申万菱信新经济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	申万菱信新经济混合
基金主代码	310358
交易代码	310358
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年12月6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	1,352,417,467.09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社会和谐发展的具有高成长性和合理价值性的上市公司股票，有效分享中国社会和谐发展的经济成果。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	本基金继续秉承基金管理人擅长的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和和行业配置，'自下而上'地精选个股。基于基础性的宏观研究和判断，并利用主动式资产配置模型结合市场情况和历史数据分析进行一级资产配置，即在股票和固定收益证券的投资比例上进行配置。从股票的基本面分析、'社会和谐发展影响综合评估体系'对企业所处发展外部环境因素等方面进行综合评价，并根据股票的市场价量表现直接定位到个股，筛选受益于中国社会和谐发展具有高成长性并且具备合理价值性的股票，构建股票组合。根据固定收益证券的类别、市场和久期进行债券配置以及具体个券的选择。
业绩比较基准	沪深300指数*85%＋金融同业存款利率*15%
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。

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 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	1,206,908,564.42	579,334,579.91	403,003,296.86
本期利润	1,377,759,158.59	277,487,460.64	615,787,473.41
加权平均基金份额本期利润	0.6017	0.0616	0.1230
本期基金份额净值增长率	35.77%	8.78%	21.97%
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	0.0160	-0.2517	-0.3121
期末基金资产净值	1,374,018,407.79	2,944,641,101.12	3,440,437,129.94
期末基金份额净值	1.0160	0.7483	0.6879

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	32.14%	2.11%	14.01%	1.42%	18.13%	0.69%
过去六个月	-12.03%	3.22%	-13.74%	2.28%	1.71%	0.94%
过去一年	35.77%	2.95%	5.87%	2.11%	29.90%	0.84%
过去三年	80.14%	1.99%	40.06%	1.52%	40.08%	0.47%
过去五年	36.74%	1.69%	20.24%	1.36%	16.50%	0.33%
自基金合同生效起至今	136.91%	1.78%	85.15%	1.65%	51.76%	0.13%

注：本基金的业绩基准指数=沪深300 指数*85%＋金融同业存款利率*15%。其中：沪深300指数作为衡量股票投资部分的业绩基准，金融同业存款利率作为非股票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。而本基金在一般市场情况下主要集中于股票的投资，非股票资产只是进行保持较高流动性的固定收益证券投资，故金融同业存款利率比较适合作为本基金的非股票投资的比较基准。

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；

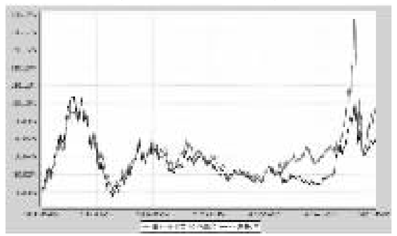
%benchmark(t)=85%*(沪深300指数(t)/沪深300指数(t-1)-1)+15%*金融同业存款利率；

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

其中t=1,2,3,...。

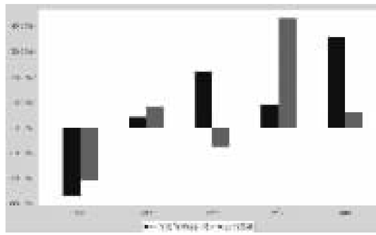
3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

申万菱信新经济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
(2006年12月6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

申万菱信新经济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

本基金过去三年未进行利润分配。

§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		
孙琳	本基金基金经理	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、申万菱信竞争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。
徐爽	本基金原基金经理	2010-08-17	2015-06-16	10年	徐爽女士，经济学硕士。曾任职于上海融昌资产管理公司。2005至2015年任职于本公司，历任权益投资部总经理，申万菱信盛利精选证券投资基金、申万菱信新经济混合型证券投资基金、申万菱信消费增长股票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，徐爽不再担任本基金基金经理，本基金由孙琳继续管理，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

