

申万菱信中证军工指数分级证券投资基金

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

基金管理人來商以城头信用、劉煜公內印原於自任中國內面是於 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 投资決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 其全简介

基金简称		申万菱信	中证军工指数分级
场内简称			申万军
基金主代码			16311
交易代码			16311
基金运作方式			契约型开放式
基金合同生效日			2014年7月24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		1,	152,183,184.496
基金合同存线期			不定其
基金份额上市的证券交易所			深圳证券交易所
上市日期			2014年8月11日
下属分级基金的基金简称	申万军工	军工A级	军工B級
下属分级基金的场内简称	申万军工	军工A级	军工B級
下属分级基金的交易代码	163115	150186	150187
报告期末下属分级基金的份额总额	1,063,037,550.49份	44,572,817.00 ()	44,572,817.006

投资目标	力争	金采取指数化投资方式,通过严格的 控制本基金的净值增长率与业绩比较 过0.36%,年跟踪误差不超过4%,实现	基准之间的日均	跟踪偏离度的绝对值
投资策略	股及对股	金股票投资策略主要采用完全复制的 其权重构建基金的股票投资组合,并 原投资组合进行相应地调整。本基金 根据风险管理的原则,在风险可挖的 资。	根据标的指数成	份股及其权重的变动 略为在股指期货投资
业绩比较基准	95%	×中证军工指数收益率+6%×银行同	业存款利率	
下属分级基金的风险 收益特征	预期 预期	军工份额为常规指数基金份额,具有 风险较高、预期收益较高的特征,其 风险和预期收益水平均高于货币市 金、债券型基金和混合型基金。	额,具有规则	申万军工B 份额由于利用杠杆投资,具有预期风险高、预期收益高的特征。
2.3 基金管理/	人和	基金托管人		
项目		基金管理人	基金	托管人

项目		基金管理。	A.	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	
姓名		王菲萍		贺倩	
信息披露负 责人	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		96599	
传真		021-23261199		010-68121816	
2.4 信息	.披露方式	4			
登载基金半年!	度报告正文的管	理人互联网网址	http://wv	ww.swsmu.com	
基金半年度报信	告备置地点			基金管理有限公司 收业银行股份有限公司	

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	-586,020,931.14
本期利润	-297,434,067.01
加权平均基金份额本期利润	-0.1943
本期加权平均净值利润率	-20.49%
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	-1.2941
期末基金资产净值	1,117,283,524.29
期末基金份额净值	0.9697
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
今八分价值亦动收约 扣除	相关弗田巨的全额 本期利润为本制

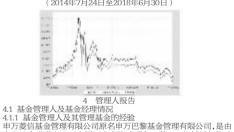
(不含公允价值变动收益) 扣除相关费用后的余额, 本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。2、上述基金业绩指标已扣除了基金的管理费、托管费和各项交易费用, 但不包括持有人认/申购或交易基金的各项费用(例如:申购费、赎回费等), 计入认/申购或交易基金的各项费用后, 实际收益水平要低于所列数字。

3.2.1 建金	7万秋(尹)	且垣大华及	具一印刷	业坝比较型	评的人们	学门门
阶段	份額净值 增长率①	份額净值增长率 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	10-3	2-4
过去一个月	-7.99%	1.97%	-8.27%	2.08%	0.28%	-0.11%
过去三个月	-17.41%	1.60%	-17.66%	1.68%	0.25%	-0.08%
过去六个月	-17.89%	1.71%	-16.87%	1.75%	-1.02%	-0.04%
过去一年	-25.22%	1.46%	-21.83%	1.48%	-3.39%	-0.02%
过去三年	-56.55%	2.27%	-55.85%	2.13%	-0.70%	0.14%
自基金合同生效 起至今	-6.08%	2.28%	6.05%	2.18%	-12.13%	0.10%
注:本基金	的业绩	基准指数按	沢照构建2	\式每交易E]进行ì	十算,

benchmark(0) =1000; %benchmark(t)= 95%*(中证军工指数(t)/ 中证军工指数(t-1)-1) +5%*银行同业存款利率(税后)/365;

benchmark(t)=(1+%benchmark(t))* benchmark(t-1); t中t=1,2,3,…。 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

