

申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)

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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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	988,698,869.60 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	郭明
	联系电话	021-23261188	010-66105799
	电子邮箱	service@swsmu.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008808588	95588
传真		021-23261199	010-66105798

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 中国工商银行股份有限公司

§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	212,493,018.28	72,856,345.45	49,994,185.54
本期利润	155,441,720.85	88,583,884.95	36,204,347.49
加权平均基金份额本期利润	0.2621	0.9290	0.2626
本期基金份额净值增长率	5.11%	87.48%	28.36%
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	1.5313	1.2767	0.3576
期末基金资产净值	2,646,036,593.26	628,471,217.04	163,196,667.32
期末基金份额净值	2.676	2.546	1.358

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	2.29%	0.71%	-0.88%	0.74%	3.17%	-0.03%
过去六个月	12.82%	0.75%	2.14%	0.83%	10.68%	-0.08%
过去一年	5.11%	1.59%	-15.74%	1.71%	20.85%	-0.12%
过去三年	152.95%	1.91%	58.39%	1.88%	94.56%	0.03%
过去五年	242.64%	1.72%	83.88%	1.69%	158.76%	0.03%
自基金合同 生效起至今	167.59%	1.67%	38.11%	1.66%	129.48%	0.01%

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：

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

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

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)

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

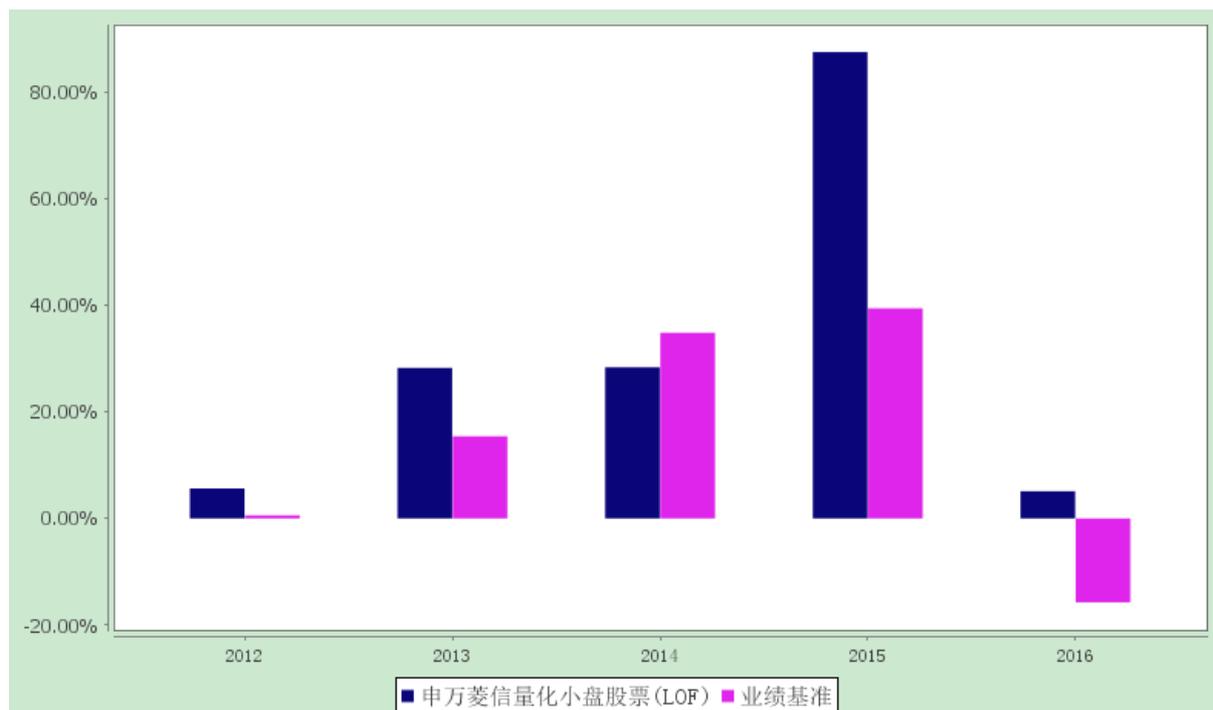
(2011年6月16日至2016年12月31日)



3.2.3 过去五年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

申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)

过去五年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

自基金成立至本报告期末，本基金未进行利润分配。

§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		

金昉毅	本基金基金经理、投资管理总部总监助理兼量化投资部总经理	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等，现任投资管理总部总监助理兼量化投资部总经理，申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)、申万菱信沪深 300 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

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均价差率为 0,我们进行了 95%的置信度、假设均价差率为 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。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,证券市场在经历了开年大幅下跌后逐渐企稳,之后震荡上行,但还是未能收复 2016 年一月的损失,最终沪深 300 指数实现 11.28%的跌幅。从市场结构来看 2016 年中证 500 指数下跌达 17.78%,落后于沪深 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,除此以外在模型中结合不同时期的风格变化进行了各因子权重的改变,从结果来看比较符合全年的行情特征。本基金以全年 5.11%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 年全年中证 500 指数期间表现为-17.78%，基金业绩基准表现为-15.74%，申万菱信量化小盘基金净值期间表现为 5.11%，领先业绩基准 20.85%。

