

申万菱信深证成指分级证券投资基金
2019 年半年度报告
2019 年 6 月 30 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：二〇一九年八月二十四日

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。

基金托管人中国工商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。

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 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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.....	12
5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	13
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.....	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	35
7.3 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.....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	49
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.....	49
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.....	49
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.....	49
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.....	49
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	49
7.12 投资组合报告附注.....	50
8 基金份额持有人信息	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	51

8.2 期末上市基金前十名持有人.....	51
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	52
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.....	52
9 开放式基金份额变动.....	52
10 重大事件揭示.....	52
10.1 基金份额持有人大会决议.....	52
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.....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	53
10.4 基金投资策略的改变.....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	53
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.....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	53
10.8 其他重大事件.....	54
11 影响投资者决策的其他重要信息.....	56
12 备查文件目录.....	57
12.1 备查文件目录.....	57
12.2 存放地点.....	57
12.3 查阅方式.....	57

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	5,318,635,152.17 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	210,676,232.17 份	2,553,979,460.00 份	2,553,979,460.00 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	深证成指收益率 × 95% + 银行同业存款利率 × 5%		
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	姓名	
	王菲萍	郭明

负责人	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	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
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
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	-29,682,837.05
本期利润	540,192,468.65
加权平均基金份额本期利润	0.1032
本期加权平均净值利润率	21.03%
本期基金份额净值增长率	25.20%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	-1,252,978,783.44
期末可供分配基金份额利润	-0.2356
期末基金资产净值	2,681,641,216.89
期末基金份额净值	0.5042
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-31.79%

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	2.90%	1.27%	2.73%	1.31%	0.17%	-0.04%
过去三个月	-6.37%	1.70%	-6.95%	1.74%	0.58%	-0.04%
过去六个月	25.20%	1.67%	25.42%	1.71%	-0.22%	-0.04%
过去一年	-1.02%	1.61%	-1.83%	1.64%	0.81%	-0.03%
过去三年	-12.01%	1.22%	-11.55%	1.24%	-0.46%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-31.79%	1.56%	-27.53%	1.56%	-4.26%	0.00%

注：本基金的业绩基准指数=95%×深证成分指数收益率+5%×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：

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

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

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

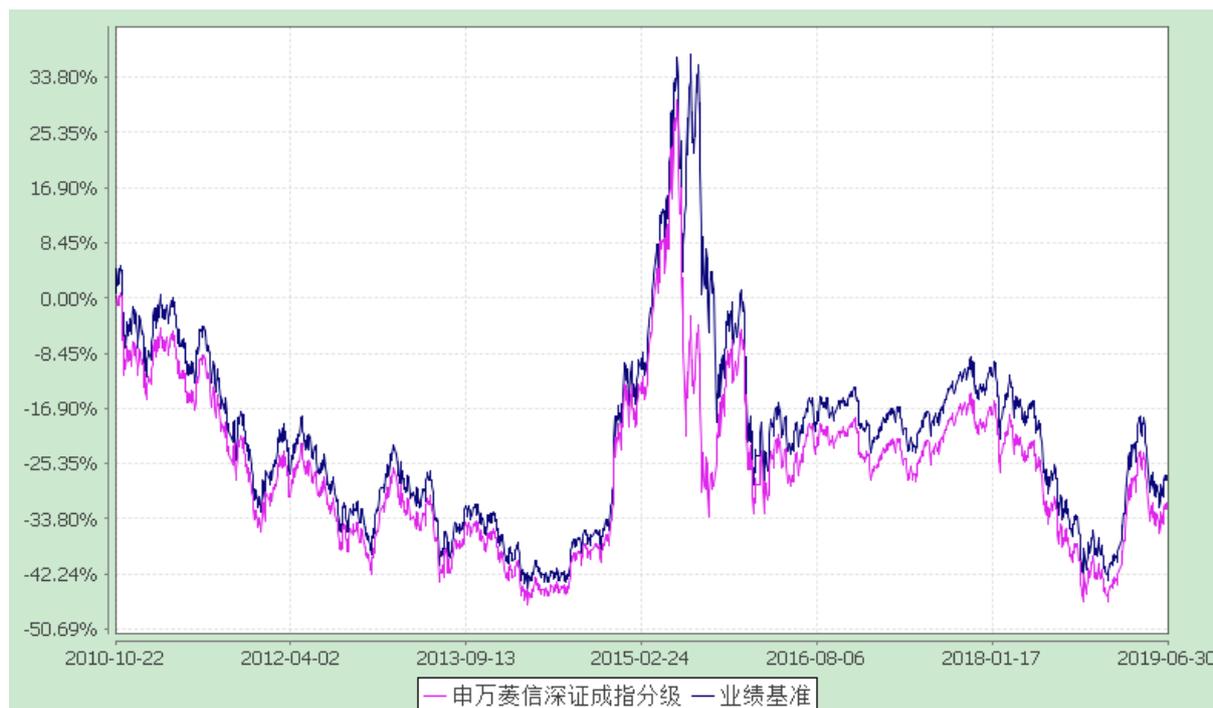
其中 $t=1,2,3,\dots$ 。

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

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

(2010年10月22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		
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合规守信情况的说明

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是 1) 指数成份股现金分红；2) 长期停牌股票估值调整；3) 基金大额申购赎回。

本基金产品在申万菱信深证成指指数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。深成指 A 和深成指 B 份额之比为 1:1。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。二级市场中，该品种交易的溢价幅度较大，而深成指 A 份额则是同类产品中折价幅度较高的品种。

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

2019 年上半年深证成分指数期间表现为 26.78%，基金业绩基准表现为 25.42%，申万菱信深成指分级基金净值期间表现为 25.20%，和业绩基准的差约 0.22%。

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投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

本基金本报告期末未进行利润分配，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

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 2019 年半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：申万菱信深证成指分级证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	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	7.4.7.1	186,176,122.08	154,425,087.69
结算备付金		346,272.44	121,592.49
存出保证金		85,591.53	193,021.55
交易性金融资产	7.4.7.2	2,496,493,581.02	1,956,876,745.84
其中：股票投资		2,496,493,581.02	1,956,876,745.84
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		2,039,504.98	34,442.94
应收利息	7.4.7.5	38,291.50	41,895.32
应收股利		-	-
应收申购款		58,625.35	6,378,794.27
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		2,685,237,988.90	2,118,071,580.10
负债和所有者权益	附注号	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	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		303,399.38	30,874.17
应付管理人报酬		2,116,668.60	1,810,729.81
应付托管费		465,667.10	398,360.58
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	366,113.52	365,376.96
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	344,923.41	365,578.73
负债合计		3,596,772.01	2,970,920.25
所有者权益:		-	-
实收基金	7.4.7.9	3,934,620,000.33	3,885,550,830.24
未分配利润	7.4.7.10	-1,252,978,783.44	-1,770,450,170.39
所有者权益合计		2,681,641,216.89	2,115,100,659.85
负债和所有者权益总计		2,685,237,988.90	2,118,071,580.10

注：报告截止日 2019 年 06 月 30 日，申万菱信深证成指分级证券投资基金之基础(以下简称“申万深成”)份额净值 0.5042 元，申万菱信深证成指分级证券投资基金之稳健收益类(以下简称“申万收益”)份额净值 0.9183 元，申万菱信深证成指分级证券投资基金之积极进取类(以下简称“申万进取”)份额净值 0.0901 元；申万深成份额 210,676,232.17 份，申万收益基金份额 2,553,979,460.00 份，申万进取类基金份额 2,553,979,460.00 份。

6.2 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	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		556,840,610.45	-306,086,802.32
1.利息收入		683,277.49	734,306.74
其中：存款利息收入	7.4.7.11	683,277.49	734,198.51
债券利息收入		-	108.23
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）		-13,915,769.63	-32,268,643.89
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-35,362,955.48	-46,479,215.90
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	131,520.38
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	21,447,185.85	14,079,051.63
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	569,875,305.70	-279,319,341.93
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	197,796.89	4,766,876.76
减：二、费用		16,648,141.80	17,665,711.08
1. 管理人报酬		12,677,360.05	11,567,445.14
2. 托管费		2,789,019.23	2,544,837.90
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	777,170.58	3,139,223.16
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	404,591.94	414,204.76
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		540,192,468.65	-323,752,513.40
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		540,192,468.65	-323,752,513.40

