申万菱信中小板指数证券投资基金(LOF)(原申万菱信中小板指数分级证券投资基金)

2017 半年度 报告摘要

2017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：二〇一七年八月二十八日

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2017年8月23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。

根据《基金合同》的相关规定，原申万菱信中小板指数分级证券投资基金分级运作期共包含五个运作周年。分级运作期结束，无需召开基金份额持有人大会，自动转换为上市开放式基金（LOF）。2017年5月8日，申万菱信中小板指数分级证券投资基金分级运作期结束，申万菱信中小板指数分级证券投资基金之稳健收益类份额、申万菱信中小板指数分级证券投资基金之积极进取类份额按照《基金合同》约定折算成场内申万菱信中小板指数分级证券投资基金之申万中小板份额，基金名称变更为“申万菱信中小板指数证券投资基金（LOF）”。

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2017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

2.1.1 申万菱信中小板指数证券投资基金(LOF)

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	154,305,715.08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	2017年5月26日

2.1.2 申万菱信中小板指数分级证券投资基金

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	324,950,387.61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		
下属分级基金的基金简称	申万中小	中小板A	中小板B
下属分级基金的交易代码	163111	150085	150086
报告期末下属分级基金的份额总额	101,058,751.61份	111,945,818.00份	111,945,818.00份

2.2 基金产品说明

2.2.1 申万菱信中小板指数证券投资基金(LOF)

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。

2.2.2 申万菱信中小板指数分级证券投资基金

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。

注：申万菱信中小板指数分级证券投资基金报告期末是指2017年5月8日。

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

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.swsmu.com
基金半年度报告备置地点	申万菱信基金管理有限公司 中国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 申万菱信中小板指数证券投资基金(LOF)

3.1.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1.1期间数据和指标	报告期(2017年5月9日至2017年6月30日)
本期已实现收益	-17,748,125.84
本期利润	18,616,642.92
加权平均基金份额本期利润	0.0745
本期基金份额净值增长率	9.00%
3.1.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0763
期末基金资产净值	163,650,895.80
期末基金份额净值	1.0606

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.本基金自转型以来，运作未满一年。

3.1.2 基金净值表现

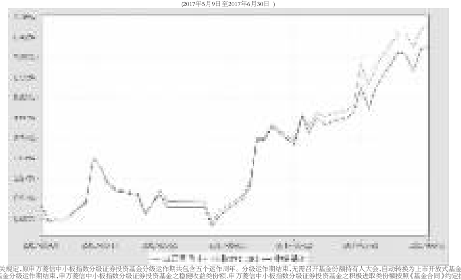
3.1.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	8.19%	0.81%	7.39%	0.82%	0.80%	-0.01%
自分级运作终止日次日起至本报告期末（2017年5月9日至2017年6月30日）	9.00%	0.80%	7.95%	0.80%	1.05%	0.00%

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：benchmark(0) =1000；%benchmark(t)= 95%*(中小板指数(t)/ 中小板指数(t-1)-1)+5%*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,…。

3.1.2.2 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2017年6月30日)



注：1.根据《基金合同》的相关规定，原申万菱信中小板指数分级证券投资基金分级运作期共包含五个运作周年。分级运作期结束，无需召开基金份额持有人大会，自动转换为上市开放式基金（LOF）。2017年5月8日，申万菱信中小板指数分级证券投资基金分级运作期结束，申万菱信中小板指数分级证券投资基金之稳健收益类份额、申万菱信中小板指数分级证券投资基金之积极进取类份额按照《基金合同》约定折算成场内申万菱信中小板指数分级证券投资基金之申万中小板份额，基金名称变更为“申万菱信中小板指数证券投资基金（LOF）”；
2.本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，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）。本基金投资于中小板指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产的90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产的5%。原申万菱信中小板指数分级证券投资基金合同于2012年5月8日生效。本基金已在基金合同生效之日起6个月内，使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

3.2 申万菱信中小板指数分级证券投资基金

3.2.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1.1期间数据和指标	报告期(2017年1月1日至2017年5月8日)
本期已实现收益	-14,933,830.43
本期利润	1,620,119.80
加权平均基金份额本期利润	0.0040
本期基金份额净值增长率	-0.67%
3.1.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年5月8日)
期末可供分配基金份额利润	0.1622
期末基金资产净值	316,180,963.89
期末基金份额净值	0.9730

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。

3.2.2 基金净值表现

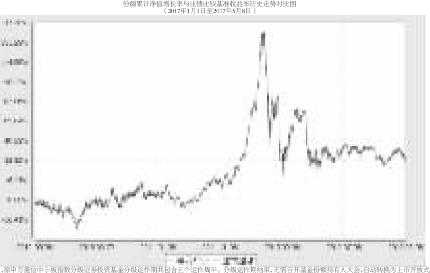
3.2.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
2017年05月01日至分级运作终止日(2017年5月8日)	-3.29%	0.48%	-3.30%	0.50%	0.01%	-0.02%
2017年04月01日至分级运作终止日(2017年5月8日)	-4.75%	0.78%	-4.73%	0.79%	-0.02%	-0.01%
2017年01月01日至分级运作终止日(2017年5月8日)	-0.67%	0.78%	-0.89%	0.78%	0.22%	0.00%
2016年07月01日至分级运作终止日(2017年5月8日)	-6.31%	0.83%	-6.61%	0.84%	0.30%	-0.01%
2014年07月01日至分级运作终止日(2017年5月8日)	30.81%	2.01%	32.79%	1.91%	-1.98%	0.10%
自基金合同生效起至分级运作终止日(2017年5月8日)	32.03%	1.75%	33.17%	1.69%	-1.14%	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：benchmark(0) =1000；%benchmark(t)= 95%*(中小板指数(t)/ 中小板指数(t-1)-1)+5%*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,…。

