

## 申万菱信价值优先混合型证券投资基金

2019年半年度报告摘要

基金管理人:申万菱信基金管理有限公司  
基金托管人:中国农业银行股份有限公司  
报告送出日期:二〇一九年八月二十四日

1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告经三分之二以上独立董事签字同意,并经董事签发。

基金管理人:申万菱信基金管理有限公司根据基金合同约定,于2019年8月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内页,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及其更新。

本年度报告摘要摘录于年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告的财务资料未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至6月30日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称 申万菱信价值优先混合型证券投资基金

基金简称 申万菱信价值优先混合型证券投资基金

基金代码 004769

基金运作方式 约定开放型

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 中国农业银行股份有限公司

报告期末基金总资产 206,447,376,189.00

报告期末基金份额总额 206,447,376,189.00

基金份额净值 1.0000

基金合同的延续期 不定期

2.2 基金产品说明

投资目标 本基金采用量化投资的方法精选个股,严格按照纪律执行,力争获取长期稳定的超额收益。

基金的业绩比较基准 上证综指×60%+中证银行指数×40%

投资策略 本基金采用量化投资方法投资策略进行优化,将特定的投资思想和理念通过具体的参数的设定体现在数量模型中,坚持以数据化的方式进行投资,充分发掘数据化的优势,保持投资策略的一致性和有效性。

业绩比较基准 上证综指×60%+中证银行指数×40%

风险收益特征 本基金属于股票型基金,其风险收益特征与股票型基金相似,风险收益特征与货币型基金、债券型基金、混合型基金等有显著差异。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目 基金管理人 基金托管人

名称 申万菱信基金管理有限公司 中国农业银行股份有限公司

信息披露义务人 姚伟

联系人 联系电话 021-23611988

电子邮箱 service@sunwin.com

客户服务电话 4008898888

传真 95599

客户服务电话 021-23611999

010-68121816

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告的管理人的互联网址 http://www.sunwin.com

基金半年度报告备置地点 申万菱信基金管理有限公司

中国农业银行股份有限公司

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标 报告期(2019年1月1日至2019年6月30日)

本期末余额 12,396,217.70

本期利润 388,333.04

加权平均基金份额本期利润 0.02401

本期利润总额 26.10%

3.1.2 期末数据和指标 报告期(2019年6月30日)

本期末余额 -0.0746

期末基金份额总额 202,073,394.02

期末基金份额净值 0.00707

注:1.本期已实现收益指基金本期利润收入、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,本期利润率为本期已实现收益除以本期公允价值变动收益;2.期末,本期利润率为本期已实现收益除以本期公允价值变动收益。

3.2.1 基金份额变动率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 份额增长(%) 份额增长(%) 基金份额净值增长(%) (1) (2) (3) (4)

过去一个月 4.77% 0.94% 4.18% 0.07% 0.00% 0.07%

过去二个月 0.36% 1.36% -0.01% 1.14% 0.07% 0.22%

过去三个月 27.39% 1.37% 26.61% 1.16% 6.76% 0.21%

过去一年 6.17% 1.42% 8.81% 1.14% -2 0.28%

自基金合同生效之日起至今 -130% 1.20% -10% 1.06% -0 0.26%

注:1.本基金的业绩基准指按公式每交易日进行计算,计算方式如下:

benchmark0=1000;

%benchmarkt=(1-75%\*申万300指数)t/(1-75%\*申万300指数)(t-1)+25%\*(中证综合债指数)t/(1-中证综合债指数)(t-1);

benchmarkt=(1+4%\*benchmark0)t=benchmark0\*t;

其中t=1,2,3,...

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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较

申万菱信价值优先混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图(2017年12月14日至2019年6月30日)

注:本基金管理人对基金的业绩基准指按公式每交易日进行计算,计算方式如下:

benchmark0=1000;

%benchmarkt=(1-75%\*申万300指数)t/(1-75%\*申万300指数)(t-1)+25%\*(中证综合债指数)t/(1-中证综合债指数)(t-1);

benchmarkt=(1+4%\*benchmark0)t=benchmark0\*t;

其中t=1,2,3,...

3.2.3 自基金合同生效以来基金份额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较

注:本基金管理人对基金的业绩基准指按公式每交易日进行计算,计算方式如下:

benchmark0=1000;

%benchmarkt=(1-75%\*申万300指数)t/(1-75%\*申万300指数)(t-1)+25%\*(中证综合债指数)t/(1-中证综合债指数)(t-1);

benchmarkt=(1+4%\*benchmark0)t=benchmark0\*t;

其中t=1,2,3,...

3.2.4 与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金管理人对基金的业绩基准指按公式每交易日进行计算,计算方式如下:

benchmark0=1000;

%benchmarkt=(1-75%\*申万300指数)t/(1-75%\*申万300指数)(t-1)+25%\*(中证综合债指数)t/(1-中证综合债指数)(t-1);

benchmarkt=(1+4%\*benchmark0)t=benchmark0\*t;

其中t=1,2,3,...