6.3 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：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）	3,885,550,830.24	-1,770,450,170.39	2,115,100,659.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	540,192,468.65	540,192,468.65
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）	49,069,170.09	-22,721,081.70	26,348,088.39
其中：1.基金申购款	273,911,012.33	-93,132,124.67	180,778,887.66
2.基金赎回款	-224,841,842.24	70,411,042.97	-154,430,799.27
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）	3,934,620,000.33	-1,252,978,783.44	2,681,641,216.89
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）	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）	-	-323,752,513.40	-323,752,513.40
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）	50,505,727.23	-27,846,043.10	22,659,684.13
其中：1.基金申购款	1,603,442,844.69	-387,736,771.26	1,215,706,073.43
2.基金赎回款	-1,552,937,117.46	359,890,728.16	-1,193,046,389.30
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）	2,959,485,573.78	-921,541,414.83	2,037,944,158.95

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，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,业经普华永道中天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(以下简称“中国工商银行”)。

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%。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: $95\% \times \text{深证成份指数增长率} + 5\% \times \text{银行同业存款利率}$ 。

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 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》、《申万菱信深证成指分级证券投资基金

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 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
活期存款	186,176,122.08
定期存款	-
其他存款	-
合计	186,176,122.08

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,471,181,712.05	2,496,493,581.02	25,311,868.97
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	2,471,181,712.05	2,496,493,581.02	25,311,868.97

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	38,097.20
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	155.80
应收债券利息	-
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	38.50
合计	38,291.50

6.4.7.6 其他资产

无余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日

交易所市场应付交易费用	366,113.52
银行间市场应付交易费用	-
合计	366,113.52

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,139.15
应付指数使用费	133,654.68
其他应付款	68,349.84
预提费用	141,779.74
合计	344,923.41

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,252,306,382.22	3,885,550,830.24
本期申购	370,260,683.81	273,911,012.33
本期赎回（以“-”号填列）	-303,931,913.86	-224,841,842.24
本期末	5,318,635,152.17	3,934,620,000.33

注：本期申购含红利再投资和转换转入份额，本期赎回含转换转出份额。

6.4.7.10 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	1,824,993,528.90	-3,595,443,699.29	-1,770,450,170.39
本期利润	-29,682,837.05	569,875,305.70	540,192,468.65
本期基金份额交易产生的变动数	22,796,068.62	-45,517,150.32	-22,721,081.70
其中：基金申购款	127,855,261.71	-220,987,386.38	-93,132,124.67
基金赎回款	-105,059,193.09	175,470,236.06	70,411,042.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,818,106,760.47	-3,071,085,543.91	-1,252,978,783.44

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	677,501.01
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	4,507.15
其他	1,269.33
合计	683,277.49

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	263,076,659.26
减：卖出股票成本总额	298,439,614.74
买卖股票差价收入	-35,362,955.48

6.4.7.13 债券投资收益

无。

6.4.7.14 衍生工具收益

无。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	21,447,185.85
基金投资产生的股利收益	-
合计	21,447,185.85

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
1.交易性金融资产	569,875,305.70
——股票投资	569,875,305.70
——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	569,875,305.70

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	197,462.67
转换费收入	334.22
合计	197,796.89

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。2、本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分组成，其中赎回费总额的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	777,170.58
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	777,170.58

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	62,438.39
汇划手续费	265.00
指数使用费	253,547.20
上市年费	29,752.78
账户维护费	9,000.00
合计	404,591.94

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。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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
中国工商银行股份有限公司	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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 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	65,376,676.46	12.59%	65,584,969.90	3.13%

6.4.10.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	59,578.13	12.59%	59,578.13	16.27%
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	59,768.17	3.13%	47,825.36	3.10%

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。权证交易不计佣金。

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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 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	12,677,360.05	11,567,445.14
其中：支付销售机构的客户维护费	379,583.35	455,238.77

注：支付基金管理人的基金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：日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 * 1.00% / 当年天数。

6.4.10.2.2 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	2,789,019.23	2,544,837.90

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

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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

申万深成

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。

6.4.10.5 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	
	2019年1月1日至2019年6月30日		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
中国工商银行	186,176,122.08	677,501.01	140,060,895.83	717,829.13

注：本基金的活期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。

6.4.10.6 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。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明**6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明**

本报告期内，本基金对基金管理人控股股东申万宏源证券有限公司的实际控制人申万宏源集团股份有限公司发行的证券“申万宏源”（证券代码“000166”）进行了投资交易。上述关联交易符合《基金合同》及相关法律法规的规定，不存在任何利益冲突或者损害持有人利益的情况。

6.4.10.7.2 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。

6.4.11 利润分配情况

根据本基金基金合同，本基金不进行利润分配。

6.4.12 期末（2019年6月30日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

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	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

6.4.12.3 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。

6.4.13 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。

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 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其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 2019 年 6 月 30 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(2018 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.3 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。

6.4.13.3.1 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该比例限制。

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 6.4.12。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 2019 年 6 月 30 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 0.001%。

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 2019 年 6 月 30 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 2,684,744,726.83 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 2019 年 6 月 30 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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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 2019 年 6 月 30 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019 年 6 月 30 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	186,176,122.08	-	-	-	-	-	186,176,122.08
结算备付金	346,272.44	-	-	-	-	-	346,272.44
存出保证金	85,591.53	-	-	-	-	-	85,591.53
交易性金融资产	-	-	-	-	-	2,496,493,581.02	2,496,493,581.02
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	2,039,504.98	2,039,504.98
应收利息	-	-	-	-	-	38,291.50	38,291.50
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	58,625.35	58,625.35
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	186,607,986.05	-	-	-	-	2,498,630,002.85	2,685,237,988.90
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	303,399.38	303,399.38
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,116,668.60	2,116,668.60
应付托管费	-	-	-	-	-	465,667.10	465,667.10

应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	366,113.52	366,113.52
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	344,923.41	344,923.41
负债总计	-	-	-	-	-	3,596,772.01	3,596,772.01
利率敏感度缺口	186,607,986.05	-	-	-	-	2,495,033,230.84	2,681,641,216.89
上年度末 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

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2018 年 12 月 31 日：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2018 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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的市场价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 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	2,496,493,581.02	93.10	1,956,876,745.84	92.52
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	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,496,493,581.02	93.10	1,956,876,745.84	92.52

6.4.13.4.3.2 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：人民币万元）	
		本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
	基准上升 5%	增加约 12,460	增加约 10,327
	基准下降 5%	减少约 12,460	减少约 10,327

6.4.14 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 2019 年 06 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 2,496,470,474.42 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

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 06 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) 除公允价值和增值税外，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	2,496,493,581.02	92.97

	其中：股票	2,496,493,581.02	92.97
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	186,522,394.52	6.95
8	其他各项资产	2,222,013.36	0.08
9	合计	2,685,237,988.90	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	75,370,536.39	2.81
B	采矿业	20,258,740.18	0.76
C	制造业	1,588,664,202.19	59.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	26,152,536.50	0.98
E	建筑业	15,142,960.46	0.56
F	批发和零售业	48,635,077.88	1.81
G	交通运输、仓储和邮政业	25,740,544.91	0.96
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	238,500,192.75	8.89
J	金融业	178,847,180.64	6.67
K	房地产业	130,108,616.47	4.85
L	租赁和商务服务业	41,446,520.84	1.55
M	科学研究和技术服务业	10,129,808.00	0.38
N	水利、环境和公共设施管理业	16,144,556.82	0.60
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	3,770,258.00	0.14
Q	卫生和社会工作	39,859,065.63	1.49

