

申万菱信中证环保产业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、监事会对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。

本基金年度报告经审计。审计意见为“标准无保留意见”。审计报告于2018年8月20日复核了本报告中的财务指标、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信原则、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。

基金经理的过往业绩并不代表其未来表现,投资人应谨慎选择。

本半年度报告摘要请见半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务数据未经审计。

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	申万菱信中证环保产业指数分级
场内简称	申万环保
基金代码	663114
交易代码	663114
基金规模方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014/05/0301
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
报告期末基金资产总额	946,713,440.029
基金类别	股票型
基金的运作周期	不定期
基金上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2014年10月16日
下属分级基金的基金简称	申万环保 环保A 环保B
下属分级基金的场内简称	申万环保 环保A 环保B
下属分级基金的交易代码	163114 160184 160186
报告期末下属分级基金的份额总额	462,196,894.829 106,756,773.000 76,756,773.000

2.2 基金产品概况

投资目标 本基金采取指数投资方式,通过严格的投资纪律和数量化风险管理手段,力争在扣除基金操作费用后,在相对准确地跟踪标的指数的基础上获得超越标的指数的回报。

投资策略 本基金将主要通过投资于具有良好流动性的金融工具,包括股票、债券、货币市场工具等,以期在有效控制风险的前提下,实现基金资产的长期增值。

业绩比较基准 中证环保产业指数×4%+银行存款利率(税后)

风险收益特征 本基金为股票型基金,其预期风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

风险等级 中风险

费率结构 申购费率为0.5%;赎回费率为0.5%;申购金额在100万元以上的,申购费率为0.3%;赎回金额在100万元以上的,赎回费率为0.3%。

基金管理人和基金托管人

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

基金名称:申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金

基金代码:163114

交易代码:163114

基金规模方式:契约型开放式

基金合同生效日:2014/05/0301

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

报告期末基金资产总额:462,196,894.829 106,756,773.000 76,756,773.000

报告期末基金资产净值:462,196,894.829 106,756,773.000 76,756,773.000

报告期末基金份额总额:462,196,894.829 106,756,773.000 76,756,773.000

报告期末基金份额净值:1.0000 1.0000 1.0000

报告期末基金份额:462,196,894.829 106,756,773.000 76,756,773.000

报告期末基金份额总额:462,196,894.829 106,756,773.000 76,756,773.000

报告期末基金份额净值:1.0000 1.0000 1.0000

报告期末基金份额:462,196,894.829 106,756,773.000 76,756,773.000

报告期末基金份额总额:462,196,894.829 106,756,773.000 76,756,773.000

报告期末基金份额净值:1.0000 1.0000 1.0000

报告期末基金份额:462,196,894.829 106,756,773.000 76,756,773.000

报告期末基金份额总额:462,196,894.829 106,756,773.000 76,756,773.000

报告期末基金份额净值:1.0000 1.0000 1.0000

报告期末基金份额:462,196,894.829 106,756,773.000 76,756,773.000

报告期末基金份额总额:462,196,894.829 106,756,773.000 76,756,773.000

报告期末基金份额净值:1.0000 1.0000 1.0000

报告期末基金份额:462,196,894.829 106,756,773.000 76,756,773.000

报告期末基金份额总额:462,196,894.829 106,756,773.000 76,756,773.000

报告期末基金份额净值:1.0000 1.0000 1.0000

报告期末基金份额:462,196,894.829 106,756,773.000 76,756,773.000

报告期末基金份额总额:462,196,894.829 106,756,773.000 76,756,773.000

报告期末基金份额净值:1.0000 1.0000 1.0000

报告期末基金份额:462,196,894.829 106,756,773.000 76,756,773.000

报告期末基金份额总额:462,196,894.829 106,756,773.000 76,756,773.000

报告期末基金份额净值:1.0000 1.0000 1.0000

报告期末基金份额:462,196,894.829 106,756,773.000 76,756,773.000

报告期末基金份额总额:462,196,894.829 106,756,773.000 76,756,773.000

报告期末基金份额净值:1.0000 1.0000 1.0000

报告期末基金份额:462,196,894.829 106,756,773.000 76,756,773.000

报告期末基金份额总额:462,196,894.829 106,756,773.000 76,756,773.000

报告期末基金份额净值:1.0000 1.0000 1.0000

报告期末基金份额:462,196,894.829 106,756,773.000 76,756,773.000

报告期末基金份额总额:462,196,894.829 106,756,773.000 76,756,773.000

报告期末基金份额净值:1.0000 1.0000 1.0000

报告期末基金份额:462,196,894.829 106,756,773.000 76,756,773.000

报告期末基金份额总额:462,196,894.829 106,756,773.000 76,756,773.000

报告期末基金份额净值:1.0000 1.0000 1.0000

报告期末基金份额:462,196,894.829 106,756,773.000 76,756,773.000

报告期末基金份额总额:462,196,894.829 106,756,773.000 76,756,773.000

报告期末基金份额净值:1.0000 1.0000 1.0000

报告期末基金份额:462,196,894.829 106,756,773.000 76,756,773.000

报告期末基金份额总额:462,196,894.829 106,756,773.000 76,756,773.000

报告期末基金份额净值:1.0000 1.0000 1.0000

报告期末基金份额:462,196,894.829 106,756,773.000 76,756,773.000

报告期末基金份额总额:462,196,894.829 106,756,773.000 76,756,773.000

报告期末基金份额净值:1.0000 1.0000 1.0000

报告期末基金份额:462,196,894.829 106,756,773.000 76,756,773.000

报告期末基金份额总额:462,196,894.829 106,756,773.000 76,756,773.000

报告期末基金份额净值:1.0000 1.0000 1.0000

报告期末基金份额:462,196,894.829 106,756,773.000 76,756,773.000

报告期末基金份额总额:462,196,894.829 106,756,773.000 76,756,773.000

报告期末基金份额净值:1.0000 1.0000 1.0000

报告期末基金份额:462,196,894.829 106,756,773.000 76,756,773.000

报告期末基金份额总额:462,196,894.829 106,756,773.000 76,756,773.000

报告期末基金份额净值:1.0000 1.0000 1.0000

报告期末基金份额:462,196,894.829 106,756,773.000 76,756,773.000

报告期末基金份额总额:462,196,894.829 106,756,773.000 76,756,773.000

报告期末基金份额净值:1.0000 1.0000 1.0000

报告期末基金份额:462,196,894.829 106,756,773.000 76,756,773.000

报告期末基金份额总额:462,196,894.829 106,756,773.000 76,756,773.000

报告期末基金份额净值:1.0000 1.0000 1.0000

报告期末基金份额:462,196,894.829 106,756,773.000 76,756,773.000

报告期末基金份额总额:462,196,894.829 106,756,773.000 76,756,773.000

报告期末基金份额净值:1.0000 1.0000 1.0000

报告期末基金份额:462,196,894.829 106,756,773.000 76,756,773.000

报告期末基金份额总额:462,196,894.829 106,756,773.000 76,756,773.000

报告期末基金份额净值:1.0000 1.0000 1.0000

报告期末基金份额:462,196,894.829 106,756,773.000 76,756,773.000

报告期末基金份额总额:462,196,894.829 106,756,773.000 76,756,773.000

报告期末基金份额净值:1.0000 1.0000 1.0000

报告期末基金份额:462,196,894.829 106,756,773.000 76,756,773.000

报告期末基金份额总额:462,196,894.829 106,756,773.000 76,756,773