申万菱信智能驱动股票型证券投资基金

2019 半年度 报告摘要

2019年6月30日

基金管理人:申万菱信基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年八月二十四日

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。本半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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年8月20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。

本报告期自2019年1月1日起至6月30日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	申万菱信智能驱动股票
基金主代码	005825
交易代码	005825
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年6月13日
基金管理人	申万菱信基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	45,278,176.28份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过重点投资于与新一轮科技进步和智能化相关的优质企业,把握全球科技进步和智能化革命带来的系统性投资机会,在控制风险并保持基金资产良好的流动性的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金将重点围绕我国经济周期动力机制与发展规律,研究我国国民经济发展过程中的结构化特征,捕捉新一轮科技进步和智能化相关的投资机会,采取自上而下的资产配置策略、行业配置策略与自下而上的个股选择策略相结合,精选智能驱动主题相关行业中具有核心竞争优势的个股,力求获取稳健的超额回报。
业绩比较基准	业绩比较基准为:85%×中证800指数收益率+15%×中证综合债指数收益率
风险收益特征	本基金是股票型基金,其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王菲萍	贺倩
	联系电话	021-23261188	010-66060069
	电子邮箱	service@swsmu.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008808588	95599
传真		021-23261199	010-68121816

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.swsmu.com
基金半年度报告备置地点	申万菱信基金管理有限公司 中国农业银行股份有限公司

3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2019年1月1日至2019年6月30日)
本期已实现收益	13,774,684.22
本期利润	20,947,418.38
加权平均基金份额本期利润	0.3488
本期加权平均净值利润率	33.99%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.1292
期末基金资产净值	51,126,956.84
期末基金份额净值	1.1292

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
过去一个月	8.04%	1.32%	3.73%	1.01%	4.31%	0.31%
过去三个月	1.42%	1.74%	-2.88%	1.33%	4.30%	0.41%
过去六个月	23.13%	1.68%	21.52%	1.33%	1.61%	0.35%
过去一年	12.98%	1.31%	5.89%	1.30%	7.09%	0.01%
自基金合同生效起至今	12.92%	1.27%	-1.47%	1.31%	14.39%	-0.04%

注:本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算,计算方式如下:

benchmark(0) =1000;

%benchmark(t)= 85%*(中证800指数(t)/ 中证800指数(t-1)-1)+15%*(中证综合债指数(t)/ 中证综合债指数(t-1)-1);

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

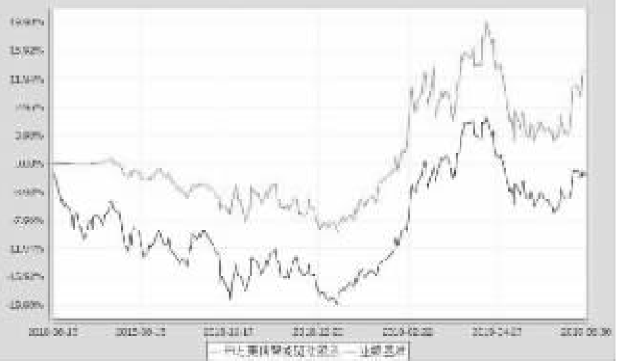
其中t=1,2,3,… 。

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

申万菱信智能驱动股票型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018年6月13日至2019年6月30日)



注:本基金已在建仓期结束时,使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

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2019年6月30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34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超过238亿元,客户数超过596万户。

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		
张朋	本基金基金经理	2018-06-25	-	7年	张朋先生,硕士研究生。2012年起从事金融相关工作,曾任职于东方证券研究所、光大证券研究所,2015年01月加入申万菱信基金管理有限公司,曾任行业研究员、基金经理助理,现任申万菱信智能驱动股票型证券投资基金基金经理。
卢扬	本基金原基金经理	2018-06-13	2019-03-05	15年	卢扬先生,硕士研究生。2004年起从事金融相关工作,曾任中信建投证券行业分析师,中金公司行业分析师,上投摩根基金行业研究员、基金经理助理、基金经理。2016年11月至2019年3月任职于申万菱信基金管理有限公司, 曾任权益投资部负责人,申万菱信新经济混合型证券投资基金、申万菱信行业轮动股票型证券投资基金、申万菱信智能驱动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,卢扬不再担任本基金基金经理,具体请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 公平交易制度的执行情况

