

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
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...

申万菱信定期开放债券型发起式证券投资基金

2013 年度 报告摘要

2013年 12月 31日

Table with 2 columns: Section (e.g., 2.1 基金基本情况, 2.2 基金产品说明) and Content.

2013年的债券市场呈现为两个阶段,第一阶段是从时间上看是年初至4月份;第二个阶段从5月至年末... 本基金于2013年3月29日成立,基于当时市场资金非常紧张,债券收益率处于历史低位位的现实情况...

3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

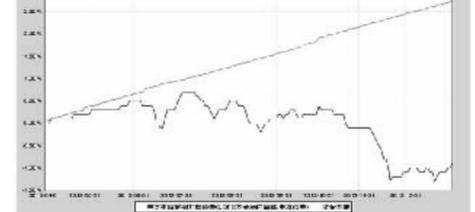
Table with 2 columns: Section (e.g., 3.1 主要会计数据和财务指标) and Content.

3.1.1 期间数据和指标 2013年3月29日 基金合同生效日 2013年12月31日
本期利润总额 16,584,409.18
本期净利润 -15,207,478.72

3.1.2 期末数据和指标 2013年末
期末可供分配基金份额净值 1.396,175.8631
期末基金份额净值 1.396,175.8631

3.2 基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
过去三个月 -1.01% 0.09% 0.91% 0.00% -2.01% 0.09%
过去六个月 -1.20% 0.08% 1.81% 0.00% -3.01% 0.08%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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
自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
2013年3月29日至2013年12月31日



注:1)自基金合同生效以来,本基金运作未满一年。
2)本基金主要投资于固定收益类品种,包括国债、地方政府债、金融债、企业债、可转债、中期票据、短期融资券、次级债、资产支持证券、中期票据、债券回购、同业存单等,以及法律法规允许基金投资的其它金融工具...

3.2.3 自基金合同生效以来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
自基金合同生效以来基金每年净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

4 管理人报告
4.1 基金管理人及基金管理人简介
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国证券股份有限公司和中国工商银行股份有限公司共同设立的一家中外合资基金管理公司...

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人履行职责情况
本报告期内,本托管人在为申万菱信定期开放债券型发起式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...

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规性、净值计算、利润分配等情况的说明
本报告期内,申万菱信定期开放债券型发起式证券投资基金的托管人——申万菱信基金管理有限公司在申万菱信定期开放债券型发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值、基金份额净值等方面恪尽职守,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为...

5.3 托管人对本报告期内基金信息真实、准确和完整发表意见
本托管人根据对申万菱信基金管理有限公司编制的申万菱信定期开放债券型发起式证券投资基金2013年度财务报表、净值表现、利润分配、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

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
申万菱信定期开放债券型发起式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定期开放债券型发起式证券投资基金(以下简称“申万菱信定期开放债券基金”)的财务报表,包括2013年12月31日的资产负债表,2013年1月1日至2013年12月31日止期间的利润表和所有者权益变动表以及财务报表附注。

6.1 管理层的责任
编制和公允列报财务报表是申万菱信定期开放债券基金的基金管理人(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”)发布的有关规定及允许的基金行业业务操作规范编制财务报表,并确保财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
(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旨在降低审计风险,但并不保证能够发现所有重大错报。审计工作包括对财务报表中的数字、会计政策和会计估计的恰当性和披露的完整性,以及评价财务报表的总体列报。

6.3 审计意见
我们认为,上述申万菱信定期开放债券基金在所有重大方面按照企业会计准则和财务报表附注中所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业业务操作规范,公允反映了申万菱信定期开放债券基金 2013年12月31日的财务状况以及2013年1月1日至2013年12月31日止期间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)
注册会计师:薛亮
注册会计师:陈淑波
上海市陆家嘴环路1318号星展银行大厦10楼

