

信息披露

申万菱信消费增长混合型证券投资基金

【2015】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：二〇一六年一月二十二日

§1 重要提示
基金管理人、基金托管人及基金销售机构已在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2016年1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。
本报告自2015年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况	
基金简称	申万菱信消费增长混合
基金代码	310388
交易代码	310388
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年6月12日
报告期末基金份额总额	189,699,006.00份
投资策略	本基金在追求资产长期稳健增值过程中恪守价值投资原则，着力于寻找具有良好财务状况、较高核心价值与估值优势的优质上市公司进行投资，分享中国经济持续增长及消费升级方式带来的投资机会，在严格控制投资风险的前提下，保持基金资产的持续增值，为投资者获取超越业绩基准的长期投资收益。
投资范围	本基金股票资产占基金资产的比例不低于60%，其中：沪、深两市A股股票资产占基金资产的比例不低于50%；本基金可投资于国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券、金融衍生品及法律法规允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中债综合指数（含债息）收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其风险收益特征表现为中高风险中收益。
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10月1日至2015年12月31日)
1.本期已实现收益	330,379.97
2.本期利润	40,170,903.56
3.加权平均基金份额本期利润	0.2649
4.期末基金资产净值	280,490,461.74
5.期末基金份额净值	1.4521

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公允价值变动收益。
2)上述基金业绩指标已扣除了基金的管理费、托管费和其他交易费用，但不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：申购费、赎回费等），计入认购或交易基金各项费用后，实际收益率水平要低于所列数字。
3.2.1 基金净值表现
3.2.1.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
3.2.1.2 本基金合同生效以来基金累计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

注：1)本基金合同生效以来（即2009年6月12日至2015年12月31日）

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计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

