

信息披露 Disclosure

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
基金管理人和基金托管人保证本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性、完整性、及时性承担法律责任。
本基金由申万菱信基金管理有限公司于2015年1月16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，保证复核结果与原基金管理人复核的结果一致。
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。
基金管理人承兑以诚信为原则，履行基金合同规定的义务，保护基金份额持有人的合法权益。基金管理人承诺以诚信为原则，履行基金合同规定的义务，保护基金份额持有人的合法权益。
本报告期自2014年10月1日起至2014年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	申万菱信可转换债券
基金代码	310518
交易代码	310518
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年1月6日
报告期末基金份额总额	79,649,252.12份
投资目标	本基金重点投资于可转换债券品种，通过利用其兼具债券和股票的特性，力求在实现对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稳健收益。
投资策略	本基金的投资策略分两个层次，第一个层次是关于资产配置，主要是确定基金资产在股票、债券、现金等资产的配置比例；第二个层次是证券投资策略，即在股票资产中选择具有较好投资价值的债券型普通股进行投资。
业绩比较基准	天相转换债指数收益率×70%+沪深300指数收益率×10%+人民币存贷款基准利率×2%
风险收益特征	本基金为债券基金，属于证券投资基金中风险较低的品种，其预期平均风险水平将低于股票型基金，混合基金，高风险的货币基金。
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(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	33,072,823.50
3.加权平均基金份额本期利润	0.6513
4.期末基金份额净值	134,006,035.58

5.期末可供分配基金份额净值

6.期末基金资产净值

7.期末基金份额净值

8.期末可供分配基金份额净值

9.期末基金资产净值

10.期末基金份额净值

11.期末可供分配基金份额净值

12.期末基金份额净值

13.期末可供分配基金份额净值

14.期末可供分配基金份额净值

15.期末可供分配基金份额净值

16.期末可供分配基金份额净值

17.期末可供分配基金份额净值

18.期末可供分配基金份额净值

19.期末可供分配基金份额净值

20.期末可供分配基金份额净值

21.期末可供分配基金份额净值

22.期末可供分配基金份额净值

23.期末可供分配基金份额净值

24.期末可供分配基金份额净值

25.期末可供分配基金份额净值

26.期末可供分配基金份额净值

27.期末可供分配基金份额净值

28.期末可供分配基金份额净值

29.期末可供分配基金份额净值

30.期末可供分配基金份额净值

31.期末可供分配基金份额净值

32.期末可供分配基金份额净值

33.期末可供分配基金份额净值

34.期末可供分配基金份额净值

35.期末可供分配基金份额净值

36.期末可供分配基金份额净值

37.期末可供分配基金份额净值

38.期末可供分配基金份额净值

39.期末可供分配基金份额净值

40.期末可供分配基金份额净值

41.期末可供分配基金份额净值

42.期末可供分配基金份额净值

43.期末可供分配基金份额净值

44.期末可供分配基金份额净值

45.期末可供分配基金份额净值

46.期末可供分配基金份额净值

47.期末可供分配基金份额净值

48.期末可供分配基金份额净值

49.期末可供分配基金份额净值

50.期末可供分配基金份额净值

51.期末可供分配基金份额净值

52.期末可供分配基金份额净值

53.期末可供分配基金份额净值

54.期末可供分配基金份额净值

55.期末可供分配基金份额净值

56.期末可供分配基金份额净值

57.期末可供分配基金份额净值

58.期末可供分配基金份额净值

59.期末可供分配基金份额净值

60.期末可供分配基金份额净值

61.期末可供分配基金份额净值

62.期末可供分配基金份额净值

63.期末可供分配基金份额净值

64.期末可供分配基金份额净值

65.期末可供分配基金份额净值

66.期末可供分配基金份额净值

67.期末可供分配基金份额净值

68.期末可供分配基金份额净值

69.期末可供分配基金份额净值

70.期末可供分配基金份额净值

71.期末可供分配基金份额净值

72.期末可供分配基金份额净值

73.期末可供分配基金份额净值

74.期末可供分配基金份额净值

75.期末可供分配基金份额净值

76.期末可供分配基金份额净值

77.期末可供分配基金份额净值

78.期末可供分配基金份额净值

79.期末可供分配基金份额净值

80.期末可供分配基金份额净值

81.期末可供分配基金份额净值

82.期末可供分配基金份额净值

83.期末可供分配基金份额净值

84.期末可供分配基金份额净值

85.期末可供分配基金份额净值

86.期末可供分配基金份额净值

87.期末可供分配基金份额净值

88.期末可供分配基金份额净值

89.期末可供分配基金份额净值

90.期末可供分配基金份额净值

91.期末可供分配基金份额净值

92.期末可供分配基金份额净值

93.期末可供分配基金份额净值

94.期末可供分配基金份额净值

95.期末可供分配基金份额净值

96.期末可供分配基金份额净值

97.期末可供分配基金份额净值

98.期末可供分配基金份额净值

99.期末可供分配基金份额净值

100.期末可供分配基金份额净值

101.期末可供分配基金份额净值

102.期末可供分配基金份额净值

103.期末可供分配基金份额净值

104.期末可供分配基金份额净值

105.期末可供分配基金份额净值

106.期末可供分配基金份额净值

107.期末可供分配基金份额净值

108.期末可供分配基金份额净值

109.期末可供分配基金份额净值

110.期末可供分配基金份额净值

111.期末可供分配基金份额净值

112.期末可供分配基金份额净值

113.期末可供分配基金份额净值

114.期末可供分配基金份额净值

115.期末可供分配基金份额净值

116.期末可供分配基金份额净值

117.期末可供分配基金份额净值

118.期末可供分配基金份额净值

119.期末可供分配基金份额净值

120.期末可供分配基金份额净值

121.期末可供分配基金份额净值

122.期末可供分配基金份额净值

123.期末可供分配基金份额净值

124.期末可供分配基金份额净值

125.期末可供分配基金份额净值

126.期末可供分配基金份额净值

127.期末可供分配基金份额净值

128.期末可供分配基金份额净值

129.期末可供分配基金份额净值

130.期末可供分配基金份额净值

131.期末可供分配基金份额净值

132.期末可供分配基金份额净值

133.期末可供分配基金份额净值

134.期末可供分配基金份额净值

135.期末可供分配基金份额净值

136.期末可供分配基金份额净值

137.期末可供分配基金份额净值

138.期末可供分配基金份额净值

139.期末可供分配基金份额净值

140.期末可供分配基金份额净值

141.期末可供分配基金份额净值

142.期末可供分配基金份额净值

143.期末可供分配基金份额净值

144.期末可供分配基金份额净值

145.期末可供分配基金份额净值

146.期末可供分配基金份额净值

147.期末可供分配基金份额净值

148.期末可供分配基金份额净值

149.期末可供分配基金份额净值

150.期末可供分配基金份额净值

151.期末可供分配基金份额净值

152.期末可供分配基金份额净值

153.期末可供分配基金份额净值

154.期末可供分配基金份额净值