# 申万菱信盛利精选证券投资基金 2016年年度报告摘要

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:二〇一七年三月三十日

## §1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

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2017年3月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2016年1月1日起至12月31日止。

## §2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 申万菱信盛利精选混合 |
| 基金主代码 | 310308 |
| 交易代码 | 310308 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2004年4月9日 |
| 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 |
| 报告期末基金份额总额 | 827,598,121.08份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金的投资目标是通过采用积极主动的分散化投资策略,依靠先进成熟的风险管理技术,运用前沿的动态行业配置模型,努力创造长期领先于投资组合基准的稳定投资业绩,追求当期收益和长期增值的平衡,并实现中、长期资本增值为目标的最优化回报。 |
| 投资策略 | 本基金是以股票投资为主的平衡型基金,采用主动投资管理模式。本基金采取“行业配置”与“个股选择”双线并行的投资策略。本基金管理人引进外方股东的投资管理经验及技能,根据国内市场的特征,将外方股东行之有效的投资管理方法及工具加以吸收和应用。这些投资管理工具包括内部开发的专用模型(包括股票估值模型、主动行业矩阵、债券估值模型),以及惯用的成长价值平衡模型(PEG)、资产回报率模型(ROE、ROA)、自由现金流折现模型(DCF)及经济价值模型(EV/EBITDA)等。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数×75%+中债总指数(全价)×20%+1年定期存款利率×5% |
| 风险收益特征 | 本基金是一只偏股型的证券投资基金,股票资产的配置一般情况下在50-75%的比例(建仓期以后),从资产配置的特性分类,本基金属于相对收益高、风险偏高的证券投资基金。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---|---|---|---|
| 名称 | | 申万菱信基金管理有限公司 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 王菲萍 | 郭明 |
| | 联系电话 | 021-23261188 | 010-66105799 |
| | 电子邮箱 | service@swsmu.com | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 4008808588 | 95588 |
| 传真 | | 021-23261199 | 010-66105798 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---|---|
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.swsmu.com |
| 基金年度报告备置地点 | 申万菱信基金管理有限公司<br>中国工商银行股份有限公司 |

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2016年 | 2015年 | 2014年 |
|---|---|---|---|
| 本期已实现收益 | -112,640,846.78 | 432,294,674.01 | 265,969,590.86 |
| 本期利润 | -175,365,486.99 | 357,686,470.04 | 298,958,768.58 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.2073 | 0.4290 | 0.2640 |
| 本期基金份额净值增长率 | -20.98% | 29.00% | 30.97% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2016年末 | 2015年末 | 2014年末 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.2324 | 0.3067 | 0.1609 |
| 期末基金资产净值 | 635,271,116.07 | 872,161,013.88 | 1,215,869,196.22 |
| 期末基金份额净值 | 0.7676 | 1.3067 | 1.1609 |

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、托管费和各项交易费用,但不包括持有人认/申购或交易基金的各项费用(例如:申购费、赎回费等),计入认/申购或交易基金的各项费用后,实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率标准差③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 0.44% | 0.59% | 0.83% | 0.55% | -0.39% | 0.04% |
| 过去六个月 | 0.71% | 0.58% | 3.51% | 0.57% | -2.80% | 0.01% |
| 过去一年 | -20.98% | 1.27% | -8.43% | 1.05% | -12.55% | 0.22% |
| 过去三年 | 33.51% | 1.52% | 35.56% | 1.34% | -2.05% | 0.18% |
| 过去五年 | 56.62% | 1.41% | 40.26% | 1.22% | 16.36% | 0.19% |
| 自基金合同生效起至今 | 326.01% | 1.34% | 123.78% | 1.36% | 197.23% | -0.02% |

注:本基金的业绩基准指数按照构建公式每日历日进行计算,计算方式如下:

benchmark 0=1000;

%benchmark t = 20% *(中债总指数(全价)t /中债总指数(全价)t-1 -1)+ 75% *(沪深300 指数t /沪深300 指数t-1 -1)+ 5% * 一年期银行定期存款利率 / 365

benchmark t =(1+%benchmark t )* benchmark t-1;

