

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

§ 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2012年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 申万菱信量化小盘股票(LOF)

基金主代码 163110

交易代码 163110

基金运作方式 约定型开放式

基金合同生效日 2011年6月16日

报告期末基金份额总额 209,000,377.12份

投资目标 本基金采用数量化的方法精选个股，严格按照纪律执行，力争获取长期稳定的超越业绩比较基准的投资回报。

投资策略 基金坚持数量化的投资策略，专注于小盘股的投资。基金管理人基于国内股票市场的大量实证研究，专门开发了适合小盘股投资的数量化投资模式(简称“量化小盘投资模型”)，作为本基金投资的核心。本基金的股票选择方式都是基于该投资模型而定。这种完全基于模型的量化投资方法能够更加客观、公正而理性的去分析和筛选股票，并不受分析师的预测，极大的减少了投资者情绪的影响，从而能够保持投资策略的一致性与有效性。

业绩比较基准 90%×中证500指数收益率+10%×银行同业存款利率(税后)

风险收益特征 本基金是一只量化股票基金，属于较高预期风险和较高预期收益的证券投资品种，其风险收益特征从长期平均来看高于混合型基金、债券基金与货币市场基金。

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

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2012年10月1日-2012年12月31日)

1.本期已实现收益 -7,507,749.41

2.本期利润 319,240.97

3.加权平均基金份额本期利润 0.0014

4.期末基金资产净值 172,346,240.85

5.期末基金份额净值 0.825

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)上述基金业绩报酬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。

3)基金净值增长率代表本基金管理人对基金未来表现的预测，不代表任何收益。

4.2.2本报告期内以来以基金累计份额净值增长率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) 样本基准(%) ①-(③) ②-(④)

过去三个月 0.49% 1.45% 2.21% 1.30% -1.72% 0.15%

3.2.2本基金管理人以本期基金累计份额净值增长率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) 样本基准(%) ①-(③) ②-(④)

过去三个月 4.72% 1.25% 4.82% 1.26% -0.10% -0.01%

3.2.2.2本基金管理人以来以基金累计份额净值增长率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) 样本基准(%) ①-(③) ②-(④)

过去三个月 4.78% 1.27% 4.85% 1.28% -0.05% -0.01%

3.2.2.3本基金管理人以来以基金累计份额净值增长率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) 样本基准(%) ①-(③) ②-(④)

过去三个月 4.78% 1.27% 4.85% 1.28% -0.05% -0.01%

3.2.2.4本基金管理人以来以基金累计份额净值增长率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) 样本基准(%) ①-(③) ②-(④)

过去三个月 4.78% 1.27% 4.85% 1.28% -0.05% -0.01%

3.2.2.5本基金管理人以来以基金累计份额净值增长率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) 样本基准(%) ①-(③) ②-(④)

过去三个月 4.78% 1.27% 4.85% 1.28% -0.05% -0.01%

3.2.2.6本基金管理人以来以基金累计份额净值增长率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) 样本基准(%) ①-(③) ②-(④)

过去三个月 4.78% 1.27% 4.85% 1.28% -0.05% -0.01%

3.2.2.7本基金管理人以来以基金累计份额净值增长率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) 样本基准(%) ①-(③) ②-(④)

过去三个月 4.78% 1.27% 4.85% 1.28% -0.05% -0.01%

3.2.2.8本基金管理人以来以基金累计份额净值增长率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) 样本基准(%) ①-(③) ②-(④)

过去三个月 4.78% 1.27% 4.85% 1.28% -0.05% -0.01%

3.2.2.9本基金管理人以来以基金累计份额净值增长率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) 样本基准(%) ①-(③) ②-(④)

过去三个月 4.78% 1.27% 4.85% 1.28% -0.05% -0.01%

3.2.2.10本基金管理人以来以基金累计份额净值增长率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) 样本基准(%) ①-(③) ②-(④)

过去三个月 4.78% 1.27% 4.85% 1.28% -0.05% -0.01%

3.2.2.11本基金管理人以来以基金累计份额净值增长率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) 样本基准(%) ①-(③) ②-(④)

过去三个月 4.78% 1.27% 4.85% 1.28% -0.05% -0.01%

3.2.2.12本基金管理人以来以基金累计份额净值增长率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) 样本基准(%) ①-(③) ②-(④)

过去三个月 4.78% 1.27% 4.85% 1.28% -0.05% -0.01%

3.2.2.13本基金管理人以来以基金累计份额净值增长率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) 样本基准(%) ①-(③) ②-(④)

过去三个月 4.78% 1.27% 4.85% 1.28% -0.05% -0.01%

3.2.2.14本基金管理人以来以基金累计份额净值增长率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) 样本基准(%) ①-(③) ②-(④)

过去三个月 4.78% 1.27% 4.85% 1.28% -0.05% -0.01%

3.2.2.15本基金管理人以来以基金累计份额净值增长率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) 样本基准(%) ①-(③) ②-(④)

过去三个月 4.78% 1.27% 4.85% 1.28% -0.05% -0.01%

3.2.2.16本基金管理人以来以基金累计份额净值增长率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) 样本基准(%) ①-(③) ②-(④)

过去三个月 4.78% 1.27% 4.85% 1.28% -0.05% -0.01%

3.2.2.17本基金管理人以来以基金累计份额净值增长率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) 样本基准(%) ①-(③) ②-(④)

过去三个月 4.78% 1.27% 4.85% 1.28% -0.05% -0.01%

3.2.2.18本基金管理人以来以基金累计份额净值增长率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) 样本基准(%) ①-(③) ②-(④)

过去三个月 4.78% 1.27% 4.85% 1.28% -0.05% -0.01%

3.2.2.19本基金管理人以来以基金累计份额净值增长率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) 样本基准(%) ①-(③) ②-(④)

过去三个月 4.78% 1.27% 4.85% 1.28% -0.05% -0.01%

3.2.2.20本基金管理人以来以基金累计份额净值增长率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) 样本基准(%) ①-(③) ②-(④)

过去三个月 4.78% 1.27% 4.85% 1.28% -0.05% -0.01%

3.2.2.21本基金管理人以来以基金累计份额净值增长率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) 样本基准(%) ①-(③) ②-(④)

过去三个月 4.78% 1.27% 4.85% 1.28% -0.05% -0.01%

3.2.2.22本基金管理人以来以基金累计份额净值增长率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) 样本基准(%) ①-(③) ②-(④)

过去三个月 4.78% 1.27% 4.85% 1.28% -0.05% -0.01%

3.2.2.23本基金管理人以来以基金累计份额净值增长率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) 样本基准(%) ①-(③) ②-(④)

过去三个月 4.78% 1.27% 4.85% 1.28% -0.05% -0.01%

3.2.2.24本基金管理人以来以基金累计份额净值增长率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) 样本基准(%) ①-(③) ②-(④)

过去三个月 4.78% 1.27% 4.85% 1.28% -0.05% -0.01%

3.2.2.25本基金管理人以来以基金累计份额净值增长率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) 样本基准(%) ①-(③) ②-(④)

过去三个月 4.78% 1.27% 4.85% 1.28% -0.05% -0.01%

3.2.2.26本基金管理人以来以基金累计份额净值增长率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) 样本基准(%) ①-(③) ②-(④)

过去三个月 4.78% 1.27% 4.85% 1.28% -0.05% -0.01%

3.2.2.27本基金管理人以来以基金累计份额净值增长率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) 样本基准(%) ①-(③) ②-(④)

过去三个月 4.78% 1.27% 4.85% 1.28% -0.05