3.2.2.2 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
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1月1日至2017年5月8日)



注：1.根据《基金合同》的相关规定，原申万菱信中小板指数分级证券投资基金分级运作期共包含五个运作周年。分级运作期结束，无需召开基金份额持有人大会，自动转换为上市开放式基金（LOF）。2017年5月8日，申万菱信中小板指数分级证券投资基金分级运作期结束，申万菱信中小板指数分级证券投资基金之稳健收益类份额、申万菱信中小板指数分级证券投资基金之积极进取类份额按照《基金合同》约定折算成场内申万菱信中小板指数分级证券投资基金之申万中小板份额，基金名称变更为“申万菱信中小板指数证券投资基金（LOF）”；
2.本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，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）。本基金投资于中小板指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产的90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产的5%。原申万菱信中小板指数分级证券投资基金合同于2012年5月8日生效。本基金已在基金合同生效之日起6个月内，使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

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，注册资本金为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2017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33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315亿元，客户数超过603万户。

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，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基金经理，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。
俞诚	本基金基金经理	2015-12-03	–	8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，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基金经理，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。

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遵规守信情况的说明

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与公司资产之间严格分开；没有发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为。在基金资产的管理运作中，无任何损害基金持有人利益的行为，并通过稳健经营、规范运作、规避风险，保护了基金持有人的合法权益。

4.3管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

在研究分析方面，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，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。

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。

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

4.3.2异常交易行为的专项说明

本公司制定了《异常交易监控报告制度》，明确定义了在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%的情况有三次。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说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2017年上半年，沪深A股整体走势较为平稳，指数表现结构化特征明显。报告期内，大小盘风格差显著扩大，在流动性中性的环境下，市场更青睐业绩稳定，估值更具有优势的蓝筹板块。而市场担忧的是以小盘为代表的创业板个股未来高增长能否持续。目前，风格的波动很大程度来源于资金对各种不确定性容忍度降低，对应风险溢价在提升。2017年上半年，上证综指上涨2.86%，深证成份指数上涨3.46%，沪深300指数上涨10.78%；而中证500指数下跌2.00%，中小板指数上涨7.33%，创业板指数下跌7.34%，显示大盘风格占优。

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长期停牌股票估值调整以及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。本基金已于2017年5月8日分级运作期结束，无需召开基金份额持有人大会，已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）”。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，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

2017年1月1日至5月8日中小板成份指数期间表现为-0.97%，基金业绩基准表现为-0.89%，申万菱信中小板指数分级证券投资基金净值期间表现为-0.67%，领先业绩基准0.22%。

2017年5月9日至6月30日中小板成份指数期间表现为8.38%，基金业绩基准表现为7.95%，申万菱信中小板指数证券投资基金（LOF）净值期间表现为9.00%，领先业绩基准1.05%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

全球经济同步复苏，内地经济受益于供给侧改革和房地产景气而回升，增速前高后低但全年增长无忧。全球流动性收紧，国内经济去杠杆和金融严监管将使货币政策中性偏紧，利率维持高位。以沪深300为代表的低估值、业绩好的大票将维持慢牛格局，而中小创仍然面临估值压力。建议关注估值水平偏低的大蓝筹股票、竞争力边际改善的行业龙头股票和业绩具有确定性的白马股票。

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12年基金行业高级管理人员经验；分管基金投资的副总经理张少华先生，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16年的基金会计经验；监察稽核总部总监牛锐女士，拥有13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10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

本报告期，在本基金分级运作期内（2017年1月1日至2017年5月8日），本基金（包括申万中小板份额、中小板A份额、中小板B份额）不进行利润分配；本基金转型后（2017年5月9日至2017年6月30日），本基金未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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 2017 年 1 月 1 日至 2017 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，未发现有损害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 申万菱信中小板指数证券投资基金(LOF)

6.1.1 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：2017年6月30日

单位：人民币元

资产	本期末 2017年6月30日
资产：	
银行存款	11,992,501.02
结算备付金	–
存出保证金	70,682.17
交易性金融资产	154,329,707.65
其中：股票投资	154,329,707.65
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	–
应收利息	3,479.68
应收股利	–
应收申购款	30,147.95
递延所得税资产	–
其他资产	30,093.50
资产总计	166,456,611.97
负债和所有者权益	本期末 2017年6月30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	1,461,745.87
应付赎回款	857,996.37
应付管理人报酬	113,749.50
应付托管费	20,999.88
应付销售服务费	–
应付交易费用	198,048.65
应交税费	–
应付利息	–
应付利润	–
递延所得税负债	–
其他负债	153,175.90
负债合计	2,805,716.17
所有者权益：	
实收基金	113,709,994.57
未分配利润	49,940,901.23
所有者权益合计	163,650,895.80
负债和所有者权益总计	166,456,611.97

