

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:二〇一三年一月二十二日

基金管理人的董事、监事及董事会秘书本基金不存在虚假记载、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2013年1月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告,确认不存在虚假记载、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。

本报告书内容财务数据经审计。

本报告期自2012年10月1日起至2012年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	申万菱信收益宝货币
基金主代码	310338
交易代码	310338
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年7月5日
报告期末基金份额总额	377,207,923.30份
投资目标	在力求基金资产安全和高流动性的基础上,追求稳定的高收益业绩基准的回报。
投资策略	本基金基于市场特征分析,平衡投资组合的流动性和收益性,以价值研究为基础,在深入分析和数量化分析方法,通过对短期金融工具的积极投资,在控制风险和保持流动性的基础上,追求稳定的当期收益。
业绩比较基准	银行活期存款利率(税后)
风险收益特征	低风险、高流动性和持续稳定收益。
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

主要财务指标	报告期(2012年10月1日-2012年12月31日)	单位:人民币元
1.本期已实现收益	1,411,129.27	
2.本期利润	1,411,129.27	
3.期初基金份额总额	377,207,923.30	

注: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,本期利润即本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,由于货币市场基金采用余收益法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本基金报告期基金净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率 率(①)	净值收益率 率(②)	业绩比较基准 收益率(③)	业绩比较基准收 益率(④)	①-③	②-④
过去三个月	0.795%	0.005%	0.088%	0.000%	0.7070%	0.0050%

注:本基金基金净值分为按日公布净值,按月精简净值。

3.2.2 本基金同日成立以来基金净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

申万菱信收益宝货币市场基金	累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势图
2006年7月7日至2012年12月31日	

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业 年限	说明
周鸣	本基金 基金经理	2009-6-25	-	11年 周鸣女士,清华大学工商管理硕士,自2001年从事金融工作,先后就职于天相投资顾问公司、太平人寿保险公司,太平养老保险有限公司;2009年加入本公司,现任申万菱信收益宝货币基金、申万菱信添益宝货币基金、申万菱信可转换债券基金。

注:任职日期和离任日期均指公司作出决定之日;证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》。

4.2 报告期内本基金运作情况说明

报告期内,基金管理人严格按照《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、勤勉尽责的原则管理运用基金资产,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;本基金资产与基本基金管理人资产之间不存在关联交易,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,任何基金经理持有人有利害的行为,并通过稳健经营、规范运作、规避风险,保护了基金经理持有人的合法权益。

本基金的过往业绩并不代表其未来表现。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。

本报告书内容财务数据经审计。

本报告期自2012年10月1日起至2012年12月31日止。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的 比例(%)
1	固定收益投资	55,038,171.83	14.46
2	买入返售金融资产	75,300,666.95	19.79
3	银行存款和结算备付金合计	214,123,680.49	56.27
4	其他各项资产	36,088,176.71	9.48
5	合计	380,550,695.98	100.00

注:任职日期和离任日期均指公司作出决定之日;证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》。

4.3 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金运作管理办法》,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、流程和手段分析和数量化分析方法,通过对短期金融工具的积极投资,在控制风险和保持流动性的基础上,追求稳定的当期收益。

4.4 报告期内本基金的关联交易

报告期内,本公司未发生与关联方的关联交易。

4.5 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金运作管理办法》,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、流程和手段分析和数量化分析方法,通过对短期金融工具的积极投资,在控制风险和保持流动性的基础上,追求稳定的当期收益。

4.6 报告期内本基金的关联交易

报告期内,本公司未发生与关联方的关联交易。

4.7 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金运作管理办法》,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、流程和手段分析和数量化分析方法,通过对短期金融工具的积极投资,在控制风险和保持流动性的基础上,追求稳定的当期收益。

4.8 报告期内本基金的关联交易

报告期内,本公司未发生与关联方的关联交易。

4.9 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金运作管理办法》,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、流程和手段分析和数量化分析方法,通过对短期金融工具的积极投资,在控制风险和保持流动性的基础上,追求稳定的当期收益。

4.10 报告期内本基金的关联交易

报告期内,本公司未发生与关联方的关联交易。

4.11 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金运作管理办法》,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、流程和手段分析和数量化分析方法,通过对短期金融工具的积极投资,在控制风险和保持流动性的基础上,追求稳定的当期收益。

4.12 报告期内本基金的关联交易

报告期内,本公司未发生与关联方的关联交易。

4.13 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金运作管理办法》,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、流程和手段分析和数量化分析方法,通过对短期金融工具的积极投资,在控制风险和保持流动性的基础上,追求稳定的当期收益。

4.14 报告期内本基金的关联交易

报告期内,本公司未发生与关联方的关联交易。

4.15 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金运作管理办法》,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、流程和手段分析和数量化分析方法,通过对短期金融工具的积极投资,在控制风险和保持流动性的基础上,追求稳定的当期收益。

4.16 报告期内本基金的关联交易

报告期内,本公司未发生与关联方的关联交易。

4.17 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金运作管理办法》,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、流程和手段分析和数量化分析方法,通过对短期金融工具的积极投资,在控制风险和保持流动性的基础上,追求稳定的当期收益。

4.18 报告期内本基金的关联交易

报告期内,本公司未发生与关联方的关联交易。

4.19 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金运作管理办法》,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、流程和手段分析和数量化分析方法,通过对短期金融工具的积极投资,在控制风险和保持流动性的基础上,追求稳定的当期收益。

4.20 报告期内本基金的关联交易

报告期内,本公司未发生与关联方的关联交易。

4.21 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金运作管理办法》,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、流程和手段分析和数量化分析方法,通过对短期金融工具的积极投资,在控制风险和保持流动性的基础上,追求稳定的当期收益。

4.22 报告期内本基金的关联交易

报告期内,本公司未发生与关联方的关联交易。

4.23 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金运作管理办法》,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、流程和手段分析和数量化分析方法,通过对短期金融工具的积极投资,在控制风险和保持流动性的基础上,追求稳定的当期收益。

4.24 报告期内本基金的关联交易

报告期内,本公司未发生与关联方的关联交易。

4.25 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金运作管理办法》,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、流程和手段分析和数量化分析方法,通过对短期金融工具的积极投资,在控制风险和保持流动性的基础上,追求稳定的当期收益。

4.26 报告期内本基金的关联交易

报告期内,本公司未发生与关联方的关联交易。

4.27 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金运作管理办法》,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、流程和手段分析和数量化分析方法,通过对短期金融工具的积极投资,在控制风险和保持流动性的基础上,追求稳定的当期收益。

4.28 报告期内本基金的关联交易

报告期内,本公司未发生与关联方的关联交易。

4.29 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金运作管理办法》,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、流程和手段分析和数量化分析方法,通过对短期金融工具的积极投资,在控制风险和保持流动性的基础上,追求稳定的当期收益。

4.30 报告期内本基金的关联交易

报告期内,本公司未发生与关联方的关联交易。

4.31 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金运作管理办法》,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、流程和手段分析和数量化分析方法,通过对短期金融工具的积极投资,在控制风险和保持流动性的基础上,追求稳定的当期收益。

4.32 报告期内本基金的关联交易

报告期内,本公司未发生与关联方的关联交易。

4.33 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金运作管理办法》,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、流程和手段分析和数量化分析方法,通过对短期金融工具的积极投资,在控制风险和保持流动性的基础上,追求稳定的当期收益。

4.34 报告期内本基金的关联交易

报告期内,本公司未发生与关联方的关联交易。

4.35 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金运作管理办法》,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、流程和手段分析和数量化分析方法,通过对短期金融工具的积极投资,在控制风险和保持流动性的基础上,追求稳定的