

2018年6月30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:二〇一八年七月十九日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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，并对其中的真实性、准确性、完整性承担责任。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2018年7月13日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告书由基金公司未经审计。

本报告期自2018年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金名称 申万菱信可转换债券型证券投资基金
基金代码 310518
交易代码 310518
基金运作方式 约定开放式
基金合同生效日 2011年12月9日
报告期末基金份额总额 38,367,765.90份

投资目标 在严格控制风险的前提下，通过利用利率差价套利和股票的折价，力争实现基金资产的增值。

基金资产配置 在严格控制风险的前提下，通过利用利率差价套利和股票的折价，力争实现基金资产的增值。

投资策略 在严格控制风险的前提下，通过利用利率差价套利和股票的折价，力争实现基金资产的增值。

业绩比较基准 50%×沪深300指数收益率+50%×中证国债指数收益率

净值比较基准 50%×沪深300指数收益率+50%×中证国债指数收益率+10%×中债总指数(全价)的收益

风险收益特征 中高风险、中高收益

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

		报告期	
		2018年4月1日-2018年6月30日	
1.本期已实现收益		-2,597,290.27	
2.本期利润		-3,205,771.40	
3.期初至报告期末基金累计净值		-0.0763	
4.期末基金资产净值		46,055,674.62	
5.期末基金份额净值		1.200	

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)期末可供分配利润为截至期末按摊余成本计算的基金未分配利润，余额以负债列示。

2)上本基金业绩指标已扣除了基金管理费、托管费和各项交易费用，但不包括持有人认购或申购基金的各项费用(例如：申购费、赎回费等)，计入认购或交易基金时各项费用后，实际收益水平将低于所列数字。

3.2 基金净值表现以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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)上本基金业绩指标已扣除了基金管理费、托管费和各项交易费用，但不包括持有人认购或申购基金的各项费用(例如：申购费、赎回费等)，计入认购或交易基金时各项费用后，实际收益水平将低于所列数字。

3.2.1 本基金报告期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(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -6.29% 0.64% -3.77% 0.47% -0.4% -2.48% 0.17%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

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)上本基金业绩指标已扣除了基金管理费、托管费和各项交易费用，但不包括持有人认购或申购基金的各项费用(例如：申购费、赎回费等)，计入认购或交易基金时各项费用后，实际收益水平将低于所列数字。

3.2.3 基金净值表现

3.2.1.1 本基金报告期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(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -4.5% 1.0% -4.0% 0.5% -0.4% -0.4% 0.5%

3.2.1.2 自基金合同生效以来基金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

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)上本基金业绩指标已扣除了基金管理费、托管费和各项交易费用，但不包括持有人认购或申购基金的各项费用(例如：申购费、赎回费等)，计入认购或交易基金时各项费用后，实际收益水平将低于所列数字。

3.2.2 基金净值表现以来基金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

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)上本基金业绩指标已扣除了基金管理费、托管费和各项交易费用，但不包括持有人认购或申购基金的各项费用(例如：申购费、赎回费等)，计入认购或交易基金时各项费用后，实际收益水平将低于所列数字。

3.2.3 基金净值表现

3.2.3.1 本基金报告期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(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -4.5% 1.0% -4.0% 0.5% -0.4% -0.4% 0.5%

3.2.3.2 自基金合同生效以来基金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

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)上本基金业绩指标已扣除了基金管理费、托管费和各项交易费用，但不包括持有人认购或申购基金的各项费用(例如：申购费、赎回费等)，计入认购或交易基金时各项费用后，实际收益水平将低于所列数字。

3.2.3.3 基金净值表现

3.2.3.4 本基金报告期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(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -4.5% 1.0% -4.0% 0.5% -0.4% -0.4% 0.5%

3.2.3.5 基金净值表现

3.2.3.6 本基金报告期基金份额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

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)上本基金业绩指标已扣除了基金管理费、托管费和各项交易费用，但不包括持有人认购或申购基金的各项费用(例如：申购费、赎回费等)，计入认购或交易基金时各项费用后，实际收益水平将低于所列数字。

3.2.3.7 基金净值表现

3.2.3.8 本基金报告期基金份额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

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)上本基金业绩指标已扣除了基金管理费、托管费和各项交易费用，但不包括持有人认购或申购基金的各项费用(例如：申购费、赎回费等)，计入认购或交易基金时各项费用后，实际收益水平将低于所列数字。