注：1)本基金合同生效以来（即2009年6月12日至2015年12月31日）

3.2.3 自基金合同生效以来基金累计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

注：1)本基金合同生效以来（即2009年6月12日至2015年12月31日）

3.2.4 自基金合同生效以来基金累计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

注：1)本基金合同生效以来（即2009年6月12日至2015年12月31日）

3.2.5 自基金合同生效以来基金累计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

注：1)本基金合同生效以来（即2009年6月12日至2015年12月31日）

3.2.6 自基金合同生效以来基金累计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

注：1)本基金合同生效以来（即2009年6月12日至2015年12月31日）

3.2.7 自基金合同生效以来基金累计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

注：1)本基金合同生效以来（即2009年6月12日至2015年12月31日）

3.2.8 自基金合同生效以来基金累计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

注：1)本基金合同生效以来（即2009年6月12日至2015年12月31日）

3.2.9 自基金合同生效以来基金累计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

注：1)本基金合同生效以来（即2009年6月12日至2015年12月31日）

3.2.10 自基金合同生效以来基金累计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

注：1)本基金合同生效以来（即2009年6月12日至2015年12月31日）

3.2.11 自基金合同生效以来基金累计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

注：1)本基金合同生效以来（即2009年6月12日至2015年12月31日）

3.2.12 自基金合同生效以来基金累计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

注：1)本基金合同生效以来（即2009年6月12日至2015年12月31日）

3.2.13 自基金合同生效以来基金累计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

注：1)本基金合同生效以来（即2009年6月12日至2015年12月31日）

3.2.14 自基金合同生效以来基金累计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

注：1)本基金合同生效以来（即2009年6月12日至2015年12月31日）

3.2.15 自基金合同生效以来基金累计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

注：1)本基金合同生效以来（即2009年6月12日至2015年12月31日）

3.2.16 自基金合同生效以来基金累计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

注：1)本基金合同生效以来（即2009年6月12日至2015年12月31日）

3.2.17 自基金合同生效以来基金累计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

注：1)本基金合同生效以来（即2009年6月12日至2015年12月31日）

3.2.18 自基金合同生效以来基金累计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

注：1)本基金合同生效以来（即2009年6月12日至2015年12月31日）

3.2.19 自基金合同生效以来基金累计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

注：1)本基金合同生效以来（即2009年6月12日至2015年12月31日）

3.2.20 自基金合同生效以来基金累计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

注：1)本基金合同生效以来（即2009年6月12日至2015年12月31日）

3.2.21 自基金合同生效以来基金累计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

注：1)本基金合同生效以来（即2009年6月12日至2015年12月31日）

本基金报告期内净值表现为19.98%，同期业绩比较基准表现为13.67%。

4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	247,304,512.26	84.27
2	固定收益投资	247,304,512.26	84.27
3	其中：股票	247,304,512.26	84.27
4	其中：债券	—	—
5	资产支持证券	—	—
6	贵金属投资	—	—
7	金融衍生品投资	—	—
8	买入返售金融资产	—	—
9	其中：买入返售金融资产	—	—
10	其中：买入返售金融资产	—	—
11	其中：买入返售金融资产	—	—
12	其中：买入返售金融资产	—	—
13	其中：买入返售金融资产	—	—
14	其中：买入返售金融资产	—	—
15	其中：买入返售金融资产	—	—
16	其中：买入返售金融资产	—	—
17	其中：买入返售金融资产	—	—
18	其中：买入返售金融资产	—	—
19	其中：买入返售金融资产	—	—
20	其中：买入返售金融资产	—	—
21	其中：买入返售金融资产	—	—
22	其中：买入返售金融资产	—	—
23	其中：买入返售金融资产	—	—
24	其中：买入返售金融资产	—	—
25	其中：买入返售金融资产	—	—
26	其中：买入返售金融资产	—	—
27	其中：买入返售金融资产	—	—
28	其中：买入返售金融资产	—	—
29	其中：买入返售金融资产	—	—
30	其中：买入返售金融资产	—	—
31	其中：买入返售金融资产	—	—
32	其中：买入返售金融资产	—	—
33	其中：买入返售金融资产	—	—
34	其中：买入返售金融资产	—	—
35	其中：买入返售金融资产	—	—
36	其中：买入返售金融资产	—	—
37	其中：买入返售金融资产	—	—
38	其中：买入返售金融资产	—	—
39	其中：买入返售金融资产	—	—
40	其中：买入返售金融资产	—	—
41	其中：买入返售金融资产	—	—
42	其中：买入返售金融资产	—	—
43	其中：买入返售金融资产	—	—
44	其中：买入返售金融资产	—	—
45	其中：买入返售金融资产	—	—
46	其中：买入返售金融资产	—	—
47	其中：买入返售金融资产	—	—
48	其中：买入返售金融资产	—	—
49	其中：买入返售金融资产	—	—
50	其中：买入返售金融资产	—	—
51	其中：买入返售金融资产	—	—
52	其中：买入返售金融资产	—	—
53	其中：买入返售金融资产	—	—
54	其中：买入返售金融资产	—	—
55	其中：买入返售金融资产	—	—
56	其中：买入返售金融资产	—	—
57	其中：买入返售金融资产	—	—
58	其中：买入返售金融资产	—	—
59	其中：买入返售金融资产	—	—
60	其中：买入返售金融资产	—	—
61	其中：买入返售金融资产	—	—
62	其中：买入返售金融资产	—	—
63	其中：买入返售金融资产	—	—
64	其中：买入返售金融资产	—	—
65	其中：买入返售金融资产	—	—
66	其中：买入返售金融资产	—	—
67	其中：买入返售金融资产	—	—
68	其中：买入返售金融资产	—	—
69	其中：买入返售金融资产	—	—
70	其中：买入返售金融资产	—	—
71	其中：买入返售金融资产	—	—
72	其中：买入返售金融资产	—	—
73	其中：买入返售金融资产	—	—
74	其中：买入返售金融资产	—	—
75	其中：买入返售金融资产	—	—
76	其中：买入返售金融资产	—	—
77	其中：买入返售金融资产	—	—
78	其中：买入返售金融资产	—	—
79	其中：买入返售金融资产	—	—
80	其中：买入返售金融资产	—	—
81	其中：买入返售金融资产	—	—
82	其中：买入返售金融资产	—	—
83	其中：买入返售金融资产	—	—
84	其中：买入返售金融资产	—	—
85	其中：买入返售金融资产	—	—
86	其中：买入返售金融资产	—	—
87	其中：买入返售金融资产	—	—
88	其中：买入返售金融资产	—	—
89	其中：买入返售金融资产	—	—
90	其中：买入返售金融资产	—	—
91	其中：买入返售金融资产	—	—
92	其中：买入返售金融资产	—	—
93	其中：买入返售金融资产	—	—
94	其中：买入返售金融资产	—	—
95	其中：买入返售金融资产	—	—
96	其中：买入返售金融资产	—	—
97	其中：买入返售金融资产	—	—
98	其中：买入返售金融资产	—	—
99	其中：买入返售金融资产	—	—
100	其中：买入返售金融资产	—	—

注：本基金未开通沪港通交易机制投资于港股。

§5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	132,394,290.09	46.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	5,317,280.00	1.83
F	批发和零售业	7,127,056.00	2.46
G	交通运输、仓储和邮政业	8,052,000.00	2.77
H	住宿和餐饮业	1,479,000.00	0.51
I	信息技术业	38,443,622.56	13.23
J	金融业	15,062,000.00	5.19
K	房地产业	4,294,260.00	1.48
L	租赁和商务服务业	8,564,770.00	2.94
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	24,325,118.40	8.37
S	综合	2,153,700.00	0.74
合计		247,304,512.26	84.31

§5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600172	招商局A	841,176.00	21,290,136.26	7.33
2	300078	多伦科技	348,276.00	16,196,520.00	5.65
3	002655	明微电子	225,000.00	8,698,500.00	2.99
4	600138	中原特钢	397,000.00	8,564,770.00	2.94
5	600155	华鲁恒升	700,000.00	8,488,000.00	2.93
6	601011	华彬集团	132,000.00	8,052,000.00	2.77
7	002289	美盈电子	150,000.00	7,665,000.00	2.64
8	300144	瑞康医药	297,318.00	7,566,096.40	2.60
9	600420	现代制药	174,900.00	7,303,624.00	2.51
10	002174	招商局B	85,612.00	7,225,652.80	2.49

§5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

§5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

§5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

§5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

§5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

§5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

§5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

根据本基金基金合同，本基金不得参与股指期货交易。

§5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金基金合同，本基金不得参与股指期货交易。

§5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

§5.10.1 本期国债期货交易投资情况

根据本基金基金合同，本基金不得参与国债期货交易。

§5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据本基金基金合同，本基金不得参与国债期货交易。

§5.10.3 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同，本基金不得参与国债期货交易。

§5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	项目	名称	金额(元)
1	存出保证金	—	192,698.86
2	应收证券清算款	—	1,036,214.03
3	应收利息	—	—
4	应收股利	—	8,716.33
5	应收申购款	—	297,074.24
6	其他应收款	—	—
7	待摊费用	—	—
8	其他	—	1,623,702.46
9	合计	—	1,623,702.46

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600420	现代制药	7,303,624.00	2.51	重大事项
2	002174	招商局B	7,225,652.80	2.49	重大事项

§6 开放式基金份额变动

单位：份	本报告期初基金份额总额	本报告期末基金份额总额
	192,427,564.00	189,699,006.00
	6,962,672.32	9,441,131.71
	9,441,131.71	189,699,006.00

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内，本基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况。