申万菱信中小板指数证券投资基金(LOF) 2019年半年度报告摘要

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：二〇一九年八月二十四日

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2019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2019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	161,182,624.02份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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、个别成份股停牌或者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。

2.3 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	贺倩
	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 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2019年1月1日至2019年6月30日）
本期已实现收益	-2,360,531.65
本期利润	25,044,087.79
加权平均基金份额本期利润	0.1597
本期加权平均净值利润率	17.97%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0063
期末基金资产净值	144,187,993.63
期末基金份额净值	0.8946

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 基金净值表现

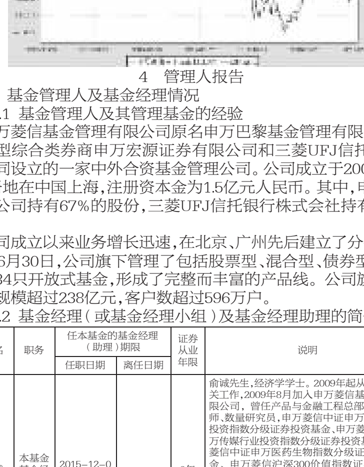
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	3.78%	1.33%	3.55%	1.36%	0.23%	-0.03%
过去三个月	-9.43%	1.70%	-10.42%	1.74%	0.99%	-0.04%
过去六个月	20.44%	1.69%	19.75%	1.73%	0.69%	-0.04%
过去一年	-9.40%	1.69%	-11.56%	1.70%	2.16%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-8.05%	1.41%	-10.55%	1.42%	2.50%	-0.01%

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2019年6月30日）



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2019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34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238亿元，客户数超过596万户。

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		
俞诚	本基金基金经理	2015-12-03	-	9年	俞诚先生，经济学学士。2009年起从事金融相关工作，2009年8月加入申万菱信基金管理有限公司，曾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、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、申万菱信价值优享混合型证券投资基金基金经理，现任申万菱信中小板指数证券投资基金（LOF）、申万菱信中证500指数增强型证券投资基金基金经理。
龚丽丽	本基金基金经理	2017-12-26	-	8年	龚丽丽女士，硕士研究生。2011年起从事金融相关工作，曾任华泰柏瑞基金研究员、专户经理、基金经理等。2017年08月加入申万菱信基金管理有限公司，现任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、申万菱信深证成指分级证券投资基金、申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金、申万菱信上证50交易型开放式指数发起式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《公平交易办法》，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《异常交易监控与报告办法》，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1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的说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2019年上半年，尽管中间受中美贸易冲突影响市场波动较大，但A股整体表现亮眼。其中，上证综指和深成指涨幅分别为19.45%和26.78%。市场风格方面，一方面，大盘蓝筹仍是市场核心配置方向，其中上证50涨幅27.80%，沪深300上涨27.07%；另一方面，受益于政策和风险偏好好转，成长股整体表现不俗，其中中小板指和创业板指上半年涨幅分别为20.75%、20.87%。

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：1）长期停牌股票估值调整；2）指数成分股定期调整。

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。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2019年上半年中小板指期间表现为20.75%，基金业绩基准表现为19.75%，申万菱信中小板指数证券投资基金净值期间表现为20.44%，领先业绩基准0.69%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于2019年上半年股市上涨的驱动力，我们理解主要源自对于2018年对于A股过分悲观下杀带来和估值修复，以及政策和流动性好转带来的中级反弹行情。对于2019年下半年的投资逻辑并未发生根本性转变。

盈利方面，在全球经济放缓，以及国内或将维持"结构性去杠杆"的长期政策目标的大背景下，拐点短期较难出现。但政策边际改善，"逆周期调节"支撑下，完成经济增长目标概率较高。特别是，并购重组对于中小创股的外延增速拖累已逐步改善。考虑市场本身对于经济下行已经充分预期，因此盈利对股市下拉风险不大。

年初以来多项政策适度放松表明"政策底"，有助于抬升市场流动性和情绪。对于中美贸易摩擦长期化已达成市场共识。其对于市场的冲击从时间和强度上有望边际弱化。

基于此，下半年投资线索可遵循两个方面：一方面，切合当前经济发展阶段，具有盈利支撑和符合资金偏好的标的，如消费股，蓝筹、龙头股等；另一方面，受益于政策推动，以5G为代表的成长股。特别是随之科创板的推出，其对中小创映射效应值得关注。

