

申万菱信深证成指分级证券投资基金

2018 年年度报告

2018 年 12 月 31 日

基金管理人：申万菱信基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一九年三月二十七日

§1 重要提示及目录

1.1 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 月 22 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。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 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	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§6 审计报告	16
6.1 审计意见	16
6.2 形成审计意见的基础	16
6.3 管理层对财务报表的责任	16
6.4 注册会计师的责任	17
§7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	21
7.4 报表附注	22
§8 投资组合报告	48
8.1 期末基金资产组合情况	48
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	49
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	50
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	61
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	63

8.6	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.....	63
8.7	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.....	63
8.8	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.....	63
8.9	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.....	63
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	63
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	63
8.12	投资组合报告附注.....	64
§9	基金份额持有人信息.....	64
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	64
9.2	期末上市基金前十名持有人.....	65
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	66
9.4	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.....	66
§10	开放式基金份额变动.....	66
§11	重大事件揭示.....	66
11.1	基金份额持有人大会决议.....	66
11.2	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.....	66
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	67
11.4	基金投资策略的改变.....	67
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	67
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	67
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	67
11.8	其他重大事件.....	68
12	影响投资者决策的其他重要信息.....	74
§13	备查文件目录.....	75
13.1	备查文件目录.....	75
13.2	存放地点.....	75
13.3	查阅方式.....	75

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	申万菱信深证成指分级证券投资基金		
基金简称	申万菱信深证成指分级		
场内简称	申万深成		
基金主代码	163109		
交易代码	163109		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2010 年 10 月 22 日		
基金管理人	申万菱信基金管理有限公司		
基金托管人	中国工商银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	5,252,306,382.22 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2010 年 11 月 8 日		
下属分级基金的基金简称	申万深成	深成指 A	深成指 B
下属分级基金的场内简称	申万深成	深成指 A	深成指 B
下属分级基金的交易代码	163109	150022	150023
报告期末下属分级基金的份额总额	225,828,744.22 份	2,513,238,819.00 份	2,513,238,819.00 份

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平均跟踪误差不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%，实现对深证成指的有效跟踪。		
投资策略	本基金采取完全复制法进行投资，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。但在因特殊情况导致无法获得足够数量的股票时，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%×深证成指收益率+5%×银行同业存款利率		
下属分级基金的风险收益特征	申万深成份额为常规指数基金份额，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金。	深成指 A 份额风险和预期收益与债券型基金相近。	深成指 B 份额由于具有杠杆特性，具有高风险高收益的特征，其风险和预期收益要高于一般的股票型指数基金。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王菲萍	郭明
	联系电话	021-23261188	010-66105799
	电子邮箱	service@swsmu.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008808588	95588
传真		021-23261199	010-66105798
注册地址		上海市中山南路100号11层	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		上海市中山南路100号11层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		200010	100140
法定代表人		刘郎	易会满

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《证券日报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.swsmu.com
基金年度报告备置地点	申万菱信基金管理有限公司 中国工商银行股份有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§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 期间数据和指标	2018 年	2017 年	2016 年
本期已实现收益	-132,672,580.12	-35,399,107.80	-166,336,243.75
本期利润	-797,298,130.23	266,641,390.73	-365,259,148.68

加权平均基金份额本期利润	-0.1839	0.0486	-0.0609
本期加权平均净值利润率	-36.37%	8.18%	-9.96%
本期基金份额净值增长率	-32.30%	7.12%	-18.30%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
期末可供分配利润	-1,770,450,170.39	-569,942,858.33	-1,238,341,532.39
期末可供分配基金份额利润	-0.3371	-0.1504	-0.1988
期末基金资产净值	2,115,100,659.85	2,339,036,988.22	3,726,533,067.43
期末基金份额净值	0.4027	0.6171	0.5984
3.1.3 累计期末指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
基金份额累计净值增长率	-45.52%	-19.53%	-24.88%

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
过去三个月	-12.53%	1.74%	-13.13%	1.74%	0.60%	0.00%
过去六个月	-20.95%	1.54%	-21.73%	1.55%	0.78%	-0.01%
过去一年	-32.30%	1.41%	-32.91%	1.43%	0.61%	-0.02%
过去三年	-40.75%	1.38%	-40.93%	1.37%	0.18%	0.01%
过去五年	-10.84%	1.68%	-9.38%	1.64%	-1.46%	0.04%
自基金合同生效起至今	-45.52%	1.56%	-42.22%	1.55%	-3.30%	0.01%

注：本基金的业绩基准指数=95%x 深证成分指数收益率+5%x 银行同业存款利率。其中：深证成分指数作为衡量股票投资部分的业绩基准，银行同业存款利率作为衡量非股票投资部分的业绩基准。

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：

$$\text{benchmark}(0) = 1000;$$

$\%benchmark(t) = 95\% * (\text{深证成分指数}(t) / \text{深证成分指数}(t-1) - 1) + 5\% * \text{银行同业存款利率} / 365;$

$benchmark(t) = (1 + \%benchmark(t)) * benchmark(t-1);$

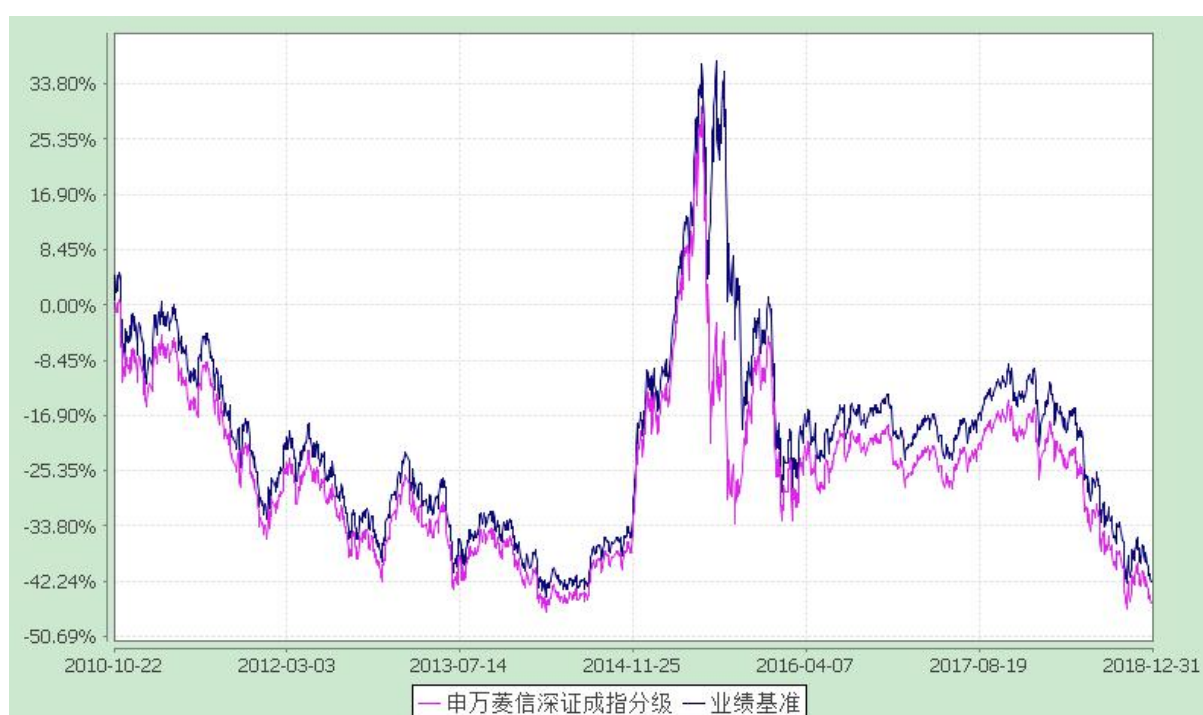
其中 $t=1,2,3,\dots$ 。

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期业绩比较基准收益率变动的比较

申万菱信深证成指分级证券投资基金

自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2010 年 10 月 22 日至 2018 年 12 月 31 日)



3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

申万菱信深证成指分级证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

根据基金合同，本基金不进行利润分配。

§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 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 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 262 亿元，客户数超过 586 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		

龚丽丽	本基金基金经理	2017-12-26	-	7 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。
刘敦	本基金原基金经理、指数与创新投资部负责人兼量化投资部负责人	2017-10-10	2018-10-18	10 年	刘敦先生，硕士研究生。2008 年起从事金融相关工作，曾任职于艾利士通资产管理有限公司、平安资产管理有限公司、申银万国证券研究所等。2015 年 03 月加入申万菱信基金管理有限公司，曾任专户投资经理，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、申万菱信价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理，现任指数与创新投资部负责人兼量化投资部负责人，申万菱信量化成长混合型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。

3.本报告期内，刘敦不再担任本基金基金经理，本基金由龚丽丽继续管理，具体见本基金管理人的相关公告。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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 公平交易制度和控制方法

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。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

对于场内同向交易，我们采集了本报告期内本公司旗下两两投资组合在相同时间窗口下（日内、3 日内和 5 日内）同买或者同卖场内同一证券时两者买卖均价存在的差异（即价差率）序列，然后按两两组合归类计算平均价差率。首先，假设两两组合在本报告期的价差率呈正态分布且平均价差率为 0，我们进行了 95%的置信度、假设平均价差率为 0 的 T 检验，若通过该假设检验，则认为该两两组合的交易得到了公平的执行；对于未通过假设检验的情况，我们还计算了两两组合价差占优比差、模拟输送比例等指标；若综合以上各项指标，认为仍存在一定的嫌疑，则我们将进一步对该两两组合同向买卖特定场内证券的时点、价格、数量等作分析，来判断是否存在重大利益输送的可能性。经分析本期未发生异常情况。

对于场外同向交易，我们分析了本报告期内不同时间窗口内（日内、3 日内和 5 日内）两两组合同向交易的价差率、对比市场公允价格和交易对手，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。

综合而言，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。

4.3.3 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 2 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

2018 年在国内经济下行和外部贸易冲突的双重压制下，A 股市场整体大幅下跌。其中，上证综指和深证成指跌幅分别为 24.59%和 34.42%。风格上，大盘龙头相较于中小盘股跌幅较小，具有超额收益。主要宽基指数中上证 50 跌幅最小，为-19.83%；沪深 300、中证 500 和中证 1000 分别下跌 25.31%，33.32%，36.87%；创业板指下跌 28.65%。

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是大额申购赎回、长期停牌股票估值调整、指数成份股调整

和指数成份股现金分红。

本基金产品在申万菱信深成指分级基金之基础份额的基础上，设计了深成指 A 份额和深成指 B 份额两个品种。深成指 B 份额是在发生合同约定的极端情景后，不进行重新折算，其净值按照母基金净值波动与深成指 A 份额同涨同跌方式计算的产品。

作为被动投资的基金产品，申万菱信深成指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级端两个产品的折溢价状况。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2018 年，深证成份指数期间表现为-34.42%，基金业绩基准表现为-32.91%，申万菱信深成指分级基金净值期间表现为-32.30%，领先业绩基准 0.61%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2019 年，A 股盈利大概率继续下行。一方面，经济转型期 GDP 下台阶；另一方面，预计以美国为代表的外部经济环境可能走势趋弱，影响国内出口。然而，去年压制股市的两个关键因素：去杠杆和贸易冲突均有望在 2019 年有所好转，从而带动流动性和市场情绪边际改善。叠加当前 A 股估值已处于近十年低位，投资价值显现。投资线索建议关注：一是受益流动性抬升和市场情绪改善的优质成长股；二是长期资金偏好的具有估值优势和稳定盈利能力蓝筹股。

深成指作为深圳市场的表征指数，成份股市值占深证市场总市值的 6 成左右，有良好的市场代表性。在市场估值底部布局，长期投资收益可期。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，监察稽核工作继续坚持以维护基金份额持有人利益为出发点，紧密围绕优化和完善公司内控体系，重点从推动公司制度建设、优化内控体系、深化合规管理工作、加强针对性合规培训、强化员工行为规范、提升反洗钱工作质量、推进内审稽核、信息披露等方面有序开展各项工作，保障基金运作和公司经营合法合规。

本报告期内，本基金管理人的监察稽核工作重点包括：

1、继续推进建章立制和流程优化，优化内控体系。制度建设是内部控制的主要抓手，本报告期内，以资管新规、债券交易、廉洁从业、反洗钱等系列配套法规的颁布为标志，监管层密集出台多项新规，公司及时、全面、有序地组织开展新规解读、建章立制、查漏补缺、优化流程，同时通过制度固化内部授权机制，使各项内部制度流程符合监管要求，同时在公司上下进一步传导了制度建

