# 申万菱信新动力混合型证券投资基金

## 2015 年度 报告摘要

2015年12月31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:二〇一六年三月三十日

§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2016年3月23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2015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 | 申万菱信新动力混合 |
| 基金主代码 | 310328 |
| 交易代码 | 310328 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2005年11月10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 | 1,259,247,185.90份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金通过投资受益于促进国民经济持续增长的新动力而具有高成长性和持续盈利增长潜力的上市公司,有效分享中国经济快速持续增长的成果;通过采用积极主动的分散化投资策略,在严密控制投资风险的前提下,保持基金资产的持续增值,为投资者获取超过业绩基准的收益。 |
| 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.本基金采用双线并行的组合投资策略,‘自上而下’地进行证券品种的一级资产配置,‘自下而上’地精选个股。基于基础性宏观研究,由投资总监和基金经理首先提出初步的一级资产配置比例;同时,根据本基金管理人自主开发的主动式资产配置模型—AAAM(Active Asset Allocation Model)提示的一级资产配置建议方案,在进行综合的对比分析和评估后作出一级资产配置方案.通过基本面分析、综合分析影响企业持续发展的动力因素和其目身发展环境因素和市场分析,组合投资有高成长性和具备持续发展能力的上市公司股票,经严格的风险管理后,争取持续稳定的经风险调整后的优良回报.在本基金的投资管理过程中,基金管理人将跟随中国经济的发展,分析各个阶段中国经济的发展环境,对持续成长动力评估体系中的新动力指标和各指标评分权重进行适时地调整,以更适合当时的基金投资环境并挖掘各个阶段的最具持续成长性的上市公司股票进行投资。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数×80%+中债总指数(全价)收益率×20%。 |
| 风险收益特征 | 本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金,其风险和预期收益均高于平衡型基金,属于证券投资基金中的中高风险品种.本基金力争通过资产配置、精选个股等投资策略的实施和积极的风险管理而谋求中长期的较高收益。 |

注:鉴于中信标普指数信息服务(北京)有限公司终止维护和发布中信标普国债指数,按照本基金基金合同的约定,本基金管理人经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致,并报中国证监会备案后,自2015年9月30日起,将本基金的业绩比较基准由“沪深300指数*80%+中信标普国债指数收益率*20%”变更为“沪深300指数×80%+中债总指数(全价)收益率×20%”。

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 | 蒋松云 |
| | 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 | 2015年 | 2014年 | 2013年 |
|---|---|---|---|
| 本期已实现收益 | 1,208,694,631.05 | 379,933,007.91 | 242,686,870.64 |
| 本期利润 | 721,203,488.81 | 907,004,712.81 | 206,208,185.40 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.3720 | 0.2277 | 0.0499 |
| 本期基金份额净值增长率 | 26.18% | 38.25% | 9.18% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2015年末 | 2014年末 | 2013年末 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.5319 | 0.0329 | -0.0636 |
| 期末基金资产净值 | 1,363,410,773.81 | 3,240,857,268.10 | 2,779,245,334.62 |
| 期末基金份额净值 | 1.0827 | 0.8750 | 0.6329 |

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③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 19.57% | 1.61% | 13.67% | 1.34% | 5.90% | 0.27% |
| 过去六个月 | -8.41% | 2.88% | -12.67% | 2.14% | 4.26% | 0.74% |
| 过去一年 | 26.18% | 2.60% | 6.51% | 1.99% | 19.67% | 0.61% |
| 过去三年 | 90.46% | 1.76% | 41.32% | 1.44% | 49.14% | 0.32% |
| 过去五年 | 42.35% | 1.61% | 36.68% | 1.27% | 5.67% | 0.34% |
| 自基金合同生效起至今 | 337.31% | 1.76% | 285.31% | 1.51% | 52.00% | 0.25% |

注:自基金合同生效日至2015年9月29日,本基金的业绩基准指数=沪深300指数*80%+中信标普国债指数收益率*20%。其中:沪深300指数作为衡量股票投资部分的业绩基准,中信标普国债指数作为衡量基金债券投资部分的业绩基准。中证系列指数中,沪深300指数的市场代表性比较强,比较适合作为本基金股票投资的比较基准。中信标普国债指数由中信标普指数信息服务有限公司发布,是中信标普债券系列指数中的一员,该指数市场影响力大,被基金业广泛用作衡量债券投资收益的评价基准。

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)=80%*(沪深300指数(t)/沪深300指数(t-1)-1)+20%*(中信标普国债指数(t)/中信标普国债指数(t-1)-1);

