

申万菱信新能源汽车主题灵活配置混合型证券投资基金

2018年第二季度报告

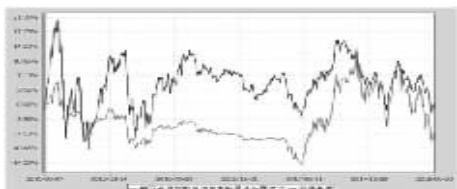


图1：本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图（2017年5月7日至2018年6月30日）

§ 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	任职日期	离任日期
孙勇	本基金基金经理		2017-04-18	-
任海峰	本基金基金经理		2017-11-27	-

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遵规守信情况的说明
本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及相关法律法规的规定,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约定,信息披露及时、准确、完整;本基金资产与本基金管理人及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用中,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》,通过组织架构的设置、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。
在投资和研究方面,本公司投资和研究部门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,建立公平交易执行的制度环境。
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和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双向交易

的价差率假设检验、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异的比较等方法对本报告期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间双向交易的交易价差进行了分析;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 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年第二季度,上证指数下跌10.14%,中证新能源汽车指数下跌16.24%,新能源汽车板块表现弱于市场。
2018年第二季度,新能源汽车产业链各环节市场表现出现了明显的分化,受到产品价格下降影响,资质类相关个股表现落后,而受益于动力电池技术高纯化趋势的相关个股表现相对较好。
报告期内,本基金保持灵活仓位,主要投资于新能源汽车产业链具有竞争优势的公司,包括具备技术、资源优势的材料企业,具有国际竞争力的零部件供应企业等。
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-12.25%,同期业绩基准表现为-7.37%。
4.5 报告期内本基金持有的人数或基金资产净值预警说明
无。

5 § 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	274,542,319.06	74.34
2	其中:股票	274,542,319.06	74.34
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
9	银行存款和结算备付金合计	89,411,739.05	24.21
10	其他资产	5,342,017.64	1.45
合计		368,296,129.75	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
5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	农林、牧、渔业	5,050,317.41	3.67
2	采矿业	-	-
3	制造业	99,246,423.10	72.18
4	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
5	建筑业	-	-
6	批发和零售业	3,379,500.00	2.46
7	交通运输、仓储和邮政业	-	-
8	住宿和餐饮业	-	-
9	金融业	-	-
10	信息技术、软件和信息技术服务业	14,546,971.00	10.58
11	房地产业	-	-
12	租赁和商务服务业	4,630,750.00	3.51
13	科学研究和技术服务业	-	-
14	水利、环境和公共设施管理业	-	-
15	教育、体育和娱乐业	-	-
16	文化、体育和娱乐业	-	-
17	合计	128,274,361.51	93.29

5.2.2 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。
5.3 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组合明细
本基金本报告期末未持有债券。
5.5 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债券投资组合明细
本基金本报告期末未持有债券。
5.6 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。
5.7 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。
5.8 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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
根据本基金基金合同,本基金不得参与股指期货交易。
5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金本报告期末未投资股指期货。

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	128,274,361.51	93.27
2	其中:股票	128,274,361.51	93.27
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
9	银行存款和结算备付金合计	10,320,376.07	7.44
10	其他资产	265,971.47	0.19
合计		138,664,709.05	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
5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	农林、牧、渔业	20,411,057.21	3.90
2	采矿业	119,020,922.58	22.72
3	制造业	23,333,415.19	4.07
4	电力、热力、燃气及水生产和供应业	27,883,369.54	5.32
5	建筑业	5,840,043.33	1.12
6	批发和零售业	16,722,931.13	3.19
7	交通运输、仓储和邮政业	-	-
8	住宿和餐饮业	-	-
9	金融业	230,259,536.06	43.96
10	信息技术、软件和信息技术服务业	40,511,198.86	7.73
11	房地产业	544,133.04	0.10
12	租赁和商务服务业	-	-
13	科学研究和技术服务业	-	-
14	水利、环境和公共设施管理业	81,226.14	0.02
15	教育、体育和娱乐业	-	-
16	文化、体育和娱乐业	-	-
17	合计	450,767,457.08	92.15

5.2.2 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。
5.3 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组合明细
本基金本报告期末未持有债券。
5.5 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债券投资组合明细
本基金本报告期末未持有债券。
5.6 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。
5.7 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。
5.8 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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
根据本基金基金合同,本基金不得参与股指期货交易。
5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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	-	-
C	制造业	260,885,273.07	70.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,559.85	0.02
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	13,504,290.00	3.67
J	金融业	-	-
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	81,226.14	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	教育、体育和娱乐业	-	-
P	文化、体育和娱乐业	-	-
合计		274,542,319.06	74.59