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《公平交易办法》,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部,实行了集中交易制度和公平的交易分配制度:(1)对于交易所公开竞价的同向交易,内部制定了专门的交易规则,保证各投资组合获得公平的交易执行机会;(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。

在日常监控和事后分析评估方面, 本公司风险管理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。

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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司制定了《异常交易监控与报告办法》,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。

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内,本公司所有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%的情况有1次。投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易,未导致不公平交易和利益输送。

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

2019年上半年,上证综指上涨19.5%,沪深300上涨27.1%,创业板指上涨20.9%,市场整体呈现普涨局面。分行业来看,食品饮料、非银金融、农林牧渔、家电等大消费板块表现最好成为市场焦点,汽车及周期类板块相对落后。

2018年在中美贸易摩擦、国内去杠杆的双重影响下,企业投资信心、居民消费信心、资本市场投资者信心均受到较大冲击,代表性表现分别是:企业资本开支下滑、汽车销量第一次出现年度负增长、沪深300指数全年下跌25%(跌幅仅次于2008年)。大多数行业对于未来的展望偏悲观,或者看不清楚。

在此背景下,2019年年初我们主要以保守的思路构建组合,回避了一直非常看好,但可能受美国科技制裁影响的部分优质科技股,以及在经济下行周期可能受到较大影响的板块和个股。我们希望观察一下内外部不利因素和低迷的信心对于宏观经济和各个行业的具体影响,再对组合做相应的动态调整。

从实际情况来看,一季度中美之间有所缓和,一度接近达成贸易协议;而为遏制经济进一步下滑,宽松的政策使得信贷也在一季度超预期放量。这在一定程度上改善了各方信心,加之北上资金一季度累计净买入超千亿,优质蓝筹股的持续上涨带活了市场,各类资金都很活跃,市场走出超预期的小牛市。

我们基于中美之间的缓和加仓了一直看好的优质科技成长股,降低了部分逆周期逻辑的标的,同时也加仓了优质的金融成长股。但在一季度还是跑输了市场,二季度市场整体回归于真正有基本面的个股,二季度我们跑出了相对收益。

在报告期末,我们的组合主要配置于科技、金融、家电、医药等板块,这几个板块是我们在智能驱动主题范围内优选的具备长期配置价值的板块,我们从中精选个股,提高了优质个股的持股集中度,希望为投资者赚取稳健、持续的长期复合收益。

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23.13%,同期业绩基准表现为21.52%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

由于逆全球化的贸易摩擦和技术进步进入新旧周期更替阶段,全球经济增长动力不乐观,正在进入宽松周期。具体到国内来看,经济下行的压力需要相对宽松的货币政策,信用刚兑的打破,也有利于实际的无风险利率下行,权益类资产的吸引力将会上升。

沪深300最新TTM PE为12.3倍,在过去十年的中位数之下,相对海外主要市场也处于偏低水平;股息率在2-3%之间,而十年国债收益率也已降到3.2%以下。考虑到中国GDP还在以6%左右的速度增长,我们认为A股对于国内资金是具备吸引力的,对于海外的低成本资金更是具备非常高的吸引力,我们对于A股投资价值不悲观,通过精选个股,我们能找到许多比现金更好的股票资产。

从结构来看,我们首先会继续重点关注科技板块的投资机会。近几年来,A股的消费股投资大放异彩,我们理解是本质上是因为这些消费品公司具备真实的价值创造能力,同时满足了投资者对于收益率和回撤控制的要求。科技板块的投资如何为投资者创造适当的价值?这是我们正在思考和实践的事情,我们相信在5G为代表的新一轮科技周期下,在科创板提供越来越多优质标的的背景下,秉持价值挖掘的理念,通过深入的产业研究精选个股,能够在适当控制回撤的前提下,为投资者获取足够的成长收益。想想腾讯、阿里、华为、海康,科技股并非只能炒作主题。

除科技板块之外,我们也继续看好银行、保险、家电等板块的优质个股。这些每年稳健成长10-20%的优质标的,中长期来看是远比现金更好的优质资产,除非我们找到大批增长更快的优质成长股,这些资产将持续作为我们的重要配置。

