

# B484信息披露

## 申万菱信中证申万新兴健康产业主题投资指数证券投资基金(LOF)

### 2018年第二季度报告

2018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：二〇一八年七月十九日

**§1 重要提示**

基金管理人的董事会及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责任。

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2018年7月13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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告自2018年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况	
基金简称	申万菱信中证申万新兴健康产业主题投资指数基金
基金代码	161919
交易代码	161919
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年10月10日
报告期末基金份额总额	68,399,043.73份
投资目标	本基金采取积极的投资方式，通过严格的股票筛选程序和数量化风险管理手段，力争控制基金的净值增长率与业绩比较基准之间的年度跟踪误差正负控制在0.50%以内，长期期望收益不低于4%，实现对中证申万新兴健康产业主题投资指数的有效跟踪。
业绩比较基准	本基金采用完全复制的方法进行跟踪，跟踪标的指数成份股及其权重，本基金将投资于标的指数成份股，并跟踪标的指数的表现，在风险可控的前提下，力争实现跟踪标的指数的投资收益，跟踪标的指数的净值增长率，但本基金不参与标的指数的申购、赎回及分红业务。
投资策略	本基金主要投资于符合复制的方法进行跟踪，跟踪标的指数成份股及其权重，本基金将投资于标的指数成份股，并跟踪标的指数的表现，在风险可控的前提下，力争实现跟踪标的指数的投资收益，跟踪标的指数的净值增长率，但本基金不参与标的指数的申购、赎回及分红业务。
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金跟踪中证申万新兴健康产业主题投资指数，跟踪标的指数的净值增长率，但本基金不参与标的指数的申购、赎回及分红业务。
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

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期 (2018年4月1日-2018年6月30日)
1.本期已实现收益	3,021,168.94
2.本期利润	-5,316,150.79
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0751
4.期末基金资产净值	57,958,298.38
5.期末基金份额净值	0.8470

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、托管费和其他各项费用,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 本报告期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	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	净值增长率④	①-③	②-④
过去三个月	-8.72%	15.4%	-8.89%	1.60%	0.17%	-1.00%

##### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收



鹏华基金管理有限公司 2017 年年度报告

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金基金经理时间	证券从业年限	说明
姓名	职务	任职日期	离任日期	说明
张一	本基金基金经理	2017-03-16	6年	<p>男,汉族,硕士研究生, 2012年起从事金融相关工作,曾任职于泰达宏利基金管理有限公司,该期间曾任泰达宏利基金管理有限公司, 2017年1月加入鹏华基金管理有限公司,现任鹏华基金管理有限公司 300 多只证券投资基金基金经理,曾管理过鹏华消费优选股票基金、鹏华新兴产业股票基金、鹏华医药生物股票基金、鹏华互联网+股票基金、鹏华新兴产业混合基金、鹏华医药生物混合基金、鹏华新兴产业混合</p>

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、公司资产之间严格分开;没有发生内幕交易、操纵市场和不正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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理人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,在确保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、投资决策和买卖股票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。

在投资和研究方面,本公司投资和研究人员不断完善研究方法和投资决策流程,提高投资决策的科学性和客观性,确保各投资组合享有公平的投资决策机会,建立公平交易的制度环境。

### 2018年第二季度报告

基金投资决策的科学性和客观性,确保各投资组合享有公平的投资决策机会,建立公平交易的制度环境。

在交易执行方面,本公司的投资管理职能和交易执行职能相隔离,通过实行集中交易制度对公平的交易分配机制,确保各投资组合享有公平的交易执行机会。

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。风险管理部通过对不同组合之间同向交易的价差率的假设检验、价格占优的次数百分比统计、价差交易模拟贡献与组合收益率差别的比较等方法对本报告期内以及连续四个季度期间内、不同时间窗口下公司管理的不同投资组合同向交易的价格差进行了分析,对于场外交易,还特别对比了组合之间发生的同向交易的市场公允价格和交易对手,判断交易是否公平且是否涉及利益输送。

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》,明确定义了在进行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与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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年二季度,上海与深圳A股整体均有所下跌,2018年二季度,上证综指下跌10.14%,深证成份指数下跌13.70%,沪深300指数下跌9.94%,中证500指数下跌14.67%,中小板指数下跌12.98%,创业板指数下跌15.46%。

操作上,基金运作主要着眼于控制每日跟踪误差,净值表现和业绩基准的偏差幅度。从实际运作结果观察,基金跟踪误差的主要来源是长期停牌股票估值调整以及指数成分股调整的影响。

4.4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

2018年二季度,上海与深圳A股整体均有所下跌,2018年二季度,上证综指下跌10.14%,深证成份指数下跌13.70%,沪深300指数下跌9.94%,中证500指数下跌14.67%,中小板指数下跌12.98%,创业板指数下跌15.46%。