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，经济在 2016 年四季度已经企稳并略有反弹，预计上市公司的盈利将在 2017 年上半年有超预期的表现。然而货币政策宽松的空间较 2016 年明显缩小，甚至边际上有从紧的态势，这对于市场整体估值有压制作用，预计估值很难再有上行空间。财政政策以及改革的措施依然是 2017 年的最大看点。本基金特别关注两点，首先是“供给侧改革”已经影响到 2016 年市场风格的演变，传统周期行业能否在 2017 年继续维持强势值得关注；其次是随着新股发行的加速以及对于再融资政策的收紧，小市值股票能否维持过去三年的强势值得关注。我们预计小市值股票将会有分化，有业绩支撑的小市值甚至中等市值股票将会表现更好。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，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

本基金本报告期末进行利润分配，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。

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 审计报告

普华永道中天审字(2017)第 21794 号

申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)全体基金份额持有人：

我们审计了后附的申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)(以下简称“申万菱信量化小盘基金”)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量化小盘基金 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,上述申万菱信量化小盘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量化小盘基金 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：申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)

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	368,099,846.33	58,206,992.53
结算备付金	8,312,258.27	782,915.83
存出保证金	450,556.30	165,338.30
交易性金融资产	2,261,877,792.32	506,016,363.77
其中：股票投资	2,181,226,792.32	506,016,363.77
基金投资	-	-
债券投资	80,651,000.00	-
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	4,734,330.18	-
应收利息	1,298,787.27	13,127.12
应收股利	-	-
应收申购款	34,170,311.14	130,816,445.62
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,678,943,881.81	696,001,183.17

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	19,817,509.07	64,126,974.28
应付赎回款	4,299,084.87	1,878,141.42
应付管理人报酬	3,396,161.21	457,347.66
应付托管费	566,026.89	76,224.61
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	4,500,021.38	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	328,485.13	279,736.73
负债合计	32,907,288.55	67,529,966.13
所有者权益:	-	-
实收基金	988,698,869.60	246,864,331.77
未分配利润	1,657,337,723.66	381,606,885.27
所有者权益合计	2,646,036,593.26	628,471,217.04
负债和所有者权益总计	2,678,943,881.81	696,001,183.17

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，申万菱信量化小盘股票型证券投资基金份额净值 2.6760 元，基金份额总额 988,698,869.60 份。

7.2 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 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	上年度可比期间 2015年1月1日至2015 年12月31日
一、收入	199,553,953.34	95,277,154.59
1.利息收入	2,257,758.39	212,431.51
其中：存款利息收入	1,641,461.68	212,431.51
债券利息收入	527,312.90	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	88,983.81	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	252,281,196.41	78,667,819.47
其中：股票投资收益	237,405,648.57	76,973,694.17
基金投资收益	-	-
债券投资收益	326,236.56	-
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	14,549,311.28	1,694,125.30
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-57,051,297.43	15,727,539.50
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	2,066,295.97	669,364.11
减：二、费用	44,112,232.49	6,693,269.64
1. 管理人报酬	22,096,799.31	2,960,388.98
2. 托管费	3,682,799.91	493,398.22
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	17,942,656.18	2,913,021.44
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-

6. 其他费用	389,977.09	326,461.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	155,441,720.85	88,583,884.95
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	155,441,720.85	88,583,884.95

7.3 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）	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）	-	155,441,720.85	155,441,720.85
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）	741,834,537.83	1,120,289,117.54	1,862,123,655.37
其中：1.基金申购款	1,410,395,915.64	2,132,747,179.52	3,543,143,095.16
2.基金赎回款	-668,561,377.81	-1,012,458,061.98	-1,681,019,439.79
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）	988,698,869.60	1,657,337,723.66	2,646,036,593.26
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）	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）	-	88,583,884.95	88,583,884.95
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）	126,654,947.03	250,035,717.74	376,690,664.77

其中：1.基金申购款	421,964,147.94	544,775,357.62	966,739,505.56
2.基金赎回款	-295,309,200.91	-294,739,639.88	-590,048,840.79
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）	246,864,331.77	381,606,885.27	628,471,217.04

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《关于核准申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)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《申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)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，《申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)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《申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)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、股指期货、股票期权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。本基金可以参与融资业务。本基金各类资产投资比例为：本基金投资于股票的资产不低于基金资产的 80%，投资于本基金界定的小盘股占非现金基金资产的比例不低于 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约

需缴纳的交易保证金后,应当保持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%。本基金投资股指期货、权证、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。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 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》、《申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)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。

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	3,239,161,874.87	26.15%	227,002,295.33	11.24%

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 12 月 31 日的交易量。

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	2,988,611.02	26.23%	1,115,060.89	24.79%
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	201,537.14	10.98%	3,552.89	0.50%

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 12 月 31 日的佣金。

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	22,096,799.31

其中：支付销售机构的客户维护费	3,721,059.50	953,495.75
-----------------	--------------	------------

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。

7.4.8.2.2 基金托管费

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
当期发生的基金应支付的托管费	3,682,799.91	493,398.22

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。

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自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自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
中国工商银行	368,099,846.33	1,503,297.65	58,206,992.53	192,713.65