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分管基金运营的副总经理，督察长，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15年的基金行业运营、财务管理相关经验；督察长王菲萍女士，拥有15年的基金行业合规管理经验；分管基金投资的副总经理张少华先生，拥有15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18年的基金会计经验；监察稽核部总监牛锐女士，拥有15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14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

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2019年01月01日至2019年06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 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：2019年6月30日

单位：人民币元

资产	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
资产：	-	-
银行存款	10,501,464.91	9,178,362.34
结算备付金	62,388.76	40,899.82
存出保证金	11,101.91	13,145.48
交易性金融资产	134,175,649.75	106,019,662.00
其中：股票投资	134,175,649.75	106,019,662.00
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	2,102.89	2,342.76
应收股利	-	-
应收申购款	168,356.63	150,714.47
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	144,921,064.85	115,405,126.87
负债和所有者权益	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018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	-	476,831.76
应付赎回款	460,905.98	64,379.65
应付管理人报酬	74,466.01	65,476.64
应付托管费	13,747.59	12,088.02
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	35,684.22	31,146.30
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	148,267.42	112,659.50
负债合计	733,071.22	762,581.87
所有者权益：	-	-
实收基金	118,778,255.07	113,739,730.16
未分配利润	25,409,738.56	902,814.84
所有者权益合计	144,187,993.63	114,642,545.00
负债和所有者权益总计	144,921,064.85	115,405,126.87

注：报告截止日2019年6月30日，基金份额净值0.8946元，基金份额总额161,182,624.02份。

6.2 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：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
一、收入	25,813,857.91	-17,117,114.68
1.利息收入	39,288.18	37,368.74
其中：存款利息收入	39,288.18	37,356.39
债券利息收入	-	12.35
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）	-1,733,879.32	-966,292.39
其中：股票投资收益	-2,774,007.45	-1,708,626.64
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	23,393.68
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	1,040,128.13	718,940.57
3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列）	27,404,619.44	-16,227,990.56
4.汇兑收益（损失以"-"号填列）	-	-
5.其他收入（损失以"-"号填列）	103,829.61	39,799.53
减：二、费用	769,770.12	707,612.58
1. 管理人报酬	447,223.29	413,010.10
2. 托管费	82,564.24	76,248.03
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	82,264.24	73,723.60
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	157,718.35	144,630.85
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）	25,044,087.79	-17,824,727.26
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以"-"号填列）	25,044,087.79	-17,824,727.26

6.3 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：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019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）	113,739,730.16	902,814.84	114,642,545.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	25,044,087.79	25,044,087.79
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）	5,038,524.91	-537,164.07	4,501,360.84
其中：1.基金申购款	46,333,369.08	10,635,291.89	56,968,660.97
2.基金赎回款	-41,294,844.17	-11,172,455.96	-52,467,300.13
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）	118,778,255.07	25,409,738.56	144,187,993.63
项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018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）	83,234,944.13	44,897,506.77	128,132,450.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-17,824,727.26	-17,824,727.26
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）	19,052,619.08	7,699,222.15	26,751,841.23
其中：1.基金申购款	39,889,571.18	18,471,966.59	58,361,537.77
2.基金赎回款	-20,836,952.10	-10,772,744.44	-31,609,696.54
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）	102,287,563.21	34,772,001.66	137,059,564.87

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：

基金管理人负责人：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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

申万菱信中小板指数证券投资基金(LOF)(以下简称"本基金")是由申万菱信中小板指数分级证券投资基金转型而来。根据《申万菱信中小板指数分级证券投资基金基金合同》，原申万菱信中小板指数分级证券投资基金为契约型基金，基金合同生效后5年期届满。根据《关于申万菱信中小板指数分级证券投资基金分级运作期到期基金转换结果的公告》，原申万菱信中小板指数分级证券投资基金于2017年5月8日(基金份额转换基准日)日终，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)"。本基金为契约型开放式基金，存续期间不定。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)（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)（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)（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(以下简称"深交所")深证上[2017]325号核准，本基金申万菱信中小板指数(LOF)份额201,492,154.00份(截至2017年5月19日)于2017年5月26日在深交所挂牌交易。

