

申万菱信添益宝债券型证券投资基金

[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:中国工商银行股份有限公司

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2015年10月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、基金净值表现、申购赎回价格、基金投资组合报告、基金净值表现、风险揭示、投资风险、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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称 申万菱信添益宝债券基金

基金主代码 310378

基金运作方式 灵活型开放式

基金合同生效日 2009年12月4日

报告期末基金份额总额 1,872,833,127.26份

报告目标 在控制风险和保持资产流动性的前提下，追求稳定的当期收入和总回报。

在大类资产的配置上，本基金将密切关注经济与市场运行趋势的综合分析，决定资产配置、转换、申购、赎回等投资操作，通过资产配置、转换、申购、赎回等操作，调整资产配置比例，降低风险。

本基金通过行业并不表示未来表现，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。

报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§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)

申万菱信添益宝债券基金

申万菱信添益宝债券基金

1.本期初次收入 6,131,500.00 -105,886.07

2.本期利润 7,159,623.67 -640,000.75

3.本期平均基金份额利润 0.0707 -0.0156

4.期末基金资产净值 2,100,977,296.93 47,765,162.63

5.期末基金份额净值 1.147 1.163

注:1.本期利润为收入减去必要的费用后的余额(不包含任何应付变动管理费、托管费和除非特别约定外的费用,不包括持有人认购或交易基金的各项费用)(例如赎回费、申购费、赎回费、认购费等)。

2.上述基金业绩指标不扣除“基金的管理费、托管费和各项交易费用,不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如赎回费、申购费、赎回费、认购费等),不计认申购交易基金各笔费用)。

3.基金费用表现。

3.2.1 报告期基金份额净值增长率为及与其同期业绩比较基准收益率的比较

1.申万菱信添益宝债券A: -1.21% 0.21% 1.21% 0.08% -2.52% 0.13%

2.申万菱信添益宝债券B: -0.21% 0.07% 0.07% 0.07% -0.15% 0.02%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势图对比如图(2008年1月4日至2015年9月30日)

1.申万菱信添益宝债券A:



2.申万菱信添益宝债券B:



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

叶伟俊 本基金基金经理 2013-07-30 - 10年

叶伟俊女士,法格尼洛布勒第二大学硕士,2006年加入申万菱信基金管理有限公司,历任风险管理部风险管理专员,风险管理部风险管理专员,风险管理部风险管理专员,申万菱信基金管理有限公司基金经理。

任万菱信添益宝债券型基金基金经理,申万菱信信用债券型基金基金经理,申万菱信货币市场基金基金经理。

2015年1月1日起至报告期末,叶伟俊女士未担任本基金基金经理。

4.1.2 管理人对报告期内基金运作的总体评价

根据《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》,本公司制定了《公平交易制度》,通过组织结构的设置、工作流程、交易规则和全面实行公平交易的原则,保证基金在投资决策、交易执行、业绩评估等环节中公平对待所有投资对象,避免不公平交易行为,并进行绩效评价、合规性监督、规范运作,保障基金持有人的合法权益。

4.1.3 管理人对报告期内基金投资策略的说明

根据《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》,本公司制定了《公平交易制度》,通过组织结构的设置、工作流程、交易规则和全面实行公平交易的原则,保证基金在投资决策、交易执行、业绩评估等环节中公平对待所有投资对象,避免不公平交易行为,并进行绩效评价、合规性监督、规范运作,保障基金持有人的合法权益。

4.1.4 管理人对报告期内基金业绩表现的评价

根据《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》,本公司制定了《公平交易制度》,通过组织结构的设置、工作流程、交易规则和全面实行公平交易的原则,保证基金在投资决策、交易执行、业绩评估等环节中公平对待所有投资对象,避免不公平交易行为,并进行绩效评价、合规性监督、规范运作,保障基金持有人的合法权益。

4.1.5 管理人对报告期内基金投资策略的说明

根据《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》,本公司制定了《公平交易制度》,通过组织结构的设置、工作流程、交易规则和全面实行公平交易的原则,保证基金在投资决策、交易执行、业绩评估等环节中公平对待所有投资对象,避免不公平交易行为,并进行绩效评价、合规性监督、规范运作,保障基金持有人的合法权益。

4.1.6 管理人对报告期内基金业绩表现的评价

根据《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》,本公司制定了《公平交易制度》,通过组织结构的设置、工作流程、交易规则和全面实行公平交易的原则,保证基金在投资决策、交易执行、业绩评估等环节中公平对待所有投资对象,避免不公平交易行为,并进行绩效评价、合规性监督、规范运作,保障基金持有人的合法权益。

4.1.7 管理人对报告期内基金投资策略的说明

根据《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》,本公司制定了《公平交易制度》,通过组织结构的设置、工作流程、交易规则和全面实行公平交易的原则,保证基金在投资决策、交易执行、业绩评估等环节中公平对待所有投资对象,避免不公平交易行为,并进行绩效评价、合规性监督、规范运作,保障基金持有人的合法权益。