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。

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
601375	中原证券	2016-12-20	2017-01-03	新股	4.00	4.00	26,695.00	106,780.00	106,780.00	-
603032	德新交运	2016-12-27	2017-01-05	新股	5.81	5.81	1,628.00	9,458.68	9,458.68	-
603035	常熟汽饰	2016-12-27	2017-01-05	新股	10.44	10.44	2,316.00	24,179.04	24,179.04	-
603186	华正新材	2016-12-26	2017-01-03	新股	5.37	5.37	1,874.00	10,063.38	10,063.38	-
603228	景旺电子	2016-12-28	2017-01-06	新股	23.16	23.16	3,491.00	80,851.56	80,851.56	-
603266	天龙股份	2016-12-30	2017-01-10	新股	14.63	14.63	1,562.00	22,852.06	22,852.06	-
603689	皖天然气	2016-12-30	2017-01-10	新股	7.87	7.87	4,819.00	37,925.53	37,925.53	-
603823	百合花	2016-12-09	2017-12-20	新股 锁定期一年	10.60	32.74	36,764.00	389,698.40	1,203,653.36	-
603877	太平鸟	2016-12-29	2017-01-09	新股	21.30	21.30	3,180.00	67,734.00	67,734.00	-
300583	赛托生物	2016-12-29	2017-01-06	新股	40.29	40.29	1,582.00	63,738.78	63,738.78	-
300586	美联新材	2016-12-26	2017-01-04	新股	9.30	9.30	1,006.00	9,355.80	9,355.80	-
300587	天铁股份	2016-12-28	2017-01-05	新股	14.11	14.11	1,438.00	20,290.18	20,290.18	-
300588	熙菱信息	2016-12-27	2017-01-05	新股	4.94	4.94	1,380.00	6,817.20	6,817.20	-
300591	万里马	2016-12-30	2017-01-10	新股	3.07	3.07	2,397.00	7,358.79	7,358.79	-

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。

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	复牌开盘价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600537	亿晶光电	2016-12-27	重大事项	7.43	2017-01-13	8.17	2,833,846.00	22,046,488.49	21,055,475.78	-
600859	王府井	2016-09-27	重大事项	16.28	-	-	393,542.00	6,580,032.34	6,406,863.76	-
000531	穗恒运A	2016-08-29	重大事项	11.47	2017-01-09	11.80	1,171,797.00	13,487,166.29	13,440,511.59	-
000540	中天城投	2016-11-28	重大事项	6.93	2017-01-03	7.00	3,698,927.00	24,773,663.14	25,633,564.11	-
002440	闰土股份	2016-10-24	重大事项	16.34	2017-01-12	15.22	848,075.00	13,392,599.42	13,857,545.50	-

002491	通鼎互联	2016-12-22	重大事项	15.54	2017-01-03	15.89	1,063,452.00	17,086,722.14	16,526,044.08	-
--------	------	------------	------	-------	------------	-------	--------------	---------------	---------------	---

注：本基金截至 2016 年 12 月 31 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。

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 2,083,839,382.50 元，属于第二层次的余额为 178,038,409.82 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 489,580,911.21 元，第二层次 16,435,452.56 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	2,181,226,792.32	81.42
	其中：股票	2,181,226,792.32	81.42
2	固定收益投资	80,651,000.00	3.01
	其中：债券	80,651,000.00	3.01
	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	376,412,104.60	14.05
7	其他各项资产	40,653,984.89	1.52
8	合计	2,678,943,881.81	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	53,577,060.44	2.02
B	采矿业	26,661,122.36	1.01
C	制造业	1,296,326,804.32	48.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	154,949,736.38	5.86
E	建筑业	15,592.23	0.00
F	批发和零售业	133,595,573.31	5.05
G	交通运输、仓储和邮政业	127,221,270.71	4.81
H	住宿和餐饮业	16,125,032.52	0.61
I	信息传输、软件和信息技术服务业	26,915,934.97	1.02
J	金融业	42,847,854.84	1.62
K	房地产业	254,133,511.19	9.60
L	租赁和商务服务业	6,276,967.20	0.24
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	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	42,580,331.85	1.61
S	综合	-	-
	合计	2,181,226,792.32	82.43

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	000540	中天城投	3,698,927.00	25,633,564.11	0.97

2	000910	大亚圣象	1,144,839.00	21,866,424.90	0.83
3	000926	福星股份	1,709,351.00	21,777,131.74	0.82
4	002271	东方雨虹	999,803.00	21,685,727.07	0.82
5	000900	现代投资	2,668,637.00	21,535,900.59	0.81
6	002234	民和股份	997,936.00	21,535,458.88	0.81
7	002372	伟星新材	1,394,834.00	21,522,288.62	0.81
8	000789	万年青	2,679,936.00	21,519,886.08	0.81
9	000662	天夏智慧	1,010,302.00	21,509,329.58	0.81
10	600335	国机汽车	1,770,123.00	21,506,994.45	0.81

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	000910	大亚圣象	47,518,737.58	7.56
2	000936	华西股份	47,512,071.64	7.56
3	002042	华孚色纺	46,730,485.34	7.44
4	000957	中通客车	46,437,823.97	7.39
5	300258	精锻科技	46,304,803.03	7.37
6	000890	法尔胜	45,940,002.76	7.31
7	002372	伟星新材	44,393,837.17	7.06
8	601199	江南水务	42,746,875.52	6.80
9	002271	东方雨虹	42,450,685.32	6.75
10	002078	太阳纸业	41,076,704.52	6.54
11	000540	中天城投	40,527,463.90	6.45
12	600743	华远地产	40,108,172.03	6.38
13	000501	鄂武商 A	39,327,622.79	6.26
14	002597	金禾实业	39,296,535.68	6.25
15	600409	三友化工	39,179,102.45	6.23
16	000952	广济药业	38,895,003.81	6.19
17	002543	万和电气	38,406,334.75	6.11
18	002157	正邦科技	37,996,898.68	6.05
19	000601	韶能股份	37,835,244.37	6.02
20	600075	新疆天业	37,461,123.01	5.96
21	000811	烟台冰轮	37,361,146.82	5.94
22	300221	银禧科技	37,186,002.66	5.92
23	600657	信达地产	36,182,677.31	5.76
24	600987	航民股份	35,637,916.95	5.67

