

## 申万菱信定期开放债券型发起式证券投资基金

## 2013第四季度报告

2013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:二〇一四年一月二十一日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及高级管理人员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、完整性和及时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的规定，于2014年1月21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、基金托管人及基金销售机构已签署基金销售协议，承诺基金投资人利益优先。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资人投资于基金前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金合同全文可在基金管理人网站上查阅。

本报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称 申万菱信定期开放债券LOF基金场内简称:申万债券

基金代码 163112

前端交易代码 163112

基金后端代码 004123

基金合同生效日 2013年3月29日

报告期末基金份额总额 1,611,383,743.33份

基金类型 在长期利率变动分析为基础,结合宏观经济、宏观政策变化分析,在封闭期与开放期结合的基础上,通过适当参与股票、债券、货币市场工具等资产的配置,以获取较高的债券组合投资收益。同时通过适当参与股票、债券、货币市场工具等资产的配置,以获取较高的债券组合投资收益。

投资目标 本基金在追求资本增值的基础上,力争为投资者获取高于业绩比较基准的投资收益。

投资策略 本基金在长期利率变动分析为基础,结合宏观经济、宏观政策变化分析,在封闭期与开放期结合的基础上,通过适当参与股票、债券、货币市场工具等资产的配置,以获取较高的债券组合投资收益。同时通过适当参与股票、债券、货币市场工具等资产的配置,以获取较高的债券组合投资收益。

业绩比较基准 在每个封闭期,本基金的业绩比较基准为该封闭期起始日的上一年期金融机构人民币存款基准利率+0.6%。

风险收益特征 本基金为债券型基金,其长期预期风险和预期收益低于股票型基金和混合型基金,但高于货币市

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

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2013年10月1日-2013年12月31日)

1.本期已实现收益 -6,629,651.77

2.本期利润 -18,152,701.11

3.加权平均基金份额本期利润 0.0031

4.期末基金份额净值 1.596,175,863.61

5.期末基金净值增长率 0.991

注:1.本期利润为收入减去必要的费用后的余额,本期利润的计算公式为:本期利润=本期已实现收益+本期利息收入+本期其他收入-本期费用。

2.上述基金业绩指标已扣除了基金管理费、托管费和各项交易费用,但不包括持有认购交易本基金的各项费用(例如申购、赎回、交易等),投资人认购或交易本基金份额后,实际收益可能低于所列示。

3.2本基金的基金资产净值增长率与其同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) (1-3) (2-4)

过去一个月 -1.0% 0.09% 0.91% 0.00% -2.0% 0.09%

3.2.1本基金成立以来以基金累计净值增长率变动率与其同期业绩比较基准收益率变动率的比较

基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图(2013年3月29日至2013年12月31日)

3.2.2本基金成立以来以基金累计净值增长率变动率与其同期业绩比较基准收益率变动率的比较

基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图(2013年3月29日至2013年12月31日)

3.2.3本基金成立以来以基金累计净值增长率变动率与其同期业绩比较基准收益率变动率的比较

基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图(2013年3月29日至2013年12月31日)

3.2.4本基金成立以来以基金累计净值增长率变动率与其同期业绩比较基准收益率变动率的比较

基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图(2013年3月29日至2013年12月31日)

3.2.5本基金成立以来以基金累计净值增长率变动率与其同期业绩比较基准收益率变动率的比较

基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图(2013年3月29日至2013年12月31日)

3.2.6本基金成立以来以基金累计净值增长率变动率与其同期业绩比较基准收益率变动率的比较

基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图(2013年3月29日至2013年12月31日)

3.2.7本基金成立以来以基金累计净值增长率变动率与其同期业绩比较基准收益率变动率的比较

基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图(2013年3月29日至2013年12月31日)

3.2.8本基金成立以来以基金累计净值增长率变动率与其同期业绩比较基准收益率变动率的比较

基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图(2013年3月29日至2013年12月31日)

3.2.9本基金成立以来以基金累计净值增长率变动率与其同期业绩比较基准收益率变动率的比较

基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图(2013年3月29日至2013年12月31日)

3.2.10本基金成立以来以基金累计净值增长率变动率与其同期业绩比较基准收益率变动率的比较

基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图(2013年3月29日至2013年12月31日)

3.2.11本基金成立以来以基金累计净值增长率变动率与其同期业绩比较基准收益率变动率的比较

基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图(2013年3月29日至2013年12月31日)

3.2.12本基金成立以来以基金累计净值增长率变动率与其同期业绩比较基准收益率变动率的比较

基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图(2013年3月29日至2013年12月31日)

3.2.13本基金成立以来以基金累计净值增长率变动率与其同期业绩比较基准收益率变动率的比较

基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图(2013年3月29日至2013年12月31日)

3.2.14本基金成立以来以基金累计净值增长率变动率与其同期业绩比较基准收益率变动率的比较

基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图(2013年3月29日至2013年12月31日)

3.2.15本基金成立以来以基金累计净值增长率变动率与其同期业绩比较基准收益率变动率的比较

基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图(2013年3月29日至2013年12月31日)

3.2.16本基金成立以来以基金累计净值增长率变动率与其同期业绩比较基准收益率变动率的比较

基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图(2013年3月29日至2013年12月31日)

3.2.17本基金成立以来以基金累计净值增长率变动率与其同期业绩比较基准收益率变动率的比较

基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图(2013年3月29日至2013年12月31日)

