

**申万菱信量化成长混合型证券投资基金**  
**2019 年半年度报告（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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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	申万菱信量化成长混合
基金主代码	004135
交易代码	004135
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 3 月 10 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	276,591,127.08 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用数量化的投资方法精选个股，严格按照纪律执行，力争获取长期稳定的超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金采用量化技术对投资策略进行优化，将特定的投资思想和理念通过具体指标与参数的设定体现在数量模型中，坚持以数量化的方式进行投资，充分发挥数量化投资的优势，保持投资策略的一致性与有效性。
业绩比较基准	75%×中证 500 指数收益率 + 25%×中证综合债指数收益率
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于中高预期收益和高预期风险水平的投资品种。

### 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	郭明
	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

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.swsmu.com">http://www.swsmu.com</a>
基金半年度报告备置地点	申万菱信基金管理有限公司 中国工商银行股份有限公司

### 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	3,065,237.89
本期利润	41,182,911.97
加权平均基金份额本期利润	0.1410
本期加权平均净值利润率	17.06%
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	-0.1701
期末基金资产净值	231,078,740.84
期末基金份额净值	0.8355

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，但不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：申购费、赎回费等），计入认购或交易基金各项费用后，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	1.49%	1.07%	0.75%	1.04%	0.74%	0.03%
过去三个月	-7.12%	1.47%	-7.86%	1.36%	0.74%	0.11%
过去六个月	18.24%	1.46%	14.76%	1.34%	3.48%	0.12%
过去一年	1.89%	1.40%	-1.80%	1.26%	3.69%	0.14%
自基金合同生效起至今	-16.45%	1.12%	-14.80%	1.06%	-1.65%	0.06%

注：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：

$$\text{benchmark}(0) = 1000;$$

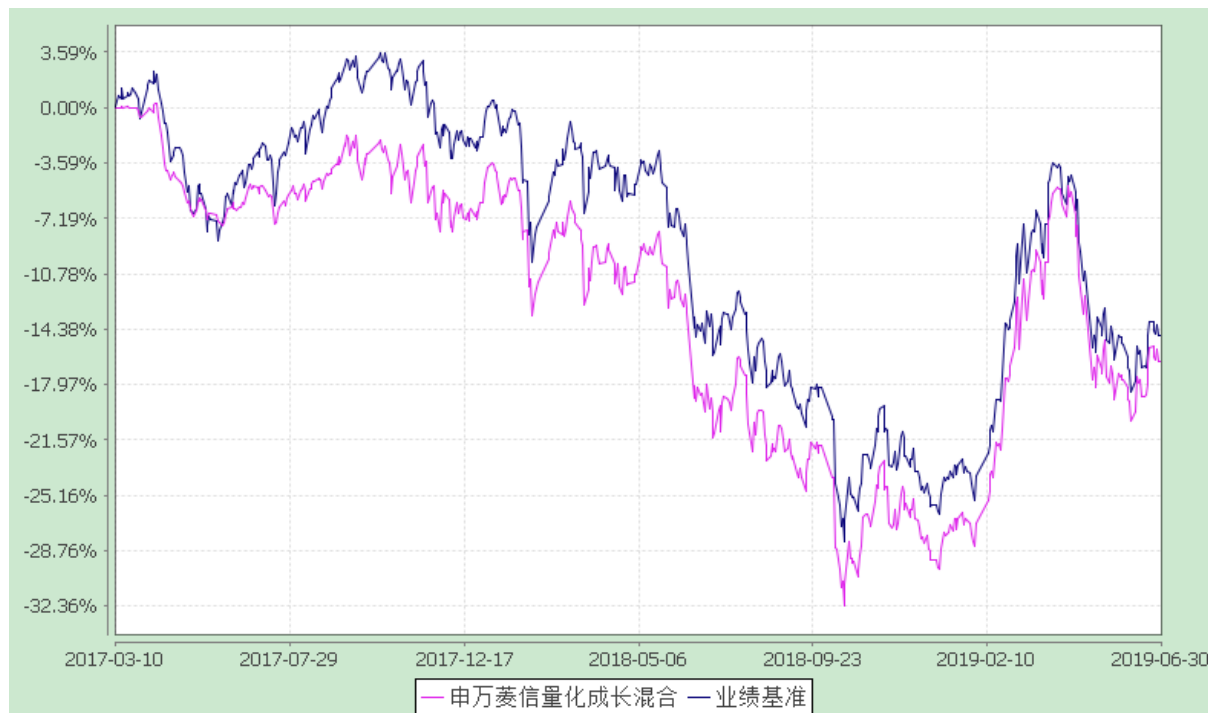
$$\% \text{benchmark}(t) = 75\% * (\text{中证 500 指数}(t) / \text{中证 500 指数}(t-1) - 1) + 25\% * ((\text{中证综合债指数}(t) / \text{中证综合债指数}(t-1) - 1));$$