25	002458	益生股份	35,560,026.96	5.66
26	600790	轻纺城	35,531,867.78	5.65
27	600697	欧亚集团	34,993,236.93	5.57
28	600335	国机汽车	34,829,133.48	5.54
29	002234	民和股份	34,247,024.84	5.45
30	600240	华业资本	33,489,619.50	5.33
31	600132	重庆啤酒	33,487,901.79	5.33
32	601009	南京银行	33,456,970.90	5.32
33	600537	亿晶光电	33,354,033.57	5.31
34	600350	山东高速	33,129,142.86	5.27
35	000900	现代投资	32,576,670.76	5.18
36	000543	皖能电力	32,492,060.00	5.17
37	000671	阳光城	32,282,522.67	5.14
38	600461	洪城水业	32,250,033.05	5.13
39	000786	北新建材	32,202,839.24	5.12
40	600548	深高速	32,090,589.33	5.11
41	000600	建投能源	31,530,053.52	5.02
42	000732	泰禾集团	31,358,659.02	4.99
43	000055	方大集团	31,340,116.63	4.99
44	603311	金海环境	30,640,094.61	4.88
45	600185	格力地产	30,481,352.19	4.85
46	000822	山东海化	30,362,175.46	4.83
47	600507	方大特钢	29,986,573.29	4.77
48	000830	鲁西化工	29,981,697.55	4.77
49	000921	海信科龙	29,953,269.50	4.77
50	600723	首商股份	29,880,816.72	4.75
51	002006	精功科技	29,678,361.23	4.72
52	600644	乐山电力	29,517,586.17	4.70
53	600755	厦门国贸	29,228,360.99	4.65
54	600694	大商股份	29,128,069.37	4.63
55	002440	闰土股份	28,957,021.30	4.61
56	000708	大冶特钢	28,848,992.77	4.59
57	002480	新筑股份	28,808,886.97	4.58
58	002088	鲁阳节能	28,742,672.44	4.57
59	600823	世茂股份	28,674,994.13	4.56
60	000650	仁和药业	28,648,620.49	4.56
61	600176	中国巨石	28,538,295.59	4.54
62	002001	新和成	28,365,346.24	4.51
63	002048	宁波华翔	28,364,863.48	4.51
64	600368	五洲交通	28,244,488.34	4.49
65	600708	光明地产	28,221,798.64	4.49
66	002039	黔源电力	28,171,721.93	4.48
67	600741	华域汽车	28,120,356.46	4.47
68	000488	晨鸣纸业	28,094,057.95	4.47

69	600060	海信电器	28,019,888.13	4.46
70	600064	南京高科	27,831,531.08	4.43
71	002302	西部建设	27,778,821.03	4.42
72	000030	富奥股份	27,771,825.90	4.42
73	600757	长江传媒	27,639,945.25	4.40
74	601929	吉视传媒	27,498,568.96	4.38
75	300118	东方日升	27,357,040.63	4.35
76	600382	广东明珠	27,299,876.44	4.34
77	603188	亚邦股份	27,278,022.48	4.34
78	002142	宁波银行	27,225,367.50	4.33
79	601000	唐山港	27,222,795.17	4.33
80	601126	四方股份	27,091,000.04	4.31
81	300121	阳谷华泰	27,073,375.69	4.31
82	000418	小天鹅A	27,021,516.15	4.30
83	300041	回天新材	26,962,426.79	4.29
84	000059	华锦股份	26,943,018.21	4.29
85	000902	新洋丰	26,941,959.34	4.29
86	600168	武汉控股	26,896,644.12	4.28
87	000926	福星股份	26,817,753.32	4.27
88	600736	苏州高新	26,486,189.42	4.21
89	601107	四川成渝	26,447,975.42	4.21
90	601799	星宇股份	26,430,621.45	4.21
91	002128	露天煤业	26,401,946.05	4.20
92	600004	白云机场	26,159,840.37	4.16
93	002394	联发股份	26,136,945.65	4.16
94	002615	哈尔斯	26,055,184.42	4.15
95	600720	祁连山	26,003,690.66	4.14
96	600469	风神股份	25,927,271.95	4.13
97	002662	京威股份	25,921,759.89	4.12
98	601677	明泰铝业	25,844,384.15	4.11
99	600258	首旅酒店	25,674,150.40	4.09
100	000036	华联控股	25,579,054.78	4.07
101	002091	江苏国泰	25,571,720.27	4.07
102	601636	旗滨集团	25,303,361.00	4.03
103	002083	孚日股份	25,243,797.73	4.02
104	600015	华夏银行	24,977,992.67	3.97
105	600066	宇通客车	24,958,345.54	3.97
106	002477	雏鹰农牧	24,868,657.93	3.96
107	601003	柳钢股份	24,864,672.50	3.96
108	600970	中材国际	24,810,487.54	3.95
109	000789	万年青	24,621,268.32	3.92
110	600487	亨通光电	24,559,141.24	3.91
111	002419	天虹商场	24,551,873.99	3.91
112	000899	赣能股份	24,495,752.55	3.90