整体上,我们希望把主要精力花在个股研究和选择上,聚焦于具备真正成长能力和价值创造能力的优质个股,努力为投资者获取持续、稳健的长期复合收益。

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分管基金运营的副总经理,督察长,分管基金投资的副总经理,基金运营部、监察稽核部、风险管理部负责人组成。其中,分管基金运营的副总经理张丽红女士,拥有15年的基金行业运营、财务管理相关经验;督察长王菲萍女士,拥有15年的基金行业合规管理经验;分管基金投资的副总经理张少华先生,拥有15年的基金行业研究、投资和风险管理相关经验;基金运营部总监李濮君女士,拥有18年的基金会计经验;监察稽核部总监牛锐女士,拥有15年的证券基金行业合规管理经验;风险管理部总监王瑾怡女士,拥有14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

本基金在本报告期内出现超过连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。截至本报告期末,本基金资产净值已恢复至五千万元以上。

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

在托管本基金的过程中,本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定,对本基金基金管理人—申万菱信基金管理有限公司 2019 年 1 月 1 日至 2019年6月30日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为, 申万菱信基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为,申万菱信基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:申万菱信智能驱动股票型证券投资基金

报告截止日:2019年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
资 产:	-	-
银行存款	4,753,035.90	19,060,332.13
结算备付金	197,548.50	480,595.36
存出保证金	106,025.31	56,311.14
交易性金融资产	46,022,566.75	79,313,668.90
其中:股票投资	46,022,566.75	79,313,668.90
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	507,547.81	1,018,379.17
应收利息	1,326.72	4,429.63
应收股利	-	-
应收申购款	4,907.88	9,954.58
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	51,592,958.87	99,943,670.91
负债和所有者权益	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018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	208,529.49	1,179,360.30
应付管理人报酬	67,450.90	129,385.80
应付托管费	11,241.80	21,564.29
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	110,887.35	234,919.81
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	67,892.49	155,065.68
负债合计	466,002.03	1,720,295.88
所有者权益:	-	-
实收基金	45,278,176.28	107,100,902.08
未分配利润	5,848,780.56	-8,877,527.05
所有者权益合计	51,126,956.84	98,223,375.03
负债和所有者权益总计	51,592,958.87	99,943,670.91

注:报告截止日2019年6月30日,基金份额净值1.1292元,基金份额总额45,278,176.28份。

6.2 利润表

会计主体:申万菱信智能驱动股票型证券投资基金

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年6月13日(基金合同生效日)至2018年6月30日
一、收入	22,455,019.43	111,959.52
1.利息收入	38,493.02	111,959.52
其中:存款利息收入	38,493.02	111,959.52
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	15,088,599.74	-
其中:股票投资收益	14,814,791.43	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
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	273,808.31	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	7,172,734.16	-
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	155,192.51	-
减:二、费用	1,507,601.05	258,782.19
1. 管理人报酬	465,882.55	205,773.76
2. 托管费	77,647.11	34,295.63
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	890,569.52	-
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.税金及附加	-	-
7. 其他费用	73,501.87	18,712.80
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	20,947,418.38	-146,822.67
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	20,947,418.38	-146,822.67

注:本基金为上年度基金合同生效的基金,上年度可比期间为2018年6月13日至2018年6月30日。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:申万菱信智能驱动股票型证券投资基金

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30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)	107,100,902.08	-8,877,527.05	98,223,375.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	20,947,418.38	20,947,418.38
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)	-61,822,725.80	-6,221,110.77	-68,043,836.57
其中:1.基金申购款	41,045,719.46	2,105,847.18	43,151,566.64
2.基金赎回款	-102,868,445.26	-8,326,957.95	-111,195,403.21
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)	45,278,176.28	5,848,780.56	51,126,956.84

项目	上年度可比期间 2018年6月13日(基金合同生效日)至2018年6月30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)	294,602,336.61	-	294,602,336.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-146,822.67	-146,822.67
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)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	294,602,336.61	-146,822.67	294,455,513.94

注:本基金为上年度基金合同生效的基金,上年度可比期间为2018年6月13日至2018年6月30日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人:来肖贤,主管会计工作负责人:张丽红,会计机构负责人:李濮君