注：1.报告截止日2017年6月30日，基金份额净值1.0606元，基金份额总额154,305,715.08份。
2.本基金分级运作终止日为2017年5月8日，本财务报表的实际编制期间为2017年5月9日（基金转型后首日）至2017年6月30日，无上年度末数据。

6.1.2 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：2017年5月9日至2017年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2017年5月9日至 2017年6月30日
一、收入	19,278,492.85
1.利息收入	22,977.41
其中：存款利息收入	22,977.41
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）	-17,326,564.58
其中：股票投资收益	-18,702,519.26
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	1,375,954.68
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	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）	217,311.26
减：二、费用	661,849.93
1. 管理人报酬	239,906.80
2. 托管费	44,596.98
3. 销售服务费	–
4. 交易费用	326,747.42
5. 利息支出	–
其中：卖出回购金融资产支出	–
6. 其他费用	50,598.73
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	18,616,642.92
减：所得税费用	–
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	18,616,642.92

注：本基金分级运作终止日为2017年5月8日，本财务报表的实际编制期间为2017年5月9日（基金转型后首日）至2017年6月30日，无上年度可比期间对比数据。

6.1.3 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：2017年5月9日至2017年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2017年5月9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，本财务报表的实际编制期间为2017年5月9日（基金转型后首日）至2017年6月30日，无上年度可比期间对比数据。
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：
基金管理公司负责人：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

6.1.4 报表附注

6.1.4.1 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。本基金基金份额到期折算基准日日终（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）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）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的基金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。

经深圳证券交易所深证上[2017]325号文审核同意，本基金申万菱信中小板指数证券投资基金（LOF）于2017年5月26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8月28日批准报出。

6.1.4.2 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6.1.4.4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。

6.1.4.3遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2017年05月09日(分级运作终止日次日)至2017年06月30日止期间 财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2017年06月30日的财务状况以及2017年05月09日(分级运作终止日次日)至2017年06月30日止期间 的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.1.4.4 重要会计政策和会计估计

6.1.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

6.1.4.4.2记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.1.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

6.1.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.1.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：?

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日在活跃市场上的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

6.1.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.1.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.1.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.1.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.1.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.1.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，其中场外基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资，场内基金份额持有人只能选择现金分红。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.1.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.1.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

6.1.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.1.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.1.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.1.4.5.3 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。

6.1.4.6 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。

6.1.4.7 关联方关系

6.1.4.7.1 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。

6.1.4.7.2 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。

6.1.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.1.4.8.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年5月9日至2017年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
申万宏源	105,199,054.78	62.85%

6.1.4.8.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年5月9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等。

6.1.4.8.3 关联方报酬

6.1.4.8.3.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年5月9日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	239,906.80
其中：支付销售机构的客户维护费	16,064.72

注：1.本基金分级运作期内，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。
2.本基金分级运作期到期后，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。

6.1.4.8.3.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年5月9日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	44,596.98

注：1.本基金分级运作期内，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。
2.本基金分级运作期到期后，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。

6.1.4.8.3.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

2017年5月9日（基金转型后首日）至2017年6月30日，本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.1.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.1.4.8.4.1 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，本基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况。

6.1.4.8.4.2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，除基金管理人之外的其他关联方，未发生投资本基金的情况。

6.1.4.8.5 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 2017年5月9日至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	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。

6.1.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

2017年5月9日（基金转型后首日）至2017年6月30日，本基金在承销期内无参与关联方承销证券的情况。

6.1.4.9 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.1.4.9.1 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

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
002879	长缆科技	2017-06-05	2017-07-07	网下中签	18.02	18.02	1,313.00	23,660.26	23,660.26	–
002882	金龙羽	2017-06-15	2017-07-17	网下中签	6.20	6.20	2,966.00	18,389.20	18,389.20	–
300670	大烨智能	2017-06-26	2017-07-03	网下中签	10.93	10.93	1,259.00	13,760.87	13,760.87	–
300671	富满电子	2017-06-27	2017-07-05	网下中签	8.11	8.11	942.00	7,639.62	7,639.62	–
300672	国科微	2017-06-30	2017-07-12	网下中签	8.48	8.48	1,257.00	10,659.36	10,659.36	–

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。

6.1.4.9.2 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
002010	传化智联	2017-06-30	重大事项	15.26	2017-07-04	16.77	25,835.00	501,574.50	394,242.10	–
002013	中航机电	2017-05-12	重大事项	10.33	2017-08-02	11.36	177,558.00	1,758,933.09	1,834,174.14	–
002049	紫光国芯	2017-02-20	重大事项	30.82	2017-07-17	27.74	109,035.00	4,553,000.74	3,360,458.70	–
002252	上海莱士	2017-04-21	重大事项	20.24	–	–	199,240.00	4,363,642.68	4,032,617.60	–
002399	海普瑞	2017-04-28	重大事项	20.23	–	–	74,457.00	1,491,197.42	1,506,265.11	–
002426	胜利精密	2017-01-16	重大事项	7.68	–	–	567,130.00	4,655,990.67	4,355,558.40	–
002610	爱康科技	2017-05-12	重大事项	2.44	2017-08-02	2.44	381,310.00	1,238,746.61	930,396.40	–
002075	沙钢股份	2016-09-15	重大事项	19.16	–	–	256,809.00	3,664,999.65	4,920,460.44	–
002129	中环股份	2016-04-25	重大事项	10.28	–	–	604,124.00	7,838,214.57	6,210,394.72	–
002168	深圳惠程	2017-01-23	重大事项	19.42	–	–	248,357.00	3,207,680.54	4,823,092.94	–

