

## 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



\$ 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	任本基金的基金经理期限	证券从业年限	说明
孙砾	本基金基金经理	2017-04-18	-	孙砾女士,经济学学士,曾就职于中企华评估有限公司,2009年5月加入申万菱信基金管理有限公司,历任行业研究员、基金经理助理等职务。2013年1月加入申万菱信基金管理有限公司,历任行业研究员、基金经理助理等职务。2015年1月加入申万菱信基金管理有限公司,历任行业研究员、基金经理助理等职务。2016年1月加入申万菱信基金管理有限公司,历任行业研究员、基金经理助理等职务。2017年4月加入申万菱信基金管理有限公司,担任基金经理。
任翀鹏	本基金基金经理	2017-11-27	-	任翀鹏先生,经济学学士,2003年起从金融相关工作,历任光大银行零售银行部产品经理、光大银行总行零售风险管理部分析师,天相投资有限公司研究员,申万菱信基金管理有限公司基金经理,2010年11月加入申万菱信基金管理有限公司,历任行业研究员、基金经理助理等职务。2014年1月加入申万菱信基金管理有限公司,担任基金经理。

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性情况的说明

本基金报告期内,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,本基金管理人诚实信用、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力求持有人最大利益。

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;本基金管理人与基金托管人之间公平公开,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 公平交易专题说明

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公平交易过程中的监督。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2018年第二季度,申万菱信新能源汽车指数下跌 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势。

2018 年第二季度,新能源汽车产业各环节表现出了明显的分化,受到产品价格下跌及原材料成本下降的影响,动力电池、电机电控、驱动系统等环节表现较好,而电池材料、充电桩等环节表现较弱,而受益于动力电池技术高壁垒的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,包括技术、资源优势的材料企业,具有国际竞争力的零部件供应商企业等。

4.5 报告期内基金持有品种情况

无。

\$ 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	274,542,319.08	74.34
其中:股票		274,542,319.08	74.34
2 固定收益投资		-	-
其中:债券		-	-
3 货币市场工具		-	-
4 其他金融工具		-	-
5 买入返售金融资产		-	-
6 银行存款和结算备付金合计		89,411,739.05	24.21
7 其他各项资产		5,342,071.64	1.45
8 合计		369,296,297.55	100.00

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申购基金份额的各项费用(例如:申购费、赎回费等),计入认购或交易基金各项费用后,实际收益率将低于所列示数据。

3.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

单位:人民币元

阶段	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④
过去二个月	-12.20%	14.5%	-7.70%	0.86%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

单位:人民币元

阶段	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④
过去二个月	22.2%	15.7%	-7.65%	0.91%

3.2.3 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

单位:人民币元

阶段	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④
过去二个月	22.2%	15.7%	-7.65%	0.91%

3.2.4 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

单位:人民币元

阶段	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④
过去二个月	22.2%	15.7%	-7.65%	0.91%

3.2.5 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

单位:人民币元

阶段	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④
过去二个月	22.2%	15.7%	-7.65%	0.91%

3.2.6 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

单位:人民币元

阶段	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④
过去二个月	22.2%	15.7%	-7.65%	0.91%

3.2.7 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

单位:人民币元

阶段	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④
过去二个月	22.2%	15.7%	-7.65%	0.91%

3.2.8 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

单位:人民币元

阶段	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④
过去二个月	22.2%	15.7%	-7.65%	0.91%

3.2.9 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

单位:人民币元

阶段	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④
过去二个月	22.2%	15.7%	-7.65%	0.91%

3.2.10 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

单位:人民币元

阶段	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④
过去二个月	22.2%	15.7%	-7.65%	0.91%

3.2.11 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

单位:人民币元

阶段	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④
过去二个月	22.2%	15.7%	-7.65%	0.91%

3.2.12 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

单位:人民币元

阶段	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④
过去二个月	22.2%	15.7%	-7.65%	0.91%

3.2.13 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

单位:人民币元

阶段	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④
过去二个月	22.2%	15.7%	-7.65%	0.91%

3.2.14 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

单位:人民币元

阶段	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④

<tbl\_r cells="5" ix="1" maxcspan="1" maxrspan="