$$\text{benchmark}(t) = (1 + \% \text{benchmark}(t)) * \text{benchmark}(t-1);$$

其中  $t=1,2,3,\dots$ 。

### 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

申万菱信量化成长混合型证券投资基金  
 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  
 （2017 年 3 月 10 日至 2019 年 6 月 30 日）



## 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		
刘敦	量化 投资 部负 责人, 本基 金基 金经 理	2018-03-14	-	10 年	刘敦先生, 硕士研究生。2008 年起从事金融相关工作, 曾任职于艾利士通资产管理有限公司、平安资产管理有限公司、申银万国证券研究所等。2015 年 03 月加入申万菱信基金管理有限公司, 曾任专户投资经理, 申万菱信沪深 300 价值指数证券投资基金、申万菱信深证成指分级证券投资基金、申万菱信价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 现任量化投资部负责人, 申万菱信量化成长混合型证券投资基金、申万菱信沪深 300 指数增强型证券投资基金、申万菱信价值优先混合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。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内, 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，上海与深圳 A 股整体均有所上涨，上证综指上涨 19.45%，深证成指上涨 26.78%，沪深 300 指数上涨 27.07%，中证 500 指数上涨 19.29%，中证 1000 指数上涨 20.12%；大市值股票跑赢中小市值股票。2019 年上半年，本基金业绩表现优于业绩比较基准，其中：持仓股票组合表现优于中证 500 指数，对基金表现跑赢业绩基准贡献为正；权益类资产平均仓位高于基金业绩基准中证 500 指数的权重，且期间持仓股票组合上涨，对基金表现跑赢业绩基准贡献为正。

本基金主要投资于中小市值股票，采用以估值、盈利、成长等因子为核心的量化多因子模型，力争构建具有较高性价比的量化投资组合。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2019 年上半年，中证 500 指数上涨 19.29%，基金业绩基准表现为 14.76%，申万菱信量化成长基金净值期间表现为 18.24%，领先业绩基准 3.48%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019 年上半年，市场一改 2018 年的颓势，出现了较大幅度的涨幅，大市值股票的表现继续优于中小市值股票。展望 2019 年下半年，我们认为市场大涨大跌的概率较小。在市场无明确方向，且个股波动较大，行业轮动较快的市场环境中，量化策略可望有较好的相对收益表现。本基金将继续主要投资于中小市值股票，采用以估值、盈利、成长等因子为核心的量化多因子模型，力争构建具有较高性价比的量化投资组合。

#### 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

本基金本报告期末进行利润分配，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量化成长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，申万菱信量化成长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量化成长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，申万菱信量化成长混合型证券投资基金未进行利润分

配。

### 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量化成长混合型证券投资基金 2019 年半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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：申万菱信量化成长混合型证券投资基金

