

申万菱信沪深 300 价值指数证券投资基金

2022 年中期报告

2022 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：二〇二二年八月三十一日

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。本中期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 2022 年 8 月 29 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 2022 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	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.....	11
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.....	13
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	14
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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	15
6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	19
7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况.....	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	47
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.....	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	53
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.....	53
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.....	53
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.....	53
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.....	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	54
7.12 投资组合报告附注.....	54
8 基金份额持有人信息	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	56

8.3 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	56
9 开放式基金份额变动	56
10 重大事件揭示	57
10.1 基金份额持有人大会决议	57
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	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
10.4 基金投资策略的改变	57
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	57
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	57
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	57
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况	57
10.9 其他重大事件	60
11 影响投资者决策的其他重要信息	60
12 备查文件目录	61
12.1 备查文件目录.....	61
12.2 存放地点.....	61
12.3 查阅方式.....	61

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	申万菱信沪深 300 价值指数证券投资基金	
基金简称	申万菱信沪深 300 价值指数	
基金主代码	310398	
交易代码	310398	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2010 年 2 月 11 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	1,094,232,684.18 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	申万菱信沪深 300 价值指数	申万菱信沪深 300 价值指数 C
下属分级基金的交易代码	310398	007800
报告期末下属分级基金的份额总额	791,812,084.01 份	302,420,600.17 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%，实现对沪深 300 价值指数的有效跟踪。
投资策略	本基金主要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（如流动性不足）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，追求尽可能贴近目标指数的表现。
业绩比较基准	沪深 300 价值指数收益率 × 95% + 银行同业存款利率 × 5%
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，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。

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	陈晓升	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	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.swsmu.com
基金中期报告备置地点	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	申万菱信基金管理有限公司	上海市中山南路 100 号 10、11 层

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（2022年1月1日至2022年6月30日）	
	申万菱信沪深 300 价值指数	申万菱信沪深 300 价值指数 C
本期已实现收益	-38,646,909.60	-10,348,770.96
本期利润	-75,419,483.59	-13,952,873.22
加权平均基金份额本期利润	-0.0835	-0.0696
本期加权平均净值利润率	-6.53%	-7.12%
本期基金份额净值增长率	-4.99%	-5.12%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)	
	申万菱信沪深 300 价值指数	申万菱信沪深 300 价值指数 C
期末可供分配利润	217,106,091.10	-2,683,991.14
期末可供分配基金份额利润	0.2742	-0.0089
期末基金资产净值	1,008,918,175.11	299,736,609.03

期末基金份额净值	1.2742	0.9911
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
	申万菱信沪深 300 价值指数	申万菱信沪深 300 价值指数 C
基金份额累计净值增长率	82.81%	10.08%

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/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

申万菱信沪深 300 价值指数

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	4.19%	0.97%	3.18%	1.01%	1.01%	-0.04%
过去三个月	-0.45%	1.14%	-1.61%	1.16%	1.16%	-0.02%
过去六个月	-4.99%	1.29%	-6.15%	1.32%	1.16%	-0.03%
过去一年	-5.65%	1.15%	-10.11%	1.18%	4.46%	-0.03%
过去三年	8.42%	1.11%	-7.45%	1.13%	15.87%	-0.02%
自基金合同生效起至今	82.81%	1.33%	38.59%	1.34%	44.22%	-0.01%

申万菱信沪深 300 价值指数 C

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	4.16%	0.97%	3.18%	1.01%	0.98%	-0.04%
过去三个月	-0.53%	1.14%	-1.61%	1.16%	1.08%	-0.02%
过去六个月	-5.12%	1.29%	-6.15%	1.32%	1.03%	-0.03%
过去一年	-5.92%	1.15%	-10.11%	1.18%	4.19%	-0.03%
自基金合同生效起至今	10.08%	1.12%	-1.90%	1.14%	11.98%	-0.02%

注：本基金的业绩基准指数=95%×沪深 300 价值指数收益率+5%×银行同业存款利率。其中：沪深 300 价值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：

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

$\% \text{benchmark}(t) = 95\% * (\text{沪深 300 价值指数}(t) / \text{沪深 300 价值指数}(t-1) - 1) + 5\% * \text{银行同业存款利率} / 365;$