3.22日基金首同生效以來基金好額家丁爭恒增下率受动及具 期业绩比较基准收益率变动的比较 申万菱信中证军工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 (2014年7月24日至2018年6月30日)



甲万菱信基並管理有限公司原名甲万巴黎基並管理有限公司,是田 国内大型综合类券商申万宏源证券有限公司和三菱(IV)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 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 理查文却模型过去的大量、发力被发达1977万百分

					1627万尸。	
4.1.2	基金	经理(或	基金经理	里小纟	且)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 商任日期 年限 用一帆先生,硕士研究生。2012年起				
荆一帆	本基基经理	2017-12-2	-	6年	期一帆先生。經一研究生。2012年起从事企識相次 工作,管任時于程度基金管理有限公司,但以周继 基金管理有限公司。2017年01月加入4月万度付基 经管理有限公司。2017年01月加入4月万度付基 证券投资基金。49万度的中证4月7新兴健康产业 主题投资质量。49万度的中证4月7新兴健康产业 主题投资预度分投资基金。49万度的中证4月7度的生态。49 万度的中亚5户转换了投资价度公按证券分级证券负度 基金。40万度的中亚4月7度的生物传发处证券负 发发热金。49万度的中亚4月7度的生物传发设定券 发发操造金。40万度的中亚4万度的生物传发设定券 发发操造金。40万度的中亚4万度的生物传发设定券	

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

注:1.任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之目: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.证券从业的合义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。
42.管理人对报告期内本基金运作遵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和途

為;另外,公司还建立机制要求公募投资经理与特定各户资产投资经理 互相隔离,且不能互相接权投资事宜。 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; 例从行机云;(2)对于部分顶穿一级印物中则,非公开及行取崇中购等 以公司名义进行的交易。各投资经理在交易前级立地确定各股资组合的 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 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、以公结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,对不同组合间间一投资标的,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,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。、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。

不然还且倚头了并而又须的口币面压、深加以及掣后的对对的危险。 本基基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竟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 合的投资第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

44.1报告期内基金投资策略和运作分析 2018年上半年,上海与深圳A股整体均有所下跌。2018年上半年, 上证综指下跌1390%,深证成份指数下跌15.04%,冲深300指数下跌 12.90%,中证500指数下跌16.53%;中小板指数下跌14.26%,创业板指

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是长 期停牌股票估值调整以及指数成分股定期调整。 序序成录。但国间建以及相致成为成是例明程。 本基金产品在申万蒙信中证军工指数分级基金之基础份额的基础,设计了军工A级份额和军工B级份额。军工A级和军工B级份额之比

为1:1。 作为被动投资的基金产品,申万菱信中证军工指数分级基金将继续 坚持既定的指数化投资策略,以严格控制基金相对目标指数的跟踪偏离 为投资目标,追求跟踪误差的最小化,使得投资者可以清晰地计算出分

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。
44.2 报告期内基金的业绩表现
2018年上半年中证军工指数期间表现为-17.78%,基金业绩基准表现为-16.87%,电万整信中证军工指数期间表现为-17.89%,和业绩基准的差约1.02%。
45.管理人对宏观经济,证券市场及行业走势的简要展望展望2018年下半年,经济上仍面临去杠杆的压力,与此同时,经济仍存在下行风险,股市整体上可能也欠缺确定的盈利性机会。证券市场面临的金融监管或仍将处于偏紧状态,但后续或仍以稳中求进为基调。行业方面,改革是军工股最为核心的驱动因素,事业单位改剩,高端军工装备制造改革、军民融合改革以及定价体系改革将在未来持续展开,建议长期关注军工股。
46.管理人,对提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,即就划采用的相关估值模型、假设及参数的适当性定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的意见。本基金明请的会计师事务所的意见。本基金明请的会计师事务所的意见。本基金明请的会计师事务所的意见。本基金明请的会计师事务所的意见。本基金明请的会计师事务所的意见。本基金明请的会计师事务所的意见。本基金明请的会计师事务所的意见。本基金明请的会计师事务所的意见。本基金明请的会计师事务所的意见。本基金明请的会计师事务所知证。本基金明请的会计师事务所的意见。本基金明请的会计师事务所知证。本基金明请的会计师事务所知证。本基金明请的会计师事务所知证。

