

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。
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年7月13日复核了本基金报告中的三类指标、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。
本基金的财务资料未经审计。

本报机构自2018年1月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称		申万菱信量化成长混合型证券投资基金	
基金代码	000416	基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年10月10日	报告期末基金总资产	329,226,280.02份
基金管理费	0.6%	基金托管费	0.2%
基金销售服务费	0.25%	其他费用	0.05%
合计	26.05%	基金总费率	2.85%

本基金采用单只的0.05%费率收取，严格按照比例执行，力争取得长期回报的绝对收益。

本基金采用量化技术对资产配置进行优化，择时定性的思想和理

投资策略

本基金平均每年度的预期收益率为14.67%，基金业绩基准表现为-10.68%，申万菱信量化成

长基金净值表现率为-0.90%，领先业绩基准0.88%。

45报告期末基金持有人数或基金资产净值余额说明

无。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标		报告期(2018年4月1日至2018年6月30日)
1.本期已实现收益	-3,411,417.28	
2.本期利润	-10,236,025.59	99,100,007
3.期末平均基金份额利润	-0.0490	0.0000
4.期末基金份额净值	189,040,620.00	267,276,374.1
5.期末基金份额净值	0.936	1.002

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管理费、托管费等各项交易费用，但不包括持有人认

购申购基金的各项费用(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

益水平要低于所示数字。

3.2基金净值表现

3.2.1本期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变动的比

率

注:2)本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益率变动

的比率

申万菱信量化成长混合型证券投资基金

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2018年6月30日)

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管理费、托管费等各项交易费用，但不包括持有人认

购申购基金的各项费用(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

益水平要低于所示数字。

3.2.2基金净值表现

3.2.1.1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变动的比

率

注:1)本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益率变动

的比率

申万菱信量化成长混合型证券投资基金

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2018年6月30日)

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管理费、托管费等各项交易费用，但不包括持有人认

购申购基金的各项费用(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

益水平要低于所示数字。

3.2.2基金净值表现

3.2.2.1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变动的比

率

注:1)本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益率变动

的比率

申万菱信量化成长混合型证券投资基金

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2018年6月30日)

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管理费、托管费等各项交易费用，但不包括持有人认

购申购基金的各项费用(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

益水平要低于所示数字。

3.2.3基金净值表现

3.2.3.1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变动的比

率

注:1)本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益率变动

的比率

申万菱信量化成长混合型证券投资基金

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2018年6月30日)

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管理费、托管费等各项交易费用，但不包括持有人认

购申购基金的各项费用(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

益水平要低于所示数字。

3.2.4基金净值表现

3.2.4.1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变动的比

率

注:1)本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益率变动

的比率

申万菱信量化成长混合型证券投资基金

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2018年6月30日)

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管理费、托管费等各项交易费用，但不包括持有人认

购申购基金的各项费用(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

益水平要低于所示数字。

3.2.5基金净值表现

3.2.5.1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变动的比

率

注:1)本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益率变动

的比率

申万菱信量化成长混合型证券投资基金

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2018年6月30日)

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管理费、托管费等各项交易费用，但不包括持有人认

购申购基金的各项费用(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

益水平要低于所示数字。

3.2.6基金净值表现

3.2.6.1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变动的比

率

注:1)本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益率变动

的比率

申万菱信量化成长混合型证券投资基金

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2018年6月30日)

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管理费、托管费等各项交易费用，但不包括持有人认

购申购基金的各项费用(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

益水平要低于所示数字。

3.2.7基金净值表现

3.2.7.1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变动的比

率

注:1)本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益率变动

的比率

申万菱信量化成长混合型证券投资基金

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2018年6月30日)

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管理费、托管费等各项交易费用，但不包括持有人认

购申购基金的各项费用(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

益水平要低于所示数字。

3.2.8基金净值表现

3.2.8.1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变动的比

率

注:1)本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益率变动

的比率

申万菱信量化成长混合型证券投资基金

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2018年6月30日)

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管理费、托管费等各项交易费用，但不包括持有人认

购申购基金的各项费用(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

益水平要低于所示数字。

3.2.9基金净值表现

</div