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

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

申万菱信沪深 300 价值指数证券投资基金

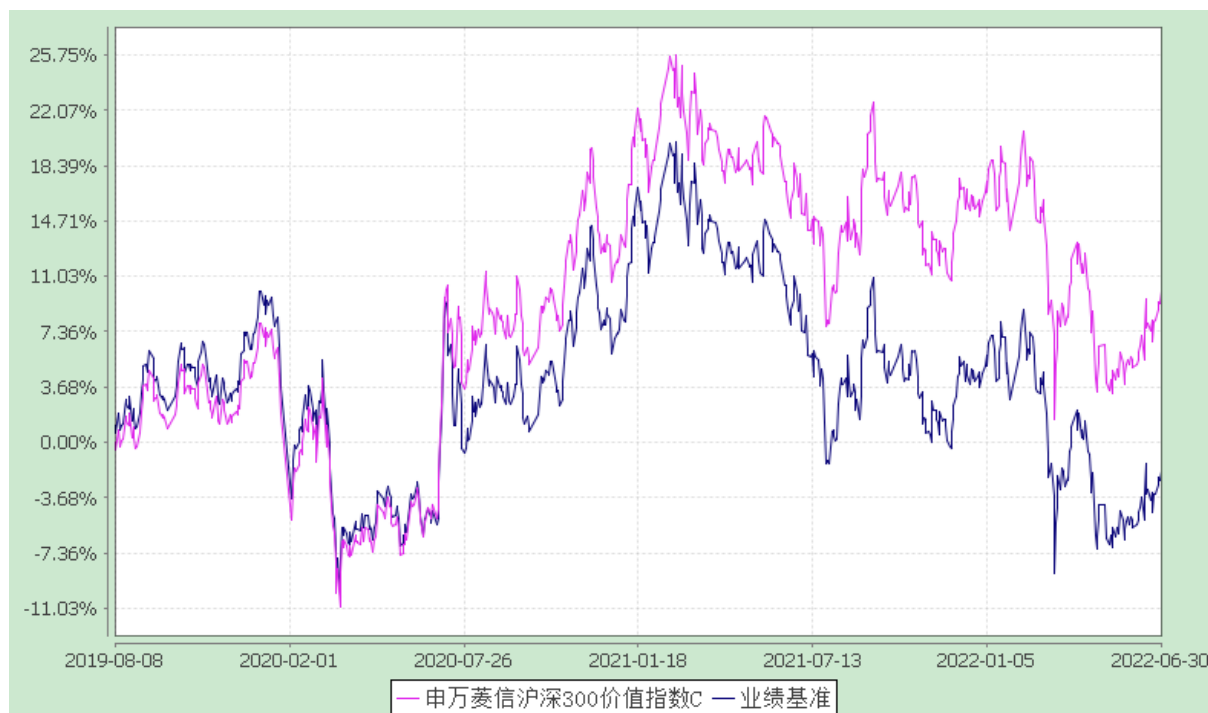
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2010 年 2 月 11 日至 2022 年 6 月 30 日)

申万菱信沪深 300 价值指数



申万菱信沪深 300 价值指数 C



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(SWS MU Fund Management Co.,Ltd)成立于 2004 年 1 月 15 日,公司总部设在上海,注册资本 1.5 亿元,净资产超过 11 亿元。

申万菱信基金自成立以来,始终将持有人的利益放在首位,秉持“研究至善”的愿景、“长期致胜”的使命,遵循“诚于心、行于矩、敏于变”的企业价值观。近年来,申万菱信基金围绕市场和客户需求,逐渐形成“投资美好生活、创新理财服务”的产品规划;通过努力打造“美好生活”系列权益产品,不断丰富“全市场、宽基指数与增强、主题指数、量化对冲、固收+、另类投资和纯固收”等产品大类,致力于为持有人提供“温暖陪伴”的服务,以努力达成“长期致胜”的使命。公司现有公募基金 68 只,资产管理规模超过 1010 亿元,公募产品累计分红 185.64 亿元。(数据截至 2022 年 6 月 30 日)

近年来,申万菱信基金通过建设关键假设平台(Key Assumption Platform),推动“研究数字化”;通过基金经理的风格开发、稳定和优化,推动“投资风格化”;通过风险管理工作的关口前移,加强市场风险管理支持,推动“风控全流程”,从而不断建设申万菱信基金的“机构理性”,以提升投资业绩。此外,申万菱信基金还持续打造卓越战略与产品管理体系(Excellent Strategy & Product)、卓

越品牌与客户服务体系（Excellent Branding & Service），提升面向不同类别客户的全方位专业服务水平。

申万菱信基金股东实力雄厚，中央汇金公司控股的申万宏源证券持有公司 67% 的股份，日本三菱 UFJ 信托银行持有公司 33% 的股份。申万菱信基金拥有公开募集证券投资基金管理人、特定客户资产管理人、合格境内机构投资者(QDII)管理人、保险资金投资管理人、基金投资顾问、合格境内有限合伙人 (QDLP) 等业务资格，并全资设立申万菱信（上海）资产管理有限公司，专门从事特定客户资产管理业务和专项资产管理业务。公司曾多次荣获中国基金业金牛奖、中国明星基金奖、中国金基金奖等多项业内重量级奖项以及东方财富“最佳指数投资团队”等荣誉。