113	600883	博闻科技	24,379,279.96	3.88
114	600352	浙江龙盛	24,369,964.52	3.88
115	600068	葛洲坝	24,299,688.95	3.87
116	600693	东百集团	24,132,195.74	3.84
117	600177	雅戈尔	24,121,563.54	3.84
118	600658	电子城	24,082,019.76	3.83
119	000625	长安汽车	23,980,519.17	3.82
120	000876	新希望	23,893,449.44	3.80
121	002087	新野纺织	23,860,408.10	3.80
122	601633	长城汽车	23,665,182.68	3.77
123	002106	莱宝高科	23,506,745.35	3.74
124	002507	涪陵榨菜	23,466,748.20	3.73
125	000662	天夏智慧	23,393,456.22	3.72
126	600153	建发股份	23,212,434.67	3.69
127	601313	江南嘉捷	22,926,222.02	3.65
128	601999	出版传媒	22,818,496.76	3.63
129	000828	东莞控股	22,754,617.74	3.62
130	002116	中国海诚	22,713,083.33	3.61
131	000906	浙商中拓	22,685,855.54	3.61
132	002110	三钢闽光	22,678,940.26	3.61
133	002705	新宝股份	22,547,178.72	3.59
134	601818	光大银行	22,523,879.31	3.58
135	002648	卫星石化	22,512,732.48	3.58
136	601137	博威合金	22,146,626.72	3.52
137	300233	金城医药	22,074,804.22	3.51
138	300479	神思电子	22,063,909.88	3.51
139	600803	新奥股份	22,003,169.54	3.50
140	600183	生益科技	21,859,306.40	3.48
141	002101	广东鸿图	21,840,622.78	3.48
142	600475	华光股份	21,838,190.23	3.47
143	600561	江西长运	21,817,337.34	3.47
144	600026	中远海能	21,804,710.60	3.47
145	000966	长源电力	21,664,743.80	3.45
146	002548	金新农	21,475,312.89	3.42
147	000939	凯迪生态	21,456,683.43	3.41
148	000698	沈阳化工	21,315,646.02	3.39
149	600816	安信信托	21,242,816.24	3.38
150	600477	杭萧钢构	21,092,703.68	3.36
151	600897	厦门空港	21,085,192.79	3.35
152	000597	东北制药	20,844,148.54	3.32
153	002221	东华能源	20,840,779.98	3.32
154	002172	澳洋科技	20,794,762.86	3.31
155	002133	广宇集团	20,759,681.24	3.30
156	600858	银座股份	20,269,333.83	3.23

157	002050	三花智控	19,939,757.90	3.17
158	000965	天保基建	19,579,648.45	3.12
159	000875	吉电股份	19,396,076.24	3.09
160	601169	北京银行	19,192,650.97	3.05
161	300025	华星创业	19,074,102.77	3.04
162	002132	恒星科技	19,004,804.32	3.02
163	600686	金龙汽车	18,711,912.20	2.98
164	300203	聚光科技	18,683,323.70	2.97
165	600683	京投发展	18,550,099.97	2.95
166	002491	通鼎互联	18,522,055.51	2.95
167	002538	司尔特	18,493,332.38	2.94
168	000993	闽东电力	18,413,537.23	2.93
169	300306	远方光电	18,382,751.36	2.92
170	002146	荣盛发展	18,210,766.32	2.90
171	600979	广安爱众	18,199,904.46	2.90
172	600067	冠城大通	18,033,998.92	2.87
173	002045	国光电器	17,909,860.03	2.85
174	002714	牧原股份	17,867,128.55	2.84
175	600027	华电国际	17,793,856.88	2.83
176	002187	广百股份	17,715,618.38	2.82
177	002138	顺络电子	17,442,583.52	2.78
178	300160	秀强股份	17,218,373.75	2.74
179	600522	中天科技	16,972,633.54	2.70
180	000726	鲁泰A	16,968,651.99	2.70
181	600886	国投电力	16,902,292.99	2.69
182	300437	清水源	16,851,742.86	2.68
183	000716	黑芝麻	16,770,573.27	2.67
184	600629	华建集团	16,650,336.44	2.65
185	300040	九洲电气	16,505,089.96	2.63
186	603969	银龙股份	16,502,362.60	2.63
187	002688	金河生物	16,457,757.88	2.62
188	600048	保利地产	16,436,301.84	2.62
189	600273	嘉化能源	16,381,655.14	2.61
190	002479	富春环保	16,371,324.65	2.60
191	601668	中国建筑	16,139,611.83	2.57
192	601328	交通银行	15,924,211.77	2.53
193	600211	西藏药业	15,866,566.31	2.52
194	002264	新华都	15,822,787.00	2.52
195	000679	大连友谊	15,749,286.28	2.51
196	600869	智慧能源	15,739,504.08	2.50
197	600643	爱建集团	15,738,588.52	2.50
198	002321	华英农业	15,676,156.16	2.49
199	600859	王府井	15,633,109.33	2.49
200	603128	华贸物流	15,619,144.50	2.49

201	600104	上汽集团	15,535,906.52	2.47
202	000417	合肥百货	15,517,454.18	2.47
203	002677	浙江美大	15,478,059.51	2.46
204	000581	威孚高科	15,458,125.37	2.46
205	600325	华发股份	15,425,305.00	2.45
206	600847	万里股份	15,403,504.79	2.45
207	000001	平安银行	15,346,016.41	2.44
208	000928	中钢国际	15,144,818.03	2.41
209	300119	瑞普生物	15,140,833.33	2.41
210	000825	太钢不锈	15,074,770.00	2.40
211	600000	浦发银行	14,885,172.16	2.37
212	000035	中国天楹	14,513,511.84	2.31
213	300237	美晨科技	14,319,126.50	2.28
214	600782	新钢股份	14,247,275.19	2.27
215	601339	百隆东方	14,072,335.22	2.24
216	000043	中航地产	13,962,387.55	2.22
217	600595	中孚实业	13,935,251.03	2.22
218	601008	连云港	13,857,540.05	2.20
219	000761	本钢板材	13,836,032.04	2.20
220	600690	青岛海尔	13,832,671.00	2.20
221	000531	穗恒运 A	13,794,811.92	2.19
222	300226	上海钢联	13,630,555.24	2.17
223	601012	隆基股份	13,623,710.54	2.17
224	600239	云南城投	13,580,341.60	2.16
225	300234	开尔新材	13,454,006.54	2.14
226	002275	桂林三金	13,116,459.52	2.09
227	002398	建研集团	13,097,243.25	2.08
228	600863	内蒙华电	13,081,972.00	2.08
229	000667	美好置业	13,060,821.76	2.08
230	002032	苏泊尔	12,969,782.22	2.06
231	600642	申能股份	12,680,984.51	2.02
232	600337	美克家居	12,678,128.21	2.02
233	603001	奥康国际	12,676,596.26	2.02
234	300476	胜宏科技	12,626,854.00	2.01
235	601588	北辰实业	12,608,881.00	2.01