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
<b>资产：</b>	-	-
银行存款	42,325,575.44	17,082,056.94
结算备付金	2,247,382.91	2,421,345.60
存出保证金	2,543,642.36	2,919,250.20
交易性金融资产	184,503,095.61	167,330,401.68
其中：股票投资	184,503,095.61	167,330,401.68
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	-	30,000,000.00
应收证券清算款	-	40,177.96
应收利息	8,679.49	34,228.52
应收股利	-	-
应收申购款	14,354.78	1,001.39
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
<b>资产总计</b>	<b>231,642,730.59</b>	<b>219,828,462.29</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2019 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2018 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>	-	-
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	73,865.33	13,978.16
应付管理人报酬	280,869.86	288,447.16
应付托管费	46,811.64	48,074.51
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	67,221.07	83,996.20
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	95,221.85	272,000.02
<b>负债合计</b>	<b>563,989.75</b>	<b>706,496.05</b>
<b>所有者权益：</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
实收基金	276,591,127.08	310,094,025.54
未分配利润	-45,512,386.24	-90,972,059.30
<b>所有者权益合计</b>	<b>231,078,740.84</b>	<b>219,121,966.24</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>231,642,730.59</b>	<b>219,828,462.29</b>

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.8355 元，基金份额总额 276,591,127.08 份。

## 6.2 利润表

会计主体：申万菱信量化成长混合型证券投资基金

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 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>	<b>43,913,787.22</b>	<b>-36,259,001.51</b>
1.利息收入	267,327.95	836,074.51
其中：存款利息收入	100,007.51	167,882.67
债券利息收入	82.05	186,799.59
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	167,238.39	481,392.25
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	5,525,622.88	-6,335,067.06
其中：股票投资收益	1,754,241.62	-8,250,635.54
基金投资收益	-	-
债券投资收益	5,459.50	271,279.61
资产支持证券投资收益	-	-

贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	1,918,377.09	-750,659.71
股利收益	1,847,544.67	2,394,948.58
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	38,117,674.08	-30,762,591.55
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	3,162.31	2,582.59
<b>减：二、费用</b>	<b>2,730,875.25</b>	<b>4,365,310.33</b>
1. 管理人报酬	1,789,371.85	2,453,061.23
2. 托管费	298,228.65	408,843.49
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	522,339.74	1,298,620.05
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6.税金及附加	6,897.58	1,378.98
7. 其他费用	114,037.43	203,406.58
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>41,182,911.97</b>	<b>-40,624,311.84</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>41,182,911.97</b>	<b>-40,624,311.84</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：申万菱信量化成长混合型证券投资基金

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）	310,094,025.54	-90,972,059.30	219,121,966.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	41,182,911.97	41,182,911.97
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）	-33,502,898.46	4,276,761.09	-29,226,137.37
其中：1.基金申购款	2,940,951.11	-460,440.60	2,480,510.51
2.基金赎回款	-36,443,849.57	4,737,201.69	-31,706,647.88
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）	276,591,127.08	-45,512,386.24	231,078,740.84
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 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）	431,490,855.72	-26,689,427.38	404,801,428.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-40,624,311.84	-40,624,311.84

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）	-102,214,006.35	8,036,756.19	-94,177,250.16
其中：1.基金申购款	1,656,011.56	-176,478.80	1,479,532.76
2.基金赎回款	-103,870,017.91	8,213,234.99	-95,656,782.92
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）	329,276,849.37	-59,276,983.03	269,999,866.34

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

申万菱信量化成长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”)证监许可[2016]第 3022 号文核准，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《申万菱信量化成长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 1,096,798,367.63 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2017)第 244 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《申万菱信量化成长混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 03 月 10 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,097,058,048.96 份基金份额，其中认购资金利息折合 259,681.33 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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《申万菱信量化成长混合型证券投资基金基金合同》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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 10%~95%；其中，本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金以及股票期权需缴纳的现金保证金后，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。本基金的业绩比较基准为中证 500 指数收益率×75% + 中证综合债指数收益率×25%。

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》、《申万菱信量化成长混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 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。

#### 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 01 月 01 日至 2019 年 06 月 30 日止期间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 06 月 30 日的财务状况以及 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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	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
中国工商银行股份有限公司	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。

## 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1月1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	14,502,829.44	4.30%	173,917,632.64	20.71%

#### 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	13,219.90	4.26%	13,155.27	19.57%
关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1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	161,468.33	20.90%	134,638.48	28.80%

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	上年度可比期间
----	----	---------



