

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:二〇一七年八月二十八日

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)

2017 半年度 报告摘要

2017年6月30日

运作效果观察,基金跟踪误差的主要来源是长期停牌股票估值调整与指数成分定期调整。
作为被动投资的指数基金,申万菱信中证申万新兴健康产业主题投资指数基金将继续保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,追求最小化跟踪误差。

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8月28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”)、中国证券业协会颁布的《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>》、中国证券业协会颁布的《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>》和中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 本报告期末资产负债表相关会计政策、会计估计与最近一期年度报告保持一致。
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保持一致。
6.4.5 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保持一致。

6.4.6 税理
根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[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所得税政策有关问题的通知》及其他相关税法法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。
(2) 对基金在证券交易所中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、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。

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

Table with columns: 关联方名称, 关联方关系, 与本基金的交易内容. Lists various related parties like 申万菱信基金管理有限公司, 中国农业银行股份有限公司, etc.

Table with columns: 关联方名称, 成交金额, 占当期股票成交金额的比例. Shows transaction amounts and percentages for related parties.

Table with columns: 关联方名称, 应付佣金, 占当期股票应付佣金的比例. Shows commission amounts and percentages for related parties.

Table with columns: 关联方名称, 应付利息, 占当期应付利息的比例. Shows interest amounts and percentages for related parties.

Table with columns: 关联方名称, 期末余额, 占当期期末余额的比例. Shows ending balances and percentages for related parties.

Table with columns: 关联方名称, 期末余额, 占当期期末余额的比例. Shows ending balances and percentages for related parties.

Table with columns: 关联方名称, 期末余额, 占当期期末余额的比例. Shows ending balances and percentages for related parties.

Table with columns: 关联方名称, 期末余额, 占当期期末余额的比例. Shows ending balances and percentages for related parties.

Table with columns: 关联方名称, 期末余额, 占当期期末余额的比例. Shows ending balances and percentages for related parties.

Table with columns: 关联方名称, 期末余额, 占当期期末余额的比例. Shows ending balances and percentages for related parties.

Table with columns: 关联方名称, 期末余额, 占当期期末余额的比例. Shows ending balances and percentages for related parties.

Table with columns: 关联方名称, 期末余额, 占当期期末余额的比例. Shows ending balances and percentages for related parties.

Table with columns: 关联方名称, 期末余额, 占当期期末余额的比例. Shows ending balances and percentages for related parties.

Table with columns: 关联方名称, 期末余额, 占当期期末余额的比例. Shows ending balances and percentages for related parties.

Table with columns: 关联方名称, 期末余额, 占当期期末余额的比例. Shows ending balances and percentages for related parties.

Table with columns: 关联方名称, 期末余额, 占当期期末余额的比例. Shows ending balances and percentages for related parties.

Table with columns: 关联方名称, 期末余额, 占当期期末余额的比例. Shows ending balances and percentages for related parties.

Table with columns: 关联方名称, 期末余额, 占当期期末余额的比例. Shows ending balances and percentages for related parties.

Table with columns: 关联方名称, 期末余额, 占当期期末余额的比例. Shows ending balances and percentages for related parties.

Table with columns: 关联方名称, 期末余额, 占当期期末余额的比例. Shows ending balances and percentages for related parties.

Table with columns: 关联方名称, 期末余额, 占当期期末余额的比例. Shows ending balances and percentages for related parties.

Table with columns: 关联方名称, 期末余额, 占当期期末余额的比例. Shows ending balances and percentages for related parties.

Table with columns: 关联方名称, 期末余额, 占当期期末余额的比例. Shows ending balances and percentages for related parties.

Table with columns: 关联方名称, 期末余额, 占当期期末余额的比例. Shows ending balances and percentages for related parties.

