

申万菱信上证 G60 战略新兴产业成份交易型开放式指数证
券投资基金
2024 年第 2 季度报告
2024 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：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年七月十九日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 7 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 申万菱信上证 G60 战略新兴产业成份 ETF |
| 基金主代码 | 510770 |
| 交易代码 | 510770 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2021 年 9 月 16 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 45,610,677.00 份 |
| 投资目标 | 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。 |
| 投资策略 | 本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足）导致无法 |

| | |
|--------|---|
| | 有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以使用其他合理方法进行适当的替代。 |
| 业绩比较基准 | 上证 G60 战略新兴产业成份指数收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用完全复制策略，跟踪上证 G60 战略新兴产业成份指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。 |
| 基金管理人 | 申万菱信基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 兴业银行股份有限公司 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2024年4月1日-2024年6月30日) |
|-----------------|---------------------------|
| 1. 本期已实现收益 | -1,028,959.51 |
| 2. 本期利润 | -2,084,060.30 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0488 |
| 4. 期末基金资产净值 | 20,423,733.70 |
| 5. 期末基金份额净值 | 0.4478 |

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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，但不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：申购费、赎回费等），计入认购或交易基金各项费用后，实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

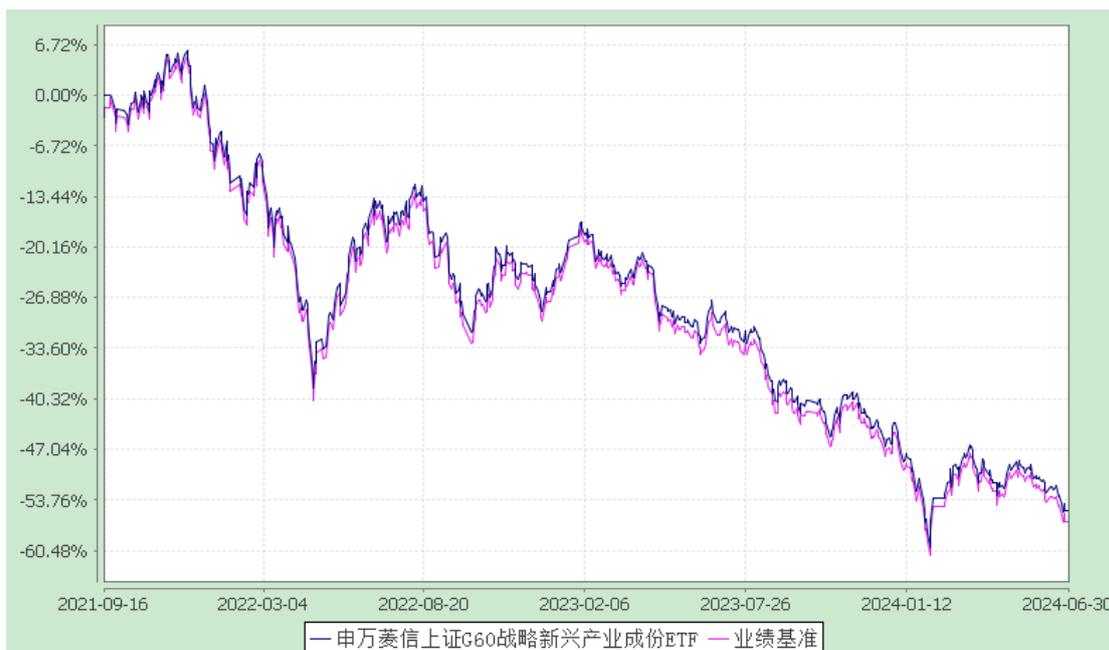
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 净值增长率① | 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 | -10.15% | 1.55% | -10.95% | 1.57% | 0.80% | -0.02% |
| 过去六个月 | -20.62% | 2.03% | -21.32% | 2.08% | 0.70% | -0.05% |
| 过去一年 | -36.55% | 1.68% | -37.05% | 1.72% | 0.50% | -0.04% |
| 自基金合同生效起至今 | -55.23% | 1.61% | -56.63% | 1.66% | 1.40% | -0.05% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