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

报告期内，股票市场整体保持上涨，综合全年来看，以创业板为主的成长风格股票表现明显强于大盘股为代表的价值风格品种。从行业细分角度，计算机、轻工制造以及纺织服装涨幅靠前。在政策友好、流动性整体宽松的宏观背景下，2015年创新成长是A股市场的主要驱动因素。下半年由于对场外配资及投资杠杆的清查，叠加宏观经济持续下行、人民币汇率贬值等因素，A股市场出现了较大幅度的调整。全年来看，基金管理人继续维持成长风格选股思路，配置重点在传媒、旅游、社会服务、智能制造等创新成长行业。在市场面临系统性风险情况下，基金调整维持较低仓位，并且将持仓集中至优质公司品种上，针对前期表现较好的主题性公司进行了适当减仓。

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35.77%，同期业绩比较基准表现为5.87%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2015年的经济处于明显的"量价齐跌"型的"衰退"环境下，从"量"的方面来考量，GDP同比增速从2014年的7.3%逐步下滑到7%以下，工业增加值和工业企业利润也大幅下滑；从"价"的角度观察，全年PPI均处于负增长区间，年中CPI由于猪周期的原因短期上行过，但"拿掉猪以后都是通缩"，全年来看CPI低位震荡，经济紧缩风险不容忽视。

展望2016年宏观环境，流动性相对2015年将呈现一个偏紧的环境，而随着发达国家经济企稳回升，人民币汇率将面临较大的挑战，改革进入深水区以及供给侧改革与保增长的矛盾将显著降低市场的风险偏好。供给侧改革从理论上看，虽能释放经济活力，提振生产效率，但是"去产能"过程可能会带来短期的经济和社会的阵痛（企业破产、员工下岗、信用违约等）。因此基金管理人认为，在市场能够看到"供给侧改革"与"保增长"的矛盾能够解决的明显信号之前，风险偏好可能会持续受到压制。尽管市场持续震荡可能性较大，但是基金管理人认为，高景气度的新兴行业仍是长期投资的重要方向。创新是十三五规划的第一理念，在谨慎选择、均衡配置、控制仓位的整体思路下，基金管理人将坚持创新、转型的方向不变，在受益于人口结构改善、消费升级、技术升级等新兴产业领域精选配置可以获得超额收益的个股。

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，即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，分管基金运营的副总经理，基金运营总部、监察稽核总部、投资管理总部，风险管理总部等各总部总监组成。其中，总经理过振华先生，直接分管基金运营，拥有11年基金行业高级管理人员经验；基金运营总部总监李濮君女士，拥有14年的基金会计经验；监察稽核总部副总监牛锐女士(主持工作)，拥有近11年的证券基金行业合规管理经验；投资管理总部总监张少华先生，拥有近12年的基金行业研究、投资和风险管理相关经验；风险管理总部总监王瑾怡女士，拥有近10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

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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新经济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，申万菱信新经济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经济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，申万菱信新经济混合型证券投资基金未进行利润分配。

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经济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21635号

申万菱信新经济混合型证券投资基金

(原名为"申万巴黎新经济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经济混合型证券投资基金(原名为"申万巴黎新经济混合型证券投资基金"，以下简称"申万菱信新经济基金")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经济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，上述申万菱信新经济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经济基金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：申万菱信新经济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	134,548,775.22	409,937,731.74
结算备付金	5,703,819.27	9,322,338.35
存出保证金	1,310,572.60	1,226,303.40
交易性金融资产	1,239,349,290.98	2,477,385,416.39
其中：股票投资	1,239,349,290.98	2,477,385,416.39
基金投资	-	-
债券投资	-	-
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	1,058,845.78	64,674,697.22
应收利息	31,311.17	74,333.30
应收股利	-	-
应收申购款	135,720.09	102,597.82
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,382,138,335.11	2,962,723,418.22
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	-	-
应付赎回款	1,966,106.56	7,872,332.35
应付管理人报酬	1,737,775.29	3,913,839.23
应付托管费	289,629.22	652,306.54
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,684,134.28	4,203,395.94
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,442,281.97	1,440,443.04
负债合计	8,119,927.32	18,082,317.10
所有者权益：	-	-
实收基金	1,352,417,467.09	3,935,246,826.18
未分配利润	21,600,940.70	-990,605,725.06
所有者权益合计	1,374,018,407.79	2,944,641,101.12
负债和所有者权益总计	1,382,138,335.11	2,962,723,418.22