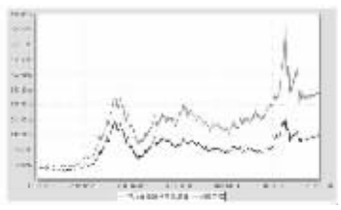
其中t=1,2,3,… 。

3.2.2自基金合同生效以来基金份额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

申万菱信盛利精选证券投资基金

自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2004年4月9日至2016年12月31日)



3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

申万菱信盛利精选证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

| 年度 | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 年度利润分配合计 | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|
| 2014年 | - | - | - | - | - |
| 2015年 | 1.449 | 46,250,742.56 | 102,854,432.69 | 149,105,175.25 | - |
| 2016年 | 2.770 | 25,990,604.03 | 158,631,829.80 | 184,622,433.83 | - |
| 合计 | 4.219 | 72,241,346.59 | 261,486,262.49 | 333,727,609.08 | - |

## §4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

申万菱信基金管理有限公司原名申万巴黎基金管理有限公司,是由国内大型综合类券商申万宏源证券有限公司和三菱UFJ信托银行株式会社共同设立的一家中外合资基金管理公司。公司成立于2004年1月15日,注册地在中国上海,注册资本金为1.5亿元人民币。其中,申万宏源证券有限公司持有67%的股份,三菱UFJ信托银行株式会社持有33%的股份。

公司成立以来业务增长迅速,在北京、广州先后建立了分公司。截至2016年12月31日,公司旗下管理了包括股票型、混合型、债券型和货币型在内的27只开放式基金,形成了完整而丰富的产品线。公司旗下基金管理资产规模超过340亿元,客户数超过592万户。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理(助理)期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 高源 | 本基金基金经理 | 2015-07-01 | - | 11年 | 高源女士,硕士研究生。曾任职于光大证券,安信证券,2010年加入申万菱信基金管理有限公司,历任行业研究员、消费行业组组长、现任申万菱信盛利精选证券投资基金、申万菱信消费增长混合型证券投资基金基金经理。 |
| 赵世光 | 本基金原基金经理助理 | 2015-07-29 | 2016-02-19 | 8年 | 赵世光先生,博士研究生。曾任职于朗讯科技(中国)有限公司,东海证券,东吴基金公司,2011年7月加入申万菱信基金管理有限公司,曾任申万菱信盛利精选证券投资基金基金经理助理、行业研究员,现任专户投资经理。 |
| 孙琳 | 本基金基金经理 | 2016-12-29 | - | 10年 | 孙琳女士,经济学学士。曾任职于中信金通证券研究所(现中信证券(浙江)研究所),2009年加入申万菱信基金管理有限公司,历任行业研究员、基金经理助理、申万菱信新动力股票型证券投资基金、申万菱信消费增长混合型证券投资基金基金经理,现任申万菱信新经济混合型证券投资基金、申万菱信竞争优势混合型证券投资基金、申万菱信盛利精选证券投资基金基金经理。 |

注:1.任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日;若该基金经理自基金合同生效日起即任职,则任职日期为基金合同生效日。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3.本报告期内,赵世光不再担任本基金基金经理助理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》及其配套法规的规定,严格遵守基金合同约定,本着诚实信用、勤勉尽责等原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。

本基金投资运作符合法律法规和基金合同的规定,信息披露及时、准确、完整;本基金资产与本基金管理人与公司资产之间严格分开;没有发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为。在基金资产的管理运作中,无任何损害基金持有人利益的行为,并通过稳健经营、规范运作、规避风险,保护了基金持有人的合法权益。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,本公司制定了《公平交易制度》,通过组织结构的设置、工作制度、流程和技术手段全面落实公平交易原则在具体业务(包括研究分析、投资决策、交易执行等)环节中的实现,在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时,确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会;同时,通过对投资交易行为的日常监控和事后分析评估来加强对公平交易过程和结果的监督。

在研究分析方面,本公司建立了规范、完善的研究管理平台,规范了研究人员的投资建议、研究报告的发布流程,使各投资组合经理在获取投资建议的及时性、准确性及深度等方面得到公平对待。

