

# 申万菱信中小板指数证券投资基金(LOF)

## 2018年半年度报告(摘要)

### 2018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：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年八月二十七日

## 1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	申万菱信中小板指数(LOF)
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	2017年5月9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	138,804,617.27份
基金合同存续期	不定期

### 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
风险收益特征	本基金具有预期风险较高、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。

### 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	贺倩
	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

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.swsmu.com">http://www.swsmu.com</a>
----------------------	---

基金半年度报告备置地点	申万菱信基金管理有限公司 中国农业银行股份有限公司
-------------	------------------------------

### 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年1月1日至2018年6月30日)
本期已实现收益	-1,596,736.70
本期利润	-17,824,727.26
加权平均基金份额本期利润	-0.1520
本期加权平均净值利润率	-13.86%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0538
期末基金资产净值	137,059,564.87
期末基金份额净值	0.9874

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	-7.87%	1.67%	-8.30%	1.63%	0.43%	0.04%
过去三个月	-11.76%	1.33%	-12.34%	1.30%	0.58%	0.03%
过去六个月	-12.96%	1.36%	-13.53%	1.37%	0.57%	-0.01%
过去一年	-6.90%	1.16%	-6.30%	1.17%	-0.60%	-0.01%
自基金合同生效起至今	1.48%	1.12%	1.14%	1.13%	0.34%	-0.01%

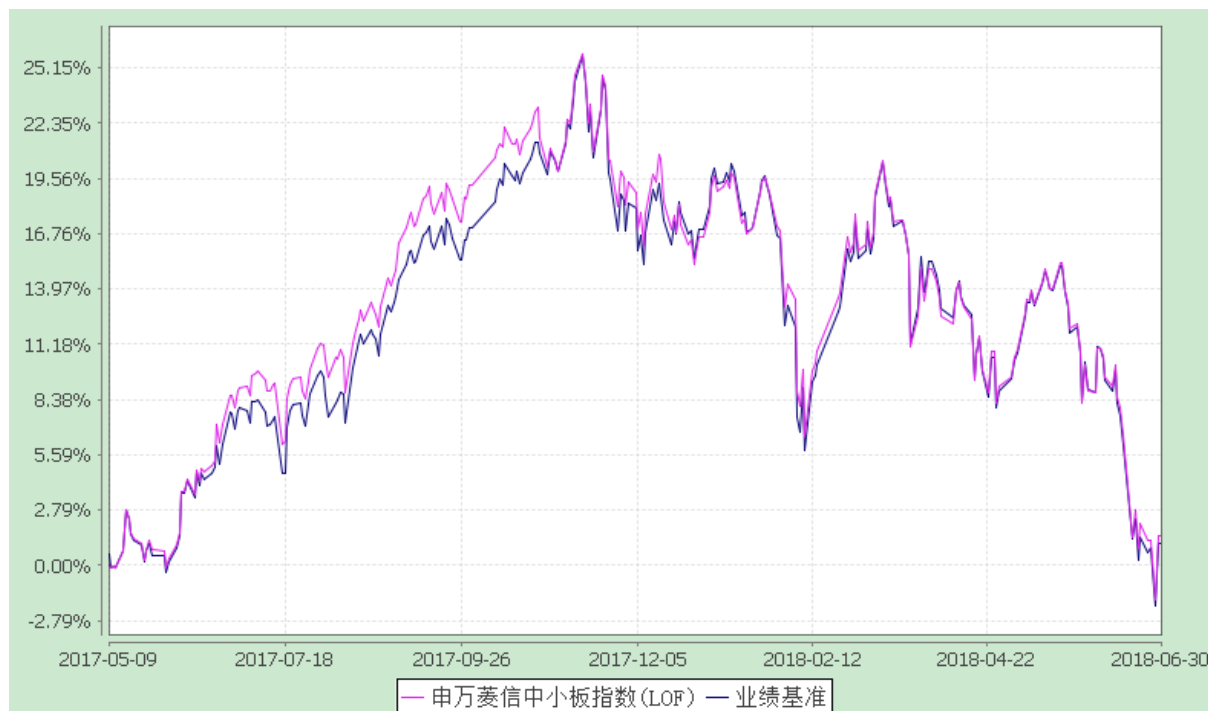
注：本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，计算方式如下： $\text{benchmark}(0) = 1000$ ； $\% \text{benchmark}(t) = 95\% * (\text{中小板指数}(t) / \text{中小板指数}(t-1) - 1) + 5\% * \text{银行同业存款利率(税后)} / 365$ ； $\text{benchmark}(t) = (1 + \% \text{benchmark}(t)) * \text{benchmark}(t-1)$ ；其中  $t=1,2,3,\dots$ 。