注：报告截止日2015年12月31日，基金份额净值1.0160元，基金份额总额1,352,417,467.09份。

7.2 利润表

会计主体：申万菱信新经济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	1,439,119,588.79	352,825,926.62
1.利息收入	2,647,355.67	5,493,342.35
其中：存款利息收入	2,575,133.47	3,955,407.76
债券利息收入	-	837,567.12
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	72,222.20	700,367.47
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以"-"填列）	1,265,128,241.63	648,567,544.13
其中：股票投资收益	1,260,119,035.72	629,219,397.61
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	374,480.00
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	5,009,205.91	18,973,666.52
3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列）	170,850,594.17	-301,847,119.27
4.汇兑收益（损失以"－"号填列）	-	-
5.其他收入（损失以"-"号填列）	493,397.32	612,159.41
减：二、费用	61,360,430.20	75,338,465.98
1. 管理人报酬	34,872,065.87	48,090,557.96
2. 托管费	5,812,010.88	8,015,093.02
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	20,338,869.64	18,907,786.00
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	337,483.81	325,029.00
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）	1,377,759,158.59	277,487,460.64
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以"-"号填列）	1,377,759,158.59	277,487,460.64

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：申万菱信新经济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）	3,935,246,826.18	-990,605,725.06	2,944,641,101.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,377,759,158.59	1,377,759,158.59
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）	-2,582,829,359.09	-365,552,492.83	-2,948,381,851.92
其中：1.基金申购款	275,099,788.82	49,493,014.00	324,592,802.82
2.基金赎回款	-2,857,929,147.91	-415,045,506.83	-3,272,974,654.74
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）	1,352,417,467.09	21,600,940.70	1,374,018,407.79
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）	5,001,083,589.78	-1,560,646,459.84	3,440,437,129.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	277,487,460.64	277,487,460.64
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）	-1,065,836,763.60	292,553,274.14	-773,283,489.46
其中：1.基金申购款	542,344,957.73	-149,800,129.35	392,544,828.38
2.基金赎回款	-1,608,181,721.33	442,353,403.49	-1,165,828,317.84
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）	3,935,246,826.18	-990,605,725.06	2,944,641,101.12

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：李濮君

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

申万菱信新经济混合型证券投资基金(原名为申万巴黎新经济混合型证券投资基金，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[2006]220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《申万巴黎新经济混合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3,106,148,932.37元，业经德勤华永会计师事务所有限公司德师报(验)字(06)第0048号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《申万巴黎新经济混合型证券投资基金基金合同》于2006年12月6日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为3,106,794,804.70份基金份额，其中认购资金利息折合645,872.33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，将申万巴黎新经济混合型证券投资基金更名为申万菱信新经济混合型证券投资基金，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》、《申万菱信新经济混合型证券投资基金基金合同》和最新公布的《申万菱信新经济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。本基金资产配置比例为：股票45%至95%，一般情况下为80%至95%，当通过详细论证认为股市步入下跌阶段时，经投资决策委员会批准可将股票投资比例最小调至45%；权证投资比例为0%至3%；债券和现金类与货币市场工具投资比例为5%以上，通常情况下为5%至20%，其中现金类及货币市场工具为5%以上。本基金的业绩比较基准为：沪深300指数 × 85%＋金融同业存款利率 × 15%。

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》、《申万菱信新经济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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

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。

(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，股权的股息、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，于2015年9月8日前暂减按25%计入应纳税所得额，自2015年9月8日起，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 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 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	
	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	1,609,618,010.65	12.77%	1,228,864,585.90	10.00%

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。上表中申万宏源的交易情况包含申银万国2015年1月1日至1月15日的交易量以及申万宏源2015年1月16日至2015年12月31日的交易量。

7.4.8.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
申万宏源	1,442,308.46	12.68%	199,680.94	7.44%
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
申万宏源	1,107,622.53	10.06%	516,849.06	12.30%