在投资决策方面,首先,公司建立健全投资授权制度,明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限。投资决策委员会和投资总监等管理机构和人员不得对投资经理在授权范围内的投资活动进行干预。投资经理在授权范围内可以自主决策,超过投资权限的操作必须经过严格的审批程序;其次,公司建立投资组合投资信息的管理及保密制度,除分管投资副总及投资总监等因业务管理的需要外,不同投资经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离;另外,公司还建立机制要求公募投资经理与特定客户资产投资经理互相隔离,且不能互相授权投资事宜。

在交易执行方面,本公司设立了独立于投资管理职能的交易总部,通过实行集中交易制度和公平的交易分配制度,确保各投资组合享有公平的交易执行机会;此外,本公司对于可能导致涉嫌不公平交易和利益输送的反向交易行为也制定并落实了严格的管理:(1)对于交易所公开竞价的同向交易,交易总部按照“时间优先、价格优先”的原则,采取“未委托数量比例法”,通过系统的公平交易模块实现公平交易;(2)对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易,各投资经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量,集中交易室按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配;(3)对于银行间市场的现券交易,交易总部在银行间市场开展独立、公平的询价,并由风险管理部对交易价格的公允性(根据市场公认的第三方信息)、交易对手和交易方式进行事前审核,确保交易得到公平和公允的执行。对于由于特殊原因不能参与以上提到的公平交易程序的交易指令,投资经理须提出申请并阐明具体原因,交由交易总监及风险管理总监进行严格的公平性审核;(4)严格禁止同一投资组合或不同投资组合之间在同一交易日内进行反向交易(除完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合外)。确因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生的不同投资组合之间的同日反向交易,相关投资经理须向风险管理委员会提供决策依据并留存记录备查。

在日常监控和事后分析评估方面,本公司风险管理总部开展日内和定期的工作对公平交易执行情况作整体监控和效果评估。其中日常监控包括了日内不定点对交易系统的抽查监控;对非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程进行审核和监控;以及对银行间交易过程中投资组合与交易对手之间议价交易的交易方式和交易价格的公允性进行审查。事后分析评估上,风险管理总部在每个季度和每年度的《公平交易执行报告》中,对不同组合间同一投资标的、临近交易日的同向交易和反向交易的合理性开展分析评估。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

对于场内同向交易,我们采集了本报告期内本公司旗下两两投资组合在相同时间窗口下(日内、3日内和5 日内)同买或者同卖场内同一证券时两者买卖均价存在的差异(即价差率)序列,然后按两两组合归类计算平均价差率。首先,假设两两组合在本报告期的价差率呈正态分布且平均价差率为0,我们进行了95%的置信度、假设平均价差率为0 的T 检验,若通过该假设检验,则我们认为该两两组合的交易得到了公平的执行;对于未通过假设检验的情况,我们还计算了两两组合价差占优次数比例、价差交易模拟贡献、组合收益率差异和模拟输送比例占收益率差的比例等指标;若综合以上各项指标,认为仍存在一定的嫌疑,则我们将进一步对该两两组合同向买卖特定场内证券的时点、价格、数量等作分析,来判断是否存在重大利益输送的可能性。

对于场外同向交易,我们分析了本报告期内不同时间窗口内(日内、3 日内和5 日内)两两组合同向交易的价差率、对比市场公允价格和交易对手,未发现利益输送的情况。

对于反向交易,我们根据交易价格、交易频率、交易数量等进行了综合分析,未发现异常情况。

综合而言,本公司通过事前的制度规范、事中的监控和事后的分析评估,严格执行了公平交易制度,公平对待了旗下各投资组合。本报告期内,未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本公司制定了《异常交易监控报告制度》,明确定义了在投资交易过程中出现的各种可能导致不公平交易和利益输送的异常交易类型,并规定且落实了异常交易的日常监控、识别以及事后的分析流程。