注：本基金截至2017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。

6.1.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

截至2017年6月30日止，本基金无债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额，无相关抵押债券。

6.1.4.10 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2017年06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121,887,937.79元，属于第二层次的余额为32,441,769.86 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2017年06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) 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。

申万菱信中小板指数分级证券投资基金

6.2.1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：2017年5月8日

单位：人民币元

资产	本期末 2017年5月8日	上年度末 2016年12月31日
资产：		
银行存款	26,110,499.27	46,541,571.67
结算备付金	–	405,271.57
存出保证金	91,144.25	57,909.40
交易性金融资产	287,820,980.85	424,704,149.55
其中：股票投资	287,820,980.85	424,704,149.55
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	12,071,725.84	–
应收利息	25,725.46	8,188.35
应收股利	–	–
应收申购款	21,390.21	23,352.66
递延所得税资产	–	–
其他资产	–	–
资产总计	326,141,465.88	471,740,443.20
负债和所有者权益	本期末 2017年5月8日	上年度末 2016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	9,441,515.29	492,017.36
应付管理人报酬	73,150.22	424,363.55
应付托管费	16,093.04	93,359.97
应付销售服务费	–	–
应付交易费用	168,098.46	144,831.76
应交税费	–	–
应付利息	–	–
应付利润	–	–
递延所得税负债	–	–
其他负债	261,644.98	293,591.80
负债合计	9,960,501.99	1,476,757.88
所有者权益：		
实收基金	239,461,306.04	353,777,891.00
未分配利润	76,719,657.85	116,485,794.32
所有者权益合计	316,180,963.89	470,263,685.32
负债和所有者权益总计	326,141,465.88	471,740,443.20

注：报告截止日2017年5月8日（分级运作终止日），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0.9730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1.0500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0.8960元；申万中小板份额101,058,751.61份，中小板A份额111,945,818.00份，中小板B份额111,945,818.00份。

6.2.2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：2017年1月1日至2017年5月8日

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年5月8日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
一、收入	3,871,963.90	-104,897,511.51
1.利息收入	75,185.82	176,313.57
其中：存款利息收入	75,185.82	176,313.57
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）	-12,972,737.67	-47,455,451.06
其中：股票投资收益	-12,971,135.38	-50,579,475.51
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	-1,602.29	3,124,024.45
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	16,553,950.23	-58,122,187.66
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	–	–
5.其他收入（损失以“-”号填列）	215,565.52	503,813.64
减：二、费用	2,251,844.10	4,696,956.03
1. 管理人报酬	1,433,110.15	2,747,747.93
2. 托管费	315,284.26	604,504.55
3. 销售服务费	–	–
4. 交易费用	347,802.83	1,107,615.35
5. 利息支出	–	–
其中：卖出回购金融资产支出	–	–
6. 其他费用	155,646.86	237,088.20
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	1,620,119.80	-109,594,467.54
减：所得税费用	–	–
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	1,620,119.80	-109,594,467.54

注：本基金分级运作终止日为2017年5月8日，本财务报表的实际编制期间为2017年1月1日至2017年5月8日（分级运作终止日）。上年度可比期间为2016年1月1日至2016年6月30日。

6.2.3 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：2017年1月1日至2017年5月8日

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年5月8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）	353,777,891.00	116,485,794.32	470,263,685.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	–	1,620,119.80	1,620,119.80
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）	-114,316,584.96	-41,386,256.27	-155,702,841.23
其中：1.基金申购款	14,018,108.17	4,083,465.30	18,101,573.47
2.基金赎回款	-128,334,693.13	-45,469,721.57	-173,804,414.70
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）	239,461,306.04	76,719,657.85	316,180,963.89
项目	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	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）	–	-109,594,467.54	-109,594,467.54
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）	-18,445,174.99	-19,019,198.41	-37,464,373.40
其中：1.基金申购款	270,928,543.41	95,003,958.73	365,932,502.14
2.基金赎回款	-289,373,718.40	-114,023,157.14	-403,396,875.54
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）	368,497,421.89	150,805,666.61	519,303,088.50

注：本基金分级运作终止日为2017年5月8日，本财务报表的实际编制期间为2017年1月1日至2017年5月8日（分级运作终止日）。上年度可比期间为2016年1月1日至2016年6月30日。
报表附注为财务报表的组成部分。
本报告6.2.1至6.2.4，财务报表由下列负责人签署：
基金管理公司负责人：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

6.2.4 报表附注

6.2.4.1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份额的基金份额参考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8月28日批准报出。

6.2.4.2会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则－基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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6.2.4.4所列示的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。

6.2.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2017年01月01日至2017年05月08日(分级运作终止日)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2017年05月08日(分级运作终止日)的财务状况以及2017年01月01日至2017年05月08日(分级运作终止日)止期间 的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.2.4.4 重要会计政策和会计估计