注：(1)上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由适用期间内中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。权证交易不计佣金。

(2)该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

(3)由于申银万国和宏源证券于2015年1月16日完成吸收合并。上表中申万宏源的佣金包含申银万国2015年1月1日至1月15日的佣金以及申万宏源2015年1月16日至2015年12月31日的佣金。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

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
当期发生的基金应支付的管理费	34,872,065.87	48,090,557.96
其中：支付销售机构的客户维护费	4,865,835.53	7,253,232.28

注：支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金管理人报酬＝前一日基金资产净值*1.50%/当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

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
当期发生的基金应支付的托管费	5,812,010.88	8,015,093.02

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费＝前一日基金资产净值*0.25%/当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期和上年度可比期间未与关联方进行的银行同业间市场进行的债券现券交易和债券回购业务。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期和上年度可比期间内，本基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本期末和上年度末，除基金管理人之外的其他关联方，未发生投资本基金的情况。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	134,548,775.22	2,478,451.29	409,937,731.74	3,849,961.90

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期和上年度可比期间内，本基金在承销期内未参与关联方承销证券买卖。

7.4.9 期末（2015年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限的证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002707	众信旅游	2015-11-16	重大事项	52.62	2016-03-15	47.36	1,329,904.00	42,093,224.10	69,979,548.48	-
300351	永贵电器	2015-10-19	重大事项	31.30	2016-02-18	29.80	499,968.00	13,898,062.11	15,648,998.40	-
600530	交大昂立	2015-08-04	重大事项	23.05	2016-01-21	23.51	623,314.00	20,698,541.31	14,367,387.70	-
600699	均胜电子	2015-11-04	重大事项	35.91	2016-03-10	29.00	1,100,000.00	24,906,987.89	39,501,000.00	-
000796	凯撒旅游	2015-11-09	重大事项	29.59	-	-	1,683,198.00	43,654,324.16	49,805,828.82	-
002502	骅威股份	2015-08-20	重大事项	32.02	2016-01-14	23.35	1,597,927.00	48,014,836.02	51,165,622.54	-
300104	乐视网	2015-12-07	重大事项	60.18	-	-	500,000.00	21,833,388.32	30,090,000.00	-

注：本基金截至2015年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

截至本报告期末2015年12月31日止，本基金无债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额，无相关抵押债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2015年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为968,790,905.元，属于第二层次的余额为270,558,385.94元，无属于第三层次的余额(2014年12月31日：第一层次2,314,710,121.09元，第二层次162,675,295.30元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。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)，本基金于2015年3月30日起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(附注7.4.5.2)，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,239,349,290.98	89.67
	其中：股票	1,239,349,290.98	89.67
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	140,252,594.49	10.15
7	其他各项资产	2,536,449.64	0.18
8	合计	1,382,138,335.11	100.00

注：本基金未开通沪港通交易机制投资于港股。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	510,587,633.47	37.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	30,009,908.30	2.18
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	30,753,000.00	2.24
H	住宿和餐饮业	84,513,544.82	6.15
I	信息传输、软件和信息技术服务业	196,035,396.91	14.27
J	金融业	-	-
K	房地产业	20,490,000.00	1.49
L	租赁和商务服务业	71,169,548.48	5.18
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	54,099,210.00	3.94
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	241,691,049.00	17.59
S	综合	-	-
	合计	1,239,349,290.98	90.20

8.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	300278	华昌达	4,500,000.00	102,465,000.00	7.46
2	002707	众信旅游	1,329,904.00	69,979,548.48	5.09
3	002292	奥飞动漫	1,239,914.00	64,115,952.94	4.67
4	600593	大连圣亚	1,039,000.00	53,394,210.00	3.89
5	002502	骅威股份	1,597,927.00	51,165,622.54	3.72
6	000796	凯撒旅游	1,683,198.00	49,805,828.82	3.62
7	002123	荣信股份	1,899,993.00	48,734,820.45	3.55
8	000793	华闻传媒	3,132,000.00	47,073,960.00	3.43
9	300299	富春通信	949,953.00	44,714,287.71	3.25
10	300310	宜通世纪	706,700.00	44,048,611.00	3.21