R	文化、体育和娱乐业	33,627,811.18	1.25
S	综合	4,094,972.18	0.15
	合计	2,496,493,581.02	93.10

7.2.2 报告期末按行业分类的沪港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	000651	格力电器	1,783,923.00	98,115,765.00	3.66
2	000333	美的集团	1,880,009.00	97,497,266.74	3.64
3	000858	五粮液	685,685.00	80,876,545.75	3.02
4	300498	温氏股份	1,466,239.00	52,579,330.54	1.96
5	000002	万科A	1,775,955.00	49,389,308.55	1.84
6	000001	平安银行	3,129,295.00	43,121,685.10	1.61
7	002415	海康威视	1,335,391.00	36,830,083.78	1.37
8	000725	京东方A	9,681,971.00	33,305,980.24	1.24
9	000063	中兴通讯	923,116.00	30,028,963.48	1.12
10	300059	东方财富	1,956,454.00	26,509,951.70	0.99
11	002304	洋河股份	211,510.00	25,711,155.60	0.96
12	000568	泸州老窖	293,272.00	23,705,175.76	0.88
13	002475	立讯精密	927,026.00	22,980,974.54	0.86
14	002027	分众传媒	4,206,614.00	22,252,988.06	0.83
15	002142	宁波银行	891,868.00	21,618,880.32	0.81
16	000338	潍柴动力	1,714,242.00	21,068,034.18	0.79
17	002230	科大讯飞	599,186.00	19,916,942.64	0.74
18	300750	宁德时代	285,631.00	19,674,263.28	0.73
19	001979	招商蛇口	898,247.00	18,773,362.30	0.70
20	000661	长春高新	54,289.00	18,349,682.00	0.68
21	002594	比亚迪	315,116.00	15,982,683.52	0.60
22	000776	广发证券	1,122,630.00	15,424,936.20	0.58
23	000166	申万宏源	3,036,161.00	15,211,166.61	0.57
24	002024	苏宁易购	1,308,580.00	15,022,498.40	0.56
25	002714	牧原股份	255,003.00	14,991,626.37	0.56
26	300015	爱尔眼科	463,913.00	14,367,385.61	0.54
27	000538	云南白药	169,416.00	14,132,682.72	0.53
28	300142	沃森生物	487,521.00	13,826,095.56	0.52
29	000876	新希望	780,574.00	13,558,570.38	0.51
30	000100	TCL 集团	4,013,404.00	13,364,635.32	0.50

31	002202	金风科技	997,180.00	12,394,947.40	0.46
32	000783	长江证券	1,537,879.00	12,010,834.99	0.45
33	002008	大族激光	331,944.00	11,412,234.72	0.43
34	000157	中联重科	1,846,710.00	11,098,727.10	0.41
35	002736	国信证券	827,965.00	10,896,019.40	0.41
36	002422	科伦药业	352,924.00	10,492,430.52	0.39
37	300347	泰格医药	130,770.00	10,082,367.00	0.38
38	300003	乐普医疗	436,851.00	10,056,310.02	0.38
39	002044	美年健康	801,580.00	9,971,655.20	0.37
40	300124	汇川技术	420,173.00	9,626,163.43	0.36
41	002007	华兰生物	306,515.00	9,345,642.35	0.35
42	002236	大华股份	626,111.00	9,091,131.72	0.34
43	000895	双汇发展	362,739.00	9,028,573.71	0.34
44	002410	广联达	271,734.00	8,937,331.26	0.33
45	000860	顺鑫农业	187,813.00	8,761,476.45	0.33
46	002001	新 和 成	443,447.00	8,554,092.63	0.32
47	000413	东旭光电	1,618,810.00	8,320,683.40	0.31
48	002311	海大集团	264,415.00	8,170,423.50	0.30
49	300760	迈瑞医疗	50,007.00	8,161,142.40	0.30
50	002157	正邦科技	488,879.00	8,144,724.14	0.30
51	000069	华侨城 A	1,158,958.00	8,054,758.10	0.30
52	300408	三环集团	408,172.00	7,938,945.40	0.30
53	002271	东方雨虹	348,945.00	7,907,093.70	0.29
54	002405	四维图新	489,956.00	7,888,291.60	0.29
55	000977	浪潮信息	330,317.00	7,881,363.62	0.29
56	000963	华东医药	300,570.00	7,802,797.20	0.29
57	300017	网宿科技	721,245.00	7,775,021.10	0.29
58	000768	中航飞机	492,717.00	7,760,292.75	0.29
59	300136	信维通信	312,756.00	7,646,884.20	0.29
60	300122	智飞生物	176,232.00	7,595,599.20	0.28
61	000425	徐工机械	1,649,670.00	7,357,528.20	0.27
62	002352	顺丰控股	216,300.00	7,345,548.00	0.27
63	000066	中国长城	712,758.00	7,327,152.24	0.27
64	000423	东阿阿胶	183,966.00	7,325,526.12	0.27
65	300033	同花顺	74,144.00	7,292,803.84	0.27
66	300024	机器人	460,323.00	7,010,719.29	0.26
67	002127	南极电商	620,400.00	6,973,296.00	0.26
68	000728	国元证券	757,311.00	6,944,541.87	0.26
69	002466	天齐锂业	274,571.00	6,941,154.88	0.26
70	002673	西部证券	686,374.00	6,918,649.92	0.26
71	002460	赣锋锂业	291,117.00	6,820,871.31	0.25
72	002049	紫光国微	153,524.00	6,771,943.64	0.25
73	002241	歌尔股份	739,272.00	6,572,128.08	0.25
74	002179	中航光电	195,599.00	6,544,742.54	0.24

75	002129	中环股份	668,801.00	6,527,497.76	0.24
76	300144	宋城演艺	281,651.00	6,517,404.14	0.24
77	002195	二三四五	1,651,792.00	6,425,470.88	0.24
78	002340	格林美	1,349,077.00	6,354,152.67	0.24
79	300253	卫宁健康	447,675.00	6,348,031.50	0.24
80	000750	国海证券	1,255,430.00	6,314,812.90	0.24
81	300383	光环新网	374,069.00	6,273,137.13	0.23
82	002439	启明星辰	230,384.00	6,197,329.60	0.23
83	002146	荣盛发展	658,632.00	6,184,554.48	0.23
84	000401	冀东水泥	349,000.00	6,145,890.00	0.23
85	002463	沪电股份	450,800.00	6,139,896.00	0.23
86	000703	恒逸石化	444,220.00	6,068,045.20	0.23
87	000938	紫光股份	222,071.00	6,051,434.75	0.23
88	000961	中南建设	691,056.00	5,984,544.96	0.22
89	300450	先导智能	177,889.00	5,977,070.40	0.22
90	300014	亿纬锂能	193,953.00	5,907,808.38	0.22
91	002456	欧菲光	751,604.00	5,892,575.36	0.22
92	000540	中天金融	1,537,937.00	5,890,298.71	0.22
93	002465	海格通信	615,995.00	5,876,592.30	0.22
94	000630	铜陵有色	2,376,650.00	5,846,559.00	0.22
95	002507	涪陵榨菜	190,100.00	5,798,050.00	0.22
96	000786	北新建材	318,685.00	5,777,759.05	0.22
97	300012	华测检测	519,100.00	5,606,280.00	0.21
98	002384	东山精密	384,464.00	5,601,640.48	0.21
99	002120	韵达股份	181,608.00	5,597,158.56	0.21
100	300146	汤臣倍健	288,301.00	5,593,039.40	0.21
101	300601	康泰生物	105,700.00	5,549,250.00	0.21
102	002223	鱼跃医疗	223,730.00	5,508,232.60	0.21
103	000596	古井贡酒	46,200.00	5,475,162.00	0.20
104	002081	金螳螂	529,788.00	5,462,114.28	0.20
105	300296	利亚德	685,983.00	5,371,246.89	0.20
106	002555	三七互娱	396,275.00	5,369,526.25	0.20
107	000623	吉林敖东	325,792.00	5,339,730.88	0.20
108	000625	长安汽车	796,591.00	5,281,398.33	0.20
109	002371	北方华创	75,233.00	5,209,885.25	0.19
110	002385	大北农	981,919.00	5,194,351.51	0.19
111	002493	荣盛石化	427,942.00	5,160,980.52	0.19
112	002065	东华软件	738,256.00	5,160,409.44	0.19
113	002739	万达电影	279,395.00	5,152,043.80	0.19
114	000656	金科股份	852,583.00	5,141,075.49	0.19
115	300070	碧水源	655,819.00	5,108,830.01	0.19
116	002797	第一创业	803,279.00	5,092,788.86	0.19
117	002268	卫士通	205,079.00	5,014,181.55	0.19
118	002926	华西证券	471,400.00	4,949,700.00	0.18