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。

6.2.4.5 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。

6.2.4.6 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。

6.2.4.7 关联方关系

6.2.4.7.1 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。

6.2.4.7.2 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。

6.2.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.2.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.2.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年5月8日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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	–	–	59,432,510.38	8.16%

6.2.4.8.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年5月8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	–	–	–	–
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
申万宏源	54,161.25	8.16%	54,161.25	16.85%

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。

6.2.4.8.2 关联方报酬

6.2.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年5月8日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,433,110.15	2,747,747.93
其中：支付销售机构的客户维护费	73,155.95	140,027.12

注：1.本基金分级运作期内，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。
2.本基金分级运作期到期后，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。

6.2.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年5月8日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	315,284.26	604,504.55

注：1.本基金分级运作期内，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。
2.本基金分级运作期到期后，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。

6.2.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

2017年1月1日至2017年5月8日（分级运作终止日），本基金与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.2.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.2.4.8.4.1 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。

6.2.4.8.4.2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。

6.2.4.8.5 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 2017年1月1日至2017年5月8日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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	26,110,499.27	74,146.22	36,688,440.14	153,387.60

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。

6.2.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

2017年1月1日至2017年5月8日（分级运作终止日），本基金在承销期内无参与关联方承销证券的情况。

6.2.4.9 期末（2017年5月8日）本基金持有的流通受限证券

6.2.4.9.1 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

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
002869	金溢科技	2017-05-04	2017-05-15	网下中签	21.80	21.80	1,255.00	27,359.00	27,359.00	–

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。

6.2.4.9.2 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
002049	紫光国芯	2017-02-20	重大事项	30.88	2017-07-17	27.74	109,035.00	4,553,000.74	3,367,000.80	–
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	–
002168	深圳惠程	2017-01-23	重大事项	16.99	–	–	248,357.00	3,207,680.54	4,219,585.43	–
002252	上海莱士	2017-04-21	重大事项	20.27	–	–	199,240.00	4,363,642.68	4,038,594.80	–
002280	联络互动	2017-02-21	重大事项	13.01	2017-06-21	11.77	148,222.00	3,383,866.66	1,928,368.22	–
002399	海普瑞	2017-04-28	重大事项	20.48	–	–	74,457.00	1,491,197.42	1,524,879.36	–
002426	胜利精密	2017-01-16	重大事项	7.68	–	–	567,130.00	4,655,990.67	4,355,558.40	–
002400	省广股份	2016-11-28	重大事项	11.12	2017-05-25	9.52	342,980.00	5,883,234.70	3,813,937.60	–
002075	沙钢股份	2016-09-15	重大事项	17.94	–	–	256,809.00	3,664,999.65	4,607,153.46	–

注：本基金截至2017年5月8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。

6.2.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

截至本基金分级运作终止日（2017年5月8日），本基金无债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额，无相关抵押债券。

6.2.4.10 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2017年05月08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254,942,438.30元，属于第二层次的余额为32,878,542.55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2017年05月08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) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 申万菱信中小板指数证券投资基金(LOF)
（报告期：2017年5月9日－2017年6月30日）

7.1.1 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	154,329,707.65	92.71
	其中：股票	154,329,707.65	92.71
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	11,992,501.02	7.20
7	其他各项资产	134,403.30	0.08
8	合计	166,456,611.97	100.00

注：本基金未开通港股通交易机制投资于港股。

7.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.1.2.1 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	792,749.44	0.48
B	采矿业	–	–
C	制造业	110,680,415.85	67.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	3,786,160.37	2.31
F	批发和零售业	3,650,805.00	2.23
G	交通运输、仓储和邮政业	707,028.00	0.43
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,994,444.87	9.77
J	金融业	10,140,395.08	6.20
K	房地产业	1,611,900.36	0.98
L	租赁和商务服务业	3,901,495.76	2.38
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	1,034,177.82	0.63
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	2,030,135.10	1.24
S	综合	–	–
T	合计	154,329,707.65	94.30

7.1.2.2 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。

7.1.3 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	251,251.00	8,115,407.30	4.96
2	002129	中环股份	604,124.00	6,210,394.72	3.79
3	002075	沙钢股份	256,809.00	4,920,460.44	3.01
4	002168	深圳惠程	248,357.00	4,823,092.94	2.95
5	002450	康得新	203,006.00	4,571,695.12	2.79
6	002426	胜利精密	567,130.00	4,355,558.40	2.66
7	002304	洋河股份	46,901.00	4,071,475.81	2.49
8	002252	上海莱士	199,240.00	4,032,617.60	2.46
9	002024	苏宁云商	324,516.00	3,650,805.00	2.23
10	002049	紫光国芯	109,035.00	3,360,458.70	2.05

