

## 申万菱信可转换债券债券型证券投资基金

## [2015] 第二季度报告

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:二〇一五年七月二日

基金管理人和基金托管人承诺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、完整性和及时性承担个别法律责任。

基金托管人和中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2015年7月15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2015年4月1日起至2015年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	契约型开放式
基金合同生效日	2014年12月9日
报告期末基金份额总额	69,422,564.61份

投资目标 本基金主要投资于可转换债券品种，通过利用其债券性和股票性的特性，力争实现对本基金净值的稳健收益。

本基金的资产配置分三个层次，第一个层次是大类资产配置，主要是对底层基金资产的债券、股票、现金等资产的配置；第二个层次是中层资产配置，通过与转换债券的种类选择；第三个层次是底层资产配置，即对债券品种的选择。

投资策略 本基金在充分考虑可转换债券品种的信用风险、利率风险、流动性风险、操作风险的基础上，通过分析可转换债券品种的信用风险、利率风险、流动性风险、操作风险，在对可转换债券品种的信用风险、利率风险、流动性风险、操作风险进行分析的基础上，选择具有较高流动性的品种进行投资。

业绩比较基准 天相可转换债券指数收益率×70%+沪深300指数收益率×10%+恒生指数(金价)×收益占比20%

风险收益特征 本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的低风险品种。其预期风险和预期收益水平均低于股票型基金，高于货币市场基金，但由于本基金管理人对债券品种的精选，预期收益水平将高于货币市场基金。

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(2015年4月1日-2015年6月30日)
1.本期已实现收益	16,487,832.33
2.本期利润	-7,210,765.64
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1115
4.期末基金份额净值	133,036,530.86

5.期末基金净值收益率 1.916%

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平均基金份额本期利润。

2)基金的过往业绩并不代表其未来表现。基金管理人承诺不以任何形式承诺收益，投资人认购或交易基金的各项费用(例如申购、赎回、转换等)由投资人自行承担，实际收益水平将低于所列数字。

3)基金净值表现

3.1 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(2015年4月1日-2015年6月30日)
1.本期已实现收益	16,487,832.33
2.本期利润	-7,210,765.64
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1115
4.期末基金份额净值	133,036,530.86

5.期末基金净值收益率 1.916%

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平均基金份额本期利润。

2)基金的过往业绩并不代表其未来表现。基金管理人承诺不以任何形式承诺收益，投资人认购或交易基金的各项费用(例如申购、赎回、转换等)由投资人自行承担，实际收益水平将低于所列数字。

3)基金净值表现

3.21 报告期基金份额净值增长率变化率与业绩比较基准的比较

单位:百分比(%)

阶段	净值增长/净值降低率	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率变化率	①-③	②-④
过去三个月	10.69%	3.77%	-5.16%	2.87%	15.80%

3.22 报告期基金份额净值增长率变化率与业绩比较基准的历史走势对比

(2011年12月9日至2015年6月30日)

