沪深300指数增强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、资产支持证券及其他法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金资产配置比例为：基金的投资组合比例：本基金投资于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%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保证现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为：95%×沪深300指数收益率+1.5%（年化收益率，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2013年8月27日批准报出。

6.2.2 会计报表所编制基础

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》、本基金基金合同和中国证监会允许的财务报表附注6.2.4所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

6.2.4.1 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2013年06月07日至2013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2013年6月30日的财务状况以及2013年06月07日至2013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。

6.2.4.4 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，本基金采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.2.4.5 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。

6.2.4.6 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［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《证券投资基金税收政策的暂行规定》（财税字［1998］055号）规定：证券投资基金从证券市场中取得的收入，暂不征收营业税。

②对基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

③对基金取得的股票股息红利收入、企业债券利息收入、国债利息收入，由上市公司、债券发行企业在向基金派发股息红利、债券利息时代扣代缴个人所得税。自2013年1月1日起，对基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。暂不征收企业所得税。

④对证券投资基金从证券市场中取得的收入，暂不征收营业税、城市维护建设税、教育费附加等其他各项税费。

⑤对于证券投资基金从证券市场中取得的收入，除了国家有明确的税收优惠政策外，其他---

6.2.4.7 关联方关系

6.1.4.7.1 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

无。

6.2.4.7.2本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	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	基金管理人的股东、基金代销机构
三菱UFJ信托银行株式会所	基金管理人的股东

注：上述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.2.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.2.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.2.4.8.1.1股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	2013年1月1日-2013年6月6日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30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
申银万国证券	3,111,853.00	100.00%	17,153,949.95	100.00%

6.1.4.8.1.2应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	2013年1月1日-2013年6月6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
申银万国证券	2,814.23	100.00%	-	-
	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30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
申银万国证券	14,109.15	100.00%	14,109.15	100.00%

注：1.上述佣金按市场佣金率计算，以扣除向中国证券登记结算有限责任公司缴纳的证券交易经手费、证券交易监管费和证券结算风险基金后的净额列示。债券交易不计佣金。

②除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。

6.2.4.8.2关联方报酬

6.1.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	2013年1月1日-2013年6月6日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的