8.4.2 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	600657	信达地产	39,599,225.86	6.30
2	000488	晨鸣纸业	39,117,963.60	6.22

3	600409	三友化工	37,790,189.68	6.01
4	300258	精锻科技	37,450,230.90	5.96
5	000708	大冶特钢	36,911,021.20	5.87
6	600132	重庆啤酒	35,964,203.89	5.72
7	600697	欧亚集团	35,845,518.78	5.70
8	600185	格力地产	34,610,287.38	5.51
9	002078	太阳纸业	33,516,421.97	5.33
10	000786	北新建材	33,498,642.36	5.33
11	000822	山东海化	33,289,004.75	5.30
12	600790	轻纺城	32,508,489.68	5.17
13	000418	小天鹅 A	31,570,373.42	5.02
14	002419	天虹商场	30,234,568.06	4.81
15	000899	赣能股份	29,969,762.31	4.77
16	000910	大亚圣象	29,321,596.23	4.67
17	000936	华西股份	29,106,059.43	4.63
18	600469	风神股份	29,048,922.57	4.62
19	000828	东莞控股	29,024,899.86	4.62
20	600693	东百集团	29,018,703.29	4.62
21	002110	三钢闽光	28,682,328.46	4.56
22	600068	葛洲坝	28,393,753.07	4.52
23	002372	伟星新材	28,355,633.85	4.51
24	601003	柳钢股份	28,216,638.03	4.49
25	000830	鲁西化工	28,154,444.77	4.48
26	002042	华孚色纺	27,854,068.56	4.43
27	000543	皖能电力	27,842,234.12	4.43
28	600897	厦门空港	27,710,601.62	4.41
29	600382	广东明珠	27,418,010.86	4.36
30	002083	孚日股份	27,187,626.06	4.33
31	002662	京威股份	27,128,757.56	4.32
32	000957	中通客车	26,867,353.50	4.28
33	000966	长源电力	26,616,132.26	4.24
34	000059	华锦股份	26,560,983.16	4.23
35	000625	长安汽车	26,498,258.72	4.22
36	600352	浙江龙盛	26,437,308.26	4.21
37	600658	电子城	26,230,153.74	4.17
38	600869	智慧能源	25,833,772.78	4.11
39	600979	广安爱众	25,822,401.61	4.11
40	300041	回天新材	25,733,309.65	4.09
41	000902	新洋丰	25,663,428.38	4.08
42	600548	深高速	25,615,434.18	4.08
43	000890	法尔胜	25,289,000.21	4.02
44	600644	乐山电力	24,771,726.27	3.94
45	601199	江南水务	24,731,110.16	3.94
46	600723	首商股份	24,712,803.41	3.93

47	601799	星宇股份	24,558,889.15	3.91
48	600883	博闻科技	24,308,480.73	3.87
49	002648	卫星石化	24,252,761.00	3.86
50	000501	鄂武商 A	24,238,012.59	3.86
51	600816	安信信托	24,051,246.56	3.83
52	000906	浙商中拓	23,850,903.85	3.80
53	600561	江西长运	23,805,501.60	3.79
54	601137	博威合金	23,775,226.72	3.78
55	600686	金龙汽车	23,750,996.97	3.78
56	002132	恒星科技	23,600,629.76	3.76
57	600858	银座股份	23,407,082.39	3.72
58	300233	金城医药	23,286,098.91	3.71
59	601009	南京银行	23,274,923.64	3.70
60	002440	闰土股份	23,222,174.80	3.70
61	600461	洪城水业	23,142,507.29	3.68
62	000698	沈阳化工	23,127,849.14	3.68
63	002271	东方雨虹	22,902,641.62	3.64
64	000597	东北制药	22,827,537.19	3.63
65	600803	新奥股份	22,724,999.65	3.62
66	600477	杭萧钢构	22,634,199.41	3.60
67	002116	中国海诚	22,614,279.13	3.60
68	600026	中远海能	22,602,751.43	3.60
69	601313	江南嘉捷	22,585,825.86	3.59
70	002133	广宇集团	22,406,702.07	3.57
71	002302	西部建设	22,141,505.32	3.52
72	002142	宁波银行	21,583,639.52	3.43
73	002187	广百股份	21,505,168.22	3.42
74	300479	神思电子	21,392,720.22	3.40
75	002548	金新农	21,340,897.02	3.40
76	600176	中国巨石	21,241,702.24	3.38
77	601818	光大银行	21,154,008.45	3.37
78	600743	华远地产	20,811,770.02	3.31
79	300118	东方日升	20,768,789.15	3.30
80	601169	北京银行	20,745,856.11	3.30
81	002157	正邦科技	20,643,090.97	3.28
82	300237	美晨科技	20,640,480.83	3.28
83	000875	吉电股份	20,434,724.47	3.25
84	300025	华星创业	20,188,163.18	3.21
85	000939	凯迪生态	19,898,274.15	3.17
86	601668	中国建筑	19,826,437.71	3.15
87	600027	华电国际	19,765,406.65	3.14
88	002597	金禾实业	19,595,620.67	3.12
89	600104	上汽集团	19,494,826.88	3.10
90	600694	大商股份	19,015,146.10	3.03

