

申万菱信中小板指数分级证券投资基金
2016 年年度报告摘要
2016 年 12 月 31 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

报告送出日期：二〇一七年三月三十日

§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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 27 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。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | | |
|-----------------|------------------|------------------|------------------|
| 基金简称 | 申万菱信中小板指数分级 | | |
| 场内简称 | 申万中小 | | |
| 基金主代码 | 163111 | | |
| 交易代码 | 163111 | | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | | |
| 基金合同生效日 | 2012 年 5 月 8 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 | | |
| 报告期末基金份额总额 | 480,076,988.07 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 | 2012 年 5 月 28 日 | | |
| 下属分级基金的基金简称 | 申万中小 | 中小板 A | 中小板 B |
| 下属分级基金的场内简称 | 申万中小 | 中小板 A | 中小板 B |
| 下属分级基金的交易代码 | 163111 | 150085 | 150086 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 105,981,424.07 份 | 187,047,782.00 份 | 187,047,782.00 份 |

2.2 基金产品说明

| | | | |
|---------------|--|-----------------------------|-------------------------------------|
| 投资目标 | 本基金采取指数化投资方式，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%，实现对中小板指数的有效跟踪。 | | |
| 投资策略 | 本基金主要采用完全复制的方法进行投资，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。在标的指数成份股发生变动、增发、配股、分红等公司行为导致成份股的构成及权重发生变化时，由于交易成本、交易制度、个别成份股停牌或者流动性不足等原因导致本基金无法及时完成投资组合同步调整的情况下，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近标的指数的表现。 | | |
| 业绩比较基准 | 95%×中小板指数收益率+5%×银行同业存款利率 | | |
| 下属分级基金的风险收益特征 | 申万中小板份额为常规指数基金份额，具有预期风险较高、预期收益较高的特征，其预期风险和预期收益水平均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。 | 中小板 A 份额，则具有预期风险低，预期收益低的特征。 | 中小板 B 份额由于利用杠杆投资，则具有预期风险高、预期收益高的特征。 |

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 负责人 | 姓名 | 王菲萍 | 林葛 |
| | 联系电话 | 021-23261188 | 010-66060069 |
| | 电子邮箱 | service@swsmu.com | tgxxpl@abchina.com |
| 客户服务电话 | | 4008808588 | 95599 |
| 传真 | | 021-23261199 | 010-68121816 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|---|
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.swsmu.com |
| 基金年度报告备置地点 | 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、基金净值表现及利润分配情况

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 | 2016 年 | 2015 年 | 2014 年 |
|---------------|-----------------|----------------|------------------|
| 本期已实现收益 | -72,734,297.16 | 142,526,753.93 | 33,394,984.39 |
| 本期利润 | -140,192,594.23 | 167,492,203.24 | -6,381,497.42 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.2709 | 0.0905 | -0.0093 |
| 本期基金份额净值增长率 | -22.81% | 51.21% | 8.16% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2016 年末 | 2015 年末 | 2014 年末 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.1992 | 0.3400 | 0.0608 |
| 期末基金资产净值 | 470,263,685.32 | 666,361,929.44 | 1,969,947,516.75 |
| 期末基金份额净值 | 0.9796 | 1.2966 | 1.0604 |

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 |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月 | -4.58% | 0.77% | -4.35% | 0.78% | -0.23% | -0.01% |
| 过去六个月 | -5.67% | 0.86% | -5.76% | 0.88% | 0.09% | -0.02% |
| 过去一年 | -22.81% | 1.78% | -21.71% | 1.70% | -1.10% | 0.08% |
| 过去三年 | 26.24% | 2.01% | 29.34% | 1.91% | -3.10% | 0.10% |
| 自基金合同生效起至今 | 32.93% | 1.80% | 34.36% | 1.74% | -1.43% | 0.06% |

注：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：

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

$$\% \text{benchmark}(t) = 95\% * (\text{中小板指数}(t) / \text{中小板指数}(t-1) - 1) + 5\% * \text{银行同业存款利率（税后）} / 365;$$

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

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

申万菱信中小板指数分级证券投资基金

自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

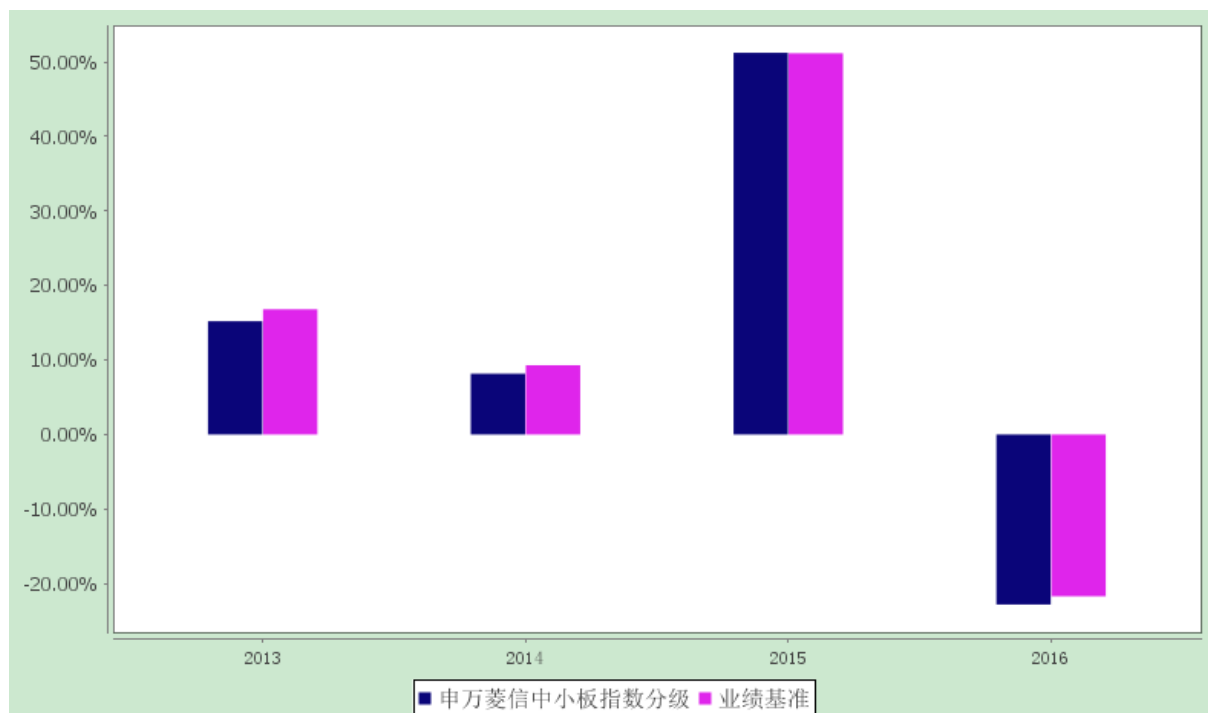
(2012 年 5 月 8 日至 2016 年 12 月 31 日)



