

申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)

2016年半年度报告

2016年6月30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

报告送出日期：二〇一六年八月二十九日

1 重要提示及目录

1.1 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，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基金合同规定，于2016年8月17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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年1月1日起至6月30日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	6
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	11
5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	12
6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
7 投资组合报告	30
7.1 期末基金资产组合情况.....	30
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	30
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	31
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	34
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	36
7.6 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明细.....	36
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	37
7.8 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贵金属投资明细.....	37
7.9 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明细.....	37
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	37
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	37
7.12 投资组合报告附注.....	37
8 基金份额持有人信息	38
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	38

8.2	期末上市基金前十名持有人	38
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	39
8.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	39
9	开放式基金份额变动	39
10	重大事件揭示	39
10.1	基金份额持有人大会决议	39
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	39
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	39
10.4	基金投资策略的改变	40
10.5	报告期内改聘会计师事务所情况	40
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	40
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	40
10.8	其他重大事件	41
11	备查文件目录	42
11.1	备查文件目录	42
11.2	存放地点	43
11.3	查阅方式	43

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)
基金简称	申万菱信量化小盘股票(LOF)
场内简称	申万量化
基金主代码	163110
交易代码	163110
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年6月16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	515,854,229.62 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011年8月1日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用数量化的投资方法精选个股，严格按照纪律执行，力争获取长期稳定的超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金坚持数量化的投资策略，专注于小盘股的投资。基金管理人基于对国内股票市场的大量实证研究，专门开发了适合小盘股投资的数量化投资模型（简称“量化小盘投资模型”），作为本基金投资的核心。本基金的股票选择行为，都是基于该投资模型而定。这种完全基于模型的数量化投资方法能够更加客观、公正而理性的去分析和筛选股票，并且不受外部分析师的影响，极大的减少了投资者情绪的影响，从而能够保持投资策略的一致性与有效性。
业绩比较基准	90%×中证 500 指数收益率+10%×银行同业存款收益率（税后）
风险收益特征	本基金是一只量化股票型基金，属于较高预期风险和较高预期收益的证券投资基金品种，其风险收益特征从长期平均来看高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王菲萍
	联系电话	021-23261188
	电子邮箱	service@swsmu.com
客户服务电话	4008808588	95588
传真	021-23261199	010-66105798
注册地址	上海市中山南路 100 号 11 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	上海市中山南路 100 号 11 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	200010	100140

法定代表人	姜国芳	易会满
-------	-----	-----

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.swsmu.com
基金半年度报告备置地点	申万菱信基金管理有限公司 中国工商银行股份有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

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（2016年1月1日至2016年6月30日）
本期已实现收益	-3,041,633.25
本期利润	-10,717,308.06
加权平均基金份额本期利润	-0.0256
本期加权平均净值利润率	-1.14%
本期基金份额净值增长率	-6.83%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)
期末可供分配利润	633,050,370.27
期末可供分配基金份额利润	1.2272
期末基金资产净值	1,223,650,768.21
期末基金份额净值	2.372
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)
基金份额累计净值增长率	137.19%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、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，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	3.45%	1.11%	2.69%	1.39%	0.76%	-0.28%
过去三个月	2.73%	1.24%	-0.38%	1.49%	3.11%	-0.25%
过去六个月	-6.83%	2.14%	-17.51%	2.30%	10.68%	-0.16%
过去一年	-2.47%	2.69%	-27.87%	2.62%	25.40%	0.07%
过去三年	177.42%	1.95%	80.70%	1.92%	96.72%	0.03%
自基金合同生效起至今	137.19%	1.73%	35.21%	1.73%	101.98%	0.00%

注：本基金的业绩基准指数=90%×中证 500 指数收益率+10%×银行同业存款收益率（税后）。

其中：中证 500 指数作为衡量股票投资部分的业绩基准，银行同业存款收益率作为衡量非股票投资部分的业绩基准。本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，计算方式如下：

$$\text{benchmark}(0) = 1000;$$

$\% \text{benchmark}(t) = 90\% * (\text{中证 500 指数}(t) / \text{中证 500 成分指数}(t-1) - 1) + 10\% * \text{银行同业存款利率（税后）} / 365;$

$$\text{benchmark}(t) = (1 + \% \text{benchmark}(t)) * \text{benchmark}(t-1);$$

其中 $t=1,2,3,\dots$ 。

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

申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2011年6月16日至2016年6月30日)



4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

申万菱信基金管理有限公司原名申万巴黎基金管理有限公司，是由国内大型综合类券商申万宏源证券有限公司和三菱 UFJ 信托银行株式会社共同设立的一家中外合资基金管理公司。公司成立于 2004 年 1 月 15 日，注册地在中国上海，注册资本为 1.5 亿元人民币。其中，申万宏源证券有限公司持有 67% 的股份，三菱 UFJ 信托银行株式会社持有 33% 的股份。

公司成立以来业务增长迅速，在北京、广州先后建立了分公司。截至 2016 年 6 月 30 日，公司旗下管理了包括股票型、混合型、债券型和货币型在内的 24 只开放式基金，形成了完整而丰富的产品线。公司旗下基金管理资产规模超过 379 亿元，客户数超过 571 万户。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
金昉毅	本基金基金经理	2015-05-21	-	5 年	金昉毅先生，博士研究生。2008 年起开始工作，曾任职于中央财经大学中国金融发展研究院，2011 年 1 月加入申万菱信基金管理有限公司，历任高级研究员、基金经理助理，

					申万菱信沪深 300 价值指数证券投资基金基金经理，现任申万菱信沪深 300 指数增强型证券投资基金、申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1.任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日；若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》及其配套法规的规定，严格遵守基金合同约定，本着诚实信用、勤勉尽责等原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。

本基金投资运作符合法律法规和基金合同的规定，信息披露及时、准确、完整；本基金资产与本基金管理人与公司资产之间严格分开；没有发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为。在基金资产的管理运作中，无任何损害基金持有人利益的行为，并通过稳健经营、规范运作、规避风险，保护了基金持有人的合法权益。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司制定了《公平交易制度》，通过组织结构的设置、工作制度、流程和技术手段全面落实公平交易原则在具体业务（包括研究分析、投资决策、交易执行等）环节中的实现，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；同时，通过对投资交易行为的日常监控和事后分析评估来加强对公平交易过程和结果的监督。