3.2.18本基金成立以来以基金累计净值增长率变动率与其同期业绩比较基准收益率变动率的比较

基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图(2013年3月29日至2013年12月31日)

3.2.19本基金成立以来以基金累计净值增长率变动率与其同期业绩比较基准收益率变动率的比较

基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图(2013年3月29日至2013年12月31日)

3.2.20本基金成立以来以基金累计净值增长率变动率与其同期业绩比较基准收益率变动率的比较

基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图(2013年3月29日至2013年12月31日)

3.2.21本基金成立以来以基金累计净值增长率变动率与其同期业绩比较基准收益率变动率的比较

基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图(2013年3月29日至2013年12月31日)

3.2.22本基金成立以来以基金累计净值增长率变动率与其同期业绩比较基准收益率变动率的比较

基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图(2013年3月29日至2013年12月31日)

3.2.23本基金成立以来以基金累计净值增长率变动率与其同期业绩比较基准收益率变动率的比较

基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图(2013年3月29日至2013年12月31日)

3.2.24本基金成立以来以基金累计净值增长率变动率与其同期业绩比较基准收益率变动率的比较

基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图(2013年3月29日至2013年12月31日)

3.2.25本基金成立以来以基金累计净值增长率变动率与其同期业绩比较基准收益率变动率的比较

基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图(2013年3月29日至2013年12月31日)

3.2.26本基金成立以来以基金累计净值增长率变动率与其同期业绩比较基准收益率变动率的比较

基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图(2013年3月29日至2013年12月31日)

3.2.27本基金成立以来以基金累计净值增长率变动率与其同期业绩比较基准收益率变动率的比较

基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图(2013年3月29日至2013年12月31日)

3.2.28本基金成立以来以基金累计净值增长率变动率与其同期业绩比较基准收益率变动率的比较

基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图(2013年3月29日至2013年12月31日)

3.2.29本基金成立以来以基金累计净值增长率变动率与其同期业绩比较基准收益率变动率的比较

基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图(2013年3月29日至2013年12月31日)

3.2.30本基金成立以来以基金累计净值增长率变动率与其同期业绩比较基准收益率变动率的比较

基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图(2013年3月29日至2013年12月31日)

3.2.31本基金成立以来以基金累计净值增长率变动率与其同期业绩比较基准收益率变动率的比较

基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图(2013年3月29日至2013年12月31日)

3.2.32本基金成立以来以基金累计净值增长率变动率与其同期业绩比较基准收益率变动率的比较

基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图(2013年3月29日至2013年12月31日)

3.2.33本基金成立以来以基金累计净值增长率变动率与其同期业绩比较基准收益率变动率的比较

基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图(2013年3月29日至2013年12月31日)

3.2.34本基金成立以来以基金累计净值增长率变动率与其同期业绩比较基准收益率变动率的比较

基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图(2013年3月29日至2013年12月31日)

3.2.35本基金成立以来以基金累计净值增长率变动率与其同期业绩比较基准收益率变动率的比较

基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图(2013年3月29日至2013年12月31日)

3.2.36本基金成立以来以基金累计净值增长率变动率与其同期业绩比较基准收益率变动率的比较

基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图(2013年3月29日至2013年12月31日)

3.2.37本基金成立以来以基金累计净值增长率变动率与其同期业绩比较基准收益率变动率的比较

基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图(2013年3月29日至2013年12月31日)

3.2.38本基金成立以来以基金累计净值增长率变动率与其同期业绩比较基准收益率变动率的比较

基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图(2013年3月29日至2013年12月31日)

3.2.39本基金成立以来以基金累计净值增长率变动率与其同期业绩比较基准收益率变动率的比较

基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图(2013年3月29日至2013年12月31日)

3.2.40本基金成立以来以基金累计净值增长率变动率与其同期业绩比较基准收益率变动率的比较

基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图(2013年3月29日至2013年12月31日)

3.2.41本基金成立以来以基金累计净值增长率变动率与其同期业绩比较基准收益率变动率的比较

基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图(2013年3月29日至2013年12月31日)

3.2.42本基金成立以来以基金累计净值增长率变动率与其同期业绩比较基准收益率变动率的比较

基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图(2013年3月29日至2013年12月31日)

3.2.43本基金成立以来以基金累计净值增长率变动率与其同期业绩比较基准收益率变动率的比较

基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图(2013年3月29日至2013年12月31日)

3.2.44本基金成立以来以基金累计净值增长率变动率与其同期业绩比较基准收益率变动率的比较

基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图(2013年3月29日至2013年12月31日)

3.2.45本基金成立以来以基金累计净值增长率变动率与其同期业绩比较基准收益率变动率的比较

基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图(2013年3月29日至2013年12月31日)

3.2.46本基金成立以来以基金累计净值增长率变动率与其同期业绩比较基准收益率变动率的比较

基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图(2013年3月29日至2013年12月31日)

3.2.47本基金成立以来以基金累计净值增长率变动率与其同期业绩比较基准收益率变动率的比较

基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图(2013年3月29日至2013年12月31日)

3.2.48本基金成立以来以基金累计净值增长率变动率与其同期业绩比较基准收益率变动率的比较

基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图(2013年3月29日至2013年12月31日)

3.2.49本基金成立以来以基金累计净值增长率变动率与其同期业绩比较基准收益率变动率的比较