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

申万菱信中小板指数分级证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

根据《基金合同》的约定，在本基金分级运作期内，本基金（包括申万中小板份额、中小板 A 份额、中小板 B 份额）不进行收益分配。

§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 12 月 31 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 27 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 340 亿元，客户数超过 592 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 | | |
| 袁英杰 | 本基金 基金经 理 | 2015-01-30 | - | 10 年 | 袁英杰先生，硕士研究生。曾任职于兴业证券、申银万国证券研究所等，2013 年 5 月加入申万菱信基金管理有限公司，曾任高级数量研究员、基金经理助理，现任申万菱信深证成指分级证券投资基金、申万菱信中小板指数分级证券投资基金、申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金、申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金、申万菱信中证军工指数分级证券投资基金、申万菱信中证申万电子行业投资指数分级证券投资基金、申万菱信中证申万传媒行业投资指数分级证券投资基金、申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金、申万菱信中证申万新兴健康产业主题投资指数证券投资基金(LOF)基金经理。 |
| 俞诚 | 本基金 基金经 理 | 2015-12-03 | - | 7 年 | 俞诚先生，经济学学士，金融风险管理师(FRM)。2009 年开始从事证券相关工作，2009 年 8 月加入申万菱信基金管理有限公司，历任产品与金融工程总部金融工程师、数量研究员，现任申万菱信沪深 300 价值指数证券投资基金、申万菱信深证成指分级证券投资基金、申万菱信中小板指数分级证券投资基金、申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金、申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金、申万菱信中证军工指数分级证券投资基金、申万菱信中证申万电子行业投资指数分级证券投资基金、申万菱信中证申万传媒行业投资指数分级证券投资基金、申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金、申万菱信中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理。 |

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

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及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 公平交易制度和控制方法

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。

在研究分析方面,本公司建立了规范、完善的研究管理平台,规范了研究人员的投资建议、研究报告的发布流程,使各投资组合经理在获取投资建议的及时性、准确性及深度等方面得到公平对待。

在投资决策方面,首先,公司建立健全投资授权制度,明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限。投资决策委员会和投资总监等管理机构和人员不得对投资经理在授权范围内的投资活动进行干预。投资经理在授权范围内可以自主决策,超过投资权限的操作必须经过严格的审批程序;其次,公司建立投资组合投资信息的管理及保密制度,除分管投资副总及投资总监等因业务管理的需要外,不同投资经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离;另外,公司还建立机制要求公募投资经理与特定客户资产投资经理互相隔离,且不能互相授权投资事宜。

在交易执行方面,本公司设立了独立于投资管理职能的交易总部,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;此外,本公司对于可能导致涉嫌不公平交易和利益输送的反向交易行为也制定并落实了严格的管理:(1)对于交易所公开竞价的同向交易,交易总部按照“时间优先、价格优先”的原则,采取“未委托数量比例法”,通过系统的公平交易模块实现公平交易;(2)对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易,各投资经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量,集中交易室按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配;(3)对于银行间市场的现券交易,交易总部在银行间市场开

展独立、公平的询价，并由风险管理部对交易价格的公允性（根据市场公认的第三方信息）、交易对手和交易方式进行事前审核，确保交易得到公平和公允的执行。对于由于特殊原因不能参与以上提到的公平交易程序的交易指令，投资经理须提出申请并阐明具体原因，交由交易总监及风险管理总监进行严格的公平性审核；（4）严格禁止同一投资组合或不同投资组合之间在同一交易日内进行反向交易（除完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合外）。确因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生的不同投资组合之间的同日反向交易，相关投资经理须向风险管理委员会提供决策依据并留存记录备查。

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。其中日常监控包括了日内不定点对交易系统的抽查监控；对非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程进行审核和监控；以及对银行间交易过程中投资组合与交易对手之间议价交易的交易方式和交易价格的公允性进行审查。事后分析评估上，风险管理总部在每个季度和每年度的《公平交易执行报告》中，对不同组合间同一投资标的、临近交易日的同向交易和反向交易的合理性开展分析评估。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