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

申万菱信智能驱动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[2018]515号《关于准予申万菱信智能驱动股票型证券投资基金注册的批复》核准,由申万菱信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《申万菱信智能驱动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294,432,102.53元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2018)第0408号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《申万菱信智能驱动股票型证券投资基金基金合同》于2018年6月13日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为294,602,336.61份基金份额,其中认购资金利息折合170,234.08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,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《申万菱信智能驱动股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括主板、中小板、创业板及其他依法发行、上市的股票)、权证、股指期货、国债期货、股票期权、债券(含国债、央行票据、金融债、次级债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、可转债及分离交易可转债、可交换债券、地方政府债等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金可以参与融资业务。本基金各类资产投资比例为:股票投资占基金资产的比例不低于80%,其中投资于智能驱动主题相关的股票资产的比例不低于非现金基金资产的80%;其中,每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金以及股票期权合约需缴纳的现金保证金后,本基金应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:85%×中证800指数收益率+15%×中证综合债指数收益率。

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2019年8月23日批准报出。

6.4.2 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》、《申万菱信智能驱动股票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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2019年1月1日至2019年6月30日止期间的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2019年6月30日的财务状况以及2019年1月1日至2019年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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

本报告期采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5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。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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,股票的股息、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,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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
申万菱信基金管理有限公司(以下简称"申万菱信")	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 基金销售机构
三菱UFJ信托银行株式会社	基金管理人的股东
中国农业银行股份有限公司(以下简称"中国农业银行")	基金托管人 基金销售机构
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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年6月13日(基金合同生效日)至2018年6月30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	73,705,360.66	12.89%	-	-

6.4.8.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30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	67,745.54	12.87%	28,657.06	25.84%
关联方名称	上年度可比期间 2018年6月13日(基金合同生效日)至2018年6月30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	-	-	-	-

注:1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年6月13日(基金合同生效日)至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	465,882.55	205,773.76
其中:支付销售机构的客户维护费	267,833.09	68,115.30

注:支付基金管理人申万菱信的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:日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.50% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年6月13日(基金合同生效日)至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	77,647.11	34,295.63

注:支付基金托管人中国农业银行的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:日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内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。

6.4.8.4.2 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投资本基金。

6.4.8.5 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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年6月13日(基金合同生效日)至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	4,753,035.90	33,224.95	294,655,365.03	111,959.52

注:本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

6.4.8.7.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

6.4.8.7.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

无。

6.4.9 期末(2019年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

受限证券类别:股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601236	红塔证券	2019-06-26	2019-07-05	网下新股申购	3.46	3.46	9,789.00	33,869.94	33,869.94	-

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.10 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2019年6月30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45,988,696.81元,属于第二层次的余额为33,869.94元,无属于第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2019年6月30日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 其他

除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 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	46,022,566.75	89.20
	其中:股票	46,022,566.75	89.20
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	4,950,584.40	9.60
8	其他各项资产	619,807.72	1.20
9	合计	51,592,958.87	100.00

注:本基金未开通港股通交易机制投资于港股。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	采矿业	37,040.70	0.07
C	制造业	31,243,801.91	61.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,055,466.20	2.06
J	金融业	13,686,257.94	26.77
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	46,022,566.75	90.02

7.2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金未开通港股通交易机制投资于港股。

7.3 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	002475	立讯精密	176,700.00	4,380,393.00	8.57
2	000063	中兴通讯	123,100.00	4,004,443.00	7.83
3	000333	美的集团	75,600.00	3,920,616.00	7.67
4	601318	中国平安	43,600.00	3,863,396.00	7.56
5	000001	平安银行	249,300.00	3,435,354.00	6.72
6	002916	深南电路	29,000.00	2,955,680.00	5.78
7	600519	贵州茅台	2,900.00	2,853,600.00	5.58
8	600030	中信证券	100,600.00	2,395,286.00	4.68
9	002142	宁波银行	93,200.00	2,259,168.00	4.42
10	000651	格力电器	28,600.00	1,573,000.00	3.08