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

77口条17日。 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 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 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 实验 的相大山国探送、IB 及公 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 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

资产估值委员会田本基並官理八分官基並尼岛印刷品总理,自家 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 仓行业运营、财务管理相关经验;督察长王菲荦女士,拥有14年的基金 行业台规管理经验;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 专社会会进业和整理级处。风险等理想的生活较少工,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
 6.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明
 6.1 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
 广临券投资基金法》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一中方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、利润分配等输足的访問

分配等情况的说明 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 依严极性照核全个局的知识:进程

^亚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 资产负债表 元广风版名 主体:申万菱信中证军工指数分级证券投资基金

单位:人民币元

141-141	本期末	上年度末
独立	2018年6月30日	2017年12月31日
资产:	-	-
银行存款	100,674,294.67	150,434,631.75
结算备付金	21,218.24	80,834.24
存出保证金	210,699.96	149,024.98
交易性金融资产	1,019,717,918.88	1,783,311,482.59
其中:股票投资	1,019,717,918.88	1,783,311,482.59
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	-	-
买人返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	
应收利息	20,075.72	32,24232
应收股利	-	-
应收申购款	208,750.51	326,518.12
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,120,852,957.98	1,934,334,734.00
负债和所有者权益	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017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	-	-
应付赎回款	1,844,671.05	1,465,768.10
应付管理人报酬	938,715.52	1,679,498.86
应付托管费	206,517.42	369,489.77
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	379,988.11	481,544.58
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	199,541.59	505,972.52
负债合计	3,569,433.69	4,502,273.83
所有者权益:	-	-
实收基金	1,189,540,656.43	1,687,159,972.86
未分配利润	-72,257,132.14	242,672,487.3
所有者权益合计	1,117,283,524.29	1,929,832,460.17
负债和所有者权益总计	1,120,852,957.98	1,934,334,734.00

SW 军工A参考净值1.0176元,SW 军工B参考净值0.9218元,申万菱信中证军工指数分级证券投资基金基金份额总额1,152,183,18449 份, 其中申万军工份额为 1,063,037,550.49 份,SW 军工A份额为 44, 572,817.00 份,SW 军工B份额为 44,572,817.00 份。

62 利润表 会2 利润表 会计主体:申万菱信中证军工指数分级证券投资基金 本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

	本期	单位:人民
項目	2018年1月1日至2018年6 月30日	2017年1月1日至2017年 6月30日
一、收入	-286,672,917.55	-235,588,099.70
1.利息收入	437,905.71	704,779.20
其中:存款利息收入	437,905.71	704,779.20
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收人	-	-
买人返售金融资产收人	-	-
其他利息收入	-	-
2投资收益(损失以"-"填列)	-575,720,087.70	-245,584,800.38
其中:股票投资收益	-578,057,303.47	-250,401,200.88
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	2,337,215.77	4,816,400.5
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	288,586,874.13	9,291,921.4
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	
5.其他收入(损失以"-"号填列)	22,390.31	
减:二、费用	10,761,139.46	17,576,013.4
1. 管理人报酬	7,200,276.47	12,697,581.4
2. 托管费	1,584,060.93	2,793,467.8
3. 销售服务费	-	
 交易费用 	1,592,314.97	1,584,157.2
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	384,487.09	500,807.0
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-297,434,057.01	-253,164,113.1
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-297,434,057.01	-253,164,113.1