对于场内同向交易，我们采集了本报告期内本公司旗下两两投资组合在相同时间窗口下（日内、3 日内和 5 日内）同买或者同卖场内同一证券时两者买卖均价存在的差异（即价差率）序列，然后按两两组合归类计算平均价差率。首先，假设两两组合在本报告期的价差率呈正态分布且平均价差率为 0，我们进行了 95% 的置信度、假设平均价差率为 0 的 T 检验，若通过该假设检验，则认为该两两组合的交易得到了公平的执行；对于未通过假设检验的情况，我们还计算了两两组合价差占优次数比例、价差交易模拟贡献、组合收益率差异和模拟输送比例占收益率差的比例等指标；若综合以上各项指标，认为仍存在一定的嫌疑，则我们将进一步对该两两组合同向买卖特定场内证券的时点、价格、数量等作分析，来判断是否存在重大利益输送的可能性。

对于场外同向交易，我们分析了本报告期内不同时间窗口内（日内、3 日内和 5 日内）两两组合同向交易的价差率、对比市场公允价格和交易对手，未发现利益输送的情况。

对于反向交易，我们根据交易价格、交易频率、交易数量等进行了综合分析，未发现异常情况。

综合而言，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。

4.3.3 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。

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。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% 的情况有六次。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，年初熔断机制推出后，市场经历了快速下跌，而后市场企稳反弹。国内市场上，流动性整体较为宽松，10 年期国债利率低位震荡，经济数据 2016 年下半年明显好转。国外市场上，风险事件频发，英国脱欧及美国大选事件增加了各类资产的波动性。全年上证综指下跌 12.31%，深证成份指数下跌 19.64%，沪深 300 指数下跌 11.28%；而中证 500 指数下跌 17.78%，中小板指数下跌 22.89%，创业板指数下跌 27.71%，显示大盘风格相对占优。

操作上，基金运作主要着眼于控制每日跟踪误差、净值表现和业绩基准的偏差幅度。从实际运作结果观察，基金跟踪误差的主要来源有：1) 长期停牌股票估值调整；2) 指数成分股定期调整。

本基金产品在申万菱信中小板指数分级基金之基础份额的基础上，设计了中小板 A 份额和中小板 B 份额。中小板 A 和中小板 B 份额之比为 1:1，本基金自成立之日起运作满 5 年之后转为中小板成分指数 LOF 基金。

从整体折溢价水平来看，溢价幅度最大超过 2.89%，折价幅度最大超过 -1.04%。

作为被动投资的基金产品，申万菱信中小板指数分级基金将继续坚持既定的指数化投资策略，以严格控制基金相对目标指数的跟踪偏离为投资目标，追求跟踪误差的最小化，使得投资者可以清晰地计算出分级端两个产品的折溢价状况。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2016 年中小板成份指数期间表现为 -22.89%，基金业绩基准表现为 -21.71%，申万菱信中小板指数分级基金净值期间表现为 -22.81%，和业绩基准的差约 -1.10%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年，受制于资产价格泡沫和人民币贬值压力，货币政策已经定调为稳健中性，实际将边际收紧，市场利率有抬升的趋势，受此影响人民币贬值幅度将低于预期。库存周期回升、制造业投资反弹、房地产投资仅小幅下滑将使 2017 年经济维持平稳增长。全球经济主导政策由货币转向财

政、美国重振制造业、国内去产能和去库存高峰过去，新一轮朱格拉周期有望开启。2017 年受基数影响 A 股盈利增速将前高后低，但下半年并不悲观，而且供给侧改革和经济周期回升将使中长期的盈利增速预期上升，尤其是周期行业和集中度提高的传统行业。中小创仍然面临盈利增速下滑和并购预期下降问题，存在估值下降压力。在流动性偏紧、经济平稳增长，风险偏好下降、再融资和解禁规模较大的情况下，A 股难有趋势性机会。建议关注受益于供给侧改革的周期股、受益于消费升级的白马股、受益于混改的国企股等。

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，总经理来肖贤先生，拥有 11 年基金行业高级管理人员经验；分管基金投资的副总经理（代行投资总监职责）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；分管基金运营的副总经理张丽红女士，拥有 13 年的基金行业运营、财务管理相关经验；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 12 年的证券基金行业合规管理经验；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 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

根据《基金合同》的约定，在本基金分级运作期内，本基金（包括申万中小板份额、中小板 A

份额、中小板 B 份额) 不进行收益分配。

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

在托管申万菱信中小板指数分级证券投资基金的过程中, 本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《申万菱信中小板指数分级证券投资基金》、《申万菱信中小板指数分级证券投资基金托管协议》的约定, 对申万菱信中小板指数分级证券投资基金管理人—申万菱信基金管理有限公司 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日基金的投资运作, 进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督, 认真履行了托管人的义务, 没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为, 申万菱信基金管理有限公司在申万菱信中小板指数分级证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上, 不存在损害基金份额持有人利益的行为; 在报告期内, 严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规, 在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为, 申万菱信基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定, 基金管理人所编制和披露的申万菱信中小板指数分级证券投资基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整, 未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§6 审计报告

普华永道中天审字(2017)第 21786 号

申万菱信中小板指数分级证券投资基金全体基金份额持有人:

我们审计了后附的申万菱信中小板指数分级证券投资基金(以下简称“申万菱信中小板指数分级基金”)的财务报表,包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是申万菱信中小板指数分级基金 的基金管理人申万菱信基金管理有
限公司管理层的责任。这种责任包括:

(1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,并使其实现公允反映;

(2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。

我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。

6.3 审计意见

我们认为,上述申万菱信中小板指数分级基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了申万菱信中小板指数分级基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