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	603799	华友铝业	257,290.00	25,078,056.30	6.81
2	300124	汇川技术	652,940.00	21,429,409.80	5.82
3	603659	恒泰艾普	236,900.00	19,266,721.00	5.19
4	300618	振源股份	128,510.00	16,492,973.40	4.48
5	600406	国电南瑞	854,700.00	13,504,290.00	3.67
6	600885	安泰股份	430,083.00	12,968,063.36	3.50
7	002851	麦格米特	425,310.00	12,453,076.80	3.38
8	600884	杉杉股份	508,100.00	11,229,010.00	3.05
9	600104	上汽集团	311,907.00	10,913,625.93	2.96
10	002341	顺络科技	818,355.00	10,875,937.95	2.95

5.4 报告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。
5.5 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债券投资组合明细
本基金本报告期末未持有债券。
5.6 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。
5.7 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。
5.8 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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
根据本基金基金合同,本基金不得参与股指期货交易。
5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金本报告期末未投资股指期货。

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	5,050,317.41	3.67
B	采矿业	-	-
C	制造业	99,246,423.10	72.18
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	3,379,500.00	2.46
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	14,546,971.00	10.58
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	4,630,750.00	3.51
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	教育、体育和娱乐业	-	-
P	文化、体育和娱乐业	-	-
合计		128,274,361.51	93.29

5.2.2 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。
5.3 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组合明细
本基金本报告期末未持有债券。
5.5 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债券投资组合明细
本基金本报告期末未持有债券。
5.6 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。
5.7 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。
5.8 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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
根据本基金基金合同,本基金不得参与股指期货交易。
5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金本报告期末未投资股指期货。

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000651	格力电器	228,646.00	10,780,658.90	7.84
2	600519	贵州茅台	14,600.00	10,679,316.00	7.77
3	603846	芯联达	384,183.00	8,627,495.27	6.27
4	300010	思杰	685,000.00	8,384,400.00	6.10
5	300595	顺祥股份	151,528.00	5,913,012.96	4.30
6	002394	华邦股份	44,300.00	5,329,360.00	4.24
7	600770	东方雨润	102,745.00	5,674,606.35	4.13
8	002096	广济股份	140,929.00	5,050,317.41	3.67
9	601888	中国国旅	75,000.00	4,630,750.00	3.51
10	002737	美年健康	215,000.00	4,650,440.00	3.38

5.4 报告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。
5.5 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债券投资组合明细
本基金本报告期末未持有债券。
5.6 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。
5.7 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。
5.8 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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
根据本基金基金合同,本基金不得参与股指期货交易。
5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金本报告期末未投资股指期货。

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	20,411,057.21	3.90
B	采矿业	119,020,922.58	22.72
C	制造业	23,333,415.19	4.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	27,883,369.54	5.32
E	建筑业	5,840,043.33	1.12
F	批发和零售业	16,722,931.13	3.19
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	-	-
J	金融业	230,259,536.06	43.96
K	房地产业	40,511,198.86	7.73
L	租赁和商务服务业	544,133.04	0.10
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	81,226.14	0.02
O	教育、体育和娱乐业	-	-
P	文化、体育和娱乐业	-	-
合计		450,767,457.08	92.15

5.2.2 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。
5.3 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组合明细
本基金本报告期末未持有债券。
5.5 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债券投资组合明细
本基金本报告期末未持有债券。
5.6 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。
5.7 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。
5.8 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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
根据本基金基金合同,本基金不得参与股指期货交易。
5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.10.1 本期国债期货投资政策
根据本基金基金合同,本基金不得参与国债期货交易。
5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
根据本基金基金合同,本基金不得参与国债期货交易。
5.10.3 本期国债期货投资评价
根据本基金基金合同,本基金不得参与国债期货交易。
5.11 投资组合报告附注
5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现过被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.11.2 本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。
5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	143,532.17
2	应收证券清算款	5,004,015.41
3	应收利息	-
4	应收股利	-
5	其他应收款	15,861.53
6	其他应收款	178,642.53
7	预付款项	-
8	其他	-
9	合计	5,342,017.64

5.11.4 报告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。
5.11.5 报告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股票中不存在流通受限的情况。