在投资和研究方面，本公司投资和研究部门不断完善研究方法和投资决策流程，提高投资决策的科学性和客观性，确保各投资组合享有公平的投资决策机会，建立公平交易的制度环境。

在交易执行方面，本公司的投资管理职能和交易执行职能相隔离，通过实行集中交易制度和公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。

在日常监控和事后分析评估方面，本公司风险管理总部开展日内和定期的工作对公平交易执行情况作整体监控和效果评估。风险管理总部通过对不同组合之间同向交易的价差率的假设检验、价格占优的次数百分比统计、价差交易模拟贡献与组合收益率差异的比较等方法对本报告期以及连续四个季度期间内、不同时间窗口下公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行了分析；对于

场外交易，还特别对比了组合之间发生的同向交易的市场公允价格和交易对手，判断交易是否公平且是否涉及利益输送。

本公司通过事前的制度规范、事中的监控和事后的分析评估，严格执行了公平交易制度，公平对待了旗下各投资组合。本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司制定了《异常交易监控报告制度》，明确定义了投资交易过程中出现的各种可能导致不公平交易和利益输送的异常交易类型，并规定且落实了异常交易的日常监控、识别以及事后的分析流程。

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%的情况有四次。其中，本基金与本公司其他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%的情况有一次。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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016年上半年，市场没有延续2015年四季度的反弹而选择向下探底，然后上证指数在2900点附近震荡，最终沪深300指数在2016年上半年下跌达15.47%。从市场结构来看，2016年上半年中证500指数下跌达19.61%，跌幅超过沪深300指数，中小市值的股票总体表现弱于大盘蓝筹股。

本基金采用的量化模型仍然秉持小盘价值的主要选股逻辑，除此以外在模型中更加兼顾了行业的分散配置，从结果来看比较符合2016年上半年的行情特征。本基金以半年-6.83%的收益率取得了超越基准指数的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2016年上半年中证500指数期间表现为-19.61%，基金业绩基准表现为-17.51%，申万菱信量化小盘基金净值期间表现为-6.83%，领先业绩基准10.68%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2016年下半年，我国经济运行在2016年一季度地产销售良好的带动下将继续企稳，但向上动能受制于经济转型与改革落地的进度，总体仍将是缓慢而有序的探底过程。货币政策尽管有放松空间，但由于向实体经济传导的过程仍不畅通，因此效果并不一定好；财政政策仍将是主要的政

策工具。总体而言，蓝筹股相对于新兴成长股更具备估值的吸引力，但是在市场整体增长乏力的情况下能够带来成长的行业与公司又将是资本市场不得不追逐的热点。本基金将继续保持小盘价值的风格，致力投资于估值有吸引力并且市值空间发展大的股票。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人、本基金托管人和本基金聘请的会计师事务所参与本基金的估值流程，上述各方不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人按照有关法规确定的原则进行估值，将导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上的，即就拟采用的相关估值模型、假设及参数的适当性征求本基金托管人和本基金聘请的会计师事务所的意见。本基金聘请的会计师事务所对相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。

本基金管理人设立资产估值委员会，负责根据法规要求，尽可能科学、合理地制定估值政策，审议批准估值程序，并在特定状态下就拟采用的相关估值模型、假设及参数的适当性进行确认，以保护基金份额持有人的利益。

资产估值委员会由本基金管理人的总经理，分管基金投资的副总经理，分管基金运营的副总经理，投资总监，基金运营总部、监察稽核总部、风险管理总部等各总部负责人组成。其中，副总经理（代总经理）来肖贤先生，直接分管基金运营（代为履职）、基金投资，拥有 11 年基金行业高级管理人员经验；基金运营总部总监李濮君女士，拥有 15 年的基金会计经验；监察稽核总部总监牛锐女士，拥有近 12 年的证券基金行业合规管理经验；投资总监（代）、投资管理总部总监张少华先生，拥有 13 年的基金行业研究、投资和风险管理相关经验；固定收益总部总监陈国辉先生，拥有 9 年固定收益研究、投资和风险管理相关经验；风险管理总部总监王瑾怡女士，拥有近 11 年的基金行业风险管理经验。

基金经理不参与决定本基金估值的程序。本公司已与中央国债登记结算有限责任公司签订协议，采用其提供的估值数据对银行间债券进行估值；采用中证指数有限公司提供的估值数据对交易所债券进行估值。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,本基金托管人在对申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)的管理人——申万菱信基金管理有限公司在申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对申万菱信基金管理有限公司编制和披露的申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)2016年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)

报告截止日:2016年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
资产:		-	-
银行存款	6.4.7.1	177,437,165.85	58,206,992.53
结算备付金		4,972,616.87	782,915.83
存出保证金		510,214.37	165,338.30
交易性金融资产	6.4.7.2	1,059,582,943.13	506,016,363.77
其中:股票投资		1,059,582,943.13	506,016,363.77
基金投资		-	-
债券投资		-	-

资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	36,198.25	13,127.12
应收股利		-	-
应收申购款		1,288,147.39	130,816,445.62
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,243,827,285.86	696,001,183.17
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
负 债:		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	64,126,974.28
应付赎回款		16,077,552.91	1,878,141.42
应付管理人报酬		1,518,746.28	457,347.66
应付托管费		253,124.38	76,224.61
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	2,094,730.59	711,541.43
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	232,363.49	279,736.73
负债合计		20,176,517.65	67,529,966.13
所有者权益:		-	-
实收基金	6.4.7.9	515,854,229.62	246,864,331.77
未分配利润	6.4.7.10	707,796,538.59	381,606,885.27
所有者权益合计		1,223,650,768.21	628,471,217.04
负债和所有者权益总计		1,243,827,285.86	696,001,183.17

注:报告截止日2016年06月30日,申万菱信量化小盘股票型证券投资基金份额净值2.372元,基金份额总额515,854,229.62份。

6.2 利润表

会计主体:申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)

本报告期:2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2016年1月1日至 2016年6月30日	2015年1月1日至 2015年6月30日
一、收入		3,168,680.79	68,646,988.89
1.利息收入		551,959.24	66,757.95
其中：存款利息收入	6.4.7.11	551,840.96	66,757.95
债券利息收入		118.28	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		9,705,045.32	73,708,889.09
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-2,127,025.55	72,506,980.02
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	285,846.22	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	11,546,224.65	1,201,909.07
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-7,675,674.81	-5,402,920.13
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	587,351.04	274,261.98
减：二、费用		13,885,988.85	2,508,664.68
1. 管理人报酬		6,958,571.13	1,063,109.86
2. 托管费		1,159,761.89	177,185.02
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	5,603,691.41	1,109,428.29
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	163,964.42	158,941.51
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-10,717,308.06	66,138,324.21
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-10,717,308.06	66,138,324.21