2.1 基金基本情况
基金名称: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
基金代码:163119
基金管理人:申万菱信基金管理有限公司

2.2 基金产品说明
基金运作方式:契约型开放式
基金存续期限:不定期
基金管理人:申万菱信基金管理有限公司

2.3 基金管理人、基金托管人
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

2.4 信息披露方式
基金管理人网站:www.swhx.com.cn
基金托管人网站:www.abchina.com

3 主要财务指标和基金净值表现
基金净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2016年10月10日至2017年6月30日)

Table with columns: 项目, 期末余额, 期初余额. Shows financial metrics for the reporting period.

Table with columns: 项目, 期末余额, 期初余额. Shows financial metrics for the reporting period.

Table with columns: 项目, 期末余额, 期初余额. Shows financial metrics for the reporting period.

Table with columns: 项目, 期末余额, 期初余额. Shows financial metrics for the reporting period.

Table with columns: 项目, 期末余额, 期初余额. Shows financial metrics for the reporting period.

Table with columns: 项目, 期末余额, 期初余额. Shows financial metrics for the reporting period.

Table with columns: 项目, 期末余额, 期初余额. Shows financial metrics for the reporting period.

Table with columns: 项目, 期末余额, 期初余额. Shows financial metrics for the reporting period.

Table with columns: 项目, 期末余额, 期初余额. Shows financial metrics for the reporting period.

Table with columns: 项目, 期末余额, 期初余额. Shows financial metrics for the reporting period.

Table with columns: 项目, 期末余额, 期初余额. Shows financial metrics for the reporting period.

Table with columns: 项目, 期末余额, 期初余额. Shows financial metrics for the reporting period.

Table with columns: 项目, 期末余额, 期初余额. Shows financial metrics for the reporting period.

Table with columns: 项目, 期末余额, 期初余额. Shows financial metrics for the reporting period.

Table with columns: 项目, 期末余额, 期初余额. Shows financial metrics for the reporting period.

Table with columns: 项目, 期末余额, 期初余额. Shows financial metrics for the reporting period.

Table with columns: 项目, 期末余额, 期初余额. Shows financial metrics for the reporting period.

Table with columns: 项目, 期末余额, 期初余额. Shows financial metrics for the reporting period.

Table with columns: 项目, 期末余额, 期初余额. Shows financial metrics for the reporting period.

Table with columns: 项目, 期末余额, 期初余额. Shows financial metrics for the reporting period.

Table with columns: 项目, 期末余额, 期初余额. Shows financial metrics for the reporting period.

Table with columns: 项目, 期末余额, 期初余额. Shows financial metrics for the reporting period.

Table with columns: 项目, 期末余额, 期初余额. Shows financial metrics for the reporting period.

Table with columns: 项目, 期末余额, 期初余额. Shows financial metrics for the reporting period.

Table with columns: 项目, 期末余额, 期初余额. Shows financial metrics for the reporting period.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值. Lists top 10 stock holdings.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值. Lists top 10 stock holdings.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值. Lists top 10 stock holdings.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值. Lists top 10 stock holdings.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值. Lists top 10 stock holdings.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值. Lists top 10 stock holdings.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值. Lists top 10 stock holdings.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值. Lists top 10 stock holdings.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值. Lists top 10 stock holdings.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值. Lists top 10 stock holdings.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值. Lists top 10 stock holdings.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值. Lists top 10 stock holdings.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值. Lists top 10 stock holdings.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值. Lists top 10 stock holdings.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值. Lists top 10 stock holdings.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值. Lists top 10 stock holdings.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值. Lists top 10 stock holdings.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值. Lists top 10 stock holdings.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值. Lists top 10 stock holdings.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值. Lists top 10 stock holdings.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值. Lists top 10 stock holdings.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值. Lists top 10 stock holdings.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值. Lists top 10 stock holdings.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值. Lists top 10 stock holdings.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值. Lists top 10 stock holdings.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值. Lists top 10 stock holdings.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值. Lists top 10 stock holdings.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值. Lists top 10 stock holdings.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值. Lists top 10 stock holdings.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值. Lists top 10 stock holdings.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值. Lists top 10 stock holdings.