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。

7.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.1.4.1累计买入金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例（%）
1	002558	巨人网络	1,526,473.00	0.93
2	002797	第一创业	1,462,527.00	0.89
3	002366	台海核电	1,083,316.00	0.66
4	002217	合力泰	1,026,887.00	0.63
5	002131	利欧股份	876,285.00	0.54
6	002601	龙蟒佰利	746,950.00	0.46
7	002352	顺丰控股	670,392.00	0.41
8	002411	必康股份	649,793.00	0.40
9	002880	卫光生物	25,059.78	0.02
10	002879	长缆科技	23,660.26	0.01
11	002882	金龙羽	18,389.20	0.01
12	300670	大烨智能	13,760.87	0.01
13	002877	智能自控	12,062.40	0.01
14	300662	科锐国际	10,846.80	0.01
15	300672	国科微	10,659.36	0.01
16	300666	江丰电子	10,560.64	0.01
17	300663	科蓝软件	9,400.11	0.01
18	002881	美格智能	8,861.44	0.01
19	300671	富满电子	7,639.62	0.00

7.1.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例（%）
1	002415	海康威视	9,999,877.48	6.11
2	002450	康得新	5,656,265.30	3.46
3	002304	洋河股份	5,456,328.72	3.33
4	002241	歌尔股份	4,745,341.00	2.90
5	002024	苏宁云商	4,716,717.03	2.88
6	002142	宁波银行	3,616,698.33	2.21
7	002236	大华股份	3,555,536.29	2.17
8	002466	天齐锂业	3,416,711.27	2.09
9	002230	科大讯飞	3,402,683.79	2.08
10	002456	欧菲光	3,248,781.64	1.99
11	002008	大族激光	3,201,272.96	1.96
12	002594	比亚迪	3,166,411.34	1.93
13	002673	西部证券	3,097,177.77	1.89
14	002475	立讯精密	2,926,880.38	1.79
15	002202	金风科技	2,858,560.38	1.75
16	002739	万达电影	2,823,219.51	1.73
17	002736	国信证券	2,709,194.22	1.66
18	002508	老板电器	2,630,564.13	1.61
19	002460	赣锋锂业	2,355,457.29	1.44
20	002065	东华软件	2,287,709.01	1.40

7.1.4.3 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	8,193,523.48
卖出股票的收入（成交）总额	159,347,046.18

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。

7.1.5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。
7.1.6期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细
本基金本报告期末未持有债券。
7.1.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。
7.1.8 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。
7.1.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
7.1.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
7.1.10.1 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。
7.1.10.2 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。
7.1.11报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
7.1.11.1 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。
7.1.11.2 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。
7.1.11.3 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。
7.1.12投资组合报告附注
7.1.12.1 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。
7.1.12.2 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。
7.1.12.3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	70,682.17
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	3,479.68
5	应收申购款	30,147.95
6	其他应收款	–
7	待摊费用	30,093.50
8	其他	–
9	合计	134,403.30

7.1.12.4 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。
7.1.12.5 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	002129	中环股份	6,210,394.72	3.79	重大事项
2	002075	沙钢股份	4,920,460.44	3.01	重大事项
3	002426	胜利精密	4,355,558.40	2.66	重大事项
4	002168	深圳惠程	4,823,092.94	2.95	重大事项
5	002252	上海莱士	4,032,617.60	2.46	重大事项
6	002049	紫光国芯	3,360,458.70	2.05	重大事项

7.2 申万菱信中小板指数分级证券投资基金
（报告期：2017年1月1日－2017年5月8日）

7.2.1 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	287,820,980.85	88.25
	其中：股票	287,820,980.85	88.25
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	26,110,499.27	8.01
7	其他各项资产	12,209,985.76	3.74
8	合计	326,141,465.88	100.00

注：本基金未开通港股通交易机制投资于港股。

7.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.2.1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	1,621,218.66	0.51
B	采矿业	–	–
C	制造业	200,182,857.49	63.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	10,106,310.36	3.20
F	批发和零售业	7,709,643.10	2.44
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	29,439,396.74	9.31
J	金融业	19,222,589.68	6.08
K	房地产业	3,748,068.78	1.19
L	租赁和商务服务业	8,562,447.46	2.71
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	2,587,963.92	0.82
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	4,640,484.66	1.47
S	综合	–	–
T	合计	287,820,980.85	91.03

7.2.2.2 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。

7.2.3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	392,890.00	13,986,884.00	4.42
2	002450	康得新	476,782.00	9,015,947.62	2.85
3	002304	洋河股份	109,776.00	8,839,163.52	2.80
4	002024	苏宁云商	763,331.00	7,709,643.10	2.44
5	002142	宁波银行	351,930.00	5,834,999.40	1.85
6	002241	歌尔股份	348,291.00	5,802,528.06	1.84
7	002466	天齐锂业	127,421.00	5,732,670.79	1.81
8	002456	欧菲光	152,967.00	5,702,609.76	1.80
9	002230	科大讯飞	189,988.00	5,699,640.00	1.80
10	002594	比亚迪	110,108.00	5,372,169.32	1.70

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。

7.2.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.2.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例（%）
1	002407	多氟多	1,665,250.00	0.35
2	002426	胜利精密	1,566,138.93	0.33
3	002508	老板电器	1,483,487.00	0.32
4	002108	沧州明珠	974,521.00	0.21
5	002797	第一创业	920,706.00	0.20
6	002673	西部证券	877,668.56	0.19
7	002716	金贵银业	796,313.00	0.17
8	002624	完美世界	772,250.00	0.16
9	002224	三力士	754,405.00	0.16
10	002709	天赐材料	738,816.56	0.16
11	002610	爱康科技	681,758.00	0.14
12	002027	分众传媒	553,180.00	0.12
13	002415	海康威视	392,751.00	0.08
14	002450	康得新	334,070.38	0.07
15	002024	苏宁云商	329,116.00	0.07
16	002304	洋河股份	300,795.00	0.06
17	002230	科大讯飞	268,891.00	0.06
18	002195	二三四五	262,030.00	0.06
19	002142	宁波银行	249,088.00	0.05
20	002185	华天科技	232,928.00	0.05