91	600886	国投电力	18,953,753.16	3.02
92	300221	银禧科技	18,903,149.66	3.01
93	600487	亨通光电	18,874,298.34	3.00
94	000679	大连友谊	18,770,419.48	2.99
95	600048	保利地产	18,765,805.57	2.99
96	002101	广东鸿图	18,726,643.15	2.98
97	002479	富春环保	18,713,075.02	2.98
98	002087	新野纺织	18,684,368.97	2.97
99	600015	华夏银行	18,601,012.50	2.96
100	002264	新华都	18,593,625.03	2.96
101	601339	百隆东方	18,550,007.72	2.95
102	600067	冠城大通	18,523,478.00	2.95
103	603128	华贸物流	18,471,035.18	2.94
104	600239	云南城投	18,428,072.36	2.93
105	002138	顺络电子	18,337,644.08	2.92
106	000726	鲁泰A	18,277,244.18	2.91
107	300121	阳谷华泰	18,246,351.31	2.90
108	002714	牧原股份	18,240,662.12	2.90
109	002538	司尔特	18,225,919.57	2.90
110	300160	秀强股份	18,130,662.45	2.88
111	600683	京投发展	18,119,927.51	2.88
112	600987	航民股份	17,968,787.20	2.86
113	600075	新疆天业	17,876,219.61	2.84
114	000716	黑芝麻	17,771,382.02	2.83
115	600847	万里股份	17,701,673.21	2.82
116	000952	广济药业	17,681,236.36	2.81
117	600177	雅戈尔	17,586,525.85	2.80
118	600475	华光股份	17,468,633.43	2.78
119	002543	万和电气	17,455,445.72	2.78
120	601678	滨化股份	17,427,775.85	2.77
121	000001	平安银行	17,401,276.48	2.77
122	002032	苏泊尔	17,280,914.17	2.75
123	002045	国光电器	17,250,349.03	2.74
124	600168	武汉控股	17,199,741.11	2.74
125	600273	嘉化能源	16,966,686.43	2.70
126	601328	交通银行	16,948,758.99	2.70
127	600629	华建集团	16,931,946.65	2.69
128	000811	烟台冰轮	16,931,455.63	2.69
129	002677	浙江美大	16,897,145.37	2.69
130	000035	中国天楹	16,796,679.46	2.67
131	000900	现代投资	16,791,279.77	2.67
132	000928	中钢国际	16,763,395.87	2.67
133	000825	太钢不锈	16,719,437.77	2.66
134	601636	旗滨集团	16,713,509.47	2.66

135	000043	中航地产	16,671,535.39	2.65
136	600325	华发股份	16,551,495.21	2.63
137	600350	山东高速	16,525,236.11	2.63
138	000417	合肥百货	16,504,441.34	2.63
139	600335	国机汽车	16,388,576.73	2.61
140	000540	中天城投	16,379,951.05	2.61
141	603311	金海环境	16,264,725.76	2.59
142	600782	新钢股份	16,117,080.48	2.56
143	002221	东华能源	15,997,604.55	2.55
144	600240	华业资本	15,782,809.68	2.51
145	600970	中材国际	15,623,241.60	2.49
146	002001	新 和 成	15,616,972.10	2.48
147	002088	鲁阳节能	15,511,985.66	2.47
148	002688	金河生物	15,415,812.75	2.45
149	000421	南京公用	15,385,360.53	2.45
150	300234	开尔新材	15,030,718.44	2.39
151	600211	西藏药业	14,777,597.75	2.35
152	600000	浦发银行	14,776,545.72	2.35
153	000813	德展健康	14,756,882.07	2.35
154	000601	韶能股份	14,696,600.72	2.34
155	600651	飞乐音响	14,690,505.13	2.34
156	002321	华英农业	14,469,507.39	2.30
157	601677	明泰铝业	14,314,774.47	2.28
158	300476	胜宏科技	14,282,867.56	2.27
159	000703	恒逸石化	14,274,065.37	2.27
160	600642	申能股份	14,234,525.13	2.26
161	002091	江苏国泰	14,182,982.59	2.26
162	601012	隆基股份	14,114,888.91	2.25
163	002671	龙泉股份	14,107,562.43	2.24
164	000498	山东路桥	14,070,314.99	2.24
165	601008	连云港	14,036,606.40	2.23
166	000671	阳 光 城	14,033,956.23	2.23
167	600736	苏州高新	14,023,665.91	2.23
168	002275	桂林三金	14,003,660.18	2.23
169	600129	太极集团	13,903,120.79	2.21
170	002305	南国置业	13,891,159.31	2.21
171	002146	荣盛发展	13,857,474.73	2.20
172	600690	青岛海尔	13,782,099.24	2.19
173	600595	中孚实业	13,624,531.66	2.17
174	002477	雏鹰农牧	13,616,820.21	2.17
175	601233	桐昆股份	13,568,727.50	2.16
176	600033	福建高速	13,535,313.37	2.15
177	601166	兴业银行	13,401,324.34	2.13
178	300342	天银机电	13,331,825.38	2.12

