

# 申万菱信可转换债券债券型证券投资基金

## 2014 第四季度报告

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：二〇一五年一月二十日

§1 重要提示  
基金管理人、基金托管人及基金销售机构在本报告中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：二〇一五年一月二十日

§2 基金产品概况

基金简称	申万菱信可转债债券
基金代码	310818
交易代码	310818
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年12月9日
报告期末基金份额总额	79,499,252.71份

本基金重点投资于可转换公司债券品种，通过利用其兼具债券股票的特性，力争实现在控制基金资产下跌风险和保证投资组合流动性的基础上，为投资者获得超越业绩比较基准的增值收益。

本基金的投资策略为：在严格控制基金资产下跌风险和保证投资组合流动性的基础上，为投资者获得超越业绩比较基准的增值收益。

本基金的投资策略为：在严格控制基金资产下跌风险和保证投资组合流动性的基础上，为投资者获得超越业绩比较基准的增值收益。

### 3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2014年10月1日-2014年12月31日)
1.本期已实现收益	16,707,442.84
2.本期利润	33,972,823.50
3.加权平均基金份额本期利润	0.6513
4.期末基金资产净值	134,006,063.58
5.期末基金份额净值	1.682

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）扣除相关费用和税金后的余额。  
2.本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。  
3.上述基金业绩指标已扣除了基金的管理费、托管费和其他各项费用，但不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：申购费、赎回费、销售服务费），计入认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。

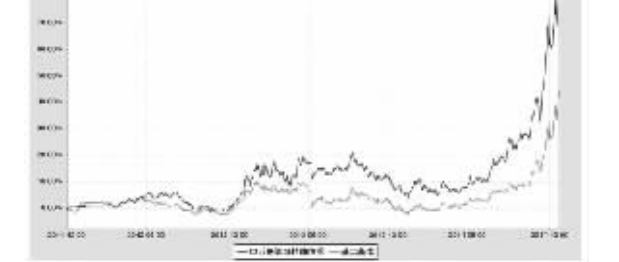
### 3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期末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	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	51.53%	2.14%	33.58%	1.46%	17.95%	0.68%

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

申万菱信可转债债券型证券投资基金  
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2011年12月9日至2014年12月31日)



### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名：张少华  
职务：基金经理  
任职日期：2014-3-13  
离任日期：-

张少华先生，复旦大学数量经济学博士，曾任招商银行总行金融市场部副经理，2008年加入申万菱信基金管理有限公司，曾任申万菱信可转债债券型证券投资基金基金经理，现任申万菱信可转债债券型证券投资基金基金经理。张少华先生具有多年证券从业经验，具备基金从业资格，并通过了基金从业资格考试。

### §4 管理人报告

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他相关法律法规，恪守诚信、勤勉、尽责的原则，为基金份额持有人谋求利益。报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他相关法律法规，恪守诚信、勤勉、尽责的原则，为基金份额持有人谋求利益。

### §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	权益投资	13,638,915.20	7.71
2	固定收益投资	150,764,380.09	85.21
3	其中：债券	150,764,380.09	85.21

5.2 报告期末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	411,000.00	0.31
D	电力、热力、燃气及生产和供应业	572,000.00	0.43
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	-	-
J	房地产业	-	-
K	金融业	7,676,800.00	5.73
L	房地产业	1,847,300.00	1.38
M	租赁和商务服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	教育、体育和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	合计	13,638,915.20	10.13

5.3 报告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

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	601988	中国银行	1,000,000	4,150,000.00	3.10
2	601318	中国平安	40,000	2,988,400.00	2.23
3	000024	招商局A	70,000	1,847,300.00	1.38
4	601989	中国重工	200,000	1,842,000.00	1.37
5	000425	徐工机械	86,160	1,289,815.20	0.96
6	600883	国际电力	50,000	572,000.00	0.43
7	600415	华夏银行	50,000	338,400.00	0.40
8	000983	西山煤电	50,000	411,000.00	0.31

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	10,015,000.00	7.47
4	企业债	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	1,407.94,380.09	10.53
8	其他	-	-
9	合计	150,764,380.09	112.51

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	10,015,000.00	7.47
4	企业债	-	-
5	企业短期融资券	-	-

5.6 报告期末按品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	10,015,000.00	7.47
4	企业债	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	1,407.94,380.09	10.53
8	其他	-	-
9	合计	150,764,380.09	112.51

5.7 报告期末按品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	10,015,000.00	7.47
4	企业债	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	1,407.94,380.09	10.53
8	其他	-	-
9	合计	150,764,380.09	112.51

5.8 报告期末按品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	10,015,000.00	7.47
4	企业债	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	1,407.94,380.09	10.53
8	其他	-	-
9	合计	150,764,380.09	112.51

5.9 报告期末按品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	10,015,000.00	7.47
4	企业债	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	1,407.94,380.09	10.53
8	其他	-	-
9	合计	150,764,380.09	112.51

5.10 报告期末按品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	10,015,000.00	7.47
4	企业债	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	1,407.94,380.09	10.53
8	其他	-	-
9	合计	150,764,380.09	112.51

5.11 报告期末按品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	10,015,000.00	7.47
4	企业债	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	1,407.94,380.09	10.53
8	其他	-	-
9	合计	150,764,380.09	112.51

5.12 报告期末按品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	10,015,000.00	7.47
4	企业债	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	1,407.94,380.09	10.53
8	其他	-	-
9	合计	150,764,380.09	112.51

5.13 报告期末按品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	10,015,000.00	7.47
4	企业债	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	1,407.94,380.09	10.53
8	其他	-	-
9	合计	150,764,380.09	112.51

5.14 报告期末按品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	10,015,000.00	7.47
4	企业债	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	1,407.94,380.09	10.53
8	其他	-	-
9	合计	150,764,380.09	112.51

5.15 报告期末按品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	10,015,000.00	7.47
4	企业债	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	1,407.94,380.09	10.53
8	其他	-	-
9	合计	150,764,380.09	112.51

5.16 报告期末按品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	10,015,000.00	7.47
4	企业债	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	1,407.94,380.09	10.53
8	其他	-	-
9	合计	150,764,380.09	112.51

5.17 报告期末按品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	10,015,000.00	7.47
4	企业债	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	1,407.94,380.09	10.53
8	其他	-	-
9	合计	150,764,380.09	112.51

5.18 报告期末按品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	10,015,000.00	7.47
4	企业债	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	1,407.94,380.09	10.53
8	其他	-	-
9	合计	150,764,380.09	112.51

5.19 报告期末按品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	10,015,000.00	7.47
4	企业债	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	1,407.94,380.09	10.53
8	其他	-	-
9	合计	150,764,380.09	112.51

5.20 报告期末按品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	10,015,000.00	7.47
4	企业债	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	1,407.94,380.09	10.53
8	其他	-	-
9	合计	150,764,380.09	112.51

5.21 报告期末按品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	10,015,000.00	7.47
4	企业债	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	1,407.94,380.09	10.53
8	其他	-	-
9	合计	150,764,380.09	112.51

5.22 报告期末按品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	10,015,000.00	7.47
4	企业债	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	1,407.94,380.09	10.53
8	其他	-	-
9	合计	150,764,380.09	112.51

5.23 报告期末按品种分类的债券投资组合

姓名	性别	任职日期	离任日期	业年限	教育背景
					张少华先生,复旦大学数量经济学硕士。曾任聚子