### 3.2.2 自基金转型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

(2017 年 5 月 9 日至 2018 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 2018 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 37 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 225 亿元，客户数超过 627 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	说明
----	----	----------------------	----------	----

		任职日期	离任日期	年限	
袁英杰	本基金 基金经 理	2015-01-30	-	11 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 05 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，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、申万菱信深证成指分级证券投资基金、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、申万菱信中证申万新兴健康产业主题投资指数证券投资基金(LOF)、申万菱信臻选 6 个月定期开放混合型证券投资基金、申万菱信智选一年期定期开放混合型证券投资基金基金经理，现任申万菱信中小板指数证券投资基金 (LOF)、申万菱信沪深 300 指数增强型证券投资基金、申万菱信中证 500 指数优选增强型证券投资基金、申万菱信中证 500 指数增强型证券投资基金、申万菱信价值优利混合型证券投资基金、申万菱信价值优先混合型证券投资基金、申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)基金经理。
俞诚	本基金 基金经 理	2015-12-03	-	8 年	俞诚先生，经济学学士。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，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基金经理，现任申万菱信中小板指数证券投资基金 (LOF)、申万菱信中证 500 指数增强型证券投资基金、申万菱信价值优享混合型证券投资基金基金经理。
龚丽丽	本基金 基金经 理	2017-12-26	-	7 年	龚丽丽女士，硕士研究生。2011 年起从事金融相关工作，曾任华泰柏瑞基金研究员、专户经理、基金经理等。2017 年 08 月加入申

					万菱信基金管理有限公司, 现任申万菱信中小板指数证券投资基金(LOF)、申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金、申万菱信深证成指分级证券投资基金、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《公平交易办法》, 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部，实行了集中交易制度和公平的交易分配制度：（1）对于交易所公开竞价的同向交易，内部制定了专门的交易规则，保证各投资组合获得公平的交易执行机会；（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。

在日常监控和事后分析评估方面，本公司风险管理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。

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《异常交易监控与报告办法》，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

2018 年上半年市场风险加大，整体呈震荡下调走势。其中，上证综指下跌 13.90%，深成指下跌 15.04%。一季度市场结构性轮动机会明显，宽基指数中以上证 50 指数和创业板指为典型代表：一月



上证 50 指数上涨 8.96%，创业板下跌 1%；二、三月创业板指大幅上涨接近 10%，而上证 50 指数反跌 12.66%。二季度受到贸易摩擦和国内金融去杠杆政策双重影响，市场整体下调。其中，沪深 300 指数下跌 9.94%，中证 500 指数下跌 14.67%，中证 1000 指数下跌 17.51%。

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。

作为被动投资的基金产品，申万菱信中小板指数证券投资基金(LOF)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。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2018 年上半年中小板指期间表现为-14.26%，基金业绩基准表现为-13.53%，申万菱信中小板指数证券投资基金(LOF)净值期间表现为-12.96%，领先业绩基准 0.57%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

截止 2018 年二季度底，上证综指市盈率和市净率分别为 12.46、1.44，市场估值已回归至 2016 年 A 股实施熔断机制后水平。考虑到上市公司的盈利抬升，当前 A 股权益类资产性价比更优。从宏观环境来看，外部风险贸易摩擦已经不是市场主要风险因素，市场更多受到投资者对于 1) 金融去杠杆大背景下，信用进一步收紧；2) 经济不景气两个方面担忧的影响。

短期来看，当前 A 股系统性风险得到较充分释放。虽然大趋势拐点难现，但如果以下几个方面出现边际改善，有利于市场情绪好转，从而带来反弹。一是中美贸易摩擦不再升级，甚至可能出现实际落地不如前期悲观；二是为对冲宏观风险，“紧信用，严监管”政策有望出现缓和。