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内,本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况有六次。投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易,未导致不公平交易和利益输送。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2016年受国内宏观经济环境以及货币流动性环境的迅速变化,股票市场出现了较大波动,其中由于行业竞争背景及企业盈利的波动造成投告期内成长风格与价值风格频繁切换,市场整体估值中枢重塑。从行业角度看,较多轻资产经营模式行业业绩出现大范围不达预期或者迅速恶化,本基金由于年初配置较多该类型资产,基金业绩表现较差。管理人在后续的管理中,逐渐减持该类资产,并积极向稳定盈利增长行业进行资产配置,进一步降低了持仓组合整体估值水平,下半年逐步缩小了对比同业相对落后的业绩差距。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本基金报告期内表现为-20.98%,同期业绩比较基准表现为-8.43%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2017年,管理人认为虽然国内外宏观经济环境不确定性依旧存在,但由于整体货币政策和财政政策调整的不确定性边际收敛,股票市场相对2016年区间波动收敛。但与2016年相比不同的是各类资产投资收益率预期进一步下降,因此管理人认为在2017年更需要审慎投资的管理方式。影响各类政策边际变化的核心因素是“外部通胀”的发生与演变,这一因素有可能在2017年全年波段变化;除此之外,由于国债收益率上行,针对上、中、下游行业成本端的影响将会出现较大分化,“真成长”与“伪成长”的筛选标准将更为审慎和严格。管理人将继续坚持“优选成长、间或价值”的配置思路,力求实现在风险可控背景下的持有人收益最大化。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人、本基金托管人和本基金聘请的会计师事务所参与本基金的估值流程,上述各方不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人按照有关法规确定的原则进行估值,将导致基金资产净值的变化在0.25%以上的,因就拟采用的相关估值模型、假设及参数的适当性征求本基金托管人和本基金聘请的会计师事务所的意见。本基金聘请的会计师事务所对相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。

本基金管理人设立资产估值委员会,负责根据法规要求,尽可能科学、合理地制定估值政策,审议批准估值程序,并在特定状态下就拟采用的相关估值模型、假设及参数的适当性进行确认,以保护基金份额持有人的利益。

资产估值委员会由本基金管理人的总经理,分管基金投资的副总经理,分管基金运营的副总经理,投资总监,基金运营总部、监察稽核总部、风险管理总部等各总部负责人组成。其中,总经理来肖贤先生,拥有11年基金行业高级管理人员经验;分管基金投资的副总经理(代行投资总监职责)张少华先生,拥有13年的基金行业研究、投资和风险管理相关经验;分管基金运营的副总经理张丽红女士,拥有13年的基金行业运营、财务管理相关经验;基金运营总部总监李濮君女士,拥有15年的基金会计经验;监察稽核总部总监牛锐女士,拥有12年的证券基金行业合规管理经验;固定收益总部总监陈国辉先生,拥有9年固定收益研究、投资和风险管理相关经验;风险管理总部总监王璀怡女士,拥有11年的基金行业风险管理经验。

基金经理不参与决定本基金估值的程序。本公司已与中央国债登记结算有限责任公司签订协议,采用其提供的估值数据对银行间债券进行估值;采用中证指数有限公司提供的估值数据对交易所债券进行估值。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内,本基金管理人向截至2016年1月21日止登记在册的本基金全体基金份额持有人,按每10份基金份额派发红利2.770元。详见本基金管理人于2016年1月18日发布的公告。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## §5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,本基金托管人在对申万菱信盛利精选证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,申万菱信盛利精选证券投资基金的管理人——申万菱信基金管理有限公司在申万菱信盛利精选证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,申万菱信盛利精选证券投资基金对基金份额持有人进行了1次利润分配,分配金额为184,622,433.83元。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对申万菱信基金管理有限公司编制和披露的申万菱信盛利精选证券投资基金2016年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

## §6 审计报告

普华永道中天审字(2017)第21799号

申万菱信盛利精选证券投资基金(原名为申万巴黎盛利精选证券投资基金)全体基金份额持有人:

我们审计了后附的申万菱信盛利精选证券投资基金(原名为“申万巴黎盛利精选证券投资基金”,以下简称“申万菱信盛利精选基金”)的财务报表,包括2016年12月31日的资产负债表、2016年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

6.1管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是申万菱信盛利精选基金 的基金管理人申万菱信基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括:

(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,并使其实现公允反映;

(2) 设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

6.2注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。

我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。

6.3审计意见

我们认为,上述申万菱信盛利精选基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了申万菱信盛利精选基金2016年12月31日的财务状况以及2016年度的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