设文化，可操作性和合规能级得到不断提升。

2、深入开展合规宣导与培训，强化员工行为管控。本报告期内，进一步深入推进公司合规文化建设，及时通过适当方式向公司各部门及全体员工进行内部合规传导，组织开展了形式多样的各类专题培训、全员培训、新员工入职培训等，面向员工进行了内幕交易防控、员工证券投资管理、合规管理办法、反洗钱等方面的合规培训和合规考试，不断提高全员守法合规意识。同时，进一步强化了员工行为管控，员工职业操守和行为规范的合规意识得到不断强化。

3、以中国人民银行组织开展的法人金融机构洗钱风险评级工作为出发点，将反洗钱风险管控落到实处。本报告期内，公司有序开展了面向全体员工的多轮次反洗钱工作相关合规培训，推进反洗钱配套制度流程的梳理与修订，形成了以公司《反洗钱内部控制办法》为核心、十多部办法、规程为配套的管理制度体系，及时推进系统流程的改造与建设等工作，切实将反洗钱管理工作扎实推进。

4、以合规管理制度建设为契机，以合规促进业务发展。公司制定实施了《合规管理办法》，进一步健全了公司合规管理架构，明确了各层级合规管理职责，推进落实合规人员设置，积极构建一线合规屏障，推动合规管理关口前移。本报告期内，继续严格进行法律合规审核，加强合同签署过程管理，切实防范各类合规风险和法律风险，及时准确做好信息披露工作。

5、深化各类内审稽核，不断优化完善内控措施。本报告期内，按年度计划有效实施了各项内审稽核工作，通过组织开展部门业务稽核、运营风险点检查以及事件专项稽核等工作，多方着手加强后续监督执行；稳步开展定期合规检查，及时优化内控流程，强化公司制度执行和落实，进一步提升了公司内控管理水平。

6、加强员工行为监督，落实合规考核。监察稽核部对员工日常行为开展合规监测。对于合规监测过程中发现的问题，及时督促相关人员整改、提交解释说明。同时，根据员工违规情况的严重程度按照公司有关规定进行问责处理。

本报告期内，在监察稽核工作的开展过程中本基金管理人未发现本基金在投资运作等方面存在与法律法规或基金合同约定相违背的情况。今后本基金管理人将继续坚持确保基金份额持有人的利益不受损害的原则，以科学的风险管理为基础，积极有效地开展监察稽核工作。

4.7 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 14 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 14 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 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 16 年的基金会计经验；监察稽核部负责人赵鹏先生，拥有 4 年的证券投资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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金合同》的约定，存续期内，本基金（包括申万深成份额、申万收益份额、申万进取份额）不进行收益分配。

4.9 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

本报告期内，本基金托管人在对申万菱信深证成指分级证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，申万菱信深证成指分级证券投资基金的管理人——申万菱信基金管理有限公司在申万菱信深证成指分级证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、

基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，申万菱信深证成指分级证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对申万菱信基金管理有限公司编制和披露的申万菱信深证成指分级证券投资基金 2018 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

普华永道中天审字(2019)第 22312 号

申万菱信深证成指分级证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了申万菱信深证成指分级证券投资基金(以下简称“申万菱信深成指分级基金”)的财务报表，包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表，2018 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

6.1 审计意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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，公允反映了申万菱信深成指分级基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和基金净值变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于申万菱信深成指分级基金，并履行了职业道德方面的其他责任。

6.3 管理层对财务报表的责任

申万菱信深成指分级基金的基金管理人申万菱信基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存

在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估申万菱信深成指分级基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算申万菱信深成指分级基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督申万菱信深成指分级基金的财务报告过程。

6.4 注册会计师的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对申万菱信深成指分级基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致申万菱信深成指分级基金不能持续经营。

(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

中国注册会计师 赵钰

上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

2019 年 3 月 26 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：申万菱信深证成指分级证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	7.4.7.1	154,425,087.69	166,771,179.18
结算备付金		121,592.49	31,864.02
存出保证金		193,021.55	316,619.93
交易性金融资产	7.4.7.2	1,956,876,745.84	2,174,976,529.34
其中：股票投资		1,956,876,745.84	2,173,224,829.34
基金投资		-	-
债券投资		-	1,751,700.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		34,442.94	287,586.78
应收利息	7.4.7.5	41,895.32	36,732.56
应收股利		-	-
应收申购款		6,378,794.27	68,017.77
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-

资产总计		2,118,071,580.10	2,342,488,529.58
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		30,874.17	23,116.86
应付管理人报酬		1,810,729.81	1,988,509.24
应付托管费		398,360.58	437,472.07
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	365,376.96	608,460.18
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	365,578.73	393,983.01
负债合计		2,970,920.25	3,451,541.36
所有者权益:		-	-
实收基金	7.4.7.9	3,885,550,830.24	2,908,979,846.55
未分配利润	7.4.7.10	-1,770,450,170.39	-569,942,858.33
所有者权益合计		2,115,100,659.85	2,339,036,988.22
负债和所有者权益总计		2,118,071,580.10	2,342,488,529.58

注:报告截止日 2018 年 12 月 31 日,申万菱信深证成指分级证券投资基金之基础份额净值 0.4027 元,申万菱信深证成指分级证券投资基金之稳健收益类份额参考净值 0.7334 元,申万菱信深证成指分级证券投资基金之积极进取类份额参考净值 0.0720 元;申万菱信深证成指分级证券投资基金基金份额总额 5,252,306,382.22 份,其中申万菱信深证成指分级证券投资基金之基础份额 225,828,744.22 份,申万菱信深证成指分级证券投资基金之稳健收益类份额 2,513,238,819.00 份,申万菱信深证成指

分级证券投资基金之积极进取类份额 2,513,238,819.00 份。

7.2 利润表

会计主体：申万菱信深证成指分级证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
一、收入		-765,558,982.92	313,870,805.73
1.利息收入	7.4.7.11	1,377,940.13	1,697,407.08
其中：存款利息收入		1,377,831.90	1,697,037.43
债券利息收入		108.23	369.65
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）		-107,199,613.92	6,951,958.01
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-131,430,494.76	-25,495,793.83
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	131,520.38	76,481.25
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	24,099,360.46	32,371,270.59
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-664,625,550.11	302,040,498.53
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	4,888,240.98	3,180,942.11
减：二、费用		31,739,147.31	47,229,415.00
1. 管理人报酬		21,953,047.60	32,795,416.87
2. 托管费		4,829,670.43	7,214,991.78

3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7. 4. 7. 18	4,148,647.29	6,284,281.99
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.12	-
7. 其他费用	7. 4. 7. 19	807,781.87	934,724.36
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-797,298,130.23	266,641,390.73
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-797,298,130.23	266,641,390.73

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：申万菱信深证成指分级证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 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）	2,908,979,846.55	-569,942,858.33	2,339,036,988.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-797,298,130.23	-797,298,130.23
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）	976,570,983.69	-403,209,181.83	573,361,801.86
其中：1.基金申购款	2,678,243,055.72	-819,844,623.64	1,858,398,432.08
2.基金赎回款	-1,701,672,072.03	416,635,441.81	-1,285,036,630.22
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）	3,885,550,830.24	-1,770,450,170.39	2,115,100,659.85
项目	上年度可比期间		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 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）	4,964,874,599.82	-1,238,341,532.39	3,726,533,067.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	266,641,390.73	266,641,390.73
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）	-2,055,894,753.27	401,757,283.33	-1,654,137,469.94
其中：1.基金申购款	1,220,833,549.64	-320,966,818.17	899,866,731.47
2.基金赎回款	-3,276,728,302.91	722,724,101.50	-2,554,004,201.41
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）	2,908,979,846.55	-569,942,858.33	2,339,036,988.22

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

申万菱信深证成指分级证券投资基金(原名为申万巴黎深证成指分级证券投资基金，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”)证监许可[2010]1066 号文核准，由申万菱信基金管理有限公司(原名为“申万巴黎基金管理有限公司”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《申万巴黎深证成指分级证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关规定负责公开募集。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人民币 712,355,232.51 元，业经普华永道会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2010)第 267 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《申万巴黎深证成指分级指数基金基金合同》于 2010 年 10 月 22 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 712,484,721.40 份基金份额，其中认购资金利息折合 129,488.89 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

经中国证监会证监许可[2011]106 号《关于核准申万巴黎基金管理有限公司变更股权、公司名称及修改章程的批复》批准，申万巴黎基金管理有限公司已于 2011 年 3 月 3 日完成相关工商变更登记

手续，并于 2011 年 3 月 4 日变更公司名称为“申万菱信基金管理有限公司”。本基金的基金管理人报请中国证监会备案，将申万巴黎深证成指分级证券投资基金更名为申万菱信深证成指分级证券投资基金，并于 2011 年 4 月 6 日公告。

根据《申万菱信深证成指分级证券投资基金基金合同》的相关规定，本基金的基金份额包括申万菱信深证成指分级指数基金之基础份额(以下简称“申万深成份额”)、申万菱信深证成指分级指数基金之稳健收益份额(以下简称“申万收益份额”)及申万菱信深证成指分级指数基金之积极进取份额(以下简称“申万进取份额”)。申万深成份额只接受场内与场外的申购和赎回，但不上市交易。申万收益份额与申万进取份额只可上市交易，不可单独进行申购或赎回。投资者可选择将其在场内申购的申万深成份额按 1:1 的比例分拆成申万收益份额和申万进取份额，但不得申请将其场外申购的申万深成份额进行分拆。投资者可将其持有的场外申万深成份额跨系统转托管至场内并申请将其分拆成申万收益份额和申万进取份额后上市交易，也可按 1:1 的配比将其持有的申万收益份额和申万进取份额申请合并为场内的申万深成份额。

申万收益份额与申万进取份额的基金份额净值按如下原则计算：正常情况下，申万收益份额每日获得日基准收益，申万收益份额实际的投资盈亏都由申万进取份额分享与承担。申万收益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%，申万收益份额的份额净值按该约定年收益率逐日计算，计算出申万收益份额的基金份额参考净值后，根据申万深成份额的基金份额净值与申万收益份额、申万进取份额之间的基金份额参考净值关系，可以计算出申万进取份额的基金份额参考净值。

若发生极端情况，即申万进取份额的基金份额净值将跌破 0.100 元的当日，申万进取份额暂时不再保证申万收益份额每日获得日基准收益，申万收益份额开始与申万进取份额按两者基金份额净值的比例共同承担亏损，各负盈亏。若由于深证成指的回涨使得申万进取份额按各负盈亏原则计算的基金份额净值大于 0.100 元，则超过 0.100 元的部分净值优先用于弥补申万收益份额自极端情况发生以来在正常情况下累计应得的基准收益，补足后申万进取份额的基金份额净值方可超过 0.100 元，并恢复至正常情况下的净值计算原则。

本基金定期进行份额折算。在每个会计年度(除基金合同生效日所在会计年度外)的第一个工作日，本基金根据基金合同的规定对申万收益份额和申万深成份额进行定期份额折算。对于申万收益份额期末的约定应得收益，即申万收益份额每个会计年度 12 月 31 日份额净值超出本金 1.000 元部分，将折算为场内申万深成份额分配给申万收益份额持有人。申万深成份额持有人持有的每 2 份申万深成份额将按 1 份申万收益份额获得新增申万深成份额的分配。经过上述份额折算，申万收益份额和申万深成份额的基金份额净值将相应调整。

本基金还进行不定期份额折算。当申万深成份额的基金份额净值连续十个交易日大于人民币 2.000 元时，基金管理人将根据基金合同的规定对申万深成份额和申万进取份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保申万进取份额与申万收益份额保持 1:1 配比，份额折算后申万深成份额的基金份额净值、申万进取份额的基金份额净值与折算基准日申万收益份额的基金份额净值三者相等。

经深圳证券交易所深证上[2010]351 号文审核同意，本基金申万收益份额 95,309,647.00 份和申万进取 95,309,647.00 份于 2010 年 11 月 8 日上市交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《申万菱信深证成指分级证券投资基金基金合同》的规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括深证成份指数成份股、备选成份股、新股(首次公开发行或增发)、现金或者到期日在一年以内的政府债券等。本基金采用完全复制法进行指数化投资，股票资产跟踪的标的指数为深证成份指数，资产配置比例为：将不低于 90%的基金资产净值投资于深证成份指数成份股和备选成份股，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{深证成指收益率} + 5\% \times \text{银行同业存款利率}$ 。

