

信息披露 disclosure

申万菱信价值优先混合型证券投资基金 2018年年度报告摘要

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
报告截止日期：二〇一九年三月三十一日

重要提示
基金管理人承诺，本报告不存在虚假记载、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法律责任。本报告已经三分之二以上独立董事审核同意，并由董事长签发。
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本报告复核了2018年3月31日报告了本报告的财务数据、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
本报告所载信息均取自公开披露的信息，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及更新。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及更新。
本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。
本年度报告自2019年1月1日起生效，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

2.1 基金基本情况

名称	申万菱信价值优先混合
基金代码	004709
交易代码	004709
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年12月14日
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
报告期末基金份额总额	191,417,610.07份
基金合同存续期限	不定期
2.2 基金产品说明	
投资目标	本基金采用量化技术对股票资产进行筛选，将符合投资策略的股票纳入投资组合，通过量化模型对股票资产进行动态调整，追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用量化技术对股票资产进行筛选，将符合投资策略的股票纳入投资组合，通过量化模型对股票资产进行动态调整，追求基金资产的长期增值。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为：中证500指数收益率×60%+沪深300指数收益率×40%。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金及货币市场基金，低于股票型基金。
2.3 基金管理人及基金托管人	
名称	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
法定代表人	陈强
信息披露负责人	陈强
客服电话	4008858888 95599
传真	021-22031199 010-68121816
2.4 基金联系方式	
基金年度报告正文的上网及查阅网站	http://www.swhx.com.cn
基金管理人及基金托管人	申万菱信基金管理有限公司 中国工商银行股份有限公司

基金年度报告摘要 3.1 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要财务指标和基金份额净值

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标 2018年 2017年12月14日至2018年12月31日

本期已实现收益 -36,759,002.84 1,003,627.24

本期利润 -62,992,276.26 1,003,627.24

加权平均基金份额本期利润 -0.2201 0.0059

本期基金份额净值增长率 -22.76% 0.31%

3.1.2 期间数据和指标 2018年度 2017年度

期末基金份额净值 148.316,040.01 313.485,147.29

期末基金份额净值增长率 0.74% 1.00%

注：1. 本基金2018年度收益基金基金本期损益及投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）和期间费用扣除后余额，本期期间费用扣除后余额，本期期间费用扣除后余额，本期期间费用扣除后余额。

2. 上述基金业绩指标已经扣除了基金管理费、托管费和其他各项费用，但不包括由于认购或赎回基金份额的各项费用（例如：申购费、赎回费）等。1. 认购或赎回基金份额时，3.5%的认购或赎回费。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.1 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.2 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.3 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.4 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.5 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.6 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.7 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.8 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.9 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.10 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.11 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.12 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.13 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.14 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.15 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.16 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.17 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.18 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.19 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.20 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.21 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.22 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.23 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.24 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.25 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.26 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.27 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.28 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.29 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.30 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.31 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.32 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.33 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.34 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.35 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.36 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.37 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.38 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.39 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.40 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.41 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.42 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.43 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.44 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.45 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.46 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.47 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

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

报告截止日期：二〇一九年三月三十一日

重要提示
基金管理人承诺，本报告不存在虚假记载、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法律责任。本报告已经三分之二以上独立董事审核同意，并由董事长签发。
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本报告复核了2018年3月31日报告了本报告的财务数据、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
本报告所载信息均取自公开披露的信息，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及更新。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及更新。
本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。
本年度报告自2019年1月1日起生效，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

2.1 基金基本情况

名称	申万菱信价值优先混合
基金代码	004709
交易代码	004709
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年12月14日
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
报告期末基金份额总额	191,417,610.07份
基金合同存续期限	不定期
2.2 基金产品说明	
投资目标	本基金采用量化技术对股票资产进行筛选，将符合投资策略的股票纳入投资组合，通过量化模型对股票资产进行动态调整，追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用量化技术对股票资产进行筛选，将符合投资策略的股票纳入投资组合，通过量化模型对股票资产进行动态调整，追求基金资产的长期增值。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为：中证500指数收益率×60%+沪深300指数收益率×40%。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金及货币市场基金，低于股票型基金。
2.3 基金管理人及基金托管人	
名称	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
法定代表人	陈强
信息披露负责人	陈强
客服电话	4008858888 95599
传真	021-22031199 010-68121816
2.4 基金联系方式	
基金年度报告正文的上网及查阅网站	http://www.swhx.com.cn
基金管理人及基金托管人	申万菱信基金管理有限公司 中国工商银行股份有限公司

基金年度报告摘要 3.1 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要财务指标和基金份额净值

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标 2018年 2017年12月14日至2018年12月31日

本期已实现收益 -36,759,002.84 1,003,627.24

本期利润 -62,992,276.26 1,003,627.24

加权平均基金份额本期利润 -0.2201 0.0059

本期基金份额净值增长率 -22.76% 0.31%

3.1.2 期间数据和指标 2018年度 2017年度

期末基金份额净值 148.316,040.01 313.485,147.29

期末基金份额净值增长率 0.74% 1.00%

注：1. 本基金2018年度收益基金基金本期损益及投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）和期间费用扣除后余额，本期期间费用扣除后余额，本期期间费用扣除后余额，本期期间费用扣除后余额。

2. 上述基金业绩指标已经扣除了基金管理费、托管费和其他各项费用，但不包括由于认购或赎回基金份额的各项费用（例如：申购费、赎回费）等。1. 认购或赎回基金份额时，3.5%的认购或赎回费。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.1 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.2 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.3 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.4 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.5 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.6 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.7 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.8 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.9 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.10 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.11 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.12 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.13 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.14 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.15 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.16 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.17 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.18 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.19 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.20 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.21 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.22 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.23 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.24 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.25 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.26 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.27 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.28 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.29 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.30 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.31 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额单位：人民币元

3.2.1.32 基金净值表现与业绩比较基准及同期业绩比较基准收益率的对比

份额