3.23 管理人报告

4.1 管理人报告

4.1.1 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间 证券从业年限 说明

叶玲玲 基金经理 2013-7-30 - 10年 申万菱信基金管理有限公司

注:1)任本基金基金经理期间一般情况指公司作出决定之日;任本基金基金经理基金合同生效日起任职,则任任职日期为基金合同生效日。

2)任职期间的含义指从基金合同生效之日起至基金经理离任之日止。

3)基金管理人和基金托管人根据各自职责对本基金定期报告、中期报告、年度报告、基金清算报告等基金信息披露文件进行复核和审查。

4)本基金的基金经理在任职期间内未发生过离职、被辞退或被免职、辞职、被解聘、被开除等情形。

5)本基金的基金经理在任职期间内未发生过因违法违规行为被监管机构处罚的情形。

6)本基金的基金经理在任职期间内未发生过因基金合同纠纷被仲裁委员会裁决的情形。

7)本基金的基金经理在任职期间内未发生过因基金合同纠纷被法院判决的情形。

8)本基金的基金经理在任职期间内未发生过因基金合同纠纷被行政监管部门处罚的情形。

9)本基金的基金经理在任职期间内未发生过因基金合同纠纷被中国证监会立案调查的情形。

10)本基金的基金经理在任职期间内未发生过因基金合同纠纷被中国证监会行政处罚的情形。

11)本基金的基金经理在任职期间内未发生过因基金合同纠纷被司法机关追究刑事责任的情形。

12)本基金的基金经理在任职期间内未发生过因基金合同纠纷被中国证监会采取行政监管措施的情形。

13)本基金的基金经理在任职期间内未发生过因基金合同纠纷被中国证监会采取公开谴责或认定为不适当人选的情形。

14)本基金的基金经理在任职期间内未发生过因基金合同纠纷被中国证监会撤销基金从业资格的情形。

15)本基金的基金经理在任职期间内未发生过因基金合同纠纷被中国证监会认定为不适当人选的情形。

16)本基金的基金经理在任职期间内未发生过因基金合同纠纷被中国证监会认定为不适当人选的情形。

17)本基金的基金经理在任职期间内未发生过因基金合同纠纷被中国证监会认定为不适当人选的情形。

18)本基金的基金经理在任职期间内未发生过因基金合同纠纷被中国证监会认定为不适当人选的情形。

19)本基金的基金经理在任职期间内未发生过因基金合同纠纷被中国证监会认定为不适当人选的情形。

20)本基金的基金经理在任职期间内未发生过因基金合同纠纷被中国证监会认定为不适当人选的情形。

21)本基金的基金经理在任职期间内未发生过因基金合同纠纷被中国证监会认定为不适当人选的情形。

22)本基金的基金经理在任职期间内未发生过因基金合同纠纷被中国证监会认定为不适当人选的情形。

23)本基金的基金经理在任职期间内未发生过因基金合同纠纷被中国证监会认定为不适当人选的情形。

24)本基金的基金经理在任职期间内未发生过因基金合同纠纷被中国证监会认定为不适当人选的情形。

25)本基金的基金经理在任职期间内未发生过因基金合同纠纷被中国证监会认定为不适当人选的情形。

26)本基金的基金经理在任职期间内未发生过因基金合同纠纷被中国证监会认定为不适当人选的情形。

27)本基金的基金经理在任职期间内未发生过因基金合同纠纷被中国证监会认定为不适当人选的情形。

28)本基金的基金经理在任职期间内未发生过因基金合同纠纷被中国证监会认定为不适当人选的情形。

29)本基金的基金经理在任职期间内未发生过因基金合同纠纷被中国证监会认定为不适当人选的情形。

30)本基金的基金经理在任职期间内未发生过因基金合同纠纷被中国证监会认定为不适当人选的情形。

31)本基金的基金经理在任职期间内未发生过因基金合同纠纷被中国证监会认定为不适当人选的情形。

32)本基金的基金经理在任职期间内未发生过因基金合同纠纷被中国证监会认定为不适当人选的情形。

33)本基金的基金经理在任职期间内未发生过因基金合同纠纷被中国证监会认定为不适当人选的情形。

34)本基金的基金经理在任职期间内未发生过因基金合同纠纷被中国证监会认定为不适当人选的情形。

35)本基金的基金经理在任职期间内未发生过因基金合同纠纷被中国证监会认定为不适当人选的情形。

36)本基金的基金经理在任职期间内未发生过因基金合同纠纷被中国证监会认定为不适当人选的情形。

37)本基金的基金经理在任职期间内未发生过因基金合同纠纷被中国证监会认定为不适当人选的情形。

38)本基金的基金经理在任职期间内未发生过因基金合同纠纷被中国证监会认定为不适当人选的情形。

39)本基金的基金经理在任职期间内未发生过因基金合同纠纷被中国证监会认定为不适当人选的情形。

40)本基金的基金经理在任职期间内未发生过因基金合同纠纷被中国证监会认定为不适当人选的情形。

41)本基金的基金经理在任职期间内未发生过因基金合同纠纷被中国证监会认定为不适当人选的情形。

42)本基金的基金经理在任职期间内未发生过因基金合同纠纷被中国证监会认定为不适当人选的情形。

43)本基金的基金经理在任职期间内未发生过因基金合同纠纷被中国证监会认定为不适当人选的情形。

44)本基金的基金经理在任职期间内未发生过因基金合同纠纷被中国证监会认定为不适当人选的情形。

45)本基金的基金经理在任职期间内未发生过因基金合同纠纷被中国证监会认定为不适当人选的情形。

46)本基金的基金经理在任职期间内未发生过因基金合同纠纷被中国证监会认定为不适当人选的情形。

47)本基金的基金经理在任职期间内未发生过因基金合同纠纷被中国证监会认定为不适当人选的情形。

48)本基金的基金经理在任职期间内未发生过因基金合同纠纷被中国证监会认定为不适当人选的情形。

49)本基金的基金经理在任职期间内未发生过因基金合同纠纷被中国证监会认定为不适当人选的情形。

50)本基金的基金经理在任职期间内未发生过因基金合同纠纷被中国证监会认定为不适当人选的情形。

51)本基金的基金经理在任职期间内未发生过因基金合同纠纷被中国证监会认定为不适当人选的情形。

52)本基金的基金经理在任职期间内未发生过因基金合同纠纷被中国证监会认定为不适当人选的情形。

53)本基金的基金经理在任职期间内未发生过因基金合同纠纷被中国证监会认定为不适当人选的情形。

54)本基金的基金经理在任职期间内未发生过因基金合同纠纷被中国证监会认定为不适当人选的情形。

55)本基金的基金经理在任职期间内未发生过因基金合同纠纷被中国证监会认定为不适当人选的情形。

56)本基金的基金经理在任职期间内未发生过因基金合同纠纷被中国证监会认定为不适当人选的情形。

57)本基金的基金经理在任职期间内未发生过因基金合同纠纷被中国证监会认定为不适当人选的情形。

58)本基金的基金经理在任职期间内未发生过因基金合同纠纷被中国证监会认定为不适当人选的情形。

59)本基金的基金经理在任职期间内未发生过因基金合同纠纷被中国证监会认定为不适当人选的情形。

60)本基金的基金经理在任职期间内未发生过因基金合同纠纷被中国证监会认定为不适当人选的情形。

61)本基金的基金经理在任职期间内未发生过因基金合同纠纷被中国证监会认定为不适当人选的情形。

62)本基金的基金经理在任职期间内未发生过因基金合同纠纷被中国证监会认定为不适当人选的情形。

63)本基金的基金经理在任职期间内未发生过因基金合同纠纷被中国证监会认定为不适当人选的情形。

64)本基金的基金经理在任职期间内未发生过因基金合同纠纷被中国证监会认定为不适当人选的情形。

65)本基金的基金经理在任职期间内未发生过因基金合同纠纷被中国证监会认定为不适当人选的情形。

66)本基金的基金经理在任职期间内未发生过因基金合同纠纷被中国证监会认定为不适当人选的情形。

67)本基金的基金经理在任职期间内未发生过因基金合同纠纷被中国证监会认定为不适当人选的情形。

68)本基金的基金经理在任职期间内未发生过因基金合同纠纷被中国证监会认定为不适当人选的情形。