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 3 月 26 日批准报出。

7.4.2 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》、《申万菱信深证成指分级证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年度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 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)

该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计

算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金（包括申万深成份额、申万收益份额、申万进取份额）不进行收益分配。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 2017年12月25日前，对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。自2017年12月25日起，对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1

季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 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。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
活期存款	154,425,087.69	166,771,179.18
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计	154,425,087.69	166,771,179.18

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末

		2018 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		2,501,440,182.57	1,956,876,745.84	-544,563,436.73
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		2,501,440,182.57	1,956,876,745.84	-544,563,436.73
项目		上年度末		
		2017 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		2,053,162,715.96	2,173,224,829.34	120,062,113.38
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	1,751,700.00	1,751,700.00	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	1,751,700.00	1,751,700.00	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		2,054,914,415.96	2,174,976,529.34	120,062,113.38

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	41,739.56	36,341.35
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	60.17	15.73
应收债券利息	-	218.73
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	95.59	156.75
合计	41,895.32	36,732.56

7.4.7.6 其他资产

无余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	365,376.96	608,460.18
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	365,376.96	608,460.18

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2018 年 12 月 31 日	2017 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	98.97	80.98
其他应付款	68,349.84	68,349.84
应付指数使用费	107,129.92	125,552.19
预提费用	190,000.00	200,000.00
合计	365,578.73	393,983.01

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,790,524,456.64	2,908,979,846.55
本期申购	143,471.26	110,102.08
本期赎回（以“-”号填列）	-38,588.25	-29,613.23
2018 年 1 月 3 日基金拆分/份额折算前	3,790,629,339.65	2,909,060,335.40
基金拆分/份额折算调整	141,746,981.98	—
本期申购	3,620,135,184.68	2,678,132,953.64
本期赎回（以“-”号填列）	-2,300,205,124.09	-1,701,642,458.80
本期末	5,252,306,382.22	3,885,550,830.24

注：1. 本基金于 2018 年 1 月 3 日进行定期份额折算，对申万深成份额和申万收益份额按照基金合同规定的定期份额折算方法进行份额调整。根据基金管理人于 2018 年 1 月 4 日发布的《申万菱信基金管理有限公司关于申万菱信深证成指分级证券投资基金办理份额折算结果及恢复交易的公告》，折算前申万深成份额为 182,097,177.65 份，申万收益份额为 1,804,266,081.00 份；折算后申万深成份额为 323,844,159.63 份，申万收益份额为 1,804,266,081.00 份。经过上述份额折算，申万收益份额和申万深成份额的基金份额净值已相应调整。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,482,301,133.58	-2,052,243,991.91	-569,942,858.33
本期利润	-132,672,580.12	-664,625,550.11	-797,298,130.23
本期基金份额交易产生的变动数	475,364,975.44	-878,574,157.27	-403,209,181.83
其中：基金申购款	1,338,198,296.66	-2,158,042,920.30	-819,844,623.64
基金赎回款	-862,833,321.22	1,279,468,763.03	416,635,441.81
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,824,993,528.90	-3,595,443,699.29	-1,770,450,170.39

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	1,350,492.82	1,673,120.89
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	22,133.76	14,998.99
其他	5,205.32	8,917.55
合计	1,377,831.90	1,697,037.43

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	1,190,440,091.43	2,630,606,994.68
减：卖出股票成本总额	1,321,870,586.19	2,656,102,788.51
买卖股票差价收入	-131,430,494.76	-25,495,793.83

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至 2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年 12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,883,548.36	980,832.17
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,751,700.00	904,200.00
减：应收利息总额	327.98	150.92
买卖债券差价收入	131,520.38	76,481.25

7.4.7.14 衍生工具收益

无。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月 31日
股票投资产生的股利收益	24,099,360.46	32,371,270.59
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	24,099,360.46	32,371,270.59

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月 31日
1.交易性金融资产	-664,625,550.11	302,040,498.53
——股票投资	-664,625,550.11	302,040,498.53
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-

——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-664,625,550.11	302,040,498.53

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
基金赎回费收入	4,888,172.13	3,180,772.43
转换费收入	68.85	169.68
合计	4,888,240.98	3,180,942.11

注：1.本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25%归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25%归入转出基金的基金资产。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
交易所市场交易费用	4,148,647.29	6,284,281.99
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	4,148,647.29	6,284,281.99

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
审计费用	100,000.00	100,000.00
信息披露费	190,000.00	100,000.00
银行汇划费	721.00	816.00
指数使用费	439,060.87	655,908.36
上市年费	60,000.00	60,000.00
银行间账户维护费	18,000.00	18,000.00
合计	807,781.87	934,724.36

注：本基金的指数使用费从基金财产中列支。在通常情况下，指数许可使用费按前一日的基金资产净值的 0.02% 的年费率计提，逐日累计，每季支付一次。若年度指数使用费下限(人民币 20 万元) 大于按基金资产净值提取的年度指数使用费，超过部分由基金管理人自行承担。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**7.4.8.1 或有事项**

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
申万菱信基金管理有限公司（以下简称“申万菱信”）	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、基金销售机构
三菱 UFJ 信托银行株式会社	基金管理人的股东
中国工商银行股份有限公司（以下简称“中国工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31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	126,164,776.80	4.27%	421,463,278.89	11.50%

7.4.10.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31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	114,974.74	4.27%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31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	384,082.88	11.50%	281.41	0.05%

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12

	月31日	月31日
当期发生的基金应支付的管理费	21,953,047.60	32,795,416.87
其中：支付销售机构的客户维护费	801,234.06	1,030,349.99

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 1.00%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 X 1.00% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	4,829,670.43	7,214,991.78

注：支付基金托管人中国工商银行的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：日托管费=前一日基金资产净值 X 0.22% / 当年天数。

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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，未发生投资本基金的情况。

7.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2018年1月1日至2018年12月31日		2017年1月1日至2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	154,425,087.69	1,350,492.82	166,771,179.18	1,673,120.89

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 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。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

7.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有 2,578,561 股申万宏源的 A 股普通股，成本总额为人民币 14,281,210.44 元，估值总额为人民币 10,494,743.27 元，占基金资产净值的比例为 0.50%(2017 年 12 月 31 日：0.37%)。

7.4.10.7.2 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。

7.4.11 利润分配情况

本基金（包括申万深成份额、申万收益份额、申万进取份额）不进行收益分配。

7.4.12 期末（2018 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限的证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000540	中天金融	2017-08-21	重大事项	4.87	2019-01-02	4.38	1,748,737.00	8,853,022.03	8,516,349.19	-
000987	越秀金控	2018-12-25	重大事项	7.97	2019-01-10	8.77	111,840.00	1,218,845.40	891,364.80	-
002183	怡亚通	2018-12-25	重大事项	5.01	2019-01-02	4.96	584,240.00	7,127,194.09	2,927,042.40	-
000693	*ST 华泽	2018-05-02	重大事项	0.00	-	-	159,528.00	2,413,198.36	0.00	附注 7.4.14

注：本基金截至 2018 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.12.3 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

本基金为指数型基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资等。与这些金融工具有关的风险，以及本基金管理人管理这些风险所采取的风险管理政策如下所述。

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数型基金，属于中高风险品种，采用完全复制策略，跟踪深证成指。本基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现与跟踪指数相同的风险收益目标。

本基金管理人已制定针对以上金融工具风险的管理政策和控制制度，并且形成了由本基金管理人在公司层面建立的风险管理委员会以及在董事会层面建立的风险控制委员会负责对与所投资金融工具相关的风险类型、管理政策和各种投资限制的定期回顾、评估和修改，本基金管理人的风险管理部门负责具体落实和日常跟踪的工作机制。

本基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

本基金面临的主要风险包括：信用风险、流动性风险和市场风险。与本基金相关的市场风险主要是利率风险和其他价格风险。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指金融工具的一方到期无法履行约定义务致使本基金遭受损失的风险。本基金的信用风险主要来源于金融工具的发行者或是交易对手不能履行约定义务而产生。

本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行，本基金管理人认为与以上银行相关的信用风险不重大。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成债券等投资品种的交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小，本基金管理人认为在交易所进行的交易涉及的信用风险不重大。

对于银行间债券等品种的交易，本基金管理人主要通过事前检查、控制交易对手信用及交割方式来管理风险。

对于发行者的信用风险控制，本基金管理人主要通过对投资品种的信用等级评估来选择适当的投资对象来管理。于 2018 年 12 月 31 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券 (2017 年 12 月 31 日：0.07%)。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险主要来源于基金兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。

本基金管理人已经建立涵盖制度、流程、组织架构、制衡机制、风险处置等方面的流动性风险管控体系；建立以压力测试为核心、覆盖全类型产品的基金流动性风险监测与预警制度及风险应对预案。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人已经建立针对公募基金申购赎回状况的监控和预测机制以及建立了巨额赎回审批规程，对于巨额赎回建立严格的流动性评估机制；此外，本基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款，设计了非常情况下赎回资金的处理模式，控制因开放模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对资产的流动性风险，本基金管理人持续监控和预测旗下基金的各项流动性指标，包括组合持仓集中度指标、投资组合在短时间内变现能力的综合指标、组合持仓中变现能力较差的品种的比例控制和流通受限资产的总量控制，通过指标来持续地评估、选择、跟踪和控制投资组合的投资流动性风险。

除了上述日常流动性管理机制外，本基金管理人已建立压力测试制度，针对不同类型投资组合建立流动性压力测试模型，对各相关风险因子进行极端假设，进而评估对投资组合流动性的负面影响。此外，本基金管理人已建立流动性风险应急机制，一旦发生或认为可能发生较大的流动性风险，本基金管理人会立即启动相应的应急流程。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余是流动性较好的可在银行间同业市场交易的金融资产工具、银行存款和结算备付金，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.58%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2018 年 12 月 31 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值为 2,105,380,314.35 元，超过经确认的当日净赎回金额。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。于 2018 年 12 月 31 日，本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果、流动性风险管理措施的实施以及本基金的资产和负债情况，本基金管理人认为本基金在本报告期内流动性情况良好。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。于 2018 年 12 月 31 日,本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息,因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2018 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	154,425,087.69	-	-	-	-	-	154,425,087.69
结算备付金	121,592.49	-	-	-	-	-	121,592.49
存出保证金	193,021.55	-	-	-	-	-	193,021.55
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,956,876,745.84	1,956,876,745.84
应收证券清算款	-	-	-	-	-	34,442.94	34,442.94
应收利息	-	-	-	-	-	41,895.32	41,895.32
应收申购款	-	-	-	-	-	6,378,794.27	6,378,794.27
资产总计	154,739,701.73	-	-	-	-	1,963,331,878.37	2,118,071,580.10
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	30,874.17	30,874.17
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,810,729.81	1,810,729.81
应付托管费	-	-	-	-	-	398,360.58	398,360.58
应付交易费用	-	-	-	-	-	365,376.96	365,376.96
其他负债	-	-	-	-	-	365,578.73	365,578.73
负债总计	-	-	-	-	-	2,970,920.25	2,970,920.25
利率敏感度缺口	154,739,701.73	-	-	-	-	1,960,360,958.12	2,115,100,659.85
上年度末 2017 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	166,771,179.18	-	-	-	-	-	166,771,179.18

结算备付金	31,864.02	-	-	-	-	-	31,864.02
存出保证金	316,619.93	-	-	-	-	-	316,619.93
交易性金融资产	-	-	-	-	1,751,700.00	2,173,224,829.34	2,174,976,529.34
应收证券清算款	-	-	-	-	-	287,586.78	287,586.78
应收利息	-	-	-	-	-	36,732.56	36,732.56
应收申购款	-	-	-	-	-	68,017.77	68,017.77
资产总计	167,119,663.13	-	-	-	1,751,700.00	2,173,617,166.45	2,342,488,529.58
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	23,116.86	23,116.86
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,988,509.24	1,988,509.24
应付托管费	-	-	-	-	-	437,472.07	437,472.07
应付交易费用	-	-	-	-	-	608,460.18	608,460.18
其他负债	-	-	-	-	-	393,983.01	393,983.01
负债总计	-	-	-	-	-	3,451,541.36	3,451,541.36
利率敏感度缺口	167,119,663.13	-	-	-	1,751,700.00	2,170,165,625.09	2,339,036,988.22

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2018 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资 (2017 年 12 月 31 日：0.07%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2017 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

基金的其他价格风险是指以交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险，该风险可能与特定投资品种相关，也有可能与整体投资品种相关。本基金的市场价格风险主要来源于本基金投资的股权和债权工具的未来价格可能受到一般市场波动或是