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项目	本期		
	2016年1月1日至2016年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	246,864,331.77	381,606,885.27	628,471,217.04

二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	-10,717,308.06	-10,717,308.06
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	268,989,897.85	336,906,961.38	605,896,859.23
其中：1.基金申购款	478,969,038.79	598,969,563.46	1,077,938,602.25
2.基金赎回款	-209,979,140.94	-262,062,602.08	-472,041,743.02
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的 基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	515,854,229.62	707,796,538.59	1,223,650,768.21
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	120,209,384.74	42,987,282.58	163,196,667.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	66,138,324.21	66,138,324.21
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-36,369,807.00	10,904,683.35	-25,465,123.65
其中：1.基金申购款	108,244,574.24	133,280,854.56	241,525,428.80
2.基金赎回款	-144,614,381.24	-122,376,171.21	-266,990,552.45
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的 基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	83,839,577.74	120,030,290.14	203,869,867.88

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：来肖贤，主管会计工作负责人：来肖贤，会计机构负责人：李濮君

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2011]525号文件核准，由申万菱信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和本基金基金合同负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 512,877,725.48 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 247 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，本基金基金合同于 2011 年 6 月 16 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 512,987,683.05 份基金份额，其中认购资金利息折合 109,957.57 份基金份额。本基金的基金管理人为申万菱信基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

经深交所深证上[2011]225 号文审核同意，本基金 63,363,855 份基金份额于 2011 年 8 月 1 日在

深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和本基金基金合同的有关规定，本基金投资于流动性良好的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、权证、资产支持证券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。本基金各类资产投资比例为：股票资产占基金资产的比例 85%-95%，其中，投资于本基金界定的小盘股占股票资产的比例不低于 90%，权证市值占基金资产净值的比例不超过 3%；债券、现金以及其他中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5%-15%，其中，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×90%+银行同业存款收益率(税后)×10%。

本财务报表由本基金的基金管理人申万菱信基金管理有限公司于 2016 年 8 月 29 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金基金合同和中国证监会允许的如财务报表附注 6.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年 01 月 01 日至 2016 年 06 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2016 年 06 月 30 日的财务状况以及 2016 年 01 月 01 日至 2016 年 06 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本报告期，本基金未发生会计差错更正事项。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2)基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3)对基金取得的股票股息红利收入、企业债券利息收入，由上市公司、债券发行企业在向基金派发股息红利、债券利息时代扣代缴个人所得税。自2013年1月1日起，对基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税，暂不征收企业所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
活期存款	177,437,165.85
定期存款	-
其他存款	-
合计	177,437,165.85

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,053,833,538.59	1,059,582,943.13	5,749,404.54
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-

其他	-	-	-
合计	1,053,833,538.59	1,059,582,943.13	5,749,404.54

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	33,730.95
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	2,237.70
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	229.60
合计	36,198.25

6.4.7.6 其他资产

无余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	2,094,730.59
银行间市场应付交易费用	-
合计	2,094,730.59

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	60,484.56
其他应付款	12,754.51
应付指数使用费	-
预提费用	159,124.42
合计	232,363.49

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	246,864,331.77	246,864,331.77
本期申购	478,969,038.79	478,969,038.79
本期赎回(以“-”号填列)	-209,979,140.94	-209,979,140.94
本期末	515,854,229.62	515,854,229.62

注：本期申购含红利再投资和转换转入份额，本期赎回含转换转出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	315,162,819.70	66,444,065.57	381,606,885.27
本期利润	-3,041,633.25	-7,675,674.81	-10,717,308.06
本期基金份额交易产生的变动数	320,929,183.82	15,977,777.56	336,906,961.38
其中：基金申购款	570,014,910.28	28,954,653.18	598,969,563.46
基金赎回款	-249,085,726.46	-12,976,875.62	-262,062,602.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	633,050,370.27	74,746,168.32	707,796,538.59

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	496,982.06
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-

结算备付金利息收入	31,844.91
其他	23,013.99
合计	551,840.96

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	1,669,542,033.04
减：卖出股票成本总额	1,671,669,058.59
买卖股票差价收入	-2,127,025.55

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,784,964.50
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,499,000.00
减：应收利息总额	118.28
买卖债券差价收入	285,846.22

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	11,546,224.65
基金投资产生的股利收益	-
合计	11,546,224.65

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1.交易性金融资产	-7,675,674.81

——股票投资	-7,675,674.81
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	-7,675,674.81

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	580,046.89
转换费	7,304.15
合计	587,351.04

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2、本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分组成，其中赎回费总额的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	5,603,691.41
银行间市场交易费用	-
合计	5,603,691.41

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	29,835.26
信息披露费	99,453.90
银行汇划费	340.00
债券帐户维护费	4,500.00
上市年费	29,835.26
合计	163,964.42

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系**6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

无。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
申万菱信基金管理有限公司	基金管理人 基金销售机构
申万宏源证券有限公司（以下简称“申万宏源”）	基金管理人的股东 基金代销机构
三菱 UFJ 信托银行株式会社	基金管理人的股东
中国工商银行	基金托管人 基金代销机构
申万菱信（上海）资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
申万宏源	759,797,590.70	19.48%	179,494,330.31	24.75%

注：由于申银万国和宏源证券于2015年1月16日完成吸收合并。上表上年度可比区间中申万宏源的交易情况包含申银万国2015年1月1日至1月15日的交易量以及申万宏源2015年1月16日至2015年6月30日的交易量。

6.4.10.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期

	2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
申万宏源	703,279.63	19.60%	352,672.20	16.84%
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
申万宏源	159,078.11	24.47%	93,328.38	19.79%

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。权证交易不计佣金。2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。3、由于申银万国和宏源证券于2015年1月16日完成吸收合并。上表上年度可比区间中申万宏源的佣金包含申银万国2015年1月1日至1月15日的佣金以及申万宏源2015年1月16日至2015年6月30日的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	6,958,571.13	1,063,109.86
其中：支付销售机构的客户维护费	1,265,894.64	382,953.20

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值*1.5%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,159,761.89	177,185.02