4.1.8 管理人对报告期内基金业绩表现的评价

根据《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》,本公司制定了《公平交易制度》,通过组织结构的设置、工作流程、交易规则和全面实行公平交易的原则,保证基金在投资决策、交易执行、业绩评估等环节中公平对待所有投资对象,避免不公平交易行为,并进行绩效评价、合规性监督、规范运作,保障基金持有人的合法权益。

4.1.9 管理人对报告期内基金投资策略的说明

根据《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》,本公司制定了《公平交易制度》,通过组织结构的设置、工作流程、交易规则和全面实行公平交易的原则,保证基金在投资决策、交易执行、业绩评估等环节中公平对待所有投资对象,避免不公平交易行为,并进行绩效评价、合规性监督、规范运作,保障基金持有人的合法权益。

4.1.10 管理人对报告期内基金业绩表现的评价

根据《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》,本公司制定了《公平交易制度》,通过组织结构的设置、工作流程、交易规则和全面实行公平交易的原则,保证基金在投资决策、交易执行、业绩评估等环节中公平对待所有投资对象,避免不公平交易行为,并进行绩效评价、合规性监督、规范运作,保障基金持有人的合法权益。

4.1.11 管理人对报告期内基金投资策略的说明

根据《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》,本公司制定了《公平交易制度》,通过组织结构的设置、工作流程、交易规则和全面实行公平交易的原则,保证基金在投资决策、交易执行、业绩评估等环节中公平对待所有投资对象,避免不公平交易行为,并进行绩效评价、合规性监督、规范运作,保障基金持有人的合法权益。

4.1.12 管理人对报告期内基金业绩表现的评价

根据《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》,本公司制定了《公平交易制度》,通过组织结构的设置、工作流程、交易规则和全面实行公平交易的原则,保证基金在投资决策、交易执行、业绩评估等环节中公平对待所有投资对象,避免不公平交易行为,并进行绩效评价、合规性监督、规范运作,保障基金持有人的合法权益。

4.1.13 管理人对报告期内基金投资策略的说明

根据《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》,本公司制定了《公平交易制度》,通过组织结构的设置、工作流程、交易规则和全面实行公平交易的原则,保证基金在投资决策、交易执行、业绩评估等环节中公平对待所有投资对象,避免不公平交易行为,并进行绩效评价、合规性监督、规范运作,保障基金持有人的合法权益。

4.1.14 管理人对报告期内基金业绩表现的评价

根据《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》,本公司制定了《公平交易制度》,通过组织结构的设置、工作流程、交易规则和全面实行公平交易的原则,保证基金在投资决策、交易执行、业绩评估等环节中公平对待所有投资对象,避免不公平交易行为,并进行绩效评价、合规性监督、规范运作,保障基金持有人的合法权益。

4.1.15 管理人对报告期内基金投资策略的说明

根据《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》,本公司制定了《公平交易制度》,通过组织结构的设置、工作流程、交易规则和全面实行公平交易的原则,保证基金在投资决策、交易执行、业绩评估等环节中公平对待所有投资对象,避免不公平交易行为,并进行绩效评价、合规性监督、规范运作,保障基金持有人的合法权益。

4.1.16 管理人对报告期内基金业绩表现的评价

根据《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》,本公司制定了《公平交易制度》,通过组织结构的设置、工作流程、交易规则和全面实行公平交易的原则,保证基金在投资决策、交易执行、业绩评估等环节中公平对待所有投资对象,避免不公平交易行为,并进行绩效评价、合规性监督、规范运作,保障基金持有人的合法权益。

4.1.17 管理人对报告期内基金投资策略的说明

根据《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》,本公司制定了《公平交易制度》,通过组织结构的设置、工作流程、交易规则和全面实行公平交易的原则,保证基金在投资决策、交易执行、业绩评估等环节中公平对待所有投资对象,避免不公平交易行为,并进行绩效评价、合规性监督、规范运作,保障基金持有人的合法权益。

4.1.18 管理人对报告期内基金业绩表现的评价

根据《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》,本公司制定了《公平交易制度》,通过组织结构的设置、工作流程、交易规则和全面实行公平交易的原则,保证基金在投资决策、交易执行、业绩评估等环节中公平对待所有投资对象,避免不公平交易行为,并进行绩效评价、合规性监督、规范运作,保障基金持有人的合法权益。

4.1.19 管理人对报告期内基金投资策略的说明

根据《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》,本公司制定了《公平交易制度》,通过组织结构的设置、工作流程、交易规则和全面实行公平交易的原则,保证基金在投资决策、交易执行、业绩评估等环节中公平对待所有投资对象,避免不公平交易行为,并进行绩效评价、合规性监督、规范运作,保障基金持有人的合法权益。

4.1.20 管理人对报告期内基金业绩表现的评价

根据《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》,本公司制定了《公平交易制度》,通过组织结构的设置、工作流程、交易规则和全面实行公平交易的原则,保证基金在投资决策、交易执行、业绩评估等环节中公平对待所有投资对象,避免不公平交易行为,并进行绩效评价、合规性监督、规范运作,保障基金持有人的合法权益。