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于申万菱信基金管理有限公司网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300226	上海钢联	130,930,003.83	4.45
2	600570	恒生电子	118,866,383.58	4.04
3	600010	包钢股份	100,099,565.37	3.40
4	600369	西南证券	94,300,978.16	3.20
5	300291	华录百纳	83,493,122.81	2.84
6	000555	神州信息	80,285,192.46	2.73
7	600687	刚泰控股	79,210,935.85	2.69
8	000587	金叶珠宝	78,547,931.33	2.67
9	300228	富瑞特装	74,819,164.27	2.54
10	300133	华策影视	69,982,952.80	2.38
11	000008	神州高铁	63,281,750.57	2.15
12	000732	泰禾集团	62,874,093.88	2.14
13	002312	三泰控股	62,634,453.37	2.13
14	002422	科伦药业	62,284,509.56	2.12
15	603885	吉祥航空	61,592,514.90	2.09
16	300013	新宁物流	61,053,826.89	2.07
17	002711	欧浦智网	58,464,864.64	1.99
18	300005	探路者	58,133,888.60	1.97
19	601599	鹿港科技	56,875,621.30	1.93
20	002343	慈文传媒	56,549,762.06	1.92

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000555	神州信息	212,398,641.45	7.21
2	300124	汇川技术	199,023,136.14	6.76
3	300212	易华录	170,628,218.21	5.79
4	002081	金 螳 螂	170,430,158.52	5.79
5	600804	鹏博士	160,051,540.47	5.44
6	300291	华录百纳	159,689,031.96	5.42
7	300271	华宇软件	149,872,208.68	5.09
8	600010	包钢股份	149,517,683.33	5.08
9	600570	恒生电子	143,391,815.52	4.87
10	600699	均胜电子	137,419,376.44	4.67
11	600015	华夏银行	124,562,269.59	4.23
12	600369	西南证券	118,507,755.58	4.02
13	300007	汉威电子	115,534,182.34	3.92
14	601998	中信银行	115,289,956.69	3.92
15	002411	九九久	114,051,981.21	3.87
16	300326	凯利泰	106,328,850.99	3.61
17	601318	中国平安	102,421,484.06	3.48
18	600479	千金药业	98,216,475.05	3.34
19	600401	*ST海润	97,955,145.87	3.33
20	601818	光大银行	95,425,561.38	3.24
21	600418	江淮汽车	91,981,945.60	3.12
22	600612	老凤祥	90,041,522.48	3.06
23	600687	刚泰控股	88,982,030.26	3.02
24	000732	泰禾集团	84,851,590.52	2.88
25	000008	神州高铁	82,888,160.79	2.81
26	300378	鼎捷软件	82,687,517.83	2.81
27	002312	三泰控股	81,712,471.87	2.77
28	002454	松芝股份	79,105,337.82	2.69
29	002041	登海种业	78,423,477.00	2.66
30	600584	长电科技	76,747,270.83	2.61
31	000768	中航飞机	75,020,537.89	2.55
32	000001	平安银行	74,980,665.64	2.55
33	300228	富瑞特装	74,775,679.73	2.54
34	002422	科伦药业	72,439,698.11	2.46
35	002711	欧浦智网	65,332,134.36	2.22
36	600000	浦发银行	61,308,711.30	2.08
37	600970	中材国际	60,020,271.16	2.04
38	300226	上海钢联	58,972,474.42	2.00

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	4,970,096,275.22
卖出股票的收入（成交）总额	7,639,102,030.52

注："买入金额"、"卖出金额"均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

8.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.11报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同，本基金不得参与国债期货交易。

8.11.2 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。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1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。

8.12.2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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,310,572.60
2	应收证券清算款	1,058,845.78
3	应收股利	-
4	应收利息	31,311.17
5	应收申购款	135,720.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,536,449.64

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002707	众信旅游	69,979,548.48	5.09	重大事项
2	002502	骅威股份	51,165,622.54	3.72	重大事项
3	000796	凯撒旅游	49,805,828.82	3.62	重大事项