§ 6 开放式基金份额变动
单位:份

本报告期期初基金份额总额	405,593,596.18
报告期内基金总申购份额	165,957,970.94
减:报告期内基金总赎回份额	26,873,517.55
报告期内基金净申购份额	365,278,049.57
本报告期末基金份额总额	365,278,049.57

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
本报告期内,本基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况。
8.1 备查文件目录
§ 8 备查文件目录
招募说明书及其定期更新;
发售公告;
成立公告;
开放日常交易业务公告;
定期报告;
其他临时公告。
8.2 存放地点
上述备查文件中基金合同、招募说明书及其定期更新,基金发售公告和基金成立公告均放置于本基金管理人及基金托管人的住所;开放日常交易业务公告、定期报告和其他临时公告放置于本基金管理人的住所。本基金管理人住所地址为:中国上海市中山南路100号11层。
8.3 查阅方式
上述文件均可到本基金管理人的住所进行查阅,也可在本基金管理人的网站进行查询,查询网址:www.swsmu.com。
申万菱信基金管理有限公司
二〇一八年七月十九日

8.1 备查文件目录
§ 8 备查文件目录
招募说明书及其定期更新;
发售公告;
成立公告;
开放日常交易业务公告;
定期报告;
其他临时公告。
8.2 存放地点
上述备查文件中基金合同、招募说明书及其定期更新,基金发售公告和基金成立公告均放置于本基金管理人及基金托管人的住所;开放日常交易业务公告、定期报告和其他临时公告放置于本基金管理人的住所。本基金管理人住所地址为:中国上海市中山南路100号11层。
8.3 查阅方式
上述文件均可到本基金管理人的住所进行查阅,也可在本基金管理人的网站进行查询,查询网址:www.swsmu.com。
申万菱信基金管理有限公司
二〇一八年七月十九日

8.1 备查文件目录
§ 8 备查文件目录
招募说明书及其定期更新;
发售公告;
成立公告;
开放日常交易业务公告;
定期报告;
其他临时公告。
8.2 存放地点
上述备查文件中基金合同、招募说明书及其定期更新,基金发售公告和基金成立公告均放置于本基金管理人及基金托管人的住所;开放日常交易业务公告、定期报告和其他临时公告放置于本基金管理人的住所。本基金管理人住所地址为:中国上海市中山南路100号11层。
8.3 查阅方式
上述文件均可到本基金管理人的住所进行查阅,也可在本基金管理人的网站进行查询,查询网址:www.swsmu.com。
申万菱信基金管理有限公司
二〇一八年七月十九日

8.1 备查文件目录
§ 8 备查文件目录
招募说明书及其定期更新;
发售公告;
成立公告;
开放日常交易业务公告;
定期报告;
其他临时公告。
8.2 存放地点
上述备查文件中基金合同、招募说明书及其定期更新,基金发售公告和基金成立公告均放置于本基金管理人及基金托管人的住所;开放日常交易业务公告、定期报告和其他临时公告放置于本基金管理人的住所。本基金管理人住所地址为:中国上海市中山南路100号11层。
8.3 查阅方式
上述文件均可到本基金管理人的住所进行查阅,也可在本基金管理人的网站进行查询,查询网址:www.swsmu.com。
申万菱信基金管理有限公司
二〇一八年七月十九日

8.1 备查文件目录
§ 8 备查文件目录
招募说明书及其定期更新;
发售公告;
成立公告;
开放日常交易业务公告;
定期报告;
其他临时公告。
8.2 存放地点
上述备查文件中基金合同、招募说明书及其定期更新,基金发售公告和基金成立公告均放置于本基金管理人及基金托管人的住所;开放日常交易业务公告、定期报告和其他临时公告放置于本基金管理人的住所。本基金管理人住所地址为:中国上海市中山南路100号11层。
8.3 查阅方式
上述文件均可到本基金管理人的住所进行查阅,也可在本基金管理人的网站进行查询,查询网址:www.swsmu.com。
申万菱信基金管理有限公司
二〇一八年七月十九日

5.10.1 本期国债期货投资政策
根据本基金基金合同,本基金不得参与国债期货交易。
5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
根据本基金基金合同,本基金不得参与国债期货交易。
5.10.3 本期国债期货投资评价
根据本基金基金合同,本基金不得参与国债期货交易。
5.11 投资组合报告附注
5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现过被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.11.2 本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。
5.11.3 其他资产构成

5.11.3 其他资产构成		
序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	96,634.45
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	9,289.45
5	应收申购款	2,236,531.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,342,455.05