

申万菱信盛利强化配置混合型证券投资基金

2012 第一季度 报告

2012年3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

报告期截止日:二〇一二年四月二十日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及监事会对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2012年4月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告，同意以此形式对外披露。

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。投资人投资有风险，投资人应当仔细阅读基金的招募说明书。

本基金合同中财务资料未经审计。

本报告期自2012年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金名称 申万菱信盛利强化配置混合型证券投资基金

基金代码 310318

交易代码 310318

基金运作方式 联接开放式

基金合同生效日 2004年11月29日

报告期末基金份额总额 51,884,297.10份

基金份额净值 2.457,893.00元

基金份额净值收益率 4.41%

基金份额净值收益率标准差 4.41%

固定收益类投资 26,950,265.10元 48.35%

其中:债券 26,950,265.10元 48.35%

货币市场基金 26,950,785.10元 48.35%

资产支持证券 -

5 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 25,360,213.46元 45.50%

6 其他各项资产 969,749.04元 1.74%

7 合计 55,738,640.60元 100.00%

§2.2 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 采掘业 -

C 制造业 818,950.00元 1.61%

D 食品、饮料 -

E 纺织、服装、皮革、毛皮 -

F 木材、家具 -

G 石油、化学、塑胶、塑料 340,610.00元 0.67%

H 电子 12,740.00元 0.03%

C6 金属、非金属 190,800.00元 0.38%

C7 机械、设备、仪表 274,800.00元 0.54%

C8 医药、生物制品 -

C99 其他制造业 -

E 电力、煤气及水的生产与供应业 -

F 建筑业 463,800.00元 0.91%

G 交通运输、仓储业 223,500.00元 0.44%

H 公用事业 -

I 传播与文化产业 -

M 综合类 -

合计 2,457,893.00元 4.41%

§2.3 报告期末按行业分类的债券投资组合

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 600036 相信银行 79,970 951,643.00元 1.87%

2 002431 国阳新能 20,000 463,800.00元 0.91%

3 000887 中信国安 30,000 332,700.00元 0.65%

4 000418 小天鹅A 30,000 274,800.00元 0.54%

5 601006 大秦铁路 30,000 223,500.00元 0.44%

6 600019 宝钢股份 40,000 190,800.00元 0.38%

7 601231 环保电子 1,000 12,740.00元 0.03%

8 002666 德赛集团 500 7,910.00元 0.02%

9 合计 2,457,893.00元 4.41%

§2.4 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 600036 相信银行 99,185 9,718,146.30元 19.10%

2 002120 信邦债 40,000 4,000,400.00元 7.86%

3 122847 11中期交 33,070 3,307,000.00元 6.50%

4 001007 21国债7 30,000 3,190,200.00元 6.27%

5 122020 09国债 20,000 2,024,000.00元 3.98%

6 11中期交 19,000 1,900,000.00元 3.74%

7 122887 11中期交 18,187,592.70元 35.75%

8 000418 小天鹅B 30,000 274,800.00元 0.54%

9 601006 大秦铁路 30,000 223,500.00元 0.44%

10 600019 宝钢股份 40,000 190,800.00元 0.38%

11 601231 环保电子 1,000 12,740.00元 0.03%

12 002666 德赛集团 500 7,910.00元 0.02%

13 600036 相信银行 99,185 9,718,146.30元 19.10%

14 002120 信邦债 40,000 4,000,400.00元 7.86%

15 122847 11中期交 33,070 3,307,000.00元 6.50%

16 001007 21国债7 30,000 3,190,200.00元 6.27%

17 122020 09国债 20,000 2,024,000.00元 3.98%

18 11中期交 19,000 1,900,000.00元 3.74%

19 122887 11中期交 18,187,592.70元 35.75%

20 000418 小天鹅B 30,000 274,800.00元 0.54%

21 601006 大秦铁路 30,000 223,500.00元 0.44%

22 600019 宝钢股份 40,000 190,800.00元 0.38%

23 601231 环保电子 1,000 12,740.00元 0.03%

24 002666 德赛集团 500 7,910.00元 0.02%

25 600036 相信银行 99,185 9,718,146.30元 19.10%

26 002120 信邦债 40,000 4,000,400.00元 7.86%

27 122847 11中期交 33,070 3,307,000.00元 6.50%

28 001007 21国债7 30,000 3,190,200.00元 6.27%

29 122020 09国债 20,000 2,024,000.00元 3.98%

30 11中期交 19,000 1,900,000.00元 3.74%

31 122887 11中期交 18,187,592.70元 35.75%

32 000418 小天鹅B 30,000 274,800.00元 0.54%

33 601006 大秦铁路 30,000 223,500.00元 0.44%

34 600019 宝钢股份 40,000 190,800.00元 0.38%

35 601231 环保电子 1,000 12,740.00元 0.03%

36 002666 德赛集团 500 7,910.00元 0.02%

37 600036 相信银行 99,185 9,718,146.30元 19.10%

38 002120 信邦债 40,000 4,000,400.00元 7.86%

39 122847 11中期交 33,070 3,307,000.00元 6.50%

40 001007 21国债7 30,000 3,190,200.00元 6.27%

41 122020 09国债 20,000 2,024,000.00元 3.98%

42 11中期交 19,000 1,900,000.00元 3.74%

43 122887 11中期交 18,187,592.70元 35.75%

44 000418 小天鹅B 30,000 274,800.00元 0.54%

45 601006 大秦铁路 30,000 223,500.00元 0.44%

46 600019 宝钢股份 40,000 190,800.00元 0.38%

47 601231 环保电子 1,000 12,740.00元 0.03%

48 002666 德赛集团 500 7,910.00元 0.02%

49 600036 相信银行 99,185 9,718,146.30元 19.10%

50 002120 信邦债 40,000 4,000,400.00元 7.86%

51 122847 11中期交 33,070 3,307,000.00元 6.50%

52 001007 21国债7 30,000 3,190,200.00元 6.27%

53 122020 09国债 20,000 2,024,000.00元 3.98%

54 11中期交 19,000 1,900,000.00元 3.74%

55 122887 11中期交 18,187,592.70元 35.75%

56 000418 小天鹅B 30,000 274,800.00元 0.54%

57 601006 大秦铁路 30,000 223,500.00元 0.44%

58 600019 宝钢股份 40,000 190,800.00元 0.38%

59 601231 环保电子 1,000 12,740.00元 0.03%

60 002666 德赛集团 500 7,910.00元 0.02%

61 600036 相信银行 99,185 9,718,146.30元 19.10%

62 002120 信邦债 40,000 4,000,400