中国注册会计师 赵 钰

中国注册会计师 陈 玲

上海市陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 层

2017 年 3 月 28 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：申万菱信中小板指数分级证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产 | 本期末 2016 年 12 月 31 日 | 上年度末 2015 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 资产： | - | - |
| 银行存款 | 46,541,571.67 | 47,393,788.41 |
| 结算备付金 | 405,271.57 | 1,376,247.07 |
| 存出保证金 | 57,909.40 | 5,936,134.23 |
| 交易性金融资产 | 424,704,149.55 | 620,188,713.82 |
| 其中：股票投资 | 424,704,149.55 | 620,188,713.82 |
| 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 | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - |
| 应收证券清算款 | - | 7,473,215.87 |
| 应收利息 | 8,188.35 | 16,159.84 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | 23,352.66 | 66,931.27 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 471,740,443.20 | 682,451,190.51 |

| 负债和所有者权益 | 本期末 2016 年 12 月 31 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 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | - | - |
| 应付证券清算款 | 28,593.44 | - |
| 应付赎回款 | 492,017.36 | 13,676,402.34 |
| 应付管理人报酬 | 424,363.55 | 656,095.06 |
| 应付托管费 | 93,359.97 | 144,340.92 |
| 应付销售服务费 | - | - |
| 应付交易费用 | 144,831.76 | 1,235,105.86 |
| 应交税费 | - | - |
| 应付利息 | - | - |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 293,591.80 | 377,316.89 |
| 负债合计 | 1,476,757.88 | 16,089,261.07 |
| 所有者权益: | - | - |
| 实收基金 | 353,777,891.00 | 386,942,596.88 |
| 未分配利润 | 116,485,794.32 | 279,419,332.56 |
| 所有者权益合计 | 470,263,685.32 | 666,361,929.44 |
| 负债和所有者权益总计 | 471,740,443.20 | 682,451,190.51 |

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，申万菱信中小板指数分级证券投资基金份额之基础（以下简称“申万中小板”）份额净值 0.9796 元，申万菱信中小板指数分级证券投资基金之稳健收益类（以下简称“中小板 A”）份额净值 1.0324 元，申万菱信中小板指数分级证券投资基金之积极进取类（以下简称“中小板 B”）份额净值 0.9268 元；申万中小板份额 105,981,424.07 份，中小板 A 份额 187,047,782.00 份，中小板 B 份额 187,047,782.00 份。

7.2 利润表

会计主体：申万菱信中小板指数分级证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-----------------------|------------------------|-----------------------|
| | 2016年1月1日至2016年12月31日 | 2015年1月1日至2015年12月31日 |
| 一、收入 | -131,754,235.32 | 217,563,585.83 |
| 1.利息收入 | 302,186.43 | 1,987,618.92 |
| 其中：存款利息收入 | 302,186.43 | 1,987,618.92 |
| 债券利息收入 | - | - |
| 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） | -65,265,023.02 | 177,778,323.40 |
| 其中：股票投资收益 | -69,118,216.42 | 170,411,273.00 |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | - | - |
| 资产支持证券投资收益 | - | - |
| 贵金属投资收益 | - | - |
| 衍生工具收益 | - | - |
| 股利收益 | 3,853,193.40 | 7,367,050.40 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | -67,458,297.07 | 24,965,449.31 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 666,898.34 | 12,832,194.20 |
| 减：二、费用 | 8,438,358.91 | 50,071,382.59 |
| 1. 管理人报酬 | 5,321,145.11 | 19,599,755.50 |
| 2. 托管费 | 1,170,651.86 | 4,311,946.20 |
| 3. 销售服务费 | - | - |

| | | |
|----------------------------|------------------------|-----------------------|
| 4. 交易费用 | 1,491,332.49 | 25,411,644.14 |
| 5. 利息支出 | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | - | - |
| 6. 其他费用 | 455,229.45 | 748,036.75 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | -140,192,594.23 | 167,492,203.24 |
| 减：所得税费用 | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | -140,192,594.23 | 167,492,203.24 |

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：申万菱信中小板指数分级证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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） | 386,942,596.88 | 279,419,332.56 | 666,361,929.44 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数 （本期利润） | - | -140,192,594.23 | -140,192,594.23 |
| 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） | -33,164,705.88 | -22,740,944.01 | -55,905,649.89 |
| 其中：1.基金申购款 | 350,636,196.36 | 129,410,403.87 | 480,046,600.23 |
| 2.基金赎回款 | -383,800,902.24 | -152,151,347.88 | -535,952,250.12 |
| 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） | 353,777,891.00 | 116,485,794.32 | 470,263,685.32 |
| 项目 | 上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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） | 1,729,578,778.10 | 240,368,738.65 | 1,969,947,516.75 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数 | - | 167,492,203.24 | 167,492,203.24 |

| | | | |
|--|-------------------|-------------------|--------------------|
| (本期利润) | | | |
| 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) | -1,342,636,181.22 | -128,441,609.33 | -1,471,077,790.55 |
| 其中: 1.基金申购款 | 5,368,123,341.23 | 3,430,309,192.31 | 8,798,432,533.54 |
| 2.基金赎回款 | -6,710,759,522.45 | -3,558,750,801.64 | -10,269,510,324.09 |
| 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) | 386,942,596.88 | 279,419,332.56 | 666,361,929.44 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码(序号)从 7.1 至 7.4, 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: 张丽红, 会计机构负责人: 李濮君