7.2.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例（%）
1	002415	海康威视	7,189,106.33	1.53
2	002304	洋河股份	5,406,884.27	1.15
3	002450	康得新	5,368,701.05	1.14
4	002024	苏宁云商	5,013,963.37	1.07
5	002142	宁波银行	3,789,870.58	0.81
6	002230	科大讯飞	3,532,645.72	0.75
7	002673	西部证券	3,446,645.49	0.73
8	002594	比亚迪	3,308,705.66	0.70
9	002456	欧菲光	3,294,078.23	0.70
10	002241	歌尔股份	3,290,854.93	0.70
11	002736	国信证券	3,256,008.44	0.69
12	002202	金风科技	3,248,540.72	0.69
13	002466	天齐锂业	3,060,604.60	0.65
14	002739	万达电影	2,962,672.60	0.63
15	002236	大华股份	2,784,336.20	0.59
16	002008	大族激光	2,635,332.86	0.56
17	002475	立讯精密	2,515,526.92	0.53
18	002065	东华软件	2,393,661.06	0.51
19	002007	华兰生物	2,370,893.97	0.50
20	002310	东方园林	2,179,111.50	0.46

7.2.4.3 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	22,877,489.03
卖出股票的收入（成交）总额	163,343,472.58

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。

7.2.5 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。
7.2.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细
本基金本报告期末未持有债券。
7.2.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。
7.2.8 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。
7.2.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
7.2.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
7.2.10.1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。
7.2.10.2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。
7.2.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
7.2.11.1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。
7.2.11.2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。
7.2.11.3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。
7.2.12投资组合报告附注
7.2.12.1 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。
7.2.12.2 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。
7.2.12.3 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	91,144.25
2	应收证券清算款	12,071,725.84
3	应收股利	–
4	应收利息	25,725.46
5	应收申购款	21,390.21
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	12,209,985.76

7.2.12.4 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。
7.2.12.5 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情况。

8 基金份额持有人信息

8.1 申万菱信中小板指数证券投资基金(LOF)
（报告期：2017年5月9日－2017年6月30日）

8.1.1 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
12,975	11,892.54	24,502,143.16	15.88%	129,803,571.92	84.12%

8.1.2 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	中国对外经济贸易信托有限公司－资产配置固定收益信托	14,449,243.00	12.14%
2	宋伟铭	4,796,092.00	4.03%
3	叶宁	3,761,797.00	3.16%
4	张美芳	2,533,092.00	2.13%
5	嘉实基金－农业银行－中国农业银行股份有限公司企业年金理事会	1,808,441.00	1.52%
6	长江证券－招商银行－长江证券超越理财基金管家II集合资产管理计划	1,379,307.00	1.16%
7	郭少华	1,218,083.00	1.02%
8	建信人寿保险股份有限公司－传统保险产品	924,837.00	0.78%
9	侯秉刚	920,863.00	0.77%
10	国信证券－中国银行－国信“金太阳”经典组合基金集合资产管理	835,501.00	0.70%

注：以上数据由中国证券登记结算有限责任公司提供。

8.1.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

序号			
基金管理人所有从业人员持有本基金			67,207.94

8.1.4 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

8.2 申万菱信中小板指数分级证券投资基金
（报告期：2017年1月1日－2017年5月8日）

8.2.1 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	6,538	15,457.14	51,379,099.16	50.84%	49,679,652.45	49.16%
中小板A	469	238,690.44	108,288,660.00	96.73%	3,657,158.00	3.27%
中小板B	8,886	12,598.00	2,585,351.00	2.31%	109,360,467.00	97.69%
合计	14,315	22,699.99	162,253,110.16	49.93%	162,697,277.45	50.07%

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。

8.2.2 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－分红－个人分红	34,865,114.00	31.14%
2	中国太保集团股份有限公司－本级－集团自有资金－012G－ZY001深	17,154,731.00	15.32%
3	太平洋资产－工商银行－南方资本管理有限公司	9,359,627.00	8.36%
4	中国太平洋财产保险－传统－普通保险产品－013C－CT001深	8,693,214.00	7.77%
5	中国太平洋人寿保险股份有限公司－分红－团体分红	8,143,661.00	7.27%
6	中国太平洋人寿保险股份有限公司－万能－个人万能	6,869,380.00	6.14%
7	申万菱信基金－工商银行－中国工商银行股份有限公司私人银行部	4,921,902.00	4.40%
8	太平洋资管－建设银行－太平洋第三极稳定增值混合型产品	4,642,170.00	4.15%
9	太平洋资管－建设银行－太平洋智选债基FOF型产品	3,704,704.00	3.31%
10	海通资管－上海银行－海通月月财集合资产管理计划	2,317,662.00	2.07%