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

其中t=1,2,3,…

自2015年9月30日起,本基金的业绩比较基准由“沪深300指数*80%+中信标普国债指数收益率*20%”变更为“沪深300指数×80%+中债总指数(全价)收益率×20%”。

其中:沪深300指数作为衡量股票投资部分的业绩基准,中债总指数(全价)作为衡量基金债券投资部分的业绩基准。沪深300股票指数由中证指数有限公司编制并发布,是由沪深A股中规模大、流动性好的最具代表性的300只股票组成,于2005年4月8日正式发布,以综合反映沪深A股市场整体表现。

中国债券总指数由中央国债登记结算公司编制并发布,首先从发布主体上保证中国债券总指数比较客观和专业;第二,本基金以中国债券总指数(全价)为业绩比较基准,是由于全价指数是以债券全价计算的指数值,债券付息后利息不再计入指数之中,比较科学且更切合实际。

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)=80%*(沪深300指数(t)/沪深300指数(t-1)-1)+20%*(中债总指数(全价)(t)/中债总指数(全价)(t-1)-1);

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

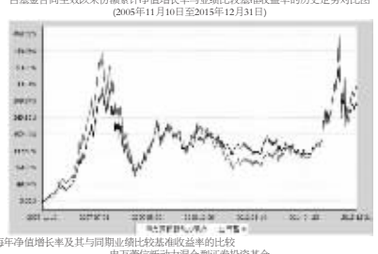
其中t=1,2,3,…"

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

申万菱信新动力混合型证券投资基金

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

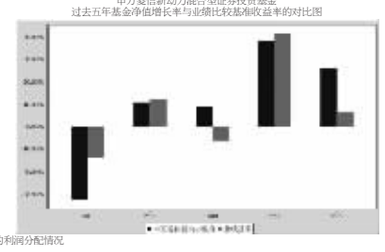
(2005年11月10日至2015年12月31日)



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

申万菱信新动力混合型证券投资基金

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 |
|---|---|---|---|---|---|
| 2013年 | - | - | - | - | - |
| 2014年 | - | - | - | - | - |
| 2015年 | 0.165 | 29,213,816.51 | 27,677,642.31 | 56,891,458.82 | - |
| 合计 | 0.165 | 29,213,816.51 | 27,677,642.31 | 56,891,458.82 | - |

§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2015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23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近500亿元,客户数超过560万户。

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 | | |
| 李大刚 | 本基金基金经理 | 2015-09-18 | - | 11年 | 李大刚先生,管理学硕士,2004年开始从事证券相关工作,曾任职于中信建投证券研究所,安信证券研究所,2011年1月加入申万菱信基金管理有限公司,历任行业研究员,节能环保研究组组长,现任申万菱信新能源汽车主题灵活配置混合型证券投资基金、申万菱信新动力混合型证券投资基金基金经理。 |
| 蒲延杰 | 本基金基金经理助理 | 2015-09-30 | - | 5年 | 蒲延杰先生,金融学博士,2009年开始从事金融相关工作,历任中国工商银行组合经理,瑞银证券策略研究员。2015年7月加入申万菱信基金管理有限公司,现任高级研究员,申万菱信新动力混合型证券投资基金基金经理助理。 |
| 章锦涛 | 本基金基金经理助理 | 2011-06-01 | - | 9年 | 章锦涛先生,金融学硕士,2006年开始从事金融工作,历任国泰君安证券研究所研究员,2009年3月加入本公司,现任研究总部副总监(主持工作),申万菱信新动力混合型证券投资基金基金经理助理。 |
| 欧庆铃 | 本基金原基金经理 | 2011-11-22 | 2015-09-21 | 16年 | 欧庆铃先生,理学博士,曾任职于广州证券研究中心、金鹰基金管理有限公司,万家基金管理有限公司等,2011年加入本公司,曾任公司副总经理、投资总监、申万菱信消费增长股票型证券投资基金基金经理、申万菱信新动力混合型证券投资基金基金经理。 |
| 孙琳 | 本基金原基金经理 | 2014-01-29 | 2015-06-04 | 9年 | 孙琳女士,经济学学士,2004年开始从事证券相关工作,曾先后任职于浙江中都控股集团,任职于中信金通证券研究所,2009年5月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、申万菱信客户优势混合型证券投资基金、申万菱信消费增长混合型证券投资基金基金经理。 |

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,欧庆铃、孙琳不再担任本基金基金经理,本基金由李大刚继续管理,具体见本基金管理人的相关公告。

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,并通过有建经营、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和对独立性的同时,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,通过实行集中交易的公平交易方式,对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以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,价差交易模拟营利、组合收益率差异和模拟输送比例三项业绩率考核的比例等指标;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 管理人对报告期内基金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

