

申万菱信臻选6个月定期开放混合型证券投资基金

基金管理人:申万菱信基金管理有限公司
基金托管人:杭州银行股份有限公司
信息披露日期:二〇一七年八月二十一日

重要提示
基金管理人承诺:本基金管理人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法律责任。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。
本报告中财务资料未经审计。

2.1 基金基本情况
基金名称:申万菱信臻选6个月定期开放混合型证券投资基金
基金代码:004411

基金管理人:申万菱信基金管理有限公司
基金托管人:杭州银行股份有限公司
基金投资目标:本基金为基金中基金,在严格控制风险的前提下,通过积极主动的资产配置,充分挖掘和利用市场中中性的投资机会,力求为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的收益。

投资策略:本基金为基金中基金,在严格控制风险的前提下,通过积极主动的资产配置,充分挖掘和利用市场中中性的投资机会,力求为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的收益。

业绩比较基准:中证综合指数收益率*50%+沪深300指数收益率*50%

风险收益特征:本基金为基金中基金,其预期收益及预期风险水平高于普通证券投资基金与货币市场基金,低于股票型基金,属于中高风险收益和预期风险水平的投资品种。

基金管理人:申万菱信基金管理有限公司
基金托管人:杭州银行股份有限公司

信息披露负责人:陈永明
联系电话:021-23281188
电子邮箱:chenyongming@swsm.com.cn

客户服务电话:400888588
官方网站:www.swsm.com

基金半年度报告备查地点:申万菱信基金管理有限公司

3.1 主要会计数据和财务指标
3.1.1 本期主要会计数据和财务指标

3.1.2 期末主要会计数据和财务指标

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

过去一个月:1.69% 0.15% 2.92% 0.34% -1.23% -0.19%

过去三个月:1.56% 0.18% 2.49% 0.33% -0.93% -0.15%

过去六个月:1.71% 0.16% 2.86% 0.31% -1.15% -0.15%

基金业绩的业绩基准指数按照指数公式每日进行计算,计算公式如下:

基金业绩的业绩基准指数按照指数公式每日进行计算,计算公式如下:

基金业绩的业绩基准指数按照指数公式每日进行计算,计算公式如下:

基金业绩的业绩基准指数按照指数公式每日进行计算,计算公式如下:

基金业绩的业绩基准指数按照指数公式每日进行计算,计算公式如下:

基金业绩的业绩基准指数按照指数公式每日进行计算,计算公式如下:

基金业绩的业绩基准指数按照指数公式每日进行计算,计算公式如下:

基金业绩的业绩基准指数按照指数公式每日进行计算,计算公式如下:

基金业绩的业绩基准指数按照指数公式每日进行计算,计算公式如下:

基金业绩的业绩基准指数按照指数公式每日进行计算,计算公式如下:

基金业绩的业绩基准指数按照指数公式每日进行计算,计算公式如下:

基金业绩的业绩基准指数按照指数公式每日进行计算,计算公式如下:

基金业绩的业绩基准指数按照指数公式每日进行计算,计算公式如下:

基金业绩的业绩基准指数按照指数公式每日进行计算,计算公式如下:

基金业绩的业绩基准指数按照指数公式每日进行计算,计算公式如下:

基金业绩的业绩基准指数按照指数公式每日进行计算,计算公式如下:

基金业绩的业绩基准指数按照指数公式每日进行计算,计算公式如下:

基金业绩的业绩基准指数按照指数公式每日进行计算,计算公式如下:

基金业绩的业绩基准指数按照指数公式每日进行计算,计算公式如下:

基金业绩的业绩基准指数按照指数公式每日进行计算,计算公式如下:

基金业绩的业绩基准指数按照指数公式每日进行计算,计算公式如下:

基金业绩的业绩基准指数按照指数公式每日进行计算,计算公式如下:

基金业绩的业绩基准指数按照指数公式每日进行计算,计算公式如下:

基金业绩的业绩基准指数按照指数公式每日进行计算,计算公式如下:

基金业绩的业绩基准指数按照指数公式每日进行计算,计算公式如下:

基金业绩的业绩基准指数按照指数公式每日进行计算,计算公式如下:

2017 半年度 报告摘要

2017年6月30日

5.3 托管人对本半年度报告财务信息内容真实、准确、完整发表意见。
本半年度报告财务信息内容真实、准确、完整。

6.1 资产负债表
单位:人民币元

资产: 2,005,109.48
银行存款: 1,380,555.04
交易性金融资产: 124,560.71

负债: 9,800,000.00
应付赎回款: 7,516,420.11

所有者权益: 1,204,609.36
未分配利润: 1,204,609.36

6.2 利润表
单位:人民币元

一、收入: 12,618,299.77
利息收入: 6,048,385.81

二、费用: 1,407,138.52
销售费用: 558,207.93

三、利润总额: 11,211,161.25
净利润: 1,176,710.44

6.3 所有者权益(基金净值)变动表
单位:人民币元

一、期初余额: 1,257,971.10
二、本期增加: 6,815,499.74

三、本期减少: 1,176,710.44
四、期末余额: 6,896,760.40

6.4 现金流量表
单位:人民币元

一、经营活动产生的现金流量: 1,358,639.89
二、投资活动产生的现金流量: -1,300,678.78

三、筹资活动产生的现金流量: 1,358,639.89
四、现金及现金等价物净增加额: 397,390.90

6.5 所有者权益(基金净值)变动表
单位:人民币元

一、期初余额: 1,257,971.10
二、本期增加: 6,815,499.74

三、本期减少: 1,176,710.44
四、期末余额: 6,896,760.40

6.6 所有者权益(基金净值)变动表
单位:人民币元

一、期初余额: 1,257,971.10
二、本期增加: 6,815,499.74

三、本期减少: 1,176,710.44
四、期末余额: 6,896,760.40

6.7 所有者权益(基金净值)变动表
单位:人民币元

一、期初余额: 1,257,971.10
二、本期增加: 6,815,499.74

三、本期减少: 1,176,710.44
四、期末余额: 6,896,760.40

6.8 所有者权益(基金净值)变动表
单位:人民币元

一、期初余额: 1,257,971.10
二、本期增加: 6,815,499.74

三、本期减少: 1,176,710.44
四、期末余额: 6,896,760.40

6.9 所有者权益(基金净值)变动表
单位:人民币元

一、期初余额: 1,257,971.10
二、本期增加: 6,815,499.74

三、本期减少: 1,176,710.44
四、期末余额: 6,896,760.40

6.10 所有者权益(基金净值)变动表
单位:人民币元

一、期初余额: 1,257,971.10
二、本期增加: 6,815,499.74

三、本期减少: 1,176,710.44
四、期末余额: 6,896,760.40

6.11 所有者权益(基金净值)变动表
单位:人民币元

一、期初余额: 1,257,971.10
二、本期增加: 6,815,499.74

三、本期减少: 1,176,710.44
四、期末余额: 6,896,760.40

6.12 所有者权益(基金净值)变动表
单位:人民币元

一、期初余额: 1,257,971.10
二、本期增加: 6,815,499.74

三、本期减少: 1,176,710.44
四、期末余额: 6,896,760.40

6.13 所有者权益(基金净值)变动表
单位:人民币元

一、期初余额: 1,257,971.10
二、本期增加: 6,815,499.74

三、本期减少: 1,176,710.44
四、期末余额: 6,896,760.40

7.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

7.3 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

Table with columns: 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(%)

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

7.4 报告期末按股票投资组合的重大变动

7.4.1 买入卖出金额超出期初基金净值 2%或前 20 名股票的投资明细

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例(%)

7.4.2 卖出金额超出期初基金净值 2%或前 20 名股票的投资明细

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计卖出金额, 占期末基金资产净值比例(%)

7.4.3 买入股票的成本及卖出股票的收入总额

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例(%)

买入股票的成本及卖出股票的收入总额

注:买入股票的成本及卖出股票的收入总额

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

7.6 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组合

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

7.8 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

7.9 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

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.11 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

7.12 报告期末本基金投资的期权投资情况说明

7.13 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

7.14 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

7.15 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

7.16 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

7.17 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

7.18 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

7.19 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

7.20 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

7.21 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

7.22 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

7.23 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

7.24 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

7.25 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

7.26 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

7.27 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

7.28 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

7.29 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

7.30 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

7.31 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

7.32 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

7.33 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

7.34 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

8.1 持有人户数、持有基金份额及持有结构

8.2 期末基金份额持有人户数及持有结构

8.3 期末基金份额持有人户数及持有结构

8.4 期末基金份额持有人户数及持有结构

8.5 期末基金份额持有人户数及持有结构

8.6 期末基金份额持有人户数及持有结构

8.7 期末基金份额持有人户数及持有结构

8.8 期末基金份额持有人户数及持有结构

8.9 期末基金份额持有人户数及持有结构

8.10 期末基金份额持有人户数及持有结构

8.11 期末基金份额持有人户数及持有结构

8.12 期末基金份额持有人户数及持有结构

8.13 期末基金份额持有人户数及持有结构

8.14 期末基金份额持有人户数及持有结构

8.15 期末基金份额持有人户数及持有结构

8.16 期末基金份额持有人户数及持有结构

8.17 期末基金份额持有人户数及持有结构

8.18 期末基金份额持有人户数及持有结构

8.19 期末基金份额持有人户数及持有结构

8.20 期末基金份额持有人户数及持有结构

8.21 期末基金份额持有人户数及持有结构

8.22 期末基金份额持有人户数及持有结构

8.23 期末基金份额持有人户数及持有结构

8.24 期末基金份额持有人户数及持有结构

8.25 期末基金份额持有人户数及持有结构

8.26 期末基金份额持有人户数及持有结构

8.27 期末基金份额持有人户数及持有结构

8.28 期末基金份额持有人户数及持有结构

8.29 期末基金份额持有人户数及持有结构

8.30 期末基金份额持有人户数及持有结构

8.31 期末基金份额持有人户数及持有结构

8.32 期末基金份额持有人户数及持有结构

8.33 期末基金份额持有人户数及持有结构

8.34 期末基金份额持有人户数及持有结构

8.35 期末基金份额持有人户数及持有结构

8.36 期末基金份额持有人户数及持有结构

8.37 期末基金份额持有人户数及持有结构

8.38 期末基金份额持有人户数及持有结构

8.39 期末基金份额持有人户数及持有结构

8.40 期末基金份额持有人户数及持有结构

8.41 期末基金份额持有人户数及持有结构

8.42 期末基金份额持有人户数及持有结构

8.43 期末基金份额持有人户数及持有结构

8.44 期末基金份额持有人户数及持有结构

8.45 期末基金份额持有人户数及持有结构

8.46 期末基金份额持有人户数及持有结构

8.47 期末基金份额持有人户数及持有结构