7 年度财务报表

7.1 资产负债表
单位:人民币元
资产 2013年12月31日
银行存款 456,732,140.50
结算备付金 1,620,049.51
存出保证金 35,780.30
应收利息 1,343,516,141.30
基金投资 1,343,516,141.30
基金投资公允价值变动 1,343,516,141.30
资产支持证券 0.00
衍生金融资产 0.00
买入返售金融资产 0.00
应收债券利息 25,778,794.81
应收股利 0.00
应收申购款 0.00
其他应收款 0.00
其他流动资产 0.00
其他资产 1,827,702,922.02
负债和所有者权益 2013年12月31日

7.2 利润表
单位:人民币元
项目 本期 2013年12月31日
一、营业收入 3,725,042.17
1.利息收入 10,424,189.34
2.投资收益 17,902,804.21
3.公允价值变动损益 1,400,000.00
4.其他收入 1,308,048.62
二、营业费用 9,241.00
三、利润总额 345,772.13
四、所得税费用 812,423.81
五、净利润 -466,651.68
六、每股收益 0.00
七、其他综合收益 812,423.81
八、综合收益总额 445,770.53

7.3 所有者权益变动表
单位:人民币元
项目 本期 2013年12月31日
基金份额持有人权益 1,611,383,742.33
其中:基金份额持有人权益 1,611,383,742.33
未分配利润 -466,651.68
所有者权益合计 1,610,917,090.65

7.4 现金流量表
单位:人民币元
项目 本期 2013年12月31日
一、经营活动产生的现金流量:
1.收到的利息收入 10,424,189.34
2.收到的投资收益 17,902,804.21
3.收到的其他收入 1,308,048.62
4.支付的各项费用 9,241.00
5.支付的其他与经营活动有关的现金 -19,036,846.86
经营活动产生的现金流量净额 1,008,044.43
二、筹资活动产生的现金流量:
1.发行基金收到的现金 1,611,383,742.33
2.发行基金收到的其他款项 1,611,383,742.33
3.发行基金收到的其他款项 -1,611,383,742.33
4.发行基金收到的其他款项 -1,611,383,742.33
5.发行基金收到的其他款项 -1,611,383,742.33
筹资活动产生的现金流量净额 0.00
三、投资活动产生的现金流量:
1.购买金融资产支付的现金 -1,343,516,141.30
2.购买金融资产支付的现金 -1,343,516,141.30
3.购买金融资产支付的现金 -1,343,516,141.30
4.购买金融资产支付的现金 -1,343,516,141.30
5.购买金融资产支付的现金 -1,343,516,141.30
投资活动产生的现金流量净额 -1,343,516,141.30
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响 0.00
五、现金及现金等价物净增加额 -338,096.87
六、期初现金及现金等价物余额 1,611,383,742.33
七、期末现金及现金等价物余额 1,273,286,865.46