投资线索上，一方面，前期估值调整较为充分的板块；另一方面，盈利具有一定确定性，且信用风险低的板块，如受益于行业集中度提升，具有资源优势的行业龙头公司。

#### 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分管基金运营的副总经理，督察长，分管基金投资的副总经理，基金运营部、监察稽核部、风险管理部负责人组成。其中，分管基金运营的副总经理张丽红女士，拥有 14 年的基金行业运营、财务管理相关经验；督察长王菲萍女士，拥有 14 年的基金行业合规管理经验；分管基金投资的副总经理张少华先生，拥有 14 年的基金行业研究、投资和风险管理相关经验；基金运营部总监李濮君女士，拥有 17 年的基金会计经验；监察稽核部负责人赵鹏先生，拥有 4 年的证券基金行业合规管理经验；风险管理部总监王瑾怡女士，拥有 13 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

在托管本基金的过程中，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基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—申万菱信基金管理有限公司 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 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本基金的投资运作、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本基金半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,未发现有关基金持有人利益的行为。

## 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:申万菱信中小板指数证券投资基金(LOF)

报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
<b>资产:</b>	-	-
银行存款	12,180,583.15	9,620,319.71
结算备付金	47,426.10	-
存出保证金	12,345.37	71,959.33
交易性金融资产	124,876,986.14	120,153,992.36
其中:股票投资	124,876,986.14	119,918,909.24
基金投资	-	-
债券投资	-	235,083.12
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	447,543.38	-
应收利息	2,290.47	2,375.31
应收股利	-	-
应收申购款	445,911.71	269,237.01
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
<b>资产总计</b>	<b>138,013,086.32</b>	<b>130,117,883.72</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2018年6月30日</b>	<b>上年度末 2017年12月31日</b>
<b>负债:</b>	-	-
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	-	1,330,975.77
应付赎回款	691,881.28	213,468.45
应付管理人报酬	73,268.67	67,914.04
应付托管费	13,526.50	12,537.99
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	35,204.08	56,725.98
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	139,640.92	303,810.59
<b>负债合计</b>	<b>953,521.45</b>	<b>1,985,432.82</b>
<b>所有者权益：</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
实收基金	102,287,563.21	83,234,944.13
未分配利润	34,772,001.66	44,897,506.77
<b>所有者权益合计</b>	<b>137,059,564.87</b>	<b>128,132,450.90</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>138,013,086.32</b>	<b>130,117,883.72</b>

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9874 元，基金份额总额 138,804,617.27 份。

## 6.2 利润表

会计主体：申万菱信中小板指数证券投资基金(LOF)

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018 年6月30日	上年度可比期间 2017年5月9日（基金 合同生效日）至2017年 6月30日
<b>一、收入</b>	<b>-17,117,114.68</b>	<b>19,278,492.85</b>
1.利息收入	37,368.74	22,977.41
其中：存款利息收入	37,356.39	22,977.41
债券利息收入	12.35	-
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）	-966,292.39	-17,326,564.58
其中：股票投资收益	-1,708,626.64	-18,702,519.26
基金投资收益	-	-
债券投资收益	23,393.68	-
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	718,940.57	1,375,954.68
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-16,227,990.56	36,364,768.76
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	39,799.53	217,311.26
<b>减:二、费用</b>	<b>707,612.58</b>	<b>661,849.93</b>
1. 管理人报酬	413,010.10	239,906.80
2. 托管费	76,248.03	44,596.98
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	73,723.60	326,747.42
5. 利息支出	-	-
其中: 卖出回购金融资产支出	-	-
6.税金及附加	-	-
7. 其他费用	144,630.85	50,598.73
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>	<b>-17,824,727.26</b>	<b>18,616,642.92</b>
减: 所得税费用	-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>	<b>-17,824,727.26</b>	<b>18,616,642.92</b>