3.2.5 与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金管理人对基金的业绩基准指按公式每交易日进行计算,计算方式如下:

benchmark0=1000;

%benchmarkt=(1-75%\*申万300指数)t/(1-75%\*申万300指数)(t-1)+25%\*(中证综合债指数)t/(1-中证综合债指数)(t-1);

benchmarkt=(1+4%\*benchmark0)t=benchmark0\*t;

其中t=1,2,3,...

3.2.6 与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金管理人对基金的业绩基准指按公式每交易日进行计算,计算方式如下:

benchmark0=1000;

%benchmarkt=(1-75%\*申万300指数)t/(1-75%\*申万300指数)(t-1)+25%\*(中证综合债指数)t/(1-中证综合债指数)(t-1);

benchmarkt=(1+4%\*benchmark0)t=benchmark0\*t;

其中t=1,2,3,...

3.2.7 与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金管理人对基金的业绩基准指按公式每交易日进行计算,计算方式如下:

benchmark0=1000;

%benchmarkt=(1-75%\*申万300指数)t/(1-75%\*申万300指数)(t-1)+25%\*(中证综合债指数)t/(1-中证综合债指数)(t-1);

benchmarkt=(1+4%\*benchmark0)t=benchmark0\*t;

其中t=1,2,3,...

3.2.8 与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金管理人对基金的业绩基准指按公式每交易日进行计算,计算方式如下:

benchmark0=1000;

%benchmarkt=(1-75%\*申万300指数)t/(1-75%\*申万300指数)(t-1)+25%\*(中证综合债指数)t/(1-中证综合债指数)(t-1);

benchmarkt=(1+4%\*benchmark0)t=benchmark0\*t;

其中t=1,2,3,...

3.2.9 与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金管理人对基金的业绩基准指按公式每交易日进行计算,计算方式如下:

benchmark0=1000;

%benchmarkt=(1-75%\*申万300指数)t/(1-75%\*申万300指数)(t-1)+25%\*(中证综合债指数)t/(1-中证综合债指数)(t-1);

benchmarkt=(1+4%\*benchmark0)t=benchmark0\*t;

其中t=1,2,3,...

3.2.10 与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金管理人对基金的业绩基准指按公式每交易日进行计算,计算方式如下:

benchmark0=1000;

%benchmarkt=(1-75%\*申万300指数)t/(1-75%\*申万300指数)(t-1)+25%\*(中证综合债指数)t/(1-中证综合债指数)(t-1);

benchmarkt=(1+4%\*benchmark0)t=benchmark0\*t;

其中t=1,2,3,...

3.2.11 与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金管理人对基金的业绩基准指按公式每交易日进行计算,计算方式如下:

benchmark0=1000;

%benchmarkt=(1-75%\*申万300指数)t/(1-75%\*申万300指数)(t-1)+25%\*(中证综合债指数)t/(1-中证综合债指数)(t-1);

benchmarkt=(1+4%\*benchmark0)t=benchmark0\*t;

其中t=1,2,3,...

3.2.12 与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金管理人对基金的业绩基准指按公式每交易日进行计算,计算方式如下:

benchmark0=1000;

%benchmarkt=(1-75%\*申万300指数)t/(1-75%\*申万300指数)(t-1)+25%\*(中证综合债指数)t/(1-中证综合债指数)(t-1);

benchmarkt=(1+4%\*benchmark0)t=benchmark0\*t;

其中t=1,2,3,...

3.2.13 与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金管理人对基金的业绩基准指按公式每交易日进行计算,计算方式如下:

benchmark0=1000;

%benchmarkt=(1-75%\*申万300指数)t/(1-75%\*申万300指数)(t-1)+25%\*(中证综合债指数)t/(1-中证综合债指数)(t-1);

benchmarkt=(1+4%\*benchmark0)t=benchmark0\*t;

其中t=1,2,3,...

3.2.14 与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金管理人对基金的业绩基准指按公式每交易日进行计算,计算方式如下:

benchmark0=1000;

%benchmarkt=(1-75%\*申万300指数)t/(1-75%\*申万300指数)(t-1)+25%\*(中证综合债指数)t/(1-中证综合债指数)(t-1);

benchmarkt=(1+4%\*benchmark0)t=benchmark0\*t;

其中t=1,2,3,...

3.2.15 与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金管理人对基金的业绩基准指按公式每交易日进行计算,计算方式如下:

benchmark0=1000;

%benchmarkt=(1-75%\*申万300指数)t/(1-75%\*申万300指数)(t-1)+25%\*(中证综合债指数)t/(1-中证综合债指数)(t-1);

benchmarkt=(1+4%\*benchmark0)t=benchmark0\*t;

其中t=1,2,3,...

3.2.16 与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金管理人对基金的业绩基准指按公式每交易日进行计算