申万菱信上证 G60 战略新兴产业成份交易型开放式指数证券投资基金
 累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2021 年 9 月 16 日至 2024 年 6 月 30 日)



注：本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|---------|-------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 廖裕舟 | 本基金基金经理 | 2022-08-08 | - | 7年 | 廖裕舟先生，硕士研究生。2016年起从事金融相关工作，曾任职于融通基金管理有限公司、安信证券股份有限公司等，2022年3月加入申万菱信基金，现任申万菱信上证 G60 战略新兴产业成份交易型开放式指数证券投资基金、申万菱信中证申万医药生物指数证券投资基金、申万菱信中证沪港深数字经济主题指数型发起式证券投资基金、申万菱信中证申万电子行业 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|-----------------------|
| | | | | | 投资指数型证券投资基金（LOF）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关于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

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 公平交易专项说明

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。

在投资和研究方面，本公司投资和研究部门不断完善研究方法和投资决策流程，提高投资决策的科学性和客观性，确保各投资组合享有公平的投资决策机会，建立公平交易的制度环境。

在交易执行方面，本公司的投资管理职能和交易执行职能相隔离，通过实行集中交易制度和公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。

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。风险管理部通过对不同组合之间同向交易的价差率的假设检验、价格占优的次数百分比统计、价差交易模拟贡献与组合收益率差异的比较等方法对本报告期以及连续四个季度期间内、不同时间窗口下公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行了分析；对于场外交易，还特别对比了组合之间发生的同向交易的市场公允价格和交易对手，判断交易是否公平且是否涉及利益输送。

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，未发生我司旗下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% 的情况以及其他可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

当前中国经济正处于转型的关键时期，由高速增长转向高质量增长。随着地产市场的调整、地方政府债务的管控以及企业融资需求的稳定，经济结构正在发生深刻变化。这一转型期，经济增长的驱动力正逐步从传统投资和出口转向内需扩大和创新驱动。

政策面上，政府持续推出一系列措施以支持经济稳定增长。从“稳增长”政策的实施到“新国九条”的发布，再到对科技创新和产业升级的大力支持，政策环境为市场的稳定和长远发展提供了坚实的基础。特别是对科技型企业的扶持，为市场注入了新的活力。

自 2022 年以来，A 股市场经历了多轮波动，从科技成长的引领到价值股的回归，市场风格轮动频繁。2023 年，市场在政策的持续发力下，展现出了较强

的韧性，尽管面临内外部诸多不确定性因素，如美联储的加息周期、地缘政治风险等，A 股市场整体保持了稳健的态势。

目前，A 股市场的估值水平相对合理。尽管部分板块如科技、新能源等因前期涨幅较大而出现估值回调，但从整体市场来看，估值仍处于历史均值附近，提供了较好的时机。

市场情绪方面，投资者对 A 股市场的信心逐步恢复。随着政策效果的逐步显现和经济数据的改善，市场情绪趋于乐观。然而，考虑到外部环境的不确定性，关注后续市场情绪表现。

流动性方面，预计 2024 年下半年市场资金面将保持适度宽松。虽然美联储的货币政策调整可能对全球流动性产生一定影响，但中国央行有望通过灵活的货币政策工具，保持市场流动性的稳定。

展望未来，中国经济预计将继续保持平稳增长。随着政策的持续发力和市场需求的逐步回暖，经济结构将进一步优化，增长质量和效益将得到提升。因此，预计 A 股市场仍具有较好的机会。在政策支持和市场需求回暖的双重驱动下，市场有望迎来新一轮的表现。

市场风格上，我认为成长风格或将再度受到青睐。随着经济转型的深入和科技创新的加速，科技成长板块有望迎来新一轮的发展机遇。同时，考虑到市场对高质量增长的追求，高 ROE、高 FCF 的企业或将受到市场的关注。