注: 本基金分级运作终止日为2017年5月8日, 上年度可比期间为2017年5月9日(基金转型日)至2017年6月30日。

### 6.3 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证券投资基金(LOF)

本报告期: 2018年1月1日至2018年6月30日

单位: 人民币元

项目	本期		
	2018年1月1日至2018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)	83,234,944.13	44,897,506.77	128,132,450.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-17,824,727.26	-17,824,727.26
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)	19,052,619.08	7,699,222.15	26,751,841.23
其中: 1.基金申购款	39,889,571.18	18,471,966.59	58,361,537.77
2.基金赎回款	-20,836,952.10	-10,772,744.44	-31,609,696.54
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)	102,287,563.21	34,772,001.66	137,059,564.87
项目	上年度可比期间		
	2017年5月9日(基金合同生效日)至2017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)	239,461,306.04	76,719,657.85	316,180,963.89

二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	18,616,642.92	18,616,642.92
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)	-125,751,311.47	-45,395,399.54	-171,146,711.01
其中：1.基金申购款	2,111,730.60	784,813.25	2,896,543.85
2.基金赎回款	-127,863,042.07	-46,180,212.79	-174,043,254.86
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)	113,709,994.57	49,940,901.23	163,650,895.80

注：本基金分级运作终止日为 2017 年 5 月 8 日，上年度可比期间为 2017 年 5 月 9 日（基金转型日）至 2017 年 6 月 30 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1.1 至 6.1.4，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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

申万菱信中小板指数证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)是由申万菱信中小板指数分级证券投资基金转型而来。根据《申万菱信中小板指数分级证券投资基金基金合同》，原申万菱信中小板指数分级证券投资基金为契约型基金，基金合同生效后 5 年期届满。根据《关于申万菱信中小板指数分级证券投资基金分级运作到期基金转换结果的公告》，原申万菱信中小板指数分级证券投资基金于 2017 年 5 月 8 日(基金份额转换基准日)日终，自动转换为上市开放式基金(LOF)，基金名称变更为“申万菱信中小板指数证券投资基金(LOF)”。本基金为契约型开放式基金，存续期间不定。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。本基金基金份额到期折算基准日日终(即 2017 年 5 月 8 日)(即 2017 年 5 月 8 日)，中小板 A 转换前份额数 111,945,818.00 份，转换比例为 1.079136691，转换后对应的份额申万菱信中小板指数证券投资基金(LOF) (LOF) 120,804,839.00 份；中小板 B 转换前份额数 111,945,818.00 份，转换比例为 0.920863309，转换后对应的份额申万菱信中小板指数证券投资基金(LOF) (LOF) 103,086,796.00 份。本基金管理人已根据本基金《基金合同》约定，对中小板 A、中小板 B 的份额持有人的基金份额进行了计算，并由本基金管理人向中国证券登记结算有限责任公

司提交份额变更登记申请。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2017]325号核准,本基金申万菱信中小板指数(LOF)份额 201,492,154.00 份(截至 2017 年 5 月 19 日)于 2017 年 5 月 26 日在深交所挂牌交易。

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 $\times$ 95%+银行同业存款利率 $\times$ 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 2018 年 8 月 24 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证券投资基金(LOF)基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年 01 月 01 日至 2018 年 6 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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年 01 月 01 日至 2018 年 6 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

本报告期所采用的会计政策、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[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》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 6.4.7 关联方关系

### 6.4.7.1 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。

#### 6.4.7.2 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
中国农业银行股份有限公司	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。

#### 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年5月9日(基金合同生效日)至2017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	6,261,295.07	11.08%	105,199,054.78	62.85%

##### 6.4.8.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018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	5,705.58	11.08%	1,451.05	4.12%
关联方名称	上年度可比期间 2017年5月9日(基金合同生效日)至2017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	95,869.33	62.85%	95,869.33	48.41%

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

务等。

## 6.4.8.2 关联方报酬

### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月 30日	上年度可比期间 2017年5月9日（基金合同生 效日）至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	413,010.10	239,906.80
其中：支付销售机构的客户维护费	92,835.23	16,064.72

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.65% 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\*0.65%/当年天数。

### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月 30日	上年度可比期间 2017年5月9日（基金合同生 效日）至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	76,248.03	44,596.98

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.12% 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\*0.12%/当年天数。

### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.8.4.1 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。

#### 6.4.8.4.2 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投资本基金。

### 6.4.8.5 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 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年5月9日（基金合同生效日） 至2017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
中国农业银行	12,180,583.15	36,579.38	11,992,501.02	22,786.75