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值*0.25%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期及上年度可比期间内，本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本报告期内和上年度可比期间内，本基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本期末和上年度末，除基金管理人之外的其他关联方未发生投资本基金的情况。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	177,437,165.85	496,982.06	35,527,847.76	60,784.84

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间内，本基金在承销期内无参与关联方承销证券的情况。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002805	丰元股份	2016-06-29	2016-07-07	新股	5.80	5.80	971.00	5,631.80	5,631.80	-
601966	玲珑轮胎	2016-06-24	2016-07-06	新股	12.98	12.98	9,423.00	122,310.54	122,310.54	-
603016	新宏泰	2016-06-23	2016-07-01	新股	8.49	8.49	1,602.00	13,600.98	13,600.98	-
300520	科大国创	2016-06-30	2016-07-08	新股	10.05	10.05	926.00	9,306.30	9,306.30	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股/新债申购。

其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股/新债，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股/新债上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股/新债，从新股/新债获配日至新股/新债上市日之间不能自由转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600139	西部资源	2016-04-11	重大事项	12.31	2016-08-15	12.99	704,146.00	6,620,350.29	8,668,037.26	-
000498	山东路桥	2016-06-20	重大事项	5.76	2016-07-04	6.11	878,501.00	5,142,159.81	5,060,165.76	-
000553	沙隆达 A	2015-08-05	重大事项	10.68	-	-	111,400.00	1,251,292.35	1,189,752.00	-
000936	华西股份	2016-05-24	重大事项	8.22	2016-07-13	9.04	1,448,318.00	12,007,012.60	11,905,173.96	-
002101	广东鸿图	2016-05-03	重大事项	21.62	-	-	455,753.00	8,416,728.70	9,853,379.86	-
002713	东易日盛	2016-06-29	重大事项	29.03	2016-07-20	31.93	798.00	21,226.15	23,165.94	-

注：本基金截至 2016 年 06 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

截至本报告期末 2016 年 06 月 30 日止，本基金无债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额，无相关抵押债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为量化股票型基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资和权证投资等。与这些金融工具有关的风险，以及本基金管理人管理这些风险所采取的风险管理政策如下所述。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为量化股票型证券投资基金，属于中高风险品种，本基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使得本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“长期平均风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币型基金”。

本基金管理人已制定针对以上金融工具风险的管理政策和控制制度，并且形成了由本基金管理人在公司层面建立的风险管理委员会以及在董事会层面建立的风险控制委员会负责对与所投资金融工具相关的风险类型、管理政策和各种投资限制的定期回顾、评估和修改，本基金管理人的风险管理部门负责具体落实和日常跟踪的工作机制。

本基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频率。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

本基金面临的主要风险包括：信用风险、流动性风险和市场风险。与本基金相关的市场风险主要是利率风险和其他价格风险。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指金融工具的一方到期无法履行约定义务致使本基金遭受损失的风险。本基金的信用风险主要来源于金融工具的发行者或是交易对手不能履行约定义务而产生。

对于发行者的信用风险控制，本基金管理人主要通过对投资品种的信用等级评估来选择适当的投资对象来管理。于2016年6月30日，本基金未持有信用类债券（2015年12月31日：同），所以本基金管理人认为本基金与债券发行者关的信用风险不重大。

本基金的银行存款存放在本基金的托管行 - 中国工商银行，因而本基金管理人认为与该银行相关的信用风险不重大。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成债券等投资品种的交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小，本基金管理人认为在交易所进行的交易涉及的信用风险不重大。

对于银行间债券等品种的交易，本基金管理人主要通过事前检查、控制交易对手信用及交割方式来管理风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险主要来源于开放式基金每日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。

本基金管理人对于流动性风险管理的目标是监控基金组合流动性指标，确保市场出现剧烈波动时，基金仍能应付大量赎回和其他负债，灵活调整组合结构，而且不影响组合估值。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人对基金申购赎回状况进行严密监控和分析预测，保持基金投资组合中的流动性资产与之相匹配。此外，本基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款，设计了非常情况下赎回资金的处理模式，控制因开放模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资交易品种变现的流动性风险，本基金管理人每日监控和预测本基金的各项流动性指标，包括组合持仓集中度指标、基金组合在短时间内变现能力的综合指标、组合持仓中变现能力较差的品种的比例控制和受限制流通股票的总量控制，通过指标来持续地评估、选择、跟踪和控制基金投资的流动性风险。同时，本基金在需要时可以卖出回购金融资产方式融入短期资金，以缓解流动性

风险。

本基金所持大部分交易性金融资产在证券交易所上市，其余是流动性较好的可在银行间同业市场交易的金融资产工具、银行存款及结算备付金等，因此比较容易变现来满足投资者对于基金资产的赎回。除附注 6.4.12 披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有有重大流动性风险的投资品种。从本基金资产和负债的情况来看，本基金管理人认为本基金面临的流动性风险较小。

本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。

于 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月30日	1个月以内	1个月-1年	1年-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	177,437,165.85	-	-	-	-	177,437,165.85
结算备付金	4,972,616.87	-	-	-	-	4,972,616.87
存出保证金	510,214.37	-	-	-	-	510,214.37
交易性金融资产	-	-	-	-	1,059,582,943.13	1,059,582,943.13
应收利息	-	-	-	-	36,198.25	36,198.25
应收申购款	-	-	-	-	1,288,147.39	1,288,147.39
资产总计	182,919,997.09	-	-	-	1,060,907,288.77	1,243,827,285.86
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	16,077,552.91	16,077,552.91
应付管理人报酬	-	-	-	-	1,518,746.28	1,518,746.28
应付托管费	-	-	-	-	253,124.38	253,124.38
应付交易费用	-	-	-	-	2,094,730.59	2,094,730.59
其他负债	-	-	-	-	232,363.49	232,363.49

负债总计	-	-	-	-	20,176,517.65	20,176,517.65
利率敏感度缺口	182,919,997.09	-	-	-	1,040,730,771.12	1,223,650,768.21
上年度末 2015年12月31日	1个月以内	1个月-1年	1年-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	58,206,992.53	-	-	-	-	58,206,992.53
结算备付金	782,915.83	-	-	-	-	782,915.83
存出保证金	165,338.30	-	-	-	-	165,338.30
交易性金融资产	-	-	-	-	506,016,363.77	506,016,363.77
应收利息	-	-	-	-	13,127.12	13,127.12
应收申购款	-	-	-	-	130,816,445.62	130,816,445.62
资产总计	59,155,246.66	-	-	-	636,845,936.51	696,001,183.17
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	64,126,974.28	64,126,974.28
应付赎回款	-	-	-	-	1,878,141.42	1,878,141.42
应付管理人报酬	-	-	-	-	457,347.66	457,347.66
应付托管费	-	-	-	-	76,224.61	76,224.61
应付交易费用	-	-	-	-	711,541.43	711,541.43
其他负债	-	-	-	-	279,736.73	279,736.73
负债总计	-	-	-	-	67,529,966.13	67,529,966.13
利率敏感度缺口	59,155,246.66	-	-	-	569,315,970.38	628,471,217.04