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半年度报告正文。

7.4报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	000063	中兴通讯	12,297,837.00	12.52
2	002236	大华股份	10,391,036.00	10.58
3	600498	烽火通信	9,687,144.97	9.86
4	002475	立讯精密	8,096,253.28	8.24
5	002384	东山精密	8,062,372.00	8.21
6	601398	工商银行	7,379,963.00	7.51
7	600030	中信证券	7,378,288.00	7.51
8	600690	海尔智家	6,257,684.00	6.37
9	300003	乐普医疗	6,046,011.00	6.16
10	601229	上海银行	5,908,485.70	6.02
11	002916	深南电路	5,771,327.22	5.88
12	601318	中国平安	5,440,307.70	5.54
13	300059	东方财富	5,352,703.00	5.45
14	600845	宝信软件	5,043,477.00	5.13
15	600519	贵州茅台	4,747,822.28	4.83
16	603186	华正新材	4,522,894.60	4.60
17	002373	千方科技	4,505,102.60	4.59
18	000002	万 科A	4,290,118.00	4.37
19	300001	特锐德	4,157,323.72	4.23
20	600183	生益科技	4,061,818.18	4.14
21	300408	三环集团	4,044,915.10	4.12
22	601877	正泰电器	3,931,029.36	4.00
23	000651	格力电器	3,902,467.00	3.97
24	000333	美的集团	3,872,545.00	3.94
25	000977	浪潮信息	3,816,856.00	3.89
26	002422	科伦药业	3,733,208.00	3.80
27	000001	平安银行	3,525,215.22	3.59
28	300687	赛意信息	3,484,812.00	3.55
29	002368	太极股份	3,468,224.00	3.53
30	601988	中国银行	3,447,549.00	3.51
31	000921	海信家电	3,442,611.34	3.50
32	002463	沪电股份	3,094,643.00	3.15
33	601012	隆基股份	3,084,870.00	3.14
34	600438	通威股份	3,056,262.00	3.11
35	002415	海康威视	3,022,759.00	3.08
36	002299	圣农发展	2,963,674.00	3.02
37	002142	宁波银行	2,934,395.57	2.99
38	300732	设研院	2,819,173.00	2.87
39	601688	华泰证券	2,484,898.98	2.53
40	300037	新宙邦	2,457,459.00	2.50
41	002179	中航光电	2,454,813.00	2.50
42	601128	常熟银行	2,411,989.34	2.46
43	002371	北方华创	2,347,731.04	2.39
44	601689	拓普集团	1,985,811.00	2.02
45	300166	东方国信	1,975,484.00	2.01

7.4.2 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	600498	烽火通信	12,509,237.17	12.74
2	002236	大华股份	11,181,336.74	11.38
3	000063	中兴通讯	11,135,601.54	11.34
4	601398	工商银行	9,958,446.00	10.14
5	300408	三环集团	8,481,309.07	8.63
6	600690	海尔智家	8,082,142.00	8.23
7	002475	立讯精密	8,028,625.56	8.17
8	600036	招商银行	7,805,090.20	7.95
9	002384	东山精密	7,664,150.71	7.80
10	600030	中信证券	6,523,266.00	6.64
11	002142	宁波银行	6,361,868.00	6.48
12	600519	贵州茅台	6,306,085.54	6.42
13	600183	生益科技	6,181,567.10	6.29
14	601229	上海银行	6,164,267.20	6.28
15	601766	中国中车	6,042,234.00	6.15
16	300059	东方财富	6,014,985.23	6.12
17	601318	中国平安	5,868,241.00	5.97
18	600845	宝信软件	5,771,717.24	5.88
19	601019	山东出版	5,753,392.24	5.86
20	300003	乐普医疗	5,504,400.68	5.60
21	002373	千方科技	5,394,159.38	5.49
22	601799	星宇股份	5,178,126.00	5.27
23	600004	白云机场	5,074,256.00	5.17
24	600406	国电南瑞	4,918,469.18	5.01
25	601098	中南传媒	4,497,791.50	4.58
26	601988	中国银行	4,418,200.00	4.50
27	000002	万 科A	4,412,502.00	4.49
28	300687	赛意信息	4,261,235.00	4.34
29	300732	设研院	4,251,100.20	4.33
30	300001	特锐德	4,160,615.56	4.24
31	601877	正泰电器	4,088,033.00	4.16
32	300284	苏交科	3,947,070.40	4.02
33	000921	海信家电	3,936,216.00	4.01
34	603018	中设集团	3,894,825.00	3.97
35	603186	华正新材	3,733,587.00	3.80
36	000977	浪潮信息	3,706,149.00	3.77
37	002368	太极股份	3,388,972.58	3.45
38	002415	海康威视	3,320,769.00	3.38
39	601186	中国铁建	3,129,192.00	3.19
40	002916	深南电路	3,060,213.00	3.12
41	000651	格力电器	2,941,927.00	3.00
42	002422	科伦药业	2,901,930.00	2.95
43	002299	圣农发展	2,720,458.00	2.77
44	002179	中航光电	2,699,991.00	2.75
45	601012	隆基股份	2,637,242.69	2.68
46	300037	新宙邦	2,628,297.00	2.68
47	300258	精锻科技	2,465,134.00	2.51
48	000333	美的集团	2,329,891.00	2.37
49	002371	北方华创	2,273,114.00	2.31
50	601688	华泰证券	2,233,858.00	2.27
51	002463	沪电股份	2,127,418.00	2.17
52	600547	山东黄金	2,103,058.00	2.14
53	002138	顺络电子	1,965,455.00	2.00