() J						
	E 动表				•	
II:	旨数分级	证券投资	基?	金		
₹20	18年6月3	30日				
				单位:人民	币:	
	2018	本期 F1月1日至20	18年6	月30日		
	实收基金	未分配利	润	所有者权益合计	1	
	1,687,159, 972.86	242,672,4	87.31	1,929,832, 460.17	1	
	-	-297,434,0	67.01	-297,434,057.01		
-49	7,619,316.43	-17,495,5	62.44	-515,114,878.87		
12	2,925,377.75	10,117,2	62.66	133,042,640.41	1	
-62	0,544,694.18	-27,612,8	25.10	-648,157,519.28	1	
	-		-	-	1	
	1,189,540, 656.43	-72,257,1	32.14	1,117,283, 524.29		
	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日					
	实收基金	未分配利	润	所有者权益合计	1	
	2,036,417, 123.79	755,547,7	92.27	2,791,964, 916.06		
	-	-253,164,1	13.15	-253,164,113.15		
-30	6,485,213.67	-121,372,9	97.46	-429,858,211.13		
27	1,388,183.55	99,049,9	23.15	370,438,106.70	1	
-57	9,873,397.22	-220,422,9	20.61	-800,296,317.83	1	
	-		-	-		
	1,727,931, 910.12	381,010,6	81.66	2,108,942, 591.78		
	12 -49 12 -62 11 1 -300 27 -57	2018年 実収基金 1,687,159,972.86 -497,619,31643 -122,925,377.25 -620,544,69418 1,189,540,6643,2017 実収基金 2,036,417,123.79 -308,495,213.67 271,388,183.95 -679,873,307.22	次収基金 未分配利 1,687,159, 152, 242,672,4 - 497,619,31643 - 17,466,5 - 122,925,377,75 - 10,117,2 - 620,544,694,18 27,612,8 - 1,189,540 - 72,257,1 - 1,189,540 - 72,257,1 - 2017年1月1日至20 次収基金 条外配利 2,036,417, 122179 253,164,1 - 308,465,213,67 - 121,372,5 - 579,873,39722 - 220,422,5 - 1,727,931, 991012 3	本期 2018年1月1日至2018年6月 300基金 未分表別例 1.687.1月6 日東2018年6月 1.687.1月6 日東2018年6月 2027.434.057.01 - 227.434.057.01 - 227.434.057.01 - 177.485.562.44 122.925.377.55 10.117.2828.662.44 122.925.377.55 10.117.2828.662.44 123.925.377.56 10.117.2828.66 -620.644.604.18 - 27.612.125.10 1.189.540, -72.277.132.14 1.189.	学位:人民i ************************************	

本报告6.1至6.4,财务报表由下列负责人签署: 本期未和基金管理人负责人:来肖贤,主管会计工作负责人:张丽红,会计机 本基金的情况。 构负责人: 李濮君

64.1 基並基本目的。 申万菱信中证军工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(2014) 350号《关于核准申万菱信中证军工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

