

申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金

基金托管人：申万菱信基金管理有限公司

基金管理人：中证金牛资产管理有限公司

报告送达日期：二〇一七年三月三十日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金持有人的基金份额，基金管理人和基金托管人不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对基金的合法性和合规性承担责任；基金持有人对基金的合法性和合规性承担责任。

对于境外同行业交易，我们分析了本报告期内不同时间间隔的境内（日内、3 日内和 6 日内）两档组合对交易的价差率，对交易价格公允价格交易对手，未发现利益输送的情况。

对于反向交易，我们根据交易价格、交易频率、交易数量等进行了综合分析，未发现异常情况。

综合分析，本公司通过事前的制度规范、事后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，未发现违反公平交易制度的情形。

4.2.3 异常交易行为的专项说明

本公司未确定了异常交易行为的界定标准及对异常交易行为的处理方法。

基金管理人和托管人根据中国证监会发布的《关于完善证券投资基金交易行为监管机制的指导意见》，对报告期内公司旗下所有投资组合进行了逐日监控和定期核查。

基金管理人和托管人对报告期内公司旗下所有投资组合进行了逐日监控和定期核查，未发现异常情况，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人和托管人以诚信为原则、勤勉尽责的原则管理基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金管理人过往业绩并不代表其未来表现。投资人应在投资决策前仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告年度报告摘要年度报告正文，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

申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金

申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金

基金合同生效日：2013年1月13日

基金托管人：中证金牛资产管理有限公司

基金名称：申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金

基金简称：申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金

基金代码：163113

基金类型：股票型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同终止日：2014年1月13日

基金管理人：中证金牛资产管理有限公司

基金托管人：中证金牛资产管理有限公司

基金名称：申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金

基金简称：申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金

基金代码：163113

基金类型：股票型证券投资基金

基金运作方式：契约