

申万菱信可转换债券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

基金管理人的董事及董事会对本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的完整性、准确性、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约定,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、财务会计报告、投资组合报告等信息,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	申万菱信可转换债券
基金主代码	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12月1日
报告期末基金份额总额	50,929,079.12份

投资目标 本基金通过资产配置,通过利用其具备债券和股票的特性,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

绩比较基准的稳定收益。

投资策略 本基金的投资将分为三个层次:第一个层次是大类资产配置,主要是确定基金资产

在债券、股票、现金等资产类别之间的配置比例,第二个层次是债券类资产的配置,主要

是根据对利率走势的判断,通过可转换债券的品种选择,第三层次是投资组合资产

的投资策略。

业绩比较基准 天相可转换债券收益率×7%+沪深300指数收益率×10%+恒生指数(全价)×收

益率×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风险较低的基金,其平均风险和预

测收益均低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。但由于本基金重点

投资于可转换债券,因此其风险和收益水平介于股票型基金和货币市场基金的中间。

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

3.1 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)
1.本期已实现收益	-6,451,981.07
2.本期利润	-29,763,598.14
3.加权平均基金份额本期利润	-0.4027
4.期末基金资产净值	88,019,491.36
5.期末基金份额净值	1.463

注:1.期末可供分配利润为本基金本期收入,按摊余成本法计算,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用

用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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申购本基金的

各项费用(例如:申购费、赎回费等),计入认购或申购本基金的各项费用后,实际收益水平要低于所列数字。

3.2 本基金净值表现

3.2.1 本期报告期基金净值增长率变化及其同同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.2 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变化及其同同期业绩比较基准收益率变动的比较

申万菱信转换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2015年9月30日)

注:1.任期内基金合同生效日(即情况下公司作出决定之日起)后,本基金经基金管理合同生效日起即任

2.本基金的净值来自于从行业协会、证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

3.2.3 代理人对报告期内本期内基金运通规则的规定,严格遵守基金

合同约定,本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》及其配套规定的制度,严格遵守基金

合同约定,本基金管理人严格