中国注册会计师 赵 钰

中国注册会计师 陈 玲

上海市陆家嘴环路1318号星展银行大厦6层

2017年3月28日

## §7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:申万菱信盛利精选证券投资基金

报告截止日:2016年12月31日

单位:人民币元

| 资产 | 本期末 2016年12月31日 | 上年度末 2015年12月31日 |
|---|---|---|
| 资 产: | - | - |
| 银行存款 | 61,389,163.53 | 51,075,262.30 |
| 结算备付金 | 1,312,082.47 | 2,076,721.09 |
| 存出保证金 | 179,176.59 | 412,824.94 |
| 交易性金融资产 | 587,573,894.84 | 812,962,521.68 |
| 其中:股票投资 | 377,778,540.74 | 635,907,637.38 |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 209,795,354.10 | 177,044,884.30 |
| 资产支持证券投资 | - | - |
| 贵金属投资 | - | - |
| 衍生金融资产 | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - |
| 应收证券清算款 | - | 3,346,690.79 |
| 应收利息 | 4,071,569.32 | 5,875,163.62 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | 878.98 | 494.07 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 654,526,765.73 | 875,739,678.49 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 2016年12月31日 | 上年度末 2015年12月31日 |
| 负 债: | - | - |
| 短期借款 | - | - |
| 交易性金融负债 | - | - |
| 衍生金融负债 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | - | - |
| 应付证券清算款 | 16,852,176.84 | 317,748.23 |
| 应付赎回款 | 73,467.04 | 552,536.29 |
| 应付管理人报酬 | 815,713.76 | 1,093,530.52 |
| 应付托管费 | 135,952.29 | 182,255.10 |
| 应付销售服务费 | - | - |
| 应付交易费用 | 1,042,705.37 | 1,062,721.05 |
| 应交税费 | - | - |
| 应付利息 | - | - |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 335,634.36 | 369,873.42 |
| 负债合计 | 19,255,649.66 | 3,578,664.61 |
| 所有者权益: | - | - |
| 实收基金 | 827,598,121.08 | 667,441,593.65 |
| 未分配利润 | -192,327,005.01 | 204,719,420.23 |
| 所有者权益合计 | 635,271,116.07 | 872,161,013.88 |
| 负债和所有者权益总计 | 654,526,765.73 | 875,739,678.49 |

注:报告截止2016年12月31日,基金份额净值0.7676元,基金份额总额827,598,121.08份。

7.2 利润表

会计主体:申万菱信盛利精选证券投资基金

本报告期:2016年1月1日至2016年12月31日

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日 |
|---|---|---|
| 一、收入 | -157,942,399.74 | 387,596,260.65 |
| 1.利息收入 | 5,921,100.27 | 11,828,516.06 |
| 其中:存款利息收入 | 394,908.40 | 630,394.93 |
| 债券利息收入 | 5,526,191.87 | 11,194,787.78 |
| 资产支持证券利息收入 | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | - | 3,333.35 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益(损失以“-”填列) | -101,158,712.15 | 450,066,181.42 |
| 其中:股票投资收益 | -110,874,956.22 | 442,735,272.59 |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | 5,124,722.56 | 4,572,795.64 |
| 资产支持证券投资收益 | - | - |
| 贵金属投资收益 | - | - |
| 衍生工具收益 | - | - |
| 股利收益 | 4,591,521.51 | 2,758,113.19 |
| 3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列) | -62,724,641.21 | -74,608,203.97 |
| 4.汇兑收益(损失以“-”号填列) | - | - |
| 5.其他收入(损失以“-”号填列) | 19,853.35 | 309,767.14 |
| 减:二、费用 | 17,423,087.25 | 29,909,790.61 |
| 1. 管理人报酬 | 9,910,093.90 | 15,883,380.33 |
| 2. 托管费 | 1,651,682.27 | 2,647,230.04 |
| 3. 销售服务费 | - | - |
| 4. 交易费用 | 5,586,698.08 | 11,069,233.21 |
| 5. 利息支出 | - | - |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | - | - |
| 6. 其他费用 | 274,613.00 | 309,947.03 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | -175,365,486.99 | 357,686,470.04 |
| 减:所得税费用 | - | - |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | -175,365,486.99 | 357,686,470.04 |

