

# 信息披露 Disclosure

## 申万菱信量化成长混合型证券投资基金招募说明书第三次更新(摘要)

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

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	600309	万华化学	63,100	2,866,002.00	1.06
2	002078	太阳纸业	204,200	2,850,798.00	1.06
3	002699	美盛文化	30,000	2,763,348.00	1.02
4	000696	古井贡酒	29,000	2,619,010.00	1.02
5	000418	中国天寿	37,100	2,574,885.00	0.96
6	601628	中国人寿	111,200,000	2,504,224.00	0.93
7	000830	鲁西化工	144,700,000	2,471,476.00	0.92
8	601900	南方传媒	259,000	2,444,960.00	0.91
9	600619	贵州茅台	3,200.00	2,340,672.00	0.87
10	600019	宝钢股份	294,977.00	2,237,870.83	0.85

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 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  
本基金本报告期末未持有债券。

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  
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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  
本基金本报告期末未持有贵金属。

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  
本基金本报告期末未持有权证。

9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明  
9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值	公允价值变动	风险说明
IC1807	IC1807	1400	14,526,400.00	-790,510.00	-
IC1809	IC1809	600	6,136,120.00	-888,000.00	-
IC1812	IC1812	200	2,003,360.00	12,360.00	-

公允价值变动总额合计 -1,675,560.00  
股指期货投资本期收益 -760,669.71  
股指期货投资本期公允价值变动 -1,675,560.00

9.2 本基金股指期货投资的收益情况  
本基金采用市场对冲策略，以流动性管理、在市场具有较好明显下跌风险时，基于风险管理角度，在基金合同的限定内进行适度的套期保值，控制基金的下跌风险；由于基金的申购及赎回并不具有同步性，基金的赎回也会造成较高基金资产净值比例，本基金通过股指期货进行流动性管理，以减少大额申购赎回对基金净值带来的影响。

10 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
10.1 本期国债期货投资情况  
本基金本报告期末未持有国债期货。

10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
本基金本报告期末未持有国债期货。

10.3 本期国债期货投资评价  
本基金本报告期末未持有国债期货。

11 投资组合报告摘要  
11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现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、处罚的情况。

11.2 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。  
11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	4,846,036.77
2	应收证券清算款	343.37
3	应收股利	-
4	应收利息	28,867.53
5	应收申购款	11,806.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,887,053.63

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。

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002699	美盛文化	2,763,348.00	1.02	限售流通股

十二、基金的业绩  
注：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交易的各项费用(例如：申购费、赎回费等)，计入认购或交易的各项费用后，实际收益水平要低于所列数字。

自基金合同成立以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的对比

日期	净值增长率①	业绩比较基准②	净值增长率-业绩比较基准差③	①-③	②-④
2017年3月10日(基金合同生效日)至2017年12月31日	-61.9%	0.63%	-1.67%	0.72%	-4.32%
2018年1月1日至2018年6月30日	-12.5%	1.12%	-11.59%	1.06%	-1.00%
2017年3月10日至2018年6月30日	-18.0%	0.84%	-13.24%	0.87%	-4.40%

注：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交易的各项费用(例如：申购费、赎回费等)，计入认购或交易的各项费用后，实际收益水平要低于所列数字。

自基金合同成立以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的对比

日期	净值增长率①	业绩比较基准②	净值增长率-业绩比较基准差③	①-③	②-④
2017年3月10日(基金合同生效日)至2017年12月31日	-61.9%	0.63%	-1.67%	0.72%	-4.32%
2018年1月1日至2018年6月30日	-12.5%	1.12%	-11.59%	1.06%	-1.00%
2017年3月10日至2018年6月30日	-18.0%	0.84%	-13.24%	0.87%	-4.40%

注：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交易的各项费用(例如：申购费、赎回费等)，计入认购或交易的各项费用后，实际收益水平要低于所列数字。

自基金合同成立以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的对比

日期	净值增长率①	业绩比较基准②	净值增长率-业绩比较基准差③	①-③	②-④
2017年3月10日(基金合同生效日)至2017年12月31日	-61.9%	0.63%	-1.67%	0.72%	-4.32%
2018年1月1日至2018年6月30日	-12.5%	1.12%	-11.59%	1.06%	-1.00%
2017年3月10日至2018年6月30日	-18.0%	0.84%	-13.24%	0.87%	-4.40%

注：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交易的各项费用(例如：申购费、赎回费等)，计入认购或交易的各项费用后，实际收益水平要低于所列数字。