3.2.3.9 基金净值表现

3.2.3.10 本基金报告期基金份额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

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)上本基金业绩指标已扣除了基金管理费、托管费和各项交易费用，但不包括持有人认购或申购基金的各项费用(例如：申购费、赎回费等)，计入认购或交易基金时各项费用后，实际收益水平将低于所列数字。

3.2.3.11 基金净值表现

3.2.3.12 本基金报告期基金份额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

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)上本基金业绩指标已扣除了基金管理费、托管费和各项交易费用，但不包括持有人认购或申购基金的各项费用(例如：申购费、赎回费等)，计入认购或交易基金时各项费用后，实际收益水平将低于所列数字。

3.2.3.13 基金净值表现

3.2.3.14 本基金报告期基金份额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

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)上本基金业绩指标已扣除了基金管理费、托管费和各项交易费用，但不包括持有人认购或申购基金的各项费用(例如：申购费、赎回费等)，计入认购或交易基金时各项费用后，实际收益水平将低于所列数字。

3.2.3.15 基金净值表现

3.2.3.16 本基金报告期基金份额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

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)上本基金业绩指标已扣除了基金管理费、托管费和各项交易费用，但不包括持有人认购或申购基金的各项费用(例如：申购费、赎回费等)，计入认购或交易基金时各项费用后，实际收益水平将低于所列数字。

3.2.3.17 基金净值表现

3.2.3.18 本基金报告期基金份额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

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)上本基金业绩指标已扣除了基金管理费、托管费和各项交易费用，但不包括持有人认购或申购基金的各项费用(例如：申购费、赎回费等)，计入认购或交易基金时各项费用后，实际收益水平将低于所列数字。

3.2.3.19 基金净值表现

3.2.3.20 本基金报告期基金份额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

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)上本基金业绩指标已扣除了基金管理费、托管费和各项交易费用，但不包括持有人认购或申购基金的各项费用(例如：申购费、赎回费等)，计入认购或交易基金时各项费用后，实际收益水平将低于所列数字。

3.2.3.21 基金净值表现

3.2.3.22 本基金报告期基金份额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

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)上本基金业绩指标已扣除了基金管理费、托管费和各项交易费用，但不包括持有人认购或申购基金的各项费用(例如：申购费、赎回费等)，计入认购或交易基金时各项费用后，实际收益水平将低于所列数字。

3.2.3.23 基金净值表现

3.2.3.24 本基金报告期基金份额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

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)上本基金业绩指标已扣除了基金管理费、托管费和各项交易费用，但不包括持有人认购或申购基金的各项费用(例如：申购费、赎回费等)，计入认购或交易基金时各项费用后，实际收益水平将低于所列数字。

3.2.3.25 基金净值表现

3.2.3.26 本基金报告期基金份额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

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)上本基金业绩指标已扣除了基金管理费、托管费和各项交易费用，但不包括持有人认购或申购基金的各项费用(例如：申购费、赎回费等)，计入认购或交易基金时各项费用后，实际收益水平将低于所列数字。

3.2.3.27 基金净值表现

3.2.3.28 本基金报告期基金份额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

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)上本基金业绩指标已扣除了基金管理费、托管费和各项交易费用，但不包括持有人认购或申购基金的各项费用(例如：申购费、赎回费等)，计入认购或交易基金时各项费用后，实际收益水平将低于所列数字。

3.2.3.29 基金净值表现

3.2.3.30 本基金报告期基金份额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

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)上本基金业绩指标已扣除了基金管理费、托管费和各项交易费用，但不包括持有人认购或申购基金的各项费用(例如：申购费、赎回费等)，计入认购或交易基金时各项费用后，实际收益水平将低于所列数字。

3.2.3.31 基金净值表现

3.2.3.32 本基金报告期基金份额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

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)上本基金业绩指标已扣除了基金管理费、托管费和各项交易费用，但不包括持有人认购或申购基金的各项费用(例如：申购费、赎回费等)，计入认购或交易基金时各项费用后，实际收益水平将低于所列数字。

3.2.3.33 基金净值表现

3.2.3.34 本基金报告期基金份额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

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)上本基金业绩指标已扣除了基金管理费、托管费和各项交易费用，但不包括持有人认购或申购基金的各项费用(例如：申购费、赎回费等)，计入认购或交易基金时各项费用后，实际收益水平将低于所列数字。

3.2.3.35 基金净值表现

3.2.3.36 本基金报告期基金份额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

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