申万菱信沪深300价值指数证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9月30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
报告送出日期: 二〇一三年十月二十五日

§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2013年10月23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。

本报告期自2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	申万菱信沪深300价值指数
基金主代码	310398
交易代码	310398
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年2月11日
报告期末基金份额总额	674,309,727.35份
投资目标	本基金采取指数化投资方式,通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%,实现对沪深300价值指数的有效跟踪。
投资策略	本基金主要采取完全复制法进行投资,即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整;但在因特殊情况(如流动性不足)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合,追求尽可能贴近目标指数的表现。
业绩比较基准	沪深300价值指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%。
风险收益特征	本基金为股票型指数基金,具有较高风险、较高预期收益的特征,其风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金。
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(2013年7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	-358,741.52
2.本期利润	26,200,977.13
3.加权平均基金份额本期利润	0.0426
4.期末基金资产净值	500,414,951.41
5.期末基金份额净值	0.7421

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 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

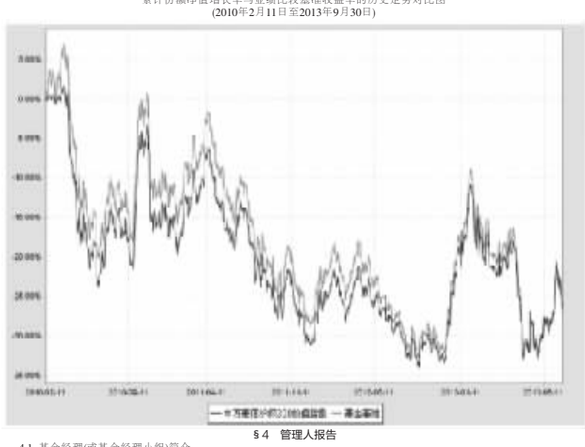
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	7.35%	1.46%	5.77%	1.45%	1.58%	0.01%

3.2.2自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

申万菱信沪深300价值指数证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2010年2月11日至2013年9月30日)



§4 管理人报告

4.1 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限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张少华	本基金基金经理	2010-2-12	-	14年	张少华先生,复旦大学数量经济学硕士。曾任职于申银万国证券,2003年1月加入申万巴黎基金管理有限公司(现名申万菱信)筹备组,后正式加入本公司,历任风险管理总部高级风险分析师、副总监、总监,投资管理总部副总监,申万菱信量化小盘基金经理,现任申万菱信沪深300价值指数、申万菱信深证成指分级、申万菱信中小板指数分级基金经理。

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。

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、勤勉尽责的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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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。

在投资和研究方面,本公司设立了独立于公募基金投资、特定客户资产投资的研究总部,建立了规范、完善的研究管理平台,确保公平地为各投资组合提供研究服务。

在交易执行方面,本公司的投资管理职能和交易执行职能相隔离,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。

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。风险管理总部通过对不同组合之间同向交易的价差率的假设检验、价格占优的次数百分比统计、价差交易模拟贡献与组合收益率差异的比较等方法对本报告期以及连续四个季度期间内、不同时间窗口下公司管理的不同投资组合同向交易的价差进行了分析;对于场外交易,还特别对比了组合之间发生的同向交易的市场公允价格和交易对手,判断交易是否公平且是否涉及利益输送。

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。

4.3.2 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。

本报告期,未发生我司旗下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%的情况以及其他可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2013年三季度,沪深A股市场整体呈现出震荡上行格局,最终A股市场收复了二季度的大部分跌幅。上证综指最高至2270点,最低至1946点,收盘2175点,上涨9.88%。深证成分指数上涨10.66%,沪深300指数上涨9.47%,中小板成指上涨17.46%,创业板指数上涨35.21%。创业板指数继续维持着高歌猛进的态势。