119	000629	攀钢钒钛	1,459,100.00	4,946,349.00	0.18
120	000709	河钢股份	1,653,277.00	4,943,298.23	0.18
121	002821	凯莱英	50,400.00	4,943,232.00	0.18
122	300454	深信服	56,400.00	4,937,256.00	0.18
123	002506	协鑫集成	739,000.00	4,936,520.00	0.18
124	002500	山西证券	609,279.00	4,935,159.90	0.18
125	002508	老板电器	181,691.00	4,931,093.74	0.18
126	000686	东北证券	552,347.00	4,866,177.07	0.18
127	000997	新大陆	286,867.00	4,845,183.63	0.18
128	002050	三花智控	455,562.00	4,806,179.10	0.18
129	002252	上海莱士	679,803.00	4,724,630.85	0.18
130	000050	深天马A	350,809.00	4,714,872.96	0.18
131	000039	中集集团	440,525.00	4,704,807.00	0.18
132	002092	中泰化学	588,835.00	4,687,126.60	0.17
133	000503	国新健康	272,714.00	4,679,772.24	0.17
134	000988	华工科技	294,849.00	4,664,511.18	0.17
135	002032	苏泊尔	61,450.00	4,659,753.50	0.17
136	000060	中金岭南	993,460.00	4,659,327.40	0.17
137	002013	中航机电	671,725.00	4,621,468.00	0.17
138	002373	千方科技	267,677.00	4,577,276.70	0.17
139	002153	石基信息	123,334.00	4,463,457.46	0.17
140	002138	顺络电子	253,763.00	4,461,153.54	0.17
141	000627	天茂集团	685,034.00	4,445,870.66	0.17
142	002353	杰瑞股份	191,462.00	4,422,772.20	0.16
143	300168	万达信息	338,907.00	4,395,623.79	0.16
144	000778	新兴铸管	985,163.00	4,374,123.72	0.16
145	300207	欣旺达	379,242.00	4,368,867.84	0.16
146	000975	银泰资源	330,847.00	4,363,871.93	0.16
147	000830	鲁西化工	399,700.00	4,348,736.00	0.16
148	002602	世纪华通	394,036.00	4,302,873.12	0.16
149	000999	华润三九	146,344.00	4,293,732.96	0.16
150	002387	维信诺	327,400.00	4,272,570.00	0.16
151	300285	国瓷材料	250,450.00	4,260,154.50	0.16
152	300271	华宇软件	222,998.00	4,236,962.00	0.16
153	000960	锡业股份	377,347.00	4,214,965.99	0.16
154	000690	宝新能源	652,963.00	4,205,081.72	0.16
155	002572	索菲亚	224,930.00	4,174,700.80	0.16
156	002624	完美世界	160,993.00	4,155,229.33	0.15
157	002299	圣农发展	163,449.00	4,138,528.68	0.15
158	002916	深南电路	40,600.00	4,137,952.00	0.15
159	000839	中信国安	1,024,111.00	4,116,926.22	0.15
160	000009	中国宝安	717,158.00	4,094,972.18	0.15
161	000898	鞍钢股份	1,079,486.00	4,091,251.94	0.15
162	002191	劲嘉股份	325,916.00	4,044,617.56	0.15

163	002600	领益智造	666,220.00	3,950,684.60	0.15
164	000671	阳光城	607,841.00	3,938,809.68	0.15
165	000831	五矿稀土	241,700.00	3,922,791.00	0.15
166	002075	沙钢股份	496,245.00	3,890,560.80	0.15
167	300009	安科生物	244,165.00	3,882,223.50	0.14
168	002217	合力泰	694,915.00	3,842,879.95	0.14
169	000970	中科三环	336,564.00	3,820,001.40	0.14
170	000547	航天发展	399,076.00	3,815,166.56	0.14
171	000723	美锦能源	364,700.00	3,811,115.00	0.14
172	002607	中公教育	274,600.00	3,770,258.00	0.14
173	002038	双鹭药业	159,569.00	3,759,445.64	0.14
174	000513	丽珠集团	113,112.00	3,758,711.76	0.14
175	000581	威孚高科	201,345.00	3,736,963.20	0.14
176	002281	光迅科技	140,983.00	3,733,229.84	0.14
177	300166	东方国信	301,743.00	3,708,421.47	0.14
178	002601	龙鳞佰利	249,900.00	3,706,017.00	0.14
179	300088	长信科技	732,064.00	3,704,243.84	0.14
180	002078	太阳纸业	541,055.00	3,684,584.55	0.14
181	000998	隆平高科	252,835.00	3,661,050.80	0.14
182	300170	汉得信息	268,756.00	3,652,394.04	0.14
183	300072	三聚环保	458,685.00	3,637,372.05	0.14
184	002180	纳思达	160,059.00	3,617,333.40	0.13
185	300098	高新兴	452,725.00	3,612,745.50	0.13
186	300676	华大基因	63,300.00	3,610,632.00	0.13
187	002074	国轩高科	274,396.00	3,597,331.56	0.13
188	000983	西山煤电	590,959.00	3,581,211.54	0.13
189	002110	三钢闽光	383,850.00	3,569,805.00	0.13
190	300001	特锐德	194,318.00	3,501,610.36	0.13
191	002237	恒邦股份	209,488.00	3,500,544.48	0.13
192	000825	太钢不锈	855,137.00	3,480,407.59	0.13
193	300413	芒果超媒	84,647.00	3,474,759.35	0.13
194	002131	利欧股份	1,806,633.00	3,450,669.03	0.13
195	300226	上海钢联	46,000.00	3,448,160.00	0.13
196	000402	金融街	438,744.00	3,439,752.96	0.13
197	002019	亿帆医药	280,565.00	3,436,921.25	0.13
198	000046	泛海控股	613,781.00	3,424,897.98	0.13
199	300274	阳光电源	361,208.00	3,377,294.80	0.13
200	000878	云南铜业	316,320.00	3,362,481.60	0.13
201	300315	掌趣科技	968,723.00	3,342,094.35	0.12
202	002396	星网锐捷	147,295.00	3,305,299.80	0.12
203	002185	华天科技	648,550.00	3,301,119.50	0.12
204	300628	亿联网络	30,800.00	3,297,756.00	0.12
205	002002	鸿达兴业	532,479.00	3,296,045.01	0.12
206	000883	湖北能源	758,808.00	3,293,226.72	0.12

