

## 申万菱信价值优先混合型证券投资基金

## 2019年第二季度报告

4.2.2 异常交易行为的专项说明  
 本报告期,未发生我司旗下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金额超过该证券当日成交量5%的情况以及其他可能導致不公平交易和利益输送的异常交易。

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  
 2019年二季度,沪深300指数下跌12.1%,基金业绩表现表现为-0.61%,申万菱信价值优先基金净值增长率为0.36%,领先业绩基准0.97%。  
 4.4.2 报告期内基金业绩表现说明  
 2019年二季度,沪深300指数下跌12.1%,基金业绩表现表现为-0.61%,申万菱信价值优先基金净值增长率为0.36%,领先业绩基准0.97%。  
 4.4.3 报告期内基金投资组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	189,464,467.92	86.26
2	其中:股票	189,464,467.92	86.26
3	债券投资	-	-
4	其中:国债	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	其他金融资产	-	-
8	银行存款和结算备付金合计	32,644,634.41	14.74
9	其他各项资产	27,761.66	0.01
10	合计	221,577,263.13	100.00

注:本基金未开通港股通交易机制投资于港股。  
 注:本基金未开通深港通交易机制投资于港股。

5.2 投资组合报告  
 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
A	医药、生物	9,476,227.76	4.67
B	制造业	52,433,314.88	26.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,507,000.00	3.72
E	建筑业	6,736,390.00	3.33
F	采矿业	8,889,311.00	4.45
G	交通运输、仓储和邮政业	4,321,500.00	2.33
H	信息技术业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,811,464.08	4.53
J	金融业	66,946,949.27	33.11
K	房地产业	8,452,730.00	4.17
L	批发和零售业	1,577,970.00	0.79
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	教育	-	-
P	农林牧渔业	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,511,190.00	0.74
S	综合	-	-
合计		189,464,467.92	86.26

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
A	医药、生物	-	-
B	制造业	-	-
C	采矿业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	采矿业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	信息技术业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	批发和零售业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	教育	-	-
P	农林牧渔业	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		-	-

5.2.3 报告期末按行业分类的内地股指期货投资投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
A	医药、生物	-	-
B	制造业	-	-
C	采矿业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	采矿业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	信息技术业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	批发和零售业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	教育	-	-
P	农林牧渔业	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		-	-

5.2.4 报告期末按行业分类的国债期货投资投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
A	医药、生物	-	-
B	制造业	-	-
C	采矿业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	采矿业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	信息技术业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	批发和零售业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	教育	-	-
P	农林牧渔业	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		-	-

5.2.5 报告期末按品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	国家债券	-	-	-
2	央行票据	-	-	-
3	金融债券	29,629,701.50	31.63	
4	企业债券	29,629,701.50	31.63	
5	地方政府债	98,076,778.00	61.79	
6	中期票据	-	-	
7	可转换债券(可转换)	-	-	
8	资产支持证券	-	-	
9	债券回购	-	-	
10	其他	87,706,480.16	88.22	
合计			122,091,798.26	92.86

5.2.6 报告期末按品种分类的资产支持证券投资组合

序号	债券品种	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	国家债券	-	-	-
2	央行票据	-	-	-
3	金融债券	29,629,701.50	31.63	
4	企业债券	29,629,701.50	31.63	
5	地方政府债	98,076,778.00	61.79	
6	中期票据	-	-	
7	可转换债券(可转换)	-	-	
8	资产支持证券	-	-	
9	债券回购	-	-	
10	其他	87,706,480.16	88.22	
合计			122,091,798.26	92.86

5.2.7 报告期末按品种分类的国债期货投资投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
A	医药、生物	-	-
B	制造业	-	-
C	采矿业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	采矿业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	信息技术业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	批发和零售业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	教育	-	-
P	农林牧渔业	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		-	-

5.2.8 报告期末按品种分类的股指期货投资投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
A	医药、生物	-	-
B	制造业	-	-
C	采矿业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	采矿业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	信息技术业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	批发和零售业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	教育	-	-
P	农林牧渔业	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		-	-

5.2.9 报告期末按品种分类的国债期货投资投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
A	医药、生物	-	-
B	制造业	-	-
C	采矿业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	采矿业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	信息技术业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	批发和零售业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	教育	-	-
P	农林牧渔业	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		-	-

5.2.10 报告期末按品种分类的股指期货投资投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
A	医药、生物	-	-
B	制造业	-	-
C	采矿业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	采矿业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	信息技术业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	批发和零售业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	教育	-	-
P	农林牧渔业	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		-	-

5.2.11 报告期末按品种分类的国债期货投资投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
A	医药、生物	-	-
B	制造业	-	-
C	采矿业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	采矿业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	信息技术业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	批发和零售业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	教育	-	-
P	农林牧渔业	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		-	-

5.2.12 报告期末按品种分类的股指期货投资投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
A	医药、生物	-	-
B	制造业	-	-
C	采矿业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	采矿业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	信息技术业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	批发和零售业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	教育	-	-
P	农林牧渔业	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		-	-

5.2.13 报告期末按品种分类的国债期货投资投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
A	医药、生物	-	-
B	制造业	-	-
C	采矿业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	采矿业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	信息技术业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	批发和零售业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	教育	-	-
P	农林牧渔业	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		-	-

5.2.14 报告期末按品种分类的股指期货投资投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
A	医药、生物	-	-
B	制造业	-	-
C	采矿业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	采矿业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	信息技术业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	批发和零售业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	教育		