

申万菱信中证申万电子行业投资指数分级证券投资基金

[2015]第三季度报告

基金管理人：申万菱信基金管理有限公司
基金托管人：广发银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一五年十月二十四日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及监事会对本基金所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其中的内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人广发银行股份有限公司根据本基金合同的约定保管本公司的基金资产，办理基金财产清算事宜，履行本基金合同规定的其他义务，但不对本基金一定盈亏。

基金的运作并不表示未来表现，投资有风险，投资者在作投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务数据未经审计。

本基金于2010年1月1日起至2015年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 申万菱信中申万电子行业投资指数分级

场内简称 申万电子

基金主要代码 163116

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2015年9月14日

报告期末基金份额总额 4,461,410,192.36份

基金管理人 申万菱信基金管理有限公司

基金托管人 广发银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称 申万电子A 申万电子B

下属分级基金的交易代码 163116 160231

报告期末下属分级基金的份额总额 202,568,713.36份 76,029,736.00份

报告期末下属分级基金的风险等级 中低风险 中低风险

基金经理的姓名及性别 申万华生（男） 电子A 电子B

报告期末基金资产净值 309,773,946.37

单位：人民币元

报告期(2015年7月1日-2015年9月30日) 指定期间(2015年7月1日-2015年9月30日)

1.本期已实现收益 -146,308,506.13 13,120,905.79

2.本期利润 -109,229,168.02 -68,564,256.41

3.期末平均基金份额利润率 -0.15%49

4.期末基金资产净值 306,812,504.75

5.期末基金份额净值 0.9873

注：1)本期已实现收益指基金本期利息收入、存款利息收入、债券利息收入、股息红利收入、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为期初至报告期末的累计利润，即以前述各项收入扣除非经常性损益后的金额，但不包括持有人认购或交易基金的的各项费用(例如：申购费、赎回费、转换费等)；2)上述基金业绩指标已扣除基金管理费、托管费和各项交易费用，但不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如：申购费、赎回费、转换费等)；3)期末平均基金份额利润率=本期利润/期末基金资产净值；4)期末基金资产净值=期末基金资产总额-所有负债总额；5)期末基金份额净值=期末基金资产净值/期末基金份额总额。

3.3 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2015年7月1日-2015年9月30日) 指定期间(2015年7月1日-2015年9月30日)

1.本期已实现收益 -146,308,506.13 13,120,905.79

2.本期利润 -109,229,168.02 -68,564,256.41

3.期末平均基金份额利润率 -0.15%49

4.期末基金资产净值 306,812,504.75

5.期末基金份额净值 0.9873

注：1)本期已实现收益指基金本期利息收入、存款利息收入、债券利息收入、股息红利收入、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为期初至报告期末的累计利润，即以前述各项收入扣除非经常性损益后的金额，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、转换费等)；2)上述基金业绩指标已扣除基金管理费、托管费和各项交易费用，但不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如：申购费、赎回费、转换费等)；3)期末平均基金份额利润率=本期利润/期末基金资产净值；4)期末基金资产净值=期末基金资产总额-所有负债总额；5)期末基金份额净值=期末基金资产净值/期末基金份额总额。

3.2.2 本基金合同生效以来基金累计份额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

本基金对不同类别份额分别计算，定期披露各份额的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比情况

注：1)自基金合同生效以来，本基金未作一年。

2)本基金的累计份额净值增长率是指以每份基金单位为基准计算的，包括了申购、赎回、基金转换、资产支持证券以及法律法规允许的其他收入等所有利得或损失后，扣除相关费用后的累计增长幅度。

3)本基金的业绩比较基准是中证申万电子行业投资指数，该指数由中证指数有限公司编制并发布，该指数的成分股由申万菱信基金管理有限公司根据指数编制规则筛选确定，该指数的成分股构成随指数编制规则的变化而调整。

4)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

5)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

6)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

7)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

8)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

9)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

10)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

11)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

12)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

13)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

14)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

15)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

16)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

17)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

18)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

19)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

20)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

21)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

22)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

23)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

24)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

25)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

26)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

27)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

28)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

29)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

30)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

31)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

32)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

33)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

34)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

35)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

36)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

37)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

38)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

39)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

40)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

41)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

42)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

43)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

44)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

45)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

46)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

47)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

48)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

49)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

50)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

51)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

52)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

53)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

54)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

55)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

56)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

57)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

58)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

59)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

60)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

61)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

62)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

63)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

64)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

65)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

66)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

67)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

68)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

69)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

70)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

71)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

72)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

73)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

74)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

75)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

76)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

77)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

78)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

79)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%

80)本基金的业绩基准=中证申万电子行业投资指数×4.5%+银行同业存款利率×5.5%