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2019年8月23日批准报出。

6.4.2 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证券投资基金(LOF)基金合同》和在财务报表附注6.4.4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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2019年01月01日至2019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2019年6月30日的财务状况以及2019年01月01日至2019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。

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一致的说明

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。

6.4.5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。

6.4.6 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[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》、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》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》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应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。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，暂适用简易计税方法，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行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月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。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。

(5) 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费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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变化的情况

无。

6.4.7.2 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。

6.4.8 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

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	23,392,216.40	42.02%	6,261,295.07	11.08%

6.4.8.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019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	21,317.50	42.02%	19,064.85	53.43%
关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	5,705.58	11.08%	1,451.05	4.12%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	447,223.29	413,010.10
其中：支付销售机构的客户维护费	133,349.36	92,835.23

注：支付基金管理人申万菱信的管理人报酬按前一日基金资产净值0.65%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：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值 × 0.65%/ 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	82,564.24	76,248.03

注：支付基金托管人中国农业银行的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：

日托管费＝前一日基金资产净值 × 0.12%/ 当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)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同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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。

6.4.8.4.2 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投资本基金。

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

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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
中国农业银行股份有限公司	10,501,464.91	38,752.59	12,180,583.15	36,579.38

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。

6.4.8.6 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销的证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

6.4.8.7.1 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。

6.4.8.7.2 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

无。

6.4.9 期末（2019年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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
300788	中信出版	2019-06-27	2019-07-05	网下新股申购	14.85	14.85	1,556.00	23,106.60	23,106.60	-

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3 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余额。

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

于2019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 134,152,543.15 元，属于第二层次的余额为 23,106.60 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

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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2019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)其他

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 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	134,175,649.75	92.59
	其中：股票	134,175,649.75	92.59
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	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	10,563,853.67	7.29
8	其他各项资产	181,561.43	0.13
9	合计	144,921,064.85	100.00

注：本基金未开通港股通交易机制投资于港股。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1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	3,954,049.00	2.74
B	采矿业	-	-
C	制造业	80,576,442.27	55.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	441,001.00	0.31
E	建筑业	2,220,633.23	1.54
F	批发和零售业	4,196,971.68	2.91
G	交通运输、仓储和邮政业	3,194,823.08	2.22
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,432,665.57	11.40
J	金融业	12,189,051.68	8.45
K	房地产业	1,276,739.52	0.89
L	租赁和商务服务业	5,768,959.32	4.00
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	778,491.00	0.54
Q	卫生和社会工作	2,058,820.00	1.43
R	文化、体育和娱乐业	1,087,002.40	0.75
S	综合	-	-
	合计	134,175,649.75	93.06

7.2.2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。

7.3 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	275,751.00	7,605,212.58	5.27
2	002304	洋河股份	43,701.00	5,312,293.56	3.68
3	002475	立讯精密	191,394.00	4,744,657.26	3.29
4	002027	分众传媒	868,473.00	4,594,222.17	3.19
5	002142	宁波银行	184,199.00	4,464,983.76	3.10
6	002230	科大讯飞	123,740.00	4,113,117.60	2.85
7	002594	比亚迪	65,080.00	3,300,857.60	2.29
8	002024	苏宁易购	270,216.00	3,102,079.68	2.15
9	002714	牧原股份	52,700.00	3,098,233.00	2.15
10	002202	金风科技	205,861.00	2,558,852.23	1.77

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	占期初基金资产净值比例（%）
1	002027	分众传媒	1,845,410.00	1.61
2	002415	海康威视	1,187,781.47	1.04
3	002299	圣农发展	821,736.00	0.72
4	002926	华西证券	763,580.00	0.67
5	002607	中公教育	758,744.00	0.66
6	002180	纳思达	750,259.00	0.65
7	002007	华兰生物	645,799.00	0.56
8	002304	洋河股份	643,904.00	0.56
9	002714	牧原股份	626,136.00	0.55
10	002773	康弘药业	623,672.00	0.54
11	002475	立讯精密	585,827.00	0.51
12	002405	四维图新	573,938.00	0.50
13	002142	宁波银行	573,847.00	0.50
14	002399	海普瑞	546,320.00	0.48
15	002230	科大讯飞	533,580.00	0.47
16	002202	金风科技	529,686.16	0.46
17	002044	美年健康	517,251.00	0.45
18	002468	申通快递	513,590.00	0.45
19	002938	鹏鼎控股	496,953.00	0.43
20	002555	三七互娱	487,657.00	0.43