2015年在流动性宽松、信息技术革命周期、国企改革等因素驱动下,上半年A股市场呈现出较快速度、较大幅度的上升,市场以各种方式对现有投资标的进行了重估,其中,以创业板最为领先。下半年,受严格场外配资的影响,市场流动性受到了边际上的影响,出现了快速的下跌,2015年市场呈现出现了宽幅震荡的格局。报告期内,本基金的配置结构相对均衡,在2015年初卖出了涨幅很大的非银金融股和银行股,增加了商业零售股、房地产股、建筑园林股配置;对于新兴产业类成长股,在风险收益比匹配的情况下进行了相关投资;但是,在6月份股市调整的过程中,由于流动性缺失,本基金亦未能规避相关的风险。四季度,在市场反弹的情况下,本基金在市场上涨过程中,进行了相关的结构调整,减持了相关涨幅较大的股票,增持了银行、医药、白酒等相关防御性品种,使得投资组合区域均衡。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本基金报告期内净值表现为26.18%,同期业绩比较基准表现为6.51%。

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2016年,受经济转型影响,在内生性短津及国家宏观政策对冲的作用下,经济总量将会呈现出震荡趋稳的态势.从内部结构来看,出口、消费将会保持平稳,投资仍将保持下降态势;分类别来看,以重工业为代表的旧经济将会出现明显的下降,以信息技术为代表的新经济仍将保持快速增长。

§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新动力混合型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,申万菱信新动力混合型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新动力混合型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,申万菱信新动力混合型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56,891,458.82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新动力混合型证券投资基金2015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(2016)第 21633号

申万菱信新动力混合型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新动力混合型证券投资基金(原申万菱信新动力股票型证券投资基金",以下简称“申万菱信新动力基金")的财务报表,包括 2015年12月31日的资产负债表、2015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新动力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,上述申万菱信新动力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新动力基金2015年12月31日的财务状况以及2015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)
注册会计师 陈玲
注册会计师 赵钰
上海市陆家嘴环路1318号星展银行大厦6层

2016年3月28日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:申万菱信新动力混合型证券投资基金

报告截止日:2015年12月31日

单位:人民币元

| 资产 | 本期末 2015年12月31日 | 上年度末 2014年12月31日 |
|---|---|---|
| 资产: | - | - |
| 银行存款 | 246,586,296.31 | 307,122,628.91 |
| 结算备付金 | 2,607,722.67 | 5,114,010.00 |
| 存出保证金 | 659,469.57 | 876,725.29 |
| 交易性金融资产 | 1,098,688,335.37 | 2,902,065,922.41 |
| 其中:股票投资 | 1,088,546,335.37 | 2,606,905,922.41 |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 10,142,000.00 | 295,160,000.00 |
| 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 | 18,462,588.16 | 35,000,048.43 |
| 应收利息 | 2,496,686.00 | 10,314,575.41 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | 30,611.49 | 401,810.81 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 1,369,531,709.57 | 3,260,895,721.26 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 2015年12月31日 | 上年度末 2014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 | 675.00 | - |
| 应付赎回款 | 1,728,206.34 | 11,384,843.37 |
| 应付管理人报酬 | 1,730,307.23 | 3,963,466.08 |
| 应付托管费 | 288,384.55 | 660,577.67 |
| 应付销售服务费 | - | - |
| 应付交易费用 | 1,635,441.10 | 3,290,616.01 |
| 应交税费 | - | - |
| 应付利息 | - | - |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 737,921.54 | 738,950.03 |
| 负债合计 | 6,120,935.76 | 20,038,453.16 |
| 所有者权益: | - | - |
| 实收基金 | 693,560,000.92 | 2,040,003,489.62 |
| 未分配利润 | 669,850,772.89 | 1,200,853,778.48 |
| 所有者权益合计 | 1,363,410,773.81 | 3,240,857,268.10 |
| 负债和所有者权益总计 | 1,369,531,709.57 | 3,260,895,721.26 |

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值1.0827元,基金份额总额1,259,247,185.90份。