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2016年6月30日，本基金未持有交易性债券投资（2015年12月31日：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2015年12月31日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

基金的其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险，该风险可能与特定投资品种相关，也可能与整体投资品种相关。本基金的市场价格风险主要来源于本基金投资的股权和债券工具的未来价格可能受到一般市场波动或是其他影响个别股权工具价值的特定风险影响。由于本基金是一只中高风险的量化股票型基金，股票资产

的配置一般情况下在 85%至 95%的比例，所以存在很高的市场价格风险。

本基金管理人通过采用数量化技术对投资策略进行优化，将特定的投资思想和理念通过具体指标与参数的设定体现在数量模型中，坚持以数量化的方式进行投资。

此外，本基金管理人在构建基金资产配置和资产投资组合的基础上，通过建立事前和事后跟踪误差以及运用多种定量的方法对基金进行风险度量，来测试基金的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制，争取将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		上年度末 2015年12月31日	
	公允价值	占基金资产 净值比例(%)	公允价值	占基金资产净 值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	1,059,582,943.13	86.59	506,016,363.77	80.52
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,059,582,943.13	86.59	506,016,363.77	80.52

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 以中证 500 指数为基准衡量其他价格风险		
	2. 其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
	基准上升 5%	增加约 5,018	增加约 2,691
	基准下降 5%	减少约 5,018	减少约 2,691

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)不以公允价值计量的金融工具 不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(b)以公允价值计量的金融工具 根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

于 2016 年 06 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 1,022,057,351.25 元，属于第二层级的余额为 37,525,591.88 元，无属于第三层级的余额。

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层级未发生重大变动。

对于持有的重大事项停牌股票，本基金将相关股票公允价值所属层级于停牌期间从第一层级转入第二层级，并于复牌后从第二层级转回第一层级。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,059,582,943.13	85.19
	其中：股票	1,059,582,943.13	85.19
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	182,409,782.72	14.67
7	其他各项资产	1,834,560.01	0.15
8	合计	1,243,827,285.86	100.00

注：本基金未开通沪港通交易机制投资于港股。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	15,826,626.72	1.29
B	采矿业	15,233,705.35	1.24
C	制造业	476,737,264.81	38.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	90,975,189.64	7.43

E	建筑业	29,021,843.38	2.37
F	批发和零售业	99,235,715.20	8.11
G	交通运输、仓储和邮政业	113,956,469.49	9.31
H	住宿和餐饮业	26,868.38	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	102,901.86	0.01
J	金融业	47,867,233.22	3.91
K	房地产业	159,408,329.01	13.03
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	6,149,975.52	0.50
N	水利、环境和公共设施管理业	4,978,929.96	0.41
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	61,890.59	0.01
S	综合	-	-
	合计	1,059,582,943.13	86.59

7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金未开通沪港通交易机制投资于港股。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	000679	大连友谊	1,057,297.00	13,015,326.07	1.06
2	603128	华贸物流	1,288,127.00	12,636,525.87	1.03
3	600651	飞乐音响	983,994.00	12,457,364.04	1.02
4	000910	大亚科技	806,008.00	12,452,823.60	1.02
5	601003	柳钢股份	3,141,860.00	12,253,254.00	1.00
6	600782	新钢股份	2,288,415.00	12,197,251.95	1.00
7	000936	华西股份	1,448,318.00	11,905,173.96	0.97
8	600075	新疆天业	1,030,785.00	11,864,335.35	0.97
9	002088	鲁阳节能	760,187.00	11,828,509.72	0.97
10	002271	东方雨虹	681,762.00	11,746,759.26	0.96
11	600382	广东明珠	730,359.00	11,685,744.00	0.95
12	002648	卫星石化	1,291,416.00	11,674,400.64	0.95
13	002479	富春环保	1,028,302.00	11,547,831.46	0.94
14	300237	美晨科技	1,223,198.00	11,522,525.16	0.94
15	600693	东百集团	1,710,719.00	11,496,031.68	0.94
16	600409	三友化工	1,701,562.00	11,468,527.88	0.94
17	000708	大冶特钢	1,019,710.00	11,420,752.00	0.93
18	000822	山东海化	2,246,618.00	11,390,353.26	0.93
19	002133	广宇集团	1,768,561.00	11,389,532.84	0.93