207	002372	伟星新材	188,906.00	3,286,964.40	0.12
208	300357	我武生物	96,640.00	3,278,028.80	0.12
209	000826	启迪环境	274,529.00	3,236,696.91	0.12
210	002085	万丰奥威	443,845.00	3,231,191.60	0.12
211	000598	兴蓉环境	710,018.00	3,230,581.90	0.12
212	000932	华菱钢铁	677,199.00	3,230,239.23	0.12
213	000089	深圳机场	362,871.00	3,225,923.19	0.12
214	300027	华谊兄弟	649,900.00	3,191,009.00	0.12
215	002511	中顺洁柔	259,400.00	3,185,432.00	0.12
216	002310	东方园林	526,956.00	3,161,736.00	0.12
217	000732	泰禾集团	191,095.00	3,153,067.50	0.12
218	002152	广电运通	459,536.00	3,147,821.60	0.12
219	002233	塔牌集团	269,000.00	3,141,920.00	0.12
220	002035	华帝股份	257,765.00	3,139,577.70	0.12
221	000563	陕国投 A	706,296.00	3,135,954.24	0.12
222	000729	燕京啤酒	472,058.00	3,134,465.12	0.12
223	300212	易华录	127,452.00	3,122,574.00	0.12
224	000800	一汽轿车	314,397.00	3,093,666.48	0.12
225	002294	信立泰	138,125.00	3,091,237.50	0.12
226	300073	当升科技	134,343.00	3,085,858.71	0.12
227	002174	游族网络	182,499.00	3,080,583.12	0.11
228	002558	巨人网络	169,480.00	3,079,451.60	0.11
229	002273	水晶光电	264,697.00	3,065,191.26	0.11
230	002440	闰土股份	244,844.00	3,050,756.24	0.11
231	002212	南洋股份	222,500.00	3,048,250.00	0.11
232	002010	传化智联	403,034.00	3,034,846.02	0.11
233	300180	华峰超纤	216,200.00	3,031,124.00	0.11
234	300188	美亚柏科	169,400.00	3,020,402.00	0.11
235	002690	美亚光电	92,106.00	3,002,655.60	0.11
236	002155	湖南黄金	297,029.00	2,991,082.03	0.11
237	002595	豪迈科技	142,341.00	2,990,584.41	0.11
238	000738	航发控制	220,537.00	2,955,195.80	0.11
239	002266	浙富控股	621,489.00	2,952,072.75	0.11
240	000758	中色股份	536,478.00	2,945,264.22	0.11
241	000559	万向钱潮	492,421.00	2,944,677.58	0.11
242	300316	晶盛机电	231,990.00	2,943,953.10	0.11
243	300699	光威复材	89,940.00	2,941,038.00	0.11
244	000516	国际医学	578,804.00	2,940,324.32	0.11
245	002368	太极股份	96,808.00	2,933,282.40	0.11
246	300058	蓝色光标	686,204.00	2,930,091.08	0.11
247	300182	捷成股份	660,737.00	2,913,850.17	0.11
248	002004	华邦健康	599,456.00	2,913,356.16	0.11
249	002023	海特高新	236,408.00	2,893,633.92	0.11
250	300558	贝达药业	69,654.00	2,890,641.00	0.11

251	000807	云铝股份	615,537.00	2,886,868.53	0.11
252	002773	康弘药业	86,283.00	2,840,436.36	0.11
253	300203	聚光科技	117,366.00	2,805,047.40	0.10
254	000415	渤海租赁	715,514.00	2,804,814.88	0.10
255	002589	瑞康医药	368,667.00	2,798,182.53	0.10
256	002938	鹏鼎控股	95,100.00	2,792,136.00	0.10
257	300339	润和软件	195,483.00	2,756,310.30	0.10
258	300418	昆仑万维	214,136.00	2,755,930.32	0.10
259	002399	海普瑞	131,068.00	2,751,117.32	0.10
260	300529	健帆生物	44,000.00	2,743,400.00	0.10
261	002583	海能达	325,889.00	2,734,208.71	0.10
262	000877	天山股份	233,460.00	2,712,805.20	0.10
263	002648	卫星石化	182,200.00	2,711,136.00	0.10
264	000683	远兴能源	1,034,800.00	2,700,828.00	0.10
265	000488	晨鸣纸业	499,158.00	2,675,486.88	0.10
266	002183	怡亚通	556,340.00	2,653,741.80	0.10
267	000027	深圳能源	427,232.00	2,648,838.40	0.10
268	000591	太阳能	807,554.00	2,648,777.12	0.10
269	000902	新洋丰	245,103.00	2,629,955.19	0.10
270	002449	国星光电	198,021.00	2,629,718.88	0.10
271	300113	顺网科技	167,658.00	2,628,877.44	0.10
272	300496	中科创达	90,286.00	2,625,516.88	0.10
273	300038	数知科技	280,200.00	2,622,672.00	0.10
274	002727	一心堂	91,800.00	2,615,382.00	0.10
275	000528	柳工	391,080.00	2,604,592.80	0.10
276	300133	华策影视	386,927.00	2,604,018.71	0.10
277	002610	爱康科技	1,386,213.00	2,592,218.31	0.10
278	300463	迈克生物	102,932.00	2,586,681.16	0.10
279	002557	洽洽食品	101,800.00	2,570,450.00	0.10
280	300567	精测电子	48,900.00	2,568,228.00	0.10
281	000008	神州高铁	679,569.00	2,561,975.13	0.10
282	000887	中鼎股份	266,740.00	2,558,036.60	0.10
283	002151	北斗星通	109,166.00	2,535,926.18	0.09
284	300010	立思辰	269,981.00	2,535,121.59	0.09
285	300630	普利制药	43,845.00	2,526,348.90	0.09
286	000031	大悦城	393,309.00	2,525,043.78	0.09
287	002468	申通快递	101,207.00	2,524,102.58	0.09
288	002407	多氟多	213,158.00	2,523,790.72	0.09
289	000930	中粮生化	334,093.00	2,512,379.36	0.09
290	002701	奥瑞金	537,158.00	2,508,527.86	0.09
291	000560	我爱我家	524,700.00	2,508,066.00	0.09
292	300451	创业慧康	167,499.00	2,504,110.05	0.09
293	002640	跨境通	300,563.00	2,503,689.79	0.09
294	300244	迪安诊断	147,075.00	2,497,333.50	0.09

295	002080	中材科技	274,376.00	2,485,846.56	0.09
296	002670	国盛金控	196,853.00	2,480,347.80	0.09
297	000650	仁和药业	343,800.00	2,478,798.00	0.09
298	000156	华数传媒	224,881.00	2,475,939.81	0.09
299	000681	视觉中国	127,700.00	2,474,826.00	0.09
300	000040	东旭蓝天	371,928.00	2,469,601.92	0.09
301	300251	光线传媒	361,262.00	2,456,581.60	0.09
302	002812	恩捷股份	52,200.00	2,440,350.00	0.09
303	002408	齐翔腾达	313,355.00	2,428,501.25	0.09
304	002563	森马服饰	218,086.00	2,412,031.16	0.09
305	002042	华孚时尚	331,100.00	2,403,786.00	0.09
306	002402	和而泰	253,500.00	2,400,645.00	0.09
307	300595	欧普康视	66,700.00	2,374,520.00	0.09
308	000739	普洛药业	241,300.00	2,371,979.00	0.09
309	000021	深科技	291,142.00	2,366,984.46	0.09
310	002176	江特电机	481,664.00	2,345,703.68	0.09
311	002025	航天电器	96,162.00	2,344,429.56	0.09
312	000793	华闻传媒	697,700.00	2,344,272.00	0.09
313	300026	红日药业	672,791.00	2,321,128.95	0.09
314	002665	首航节能	684,591.00	2,320,763.49	0.09
315	002491	通鼎互联	282,977.00	2,289,283.93	0.09
316	002414	高德红外	118,700.00	2,279,040.00	0.08
317	002056	横店东磁	299,163.00	2,273,638.80	0.08
318	002597	金禾实业	124,438.00	2,269,749.12	0.08
319	002030	达安基因	210,375.00	2,257,323.75	0.08
320	002497	雅化集团	320,600.00	2,240,994.00	0.08
321	300053	欧比特	224,406.00	2,239,571.88	0.08
322	300115	长盈精密	212,699.00	2,231,212.51	0.08
323	002603	以岭药业	191,775.00	2,220,754.50	0.08
324	300002	神州泰岳	557,274.00	2,217,950.52	0.08
325	002302	西部建设	198,800.00	2,214,632.00	0.08
326	300457	赢合科技	88,600.00	2,208,798.00	0.08
327	300294	博雅生物	81,343.00	2,208,462.45	0.08
328	002426	胜利精密	862,440.00	2,207,846.40	0.08
329	000400	许继电气	243,442.00	2,205,584.52	0.08
330	300118	东方日升	215,755.00	2,196,385.90	0.08
331	000059	华锦股份	343,001.00	2,195,206.40	0.08
332	002262	恩华药业	200,948.00	2,168,228.92	0.08
333	002608	江苏国信	250,306.00	2,135,110.18	0.08
334	002244	滨江集团	513,754.00	2,132,079.10	0.08
335	002939	长城证券	127,700.00	2,131,313.00	0.08
336	002051	中工国际	185,540.00	2,128,143.80	0.08
337	002841	视源股份	27,402.00	2,123,929.02	0.08
338	000028	国药一致	50,538.00	2,114,004.54	0.08