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。

#### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.8.7.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

##### 6.4.8.7.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

无。

#### 6.4.9 期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限的证券。

##### 6.4.9.2 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
002075	沙钢股份	2016-09-19	重大事项	19.14	-	-	256,809.00	3,664,999.65	4,915,324.26	-
002450	康得新	2018-06-04	重大事项	17.08	-	-	151,306.00	2,681,958.78	2,584,306.48	-
002252	上海莱士	2018-02-23	重大事项	21.47	-	-	77,640.00	1,691,207.26	1,666,930.80	-
002739	万达电影	2017-07-04	重大事项	38.03	-	-	39,330.00	3,383,101.95	1,495,719.90	-
002310	东方园林	2018-05-25	重大事项	15.03	-	-	87,175.00	1,218,362.63	1,310,240.25	-
002573	清新环境	2018-06-19	重大事项	11.55	-	-	43,851.00	843,702.25	506,479.05	-
002426	胜利精密	2018-06-19	重大事项	3.60	2018-07-03	3.26	131,230.00	982,934.99	472,428.00	-
002411	必康股份	2018-06-19	重大事项	28.34	-	-	15,900.00	460,869.01	450,606.00	-
002051	中工国际	2018-04-09	重大事项	12.76	-	-	28,149.00	486,914.24	359,181.24	-
002431	棕榈股份	2018-05-30	重大事项	6.71	-	-	53,500.00	424,087.01	358,985.00	-

注：本基金截至2018年6月30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。

##### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

**6.4.10 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 2018 年 6 月 30 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 110,756,785.16

元，属于第二层次的余额为 14,120,200.98 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 2018 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

**(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) 增值税**

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税

有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

此外，财政部、国家税务总局于2017年12月25日颁布的财税[2017]90号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自2018年1月1日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

(3) 除公允价值和增值税外，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	124,876,986.14	90.48
	其中：股票	124,876,986.14	90.48
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	12,228,009.25	8.86
8	其他各项资产	908,090.93	0.66
9	合计	138,013,086.32	100.00

注：本基金未开通港股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	1,120,392.00	0.82
B	采矿业	-	-

C	制造业	85,356,378.39	62.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	3,033,558.49	2.21
F	批发和零售业	3,824,502.28	2.79
G	交通运输、仓储和邮政业	1,190,680.00	0.87
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,624,811.33	9.21
J	金融业	7,362,372.26	5.37
K	房地产业	1,624,480.83	1.19
L	租赁和商务服务业	4,425,631.61	3.23
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	506,479.05	0.37
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,311,980.00	1.69
R	文化、体育和娱乐业	1,495,719.90	1.09
S	综合	-	-
	合计	124,876,986.14	91.11

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金未开通港股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	246,851.00	9,165,577.63	6.69
2	002304	洋河股份	41,001.00	5,395,731.60	3.94
3	002075	沙钢股份	256,809.00	4,915,324.26	3.59
4	002027	分众传媒	386,373.00	3,697,589.61	2.70
5	002230	科大讯飞	112,340.00	3,602,743.80	2.63
6	002024	苏宁易购	253,516.00	3,569,505.28	2.60
7	002008	大族激光	64,732.00	3,443,095.08	2.51
8	002475	立讯精密	132,465.00	2,985,761.10	2.18
9	002594	比亚迪	61,180.00	2,917,062.40	2.13

10	002142	宁波银行	178,399.00	2,906,119.71	2.12
----	--------	------	------------	--------------	------

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半年度报告正文。

## 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	002415	海康威视	2,901,870.00	2.26
2	002304	洋河股份	1,517,047.00	1.18
3	002230	科大讯飞	1,176,806.00	0.92
4	002027	分众传媒	1,162,595.00	0.91
5	002024	苏宁易购	1,056,323.00	0.82
6	002142	宁波银行	1,054,973.87	0.82
7	002008	大族激光	1,003,946.00	0.78
8	002594	比亚迪	938,458.84	0.73
9	002475	立讯精密	902,685.00	0.70
10	002271	东方雨虹	902,524.60	0.70
11	002466	天齐锂业	860,248.02	0.67
12	002236	大华股份	831,330.00	0.65
13	002456	欧菲科技	764,675.00	0.60
14	002384	东山精密	734,739.00	0.57
15	002202	金风科技	725,270.10	0.57
16	002044	美年健康	724,286.42	0.57
17	002460	赣锋锂业	637,384.00	0.50
18	002450	康得新	628,126.00	0.49
19	002736	国信证券	588,545.00	0.46
20	002422	科伦药业	551,417.00	0.43

