

申万菱信新能源汽车主题灵活配置混合型证券投资基金

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：二〇一七年三月三日

§ 1 重要提示及目录

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3月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务计划报告、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。投资者在作出投资决策前，请仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自2016年1月1日起至2016年12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|-----------|--------------------------|
| 基金名称 | 申万菱信新能源汽车主题灵活配置混合型证券投资基金 |
| 基金代码 | 001156 |
| 交易代码 | 001156 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2016年9月7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 |
| 报告期末基金总资产 | 698,212,614.84份 |
| 基金合同的存续期 | 不适用 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 本基金主要投资受益于新能源汽车产业的上市公司股票,采用积极主动的分散化投资策略,在严控投资风险的基础上,力求为基金份额持有人获取超越行业基准的收益。 |
| 投资策略 | 本基金主要投资受益于新能源汽车产业的上市公司股票,严控风险并力求基金资产的长期稳定增值。 |
| 业绩比较基准 | 50%×中证新能源汽车指数+50%×沪深300指数 |
| 风险收益特征 | 本基金以新能源汽车为主的投资组合,其预期收益及预期风险水平均高于股票基金,低于股票型基金,属于中高预期收益和较高风险水平的投资品种。 |

2.3 基金管理人及基金托管人

| 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 |
| 姓名 | 王伟群 | 林葛 |
| 信息披露负责人 | 021-23201198 | 010-66000009 |
| 电子邮箱 | service@wlfund.com | tgxpl@abcmail.com |
| 客户服务电话 | 4000900958 | 96999 |
| 传真 | 021-23201109 | 010-68121816 |

2.4 信息披露方式

| | |
|------------------|-----------------------|
| 登载基金年度报告的管理人互联网址 | http://www.wlfund.com |
|------------------|-----------------------|

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 利润数据和报告期 | 2016年 | 2015年1月1日至2016年12月31日 |
|----------------|----------------|-----------------------|
| 本期实现收益 | -44,141,416.00 | -56,954,850.04 |
| 本期利润 | -47,905,728.42 | -56,336,027.71 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0076 | -0.0067 |
| 本期基金份额净值 | -3.00% | -3.00% |
| 期末可供分配基金份额 | -0.0062 | -0.0040 |
| 期末基金财产净值 | 637,662,377.00 | 944,941,534.23 |
| 期末基金财产净值 | 0.913 | 0.970 |

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）扣减相关费用后的余额，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剔除了基金管理的管理费、托管费和各项交易费用，但不包括持有人认购或申购基金的各项费用（例如：申购费、赎回费等），认人申购或交易基金的各项费用后，实际收益水平将低于所列数字。

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 | 业绩比较基准收益率 | 业绩比较基准收益率 | ①-③ | ②-④ |
|-------------|---------|-----------|-----------|-------|---------|
| 过去三个月 | -15.1% | 0.14% | -2.64% | 0.50% | 1.13% |
| 过去六个月 | -45.0% | 2.4% | -7.11% | 0.67% | 2.61% |
| 过去一年 | -5.9% | 0.44% | -8.09% | 1.11% | 2.21% |
| 自基金合同生效日起至今 | -87.0% | 0.50% | -3.13% | 1.37% | -11.83% |

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)=50%*中证新能源汽车指数(t)/中证综合债指数(t-1)-(1-50%*中证新能源汽车指数(t-1)-1);

benchmark(t)=(1+benchmark(0)* benchmark(t-1)；

其中t=1,2,3,...

3.2.2 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比较

申万菱信新能源汽车主题灵活配置混合型证券投资基金

自基金合同生效以来份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历

史走势图（见图2）

（2015年6月7日至2016年12月31日）

3.2.3 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较

注：2015年数据按基金合同生效当年实际存续期计算，未按整个自然年度计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

自基金成立至本报告期末，本基金未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理的情况

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中外合资基金管理公司。公司成立于2004年1月16日，注册资本在中国上海，注册资本为15亿元人民币。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2016年12月31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27只开放式基金，形成了完善的产品线。公司旗下基金管理资产规模超过340亿元人民币，客户数超过592万户。

4.1.2 基金经理（或基金经理助理）及基金经理助理的简介

姓名

职务

性别

学历

工作年限

说明

王伟群

基金经理

男

硕士

12年

申万菱信基金管理有限公司基金经理，拥有12年证券从业经验。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

4.2.1 管理人对报告期内本基金运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金的投资政策、基金资产净值的计算、基金费用的开支及利润的分配等，对本基金的利润分配做出了明确规定，本基金在报告期内不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.2.2 管理人对报告期内本基金投资组合报告的说明

本基金在报告期内未进行投资组合报告的编制。

4.3 管理人对报告期内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 报告期内本基金运作合规情况说明

在托管本基金的过程中，本基金管理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申万菱信基金管理有限公司2016年1月1日至2016年12月31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、基金费用的开支及利润的分配等方面，均按照基金合同的约定，没有损害基金份额持有人利益的行为；在报告期

内，严格执行了相关法律法规、部门规章、规范性文件和《基金合同》、《托管协议》的规定，没有损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 过去三年基金的利润分配情况

自基金成立至今，本基金未进行利润分配。

§ 6 审计报告

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

审计报告

6.1 审计报告

6.1.1 审计报告基本信息

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

审计机构：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

审计报告文号：普华永道中天审字(2017)第21703号

审计报告日期：2017年3月28日

6.1.2 审计报告意见类型

审计报告意见：审计报告意见：无保留意见。

6.1.3 审计报告摘要

6.1.4 审计报告结论

6.1.5 审计报告附注

6.2 审计报告

6.2.1 审计报告

6.2.2 审计报告

6.2.3 审计报告

6.2.4 审计报告

6.2.5 审计报告

6.2.6 审计报告

6.2.7 审计报告

6.2.8 审计报告

6.2.9 审计报告

6.2.10 审计报告

6.2.11 审计报告

6.2.12 审计报告

6.2.13 审计报告

6.2.14 审计报告

</