339	300078	思创医惠	205,728.00	2,100,482.88	0.08
340	000727	华东科技	1,004,344.00	2,099,078.96	0.08
341	300433	蓝思科技	300,441.00	2,094,073.77	0.08
342	002419	天虹股份	160,100.00	2,090,906.00	0.08
343	002444	巨星科技	209,126.00	2,087,077.48	0.08
344	000012	南玻A	501,145.00	2,084,763.20	0.08
345	002249	大洋电机	479,941.00	2,082,943.94	0.08
346	002488	金固股份	249,800.00	2,080,834.00	0.08
347	300618	寒锐钴业	34,680.00	2,080,800.00	0.08
348	000717	韶钢松山	467,200.00	2,069,696.00	0.08
349	000818	航锦科技	194,100.00	2,067,165.00	0.08
350	300367	东方网力	209,301.00	2,065,800.87	0.08
351	002376	新北洋	172,700.00	2,063,765.00	0.08
352	300197	铁汉生态	573,040.00	2,057,213.60	0.08
353	300482	万孚生物	54,400.00	2,050,880.00	0.08
354	300324	旋极信息	353,952.00	2,049,382.08	0.08
355	002128	露天煤业	235,574.00	2,037,715.10	0.08
356	000685	中山公用	238,501.00	2,036,798.54	0.08
357	002831	裕同科技	106,220.00	2,036,237.40	0.08
358	000926	福星股份	293,183.00	2,028,826.36	0.08
359	300068	南都电源	179,104.00	2,023,875.20	0.08
360	000301	东方盛虹	368,200.00	2,021,418.00	0.08
361	000901	航天科技	162,429.00	2,020,616.76	0.08
362	000158	常山北明	372,284.00	2,017,779.28	0.08
363	002390	信邦制药	381,952.00	2,012,887.04	0.08
364	000078	海王生物	578,005.00	2,011,457.40	0.08
365	002168	惠程科技	226,812.00	2,007,286.20	0.07
366	300054	鼎龙股份	251,800.00	2,001,810.00	0.07
367	002839	张家港行	353,800.00	1,991,894.00	0.07
368	300616	尚品宅配	26,300.00	1,988,806.00	0.07
369	002618	丹邦科技	148,300.00	1,988,703.00	0.07
370	002048	宁波华翔	183,753.00	1,988,207.46	0.07
371	000848	承德露露	238,600.00	1,987,538.00	0.07
372	002643	万润股份	196,601.00	1,985,670.10	0.07
373	000921	海信家电	158,500.00	1,978,080.00	0.07
374	300145	中金环境	454,080.00	1,970,707.20	0.07
375	300377	赢时胜	173,742.00	1,966,759.44	0.07
376	000761	本钢板材	456,700.00	1,963,810.00	0.07
377	002573	清新环境	242,072.00	1,948,679.60	0.07
378	002716	金贵银业	249,593.00	1,946,825.40	0.07
379	002383	合众思壮	170,375.00	1,935,460.00	0.07
380	000006	深振业A	354,447.00	1,931,736.15	0.07
381	000035	中国天楹	320,817.00	1,924,902.00	0.07
382	002505	大康农业	975,483.00	1,921,701.51	0.07

383	300036	超图软件	129,528.00	1,914,423.84	0.07
384	002280	联络互动	520,878.00	1,906,413.48	0.07
385	001965	招商公路	228,200.00	1,900,906.00	0.07
386	000718	苏宁环球	548,095.00	1,896,408.70	0.07
387	300085	银之杰	133,248.00	1,890,789.12	0.07
388	002203	海亮股份	173,900.00	1,881,598.00	0.07
389	002925	盈趣科技	48,200.00	1,880,282.00	0.07
390	000933	神火股份	444,200.00	1,870,082.00	0.07
391	300355	蒙草生态	455,667.00	1,868,234.70	0.07
392	002421	达实智能	500,097.00	1,865,361.81	0.07
393	002596	海南瑞泽	230,500.00	1,862,440.00	0.07
394	002028	思源电气	186,785.00	1,860,378.60	0.07
395	002358	森源电气	183,267.00	1,860,160.05	0.07
396	000016	深康佳 A	441,200.00	1,853,040.00	0.07
397	002285	世联行	409,917.00	1,848,725.67	0.07
398	300747	锐科激光	13,200.00	1,848,132.00	0.07
399	002366	台海核电	196,252.00	1,836,918.72	0.07
400	000712	锦龙股份	142,986.00	1,835,940.24	0.07
401	002118	紫鑫药业	270,300.00	1,821,822.00	0.07
402	002389	航天彩虹	161,900.00	1,806,804.00	0.07
403	002242	九阳股份	86,055.00	1,790,804.55	0.07
404	300037	新宙邦	85,800.00	1,788,072.00	0.07
405	300159	新研股份	358,211.00	1,783,890.78	0.07
406	300199	翰宇药业	191,613.00	1,757,091.21	0.07
407	002807	江阴银行	375,280.00	1,756,310.40	0.07
408	300308	中际旭创	51,440.00	1,748,445.60	0.07
409	002614	奥佳华	106,650.00	1,740,528.00	0.06
410	300476	胜宏科技	153,138.00	1,730,459.40	0.06
411	000789	万年青	172,239.00	1,725,834.78	0.06
412	000034	神州数码	133,563.00	1,722,962.70	0.06
413	002672	东江环保	151,880.00	1,722,319.20	0.06
414	000555	神州信息	149,587.00	1,702,300.06	0.06
415	002912	中新赛克	18,100.00	1,699,047.00	0.06
416	002091	江苏国泰	297,300.00	1,697,583.00	0.06
417	002709	天赐材料	70,117.00	1,696,831.40	0.06
418	002429	兆驰股份	619,139.00	1,696,440.86	0.06
419	000600	建投能源	253,200.00	1,696,440.00	0.06
420	300055	万邦达	237,383.00	1,692,540.79	0.06
421	300633	开立医疗	59,143.00	1,689,124.08	0.06
422	002537	海联金汇	220,700.00	1,664,078.00	0.06
423	300348	长亮科技	114,650.00	1,662,425.00	0.06
424	002430	杭氧股份	137,300.00	1,655,838.00	0.06
425	002745	木林森	140,700.00	1,649,004.00	0.06
426	000990	诚志股份	98,908.00	1,623,080.28	0.06