179	300226	上海钢联	13,184,127.13	2.10
180	600742	一汽富维	13,104,642.85	2.09
181	600780	通宝能源	13,022,602.45	2.07
182	300144	宋城演艺	13,012,976.43	2.07
183	600426	华鲁恒升	12,986,484.42	2.07
184	000916	华北高速	12,775,390.48	2.03
185	002398	建研集团	12,726,175.82	2.02
186	300204	舒泰神	12,656,812.99	2.01
187	603001	奥康国际	12,638,487.15	2.01

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	6,945,406,913.45
卖出股票的收入（成交）总额	5,451,179,336.04

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	80,651,000.00	3.05
	其中：政策性金融债	80,651,000.00	3.05
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	80,651,000.00	3.05

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	140220	14 国开 20	500,000.00	50,420,000.00	1.91
2	140225	14 国开 25	300,000.00	30,231,000.00	1.14

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**

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

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**

根据本基金基金合同，本基金不得参与国债期货交易。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据本基金基金合同，本基金不得参与国债期货交易。

8.11.3 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。

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，或在报告编制日前

一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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	450,556.30
2	应收证券清算款	4,734,330.18
3	应收股利	-
4	应收利息	1,298,787.27
5	应收申购款	34,170,311.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	40,653,984.89

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

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	000540	中天城投	25,633,564.11	0.97	重大事项

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

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
54,736	18,063.05	574,264,297.97	58.08%	414,434,571.63	41.92%

9.2 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	张鸣达	4,912,900.00	10.79%
2	秦建英	1,793,600.00	3.94%
3	张科	1,005,956.00	2.21%
4	吴宪光	819,300.00	1.80%
5	葛晓涛	730,002.00	1.60%
6	李金城	630,843.00	1.39%
7	蓝宇翔	505,824.00	1.11%
8	李庆发	504,909.00	1.11%
9	陈翠芳	487,829.00	1.07%
10	缪文	457,900.00	1.01%

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	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	799,969.96	0.08%

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	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	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§10 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	1,410,395,915.64
减：本报告期基金总赎回份额	668,561,377.81
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	988,698,869.60

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内,本基金以通讯方式、网络方式召开了申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会,并于2016年12月9日表决通过了《关于修订申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)基金合同的议案》,变更了本基金的投资范围、投资比例、投资策略、投资限制及其他相关事项。

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

本报告期内，本基金管理人对本基金的投资策略进行了调整，增加了股指期货投资策略、资产支持证券投资策略、融资业务投资策略、股票期权投资策略、其他金融衍生工具投资策略。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，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6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100,000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	
申万宏源	3	3,239,161,874.87	26.15%	2,988,611.02	26.23%	-
光大证券	1	1,067,937,908.79	8.62%	973,216.58	8.54%	-
华信证券	1	1,006,132,597.30	8.12%	916,890.57	8.05%	-
海通证券	2	996,430,227.07	8.04%	916,757.75	8.05%	-
国金证券	2	763,567,498.64	6.16%	707,334.96	6.21%	-
中信证券	1	707,506,924.93	5.71%	644,752.28	5.66%	-
国泰君安	2	407,614,279.84	3.29%	376,619.25	3.31%	-
东方证券	1	398,276,484.47	3.22%	362,951.82	3.19%	新增
华创证券	1	386,238,091.11	3.12%	359,704.79	3.16%	-
西部证券	2	377,731,209.31	3.05%	349,250.20	3.07%	-
长江证券	1	337,468,869.37	2.72%	314,285.30	2.76%	-
东北证券	1	334,578,817.57	2.70%	311,595.88	2.74%	新增
天风证券	2	328,271,139.11	2.65%	302,106.86	2.65%	-
方正证券	1	287,409,437.39	2.32%	267,665.56	2.35%	-

银河证券	1	266,779,765.46	2.15%	243,116.95	2.13%	-
广州证券	1	260,873,567.66	2.11%	237,734.94	2.09%	-
招商证券	2	233,564,717.56	1.89%	217,517.35	1.91%	-
中金公司	1	186,793,624.19	1.51%	170,225.69	1.49%	-
平安证券	1	183,755,069.87	1.48%	167,456.31	1.47%	-
中信建投	1	154,918,742.69	1.25%	144,276.03	1.27%	-
国信证券	1	89,008,058.52	0.72%	81,113.46	0.71%	-
兴业证券	1	81,926,822.35	0.66%	74,660.72	0.66%	新增
广发证券	1	68,275,119.81	0.55%	62,219.22	0.55%	-
华泰证券	1	64,280,403.34	0.52%	58,579.01	0.51%	-
东兴证券	1	53,371,261.58	0.43%	48,637.23	0.43%	-
中银国际	1	52,289,095.09	0.42%	47,650.82	0.42%	新增
中泰证券	2	51,860,770.34	0.42%	47,261.35	0.41%	-
五矿证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	2	-	-	-	-	新增
民生证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
北京高华	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	2	-	-	-	-	-

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

为维护基金份额持有人利益，提高产品的市场竞争力，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和本基金基金合同的有关规定，本基金在本报告期内以通讯方式、网络方式召开了申万菱信量化小盘股票型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会，并于2016年12月9日表决通过了《关于修订申万菱信量化小盘股票型证券投资基金（LOF）基金合同的议案》，变更了本基金的投资范围、投资比例、投资策略、投资限制及其他相关事项。对于基金份额持有人大会的相关事宜，详见本基金管理人于2016年9月30日、10月10日、10月11日、12月9日、12月12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