其他影响个别股权工具价值的特定风险影响。由于本基金是一只中高风险的指数型基金，对于深证成指成分股及其备选成分股的投资比例不低于基金资产净值的 90%，所以存在很高的其他价格风险。

本基金采取完全复制策略，即按照标的指数的成分股构成及其权重构建基金股票投资组合。当预期成分股发生调整，成分股发生分红、配股、增发等行为，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，本基金管理人会对投资组合进行适当调整，以便实现对跟踪误差的有效控制。

本基金管理人日常主要运用跟踪误差、标准差、beta 值、VAR 等指标对基金进行风险度量，有效监控基金的投资组合面临的市场价格风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日		上年度末 2017 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,956,876,745.84	92.52	2,173,224,829.34	92.91
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
合计	1,956,876,745.84	92.52	2,173,224,829.34	92.91

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 以深证成指为基准衡量其他价格风险		
	2. 其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
	基准上升 5%	增加约 103,270,000.00	增加约 107,130,000.00
	基准下降 5%	减少约 103,270,000.00	减少约 107,130,000.00

7.4.14 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 2018 年 12 月 31 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 1,944,541,989.45 元，属于第二层次的余额为 12,334,756.39 元，属于第三层次的余额为零(2017 年 12 月 31 日：第一层次 2,039,652,247.06 元，第二层次 129,517,345.78 元，第三层次 5,806,936.50 元)。

(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

于本期末，本基金持有公允价值归属于第三层次的金融工具的余额为 0.00 元，涉及成都华泽钴镍材料股份有限公司发行的股票(2017 年 12 月 31 日：5,806,936.50 元，涉及乐视网信息技术(北京)股份有限公司发行的股票)。

本基金本期出售第三层次的金额为 6,909,047.00 元，转出第三层次的金额为 254.00 元，转入第三层次的金额为 0.00 元，计入损益的利得金额为 1,102,364.50 元。本基金于本期末仍持有的第三层次的资产计入本年度损益的未实现利得或损失(从年初起算)为-1,994,100.00 元。计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

于 2018 年 12 月 31 日本基金持有的第三层次的交易性金融资产权益工具投资公允价值为 0.00 元，采用成本法估值技术，不可观察输入值为每股净资产。

本基金 2017 年度转入第三层次的金额为 16,611,402.75 元,计入损益的利得金额为-10,804,466.25 元。本基金于上年度末仍持有的第三层次的资产计入上年度损益的未实现利得或损失为 -19,173,895.50 元。计入损益的利得或损失计入利润表中的公允价值变动损益项目。

于 2017 年 12 月 31 日本基金持有的第三层次的交易性金融资产权益工具投资公允价值为 5,806,936.50 元,采用市场法估值技术,不可观察输入值为市净率倍数,不可观察输入值加权平均值为 1.26,与调整后净资产相乘得到公允价值。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 12 月 31 日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017 年 12 月 31 日:同)。

(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) 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。

§8 投资组合报告

8.1 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	1,956,876,745.84	92.39
	其中:股票	1,956,876,745.84	92.39
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	154,546,680.18	7.30
8	其他各项资产	6,648,154.08	0.31
9	合计	2,118,071,580.10	100.00

注:本基金未开通港股通交易机制投资于港股。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	53,413,704.73	2.53
B	采矿业	16,205,778.75	0.77
C	制造业	1,228,370,618.69	58.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	23,417,744.15	1.11
E	建筑业	17,522,017.34	0.83
F	批发和零售业	47,357,702.84	2.24
G	交通运输、仓储和邮政业	21,473,882.34	1.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	183,792,448.41	8.69
J	金融业	130,840,339.76	6.19
K	房地产业	113,599,549.41	5.37
L	租赁和商务服务业	29,639,712.66	1.40
M	科学研究和技术服务业	6,264,470.00	0.30
N	水利、环境和公共设施管理业	14,832,085.72	0.70
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	29,909,752.45	1.41
R	文化、体育和娱乐业	37,007,636.61	1.75
S	综合	3,229,301.98	0.15
	合计	1,956,876,745.84	92.52

8.2.2 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。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	000333	美的集团	1,833,629.00	67,587,564.94	3.20
2	000651	格力电器	1,863,458.00	66,506,816.02	3.14
3	000002	万科A	1,705,855.00	40,633,466.10	1.92
4	300498	温氏股份	1,481,039.00	38,773,601.02	1.83
5	000858	五粮液	716,400.00	36,450,432.00	1.72
6	002415	海康威视	1,365,091.00	35,164,744.16	1.66
7	000001	平安银行	3,269,495.00	30,667,863.10	1.45
8	000725	京东方A	10,111,971.00	26,594,483.73	1.26
9	002304	洋河股份	219,110.00	20,754,099.20	0.98
10	300059	东方财富	1,524,262.00	18,443,570.20	0.87
11	000063	中兴通讯	929,816.00	18,215,095.44	0.86
12	002594	比亚迪	327,816.00	16,718,616.00	0.79
13	002027	分众传媒	2,992,214.00	15,679,201.36	0.74
14	002142	宁波银行	940,768.00	15,259,256.96	0.72
15	002230	科大讯飞	614,386.00	15,138,471.04	0.72
16	000776	广发证券	1,172,930.00	14,872,752.40	0.70
17	000338	潍柴动力	1,836,342.00	14,139,833.40	0.67
18	002024	苏宁易购	1,369,680.00	13,491,348.00	0.64
19	001979	招商蛇口	758,947.00	13,167,730.45	0.62
20	002475	立讯精密	933,226.00	13,121,157.56	0.62
21	000538	云南白药	174,716.00	12,921,995.36	0.61
22	000568	泸州老窖	306,372.00	12,457,085.52	0.59
23	002044	美年健康	718,080.00	10,735,296.00	0.51
24	002008	大族激光	346,792.00	10,528,605.12	0.50
25	000166	申万宏源	2,578,561.00	10,494,743.27	0.50
26	000100	TCL 集团	4,219,504.00	10,337,784.80	0.49
27	000661	长春高新	56,689.00	9,920,575.00	0.47
28	000069	华侨城A	1,523,158.00	9,672,053.30	0.46
29	000895	双汇发展	378,939.00	8,939,171.01	0.42
30	300142	沃森生物	463,221.00	8,847,521.10	0.42
31	300015	爱尔眼科	333,318.00	8,766,263.40	0.41
32	300124	汇川技术	433,673.00	8,734,174.22	0.41
33	002202	金风科技	855,811.00	8,549,551.89	0.40
34	000540	中天金融	1,748,737.00	8,516,349.19	0.40
35	002466	天齐锂业	286,771.00	8,408,125.72	0.40
36	000783	长江证券	1,606,779.00	8,274,911.85	0.39
37	300003	乐普医疗	396,351.00	8,248,064.31	0.39
38	002450	康得新	1,032,000.00	7,884,480.00	0.37

39	000423	东阿阿胶	193,866.00	7,667,400.30	0.36
40	002352	顺丰控股	233,400.00	7,643,850.00	0.36
41	002422	科伦药业	367,324.00	7,585,240.60	0.36
42	002236	大华股份	643,811.00	7,378,074.06	0.35
43	000413	东旭光电	1,615,910.00	7,271,595.00	0.34
44	002736	国信证券	865,065.00	7,240,594.05	0.34
45	002456	欧菲科技	787,504.00	7,237,161.76	0.34
46	300408	三环集团	421,972.00	7,139,766.24	0.34
47	300136	信维通信	326,756.00	7,061,197.16	0.33
48	002007	华兰生物	213,577.00	7,005,325.60	0.33
49	002001	新 和 成	463,247.00	6,953,337.47	0.33
50	300122	智飞生物	178,832.00	6,931,528.32	0.33
51	000963	华东医药	261,742.00	6,925,693.32	0.33
52	300750	宁德时代	93,300.00	6,885,540.00	0.33
53	000768	中航飞机	514,817.00	6,816,177.08	0.32
54	002460	赣锋锂业	304,117.00	6,714,903.36	0.32
55	002714	牧原股份	232,403.00	6,681,586.25	0.32
56	000157	中联重科	1,830,410.00	6,516,259.60	0.31
57	300024	机器人	480,923.00	6,357,802.06	0.30
58	002311	海大集团	272,115.00	6,304,904.55	0.30
59	002739	万达电影	286,695.00	6,258,551.85	0.30
60	300144	宋城演艺	292,451.00	6,243,828.85	0.30
61	000876	新 希 望	802,574.00	5,842,738.72	0.28
62	000656	金科股份	938,683.00	5,810,447.77	0.27
63	300253	卫宁健康	460,275.00	5,735,026.50	0.27
64	300760	迈瑞医疗	52,207.00	5,702,048.54	0.27
65	002410	广联达	273,334.00	5,688,080.54	0.27
66	000425	徐工机械	1,723,370.00	5,566,485.10	0.26
67	000728	国元证券	791,311.00	5,523,350.78	0.26
68	002673	西部证券	717,574.00	5,503,792.58	0.26
69	000625	长安汽车	832,291.00	5,484,797.69	0.26
70	002146	荣盛发展	688,932.00	5,477,009.40	0.26
71	300347	泰格医药	127,970.00	5,470,717.50	0.26
72	002241	歌尔股份	790,072.00	5,435,695.36	0.26
73	000703	恒逸石化	469,220.00	5,405,414.40	0.26
74	002340	格林美	1,407,377.00	5,404,327.68	0.26
75	000977	浪潮信息	337,217.00	5,368,494.64	0.25
76	002065	东华软件	771,356.00	5,360,924.20	0.25
77	002179	中航光电	157,090.00	5,290,791.20	0.25
78	000750	国海证券	1,195,330.00	5,211,638.80	0.25
79	300146	汤臣倍健	300,101.00	5,098,715.99	0.24
80	002129	中环股份	698,801.00	5,052,331.23	0.24
81	002602	世纪华通	243,685.00	5,032,095.25	0.24
82	300070	碧水源	635,719.00	4,958,608.20	0.23

83	002465	海格通信	633,495.00	4,941,261.00	0.23
84	300017	网宿科技	630,345.00	4,935,601.35	0.23
85	000998	隆平高科	332,135.00	4,915,598.00	0.23
86	000623	吉林敖东	340,392.00	4,911,856.56	0.23
87	000709	河钢股份	1,727,377.00	4,905,750.68	0.23
88	000630	铜陵有色	2,483,050.00	4,891,608.50	0.23
89	000401	冀东水泥	393,600.00	4,872,768.00	0.23
90	002405	四维图新	341,671.00	4,820,977.81	0.23
91	000860	顺鑫农业	150,879.00	4,811,531.31	0.23
92	300296	利亚德	623,883.00	4,797,660.27	0.23
93	002195	二三四五	1,289,771.00	4,759,254.99	0.23
94	002271	东方雨虹	363,945.00	4,713,087.75	0.22
95	300450	先导智能	161,889.00	4,685,067.66	0.22
96	002493	荣盛石化	461,742.00	4,658,976.78	0.22
97	002050	三花智控	366,871.00	4,655,592.99	0.22
98	002439	启明星辰	225,484.00	4,635,951.04	0.22
99	300383	光环新网	365,269.00	4,627,958.23	0.22
100	000690	宝新能源	682,269.00	4,591,670.37	0.22
101	002223	鱼跃医疗	233,730.00	4,583,445.30	0.22
102	000786	北新建材	332,985.00	4,581,873.60	0.22
103	002049	紫光国微	157,124.00	4,540,883.60	0.21
104	000503	国新健康	284,914.00	4,524,434.32	0.21
105	002797	第一创业	824,279.00	4,467,592.18	0.21
106	002081	金螳螂	551,271.00	4,465,295.10	0.21
107	002252	上海莱士	556,203.00	4,455,186.03	0.21
108	000778	新兴铸管	1,029,263.00	4,436,123.53	0.21
109	002384	东山精密	388,264.00	4,383,500.56	0.21
110	000997	新大陆	298,767.00	4,373,948.88	0.21
111	002624	完美世界	156,893.00	4,369,470.05	0.21
112	002092	中泰化学	600,335.00	4,232,361.75	0.20
113	300072	三聚环保	420,885.00	4,141,508.40	0.20
114	000627	天茂集团	733,354.00	4,114,115.94	0.19
115	000060	中金岭南	1,037,960.00	4,110,321.60	0.19
116	002038	双鹭药业	165,069.00	4,095,361.89	0.19
117	000830	鲁西化工	417,500.00	4,091,500.00	0.19
118	000961	中南建设	722,056.00	4,050,734.16	0.19
119	002075	沙钢股份	500,845.00	4,021,785.35	0.19
120	002572	索菲亚	239,130.00	4,005,427.50	0.19
121	002507	涪陵榨菜	183,200.00	3,957,120.00	0.19
122	002281	光迅科技	144,883.00	3,891,557.38	0.18
123	002268	卫士通	215,379.00	3,846,668.94	0.18
124	002508	老板电器	189,591.00	3,827,842.29	0.18
125	002127	南极电商	507,900.00	3,819,408.00	0.18
126	000999	华润三九	152,944.00	3,802,187.84	0.18