427	002047	宝鹰股份	287,319.00	1,611,859.59	0.06
428	002424	贵州百灵	163,128.00	1,611,704.64	0.06
429	002156	通富微电	189,500.00	1,606,960.00	0.06
430	002544	杰赛科技	123,240.00	1,602,120.00	0.06
431	000937	冀中能源	412,816.00	1,593,469.76	0.06
432	002292	奥飞娱乐	245,259.00	1,572,110.19	0.06
433	000951	中国重汽	97,800.00	1,569,690.00	0.06
434	000935	四川双马	97,200.00	1,554,228.00	0.06
435	300458	全志科技	73,813.00	1,542,691.70	0.06
436	000553	安道麦 A	143,500.00	1,538,320.00	0.06
437	002635	安洁科技	113,037.00	1,524,869.13	0.06
438	000980	众泰汽车	359,831.00	1,514,888.51	0.06
439	000426	兴业矿业	280,480.00	1,506,177.60	0.06
440	000564	供销大集	574,600.00	1,499,706.00	0.06
441	300474	景嘉微	37,805.00	1,491,785.30	0.06
442	002867	周大生	42,700.00	1,459,913.00	0.05
443	002108	沧州明珠	371,003.00	1,446,911.70	0.05
444	002341	新纶科技	247,000.00	1,442,480.00	0.05
445	000539	粤电力 A	335,090.00	1,440,887.00	0.05
446	002737	葵花药业	93,600.00	1,440,504.00	0.05
447	002611	东方精工	373,100.00	1,436,435.00	0.05
448	000869	张裕 A	44,404.00	1,426,256.48	0.05
449	000088	盐田港	260,659.00	1,423,198.14	0.05
450	002517	恺英网络	445,555.00	1,421,320.45	0.05
451	300257	开山股份	127,498.00	1,412,677.84	0.05
452	002815	崇达技术	90,300.00	1,407,777.00	0.05
453	300459	金科文化	241,400.00	1,373,566.00	0.05
454	300222	科大智能	104,682.00	1,362,959.64	0.05
455	300666	江丰电子	35,800.00	1,357,536.00	0.05
456	000062	深圳华强	101,789.00	1,352,775.81	0.05
457	002258	利尔化学	103,600.00	1,351,980.00	0.05
458	002681	奋达科技	313,185.00	1,327,904.40	0.05
459	000676	智度股份	146,600.00	1,322,332.00	0.05
460	000910	大亚圣象	117,600.00	1,310,064.00	0.05
461	002437	誉衡药业	330,003.00	1,303,511.85	0.05
462	002936	郑州银行	246,800.00	1,253,744.00	0.05
463	000968	蓝焰控股	106,800.00	1,239,948.00	0.05
464	000766	通化金马	181,900.00	1,236,920.00	0.05
465	000989	九芝堂	135,900.00	1,209,510.00	0.05
466	002382	蓝帆医疗	86,800.00	1,199,576.00	0.04
467	002509	天广中茂	582,000.00	1,198,920.00	0.04
468	002434	万里扬	173,100.00	1,175,349.00	0.04
469	002251	步步高	145,400.00	1,158,838.00	0.04
470	000537	广宇发展	167,000.00	1,155,640.00	0.04

471	002668	奥马电器	221,353.00	1,146,608.54	0.04
472	300373	扬杰科技	75,900.00	1,137,741.00	0.04
473	000429	粤高速 A	150,400.00	1,135,520.00	0.04
474	002920	德赛西威	50,400.00	1,128,960.00	0.04
475	002503	搜于特	410,380.00	1,128,545.00	0.04
476	000525	红太阳	85,400.00	1,102,514.00	0.04
477	002061	浙江交科	181,700.00	1,086,566.00	0.04
478	300409	道氏技术	85,700.00	1,082,391.00	0.04
479	300748	金力永磁	17,100.00	1,027,368.00	0.04
480	300323	华灿光电	164,460.00	1,016,362.80	0.04
481	000959	首钢股份	287,050.00	1,010,416.00	0.04
482	002625	光启技术	106,136.00	986,003.44	0.04
483	002320	海峡股份	109,876.00	982,291.44	0.04
484	000582	北部湾港	108,300.00	974,700.00	0.04
485	002653	海思科	66,000.00	937,200.00	0.03
486	000987	越秀金控	102,640.00	925,812.80	0.03
487	000710	贝瑞基因	25,600.00	912,896.00	0.03
488	300504	天邑股份	33,200.00	894,740.00	0.03
489	300634	彩讯股份	40,800.00	884,136.00	0.03
490	300724	捷佳伟创	32,900.00	875,798.00	0.03
491	000950	重药控股	158,000.00	862,680.00	0.03
492	300741	华宝股份	25,400.00	805,180.00	0.03
493	002818	富森美	62,100.00	796,743.00	0.03
494	002461	珠江啤酒	120,100.00	762,635.00	0.03
495	002512	达华智能	156,917.00	709,264.84	0.03
496	002016	世荣兆业	86,300.00	707,660.00	0.03
497	001872	招商港口	38,700.00	631,197.00	0.02
498	000617	中油资本	47,301.00	584,640.36	0.02
499	002901	大博医疗	16,500.00	542,520.00	0.02
500	002907	华森制药	21,100.00	375,580.00	0.01
501	002911	佛燃股份	23,100.00	347,193.00	0.01
502	300782	卓胜微	743.00	80,927.56	0.00
503	300594	朗进科技	721.00	31,803.31	0.00
504	300788	中信出版	1,556.00	23,106.60	0.00

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	300750	宁德时代	14,329,395.60	0.68
2	000333	美的集团	9,834,384.86	0.46

3	002027	分众传媒	7,466,037.00	0.35
4	000651	格力电器	6,053,998.65	0.29
5	000629	攀钢钒钛	5,222,213.00	0.25
6	000002	万科A	4,806,547.24	0.23
7	002387	维信诺	4,412,069.39	0.21
8	000858	五粮液	4,376,965.00	0.21
9	300454	深信服	4,201,780.00	0.20
10	001979	招商蛇口	3,746,854.00	0.18
11	300059	东方财富	3,593,108.00	0.17
12	002926	华西证券	3,154,282.00	0.15
13	300498	温氏股份	3,107,651.00	0.15
14	000938	紫光股份	2,921,307.06	0.14
15	000166	申万宏源	2,853,732.00	0.13
16	000560	我爱我家	2,828,379.00	0.13
17	002120	韵达股份	2,800,178.68	0.13
18	002007	华兰生物	2,523,297.50	0.12
19	300595	欧普康视	2,521,756.80	0.12
20	002415	海康威视	2,476,735.00	0.12

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	000651	格力电器	10,174,095.00	0.48
2	000858	五粮液	7,132,081.42	0.34
3	000333	美的集团	6,795,638.24	0.32
4	002450	*ST 康得	6,666,720.00	0.32
5	000001	平安银行	4,142,878.00	0.20
6	002221	东华能源	4,025,115.96	0.19
7	300498	温氏股份	3,728,741.00	0.18
8	002415	海康威视	3,635,927.50	0.17
9	000725	京东方 A	3,599,666.00	0.17
10	000002	万科 A	3,244,413.00	0.15
11	000069	华侨城 A	3,091,398.65	0.15
12	002007	华兰生物	2,975,299.00	0.14
13	002250	联化科技	2,935,700.90	0.14
14	002405	四维图新	2,708,127.18	0.13
15	002470	金正大	2,410,365.47	0.11
16	000338	潍柴动力	2,408,449.50	0.11
17	002304	洋河股份	2,335,853.00	0.11
18	000799	酒鬼酒	2,233,363.00	0.11
19	002142	宁波银行	2,203,034.00	0.10
20	000568	泸州老窖	1,934,039.00	0.09

7.4.3 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	263,438,606.79
卖出股票的收入（成交）总额	263,076,659.26

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

根据本基金基金合同，本基金不得参与股指期货交易。

7.10.2 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。

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

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

7.11.2 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，本基金不能投资于国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

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平安银行（000001.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。

中国银行保险监督管理委员会天津监管局在 2018 年 7 月 10 日发布了一份“天津银监局行政处罚信息公开表”。经查明，平安银行贷前调查不到位，向环保未达标的企业提供融资；贷后管理失职，流动资金贷款被挪用而受到天津监管局的行政处罚，合计处罚款 50 万元。

上述证券为本基金业绩基准的成份股，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	85,591.53
2	应收证券清算款	2,039,504.98
3	应收股利	-
4	应收利息	38,291.50
5	应收申购款	58,625.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,222,013.36

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股票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

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	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
申万深成	11,254	18,720.12	39,296,527.50	18.65%	171,379,704.67	81.35%
深成指 A	3,106	822,272.85	2,117,500,947.00	82.91%	436,478,513.00	17.09%
深成指 B	24,756	103,166.08	27,338,448.00	1.07%	2,526,641,012.00	98.93%
合计	36,425	146,016.06	2,184,135,922.50	41.07%	3,134,499,229.67	58.93%