360号《关于核准申万菱信申证军工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《申万菱信中证军工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418,642,809.42元,业经普华永道中天会计师事务所传殊普通合伙)普华永道中天验字(2014)第423号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《申万菱信中证军工指数分级证券投资基金基金合同》和《申700年间》于2014年7月24日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为418,799,097.83份基金份额,其中认购资金利息折合156,288.41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《申万菱信中证军工指数分级证券投资基金基金合同》和《申万菱信中证军工指数分级证券投资基金基金合同》和《申万菱信中证军工指数分级证券投资基金基金合同》和《申万菱信中证军工指数分级证券投资基金基金合同》和《申万菱信中证军工指数分级证券投资基金基金合同》和《申万支管中证军工指数分级证券投资基金上基础份额以下简称"申万军工份额",申万菱信中证军工指数分级证券投资基金之基础份额以下简称"申万军工份额。中万军工份额约上接受场内与场外的申购和赎回,但不上市交易,申万军工份份额与申万军工的领额,但不得申请将其场外申购的申万军工份额共存分析。投资者可选择将其在场内申购的申万军工份额和申万军工份额约有中万军工份额约有中万军工份额约有中万军工份额约有时万军工份的第一下军工份额约有时万军工份的第一下军工份额约申万军工份的第一下原则计算:一份申万军工品份额与申万军工品份额的电方军工品份额申请各并为场两的申万军工品份额与中万军工品份额申请各并为场两的申万军工品份额与平军工品份额与市万军工品份额的基金份额净值按如下原则计算:一份申万军工品份额与中万军工品份额的基金份额净值按如下原则计算:一份申万军工品份额与下军工品份额的基金份额净值按如下原则计算工品份额的参考净值与一份申万军工品的数约多考净值与一份申万军工品的数约多考净值与一份申万军工品的数约多考净值与一份申万军工品的数约多考净值与一份申万军工品的数约多考净值与一份申万军工品的数约专员,由于第一位,由下军工品的数约至工品的数约的参考净值与一份申万军工品的数约。

甲刀年上ADT領司甲刀千上BDT領担7億年以下1500年 算:一份申万军工人份额的参考净值与一份申万军工B份额的多条净值 之和等于两份申万军工份额的净值;申万军工A份额每日获得日基准收 之和等于两份申万军工份额的净值。申万军工A份额每日获得日基准收益,申万军工A份额约等的投资盈亏都由申万军工B份额分享与承担。申万军工A份额的约定年收益率为一年期银行定期存款年化利率(税后)+3%,申万军工A份额的纷减净值按该约定年收益率逐日计算,计算出申万军工A份额的基金份额参考净值后,根据申万军工A份额的基金份额参考净值后,根据申万军工A份额的基金份额参考净值后,根据申万军工的额的基金份额参考净值分额参考净值。本基金定期进行份额折算。在每个运作周年的结束日,本基金根据基金合同的规定对申万军工A份额和申万军工份份额进行定期份额折算。将申万军工A份额在运作周年结束日的份额参考净值超出本金1.0000元部分,折算为场内申万军工A份额和申万军工份额接有人,申万军工份份额持有人持有的每2份申万军工份额将按1份申万军工A份额和申万军工份额的分配。经过上述份额折算,申万军工A份额和申万军工份额的基金的和60000和

一个KUT基並近,"P1080%,仅设于%的增强风度仍放料管应成仍放的效广 不低于非现金基金资产的80%,每个交易日日86年扣除股份捐财货合约需 缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期 日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为;中证军工擅数收 益率×95%,4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

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3月24日批准报出。642 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《企业会计准则一基本准则》、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》、《申万菱信中证军工措数分级证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.44所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及介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。6.43 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明本基金2018年0月月0日至至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。

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 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

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。

64.5差错更止的说明
本报告期,本基金未发生会计差错更正事项。
64.6 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[2016]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定增值税就点的通知》、财税 [2016]36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《关于金融机构同业往来等增值税政策有关问题的通知》、财税 [2016]10号《关于金融机构同业往来等增值税政策有关问题的通知》、财税 [2017]90号《关于金融人固定资产进项税额抵扣等增值税政策有关问题的补充通知》,财税 [2017]90号《关于报人固定资产进项税额抵扣等增值税政策有关问题的通知》、财税 [2017]90号《关于租人固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》从 [2017]90号《关于租人固定资产进项税额抵扣等增值税的或策的通知》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还规节分,以资管产品管理人为增值税的统利公、资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应规的,对资管产品管理人营资管产品过程中发生的增值税应规分的,有通用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品管理人国的证明,是纳税的规划、资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减

份的增值税应纳税额由抵减

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,对调债,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

人,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

所得說。
(3) 对基金取得的企业债券利息收人,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、红利收人,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、红利收入继续笔减按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,买人股票不