127	300601	康泰生物	105,900.00	3,789,102.00	0.18
128	002500	山西证券	636,579.00	3,768,547.68	0.18
129	002506	协鑫集成	753,400.00	3,767,000.00	0.18
130	000960	锡业股份	394,247.00	3,761,116.38	0.18
131	000418	小天鹅 A	86,137.00	3,725,425.25	0.18
132	000581	威孚高科	210,345.00	3,714,692.70	0.18
133	000825	太钢不锈	893,437.00	3,698,829.18	0.17
134	002470	金正大	582,423.00	3,680,913.36	0.17
135	000988	华工科技	307,949.00	3,676,911.06	0.17
136	300168	万达信息	301,707.00	3,617,466.93	0.17
137	000898	鞍钢股份	704,751.00	3,615,372.63	0.17
138	000686	东北证券	577,147.00	3,612,940.22	0.17
139	000839	中信国安	1,070,111.00	3,606,274.07	0.17
140	002085	万丰奥威	463,745.00	3,594,023.75	0.17
141	300315	掌趣科技	1,012,023.00	3,572,441.19	0.17
142	000975	银泰资源	349,447.00	3,560,864.93	0.17
143	300012	华测检测	541,000.00	3,543,550.00	0.17
144	002180	纳思达	154,559.00	3,542,492.28	0.17
145	002221	东华能源	439,379.00	3,541,394.74	0.17
146	000066	中国长城	744,658.00	3,529,678.92	0.17
147	002821	凯莱英	52,000.00	3,528,200.00	0.17
148	002174	游族网络	189,599.00	3,524,645.41	0.17
149	002217	合力泰	750,015.00	3,510,070.20	0.17
150	002013	中航机电	537,125.00	3,496,683.75	0.17
151	002138	顺络电子	251,863.00	3,485,783.92	0.16
152	000039	中集集团	328,821.00	3,478,926.18	0.16
153	000050	深天马 A	353,009.00	3,463,018.29	0.16
154	002558	巨人网络	177,080.00	3,430,039.60	0.16
155	002110	三钢闽光	267,400.00	3,420,046.00	0.16
156	002358	森源电气	191,367.00	3,406,332.60	0.16
157	002310	东方园林	489,156.00	3,404,525.76	0.16
158	000983	西山煤电	617,359.00	3,389,300.91	0.16
159	002463	沪电股份	470,900.00	3,376,353.00	0.16
160	002032	苏泊尔	64,050.00	3,362,625.00	0.16
161	300271	华宇软件	223,998.00	3,362,209.98	0.16
162	300274	阳光电源	376,908.00	3,362,019.36	0.16
163	000671	阳光城	644,541.00	3,345,167.79	0.16
164	002153	石基信息	128,834.00	3,344,530.64	0.16
165	002074	国轩高科	285,196.00	3,296,865.76	0.16
166	300009	安科生物	246,365.00	3,291,436.40	0.16
167	300413	芒果超媒	88,447.00	3,273,423.47	0.15
168	300166	东方国信	315,243.00	3,265,917.48	0.15
169	000009	中国宝安	749,258.00	3,229,301.98	0.15
170	002078	太阳纸业	566,455.00	3,228,793.50	0.15

171	300027	华谊兄弟	679,000.00	3,184,510.00	0.15
172	300014	亿纬锂能	201,753.00	3,171,557.16	0.15
173	002385	大北农	990,119.00	3,168,380.80	0.15
174	002399	海普瑞	136,968.00	3,157,112.40	0.15
175	002640	跨境通	292,063.00	3,154,280.40	0.15
176	002019	亿帆医药	293,365.00	3,139,005.50	0.15
177	000547	航天发展	414,476.00	3,133,438.56	0.15
178	300088	长信科技	752,564.00	3,123,140.60	0.15
179	000932	华菱钢铁	513,920.00	3,114,355.20	0.15
180	300203	聚光科技	121,366.00	3,113,037.90	0.15
181	000681	视觉中国	133,400.00	3,110,888.00	0.15
182	300133	华策影视	345,927.00	3,099,505.92	0.15
183	300001	特锐德	172,718.00	3,027,746.54	0.14
184	000046	泛海控股	646,981.00	3,021,401.27	0.14
185	000516	国际医学	606,804.00	3,003,679.80	0.14
186	002294	信立泰	143,525.00	2,998,237.25	0.14
187	000598	兴蓉环境	742,918.00	2,993,959.54	0.14
188	000826	启迪桑德	285,929.00	2,970,802.31	0.14
189	002371	北方华创	78,633.00	2,969,182.08	0.14
190	000513	丽珠集团	117,912.00	2,965,486.80	0.14
191	300073	当升科技	107,020.00	2,963,383.80	0.14
192	000089	深圳机场	379,171.00	2,953,742.09	0.14
193	000402	金融街	458,544.00	2,953,023.36	0.14
194	002176	江特电机	502,564.00	2,950,050.68	0.14
195	300033	同花顺	76,944.00	2,939,260.80	0.14
196	000488	晨鸣纸业	522,658.00	2,932,111.38	0.14
197	002183	怡亚通	584,240.00	2,927,042.40	0.14
198	002353	杰瑞股份	194,762.00	2,921,430.00	0.14
199	002373	千方科技	259,577.00	2,886,496.24	0.14
200	300182	捷成股份	667,537.00	2,863,733.73	0.14
201	002341	新纶科技	241,000.00	2,863,080.00	0.14
202	300251	光线传媒	374,662.00	2,847,431.20	0.13
203	002589	瑞康医药	405,867.00	2,828,892.99	0.13
204	000887	中鼎股份	278,640.00	2,819,836.80	0.13
205	000040	东旭蓝天	388,628.00	2,809,780.44	0.13
206	300418	昆仑万维	218,036.00	2,803,942.96	0.13
207	000732	泰禾集团	199,695.00	2,799,723.90	0.13
208	000729	燕京啤酒	493,258.00	2,781,975.12	0.13
209	002185	华天科技	679,650.00	2,759,379.00	0.13
210	002120	韵达股份	90,591.00	2,744,907.30	0.13
211	002916	深南电路	33,900.00	2,717,763.00	0.13
212	300170	汉得信息	277,756.00	2,716,453.68	0.13
213	002583	海能达	343,689.00	2,711,706.21	0.13
214	002191	劲嘉股份	346,916.00	2,709,413.96	0.13

215	002812	恩捷股份	54,600.00	2,697,786.00	0.13
216	002157	正邦科技	505,879.00	2,686,217.49	0.13
217	002601	龙蟒佰利	218,200.00	2,683,860.00	0.13
218	000008	神州高铁	685,269.00	2,665,696.41	0.13
219	002233	塔牌集团	264,700.00	2,662,882.00	0.13
220	000883	湖北能源	723,008.00	2,653,439.36	0.13
221	300098	高新兴	392,025.00	2,650,089.00	0.13
222	002273	水晶光电	277,097.00	2,649,047.32	0.13
223	000559	万向钱潮	514,521.00	2,634,347.52	0.12
224	000878	云南铜业	330,520.00	2,621,023.60	0.12
225	000683	远兴能源	1,105,100.00	2,619,087.00	0.12
226	002266	浙富控股	641,089.00	2,609,232.23	0.12
227	300068	南都电源	183,304.00	2,606,582.88	0.12
228	000596	古井贡酒	48,200.00	2,600,872.00	0.12
229	000930	中粮生化	349,093.00	2,590,270.06	0.12
230	002701	奥瑞金	510,558.00	2,583,423.48	0.12
231	000970	中科三环	351,664.00	2,577,697.12	0.12
232	002396	星网锐捷	149,495.00	2,574,303.90	0.12
233	002250	联化科技	272,517.00	2,569,835.31	0.12
234	002023	海特高新	246,908.00	2,555,497.80	0.12
235	000938	紫光股份	81,657.00	2,552,597.82	0.12
236	002372	伟星新材	164,438.00	2,550,433.38	0.12
237	000738	航发控制	210,937.00	2,543,900.22	0.12
238	300180	华峰超纤	226,700.00	2,527,705.00	0.12
239	000415	渤海租赁	697,814.00	2,512,130.40	0.12
240	000591	太阳能	843,654.00	2,497,215.84	0.12
241	000807	云铝股份	643,037.00	2,494,983.56	0.12
242	300628	亿联网络	32,100.00	2,492,886.00	0.12
243	002376	新北洋	162,500.00	2,492,750.00	0.12
244	000528	柳工	408,580.00	2,480,080.60	0.12
245	300285	国瓷材料	147,800.00	2,463,826.00	0.12
246	002152	广电运通	436,636.00	2,449,527.96	0.12
247	002407	多氟多	222,558.00	2,439,235.68	0.12
248	002155	湖南黄金	310,329.00	2,436,082.65	0.12
249	300036	超图软件	132,828.00	2,434,737.24	0.12
250	002035	华帝股份	274,665.00	2,430,785.25	0.11
251	300316	晶盛机电	242,190.00	2,426,743.80	0.11
252	300207	欣旺达	281,942.00	2,421,881.78	0.11
253	000027	深圳能源	460,232.00	2,416,218.00	0.11
254	002004	华邦健康	522,856.00	2,410,366.16	0.11
255	002491	通鼎互联	300,077.00	2,364,606.76	0.11
256	002168	深圳惠程	239,012.00	2,363,828.68	0.11
257	002595	豪迈科技	147,341.00	2,357,456.00	0.11
258	300558	贝达药业	72,954.00	2,332,339.38	0.11

259	002440	闰土股份	258,244.00	2,324,196.00	0.11
260	300212	易华录	110,893.00	2,297,702.96	0.11
261	000902	新洋丰	256,103.00	2,294,682.88	0.11
262	002368	太极股份	98,408.00	2,283,065.60	0.11
263	300058	蓝色光标	524,904.00	2,278,083.36	0.11
264	002610	爱康科技	1,445,913.00	2,270,083.41	0.11
265	300038	数知科技	243,300.00	2,269,989.00	0.11
266	000400	许继电气	254,342.00	2,261,100.38	0.11
267	002408	齐翔腾达	330,455.00	2,260,312.20	0.11
268	002672	东江环保	197,080.00	2,254,595.20	0.11
269	002511	中顺洁柔	264,300.00	2,251,836.00	0.11
270	002555	三七互娱	237,975.00	2,246,484.00	0.11
271	002030	达安基因	219,875.00	2,233,930.00	0.11
272	300113	顺网科技	174,858.00	2,222,445.18	0.11
273	000717	韶钢松山	488,100.00	2,220,855.00	0.10
274	000028	国药一致	52,838.00	2,189,606.72	0.10
275	002151	北斗星通	103,566.00	2,185,242.60	0.10
276	300026	红日药业	716,391.00	2,184,992.55	0.10
277	002285	世联行	428,217.00	2,175,342.36	0.10
278	000800	一汽轿车	328,497.00	2,174,650.14	0.10
279	002025	航天电器	100,362.00	2,150,757.66	0.10
280	300226	上海钢联	47,200.00	2,149,016.00	0.10
281	002449	国星光电	206,821.00	2,146,801.98	0.10
282	002643	万润股份	211,701.00	2,142,414.12	0.10
283	000793	华闻传媒	720,900.00	2,141,073.00	0.10
284	002244	滨江集团	536,754.00	2,136,280.92	0.10
285	002603	以岭药业	204,175.00	2,135,670.50	0.10
286	002497	雅化集团	321,600.00	2,135,424.00	0.10
287	300451	创业软件	111,500.00	2,135,225.00	0.10
288	002051	中工国际	192,540.00	2,133,343.20	0.10
289	002618	丹邦科技	154,900.00	2,132,973.00	0.10
290	000059	华锦股份	358,401.00	2,128,901.94	0.10
291	300324	旋极信息	379,252.00	2,127,603.72	0.10
292	000831	五矿稀土	252,500.00	2,113,425.00	0.10
293	000301	东方盛虹	384,600.00	2,099,916.00	0.10
294	300188	美亚柏科	161,200.00	2,098,824.00	0.10
295	300357	我武生物	56,500.00	2,089,935.00	0.10
296	002383	合众思壮	175,900.00	2,080,897.00	0.10
297	002444	巨星科技	218,526.00	2,071,626.48	0.10
298	002597	金禾实业	130,038.00	2,066,303.82	0.10
299	002299	圣农发展	124,349.00	2,056,732.46	0.10
300	002831	裕同科技	51,100.00	2,047,066.00	0.10
301	002212	南洋股份	184,000.00	2,046,080.00	0.10
302	000758	中色股份	560,478.00	2,045,744.70	0.10