在高成长和高质量的板块下，可以从以下几个角度挖掘潜在投资方向：首先，随着新一轮科技革命和产业变革的推进，人工智能、大数据、云计算等领域或将迎来快速发展，相关板块值得重点关注；其次，中国制造业的转型升级将带来新的增长点，特别是在高端装备制造、新能源汽车等领域。除此以外，随着人口老龄化和健康意识的增强，医疗健康板块也可能会迎来持续的发展机会。

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基金日常申购赎回、组合再平衡及仓位调整等。

作为被动投资的基金产品，本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标的指数的跟踪偏离为投资目标，追求跟踪误差的最小化，力争基金净值和二级市场价格紧密贴合。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金报告期内净值表现为-10.15%，同期业绩基准表现为-10.95%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金在本报告期内出现超过连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。截至本报告期末，本基金资产净值未恢复至五千万元。本报告期内，本基金以通讯方式召开基金份额持有人大会但未达到基金合同约定的有效条件。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|---------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 20,039,552.34 | 97.33 |
| | 其中：股票 | 20,039,552.34 | 97.33 |
| 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 | 548,425.19 | 2.66 |
| 8 | 其他各项资产 | 1,432.61 | 0.01 |
| 9 | 合计 | 20,589,410.14 | 100.00 |

注：上述股票投资包括可退替代款估值增值。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 15,516,452.88 | 75.97 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 4,020,434.46 | 19.69 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 502,665.00 | 2.46 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 20,039,552.34 | 98.12 |

注：上述股票投资组合不包括可退替代款估值增值。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产 |
|----|------|------|-------|---------|-------|
|----|------|------|-------|---------|-------|

| | | | | | 净值比例(%) |
|----|--------|------|-----------|--------------|---------|
| 1 | 600487 | 亨通光电 | 82,013.00 | 1,293,345.01 | 6.33 |
| 2 | 603799 | 华友钴业 | 56,414.00 | 1,248,441.82 | 6.11 |
| 3 | 600418 | 江淮汽车 | 72,527.00 | 1,148,827.68 | 5.62 |
| 4 | 600570 | 恒生电子 | 62,960.00 | 1,111,873.60 | 5.44 |
| 5 | 600176 | 中国巨石 | 99,800.00 | 1,102,790.00 | 5.40 |
| 6 | 688777 | 中控技术 | 26,146.00 | 985,704.20 | 4.83 |
| 7 | 600460 | 士兰微 | 41,457.00 | 725,912.07 | 3.55 |
| 8 | 603338 | 浙江鼎力 | 10,600.00 | 640,452.00 | 3.14 |
| 9 | 603806 | 福斯特 | 43,342.00 | 637,127.40 | 3.12 |
| 10 | 601865 | 福莱特 | 30,600.00 | 615,060.00 | 3.01 |

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有受到监管部门立案调查；在报告编制日前一年内没有受到监管部门公开谴责或/及处罚。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|----------|
| 1 | 存出保证金 | 1,432.61 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,432.61 |

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告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的情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|--------------|---------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 44,110,677.00 |
|--------------|---------------|

| | |
|----------------|---------------|
| 报告期期间基金总申购份额 | 84,000,000.00 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 82,500,000.00 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 45,610,677.00 |

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，本基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|--|----------------|------------------------|---------------|------|------|---------------|--------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 1 | 20240401—20240630 | 12,985,900.00 | 0.00 | 0.00 | 12,985,900.00 | 28.47% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情况。在单一投资者持有基金份额比例较高的情况下，如投资者集中赎回，可能会给基金带来流动性冲击。基金管理人将专业审慎、勤勉尽责地管控基金的流动性风险，保护持有人利益。 | | | | | | | |

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金管理人以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，本基金未达到基金合同约定的召开基金持有人大会的有效条件。详见本基金管理人发布的相关公告。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

基金合同；

招募说明书及其更新；
产品资料概要及其更新；
发售公告；
成立公告；
定期报告；
其他临时公告。

9.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

9.3 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

二〇二四年七月十九日