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

申万菱信中小板指数分级证券投资基金(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[2012]197 号《关于核准申万菱信中小板指数分级证券投资基金募集的批复》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《申万菱信中小板指数分级证券投资基金基金合同》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 784,065,908.25 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(2012)第 131 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案, 《申万菱信中小板指数分级证券投资基金基金合同》于 2012 年 5 月 8 日正式生效, 基金合同生效日的基金份额总额为 784,503,291.30 份基金份额, 其中认购资金利息折合 437,383.05 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, 基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《申万菱信中小板指数分级证券投资基金基金合同》的相关规定, 本基金设有分级运作期, 为自基金合同生效日起五个运作周年的时间区间。分级运作期结束后, 本基金转换为上市开放式基金(LOF), 将不再进行基金份额分级。在分级运作期内, 本基金的基金份额包括申万菱信中小板指数分级基金之基础份额(以下简称“申万中小板份额”)、申万菱信中小板指数分级基金之稳健收益份额(以下简称“中小板 A 份额”)及申万菱信中小板指数分级基金之积极进取份额(以下简称“中小板 B 份额”)。申万中小板份额只接受场内与场外的申购和赎回, 但不上市交易。中小板 A 份额与中小板 B 份额只可上市交易, 不可单独进行申购或赎回。投资者可选择将其在场内申购的申万中小板份额按

1:1 的比例分拆成中小板 A 份额和中小板 B 份额，但不得申请将其场外申购的申万中小板份额进行分拆。投资者可将其持有的场外申万中小板份额跨系统转托管至场内并申请将其分拆成中小板 A 份额和中小板 B 份额后上市交易，也可按 1:1 的配比将其持有的中小板 A 份额和中小板 B 份额申请合并为场内的申万中小板份额。

中小板 A 份额与中小板 B 份额的基金份额净值按如下原则计算：一份中小板 A 份额的参考净值与一份中小板 B 份额的参考净值之和等于两份申万中小板份额的净值；中小板 A 份额每日获得日基准收益，中小板 A 份额实际的投资盈亏都由中小板 B 份额分享与承担。

在分级运作期内的每个运作周年(第五个运作周年除外)，本基金定期进行份额折算。在每个运作周年(第五个运作周年除外)的结束日，本基金根据基金合同的规定对中小板 A 份额和申万中小板份额进行定期份额折算。将中小板 A 份额在运作周年结束日的份额参考净值超出本金 1.000 元部分，折算为场内申万中小板份额分配给中小板 A 份额持有人。申万中小板份额持有人持有的每 2 份申万中小板份额将按 1 份中小板 A 份额获得新增申万中小板份额的分配。经过上述份额折算，中小板 A 份额和申万中小板份额的基金份额净值将相应调整。

本基金还进行不定期份额折算。不定期份额折算分以下两种情况：当申万中小板份额的基金份额净值连续十个交易日大于人民币 2.000 元时，基金管理人将根据基金合同的规定对申万中小板份额和中小板 B 份额进行份额折算，份额折算后中小板 B 份额与中小板 A 份额保持 1:1 配比，将中小板 B 份额的基金份额参考净值超过中小板 A 份额的基金份额参考净值的部分，折算成场内的申万中小板份额，折算后申万中小板份额的基金份额净值、中小板 B 份额的基金份额净值与折算基准日中小板 A 份额的基金份额净值三者相等；当中小板 B 份额的基金份额参考净值达到或跌破 0.250 元时，基金管理人将根据基金合同的规定对申万中小板份额、中小板 A 份额和中小板 B 份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保中小板 A 份额和中小板 B 份额的份额数比例为 1:1，份额折算后申万中小板份额的基金份额净值、中小板 A 份额和中小板 B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元。

经深圳证券交易所深证上[2012]132 号文审核同意，本基金中小板 A 份额 82,506,707.00 份和中小板 B 份额 82,506,707.00 份于 2012 年 5 月 28 日上市交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《申万菱信中小板指数分级证券投资基金基金合同》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(包括中小板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债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：投资于中小板指数成份股及其备选成份股的比

例不低于 90%；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：中小板指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%。

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 2017 年 3 月 28 日批准报出。

7.4.2 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 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《申万菱信中小板指数分级证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年度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 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局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《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》、财税[2015]101 号《关于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》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，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。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金

融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 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。

(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。

7.4.7 关联方关系

| 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 |
| 中国农业银行 | 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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 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12月31日 | | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31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 | 77,663,003.61 | 7.97% | 2,191,082,788.58 | 13.30% |

7.4.8.1.2 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12月31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 | 70,774.78 | 7.97% | 12,755.95 | 8.81% |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31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 | 1,945,886.82 | 13.24% | 99,074.27 | 8.02% |

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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016年12 月31日 | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日 |
|-----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| | 当期发生的基金应支付的管理费 | 5,321,145.11 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 266,481.11 | 440,706.07 |

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% 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% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016年12 月31日 | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日 |
|----|---------------------------------|--------------------------------------|
| | | |

| | | |
|----------------|--------------|--------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,170,651.86 | 4,311,946.20 |
|----------------|--------------|--------------|

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.22% 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 * 0.22% / 当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 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。

7.4.8.4.2 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。

7.4.8.5 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 | | 上年度可比期间 | |
|--------|-----------------------|------------|-----------------------|--------------|
| | 2016年1月1日至2016年12月31日 | | 2015年1月1日至2015年12月31日 | |
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国农业银行 | 46,541,571.67 | 276,444.73 | 47,393,788.41 | 1,827,000.66 |

注：本基金的银行活期存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内本基金在承销期内无参与关联方承销证券的情况。