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值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	占期初基金资产净值比例（%）
1	002450	*ST康得	1,325,592.00	1.16
2	002415	海康威视	1,148,196.00	1.00
3	002221	东华能源	872,700.00	0.76
4	002185	华天科技	815,364.84	0.71
5	002273	水晶光电	703,963.65	0.61
6	002007	华兰生物	685,493.00	0.60
7	002304	洋河股份	659,239.00	0.58
8	002142	宁波银行	649,104.00	0.57
9	002405	四维图新	616,127.00	0.54
10	002176	江特电机	573,919.66	0.50
11	002230	科大讯飞	559,727.00	0.49
12	002470	金正大	552,518.57	0.48
13	002497	雅化集团	512,662.00	0.45
14	002594	比亚迪	488,889.00	0.43
15	002024	苏宁易购	487,828.00	0.43
16	002475	立讯精密	477,606.00	0.42
17	002168	惠程科技	474,296.49	0.41
18	002573	清新环境	410,045.71	0.36
19	002027	分众传媒	395,234.00	0.34
20	002008	大族激光	357,550.00	0.31

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	30,112,224.46
卖出股票的收入（成交）总额	26,586,848.70

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。

7.5 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资明细

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。

7.8 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。

7.9 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投资明细

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

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.11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

本基金本报告期未投资国债期货交易。

7.11.2 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。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未投资国债期货交易。

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宁波银行(002142.SZ)外，在报告编制日前一年内没有受到公开谴责和处罚的情形。

宁波银保监局在2019年1月11日、2019年3月22日发布了两份 "宁波银监局行政处罚信息公开表"。经查明，宁波银行股份有限公司由于个人贷款资金违规流入房市、购买理财，违规将同业存款变为一般性存款，以不正当手段违规吸收存款等多个违法违规事项而受到宁波银监局的行政处罚，合计处罚款40万元。

上述证券为本基金业绩基准的成分股，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，所以上述证券收到监管部门行政处罚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库。

7.12.3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	11,101.91
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,102.89
5	应收申购款	168,356.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	181,561.43

7.12.4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。

7.12.5 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指数投资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

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
13,772	11,703.65	1,496,173.14	0.93%	159,686,450.88	99.07%

8.2 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	叶宁	3,761,797.00	8.62%
2	郭少华	1,218,083.00	2.79%
3	建信人寿保险股份有限公司-传统保险产品	924,837.00	2.12%
4	罗涛	917,720.00	2.10%
5	陈天和	719,625.00	1.65%
6	万山	620,000.00	1.42%
7	刘桂凤	460,432.00	1.05%
8	戚玉芳	408,830.00	0.94%
9	辛维举	402,907.00	0.92%
10	李贞慧	386,208.00	0.88%

注：以上数据由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况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	5,531.97	0.00%

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

9 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	154,345,253.39
本报告期基金总申购份额	62,874,509.96
减：本报告期基金总赎回份额	56,037,139.33
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	161,182,624.02

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

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董事由铃木晃先生变更为安田敬之先生。

2、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董事由川上丰先生变更为斋藤正宪先生。

3、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糠信英树先生变更为增田义之先生。

4、本报告期内，本基金托管人中国农业银行总行决定免去史静欣托管业务部副总裁职务。

5、本报告期内，本基金托管人中国农业银行总行决定免去马曙光托管业务部总裁职务。

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

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	
申万宏源证券	1	23,392,216.40	42.02%	21,317.50	42.02%	-
广发证券	1	8,038,332.03	14.44%	7,325.42	14.44%	-
光大证券	2	6,587,032.74	11.83%	6,002.70	11.83%	-
海通证券	1	6,253,814.16	11.23%	5,699.05	11.23%	-
中金公司	1	4,580,620.15	8.23%	4,174.35	8.23%	-
国盛证券	1	4,282,968.71	7.69%	3,903.05	7.69%	新增
安信证券	1	2,539,984.74	4.56%	2,314.72	4.56%	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	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。

申万菱信基金管理有限公司
二〇一九年八月二十四日