(1) 香港之上的 征收股票交易印花税。 (6) 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 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

无。 6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

"注下还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月30日

占当期佣金 总量的比例 期末应付佣金余额

金额单位:人民币元

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 性:11-1年的地球以下的时期至平月寿,於日時四十時間分享に日時月 限责任公司收取的证管费,经手载和适用期间内由寿商承担的证券结算 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

关联方名称

			单位:人民	万元
	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1月1日至2017年6月 30日	
	当期发生的基金应支付的管理费	7,200,276.47	12,697,581.41	
	其中:支付销售机构的客户维护费	3,598,015.80	5,452,262.51	
	注:支付基金管理人的管			
	·累计至每月月底,按月支		日基金管理人报酬 =	= 前
 E	∃基金资产净值*1%/当年ラ			
	6.4.8.2.2 基金托管费			
			单位:人民	TTT:

2.793.46728 注:支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值0.22%的 年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日基金托 管费。前一日基金资产净值*0.22%/当年天数。 648.3 与关联方进行银行间回业市场的债券(合回购)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回业 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

0.4.0.4 日天秋/1700小基金町间的 6.48.41 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。 648.42 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的 2018年半年度报告摘要

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 资明细 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

					半世:八氏川川	
	关联方名称 2018年1月1日		明 2018年6月30日		E可比期间 至2017年6月30日	
		期末余額	当期利息收入	期末余額	当期利息收入	
中	国农业银行	100,674,294.67	433,631.53	145,952,285.79	696,008.61	
Ý	主:本基金的	的银行活期存款	次由基金托管	人中国农业	业银行保管,按银	Į
il/li	1/和 家計自					

9加州平日志。 648.6 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

6487 其他关联交易事项的说明

648.71 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。 648.72 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

6.4.9 期末(2018年6日30日) 木其全特有的溶通 马阳证券

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 信単 价	数量(单 位:股)	期末 成本总 額	期末 估值总 额	备注
6036 93	江苏新 能	2018-06 -25	2018-07 -03	网下中签	9.00	9.00	5, 384.00	48, 456.00	48, 456.00	-
6037 06	东方环 宇	2018-06 -29	2018-07 -09	网下中签	13.09	13.09	1, 765.00	23, 103.85	23, 103.85	-
6031 06	芯能科 技	2018-06 -29	2018-07 -09	网下中签	4.83	4.83	3, 410.00	16, 470.30	16, 470.30	-

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票 本基金本报告期末无暂时停牌等流通受限股票 64.9.3 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 。 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

(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 1,019,629,888.73 元, 属于第二层次的余额为 88,030.15 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 对于证券交易所上市的股票和债券, 在出现重大事项导牌、交易不活跃(包括张摩伟的交易不活跃)。或属于非公开发行等情况、基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人第一层次, 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

(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

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。

融负债,其账而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,暂通刑人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂通用简易计税方法,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的,不再缴纳;但缴纳增值税的,不每%,完备收增值税的,不均规,管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《关于租人固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对管管产

90号《关于租人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

允价值和增值税外,截至资产负债表日本基金无需要说明

金额单位:人民币元

投资组合报告 7.1 期末基金资产组合情况

序号	项目	金額	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,019,717,918.88	90.98
	其中:股票	1,019,717,918.88	90.98
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	买人返售金融资产	-	-
	其中: 买断式回购的买人返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	100,695,512.91	8.98
8	其他各项资产	439,526.19	0.04
9	合计	1,120,852,957.98	100.00
7.2	本基金未开通港股通交易机报告期末按行业分类的股票 报告期末按行业分类的股票	票投资组合	
	行政 古外1水1女1 並力・矢口15月 行业米別	公会价值(元)	□ 占基全资产净值比例(%)

Α	农、林、牧、渔业	-	-
В	采矿业	-	-
C	制造业	946,920,036.44	84.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,559.85	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
Н	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	72,645,096.45	6.50
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	_
N	水利、环境和公共设施管理业	81,226.14	0.01
0	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	-	-
S	综合	-	_