7.4.9 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 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

| 7.4.12.1.1 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 |
| 300583 | 塞托生物 | 2016-12-29 | 2017-01-06 | 网下申购 | 40.29 | 40.29 | 1,582.00 | 63,738.78 | 63,738.78 | - |
| 300587 | 天铁股份 | 2016-12-28 | 2017-01-05 | 网下申购 | 14.11 | 14.11 | 1,438.00 | 20,290.18 | 20,290.18 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|------------|------|------|------|----------|----------|----------|---|
| 300586 | 美联新材 | 2016-12-26 | 2017-01-04 | 网下申购 | 9.30 | 9.30 | 1,006.00 | 9,355.80 | 9,355.80 | - |
| 300591 | 万里马 | 2016-12-30 | 2017-01-10 | 网下申购 | 3.07 | 3.07 | 2,397.00 | 7,358.79 | 7,358.79 | - |
| 300588 | 熙菱信息 | 2016-12-27 | 2017-01-05 | 网下申购 | 4.94 | 4.94 | 1,380.00 | 6,817.20 | 6,817.20 | - |

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申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股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，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.9.2 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 |
|--------|------|------------|------|--------|------------|--------|--------------|--------------|--------------|----|
| 002129 | 中环股份 | 2016-04-25 | 重大事项 | 8.27 | - | - | 604,124.00 | 7,838,214.57 | 4,996,105.48 | - |
| 002400 | 省广股份 | 2016-11-28 | 重大事项 | 13.79 | - | - | 342,980.00 | 5,883,234.70 | 4,729,694.20 | - |
| 002075 | 沙钢股份 | 2016-09-19 | 重大事项 | 16.12 | - | - | 256,809.00 | 3,664,999.65 | 4,139,761.08 | - |
| 002491 | 通鼎互联 | 2016-12-22 | 重大事项 | 15.54 | 2017-01-03 | 15.89 | 209,617.00 | 3,927,996.88 | 3,257,448.18 | - |
| 002396 | 星网锐捷 | 2016-09-12 | 重大事项 | 19.70 | 2017-02-21 | 18.35 | 108,125.00 | 2,206,070.78 | 2,130,062.50 | - |

注：本基金截至 2016 年 12 月 31 日止持有以上因重大资产重组可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.9.3 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 12 月 31 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。

7.4.10 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) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 405,343,517.36 元,属于第二层次的余额为 19,360,632.19 元,无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日:第一层次 557,326,974.16 元,第二层次 62,861,739.66 元,无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 12 月 31 日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015 年 12 月 31 日:同)。

(d) 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。

(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。

§8 投资组合报告

8.1 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 | 424,704,149.55 | 90.03 |
| | 其中:股票 | 424,704,149.55 | 90.03 |
| 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 | 46,946,843.24 | 9.95 |
| 7 | 其他各项资产 | 89,450.41 | 0.02 |
| 8 | 合计 | 471,740,443.20 | 100.00 |

注：本基金未开通沪港通交易机制投资于港股。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 2,895,171.92 | 0.62 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 283,605,495.62 | 60.31 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 14,436,794.87 | 3.07 |
| F | 批发和零售业 | 13,654,583.00 | 2.90 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 46,263,363.74 | 9.84 |
| J | 金融业 | 34,469,335.89 | 7.33 |
| K | 房地产业 | 5,002,615.40 | 1.06 |
| L | 租赁和商务服务业 | 13,309,194.40 | 2.83 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 3,503,363.92 | 0.74 |
| 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 | 7,564,230.79 | 1.61 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 424,704,149.55 | 90.31 |

8.2.2 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。

8.3 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 | 002415 | 海康威视 | 613,740.00 | 14,613,149.40 | 3.11 |
| 2 | 002450 | 康得新 | 745,004.00 | 14,237,026.44 | 3.03 |
| 3 | 002024 | 苏宁云商 | 1,192,540.00 | 13,654,583.00 | 2.90 |
| 4 | 002304 | 洋河股份 | 171,588.00 | 12,114,112.80 | 2.58 |
| 5 | 002673 | 西部证券 | 480,923.00 | 9,988,770.71 | 2.12 |
| 6 | 002142 | 宁波银行 | 549,890.00 | 9,150,169.60 | 1.95 |
| 7 | 002736 | 国信证券 | 567,642.00 | 8,826,833.10 | 1.88 |
| 8 | 002202 | 金风科技 | 514,648.00 | 8,805,627.28 | 1.87 |
| 9 | 002594 | 比亚迪 | 172,167.00 | 8,553,256.56 | 1.82 |
| 10 | 002456 | 欧菲光 | 239,137.00 | 8,197,616.36 | 1.74 |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于申万菱信基金管理有限公司网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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 | 002024 | 苏宁云商 | 15,767,361.00 | 2.37 |
| 2 | 002415 | 海康威视 | 13,635,526.95 | 2.05 |
| 3 | 002450 | 康得新 | 13,441,414.53 | 2.02 |
| 4 | 002673 | 西部证券 | 12,942,127.68 | 1.94 |
| 5 | 002304 | 洋河股份 | 11,506,908.03 | 1.73 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 6 | 002466 | 天齐锂业 | 10,529,585.23 | 1.58 |
| 7 | 002594 | 比亚迪 | 9,959,149.96 | 1.49 |
| 8 | 002739 | 万达院线 | 9,761,519.28 | 1.46 |
| 9 | 002736 | 国信证券 | 9,597,660.44 | 1.44 |
| 10 | 002202 | 金风科技 | 8,503,033.00 | 1.28 |
| 11 | 002142 | 宁波银行 | 8,014,670.92 | 1.20 |
| 12 | 002241 | 歌尔股份 | 7,459,120.60 | 1.12 |
| 13 | 002252 | 上海莱士 | 7,112,022.00 | 1.07 |
| 14 | 002074 | 国轩高科 | 6,758,497.88 | 1.01 |
| 15 | 002456 | 欧菲光 | 6,512,828.24 | 0.98 |
| 16 | 002460 | 赣锋锂业 | 6,441,660.94 | 0.97 |
| 17 | 002236 | 大华股份 | 6,283,549.13 | 0.94 |
| 18 | 002183 | 怡亚通 | 6,234,799.40 | 0.94 |
| 19 | 002176 | 江特电机 | 5,970,226.19 | 0.90 |
| 20 | 002008 | 大族激光 | 5,889,126.64 | 0.88 |