操作上,基金运作主要着眼于控制净值表现和业绩基准的偏差幅度。从实际运作效果来看,很好地控制了日均的跟踪偏差,今年以来年化跟踪误差控制在0.94%左右,达到契约的要求。实际运作结果观察,今年以来成分股分红、成分股调整、工商银行作为权重靠前的成分股不能投资、权重较大的成分股长期停牌后变更估值方法等是贡献基金跟踪误差的主要来源。本基金于2013年1月10日起,基金净值公布精度调整至小数点后四位。

作为被动投资的基金产品,沪深300价值指数基金将继续坚持既定的指数化投资策略,以严格控制基金相对目标指数的跟踪偏离为投资目标,追求跟踪误差的最小化。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

2013年三季度沪深300价值指数期间表现为6.03%,基金业绩基准表现为5.77%,申万菱信沪深300价值基金净值期间表现为7.35%,和业绩基准的差约1.58%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

三季度,市场表现与二季度的颓势截然相反,在"稳增长"的预期以及宏观经济数据的超预期反弹影响下,指数成功反弹。不断公布的月度数据特别是8月份的工业增加值数据使得上半年对于经济失速下跌的担忧得到缓解。但是对于经济中长期的担忧依然存在,由此市场在上涨中结构性分化继续,以中小板和创业板为代表的成长股依然领先于以沪深300指数为代表的周期股。

就未来一个季度而言,宏观面对于今年GDP守住7.5%的目标分歧不大,市场关注的焦点将会转到对于明年经济增长的预期。IPO重启和市场资金紧张是影响市场的负面因素,此外四季度历来是风格切换的时间窗口,今年的结构性行情能否得到延续或者切换将会对明年的市场运行产生较大影响。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	464,307,906.84	92.57
	其中:股票	464,307,906.84	92.57
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	36,814,704.77	7.34
6	其他各项资产	465,986.02	0.09
7	合计	501,588,597.63	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	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	26,247,784.77	5.25
C	制造业	95,093,646.90	19.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	25,665,786.36	5.13
E	建筑业	21,244,915.39	4.25
F	批发和零售业	7,961,208.65	1.59
G	交通运输、仓储和邮政业	19,304,487.01	3.86
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,165,590.00	1.03
J	金融业	227,680,778.66	45.50
K	房地产业	35,943,709.10	7.18
L	租赁和商务服务业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	464,307,906.84	92.78

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	600016	民生银行	4,195,574	40,109,687.44	8.02
2	600036	招商银行	3,065,314	33,473,228.88	6.69
3	601166	兴业银行	2,123,285	23,717,093.45	4.74
4	601318	中国平安	622,280	22,215,396.00	4.44
5	600000	浦发银行	2,078,872	20,975,818.48	4.19
6	000002	万 科A	1,798,048	16,416,178.24	3.28
7	601328	交通银行	2,916,252	12,539,883.60	2.51
8	000651	格力电器	446,877	11,869,053.12	2.37
9	601288	农业银行	4,628,354	11,570,885.00	2.31
10	601601	中国太保	583,860	10,258,420.20	2.05

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名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名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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金合同约定本基金不能投资股指期货。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金合同尚无股指期货投资政策。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本基金投资国债期货的投资政策

本基金合同尚无国债期货投资政策。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期末本基金无国债期货投资。

5.9.3 本基金投资国债期货的投资评价

本报告期末本基金无国债期货投资。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体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。

5.10.2 报告期内,本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.10.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	122,417.88
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	86,352.34
4	应收利息	6,918.33
5	应收申购款	250,297.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	465,986.02

5.10.4 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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	614,652,125.16
本报告期基金总申购份额	97,671,761.52
减:本报告期基金总赎回份额	38,014,159.33
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	674,309,727.35

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

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。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

基金合同;

招募说明书及其定期更新;

发售公告;

成立公告;

开放日常交易业务公告;

定期报告;

其他临时公告。

8.2 存放地点

上述备查文件中基金合同、招募说明书及其定期更新、基金发售公告和基金成立公告均放置于本基金管理人及基金托管人的住所;开放日常交易业务公告、定期报告和其他临时公告放置于本基金管理人的住所。本基金管理人住所地址为:中国上海淮海中路300号香港新世界大厦40层。

8.3 查阅方式

上述文件均可到本基金管理人的住所进行查阅,也可在本基金管理人的网站进行查阅,查询网址:www.swsmu.com.