4.1.21 管理人对报告期内基金投资策略的说明

根据《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》,本公司制定了《公平交易制度》,通过组织结构的设置、工作流程、交易规则和全面实行公平交易的原则,保证基金在投资决策、交易执行、业绩评估等环节中公平对待所有投资对象,避免不公平交易行为,并进行绩效评价、合规性监督、规范运作,保障基金持有人的合法权益。

4.1.22 管理人对报告期内基金业绩表现的评价

根据《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》,本公司制定了《公平交易制度》,通过组织结构的设置、工作流程、交易规则和全面实行公平交易的原则,保证基金在投资决策、交易执行、业绩评估等环节中公平对待所有投资对象,避免不公平交易行为,并进行绩效评价、合规性监督、规范运作,保障基金持有人的合法权益。

4.1.23 管理人对报告期内基金投资策略的说明

根据《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》,本公司制定了《公平交易制度》,通过组织结构的设置、工作流程、交易规则和全面实行公平交易的原则,保证基金在投资决策、交易执行、业绩评估等环节中公平对待所有投资对象,避免不公平交易行为,并进行绩效评价、合规性监督、规范运作,保障基金持有人的合法权益。

4.1.24 管理人对报告期内基金业绩表现的评价

根据《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》,本公司制定了《公平交易制度》,通过组织结构的设置、工作流程、交易规则和全面实行公平交易的原则,保证基金在投资决策、交易执行、业绩评估等环节中公平对待所有投资对象,避免不公平交易行为,并进行绩效评价、合规性监督、规范运作,保障基金持有人的合法权益。

4.1.25 管理人对报告期内基金投资策略的说明

根据《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》,本公司制定了《公平交易制度》,通过组织结构的设置、工作流程、交易规则和全面实行公平交易的原则,保证基金在投资决策、交易执行、业绩评估等环节中公平对待所有投资对象,避免不公平交易行为,并进行绩效评价、合规性监督、规范运作,保障基金持有人的合法权益。

4.1.26 管理人对报告期内基金业绩表现的评价

根据《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》,本公司制定了《公平交易制度》,通过组织结构的设置、工作流程、交易规则和全面实行公平交易的原则,保证基金在投资决策、交易执行、业绩评估等环节中公平对待所有投资对象,避免不公平交易行为,并进行绩效评价、合规性监督、规范运作,保障基金持有人的合法权益。

4.1.27 管理人对报告期内基金投资策略的说明

根据《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》,本公司制定了《公平交易制度》,通过组织结构的设置、工作流程、交易规则和全面实行公平交易的原则,保证基金在投资决策、交易执行、业绩评估等环节中公平对待所有投资对象,避免不公平交易行为,并进行绩效评价、合规性监督、规范运作,保障基金持有人的合法权益。

4.1.28 管理人对报告期内基金业绩表现的评价

根据《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》,本公司制定了《公平交易制度》,通过组织结构的设置、工作流程、交易规则和全面实行公平交易的原则,保证基金在投资决策、交易执行、业绩评估等环节中公平对待所有投资对象,避免不公平交易行为,并进行绩效评价、合规性监督、规范运作,保障基金持有人的合法权益。

4.1.29 管理人对报告期内基金投资策略的说明

根据《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》,本公司制定了《公平交易制度》,通过组织结构的设置、工作流程、交易规则和全面实行公平交易的原则,保证基金在投资决策、交易执行、业绩评估等环节中公平对待所有投资对象,避免不公平交易行为,并进行绩效评价、合规性监督、规范运作,保障基金持有人的合法权益。

4.1.30 管理人对报告期内基金业绩表现的评价

根据《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》,本公司制定了《公平交易制度》,通过组织结构的设置、工作流程、交易规则和全面实行公平交易的原则,保证基金在投资决策、交易执行、业绩评估等环节中公平对待所有投资对象,避免不公平交易行为,并进行绩效评价、合规性监督、规范运作,保障基金持有人的合法权益。

4.1.31 管理人对报告期内基金投资策略的说明

根据《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》,本公司制定了《公平交易制度》,通过组织结构的设置、工作流程、交易规则和全面实行公平交易的原则,保证基金在投资决策、交易执行、业绩评估等环节中公平对待所有投资对象,避免不公平交易行为,并进行绩效评价、合规性监督、规范运作,保障基金持有人的合法权益。

4.1.32 管理人对报告期内基金业绩表现的评价

根据《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》,本公司制定了《公平交易制度》,通过组织结构的设置、工作流程、交易规则和全面实行公平交易的原则,保证基金在投资决策、交易执行、业绩评估等环节中公平对待所有投资对象,避免不公平交易行为,并进行绩效评价、合规性监督、规范运作,保障基金持有人的合法权益。

4.1.33 管理人对报告期内基金投资策略的说明