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:申万菱信盛利精选证券投资基金

本报告期:2016年1月1日至2016年12月31日

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 | | |
|---|---|---|---|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 667,441,593.65 | 204,719,420.23 | 872,161,013.88 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | -175,365,486.99 | -175,365,486.99 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列) | 160,156,527.43 | -37,058,504.42 | 123,098,023.01 |
| 其中:1.基金申购款 | 221,627,926.07 | -50,429,230.55 | 171,198,695.52 |
| 2.基金赎回款 | -61,471,398.64 | 13,370,726.13 | -48,100,672.51 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | - | -184,622,433.83 | -184,622,433.83 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 827,598,121.08 | -192,327,005.01 | 635,271,116.07 |

| 项目 | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日 | | |
|---|---|---|---|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 1,047,314,243.17 | 168,554,952.06 | 1,215,869,196.22 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 357,686,470.04 | 357,686,470.04 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列) | -379,872,649.52 | -172,416,826.61 | -552,289,476.13 |
| 其中:1.基金申购款 | 151,143,025.04 | 19,964,405.15 | 171,107,430.19 |
| 2.基金赎回款 | -531,015,674.56 | -192,381,231.76 | -723,396,906.32 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | - | -149,105,175.25 | -149,105,175.25 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 667,441,593.65 | 204,719,420.23 | 872,161,013.88 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码(序号)从7.1至7.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人:来肖贤,主管会计工作负责人:张丽红,会计机构负责人:李濮君

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

申万菱信盛利精选证券投资基金(原名为申万巴黎盛利精选证券投资基金,以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2004]22号文核准,由申万菱信基金管理有限公司(原名为“申万巴黎基金管理有限公司”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《申万巴黎盛利精选证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币6,808,522,243.06元,业经德勤华永会计师事务所有限公司德师报(验)字(04)第015号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《申万巴黎盛利精选证券投资基金基金合同》于2004年4月9日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为6,809,310,552.85份基金份额,其中认购资金利息折合788,309.79份基金份额。本基金的基金管理人为申万菱信基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

经中国证监会证监许可[2011]106号《关于核准申万巴黎基金管理有限公司变更股权、公司名称及修改章程的批复》批准,申万巴黎基金管理有限公司已于2011年3月3日完成相关工商变更登记手续,并于2011年3月4日变更公司名称为“申万菱信基金管理有限公司”。本基金的基金管理人报请中国证监会备案,将申万巴黎盛利精选证券投资基金更名为申万菱信盛利精选证券投资基金,并于2011年4月6日公告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《申万菱信盛利精选证券投资基金基金合同》和最新公布的《申万菱信盛利精选证券投资基金更新的招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为:在中华人民共和国境内依法发行上市交易的股票和债券、银行间债券以及国务院证券监督管理机构规定的其他证券品种。资产配置比例为:股票50%至75%,债券20%至40%,现金5%至10%。自基金合同生效日至2015年9月29日,本基金的业绩比较基准为:沪深300指数×75%+中信标普国债指数×20%+1年期定期存款利率×5%。

根据本基金的基金管理人于2015年9月30日发布的《申万菱信基金管理有限公司关于修改申万菱信盛利精选证券投资基金业绩比较基准的公告》,自2015年9月30日起,本基金的业绩比较基准变更为:沪深300指数×75%+中债总指数(全价)×20%+1年期定期存款利率×5%。

本报告期末由本基金的基金管理人申万菱信基金管理有限公司于2017年3月28日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《申万菱信盛利精选证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2016年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2016年12月31日的财务状况以及2016年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 于2016年5月1日前,以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起,金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税 。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股票的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。?

(3) 对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额,上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 关联方关系

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|---|---|
| 申万菱信基金管理有限公司 | 基金管理人 基金销售机构<br>基金注册登记机构 |
| 申万宏源证券有限公司(以下简称“申万宏源”) | 基金管理人的股东 基金代销机构 |
| 三菱UFJ信托银行株式会社 | 基金管理人的股东 |
| 中国工商银行 | 基金托管人 基金代销机构 |
| 申万菱信(上海)资产管理有限公司 | 基金管理人的全资子公司 |

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 | | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 |
| 申万宏源 | 123,921,080.09 | 3.38% | 535,277,557.98 | 7.50% |

注:由于申银万国和宏源证券于2015年1月16日完成吸收合并。上表中上年度可比区间中申万宏源的交易情况包含申银万国2