20	600461	洪城水业	861,955.00	11,188,175.90	0.91
21	002275	桂林三金	597,534.00	11,030,477.64	0.90
22	002440	闰土股份	740,471.00	10,995,994.35	0.90
23	000597	东北制药	1,226,877.00	10,894,667.76	0.89
24	601008	连云港	2,287,590.00	10,843,176.60	0.89
25	000732	泰禾集团	553,151.00	10,753,255.44	0.88
26	000830	鲁西化工	2,369,947.00	10,712,160.44	0.88
27	000543	皖能电力	1,491,038.00	10,646,011.32	0.87
28	002039	黔源电力	547,720.00	10,532,655.60	0.86
29	000043	中航地产	1,272,282.00	10,496,326.50	0.86
30	600723	首商股份	1,174,844.00	10,491,356.92	0.86
31	000952	广济药业	622,007.00	10,487,038.02	0.86
32	600897	厦门空港	497,895.00	10,435,879.20	0.85
33	600816	安信信托	617,444.00	10,416,280.28	0.85
34	601012	隆基股份	797,936.00	10,413,064.80	0.85
35	600026	中海发展	1,754,390.00	10,350,901.00	0.85
36	002083	孚日股份	1,634,916.00	10,299,970.80	0.84
37	002394	联发股份	680,984.00	10,282,858.40	0.84
38	000966	长源电力	1,575,161.00	10,238,546.50	0.84
39	600595	中孚实业	1,814,007.00	10,230,999.48	0.84
40	000811	烟台冰轮	910,931.00	10,220,645.82	0.84
41	002372	伟星新材	710,304.00	10,199,965.44	0.83
42	002538	司尔特	1,089,904.00	10,190,602.40	0.83
43	600004	白云机场	830,188.00	10,178,104.88	0.83
44	002078	太阳纸业	2,070,619.00	10,104,620.72	0.83
45	600561	江西长运	826,856.00	10,104,180.32	0.83
46	600240	华业资本	1,006,946.00	10,089,598.92	0.82
47	600064	南京高科	673,068.00	10,062,366.60	0.82
48	600211	西藏药业	226,346.00	10,040,708.56	0.82
49	000900	现代投资	1,488,818.00	10,034,633.32	0.82
50	002187	广百股份	810,219.00	9,981,898.08	0.82
51	600325	华发股份	900,829.00	9,972,177.03	0.81
52	600068	葛洲坝	1,701,337.00	9,901,781.34	0.81
53	600743	华远地产	2,092,067.00	9,895,476.91	0.81
54	000789	万年青	1,599,410.00	9,884,353.80	0.81
55	000036	华联控股	1,202,254.00	9,870,505.34	0.81
56	600239	云南城投	2,126,268.00	9,865,883.52	0.81
57	000501	鄂武商A	628,238.00	9,857,054.22	0.81
58	002101	广东鸿图	455,753.00	9,853,379.86	0.81
59	002146	荣盛发展	1,465,474.00	9,847,985.28	0.80
60	600858	银座股份	1,202,085.00	9,845,076.15	0.80
61	600657	信达地产	1,975,700.00	9,838,986.00	0.80
62	600658	电子城	949,162.00	9,804,843.46	0.80
63	600859	王府井	641,160.00	9,771,278.40	0.80

64	000828	东莞控股	1,071,742.00	9,731,417.36	0.80
65	600548	深高速	1,245,200.00	9,700,108.00	0.79
66	002321	华英农业	1,029,477.00	9,697,673.34	0.79
67	600823	世茂股份	1,428,085.00	9,696,697.15	0.79
68	600987	航民股份	796,778.00	9,656,949.36	0.79
69	000600	建投能源	1,099,942.00	9,602,493.66	0.78
70	000540	中天城投	1,526,648.00	9,511,017.04	0.78
71	600883	博闻科技	635,702.00	9,224,036.02	0.75
72	600350	山东高速	1,711,532.00	9,071,119.60	0.74
73	600352	浙江龙盛	1,032,508.00	8,900,218.96	0.73
74	600139	西部资源	704,146.00	8,668,037.26	0.71
75	002142	宁波银行	585,049.00	8,647,024.22	0.71
76	601818	光大银行	2,210,664.00	8,312,096.64	0.68
77	601328	交通银行	1,476,336.00	8,311,771.68	0.68
78	600048	保利地产	942,648.00	8,135,052.24	0.66
79	600869	智慧能源	789,566.00	8,132,529.80	0.66
80	600104	上汽集团	400,148.00	8,119,002.92	0.66
81	601668	中国建筑	1,515,172.00	8,060,715.04	0.66
82	600015	华夏银行	806,996.00	7,981,190.44	0.65
83	300234	开尔新材	353,675.00	7,639,380.00	0.62
84	000625	长安汽车	549,303.00	7,508,972.01	0.61
85	600027	华电国际	1,506,663.00	7,457,981.85	0.61
86	002045	国光电器	505,813.00	7,223,009.64	0.59
87	600785	新华百货	261,256.00	6,769,142.96	0.55
88	000813	天山纺织	538,611.00	6,565,668.09	0.54
89	002523	天桥起重	1,121,740.00	6,539,744.20	0.53
90	002221	东华能源	518,688.00	6,322,806.72	0.52
91	002671	龙泉股份	509,482.00	6,292,102.70	0.51
92	002398	建研集团	466,503.00	6,129,849.42	0.50
93	002696	百洋股份	320,217.00	6,128,953.38	0.50
94	002305	南国置业	1,078,374.00	6,060,461.88	0.50
95	601339	百隆东方	932,285.00	5,920,009.75	0.48
96	603001	奥康国际	273,677.00	5,818,373.02	0.48
97	002670	华声股份	212,472.00	5,730,369.84	0.47
98	600033	福建高速	1,764,430.00	5,593,243.10	0.46
99	600780	通宝能源	1,114,070.00	5,592,631.40	0.46
100	600129	太极集团	302,420.00	5,355,858.20	0.44
101	000786	北新建材	589,742.00	5,354,857.36	0.44
102	002597	金禾实业	397,041.00	5,348,142.27	0.44
103	000703	恒逸石化	540,597.00	5,335,692.39	0.44
104	603968	醋化股份	229,591.00	5,324,215.29	0.44
105	000928	中钢国际	421,379.00	5,300,947.82	0.43
106	000488	晨鸣纸业	667,180.00	5,297,409.20	0.43
107	002662	京威股份	350,285.00	5,292,806.35	0.43

108	600168	武汉控股	542,279.00	5,292,643.04	0.43
109	601000	唐山港	1,360,098.00	5,277,180.24	0.43
110	000698	沈阳化工	805,737.00	5,269,519.98	0.43
111	600686	金龙汽车	357,246.00	5,262,233.58	0.43
112	000498	山东路桥	878,501.00	5,060,165.76	0.41
113	000899	赣能股份	621,007.00	5,048,786.91	0.41
114	002548	金新农	285,833.00	5,019,227.48	0.41
115	002573	清新环境	294,263.00	4,978,929.96	0.41
116	000716	黑芝麻	728,240.00	4,922,902.40	0.40
117	601009	南京银行	447,164.00	4,198,869.96	0.34
118	600177	雅戈尔	298,634.00	4,118,162.86	0.34
119	600642	申能股份	666,800.00	3,827,432.00	0.31
120	000553	沙隆达 A	111,400.00	1,189,752.00	0.10
121	601611	中国核建	32,269.00	675,067.48	0.06
122	300516	久之洋	1,473.00	258,025.41	0.02
123	601127	小康股份	8,662.00	206,761.94	0.02
124	603737	三棵树	1,327.00	154,038.16	0.01
125	601966	玲珑轮胎	9,423.00	122,310.54	0.01
126	603131	上海沪工	1,263.00	76,664.10	0.01
127	300515	三德科技	1,355.00	63,508.85	0.01
128	300518	盛讯达	1,306.00	61,186.10	0.01
129	002799	环球印务	1,080.00	47,131.20	0.00
130	002343	慈文传媒	763.00	37,005.50	0.00
131	603958	哈森股份	2,372.00	34,394.00	0.00
132	300369	绿盟科技	766.00	32,409.46	0.00
133	002395	双象股份	1,094.00	29,778.68	0.00
134	600754	锦江股份	803.00	26,868.38	0.00
135	300144	宋城演艺	999.00	24,885.09	0.00
136	002802	洪汇新材	1,629.00	24,565.32	0.00
137	002713	东易日盛	798.00	23,165.94	0.00
138	603909	合诚股份	1,095.00	20,126.10	0.00
139	603016	新宏泰	1,602.00	13,600.98	0.00
140	300520	科大国创	926.00	9,306.30	0.00
141	002805	丰元股份	971.00	5,631.80	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600693	东百集团	19,864,408.78	3.16
2	000936	华西股份	19,845,769.88	3.16
3	000822	山东海化	19,715,223.06	3.14