7.2 利润表

会计主体:申万菱信新动力混合型证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2015年1月1日至2015年12月31日 | 上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日 |
|---|---|---|
| 一、收入 | 775,503,648.47 | 965,947,171.41 |
| 1.利息收入 | 6,961,369.31 | 9,516,419.18 |
| 其中:存款利息收入 | 1,853,896.96 | 2,981,508.81 |
| 债券利息收入 | 4,967,194.65 | 6,083,088.60 |
| 资产支持证券利息收入 | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | 140,277.70 | 451,821.77 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益(损失以“-”填列) | 1,254,485,476.81 | 428,851,103.77 |
| 其中:股票投资收益 | 1,283,145,928.39 | 392,319,779.05 |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | -39,426,726.14 | 5,798,743.02 |
| 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 | 10,766,274.56 | 30,732,581.70 |
| 3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列) | -487,491,142.24 | 527,071,704.90 |
| 4.汇兑收益(损失以“-”号填列) | - | - |
| 5.其他收入(损失以“-”号填列) | 1,547,944.59 | 507,943.56 |
| 减:二、费用 | 54,300,159.66 | 58,942,458.60 |
| 1. 管理人报酬 | 29,538,856.21 | 38,254,409.58 |
| 2. 托管费 | 4,923,142.72 | 6,375,734.84 |
| 3. 销售服务费 | - | - |
| 4. 交易费用 | 19,153,033.86 | 13,867,311.90 |
| 5. 利息支出 | 244,982.40 | - |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | 244,982.40 | - |
| 6. 其他费用 | 440,144.47 | 445,002.28 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | 721,203,488.81 | 907,004,712.81 |
| 减:所得税费用 | - | - |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | 721,203,488.81 | 907,004,712.81 |

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:申万菱信新动力混合型证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

| 项目 | 本期 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) | 2,040,003,489.62 | 1,200,853,778.48 | 3,240,857,268.10 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 721,203,488.81 | 721,203,488.81 |
| 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) | -1,346,443,488.70 | -1,195,315,035.58 | -2,541,758,524.28 |
| 其中:1.基金申购款 | 457,941,589.28 | 429,594,406.23 | 887,535,995.51 |
| 2.基金赎回款 | -1,804,385,077.98 | -1,624,909,441.81 | -3,429,294,519.79 |
| 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) | - | -56,891,458.82 | -56,891,458.82 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 693,560,000.92 | 669,850,772.89 | 1,363,410,773.81 |

| 项目 | 上年度可比期间 2014年1月1日至2014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) | 2,418,721,291.17 | 360,524,043.45 | 2,779,245,334.62 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 907,004,712.81 | 907,004,712.81 |
| 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) | -378,717,801.55 | -66,674,977.78 | -445,392,779.33 |
| 其中:1.基金申购款 | 399,412,606.11 | 76,212,000.36 | 475,624,606.47 |
| 2.基金赎回款 | -778,130,407.66 | -142,886,978.14 | -921,017,385.80 |
| 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) | - | - | - |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 2,040,003,489.62 | 1,200,853,778.48 | 3,240,857,268.10 |

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:过振华,主管会计工作负责人:过振华,会计机构负责人:李薇君

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

申万菱信新动力混合型证券投资基金(原名为申万菱信新动力股票型证券投资基金,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[2005]159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《申万巴黎新动力股票型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669,540,171.18元,业经德勤华永会计师事务所有限公司德师报(验)字(05)第0043号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《申万巴黎新动力股票型证券投资基金基金合同》于2005年11月10日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为669,603,085.69份基金份额,其中认购资金利息折合63,814.51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更换股权、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31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,将申万巴黎新动力股票型证券投资基金更名为申万菱信新动力股票型证券投资基金,并于2011年4月6日公告。

根据2014年中国证监会令第104号《公开募集证券投资基金运作管理办法》,申万菱信新动力股票型证券投资基金于2015年7月23日公告后更名为申万菱信新动力混合型证券投资基金。

根据《申万巴黎新动力股票型证券投资基金招募说明书》和《关于申万巴黎新动力股票型证券投资基金基金份额拆分比例的公告》的有关规定,本基金于2007年4月18日进行了基金份额拆分,拆分比例为1:1.815664620(保留到小数点后9位),并于2007年4月19日进行了变更登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《申万菱信新动力混合型证券投资基金基金合同》和最新公布的《申万菱信新动力混合型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:具有良好流动性的金融工具,包括在中华人民共和国境内依法发行和上市交易的各类股票、债券、货币市场工具以及经中国证监会批准的允许证券投资基金投资的其他金融工具。资产配置比例为:股票60%至95%,其中投资于受益于促进国民经济持续增长的新动力而具有高成长性和持续盈利增长潜力的上市公司股票的比例不低于80%;债券5%至40%,其中现金和到期日在一年以内的政府债券为基金净资产的5%以上。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 X 80%+中信标普国债指数收益率 X 20%。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新动力混合型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X 80%+中债总指数(全价)收益率X 20%

本财务报表由本基金的基金管理人申万菱信基金管理有限公司于2016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》、《申万菱信新动力混合型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2015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2015年12月31日的财务状况以及2015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不一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内本基金会计政策未发生变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息,本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值

7.4.5.3 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[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。