申万菱信基金管理有限公司
二〇一三年十月二十五日

新华纯债添利债券型发起式证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9月30日

基金管理人:新华基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期: 二〇一三年十月二十五日

§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2013年10月22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。

本报告期自2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	新华纯债添利债券发起
基金主代码	519152
基金运作方式	契约型开放式基金
基金合同生效日	2012年12月21日
报告期末基金份额总额	638,103,325.34份
投资目标	本基金通过对债券组合的久期、期限结构、类属品种以及单个债券进行积极主动的配置,力争在严格控制投资组合风险的同时,提高基金资产的流行性及收益率水平,为投资者提供长期稳定的投资回报。
投资策略	基金的投资策略主要包括:利率预期策略、类属品种配置策略以及证券选择策略。采用定量与定性相结合的研究方法,深入分析市场利率发展方向、期限结构变化趋势、信用主体评级水平以及单个债券的投资价值,积极主动进行类属品种配置及个券选择,谋求基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	中债新综合指数(全价)。
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金、股票型基金,高于货币市场基金。
基金管理人	新华基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
下属两级基金的基金简称	新华纯债添利债券发起A类 新华纯债添利债券发起C类
下属两级基金的交易代码	519152 519153
报告期末下属两级基金的份额总额	106,918,985.27份 531,184,340.07份

§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(2013年7月1日-2013年9月30日)	
	新华纯债添利债券发起A类	新华纯债添利债券发起C类
1.本期已实现收益	1,974,365.01	11,306,000.29
2.本期利润	782,814.87	3,524,580.21
3.加权平均基金份额本期利润	0.0063	0.0046
4.期末基金资产净值	111,094,724.35	549,784,650.32
5.期末基金份额净值	1.039	1.035

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.以上所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如基金申购费赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.基金于2012年12月21日基金合同生效。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

1.新华纯债添利债券发起A类:

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.68%	0.07%	-1.84%	0.07%	2.52%	0.00%

2.新华纯债添利债券发起C类:

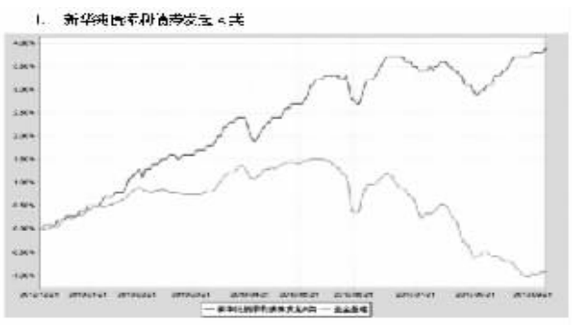
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.58%	0.07%	-1.84%	0.07%	2.42%	0.00%

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

新华纯债添利债券型发起式证券投资基金

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

(2012年12月21日至2013年9月30日)



注:1.本基金自2012年12月21日成立,至2013年9月30日披露日未满一年。

2.本基金建仓期为6个月,建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同的有关约定。

§4 管理人报告

4.1 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限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
于泽雨	本基金基金经理	2012-12-21	-	5	经济学博士,5年证券从业经验。历任华安财产保险公司债券研究员、合众人寿保险公司债券投资经理,于2012年10月加入新华基金管理有限公司,现任新华纯债添利债券型发起式证券投资基金基金经理。
贲兴振	本基金基金经理,新华灵活主题股票型证券投资基金基金经理	2012-12-21	-	6	经济学硕士,6年证券从业经验。历任北京城市系统工程研究中心研究员。贲兴振先生于2007年9月加入新华基金管理有限公司,先后负责研究煤炭、电力、金融、通信设备、电子和有色金属等行业,担任过策略分析师、债券分析师。现任新华纯债添利债券型发起式证券投资基金基金经理,新华灵活主题股票型证券投资基金基金经理。