72.2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

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	601989	中国重工	23,658,821.00	95,581,636.84	8.55
2	000768	中航飞机	4,063,952.00	63,560,209.28	5.69
3	600893	航发动力	2,641,907.00	58,967,364.24	5.28
4	002179	中航光电	1,160,989.00	45,278,571.00	4.05
5	600879	航天电子	6,386,356.00	44,896,082.68	4.02
6	600482	中国动力	2,545,350.00	44,416,357.50	3.98
7	600760	中航沈飞	1,230,550.00	44,349,022.00	3.97
8	002465	海格通信	4,741,667.00	38,075,586.01	3.41
9	002268	卫士通	1,722,744.00	37,607,501.52	3.37
10	600038	中直股份	865,266.00	34,601,987.34	3.10

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

金額单位:人民市元 本期累计买人金额 占期初基金资产 海值比例(%)

開初基金资产 ▶值比例(%)	本期累计买入金额	股票名称	股票代码	序号
2.37	45,658,231.06	中航沈飞	600760	1
0.92	17,789,876.81	中国重工	601989	2
0.86	16,663,903.32	卫士通	002268	3
0.53	10,146,263.99	航天电子	600879	4
0.52	9,963,352.24	中直股份	600038	5
0.43	8,352,109.72	内蒙一机	600967	6
0.32	6,224,607.80	航发动力	600893	7
0.32	6,217,647.00	中航飞机	000768	8
0.31	5,955,630.68	北斗星通	002151	9
0.26	5,013,238.15	火炬电子	603678	10
0.26	4,934,416.67	中国动力	600482	11
0.25	4,908,673.00	国睿科技	600562	12
0.24	4,541,294.69	中航光电	002179	13
0.22	4,306,557.00	海格通信	002465	14
0.21	4,139,984.50	航天科技	000901	15
0.21	3,999,814.00	欧比特	300053	16
0.19	3,647,791.00	广哈通信	300711	17
0.18	3,564,389.00	中国卫星	600118	18
0.18	3,561,453.41	高德红外	002414	19
0.16	3,173,651.47	中航机电	002013	20

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	601989	中国重工	62,154,367.99	3.22
2	002049	紫光国微	61,538,383.24	3.19
3	600150	*ST船舶	40,914,081.60	2.12
4	600435	北方导航	31,859,082.97	1.65
5	300159	新研股份	23,077,646.29	1.20
6	600893	航发动力	22,751,524.84	1.18
7	600482	中国动力	21,753,462.22	1.13
8	000768	中航飞机	20,031,603.54	1.04
9	600316	洪都航空	17,042,950.42	0.88
10	000519	中兵红箭	16,985,323.47	0.88
11	002465	海格通信	16,166,849.58	0.84
12	600765	中航重机	14,756,332.82	0.76
13	002179	中航光电	14,710,862.12	0.76
14	600343	航天动力	14,435,274.23	0.78
15	600879	航天电子	13,966,815.65	0.72
16	600391	航发科技	13,562,191.77	0.70
17	300045	华力创通	13,061,065.89	0.68
18	600855	航天长峰	12,417,125.34	0.64
19	600118	中国卫星	12,284,307.08	0.60
20	600677	航天通信	12,233,325.87	0.63

無出限期的效人(成文) 2周期 注:"买人金额"、"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

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

乔汉钦明细 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

贵金属及资明细 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

[6]到 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 7.101 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 本基金本报告期未投资股指期货。 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

根据本基金基金合同,本基金不能投资于国债期货。 7.11.2 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,本基金不能投资于国债期货。 7113 本期国债期货投资评价

7.11.3 本期国债期货投资评价 根据本基金基金合同,本基金不能投资于国债期货。 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的情形。本基金投资的前十名证券的发行主体除中国动力 (600482.SH)外,在报告编制日前一年内没有受到公开谴责和处罚的