自基金合同成立以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的对比

日期	净值增长率①	业绩比较基准②	净值增长率-业绩比较基准差③	①-③	②-④
2017年3月10日(基金合同生效日)至2017年12月31日	-61.9%	0.63%	-1.67%	0.72%	-4.32%
2018年1月1日至2018年6月30日	-12.5%	1.12%	-11.59%	1.06%	-1.00%
2017年3月10日至2018年6月30日	-18.0%	0.84%	-13.24%	0.87%	-4.40%

注：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交易的各项费用(例如：申购费、赎回费等)，计入认购或交易的各项费用后，实际收益水平要低于所列数字。

自基金合同成立以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的对比

日期	净值增长率①	业绩比较基准②	净值增长率-业绩比较基准差③	①-③	②-④
2017年3月10日(基金合同生效日)至2017年12月31日	-61.9%	0.63%	-1.67%	0.72%	-4.32%
2018年1月1日至2018年6月30日	-12.5%	1.12%	-11.59%	1.06%	-1.00%
2017年3月10日至2018年6月30日	-18.0%	0.84%	-13.24%	0.87%	-4.40%

注：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交易的各项费用(例如：申购费、赎回费等)，计入认购或交易的各项费用后，实际收益水平要低于所列数字。

自基金合同成立以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的对比

日期	净值增长率①	业绩比较基准②	净值增长率-业绩比较基准差③	①-③	②-④
2017年3月10日(基金合同生效日)至2017年12月31日	-61.9%	0.63%	-1.67%	0.72%	-4.32%
2018年1月1日至2018年6月30日	-12.5%	1.12%	-11.59%	1.06%	-1.00%
2017年3月10日至2018年6月30日	-18.0%	0.84%	-13.24%	0.87%	-4.40%

注：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交易的各项费用(例如：申购费、赎回费等)，计入认购或交易的各项费用后，实际收益水平要低于所列数字。

自基金合同成立以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的对比

日期	净值增长率①	业绩比较基准②	净值增长率-业绩比较基准差③	①-③	②-④
2017年3月10日(基金合同生效日)至2017年12月31日	-61.9%	0.63%	-1.67%	0.72%	-4.32%
2018年1月1日至2018年6月30日	-12.5%	1.12%	-11.59%	1.06%	-1.00%
2017年3月10日至2018年6月30日	-18.0%	0.84%	-13.24%	0.87%	-4.40%

注：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交易的各项费用(例如：申购费、赎回费等)，计入认购或交易的各项费用后，实际收益水平要低于所列数字。

自基金合同成立以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的对比

日期	净值增长率①	业绩比较基准②	净值增长率-业绩比较基准差③	①-③	②-④
2017年3月10日(基金合同生效日)至2017年12月31日	-61.9%	0.63%	-1.67%	0.72%	-4.32%
2018年1月1日至2018年6月30日	-12.5%	1.12%	-11.59%	1.06%	-1.00%
2017年3月10日至2018年6月30日	-18.0%	0.84%	-13.24%	0.87%	-4.40%

注：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交易的各项费用(例如：申购费、赎回费等)，计入认购或交易的各项费用后，实际收益水平要低于所列数字。

自基金合同成立以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的对比

日期	净值增长率①	业绩比较基准②	净值增长率-业绩比较基准差③	①-③	②-④
2017年3月10日(基金合同生效日)至2017年12月31日	-61.9%	0.63%	-1.67%	0.72%	-4.32%
2018年1月1日至2018年6月30日	-12.5%	1.12%	-11.59%	1.06%	-1.00%
2017年3月10日至2018年6月30日	-18.0%	0.84%	-13.24%	0.87%	-4.40%

注：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交易的各项费用(例如：申购费、赎回费等)，计入认购或交易的各项费用后，实际收益水平要低于所列数字。

自基金合同成立以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的对比

日期	净值增长率①	业绩比较基准②	净值增长率-业绩比较基准差③	①-③	②-④
2017年3月10日(基金合同生效日)至2017年12月31日	-61.9%	0.63%	-1.67%	0.72%	-4.32%
2018年1月1日至2018年6月30日	-12.5%	1.12%	-11.59%	1.06%	-1.00%
2017年3月10日至2018年6月30日	-18.0%	0.84%	-13.24%	0.87%	-4.40%

注：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交易的各项费用(例如：申购费、赎回费等)，计入认购或交易的各项费用后，实际收益水平要低于所列数字。