303	002690	美亚光电	96,006.00	2,043,007.68	0.10
304	002010	传化智联	312,334.00	2,030,171.00	0.10
305	300037	新宙邦	84,300.00	2,027,415.00	0.10
306	002047	宝鹰股份	295,919.00	2,027,045.15	0.10
307	300078	思创医惠	203,428.00	2,022,074.32	0.10
308	300618	寒锐钴业	27,180.00	2,013,494.40	0.10
309	000031	中粮地产	410,909.00	2,005,235.92	0.09
310	000848	承德露露	249,300.00	2,004,372.00	0.09
311	002280	联络互动	517,778.00	2,003,800.86	0.09
312	300222	科大智能	127,782.00	1,980,621.00	0.09
313	000563	陕国投 A	737,996.00	1,977,829.28	0.09
314	300377	赢时胜	178,842.00	1,974,415.68	0.09
315	000650	仁和药业	359,100.00	1,967,868.00	0.09
316	300699	光威复材	54,900.00	1,965,420.00	0.09
317	000006	深振业 A	376,347.00	1,949,477.46	0.09
318	002061	浙江交科	189,800.00	1,949,246.00	0.09
319	002389	航天彩虹	159,400.00	1,946,274.00	0.09
320	002839	张家港行	363,200.00	1,943,120.00	0.09
321	300496	中科创达	87,586.00	1,935,650.60	0.09
322	300244	迪安诊断	127,475.00	1,933,795.75	0.09
323	300294	博雅生物	71,543.00	1,930,945.57	0.09
324	300476	胜宏科技	164,338.00	1,922,754.60	0.09
325	002426	胜利精密	827,640.00	1,920,124.80	0.09
326	002366	台海核电	204,452.00	1,917,759.76	0.09
327	300055	万邦达	249,983.00	1,917,369.61	0.09
328	002773	康弘药业	56,195.00	1,914,563.65	0.09
329	001965	招商公路	238,400.00	1,914,352.00	0.09
330	300197	铁汉生态	501,840.00	1,901,973.60	0.09
331	000012	南玻 A	475,023.00	1,895,341.77	0.09
332	002262	恩华药业	210,048.00	1,894,632.96	0.09
333	000718	苏宁环球	594,995.00	1,892,084.10	0.09
334	002411	延安必康	89,685.00	1,890,559.80	0.09
335	002563	森马服饰	211,886.00	1,890,023.12	0.09
336	300747	锐科激光	13,700.00	1,885,120.00	0.09
337	002131	利欧股份	1,281,433.00	1,883,706.51	0.09
338	002042	华孚时尚	346,300.00	1,880,409.00	0.09
339	300433	蓝思科技	288,141.00	1,875,797.91	0.09
340	000926	福星股份	306,383.00	1,875,063.96	0.09
341	000818	航锦科技	202,800.00	1,871,844.00	0.09
342	300676	华大基因	31,100.00	1,866,000.00	0.09
343	000156	华数传媒	234,981.00	1,863,399.33	0.09
344	300010	立思辰	255,181.00	1,852,614.06	0.09
345	002648	卫星石化	190,600.00	1,843,102.00	0.09
346	300355	蒙草生态	472,767.00	1,839,063.63	0.09

347	002302	西部建设	207,600.00	1,835,184.00	0.09
348	002237	恒邦股份	218,888.00	1,834,281.44	0.09
349	002419	天虹股份	167,200.00	1,834,184.00	0.09
350	002573	清新环境	252,972.00	1,826,457.84	0.09
351	000158	常山北明	349,684.00	1,825,350.48	0.09
352	300115	长盈精密	222,299.00	1,820,628.81	0.09
353	000933	神火股份	464,100.00	1,809,990.00	0.09
354	002421	达实智能	459,297.00	1,800,444.24	0.09
355	000078	海王生物	603,905.00	1,799,636.90	0.09
356	002028	思源电气	181,885.00	1,795,204.95	0.08
357	300367	东方网力	199,801.00	1,772,234.87	0.08
358	002128	露天煤业	246,074.00	1,761,889.84	0.08
359	002727	一心堂	98,900.00	1,758,442.00	0.08
360	002091	江苏国泰	313,700.00	1,756,720.00	0.08
361	002670	国盛金控	174,153.00	1,755,462.24	0.08
362	300529	健帆生物	42,300.00	1,755,450.00	0.08
363	000021	深科技	304,742.00	1,752,266.50	0.08
364	000685	中山公用	249,201.00	1,744,407.00	0.08
365	000712	锦龙股份	191,786.00	1,741,416.88	0.08
366	000877	天山股份	243,960.00	1,734,555.60	0.08
367	002488	金固股份	260,700.00	1,728,441.00	0.08
368	002056	横店东磁	311,763.00	1,724,049.39	0.08
369	300459	金科文化	234,200.00	1,721,370.00	0.08
370	300002	神州泰岳	511,674.00	1,688,524.20	0.08
371	002608	江苏国信	220,106.00	1,683,810.90	0.08
372	300287	飞利信	445,361.00	1,683,464.58	0.08
373	002665	首航节能	598,091.00	1,680,635.71	0.08
374	300199	翰宇药业	179,813.00	1,679,453.42	0.08
375	300054	鼎龙股份	263,500.00	1,678,495.00	0.08
376	300616	尚品宅配	27,400.00	1,665,098.00	0.08
377	002505	大康农业	1,023,483.00	1,658,042.46	0.08
378	300053	欧比特	202,006.00	1,648,368.96	0.08
379	000789	万年青	151,300.00	1,647,657.00	0.08
380	300101	振芯科技	164,912.00	1,632,628.80	0.08
381	002841	视源股份	28,602.00	1,627,453.80	0.08
382	300159	新研股份	353,011.00	1,627,380.71	0.08
383	000980	众泰汽车	375,831.00	1,627,348.23	0.08
384	002108	沧州明珠	386,303.00	1,626,335.63	0.08
385	000937	冀中能源	431,316.00	1,626,061.32	0.08
386	002431	棕榈股份	455,236.00	1,625,192.52	0.08
387	000539	粤电力 A	350,090.00	1,620,916.70	0.08
388	000507	珠海港	244,200.00	1,611,720.00	0.08
389	000034	神州数码	119,363.00	1,605,432.35	0.08
390	002048	宁波华翔	153,753.00	1,603,643.79	0.08

391	002402	和而泰	258,300.00	1,596,294.00	0.08
392	002745	木林森	140,700.00	1,588,503.00	0.08
393	002709	天赐材料	73,317.00	1,588,046.22	0.08
394	002517	恺英网络	427,255.00	1,585,116.05	0.07
395	300458	全志科技	78,913.00	1,578,260.00	0.07
396	300308	中际旭创	38,600.00	1,570,634.00	0.07
397	002807	江阴银行	308,700.00	1,568,196.00	0.07
398	300463	迈克生物	107,032.00	1,562,667.20	0.07
399	002249	大洋电机	470,541.00	1,552,785.30	0.07
400	000727	华东科技	1,049,344.00	1,542,535.68	0.07
401	000799	酒鬼酒	96,400.00	1,540,472.00	0.07
402	002468	申通快递	93,600.00	1,539,720.00	0.07
403	002912	中新赛克	18,900.00	1,532,034.00	0.07
404	000935	四川双马	101,500.00	1,526,560.00	0.07
405	000564	供销大集	600,300.00	1,518,759.00	0.07
406	300567	精测电子	29,900.00	1,509,352.00	0.07
407	000901	航天科技	169,679.00	1,499,962.36	0.07
408	000016	深康佳 A	460,900.00	1,493,316.00	0.07
409	002424	贵州百灵	170,428.00	1,491,245.00	0.07
410	300666	江丰电子	35,900.00	1,483,388.00	0.07
411	002600	领益智造	592,520.00	1,481,300.00	0.07
412	002596	海南瑞泽	244,000.00	1,461,560.00	0.07
413	002359	北讯集团	177,800.00	1,459,738.00	0.07
414	002242	九阳股份	90,655.00	1,451,386.55	0.07
415	300145	中金环境	444,880.00	1,445,860.00	0.07
416	002737	葵花药业	97,800.00	1,445,484.00	0.07
417	300339	润和软件	158,383.00	1,444,452.96	0.07
418	300482	万孚生物	56,800.00	1,443,288.00	0.07
419	002002	鸿达兴业	498,979.00	1,437,059.52	0.07
420	002258	利尔化学	108,400.00	1,424,376.00	0.07
421	002926	华西证券	169,500.00	1,418,715.00	0.07
422	002156	通富微电	197,900.00	1,411,027.00	0.07
423	002925	盈趣科技	32,100.00	1,408,548.00	0.07
424	002544	杰赛科技	129,440.00	1,400,540.80	0.07
425	000049	德赛电池	48,570.00	1,392,987.60	0.07
426	002716	金贵银业	227,093.00	1,392,080.09	0.07
427	002614	奥佳华	87,250.00	1,391,637.50	0.07
428	000426	兴业矿业	278,280.00	1,385,834.40	0.07
429	002343	慈文传媒	153,217.00	1,382,017.34	0.07
430	300257	开山股份	137,698.00	1,375,603.02	0.07
431	002815	崇达技术	93,500.00	1,366,035.00	0.06
432	000088	盐田港	272,259.00	1,361,295.00	0.06
433	002635	安洁科技	119,537.00	1,354,354.21	0.06
434	002430	杭氧股份	143,400.00	1,340,790.00	0.06

435	300266	兴源环境	378,238.00	1,335,180.14	0.06
436	002382	蓝帆医疗	89,800.00	1,334,428.00	0.06
437	002292	奥飞娱乐	234,559.00	1,327,603.94	0.06
438	002611	东方精工	354,000.00	1,327,500.00	0.06
439	000555	神州信息	141,787.00	1,324,290.58	0.06
440	000537	广宇发展	174,400.00	1,306,256.00	0.06
441	000525	红太阳	91,900.00	1,289,357.00	0.06
442	002509	天广中茂	543,700.00	1,288,569.00	0.06
443	002390	信邦制药	315,052.00	1,288,562.68	0.06
444	000910	大亚圣象	122,800.00	1,266,068.00	0.06
445	000990	诚志股份	103,300.00	1,240,633.00	0.06
446	300348	长亮科技	75,300.00	1,237,179.00	0.06
447	000989	九芝堂	126,100.00	1,237,041.00	0.06
448	002354	天神娱乐	235,247.00	1,232,694.28	0.06
449	300118	东方日升	216,255.00	1,230,490.95	0.06
450	002429	兆驰股份	646,939.00	1,229,184.10	0.06
451	000723	美锦能源	381,100.00	1,223,331.00	0.06
452	000062	深圳华强	73,306.00	1,221,277.96	0.06
453	002434	万里扬	185,100.00	1,219,809.00	0.06
454	000869	张裕A	46,404.00	1,206,504.00	0.06
455	000921	海信家电	165,500.00	1,170,085.00	0.06
456	002681	奋达科技	316,585.00	1,158,701.10	0.05
457	002251	步步高	155,600.00	1,154,552.00	0.05
458	300353	东土科技	131,700.00	1,149,741.00	0.05
459	000766	通化金马	166,700.00	1,143,562.00	0.05
460	300323	华灿光电	157,300.00	1,137,279.00	0.05
461	002501	利源精制	401,129.00	1,135,195.07	0.05
462	300373	扬杰科技	78,300.00	1,130,652.00	0.05
463	000155	川能动力	313,000.00	1,126,800.00	0.05
464	002668	奥马电器	230,753.00	1,123,767.11	0.05
465	000959	首钢股份	299,850.00	1,118,440.50	0.05
466	300409	道氏技术	85,000.00	1,114,350.00	0.05
467	000822	山东海化	229,500.00	1,113,075.00	0.05
468	300568	星源材质	50,100.00	1,111,719.00	0.05
469	300085	银之杰	138,548.00	1,102,842.08	0.05
470	000981	银亿股份	350,500.00	1,093,560.00	0.05
471	002308	威创股份	239,384.00	1,065,258.80	0.05
472	300107	建新股份	112,700.00	1,062,761.00	0.05
473	300474	景嘉微	29,205.00	1,056,052.80	0.05
474	002320	海峡股份	76,551.00	1,029,610.95	0.05
475	002080	中材科技	125,600.00	1,016,104.00	0.05
476	002503	搜于特	428,580.00	1,007,163.00	0.05
477	002625	光启技术	101,336.00	1,003,226.40	0.05
478	300454	深信服	11,100.00	994,560.00	0.05