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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 | 002024 | 苏宁云商 | 21,340,655.70 | 3.20 |
| 2 | 002450 | 康得新 | 18,418,463.21 | 2.76 |
| 3 | 002415 | 海康威视 | 16,550,651.42 | 2.48 |
| 4 | 002304 | 洋河股份 | 14,590,445.00 | 2.19 |
| 5 | 002594 | 比亚迪 | 12,532,909.33 | 1.88 |
| 6 | 002219 | 恒康医疗 | 11,792,124.26 | 1.77 |
| 7 | 002736 | 国信证券 | 11,540,170.77 | 1.73 |
| 8 | 002202 | 金风科技 | 10,487,827.76 | 1.57 |
| 9 | 002673 | 西部证券 | 10,148,301.74 | 1.52 |
| 10 | 002142 | 宁波银行 | 10,084,645.04 | 1.51 |
| 11 | 002241 | 歌尔股份 | 9,536,536.80 | 1.43 |
| 12 | 002252 | 上海莱士 | 9,435,297.61 | 1.42 |
| 13 | 002456 | 欧菲光 | 8,712,478.16 | 1.31 |
| 14 | 002465 | 海格通信 | 7,874,202.09 | 1.18 |
| 15 | 002236 | 大华股份 | 7,872,647.23 | 1.18 |
| 16 | 002008 | 大族激光 | 7,469,433.47 | 1.12 |
| 17 | 002183 | 怡亚通 | 7,078,978.84 | 1.06 |
| 18 | 002475 | 立讯精密 | 6,518,301.20 | 0.98 |
| 19 | 002007 | 华兰生物 | 6,331,769.45 | 0.95 |
| 20 | 002250 | 联化科技 | 6,323,062.95 | 0.95 |

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|---------------|----------------|
| 买入股票的成本（成交）总额 | 457,884,546.89 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 516,792,597.67 |

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。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**8.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末未投资国债期货交易。

8.11.2 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投资国债期货交易。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货交易。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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的情形。本基金投资的前十名证券的发行主体除西部证券（002673.SH）外，在报告编制日前一年内没有受到公开谴责和处罚的情形。

西部证券于 2016 年 8 月 2 日收到了中国证监会湖北监管局下发的《关于对西部证券股份有限公司湖北分公司采取责令增加内部合规检查次数的监管措施的决定》。中国证监会湖北监管局认定，西部证券湖北分公司在防范和控制风险的内部控制制度在运行中存在缺陷，规范负责人行为的监督机制不够完善。中国证监会湖北监管局为此要求西部证券采取相应的整改措施。

此外，西部证券于 2016 年 8 月 30 日收到了中国证监会陕西监管局下发《关于对西部证券股份有限公司采取出具警示函措施的决定》。中国证监会陕西监管局认定，西部证券在担任宝信国际融资租赁有限公司（以下简称“宝信租赁”）于 2015 年 7 月 7 日公开发行的 15 宝信债受托管理机构过程中，未能在债券存续期内持续有效督导宝信租赁履行信息披露义务。中国证监会陕西监管局为此对西部证券采取出具警示函的行政监管措施。

西部证券为本基金的业绩基准“中小板指数”的成份股，因为本基金为采用完全复制方式被动跟踪标的指数的基金产品，所以西部证券受到监管机构警示的情形不会影响本基金的投资决策。

8.12.2 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。

8.12.3 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 | 57,909.40 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 8,188.35 |
| 5 | 应收申购款 | 23,352.66 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |

| | | |
|---|----|-----------|
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 89,450.41 |

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别 | 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 |
| 申万中小 | 6,848 | 15,476.26 | 51,713,749.16 | 48.80% | 54,267,674.91 | 51.20% |
| 中小板 A | 608 | 307,644.38 | 179,469,496.00 | 95.95% | 7,578,286.00 | 4.05% |
| 中小板 B | 11,668 | 16,030.83 | 5,673,233.00 | 3.03% | 181,374,549.00 | 96.97% |
| 合计 | 17,291 | 27,764.56 | 236,856,478.16 | 49.34% | 243,220,509.91 | 50.66% |