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。

8.2 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	中意人寿保险有限公司	267,582,893.00	10.48%
2	中意人寿保险有限公司—分红—团体年金	133,825,661.00	5.24%
3	中国人寿资产管理有限公司	129,036,559.00	5.05%
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	105,264,256.00	4.12%
5	中国人寿再保险有限责任公司	85,692,339.00	3.36%
6	广发基金—招商银行—招商财富资产管理有限公司	81,205,140.00	3.18%
7	广发基金—光大银行—光大保德信资产管理有限公司	79,877,609.00	3.13%
8	中意资产管理有限责任公司—自有资金	78,002,222.00	3.05%
9	广发基金—工商银行—东兴证券股份有限公司	53,948,281.00	2.11%
10	中国财产再保险有限责任公司	50,931,213.00	1.99%

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	李圣林	33,163,713.00	1.30%
2	赵刚	31,251,574.00	1.22%
3	唐志军	29,100,000.00	1.14%
4	姜晓明	24,010,000.00	0.94%
5	卢文星	21,897,600.00	0.86%

6	张学强	19,388,038.00	0.76%
7	丁锐	19,372,175.00	0.76%
8	祁林荣	18,700,000.00	0.73%
9	王玉	18,660,443.00	0.73%
10	栾天	18,482,339.00	0.72%

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

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）。

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	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

9 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	225,828,744.22	2,513,238,819.00	2,513,238,819.00
本报告期基金总申购份额	370,260,683.81	-	-
减：本报告期基金总赎回份额	303,931,913.86	-	-
本报告期基金拆分变动份额	-81,481,282.00	40,740,641.00	40,740,641.00
本报告期期末基金份额总额	210,676,232.17	2,553,979,460.00	2,553,979,460.00

注：报告期期间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。

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、本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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	
海通证券	1	207,380,902.57	39.95%	188,987.56	39.95%	-
中信建投证券	1	176,976,618.62	34.09%	161,279.74	34.09%	-
申万宏源证券	2	65,376,676.46	12.59%	59,578.13	12.59%	-
广发证券	1	47,467,184.53	9.14%	43,257.03	9.14%	-
国泰君安证券	1	8,465,145.86	1.63%	7,714.39	1.63%	-
中信证券	1	7,096,934.88	1.37%	6,467.41	1.37%	-
光大证券	1	3,342,644.52	0.64%	3,046.14	0.64%	-
财通证券	1	3,046,026.36	0.59%	2,775.85	0.59%	新增
五矿证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-

银河证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	新增
国金证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
华信证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
东方财富证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	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。

10.8 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 2018 年 12 月 31 日基金净值公告	《证券时报》	2019-01-02
2	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 2019 年度约定年基准收益率变更的公告	《证券时报》	2019-01-03
3	关于申万菱信深证成指分级证券投资基金不进行定期份额折算的公告	《证券时报》	2019-01-03
4	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	《证券时报》	2019-01-04

5	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	《证券时报》	2019-01-12
6	关于调整旗下部分基金申购金额、赎回份额及转换份额最低下限的公告	《证券时报》	2019-01-18
7	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	《证券时报》	2019-01-19
8	申万菱信深证成指分级证券投资基金 2018 年第 4 季度报告	《证券时报》	2019-01-22
9	关于旗下部分基金新增玄元保险代理有限公司为代销机构并开通定期定额投资、转换业务并参加玄元保险代理有限公司开展的费率优惠活动的公告	《证券时报》	2019-01-25
10	关于旗下部分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	《证券时报》	2019-01-25
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、申万进取份额发生极端情况的风险提示公告	《证券时报》	2019-01-31
12	关于取消旗下部分基金场内申购费率优惠的公告	《证券时报》	2019-02-18
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、申万进取份额发生极端情况的风险提示公告	《证券时报》	2019-02-18
14	关于旗下部分基金暂停跨系统转托管（场外转场内）业务的公告	《证券时报》	2019-02-22
15	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	《证券时报》	2019-02-27
16	申万菱信深证成指分级证券投资基金恢复直销机构大额申购、定期定额投资及转换转入业务的公告	《证券时报》	2019-03-04
17	申万菱信深证成指分级证券投资基金调整代销机构场外大额申购、定期定额投资及转换转入业务的公告	《证券时报》	2019-03-07
18	关于网上直销系统开展申万菱信收益宝货币市场基金赎回转购费率优惠活动的公告	《证券时报》	2019-03-21
19	申万菱信深证成指分级证券投资基金 2018 年年度报告（摘要）	《证券时报》	2019-03-27
20	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交易价格波动风险提示公告	《证券时报》	2019-03-27
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、申万进取份额发生极端情况的风险提示公告	《证券时报》	2019-03-27
22	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	《证券时报》	2019-03-30
23	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	《证券时报》	2019-04-17
24	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交易价格波动风险提示公告	《证券时报》	2019-04-17
25	关于旗下基金参加北京植信基金销售有限公司开展的申购费率优惠活动的公告	《证券时报》	2019-04-17
26	申万菱信深证成指分级证券投资基金 2019 年第 1 季度	《证券时报》	2019-04-19

	报告		
27	关于调整旗下部分开放式基金在上海天天基金销售有限公司的定期定额投资申购金额下限的公告	《证券时报》	2019-05-10
28	关于旗下部分基金参加中国民生银行股份有限公司开展的申购费率优惠活动的公告（中登）	《证券时报》	2019-05-17
29	关于旗下基金参加北京恒天明泽基金销售有限公司开展的申购费率优惠活动的公告	《证券时报》	2019-05-17
30	申万菱信深证成指分级证券投资基金招募说明书第十七次更新（摘要）	《证券时报》	2019-06-05
31	关于旗下部分基金新增西藏东方财富证券股份有限公司为代销机构及开通转换业务并参加西藏东方财富证券股份有限公司开展的费率优惠活动的公告	《证券时报》	2019-06-12
32	关于开通中国银行网上直销交易并开展申购费率优惠的公告	《证券时报》	2019-06-14
33	申万菱信基金管理有限公司关于旗下基金参与科创板证券投资及相关风险提示的公告	《证券时报》	2019-06-20
34	申万菱信深证成指分级证券投资基金暂停场内申购业务的公告	《证券时报》	2019-06-22
35	关于调整旗下部分开放式基金在诺亚正行基金销售有限公司定期定额投资申购金额下限的公告	《证券时报》	2019-06-27

11 影响投资者决策的其他重要信息

因本基金收益份额 2018 年 12 月 31 日净值未达到 1.0000 元，未满足办理基金份额定期折算条件，因此 2019 年度第一个工作日未办理本基金的定期份额折算业务。详见本基金管理人 2019 年 1 月 3 日发布的相关公告。

根据本基金《基金合同》及相关业务规定，本基金申万进取份额的基金份额净值按照正常情况下的原则计算跌破 0.1000 元的当日为极端情况发生日，本基金将在极端情况发生日及之后采用极端情况下的基金份额净值计算原则对申万收益份额与申万进取份额的基金份额净值进行计算。本报告期内，本基金仍然处于极端情况，基金份额采用同涨同跌、各负盈亏原则计算净值。详见本基金管理人发布的相关公告。

本报告期内，为保证基金平稳运行，本基金管理人暂停了本基金之基础份额场外转场内的跨系统转托管业务，并对不同销售机构、场内场外采取不同的暂停大额申购、定期定额投资及转换转入业务；为保护基金份额持有人的利益，本基金管理人自 2019 年 6 月 27 日起暂停场内申购业务的办理。详见本基金管理人 2019 年 2 月 22 日、2 月 27 日、3 月 4 日、3 月 7 日和 6 月 22 日发布的相关公告。

12 备查文件目录

12.1 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。

12.2 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。

12.3 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

二〇一九年八月二十四日