479	002477	雏鹰农牧	657,458.00	986,187.00	0.05
480	000553	沙隆达 A	105,000.00	958,650.00	0.05
481	002437	誉衡药业	328,803.00	920,648.40	0.04
482	002607	亚夏汽车	127,700.00	919,440.00	0.04
483	002512	达华智能	170,717.00	906,507.27	0.04
484	002664	长鹰信质	72,600.00	891,528.00	0.04
485	000987	越秀金控	111,840.00	891,364.80	0.04
486	002118	紫鑫药业	197,800.00	862,408.00	0.04
487	000687	华讯方舟	120,643.00	856,565.30	0.04
488	000710	贝瑞基因	26,800.00	854,920.00	0.04
489	300156	神雾环保	229,503.00	833,095.89	0.04
490	300741	华宝股份	26,500.00	823,355.00	0.04
491	002016	世荣兆业	90,100.00	812,702.00	0.04
492	000587	金洲慈航	343,092.00	806,266.20	0.04
493	002920	德赛西威	43,000.00	746,050.00	0.04
494	300504	天邑股份	28,700.00	739,312.00	0.03
495	002699	美盛文化	134,904.00	739,273.92	0.03
496	002930	宏川智慧	26,100.00	674,685.00	0.03
497	000617	中油资本	49,501.00	532,135.75	0.03
498	300317	珈伟新能	109,721.00	515,688.70	0.02
499	002907	华森制药	22,000.00	414,480.00	0.02
500	300634	彩讯股份	17,200.00	410,564.00	0.02
501	002911	佛燃股份	24,100.00	406,326.00	0.02
502	002143	印纪传媒	137,649.00	393,676.14	0.02
503	300431	暴风集团	74.00	617.16	0.00
504	000693	*ST 华泽	159,528.00	0.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	000333	美的集团	56,091,271.01	2.40
2	000651	格力电器	53,970,880.49	2.31
3	000858	五粮液	32,082,678.06	1.37
4	002415	海康威视	31,089,877.47	1.33
5	000002	万科 A	29,767,338.66	1.27
6	000725	京东方 A	26,600,214.08	1.14
7	000001	平安银行	23,003,589.00	0.98
8	300498	温氏股份	21,291,091.42	0.91
9	002027	分众传媒	20,275,534.31	0.87

10	002304	洋河股份	17,092,659.55	0.73
11	002450	康得新	15,870,160.82	0.68
12	300059	东方财富	13,101,693.84	0.56
13	002230	科大讯飞	13,025,601.97	0.56
14	002142	宁波银行	12,342,298.35	0.53
15	000776	广发证券	11,548,505.19	0.49
16	002024	苏宁易购	11,374,582.09	0.49
17	000568	泸州老窖	10,899,568.97	0.47
18	002594	比亚迪	10,521,370.50	0.45
19	001979	招商蛇口	10,199,187.15	0.44
20	002008	大族激光	10,164,023.35	0.43

8.4.2 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	000651	格力电器	40,150,048.14	1.72
2	000333	美的集团	39,470,173.48	1.69
3	000858	五粮液	24,311,782.97	1.04
4	002415	海康威视	21,213,241.81	0.91
5	000002	万科A	19,133,926.77	0.82
6	000725	京东方A	18,514,491.00	0.79
7	000001	平安银行	15,773,274.50	0.67
8	300498	温氏股份	14,500,840.95	0.62
9	002450	康得新	12,635,685.60	0.54
10	002304	洋河股份	12,339,003.02	0.53
11	002230	科大讯飞	8,868,841.97	0.38
12	002466	天齐锂业	8,732,142.65	0.37
13	002027	分众传媒	8,644,564.00	0.37
14	002142	宁波银行	8,297,249.22	0.35
15	000568	泸州老窖	7,897,536.00	0.34
16	000776	广发证券	7,894,998.00	0.34
17	002024	苏宁易购	7,885,791.13	0.34
18	000538	云南白药	7,751,677.87	0.33
19	002594	比亚迪	7,688,720.38	0.33
20	002008	大族激光	7,629,389.15	0.33

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	1,770,148,052.80
---------------	------------------

卖出股票的收入（成交）总额	1,190,440,091.43
---------------	------------------

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。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

根据本基金基金合同，本基金不得参与股指期货交易。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金基金合同，本基金不得参与股指期货交易。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同，本基金不得参与国债期货交易。

8.11.2 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，本基金不得参与国债期货交易。

8.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同，本基金不得参与国债期货交易。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 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。

8.12.3 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	193,021.55
2	应收证券清算款	34,442.94
3	应收股利	-
4	应收利息	41,895.32
5	应收申购款	6,378,794.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,648,154.08

8.12.4 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。

8.12.5 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股票中不存在流通受限情况。

§9 基金份额持有人信息**9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

份额级别	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	持有份额	占总份	

				例		额比例
申万深成	8,958	25,209.73	41,820,313.50	18.52%	184,008,430.72	81.48%
深成指 A	2,664	943,407.97	2,178,036,690.00	86.66%	335,202,129.00	13.34%
深成指 B	24,823	101,246.38	44,886,058.00	1.79%	2,468,352,761.00	98.21%
合计	34,180	153,666.07	2,264,743,061.50	43.12%	2,987,563,320.72	56.88%

注：“持有人户数”合计数小于各份额级别持有人户数的总和，是由于一个持有人同时持有多个级别基金份额。

9.2 期末上市基金前十名持有人

深成指A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	工银瑞信基金—交通银行—工银瑞信投资管理有限公司	292,846,676.00	11.65%
2	工银瑞信基金—招商银行—招商财富资产管理有限公司	266,431,178.00	10.60%
3	中意人寿保险有限公司	230,582,893.00	9.17%
4	国寿安保基金—工商银行—中国人寿保险—中国人寿保险股份有限公司委托国寿安保基金管理有限公司稳健系列组合	124,127,556.00	4.94%
5	中意人寿保险有限公司—分红—团体年金	103,825,661.00	4.13%
6	广发基金—招商银行—招商财富资产管理有限公司	86,205,140.00	3.43%
7	广发基金—光大银行—光大保德信资产管理有限公司	82,877,609.00	3.30%
8	中国太平洋人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品	79,674,961.00	3.17%
9	中意资产管理有限责任公司—自有资金	78,002,222.00	3.10%
10	中国太平洋人寿保险股份有限公司—分红—个人分红	69,934,195.00	2.78%

注：以上数据由中国证券登记结算有限责任公司提供。

深成指B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	郭玉清	61,478,782.00	2.45%
2	卢文星	39,886,400.00	1.59%
3	赵刚	31,251,574.00	1.24%
4	张云龙	29,598,511.00	1.18%
5	唐志军	25,000,000.00	0.99%
6	国泰基金—工商银行—国泰基金—天鑫多策略1号资产管理计划	19,891,700.00	0.79%
7	谭秩秋	16,000,000.00	0.64%
8	周沫	15,106,100.00	0.60%

9	许昌清	13,464,889.00	0.54%
10	段莉莉	12,455,717.00	0.50%

注：以上数据由中国证券登记结算有限责任公司提供。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

分级基金管理人的从业人员持有基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.4 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	份额级别	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	申万深成	0
	深成指 A	0
	深成指 B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	申万深成	0
	深成指 A	0
	深成指 B	0
	合计	0

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	申万深成	深成指 A	深成指 B
本报告期期初基金份额总额	181,750,636.64	1,804,386,910.00	1,804,386,910.00
本报告期基金总申购份额	3,620,278,655.94	-	-
减：本报告期基金总赎回份额	2,300,243,712.34	-	-
本报告期基金拆分变动份额	-1,275,956,836.02	708,851,909.00	708,851,909.00
本报告期末基金份额总额	225,828,744.22	2,513,238,819.00	2,513,238,819.00

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。

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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，同意独立董事由阎小平先生变更为 WEI/SHANGJIN（魏尚进）先生。

2、本报告期内，经本基金管理人股东会决议，同意独立董事由张军建先生变更为余卫明先生。

3、本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 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。自本基金合同生效以来，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务时间为 9 年。本报告期本基金应支付普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计费 100,000 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本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。

11.7 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	
安信证券	1	539,955,483.63	18.25%	492,063.96	18.25%	-
中泰证券	1	341,144,513.90	11.53%	310,890.67	11.53%	-
东方财富证券	1	323,583,278.98	10.94%	294,885.37	10.94%	-
东吴证券	1	241,271,394.65	8.16%	219,872.70	8.16%	-
华信证券	1	225,490,053.33	7.62%	205,491.04	7.62%	-
光大证券	1	181,986,265.28	6.15%	165,844.62	6.15%	-
中信建投	1	176,864,445.93	5.98%	161,177.66	5.98%	新增
海通证券	1	162,902,627.64	5.51%	148,453.90	5.51%	-
兴业证券	1	134,464,007.91	4.55%	122,537.97	4.55%	-
申万宏源	3	126,164,776.80	4.27%	114,974.74	4.27%	-
国泰君安	1	109,833,359.74	3.71%	100,091.43	3.71%	-
银河证券	1	100,719,873.98	3.40%	91,786.77	3.40%	-
广发证券	1	94,170,345.99	3.18%	85,817.50	3.18%	-
中信证券	1	92,443,711.85	3.13%	84,243.83	3.13%	-
国金证券	2	55,146,530.58	1.86%	50,256.30	1.86%	-

东兴证券	1	51,859,115.09	1.75%	47,259.62	1.75%	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
华融证券	2	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
五矿证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	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。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于旗下开放式基金 2017 年年度最后一个交易日基金资产净值和基金份额净值的公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-01-02
2	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金办理份额折算业务期间深成指 A 停复牌的公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-01-03
3	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金之申万收益份额 2018 年度约定年基准收益率变更的公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-01-04
4	关于旗下部分开放式基金参加中国农业银行股份有限公司开展的费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-01-04
5	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金办理份额折算结果及恢复交易的公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-01-04
6	关于深成指 A 定期份额折算后前收盘价调整的公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-01-04
7	关于旗下部分开放式基金在上海利得基金销售有限公司	《中国证券报》、	2018-01-05

	司开通转换业务及参加上海利得基金销售有限公司开展的转换费率优惠活动的公告	《证券日报》	
8	关于旗下部分开放式基金新增财通证券股份有限公司为代销机构并开通定期定额投资、转换业务及参加财通证券股份有限公司开展的费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-01-15
9	关于旗下部分开放式基金参加北京展恒基金销售股份有限公司开展的费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-01-30
10	关于调整旗下部分开放式基金在深圳市新兰德证券投资咨询有限公司的申购、赎回及最低持有份额下限的公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-02-01
11	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金之申万收益份额（场内简称“深成指 A”）、申万进取份额（场内简称“深成指 B”）可能发生极端情况的风险提示公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-02-01
12	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金之申万收益份额（场内简称“深成指 A”）、申万进取份额（场内简称“深成指 B”）可能发生极端情况的风险提示公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-02-07
13	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金之申万收益份额（场内简称“深成指 A”）、申万进取份额（场内简称“深成指 B”）可能发生极端情况的风险提示公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-02-08
14	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金之申万收益份额（场内简称“深成指 A”）、申万进取份额（场内简称“深成指 B”）可能发生极端情况的风险提示公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-02-09
15	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金之申万收益份额发生极端情况的风险提示公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-02-10
16	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金之申万进取份额发生极端情况的风险提示公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-02-10
17	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金发生极端情况下申万收益、申万进取份额净值计算方法的公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-02-10
18	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金恢复正常情况后申万收益份额（场内简称“深成指 A”）、申万进取份额（场内简称“深成指 B”）净值计算方法的公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-02-13
19	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金之申万收益份额（场内简称“深成指 A”）、申万进取份额（场内简称“深成指 B”）可能发生极端情况的风险提示公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-02-14
20	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金之申万收益份额（场内简称“深成指 A”）、申万进取份额（场内简称“深成指 B”）可能发生极端情况的风险提示公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-02-22
21	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金之申万收益份额（场内简称“深成指 A”）、申万进取份额（场内简称“深成指 B”）可能发生极端情况的风险提示公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-02-23
22	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金之申万收益份额（场内简称“深成指 A”）、申万进取份额（场内简称“深成指 B”）可能发生极端情况的风险提示公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-02-24
23	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金之申万收益	《中国证券报》、	2018-03-06