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
60,494	22,356.22	99,338,175.25	7.35%	1,253,079,291.84	92.65%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	65,568.42	0.00%

9.3期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§10 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	3,935,246,826.18
本报告期基金总申购份额	275,099,788.82
减：本报告期基金总赎回份额	2,857,929,147.91
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,352,417,467.09

§11 重大事件揭示

11.1基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内，经本基金管理人股东会决议，同意外方股东提名的董事由原田义久先生变更为安田敬之先生。

2、本报告期内，经本基金管理人股东会决议，同意中方股东提名的董事由杜平先生变更为朱敏杰先生。

3、本报告期内，经本基金管理人股东会决议，同意免去李秀仑先生独立董事职务。

4、本报告期内，经本基金管理人股东会决议，同意聘任过振华先生为公司董事。

5、本报告期内，经本基金管理人股东会决议，同意中方股东提名的独立董事由冯根福先生变更为白虹女士。

6、本报告期内，经本基金管理人股东会决议，同意中方股东提名的监事会主席由蒋元真先生变更为徐宜阳先生。

7、本报告期内，经本基金管理人董事会决议，同意免去欧庆铃先生公司副总经理职务。

8、报告期内本基金基金托管人无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的，与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金管理人的基金投资策略严格遵循本基金《招募说明书》中披露的基本投资策略，未发生显著的改变。

11.5为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，本基金聘用普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）负责基金审计事务，未发生改聘会计师事务所事宜。自本基金合同生效以来，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务时间为8年。本报告期本基金应支付普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计费100,000元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券	1	2,096,159,068.68	16.63%	1,870,780.37	16.45%	-
国金证券	1	1,437,102,702.84	11.40%	1,317,441.26	11.58%	-
东兴证券	1	904,324,392.22	7.18%	824,108.71	7.25%	-
申万宏源	3	1,609,618,010.65	12.77%	1,442,308.46	12.68%	-
银河证券	1	840,504,010.68	6.67%	743,763.28	6.54%	-
华创证券	1	828,159,848.61	6.57%	768,216.60	6.75%	-
中航证券	2	715,744,868.07	5.68%	646,923.38	5.69%	-
中银国际	1	636,806,004.33	5.05%	566,770.50	4.98%	新增
中信建投	1	566,599,221.40	4.50%	515,831.04	4.54%	-
中泰证券	3	445,729,494.54	3.54%	402,320.51	3.54%	-
第一创业	1	356,630,402.28	2.83%	325,560.78	2.86%	新增
西部证券	2	295,639,426.78	2.35%	269,152.75	2.37%	-
国信证券	1	257,267,463.30	2.04%	234,448.07	2.06%	-
广州证券	1	230,805,577.89	1.83%	204,239.91	1.80%	-
海通证券	2	216,673,630.47	1.72%	194,476.16	1.71%	-
招商证券	2	213,842,128.48	1.70%	191,800.95	1.69%	-
天风证券	1	152,298,424.90	1.21%	134,768.89	1.18%	-
华信证券	1	143,160,671.45	1.14%	130,461.85	1.15%	新增
中投证券	1	114,174,472.85	0.91%	104,047.43	0.91%	-
长江证券	1	59,430,922.29	0.47%	54,105.88	0.48%	-
光大证券	1	48,429,558.12	0.38%	44,133.81	0.39%	-
东海证券	1	36,064,610.48	0.29%	32,865.67	0.29%	-
兴业证券	1	19,507,127.86	0.15%	17,776.78	0.16%	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
北京高华	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-

注：交易单元选择的标准：1、经营行为规范，在近一年内无重大违规行为；2、公司财务状况良好；3、有良好的内控制度，在业内有良好的声誉；4、有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；5、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

由于申银万国和宏源证券于2015年1月16日完成吸收合并。宏源证券的交易席位只披露2015年1月1日至2015年1月15日的交易量和佣金情况，2015年1月16日至2015年12月31日的交易量和佣金情况合并至申万宏源一并披露。

申万菱信基金管理有限公司
二〇一六年三月三十日