注：“持有人户数”合计数小于各份额级别持有人户数的总和，是由于一个持有人同时持有多个级别基金份额。

9.2 期末上市基金前十名持有人

中小板A

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额（份） | 占上市总份额比例 |
|----|-----------------------------------|---------------|----------|
| 1 | 中国太平洋人寿保险股份有限公司一分红-个人分红 | 35,310,403.00 | 18.88% |
| 2 | 中国银河证券股份有限公司 | 20,628,457.00 | 11.03% |
| 3 | 中国太保集团股份有限公司一本级一集团自有资金-012G-ZY001 | 18,128,031.00 | 9.69% |
| 4 | 太平洋资产—工商银行—南方资本管理有限公司 | 15,801,079.00 | 8.45% |

| | | | |
|----|----------------------------------|---------------|-------|
| 5 | 太平洋资管—建设银行—太平洋第三极稳定增值混合型产品 | 13,927,780.00 | 7.45% |
| 6 | 中国太平洋财产保险—传统—普通保险产品-013C-CT001 深 | 12,482,598.00 | 6.67% |
| 7 | 太平洋资产管理有限责任公司 | 9,799,834.00 | 5.24% |
| 8 | 太平洋资管—建设银行—太平洋智选债基 FOF 型产品 | 8,243,957.00 | 4.41% |
| 9 | 中国石油天然气集团公司企业年金计划—中国工商银行股份有限公 | 5,773,900.00 | 3.09% |
| 10 | 中国对外经济贸易信托有限公司—光大稳健 1 号信托计划 | 5,203,698.00 | 2.78% |

注：以上数据由中国证券登记结算有限责任公司提供。

中小板B

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额（份） | 占上市总份额比例 |
|----|---------------------------------|--------------|----------|
| 1 | 宋伟铭 | 5,798,333.00 | 3.10% |
| 2 | 叶宁 | 4,085,076.00 | 2.18% |
| 3 | 胡静亚 | 2,160,400.00 | 1.15% |
| 4 | 张美芳 | 2,120,779.00 | 1.13% |
| 5 | 长江证券—招商银行—长江证券超越理财基金管家 II 集合资产管 | 1,497,841.00 | 0.80% |
| 6 | 赵波 | 1,400,042.00 | 0.75% |
| 7 | 黄艳群 | 1,182,400.00 | 0.63% |
| 8 | 李琳丽 | 1,097,700.00 | 0.59% |
| 9 | 余功斌 | 1,097,000.00 | 0.59% |
| 10 | 侯秉刚 | 1,000,000.00 | 0.53% |

注：以上数据由中国证券登记结算有限责任公司提供。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 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 | 申万中小 | 67,207.94 | 0.06% |
| | 中小板 A | - | - |
| | 中小板 B | - | - |
| | 合计 | 67,207.94 | 0.01% |

注：分级基金管理人的从业人员持有基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.4 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 | 份额级别 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|-------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 申万中小 | 0 |
| | 中小板 A | 0 |
| | 中小板 B | 0 |
| | 合计 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 申万中小 | 0 |
| | 中小板 A | 0 |
| | 中小板 B | 0 |

| | | |
|--|----|---|
| | 合计 | 0 |
|--|----|---|

§10 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 申万中小 | 中小板 A | 中小板 B |
|---------------|----------------|----------------|----------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 149,901,638.53 | 182,020,226.00 | 182,020,226.00 |
| 本报告期基金总申购份额 | 468,449,520.25 | - | - |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 513,702,120.77 | - | - |
| 本报告期基金拆分变动份额 | 1,332,386.06 | 5,027,556.00 | 5,027,556.00 |
| 本报告期期末基金份额总额 | 105,981,424.07 | 187,047,782.00 | 187,047,782.00 |

注：本报告期基金拆分变动份额包含基金份额配对转换及基金份额折算所带来的变动数。

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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，同意外方股东提名的董事由陈志成先生变更为增田义之先生。

4、本报告期内，经本基金管理人股东会决议，根据公司章程相关规定，同意公司总经理来肖贤先生担任公司董事。

5、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。

6、本报告期内，经本基金管理人董事会决议，同意中方股东提名的董事长由姜国芳先生变更为刘郎先生。

7、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。

8、本报告期内，经本基金管理人董事会决议，同意聘任来肖贤先生担任公司总经理职务。

9、本报告期内，经本基金管理人董事会决议，同意聘任张少华先生担任公司副总经理职务。

10、本报告期内，经本基金管理人董事会决议，同意聘任张丽红女士担任公司副总经理职务。

11、本报告期内，根据公司章程相关规定，经公司职工民主选举，同意监事会职工监事由赵鲜女士变更为葛菲斐女士。

12、报告期内本基金基金托管人无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的，与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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。自本基金合同生效以来，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务时间为 5 年。本报告期本基金应支付普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计费 60,000 元。

11.6 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。

11.7 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 | |
| 安信证券 | 1 | 346,060,263.98 | 35.51% | 315,369.33 | 35.51% | - |
| 东方证券 | 1 | 187,382,483.03 | 19.23% | 170,763.37 | 19.23% | - |
| 川财证券 | 1 | 139,836,582.40 | 14.35% | 127,435.54 | 14.35% | - |
| 海通证券 | 1 | 133,672,344.57 | 13.72% | 121,816.63 | 13.72% | - |
| 申万宏源 | 1 | 77,663,003.61 | 7.97% | 70,774.78 | 7.97% | - |
| 广发证券 | 1 | 52,379,309.62 | 5.37% | 47,734.31 | 5.37% | - |

| | | | | | | |
|------|---|---------------|-------|-----------|-------|---|
| 华创证券 | 1 | 37,517,560.01 | 3.85% | 34,190.41 | 3.85% | - |
| 兴业证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 信达证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 联讯证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | 1 | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | 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。

§12 影响投资者决策的其他重要信息

根据深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定及本基金《基金合同》的约定，本基金以 2016 年 5 月 9 日为折算基准日对该日登记在册的的中小板 A 份额、申万中小板份额（包括场内份额与场外份额）办理了定期份额折算业务。对于定期份额折算的方法及相关事宜，详见本基金管理人于 2016 年 5 月 4 日、5 月 10 日、5 月 11 日发布的公告。

申万菱信基金管理有限公司

二〇一七年三月三十日