	份额（场内简称“深成指 A”）、申万进取份额（场内简称“深成指 B”）可能发生极端情况的风险提示公告	《证券日报》	
24	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金之申万收益份额（场内简称“深成指 A”）、申万进取份额（场内简称“深成指 B”）可能发生极端情况的风险提示公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-03-21
25	申万菱信深证成指分级证券投资基金托管协议	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-03-24
26	申万菱信深证成指分级证券投资基金基金合同	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-03-24
27	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金之申万收益份额（场内简称“深成指 A”）、申万进取份额（场内简称“深成指 B”）可能发生极端情况的风险提示公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-03-24
28	关于旗下部分开放式基金修改基金合同的公告（24 只基金）	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-03-24
29	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金之申万收益份额（场内简称“深成指 A”）、申万进取份额（场内简称“深成指 B”）可能发生极端情况的风险提示公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-03-27
30	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金之申万收益份额（场内简称“深成指 A”）、申万进取份额（场内简称“深成指 B”）可能发生极端情况的风险提示公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-03-28
31	申万菱信基金管理有限公司关于申万菱信深证成指分级证券投资基金之申万收益份额（场内简称“深成指 A”）、申万进取份额（场内简称“深成指 B”）可能发生极端情况的风险提示公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-03-29
32	关于旗下部分开放式基金继续参加中国工商银行股份有限公司开展的个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-03-29
33	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金之申万收益份额（场内简称“深成指 A”）、申万进取份额（场内简称“深成指 B”）可能发生极端情况的风险提示公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-03-30
34	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金之申万收益份额（场内简称“深成指 A”）、申万进取份额（场内简称“深成指 B”）可能发生极端情况的风险提示公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-04-04
35	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金之申万收益份额（场内简称“深成指 A”）、申万进取份额（场内简称“深成指 B”）可能发生极端情况的风险提示公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-04-09
36	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金之申万收益份额（场内简称“深成指 A”）、申万进取份额（场内简称“深成指 B”）可能发生极端情况的风险提示公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-04-10
37	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金之申万收益份额（场内简称“深成指 A”）、申万进取份额（场内简称“深成指 B”）可能发生极端情况的风险提示公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-04-11
38	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金之申万收益份额（场内简称“深成指 A”）、申万进取份额（场内简	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-04-13

	称“深成指 B”)可能发生极端情况的风险提示公告		
39	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金之申万收益份额(场内简称“深成指 A”)、申万进取份额(场内简称“深成指 B”)可能发生极端情况的风险提示公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-04-14
40	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金之申万收益份额(场内简称“深成指 A”)、申万进取份额(场内简称“深成指 B”)可能发生极端情况的风险提示公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-04-17
41	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金之申万收益份额(场内简称“深成指 A”)、申万进取份额(场内简称“深成指 B”)可能发生极端情况的风险提示公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-04-18
42	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金之申万收益份额(场内简称“深成指 A”)、申万进取份额(场内简称“深成指 B”)可能发生极端情况的风险提示公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-04-19
43	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金之申万收益份额(场内简称“深成指 A”)、申万进取份额(场内简称“深成指 B”)可能发生极端情况的风险提示公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-04-20
44	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金之申万收益份额(场内简称“深成指 A”)、申万进取份额(场内简称“深成指 B”)可能发生极端情况的风险提示公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-04-21
45	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金之申万进取份额发生极端情况的风险提示公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-04-24
46	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金发生极端情况下申万收益、申万进取份额净值计算方法的公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-04-24
47	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金之申万收益份额发生极端情况的风险提示公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-04-24
48	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金恢复正常情况后申万收益份额(场内简称“深成指 A”)、申万进取份额(场内简称“深成指 B”)净值计算方法的公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-04-25
49	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金之申万收益份额(场内简称“深成指 A”)、申万进取份额(场内简称“深成指 B”)可能发生极端情况的风险提示公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-04-26
50	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金之申万收益份额发生极端情况的风险提示公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-04-27
51	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金之申万进取份额发生极端情况的风险提示公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-04-27
52	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金发生极端情况下申万收益、申万进取份额净值计算方法的公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-04-27
53	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金恢复正常情况后申万收益份额(场内简称“深成指 A”)、申万进取份额(场内简称“深成指 B”)净值计算方法的公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-05-04
54	关于旗下部分分级基金交易价格波动风险提示公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-05-07
55	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金之申万收益份额(场内简称“深成指 A”)、申万进取份额(场内简	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-05-07

	称“深成指 B”)可能发生极端情况的风险提示公告		
56	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金之申万收益份额(场内简称“深成指 A”)、申万进取份额(场内简称“深成指 B”)可能发生极端情况的风险提示公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-05-08
57	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金之申万收益份额(场内简称“深成指 A”)、申万进取份额(场内简称“深成指 B”)可能发生极端情况的风险提示公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-05-09
58	关于旗下部分基金新增南京苏宁基金销售有限公司为代销机构并开通定期定额投资、转换业务并参加南京苏宁基金销售有限公司开展的费率优惠活动及调整部分基金在南京苏宁基金销售有限公司申购金额、赎回份额、最低持有份额下限的公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-05-09
59	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金之申万收益份额(场内简称“深成指 A”)、申万进取份额(场内简称“深成指 B”)可能发生极端情况的风险提示公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-05-10
60	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金之申万收益份额(场内简称“深成指 A”)、申万进取份额(场内简称“深成指 B”)可能发生极端情况的风险提示公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-05-11
61	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金之申万收益份额(场内简称“深成指 A”)、申万进取份额(场内简称“深成指 B”)可能发生极端情况的风险提示公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-05-12
62	申万菱信深证成指分级证券投资基金暂停大额申购、定期定额投资及转换转入业务的公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-05-12
63	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金之申万收益份额(场内简称“深成指 A”)、申万进取份额(场内简称“深成指 B”)可能发生极端情况的风险提示公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-05-15
64	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金之申万收益份额(场内简称“深成指 A”)、申万进取份额(场内简称“深成指 B”)可能发生极端情况的风险提示公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-05-16
65	关于旗下部分基金参加中国银河证券股份有限公司开展的费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-05-17
66	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金之申万收益份额(场内简称“深成指 A”)、申万进取份额(场内简称“深成指 B”)可能发生极端情况的风险提示公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-05-17
67	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金之申万收益份额(场内简称“深成指 A”)、申万进取份额(场内简称“深成指 B”)可能发生极端情况的风险提示公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-05-18
68	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金之申万收益份额(场内简称“深成指 A”)、申万进取份额(场内简称“深成指 B”)可能发生极端情况的风险提示公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-05-19
69	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金之申万收益份额(场内简称“深成指 A”)、申万进取份额(场内简称“深成指 B”)可能发生极端情况的风险提示公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-05-22
70	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金之申万收益	《中国证券报》、	2018-05-23

	份额（场内简称“深成指 A”）、申万进取份额（场内简称“深成指 B”）可能发生极端情况的风险提示公告	《证券日报》	
71	关于旗下部分分级基金交易价格波动风险提示公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-05-24
72	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金之申万收益份额（场内简称“深成指 A”）、申万进取份额（场内简称“深成指 B”）可能发生极端情况的风险提示公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-05-24
73	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金之申万收益份额（场内简称“深成指 A”）、申万进取份额（场内简称“深成指 B”）可能发生极端情况的风险提示公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-05-25
74	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金之申万收益份额（场内简称“深成指 A”）、申万进取份额（场内简称“深成指 B”）可能发生极端情况的风险提示公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-05-26
75	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金之申万收益份额（场内简称“深成指 A”）、申万进取份额（场内简称“深成指 B”）可能发生极端情况的风险提示公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-05-29
76	关于旗下部分基金新增上海基煜基金销售有限公司为代销机构并开通定期定额投资、转换业务并参加上海基煜基金销售有限公司开展的费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-05-29
77	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金之申万收益份额发生极端情况的风险提示公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-05-30
78	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金之申万进取份额发生极端情况的风险提示公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-05-30
79	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金发生极端情况下申万收益、申万进取份额净值计算方法的公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-05-30
80	关于旗下部分基金新增上海挖财基金销售有限公司为代销机构并开通定期定额投资、转换业务并参加上海挖财基金销售有限公司开展的费率优惠活动及调整部分基金在上海挖财基金销售有限公司申购金额、赎回份额、最低持有份额下限的公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-06-08
81	关于旗下部分基金参加大泰金石基金销售有限公司开展的费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-06-27
82	关于旗下开放式基金 2018 年 6 月 30 日基金资产净值和基金份额净值的公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-07-02
83	关于取消旗下部分开放式基金面向直销中心养老金客户实施的特定赎回费率活动的公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-07-12
84	关于旗下部分基金新增南京银行股份有限公司为代销机构并开通定期定额投资、转换业务的公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-08-22
85	关于旗下部分基金新增中信期货有限公司为代销机构并开通定期定额投资、转换业务的公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-08-22
86	关于旗下基金新增北京植信基金销售有限公司为代销机构并参加费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-09-05
87	关于旗下部分基金新增济安财富（北京）基金销售有限公司为代销机构并开通定期定额投资、转换业务并	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-09-06

	参加济安财富（北京）基金销售有限公司开展的费率优惠活动的公告		
88	关于旗下部分基金新增大连网金基金销售有限公司为代销机构并开通定期定额投资、转换业务并参加大连网金基金销售有限公司开展的费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-09-12
89	关于旗下部分基金新增泰诚财富基金销售（大连）有限公司为代销机构并开通定期定额投资、转换业务并参加泰诚财富基金销售（大连）有限公司开展的费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-09-12
90	关于旗下申万菱信中证 500 指数优选增强型证券投资基金新增中国国际金融股份有限公司为代销机构并开通部分基金的定期定额投资及参加中国国际金融股份有限公司开展的费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-10-15
91	申万菱信深证成指分级证券投资基金基金经理变更公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-10-19
92	关于旗下部分基金新增北京虹点基金销售有限公司为代销机构并开通定期定额投资、转换业务并参加北京虹点基金销售有限公司开展的费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-11-13
93	关于旗下部分基金新增上海有鱼基金销售有限公司为代销机构并开通定期定额投资、转换业务并参加上海有鱼基金销售有限公司开展的费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-11-15
94	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金之申万收益份额、申万进取份额发生极端情况的风险提示公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-11-28
95	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金之申万收益份额、申万进取份额发生极端情况的风险提示公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-12-05
96	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金之申万收益份额、申万进取份额发生极端情况的风险提示公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-12-12
97	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金之申万收益份额、申万进取份额发生极端情况的风险提示公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-12-19
98	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金可能无法进行定期份额折算的风险提示公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-12-25
99	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金之申万收益份额、申万进取份额发生极端情况的风险提示公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-12-26
100	关于旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司开展的“2019 倾心回馈”基金定投优惠活动的公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-12-26
101	关于旗下部分开放式基金参加中国农业银行股份有限公司开展的费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《证券日报》	2018-12-27

12 影响投资者决策的其他重要信息

根据深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定及本基金《基金合同》的约定，本基金以 2018 年 1 月 2 日为折算基准日对该日登记在册的申万收益份额、申万深成份额（包括场内份额与场外份额）办理了定期份额折算业务。对于定期份额折算的方法及相关事宜，详见本

基金管理人于 2017 年 12 月 27 日、2018 年 1 月 3 日、2018 年 1 月 4 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基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》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，本基金管理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款。详见本基金管理人于 2018 年 3 月 24 日发布的公告。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

基金合同；
招募说明书及其定期更新；
发售公告；
成立公告；
开放日常交易业务公告；
定期报告；
其他临时公告。

13.2 存放地点

上述备查文件中基金合同、招募说明书及其定期更新、基金发售公告和基金成立公告均放置于本基金管理人及基金托管人的住所；开放日常交易业务公告、定期报告和其他临时公告放置于本基金管理人的住所。本基金管理人住所地址为：中国上海市中山南路 100 号 11 层。

13.3 查阅方式

上述文件均可到本基金管理人的住所进行查阅，也可在本基金管理人的网站进行查阅，查询网址：www.swsmu.com。

申万菱信基金管理有限公司

二〇一九年三月二十七日