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	5,588,333.00	4.99%
2	叶宁	4,085,076.00	3.65%
3	张美芳	2,750,779.00	2.46%
4	长江证券－招商银行－长江证券超越理财基金管家II集合资产管理计	1,497,841.00	1.34%
5	黄艳群	1,194,700.00	1.07%
6	余功斌	1,097,000.00	0.98%
7	侯秉刚	1,000,000.00	0.89%
8	余子贵	966,923.00	0.86%
9	罗涛	883,641.00	0.79%
10	勒斌	871,200.00	0.78%

注：以上数据由中国证券登记结算有限责任公司提供。

9 开放式基金份额变动

9.1 申万菱信中小板指数证券投资基金(LOF)
（报告期：2017年5月9日－2017年6月30日）

单位：份

分级运作终止日次（2017年5月9日）基金份额总额	324,950,387.61
自分级运作终止日次日起至本报告期末（2017年5月9日至2017年6月30日）基金总申购份额	2,865,647.64
减：自分级运作终止日次日起至本报告期末（2017年5月9日至2017年6月30日）基金总赎回份额	173,510,319.17
自分级运作终止日次日起至本报告期末（2017年5月9日至2017年6月30日）基金拆分变动份额	-1.00
本报告期期末基金份额总额	154,305,715.08

9.2 申万菱信中小板指数分级证券投资基金
（报告期：2017年1月1日－2017年5月8日）

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	105,981,424.07	187,047,782.00	187,047,782.00
本报告期期初至分级运作终止日(2017年5月8日)基金总申购份额	19,023,445.09	–	–
减：本报告期期初至分级运作终止日(2017年5月8日)基金总赎回份额	174,150,045.55	–	–
本报告期期初至分级运作终止日(2017年5月8日)基金拆分变动份额	150,203,928.00	-75,101,964.00	-75,101,964.00
分级运作终止日(2017年5月8日)基金份额总额	101,058,751.61	111,945,818.00	111,945,818.00

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。

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
报告期内本基金基金管理人、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报告期内改聘会计师事务所情况
报告期内，本基金聘用普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）负责基金审计事务，未发生改聘会计师事务所事宜。
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况
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
10.7.1 申万菱信中小板指数证券投资基金(LOF)
（报告期：2017年5月9日－2017年6月30日）

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	1	105,199,054.78	62.85%	95,869.33	62.85%	–
中金公司	1	35,987,530.97	21.50%	32,795.75	21.50%	–
海通证券	1	26,203,083.43	15.65%	23,879.31	15.65%	–
国泰君安	1	–	–	–	–	–
川财证券	1	–	–	–	–	–
东方证券	1	–	–	–	–	–
安信证券	1	–	–	–	–	–
光大证券	1	–	–	–	–	–
信达证券	1	–	–	–	–	–
兴业证券	1	–	–	–	–	–
广发证券	1	–	–	–	–	–
华创证券	1	–	–	–	–	–
招商证券	1	–	–	–	–	–
联讯证券	1	–	–	–	–	–

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

10.7.2 申万菱信中小板指数分级证券投资基金
（报告期：2017年1月1日－2017年5月8日）

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	132,442,878.57	71.80%	120,695.92	71.80%	–
川财证券	1	52,016,200.93	28.20%	47,402.54	28.20%	–
申万宏源	1	–	–	–	–	–
国泰君安	1	–	–	–	–	–
中金公司	1	–	–	–	–	–
东方证券	1	–	–	–	–	–
安信证券	1	–	–	–	–	–
光大证券	1	–	–	–	–	–
信达证券	1	–	–	–	–	–
兴业证券	1	–	–	–	–	–
广发证券	1	–	–	–	–	–
华创证券	1	–	–	–	–	–
招商证券	1	–	–	–	–	–
联讯证券	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

11.1 申万菱信中小板指数证券投资基金(LOF)

11.1.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170606~20170611	42,184,103.00	147,901,380.00	190,085,483.00	–	0.00%
产品特有风险							
本报告期，本基金转型后（2017年5月9日至2017年6月30日）存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情况。在单一投资者持有基金份额比例较高的情况下，如投资者集中赎回，可能会给基金带来流动性冲击。基金管理人将专业审慎、勤勉尽责地管控基金的流动性风险，保护持有人利益。							

11.2 申万菱信中小板指数分级证券投资基金

11.2.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本报告期，本基金转型前（2017年1月1日至2017年5月8日）不存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情况。

11.3影响投资者决策的其他重要信息

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，原申万菱信中小板指数分级证券投资基金分级运作期共包含五个运作周年。分级运作期结束，无需召开基金份额持有人大会，自动转换为上市开放式基金（LOF）。2017年5月8日，申万菱信中小板指数分级证券投资基金分级运作期结束，申万菱信中小板指数分级证券投资基金之稳健收益类份额（简称“中小板A份额”）、申万菱信中小板指数分级证券投资基金之积极进取类份额（简称“中小板B份额”）按照《基金合同》约定折算成场内申万菱信中小板指数分级证券投资基金之申万中小板份额，基金名称变更为“申万菱信中小板指数证券投资基金（LOF）”。对于本次转换业务相关事宜，详见本基金管理人于2017年3月23日、4月7日、4月22日、4月28日、5月3日、5月5日、5月10日发布的公告。

申万菱信基金管理有限公司
二〇一七年八月二十八日