操作上,基金运作主要着眼于控制每日跟踪误差,净值表现和业绩基准的偏差幅度。从实际运作结果观察,基金跟踪误差的主要来源是长期停牌股票估值调整以及指数成分股调整的影响。

元。

### § 5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

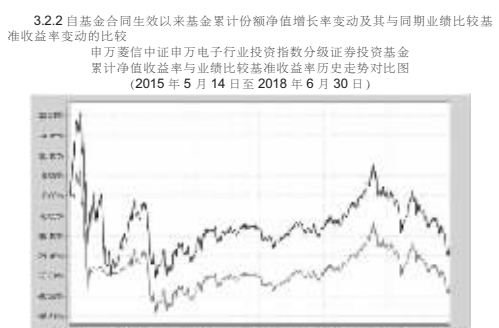
序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	53,592,285.80	92.19
	其中:股票	53,592,285.80	92.19
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	4,503,545.39	7.75
7	其他各项资产	36,220.87	0.06
8	合计	58,132,052.06	100.00

注:本基金未开通港股通交易机制投资于港股。

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

## 申万菱信中证申万电子行业投资指数分级证券投资基金

### 2018年第二季度报告



基金管理人		基金管理人		基金管理人	基金管理人
§4 管理人报告					
4.1 基金经理(或基金经理小组)简介					
姓名	职务	任本基金基金经理时间	证券从业年限	说明	
张一	本基金基金经理	2017-06-01	6年	<p>张一先生,硕士研究生,2012年起从事金融相关工作。曾任招商证券基金销售有限公司、国投证券股份有限公司,2017年1月加入南方基金基金销售有限公司,现任南方基金专户 300 余位基金经理助理,负责专户、中资股及证券另类投资业务。</p> <p>张一先生曾任职于南方证券基金销售业务,于 2012 年加入南方基金销售业务, LOP, 于 2012 年负责南方基金专户证券类基金销售业务, 2013 年负责中资股证券类基金销售业务, 2014 年负责中资股证券类基金销售业务, 2015 年负责中资股证券类基金销售业务, 2016 年负责中资股证券类基金销售业务, 2017 年负责中资股证券类基金销售业务。</p>	

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、公司资产之间严格分开;没有发生内幕交易、操纵市场和不正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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理人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,在确保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、投资决策和买卖股票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。

在投资和研究方面,本公司投资和研究人员不断完善研究方法和投资决策流程,提高投资决策的科学性和客观性,确保各投资组合享有公平的投资决策机会,建立公平交易的制度环境。

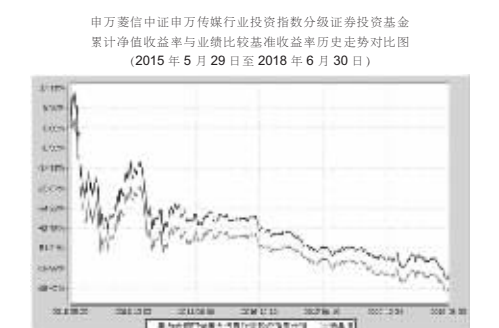
序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	119,453,113.93	92.26
	其中:股票	119,453,113.93	92.26
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买入返售的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	9,930,427.69	7.67
7	其他各项资产	57,306.46	0.04
8	合计	129,424,848.08	100.00

注:本基金采用普通开放式交易机制投资于港股。

2. 本基金未持有与公允价值计量相关的金融资产。

## 申万菱信中证申万传媒行业投资指数分级证券投资基金

### 2018年第二季度报告



§4 管理人报告				
4.1 基金经理(或基金经理小组)简介				
姓名	职务	任本基金基金经理时间		说明
		任职日期	离任日期	
张一	本基金基金经理	2017.06.01	6年	<p>张一先生,硕士研究生学历,2012年毕业于金融信息工程,曾任新华万安基金管理有限公司、国投瑞银基金管理有限公司,2017年1月加入万安基金瑞银资产管理公司,现任资产管理部副总监兼中债新综合债券投资基金经理,中债新综合债券投资基金经理(LOF),中债新综合债券7年纯债指数证券投资基金基金经理,中债新综合债券7年国债指数证券投资基金基金经理,中债新综合债券7年地方政府债指数证券投资基金基金经理,中债新综合债券7年地方政府债指数证券投资基金,中债新综合债券7年地方政府债指数</p>

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、公司资产之间严格分开;没有发生内幕交易、操纵市场和不正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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理人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,在确保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、投资决策和买卖股票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。

在投资和研究方面,本公司投资和研究人员不断完善研究方法和投资决策流程,提高投资决策的科学性和客观性,确保各投资组合享有公平的投资决策机会,建立公平交易的制度环境。

比例约 0.20%。

4.5 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明

本基金在本报告期内出现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,本基金的资产净值未恢复至五千万元以上。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	39,332,376.89	92.26
	其中:股票	39,332,376.89	92.26
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-