4	002133	广宇集团	18,673,353.24	2.97
5	002648	卫星石化	18,301,628.48	2.91
6	600883	博闻科技	17,900,406.84	2.85
7	000910	大亚科技	17,491,181.10	2.78
8	600987	航民股份	17,467,493.82	2.78
9	600657	信达地产	17,021,867.40	2.71
10	000900	现代投资	16,698,823.45	2.66
11	600743	华远地产	16,245,550.54	2.58
12	600068	葛洲坝	16,184,855.35	2.58
13	000830	鲁西化工	15,920,256.56	2.53
14	600352	浙江龙盛	15,845,541.64	2.52
15	002372	伟星新材	15,836,936.57	2.52
16	600869	智慧能源	15,739,504.08	2.50
17	000540	中天城投	15,690,609.59	2.50
18	600858	银座股份	15,413,601.42	2.45
19	002440	闰土股份	14,927,989.60	2.38
20	600026	中海发展	14,796,768.60	2.35
21	601199	江南水务	14,546,001.91	2.31
22	002321	华英农业	14,455,293.16	2.30
23	000811	烟台冰轮	14,409,654.24	2.29
24	000952	广济药业	14,084,613.25	2.24
25	000043	中航地产	13,811,411.55	2.20
26	600350	山东高速	13,742,790.28	2.19
27	600240	华业资本	13,715,832.00	2.18
28	600211	西藏药业	13,709,729.07	2.18
29	002146	荣盛发展	13,708,022.32	2.18
30	600816	安信信托	13,572,061.08	2.16
31	002083	孚日股份	13,529,703.69	2.15
32	600325	华发股份	13,491,446.43	2.15
33	000708	大冶特钢	13,465,717.93	2.14
34	300234	开尔新材	13,454,006.54	2.14
35	600595	中孚实业	13,442,783.03	2.14
36	000732	泰禾集团	13,312,365.90	2.12
37	002538	司尔特	13,268,482.60	2.11
38	601012	隆基股份	13,168,730.54	2.10
39	600658	电子城	13,105,835.18	2.09
40	002398	建研集团	13,097,243.25	2.08
41	600863	内蒙华电	13,081,972.00	2.08
42	002662	京威股份	13,057,569.11	2.08
43	600561	江西长运	12,974,896.10	2.06
44	002032	苏泊尔	12,969,782.22	2.06
45	000939	凯迪生态	12,866,976.80	2.05
46	600015	华夏银行	12,834,870.67	2.04
47	000600	建投能源	12,729,002.65	2.03

48	600337	美克家居	12,678,128.21	2.02
49	603001	奥康国际	12,676,596.26	2.02
50	601588	北辰实业	12,608,881.00	2.01

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601199	江南水务	20,852,823.14	3.32
2	600869	智慧能源	17,683,216.32	2.81
3	002032	苏泊尔	17,280,914.17	2.75
4	300258	精锻科技	14,609,483.99	2.32
5	000957	中通客车	13,639,574.36	2.17
6	300342	天银机电	13,331,825.38	2.12
7	600132	重庆啤酒	13,153,493.37	2.09
8	600742	一汽富维	13,104,642.85	2.09
9	300144	宋城演艺	12,989,539.89	2.07
10	600426	华鲁恒升	12,986,484.42	2.07
11	002543	万和电气	12,848,792.71	2.04
12	000916	华北高速	12,775,390.48	2.03
13	300204	舒泰神	12,656,812.99	2.01
14	600790	轻纺城	12,624,761.32	2.01
15	600479	千金药业	12,411,563.09	1.97
16	300012	华测检测	12,382,413.05	1.97
17	600681	百川能源	12,347,980.02	1.96
18	600185	格力地产	12,284,234.74	1.95
19	601588	北辰实业	12,238,669.62	1.95
20	600863	内蒙华电	11,950,533.65	1.90

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	2,232,911,312.76
卖出股票的收入（成交）总额	1,669,542,033.04

注：“买入金额”、“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 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。

7.6 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明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

根据本基金基金合同，本基金不得参与股指期货交易。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金基金合同，本基金不得参与股指期货交易。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 本期国债期货投资政策**

根据本基金基金合同，本基金不得参与国债期货交易。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据本基金基金合同，本基金不得参与国债期货交易。

7.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同，本基金不得参与国债期货交易。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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、处罚的情形。

7.12.2 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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	510,214.37
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	36,198.25
5	应收申购款	1,288,147.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,834,560.01

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000936	华西股份	11,905,173.96	0.97	重大事项

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
29,002	17,786.85	308,844,509.66	59.87%	207,009,719.96	40.13%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	陈翠芳	487,629.00	5.91%
2	黎文亮	323,603.00	3.92%
3	吴家驹	288,076.00	3.49%
4	孙玉侠	254,039.00	3.08%
5	葛晓涛	214,163.00	2.60%
6	杨锐赏	200,022.00	2.43%
7	吴祥宝	192,051.00	2.33%
8	陈董颖	175,000.00	2.12%
9	郑重	147,000.00	1.78%
10	杨静洪	140,911.00	1.71%

注：以上数据由中国证券登记结算有限责任公司提供。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	70,198.35	0.01%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究人员持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	246,864,331.77
本报告期基金总申购份额	478,969,038.79
减：本报告期基金总赎回份额	209,979,140.94
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	515,854,229.62