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,新华基金管理有限公司作为新华纯债添利债券型发起式证券投资基金的管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《新华纯债添利债券型发起式证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的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。运作整体合法合规,无损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》(2011年修订),公司制定了《新华基金管理有限公司公平交易管理制度》,制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动,同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动相关的各个环节。

场内交易,投资指令统一由中央交易室下达,并且启动交易系统公平交易模块。根据公司制度,严格禁止不同投资组合之间互为对手方的交易,严格控制不同投资组合之间的同日反向交易。

场外交易中,对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等交易,中央交易室根据各投资组合经理申报的满足价格条件的数量进行比例分配,如有异议,由中央交易室提投资总监、督察长、金融工程部和监察稽核部,再次进行审核并确定最终分配结果。如果督察长认为有必要,可以召开风险管理委员会,对公平交易的结果进行评估和审议。对于银行间市场交易、固定收益平台、交易所大宗交易,投资组合经理以该投资组合的名义向中央交易室下达投资指令,中央交易室向银行间市场或交易对手询价,成交确认,并根据"时间优先、价格优先"的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期,公司对不同组合不同时间段的同向交易价差进行了溢价率样本的采集,通过平均溢价率、买入/卖出溢价率以及利益输送金额等多个层面来判断不同投资组合之间在某一时间段是否存在违反公平交易原则的异常情况,未发现重大异常情况,且不存在报告期内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成交量超过该证券当日成交量的5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

在基本面和流动性双重打压,以及利率品的一级供给冲击下,国债金融债收益率整季上行幅度较大,受利率品带动,3季度信用品市场也整体下跌,期间有短暂的两次反弹。短融中票各期限收益率全线上行,短端相对抗跌,长端调整幅度大,高等级表现好于低等级;企业债也全线上行,长端调整幅度大,中低等级的5年期品种调整幅度最大。在6月初降低仓位的基础上,本基金在7月上旬进行了进一步减仓,较纯地减少了在市场调整过程中受到的损失。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2013年9月30日,本基金A类份额净值为1.039元,本报告期份额净值增长率为0.68%,同期比较基准的增长率为-1.84%;本基金C类份额净值为1.035元,本报告期份额净值增长率为0.58%,同期比较基准的增长率为-1.84%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	935,055,377.51	96.02
	其中:债券	935,055,377.51	96.02
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	4,616,258.81	0.47
6	其他各项资产	34,114,835.23	3.50
7	合计	973,786,471.55	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

报告期末,本基金未持有股票。

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

报告期末,本基金未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	39,900,000.00	6.04
	其中:政策性金融债	39,900,000.00	6.04
4	企业债券	743,050,055.10	112.43
5	企业短期融资券	90,437,000.00	13.68
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	中小企业私募债券	61,668,322.41	9.33
9	其他	-	-
10	合计	935,055,377.51	141.49

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	124097	12宝投资	499,990	50,873,982.50	7.70
2	1280305	12合力债	500,000	50,855,000.00	7.70
2	1280162	12铁岭债	500,000	50,855,000.00	7.70
4	1280415	12驻投资债	500,000	50,610,000.00	7.66
5	124001	12漯城投	499,990	50,398,992.00	7.63

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

报告期末,本基金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名的前五名权证投资明细

报告期末,本基金未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金合同约定本基金不能投资股指期货。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金合同尚无股指期货投资政策。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本基金投资国债期货的投资政策

本基金合同尚无国债期货投资政策。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期末本基金无国债期货投资。

5.9.3 本基金投资国债期货的投资评价

本报告期末本基金无国债期货投资。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体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。

5.10.2 报告期内,本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.10.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	239,774.28
2	应收证券清算款	2,455,382.74
3	应收股利	-
4	应收利息	30,920,378.21
5	应收申购款	499,300.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	34,114,835.23