	2019年1月1日至2019年6月 30日	2018年1月1日至2018年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,789,371.85	2,453,061.23
其中：支付销售机构的客户维护费	682,580.83	1,009,720.67

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 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 X 1.5% / 当年天数。

#### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年6月 30日	2018年1月1日至2018年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	298,228.65	408,843.49

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 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，未发生投资本基金的情况。

#### 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		上年度可比期间	
	2019年1月1日至2019年6月30日		2018年1月1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
中国工商银行股份有限公司	42,325,575.44	95,276.12	22,800,389.13	157,992.65

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。

#### 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	-
600480	凌云股份	2019-06-20	2019-07-03	配股	8.74	8.75	19,290.00	168,594.60	168,787.50	-
300788	中信出版	2019-06-27	2019-07-05	网下新股申购	14.85	14.85	1,556.00	23,106.60	23,106.60	-

**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的股票。

**6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

截止本报告期末，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。

**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 06 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 184,277,331.57 元，属于第二层次的余额为 225,764.04 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

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 06 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)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	184,503,095.61	79.65
	其中：股票	184,503,095.61	79.65
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	44,572,958.35	19.24

8	其他各项资产	2,566,676.63	1.11
9	合计	231,642,730.59	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	8,058,023.31	3.49
C	制造业	114,726,691.77	49.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,356,944.00	3.62
E	建筑业	5,143,741.00	2.23
F	批发和零售业	11,844,754.95	5.13
G	交通运输、仓储和邮政业	5,509,212.00	2.38
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,870,048.03	2.97
J	金融业	33,869.94	0.01
K	房地产业	10,435,349.28	4.52
L	租赁和商务服务业	1,498,638.00	0.65
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,213,676.00	0.53
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,002,804.00	0.43
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	7,696,123.33	3.33
S	综合	2,113,220.00	0.91
	合计	184,503,095.61	79.84

### 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	002233	塔牌集团	269,200.00	3,144,256.00	1.36
2	002373	千方科技	178,200.00	3,047,220.00	1.32
3	000975	银泰资源	224,529.00	2,961,537.51	1.28
4	600260	凯乐科技	144,400.00	2,885,112.00	1.25
5	600580	卧龙电驱	334,904.00	2,816,542.64	1.22
6	600350	山东高速	579,900.00	2,783,520.00	1.20
7	600195	中牧股份	200,460.00	2,776,371.00	1.20
8	000598	兴蓉环境	609,600.00	2,773,680.00	1.20
9	601179	中国西电	741,000.00	2,741,700.00	1.19
10	600737	中粮糖业	305,400.00	2,650,872.00	1.15

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	601179	中国西电	2,941,010.00	1.34
2	002635	安洁科技	2,833,119.00	1.29
3	002233	塔牌集团	2,813,977.00	1.28
4	601003	柳钢股份	2,565,455.00	1.17
5	000761	本钢板材	2,453,754.00	1.12
6	002048	宁波华翔	2,301,238.48	1.05
7	600673	东阳光	2,162,806.00	0.99
8	600623	华谊集团	2,160,077.00	0.99
9	600143	金发科技	2,156,377.00	0.98
10	000990	诚志股份	2,145,990.00	0.98
11	002254	泰和新材	2,144,055.40	0.98
12	600500	中化国际	2,114,678.00	0.97
13	600348	阳泉煤业	1,932,699.00	0.88
14	603355	莱克电气	1,909,191.00	0.87
15	000528	柳工	1,859,252.30	0.85
16	002128	露天煤业	1,774,215.00	0.81
17	603025	大豪科技	1,755,236.84	0.80
18	600699	均胜电子	1,694,071.98	0.77
19	603766	隆鑫通用	1,686,739.00	0.77
20	601872	招商轮船	1,656,485.25	0.76