10 重大事件揭示**10.1 基金份额持有人大会决议**

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内，经本基金管理人股东会决议，同意外方股东提名的董事由安田敬之先生变更为川上丰先生。

2、本报告期内，经本基金管理人股东会决议，同意免去过振华先生董事职务。

3、本报告期内，经本基金管理人股东会决议，同意中方股东提名的监事会主席由徐宜阳先生变更为徐志斌先生。

4、本报告期内，经本基金管理人股东会决议，同意中方股东提名的监事会职工监事由赵鲜女士变更为葛菲斐女士。

5、本报告期内，经本基金管理人董事会决议，同意免去过振华先生公司总经理职务。

6、报告期内本基金基金托管人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金管理人的基金投资策略严格遵循本基金《招募说明书》中披露的基本投资策略，未发生显著的改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

报告期内本基金聘用普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）负责基金审计事务，未发生改聘会计师事务所事宜。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，上海证监局对我司进行了常规全面现场检查，就公司内部控制提出了相应改进意见并采取责令改正的行政监管措施，要求我司于2016年8月22日之前予以改正，并对相关责任人采取出具警示函措施的决定。对此我司高度重视，成立了整改工作小组，全面梳理内控制度，针对性的制定和实施了整改方案，排除业务中存在的风险隐患，进一步提升了公司内部控制和风险管理能力。公司现已完成相关整改工作，并已向上海证监局提交了整改报告。

除上述情况外，本报告期内基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
申万宏源	3	759,797,590.70	19.48%	703,279.63	19.60%	-
国金证券	2	597,099,525.06	15.31%	552,306.21	15.39%	-
海通证券	2	560,836,280.13	14.38%	511,091.20	14.24%	-
华创证券	1	386,075,001.11	9.90%	359,552.89	10.02%	-
广州证券	1	260,873,567.66	6.69%	237,734.94	6.63%	-
华信证券	1	259,819,324.36	6.66%	236,773.85	6.60%	-
中信证券	1	193,901,186.89	4.97%	176,701.97	4.92%	-
中金公司	1	186,793,624.19	4.79%	170,225.69	4.74%	-
平安证券	1	183,755,069.87	4.71%	167,456.31	4.67%	-
方正证券	1	141,510,770.32	3.63%	131,788.80	3.67%	-
长江证券	1	138,878,541.44	3.56%	129,337.15	3.60%	-
中信建投	1	103,296,035.01	2.65%	96,200.68	2.68%	-
广发证券	1	57,069,152.67	1.46%	52,007.31	1.45%	-
中银国际	1	52,289,095.09	1.34%	47,650.82	1.33%	新增
华泰证券	1	17,663,937.78	0.45%	16,097.39	0.45%	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
红塔证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-

北京高华	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	2	-	-	-	-	新增
中投证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
五矿证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-

注：交易单元选择的标准：1、经营行为规范，在近一年内无重大违规行为；2、公司财务状况良好；3、有良好的内控制度，在业内有良好的声誉；4、有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；5、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于 2016 年 1 月 4 日指数熔断触发后调整旗下部分基金开放时间的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》	2016-01-04
2	关于旗下开放式基金 2015 年年度最后一个交易日基金资产净值和基金份额净值的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》	2016-01-04
3	关于新增华泰证券股份有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通定期定额投资、转换业务及参加华泰证券股份有限公司开展的申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》	2016-01-05
4	关于旗下申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)新增中信证券股份有限公司为代销机构并开通定期定额投资、转换业务的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》	2016-01-05
5	关于新增中信证券股份有限公司为代销机构并开通定期定额投资、转换业务的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》	2016-01-05
6	关于申万菱信基金旗下场内基金在指数熔断期间暂停场内申购赎回业务的提示性公告	《中国证券报》、 《上海证券报》	2016-01-06
7	关于 2016 年 1 月 7 日指数熔断触发后调整旗下部分基金开放时间的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》	2016-01-07
8	申万菱信基金管理有限公司关于旗下基金参加浙江同花顺基金销售有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》	2016-01-09
9	申万菱信基金管理有限公司关于新增珠海盈米财富管理	《中国证券报》、	2016-01-16

	有限公司为旗下开放式基金代销机构并开通定期定额投资、转换业务及参加珠海盈米财富管理有限公司开展的申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》	
10	关于新增国金证券股份有限公司为旗下开放式基金代销机构并开通转换业务的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》	2016-01-21
11	关于新增大泰金石投资管理有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换业务及参加大泰金石投资管理有限公司开展的费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》	2016-03-15
12	申万菱信基金管理有限公司关于新增浙商证券股份有限公司为旗下开放式基金代销机构并开通定期定额投资、转换业务及参加浙商证券股份有限公司开展的申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》	2016-03-22
13	关于旗下部分开放式基金继续参加中国工商银行股份有限公司开展的个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》	2016-03-30
14	关于在华西证券股份有限公司开通定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》	2016-04-08
15	关于网上交易系统支付宝渠道关闭基金支付服务的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》	2016-05-13
16	关于旗下部分开放式基金参加中国民生银行股份有限公司直销银行费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》	2016-05-13
17	关于新增华泰证券股份有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通定期定额投资、转换业务及参加华泰证券股份有限公司开展的申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》	2016-05-24
18	关于调整直销柜台基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》	2016-05-25
19	申万菱信基金关于旗下部分开放式基金参加珠海盈米财富管理有限公司开展的转换费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》	2016-06-01
20	关于旗下部分开放式基金在上海陆金所资产管理有限公司开通定期定额投资业务及参加上海陆金所资产管理有限公司开展的定期定额申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》	2016-06-08
21	关于调整开立基金账户证件类型类型的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》	2016-06-22
22	申万菱信基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行股份有限公司开展的申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》	2016-06-27

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

基金合同；

招募说明书及其定期更新；

发售公告；
成立公告；
开放日常交易业务公告；
定期报告；
其他临时公告。

11.2 存放地点

上述备查文件中基金合同、招募说明书及其定期更新、基金发售公告和基金成立公告均放置于本基金管理人及基金托管人的住所；开放日常交易业务公告、定期报告和其他临时公告放置于本基金管理人的住所。本基金管理人住所地址为：中国上海市中山南路 100 号 11 层。

11.3 查阅方式

上述文件均可到本基金管理人的住所进行查阅，也可在本基金管理人的网站进行查阅，查询网址：www.swsmu.com。

申万菱信基金管理有限公司

二〇一六年八月二十九日