上海证券交易所于2018年1月10日发布了"《关于对中国船舶重工集团动力股份有限公司及有关责任人予以纪律处分的决定》的公告"。 经查明,公司未按要求及时披露2016年年度业绩预告和大额政府补助

信息,上海证券交易所为此对公司予以通报批评。中国动力为本基金的业绩基准"中证军工指数"的成份股,因为本基金为采用完全复制方式被动跟踪标的指数的基金产品,所以中国动力

受到上海证券交易所批评的情形不会影响本基金的投资决策 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

7.12.3期末其他各项资产构成

单位:人民币元

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 木其全木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 期末基金份额持有人户数及持有人结构

7.12.4期末持有的处于转股期的可转换债券明约

			持有人结构					
份額级别	持有人户 数(户)	户均持有的基	机构投	机构投资者		者		
	303()-1)	金份額	持有份额	占总份额比 例	持有份额	占总份额 比例		
申万军工	90,299	11,772.42	14,123, 676.78	1.33%	1,048,913, 873.71	98.67%		
军工A级	766	58,189.06	30,145, 723.00	67.63%	14,427,094.00	32.37%		
军工B级	17,236	2,586.03	414,990.00	0.93%	44,157,827.00	99.07%		
合计	106,381	10,830.72	44,684, 389.78	3.88%	1,107,498, 794.71	96.12%		
	有人户				持有人户数的	的总和,5		
			フロルせ ヘ ハ					

份额单位:份

8.2 期末上市基金前十名持有人

	77.17.4.117.	101100101101	1)199110
1	新华人寿保险股份有限公司	13,661,333.00	30.6
2	中国银河证券股份有限公司	6,407,912.00	14.3
3	富国基金 - 广发银行 - 中信证券股份有限公司	3,121,425.00	7.0
4	李怕名	2,568,406.00	5.5
Б	丁碧霞	2,382,948.00	5.3
6	民生加银基金 - 广州农商银行 - 中信证券股份有限公司	1,367,100.00	3.0
7	孟本先	1,011,806.00	2.5
8	深圳市九州风险管理有限公司	952,954.00	2.7
9	高群亮	890,000.00	2.0
10	中国太平洋财产保险 - 传统 - 普通保险产品-013C-CT001深	779,645.00	1.5
注	:以上数据由中国证券登记结算有限责任	公司提供。	
军:	工B级		

10 ESTIVE			29	0,173.00	U20076
注:以上数据由中	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	沅	
项目	份物研级到	持有份	額总数(份)	占基金总份额	新比例
	申万军工		-		-
基金管理人所有从业人	军工A级		-		-
员持有本基金	军工B级		-		-
	合计		-		-
注: 分级基金管	理人的从业人员	持有基	基金总份额	近比例的 计	上算中,x
下属分级基金,比例的	的分母采用各自	级别的	份额,对台	计数,比	例的分E

采用下属分级基金份额的合计数(即期末基金份额总额) 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

9开放式基金份额变动 单位:份

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

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 监事由长岭干梯先生变更为粮信贵树先生。 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 招告期内太其会管理人的其会投资策略严格遵循太其会《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

混合例外外基础等用自于小园产人区划》等另所(10.4 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 成交金额 佣金

选择的标准:1. 经营行为规范, 在访 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

11 影响投资者决策的其他重要信息 根据本基金《基金合同》的约定,当本基金之B 类份额(申万军工B份额)的基金份额参考净值达到或跌破 0.2500 元时,申万军工份额、

申万军工品 份额和申万军工B 份额将进行不定期份额折算。截至2018 年2 月6日,申万军工B 份额的基金份额参考净值为0.2402元,达到基金合同规定的不定期份额折算条件。根据基金合同以及深圳证券交 易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定,本基金以2018年2月7日为基准日办理了不定期份额折算业务。详见本基金管理人于2018年2月7日、2月8日、2月9日发布的公告。 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

据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》的,应当在《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,本基金管用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件。 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