自基金合同成立以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的对比

日期	净值增长率①	业绩比较基准②	净值增长率-业绩比较基准差③	①-③	②-④
2017年3月10日(基金合同生效日)至2017年12月31日	-61.9%	0.63%	-1.67%	0.72%	-4.32%
2018年1月1日至2018年6月30日	-12.5%	1.12%	-11.59%	1.06%	-1.00%
2017年3月10日至2018年6月30日	-18.0%	0.84%	-13.24%	0.87%	-4.40%

注：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交易的各项费用(例如：申购费、赎回费等)，计入认购或交易的各项费用后，实际收益水平要低于所列数字。

自基金合同成立以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的对比

日期	净值增长率①	业绩比较基准②	净值增长率-业绩比较基准差③	①-③	②-④
2017年3月10日(基金合同生效日)至2017年12月31日	-61.9%	0.63%	-1.67%	0.72%	-4.32%
2018年1月1日至2018年6月30日	-12.5%	1.12%	-11.59%	1.06%	-1.00%
2017年3月10日至2018年6月30日	-18.0%	0.84%	-13.24%	0.87%	-4.40%

注：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交易的各项费用(例如：申购费、赎回费等)，计入认购或交易的各项费用后，实际收益水平要低于所列数字。

自基金合同成立以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的对比

日期	净值增长率①	业绩比较基准②	净值增长率-业绩比较基准差③	①-③	②-④
2017年3月10日(基金合同生效日)至2017年12月31日	-61.9%	0.63%	-1.67%	0.72%	-4.32%
2018年1月1日至2018年6月30日	-12.5%	1.12%	-11.59%	1.06%	-1.00%
2017年3月10日至2018年6月30日	-18.0%	0.84%	-13.24%	0.87%	-4.40%

注：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交易的各项费用(例如：申购费、赎回费等)，计入认购或交易的各项费用后，实际收益水平要低于所列数字。

自基金合同成立以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的对比

日期	净值增长率①	业绩比较基准②	净值增长率-业绩比较基准差③	①-③	②-④
2017年3月10日(基金合同生效日)至2017年12月31日	-61.9%	0.63%	-1.67%	0.72%	-4.32%
2018年1月1日至2018年6月30日	-12.5%	1.12%	-11.59%	1.06%	-1.00%
2017年3月10日至2018年6月30日	-18.0%	0.84%	-13.24%	0.87%	-4.40%

注：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交易的各项费用(例如：申购费、赎回费等)，计入认购或交易的各项费用后，实际收益水平要低于所列数字。

自基金合同成立以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的对比

日期	净值增长率①	业绩比较基准②	净值增长率-业绩比较基准差③	①-③	②-④
2017年3月10日(基金合同生效日)至2017年12月31日	-61.9%	0.63%	-1.67%	0.72%	-4.32%
2018年1月1日至2018年6月30日	-12.5%	1.12%	-11.59%	1.06%	-1.00%
2017年3月10日至2018年6月30日	-18.0%	0.84%	-13.24%	0.87%	-4.40%

注：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交易的各项费用(例如：申购费、赎回费等)，计入认购或交易的各项费用后，实际收益水平要低于所列数字。

自基金合同成立以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的对比

日期	净值增长率①	业绩比较基准②	净值增长率-业绩比较基准差③	①-③	②-④
2017年3月10日(基金合同生效日)至2017年12月31日	-61.9%	0.63%	-1.67%	0.72%	-4.32%
2018年1月1日至2018年6月30日	-12.5%	1.12%	-11.59%	1.06%	-1.00%
2017年3月10日至2018年6月30日	-18.0%	0.84%	-13.24%	0.87%	-4.40%

注：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交易的各项费用(例如：申购费、赎回费等)，计入认购或交易的各项费用后，实际收益水平要低于所列数字。

自基金合同成立以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的对比

日期	净值增长率①	业绩比较基准②	净值增长率-业绩比较基准差③	①-③	②-④
2017年3月10日(基金合同生效日)至2017年12月31日	-61.9%	0.63%	-1.67%	0.72%	-4.32%
2018年1月1日至2018年6月30日	-12.5%	1.12%	-11.59%	1.06%	-1.00%
2017年3月10日至2018年6月30日	-18.0%	0.84%	-13.24%	0.87%	-4.40%

注：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交易的各项费用(例如：申购费、赎回费等)，计入认购或交易的各项费用后，实际收益水平要低于所列数字。

自基金合同成立以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的对比

日期	净值增长率①	业绩比较基准②	净值增长率-业绩比较基准差③	①-③	②-④
2017年3月10日(基金合同生效日)至2017年12月31日	-61.9%	0.63%	-1.67%	0.72%	-4.32%
2018年1月1日至2018年6月30日	-12.5%	1.12%	-11.59%		