7.5 关联方交易
7.5.1 关联方交易
7.5.2 关联方交易
7.5.3 关联方交易

7.6 关联方交易
7.6.1 关联方交易
7.6.2 关联方交易
7.6.3 关联方交易

7.7 关联方交易
7.7.1 关联方交易
7.7.2 关联方交易
7.7.3 关联方交易

7.8 关联方交易
7.8.1 关联方交易
7.8.2 关联方交易
7.8.3 关联方交易

7.9 关联方交易
7.9.1 关联方交易
7.9.2 关联方交易
7.9.3 关联方交易

7.10 关联方交易
7.10.1 关联方交易
7.10.2 关联方交易
7.10.3 关联方交易

7.11 关联方交易
7.11.1 关联方交易
7.11.2 关联方交易
7.11.3 关联方交易

7.12 关联方交易
7.12.1 关联方交易
7.12.2 关联方交易
7.12.3 关联方交易

7.13 关联方交易
7.13.1 关联方交易
7.13.2 关联方交易
7.13.3 关联方交易

7.14 关联方交易
7.14.1 关联方交易
7.14.2 关联方交易
7.14.3 关联方交易

7.15 关联方交易
7.15.1 关联方交易
7.15.2 关联方交易
7.15.3 关联方交易

7.16 关联方交易
7.16.1 关联方交易
7.16.2 关联方交易
7.16.3 关联方交易

7.17 关联方交易
7.17.1 关联方交易
7.17.2 关联方交易
7.17.3 关联方交易

7.18 关联方交易
7.18.1 关联方交易
7.18.2 关联方交易
7.18.3 关联方交易

7.19 关联方交易
7.19.1 关联方交易
7.19.2 关联方交易
7.19.3 关联方交易

7.20 关联方交易
7.20.1 关联方交易
7.20.2 关联方交易
7.20.3 关联方交易

7.21 关联方交易
7.21.1 关联方交易
7.21.2 关联方交易
7.21.3 关联方交易

7.22 关联方交易
7.22.1 关联方交易
7.22.2 关联方交易
7.22.3 关联方交易

7.23 关联方交易
7.23.1 关联方交易
7.23.2 关联方交易
7.23.3 关联方交易

7.24 关联方交易
7.24.1 关联方交易
7.24.2 关联方交易
7.24.3 关联方交易

7.4.9.3 交易对手市场公允价值
截至本报告期末2013年12月31日止,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额220,000,000.00元,先后于2014年1月3日全部到期,该类交易要求本基金在质押式回购转入质押券的债券,于证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

7.4.10 公允价值
7.4.10.1 公允价值
7.4.10.2 公允价值

7.4.10.3 公允价值
7.4.10.4 公允价值

7.4.10.5 公允价值
7.4.10.6 公允价值

7.4.10.7 公允价值
7.4.10.8 公允价值

7.4.10.9 公允价值
7.4.10.10 公允价值

7.4.10.11 公允价值
7.4.10.12 公允价值

7.4.10.13 公允价值
7.4.10.14 公允价值

7.4.10.15 公允价值
7.4.10.16 公允价值

7.4.10.17 公允价值
7.4.10.18 公允价值

7.4.10.19 公允价值
7.4.10.20 公允价值

7.4.10.21 公允价值
7.4.10.22 公允价值

7.4.10.23 公允价值
7.4.10.24 公允价值

7.4.10.25 公允价值
7.4.10.26 公允价值

7.4.10.27 公允价值
7.4.10.28 公允价值

7.4.10.29 公允价值
7.4.10.30 公允价值

7.4.10.31 公允价值
7.4.10.32 公允价值

7.4.10.33 公允价值
7.4.10.34 公允价值

7.4.10.35 公允价值
7.4.10.36 公允价值

7.4.10.37 公允价值
7.4.10.38 公允价值

7.4.10.39 公允价值
7.4.10.40 公允价值

7.4.10.41 公允价值
7.4.10.42 公允价值

7.4.10.43 公允价值
7.4.10.44 公允价值

7.4.10.45 公允价值
7.4.10.46 公允价值

7.4.10.47 公允价值
7.4.10.48 公允价值

7.4.10.49 公允价值
7.4.10.50 公允价值

7.4.10.51 公允价值
7.4.10.52 公允价值

7.4.10.53 公允价值
7.4.10.54 公允价值

7.4.10.55 公允价值
7.4.10.56 公允价值

7.4.10.57 公允价值
7.4.10.58 公允价值

7.4.10.59 公允价值
7.4.10.60 公允价值

7.4.10.61 公允价值
7.4.10.62 公允价值

7.4.10.63 公允价值
7.4.10.64 公允价值

7.4.10.65 公允价值
7.4.10.66 公允价值

7.4.10.67 公允价值
7.4.10.68 公允价值

7.4.10.69 公允价值
7.4.10.70 公允价值

7.4.10.71 公允价值
7.4.10.72 公允价值

7.4.10.73 公允价值
7.4.10.74 公允价值

7.4.10.75 公允价值
7.4.10.76 公允价值

7.4.10.77 公允价值
7.4.10.78 公允价值

7.4.10.79 公允价值
7.4.10.80 公允价值

7.4.10.81 公允价值
7.4.10.82 公允价值

7.4.10.83 公允价值
7.4.10.84 公允价值

7.4.10.85 公允价值
7.4.10.86 公允价值

7.4.10.87 公允价值
7.4.10.88 公允价值

7.4.10.89 公允价值
7.4.10.90 公允价值