### 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	002168	深圳惠程	1,999,876.00	1.56
2	002415	海康威视	833,203.00	0.65
3	002030	达安基因	644,199.87	0.50
4	002353	杰瑞股份	600,912.34	0.47
5	002399	海普瑞	574,852.65	0.45
6	002701	奥瑞金	548,180.16	0.43
7	002299	圣农发展	512,607.95	0.40

8	002004	华邦健康	489,538.24	0.38
9	002108	沧州明珠	397,363.12	0.31
10	002400	省广集团	369,257.88	0.29
11	002304	洋河股份	359,906.00	0.28
12	002024	苏宁易购	357,460.00	0.28
13	002450	康得新	277,139.00	0.22
14	002594	比亚迪	264,506.00	0.21
15	002008	大族激光	261,848.00	0.20
16	002276	万马股份	261,013.15	0.20
17	002230	科大讯飞	258,595.00	0.20
18	002456	欧菲科技	243,190.00	0.19
19	002925	盈趣科技	230,731.20	0.18
20	002142	宁波银行	227,530.04	0.18

#### 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	40,102,443.76
卖出股票的收入（成交）总额	17,207,732.78

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**

本基金本报告期末未持有股指期货。

**7.10.2 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。

**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**

本基金本报告期末未投资国债期货交易。

**7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未投资国债期货交易。

**7.11.3 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。

**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	12,345.37
2	应收证券清算款	447,543.38
3	应收股利	-
4	应收利息	2,290.47
5	应收申购款	445,911.71
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	908,090.93

**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	002075	沙钢股份	4,915,324.26	3.59	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
13,826	10,039.39	1,943,326.81	1.40%	136,861,290.46	98.60%

**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	叶宁	3,761,797.00	7.48%
2	郭少华	1,218,083.00	2.42%
3	建信人寿保险-传统保险产品	924,837.00	1.84%
4	罗涛	817,713.00	1.63%
5	陈天和	719,625.00	1.43%
6	万山	620,000.00	1.23%
7	刘桂凤	460,432.00	0.92%
8	吴伟军	414,388.00	0.82%
9	戚玉芳	408,830.00	0.81%
10	辛维举	402,907.00	0.80%

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	175.31	0.00%

**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 研究部门负责人持有本开放式基金	0
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	112,950,221.91
本报告期基金总申购份额	54,130,374.82
减:本报告期基金总赎回份额	28,275,979.46
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	138,804,617.27

**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监事由杉崎干雄先生变更为糠信英树先生。

2、本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

**10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

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。

**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 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。

**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**

报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

## 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	
海通证券	1	16,125,214.33	28.54%	14,695.09	28.54%	-
天风证券	1	10,712,133.85	18.96%	9,762.14	18.96%	新增
中金公司	1	10,011,196.10	17.72%	9,123.31	17.72%	-
广发证券	1	8,180,089.81	14.48%	7,454.44	14.48%	-
申万宏源	1	6,261,295.07	11.08%	5,705.58	11.08%	-
安信证券	1	3,645,683.75	6.45%	3,322.35	6.45%	-
招商证券	1	1,565,786.00	2.77%	1,427.14	2.77%	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
华创证券	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。

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

根据中国证监会2017年8月31日发布的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》,对已经成立的开放式基金,原基金合同内容不符合《管理规定》的,应当在《管理规定》施行之日起6个月内,修改基金合同并公告。经与相应基金托管人协商一致,并报监管机构备案,本基金管理人对本基金基金合同相关条款进行修改,本次基金合同的修改内容包括释义、申购和赎回、基金的估值、基金的投资和信息披露等条款。详见本基金管理人于2018年3月24日发布的公告。

申万菱信基金管理有限公司

二〇一八年八月二十七日