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末,本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金合同约定本基金不能投资股票。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	新华纯债添利债券发起A类	新华纯债添利债券发起C类
本报告期期初基金份额总额	140,500,029.95	909,825,647.42
本报告期基金总申购份额	9,137,999.37	342,018,812.16
减:本报告期基金总赎回份额	42,719,044.05	720,660,119.51
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	106,918,985.27	531,184,340.07

§7 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	9,999,900.00	1.57%	9,999,900.00	1.57%	3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	
基金经理等人员	-	-	-	-	
基金管理人股东	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	9,999,900.00	1.57%	9,999,900.00	1.57%	

§8 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期本基金未有影响投资者决策的其他重要信息

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

(一)中国证监会批准新华纯债添利债券型发起式证券投资基金募集的文件

(二)关于申请募集新华纯债添利债券型发起式证券投资基金之法律意见书

(三)《新华纯债添利债券型发起式证券投资基金托管协议》

(四)《新华纯债添利债券型发起式证券投资基金合同》

(五)《新华基金管理有限公司开放式基金业务规则》

(六)更新的《新华纯债添利债券型发起式证券投资基金招募说明书》

(七) 基金管理人业务资格批件、营业执照的公司章程

(八) 基金托管人业务资格批件及营业执照

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件,或通过本基金管理人网站查阅。

新华基金管理有限公司
二〇一三年十月二十五日

申万菱信沪深300指数增强型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9月30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
报告送出日期: 二〇一三年十月二十五日

§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2013年10月23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。

本报告期自2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	申万菱信沪深300指数增强
基金主代码	310318
交易代码	310318
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年6月7日
报告期末基金份额总额	50,149,667.86份
投资目标	本基金为增强型指数基金,通过数量化的投资方法与严格的投资纪律约束,力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%,年化跟踪误差不超过7.75%,同时力求实现超越标的指数的业绩表现,谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金在指数化投资的基础上通过数量化模型进行投资组合优化,在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下,力争获得超越标的指数的投资收益。
业绩比较基准	95%×沪深300指数收益率+1.5%(指年收益率,评价时按照回折算)。
风险收益特征	本基金为增强型指数基金,具有较高预期风险、较高预期收益的特征,其预期风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。
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(2013年7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	2,021,250.50
2.本期利润	4,354,036.11
3.加权平均基金份额本期利润	0.0847
4.期末基金资产净值	52,577,975.12
5.期末基金份额净值	1.0484

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 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

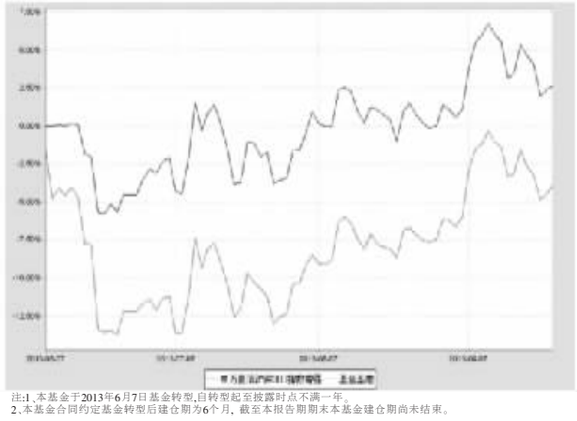
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	7.55%	1.29%	9.42%	1.36%	-1.87%	-0.07%

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

申万菱信沪深300指数增强型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2013年6月7日至2013年9月30日)



注:1.本基金于2013年6月7日基金转型,自转型起至披露时点不满一年。

2.本基金合同约定基金转型后建仓期为6个月,截至本报告期期末本基金建仓期尚未结束。

§4 管理人报告

4.1 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限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘忠勋	本基金基金经理	2013-5-29	-	7年	刘忠勋先生,上海大学经济学硕士,曾任职于华泰证券股份有限公司,2008年加入本公司,历任金融工程师、产品与金融工程总部总监助理、副总监(主持工作)。现任申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)、申万菱信沪深300指数增强型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。

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