##### 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	002414	高德红外	3,489,887.90	1.59
2	600875	东方电气	3,167,654.96	1.45
3	000990	诚志股份	3,098,227.00	1.41
4	600006	东风汽车	3,027,976.00	1.38
5	000761	本钢板材	2,925,598.00	1.34
6	601678	滨化股份	2,921,721.98	1.33
7	601003	柳钢股份	2,687,637.00	1.23
8	600094	大名城	2,678,213.60	1.22
9	000401	冀东水泥	2,655,889.56	1.21
10	002048	宁波华翔	2,479,123.00	1.13
11	603369	今世缘	2,316,078.00	1.06
12	600519	贵州茅台	2,286,704.00	1.04
13	300438	鹏辉能源	2,277,664.58	1.04
14	300115	长盈精密	2,240,644.78	1.02
15	002299	圣农发展	2,231,418.00	1.02
16	000553	安道麦 A	2,218,994.92	1.01
17	600037	歌华有线	2,202,929.00	1.01
18	300088	长信科技	2,137,210.00	0.98
19	600362	江西铜业	2,077,519.00	0.95
20	600426	华鲁恒升	2,039,391.50	0.93

#### 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	159,557,305.84
卖出股票的收入（成交）总额	181,426,407.61

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**

代码	名称	持仓量	合约市值	公允价值变动	风险说明
IC1909	IC1909	12.00	11,552,640.00	101,160.00	-
IC1907	IC1907	8.00	7,850,240.00	325,160.00	-
公允价值变动总额合计					426,320.00
股指期货投资本期收益					1,918,377.09
股指期货投资本期公允价值变动					830,120.00

**7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金股指期货投资以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金利用股指期货工具，力争降低流动性管理的交易成本，增厚基金的业绩表现。

**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凯乐科技(600260.SH)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。

2019年4月29日，凯乐科技发布了《关于收到中国证监会湖北监管局警示函的公告》。经查明，凯乐科技存在募集资金信息披露违规，2017年9月15日，公司公告称将使用闲置募集资金

5 亿元临时补流资金，使用期限为 12 个月，但公司直至 2018 年 12 月 29 日才归还上述募集资金，已超过使用期限，却并未及时披露相关的进展或者变化情况、可能产生的影响；2018 年 10 月 9 日和 12 月 24 日，公司共将“增资上海凡卓”募投项目的 1.25 亿元资金从专户转入一般银行账户并使用，未履行相关审议程序并进行披露。根据《上市公司信息披露管理办法》第五十九条的规定，中国证监会湖北监管局对公司采取出具警示函的行政监管措施，并将上述违规行为情况记入诚信档案。

本基金采用量化模型选股策略，上述股票是量化模型批量选择结果之一。由于该事件并没有影响到量化模型关注的指标，因此也不影响基金管理人遵循量化模型的结果投资上述股票。

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	2,543,642.36
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,679.49
5	应收申购款	14,354.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,566,676.63

### 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



3,959	69,863.89	6,219,901.13	2.25%	270,371,225.95	97.75%
-------	-----------	--------------	-------	----------------	--------

## 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	295,243.38	0.11%

## 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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

## 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	310,094,025.54
本报告期基金总申购份额	2,940,951.11
减：本报告期基金总赎回份额	36,443,849.57
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	276,591,127.08

## 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、本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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	
中信建投证券	2	103,836,916.17	30.81%	94,626.57	30.48%	-
财通证券	2	76,124,510.46	22.59%	70,894.16	22.83%	新增
安信证券	1	40,990,592.71	12.16%	37,354.69	12.03%	-
方正证券	1	29,784,971.74	8.84%	27,738.18	8.93%	-
东方财富证券	2	27,394,217.63	8.13%	25,512.91	8.22%	-
东北证券	1	21,359,836.06	6.34%	19,893.46	6.41%	-
申万宏源证券	2	14,502,829.44	4.30%	13,219.90	4.26%	-
瑞银证券	1	13,507,013.83	4.01%	12,579.01	4.05%	-
东兴证券	1	9,366,485.01	2.78%	8,535.64	2.75%	-
国信证券	1	135,839.24	0.04%	123.79	0.04%	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
北京高华	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华信证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-

天风证券	2	-	-	-	-	-
五矿证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
华融证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	新增
国金证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安证券	2	-	-	-	-	-

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。

申万菱信基金管理有限公司

二〇一九年八月二十四日