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位:人民币元

买入股票的成本(成交)总额	258,374,260.09
卖出股票的收入(成交)总额	313,652,887.83

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。

7.5 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。

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明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 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。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货

7.11报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1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的情形。本基金投资的前十名证券的发行主体除平安银行(000001.SZ)、宁波银行(002142.SZ)外,在报告编制日前一年内没有受到公开谴责和处罚的情形。

中国银行保险监督管理委员会天津监管局在2018年7月10日发布了一份"天津银监局行政处罚信息公开表"。经查明,平安银行贷前调查不到位,向环保未达标的企业提供融资;贷后管理失职,流动资金贷款被挪用而受到天津监管局的行政处罚,合计处罚款50万元。

宁波银保监局在2019年1月11日、2019年3月22日发布了两份"宁波银监局行政处罚信息公开表"。经查明,宁波银行股份有限公司由于个人贷款资金违规流入房市、购买理财,违规将同业存款变为一般性存款,以不正当手段违规吸收存款等多个违法违规事项而受到宁波银监局的行政处罚,合计处罚款40万元。

本基金管理人认为上述情形不会对上述证券的投资价值构成影响, 因此也不影响基金管理人对上述证券的投资决策。

7.12.2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。

7.12.3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	106,025.31
2	应收证券清算款	507,547.81
3	应收股利	-
4	应收利息	1,326.72
5	应收申购款	4,907.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	619,807.72

7.12.4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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况。

8 基金份额持有人信息

8.1 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
2,053	22,054.64	269,103.63	0.59%	45,009,072.65	99.41%

8.2 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	546,076.83	1.21%

8.3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	50~100

9 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	107,100,902.08
本报告期基金总申购份额	41,045,719.46
减:本报告期基金总赎回份额	102,868,445.26
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	45,278,176.28

10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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铃木晃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,同意外方股东提名的董事由川上丰先生变更为斋藤正宪先生。

3、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监事由糠信英树先生变更为增田义之先生。

4、本报告期内,本基金托管人中国农业银行总行决定免去史静欣托管业务部副总裁职务。

5、本报告期内,本基金托管人中国农业银行总行决定免去马曙光托管业务部总裁职务。

10.3 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。

10.4 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。

10.5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。

10.6 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。

10.7 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	
东方证券	2	113,382,203.32	19.83%	105,234.35	20.00%	-
海通证券	2	86,292,503.62	15.09%	79,091.50	15.03%	-
光大证券	2	85,067,530.68	14.88%	77,522.38	14.73%	-
申万宏源证券	2	73,705,360.66	12.89%	67,745.54	12.87%	-
广发证券	2	58,972,712.24	10.32%	54,477.48	10.35%	-
国泰君安证券	1	33,415,550.64	5.84%	31,119.91	5.91%	-
兴业证券	1	27,466,713.77	4.80%	25,579.78	4.86%	-
招商证券	1	26,602,599.95	4.65%	24,242.87	4.61%	-
华创证券	1	17,699,250.00	3.10%	16,129.30	3.07%	新增
中金公司	1	15,471,100.10	2.71%	14,098.83	2.68%	-
安信证券	1	14,045,594.49	2.46%	12,799.71	2.43%	-
中信建投证券	1	10,574,477.72	1.85%	9,847.83	1.87%	新增
中信证券	1	4,650,829.18	0.81%	4,331.29	0.82%	-
国盛证券	2	4,366,111.00	0.76%	3,978.82	0.76%	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	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。

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20190606~20190616	0.00	14,354,483.68	14,354,483.68	0.00	0.00%
产品特有风险							
本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情况。在单一投资者持有基金份额比例较高的情况下,如投资者集中赎回,可能会给基金带来流动性冲击。基金管理人将专业审慎、勤勉尽责地管控基金的流动性风险,保护持有人利益。							

申万菱信基金管理有限公司
二〇一九年八月二十四日