

# 申万菱信量化成长混合型证券投资基金

## 2018年第二季度报告

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年二季度,上海与深圳A股整体均有所下跌,上证综指下跌10.14%,深证成指指数下跌13.70%,沪深300指数下跌9.94%,中证500指数下跌14.67%,中证1000指数下跌17.51%。本基金采用以估值、盈利、成长等因子为核心的多元化因子模型,力争构建具有性价比的成长组合。

### 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,中证500指数下跌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期间表现为-9.90%,领先业绩基准0.88%。  
4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明  
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)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	204,880,314.43	75.48
2	固定收益投资	204,880,314.43	75.48
3	货币资金	-	-
4	资产支持证券	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	38,000,000.00	13.89
8	其他各项资产	10,887,230.91	4.01
9	其他资产	28,564,100.84	10.52
10	合计	271,431,427.40	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

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	2,619,127.00	0.97
B	采矿业	5,975,560.26	2.21
C	制造业	127,973,200.71	47.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,363,406.68	2.74
E	建筑业	7,175,438.40	2.66
F	批发和零售业	9,787,215.61	3.60
G	交通运输、仓储和邮政业	4,978,504.00	1.83
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,889,464.00	2.56
J	金融业	3,827,744.00	1.42
K	房地产业	10,888,236.25	4.00
L	租赁和商务服务业	9,776,215.61	3.60
M	科学研究和技术服务业	776,802.00	0.29
N	水利、环境和公共设施管理业	2,306,113.14	0.86
O	卫生和社会工作	-	-
P	教育	-	-
Q	文化、体育和娱乐业	9,586,704.00	3.56
R	综合	-	-
合计		204,880,314.43	75.48

#### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合


#### 5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

## 量化驱动混合型证券

5.2.4 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.5 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.6 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.7 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.8 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.9 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.10 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.11 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.12 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.13 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.14 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.15 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.16 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.17 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.18 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.19 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.20 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.21 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.22 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.23 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.24 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.25 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.26 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.27 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.28 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.29 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.30 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.31 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.32 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.33 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.34 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.35 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.36 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.37 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.38 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.39 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.40 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.41 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.42 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.43 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.44 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.45 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.46 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.47 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.48 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.49 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.50 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.51 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.52 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.53 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.54 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.55 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.56 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.57 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.58 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.59 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.60 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.61 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.62 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.63 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.64 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.65 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.66 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.67 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.68 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.69 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.70 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.71 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.72 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.73 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.74 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.75 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.76 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.77 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.78 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.79 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.80 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.81 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.82 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.83 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.84 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.85 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.86 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.87 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.88 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.89 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.90 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.91 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.92 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.93 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.94 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.95 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.96 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.97 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.98 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.99 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.100 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.101 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.102 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.103 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.104 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.105 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.106 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.107 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.108 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.109 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.110 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.111 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.112 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.113 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.114 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.115 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.116 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.117 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.118 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.119 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.120 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.121 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.122 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.123 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.124 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.125 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.126 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.127 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.128 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.129 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.130 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.131 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.132 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.133 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.134 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.135 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.136 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.137 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.138 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.139 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.140 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.141 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.142 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.143 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.144 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.145 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.146 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.147 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.148 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.149 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.150 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.151 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.152 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.153 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.154 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.155 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.156 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.157 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.158 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.159 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.160 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.161 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.162 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.163 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.164 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.165 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.166 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.167 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.168 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.169 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.170 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.171 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.172 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.173 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.174 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.175 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.176 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.177 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.178 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.179 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.180 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.181 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.182 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.183 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.184 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.185 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.186 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.187 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.188 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.189 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.190 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.191 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.192 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.193 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.194 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.195 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.196 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.197 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.198 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.199 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.200 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.201 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.202 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.203 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.204 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.205 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.206 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.207 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.208 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.209 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.210 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.211 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.212 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.213 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.214 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.215 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.216 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.217 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.218 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.219 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.220 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.221 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.222 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.223 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.224 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
5.2.225 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合