展望未来，申万菱信基金将紧紧依托双方股东优势，不断深化体制机制改革，以更加市场化的导向推动专业队伍的全方位发展，努力将公司打造成为一家优秀乃至卓越的资产管理机构！

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		
赵兵	指数投资部负责人、本基金基金经理	2022-03-15	-	15 年	赵兵先生，硕士研究生。2007 年起从事金融相关工作，曾任职于华泰柏瑞基金，2012 年 10 月加入申万菱信基金，曾任产品与金融工程部总监、创新投资部负责人等，现任指数投资部负责人，申万菱信沪深 300 价值指数证券投资基金、申万菱信中证军工指数型证券投资基金、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。
龚丽丽	本基金原基金经理	2019-11-27	2022-03-16	-	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 8 月至 2022 年 3 月任职于申万菱信基金，曾任指数投资部负责人，申万菱信中证申万新兴健康产业主题投资指数证券投资基金(LOF)、申万菱信深证成指分级证券投资基金、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、申万菱信中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金、申万菱信中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、申万菱信中证申万医药生物指数型证券投资基金、申万菱信沪深 300 价值指数证券投资基金、申万菱信中证军工指数型证券投资基金、申万菱信中证申万电子行业投资指数型证券投资基金 (LOF)、申万菱信中证内地新能源主题交易型开放式指数证券投资基金、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。

3、本报告期内，公司聘任赵兵担任本基金基金经理，龚丽丽不再担任本基金基金经理，具体见本基金管理人的相关公告。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

2022 年上半年 A 股市场波动较大，指数整体出现下行，上证综指和深证成指分别下跌 6.63%、13.20%，创业板指数和科创 50 指数分别下跌了 15.41% 和 20.92%。

行业层面，根据申万一级行业分类，煤炭、交通运输和房地产成为表现较好的三个行业，传媒、计算机和电子则成为表现较差的三个行业。

在操作上，本基金采用了全复制的方式进行投资管理。基金运作主要着眼于控制每日跟踪误差和跟踪偏离度。从实际运作结果观察，基金跟踪误差的主要来源于基金日常申赎和指数成分股定期调整。

作为被动投资型基金产品，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。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金 A 类产品报告期内净值表现为-4.99%，同期业绩基准表现为-6.15%。

本基金 C 类产品报告期内净值表现为-5.12%，同期业绩基准表现为-6.15%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，在上半年经济稳增长政策不断推出的背景下，疫情、俄乌冲突等事件对中国经济负面影响的边际效应会不断减弱，随着稳增长政策的持续落地，中国经济在下半年有望迎来边际改善。市场流动性和企业盈利能力将会是决定投资价值的重要因素。

流动性方面，海外成熟市场受通胀高企等因素影响，已经进入货币政策紧缩周期。中国目前的货币政策依然相对有底线的宽松，为实体经济的复苏创造了良好的货币条件，但是随着经济运行逐渐步入正轨，CPI 上升的预期不断增强，要关注流动性边际收缩对 A 股市场的影响。

盈利方面，复工复产后，部分行业的景气周期重新被市场认知。新能源、汽车、军工等行业的景气度在下半年或仍将延续。同时，稳增长政策将持续落地，房地产、金融、消费等行业盈利能力的翻转或将带来机会。

中国 A 股市场成长价值风格轮动比较显著，沪深 300 价值指数代表了具有大盘价值风格的中国核心资产，在价值风格走强的周期内具有显著的性价比。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值政策及净值计算的复核责任。会计师事务所所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。本基金管理人估值委员会成员包括督察长、分管基金投资的副总经理、分管基金运营的副总经理、基金运营部门负责人、法律合规与审计部门负责人、风险管理部门负责人。以上成员均具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规、基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与最终决策和日常估值的执行。参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

报告期内，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据和流通受限股票的折扣率数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所债券市场的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金的管理人——申万菱信基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、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。

5.3 托管人对本中期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本基金 2022 年中期报告中财务指标、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：申万菱信沪深 300 价值指数证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	87,981,306.95	68,872,903.69
结算备付金		13,455.99	1,919,780.71
存出保证金		242,984.33	83,986.80
交易性金融资产	6.4.7.2	1,223,335,398.46	974,177,126.73
其中：股票投资		1,223,335,398.46	974,177,126.73
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	71,066.45
应收股利		-	-
应收申购款		923,290.88	525,195.41
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	9,517.33
资产总计		1,312,496,436.61	1,045,659,577.12

负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		12.65	-
应付赎回款		1,585,104.27	1,314,212.61
应付管理人报酬		674,055.11	584,595.74
应付托管费		155,551.18	134,906.70
应付销售服务费		57,709.88	11,188.28
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	1,369,219.38	787,716.51
负债合计		3,841,652.47	2,832,619.84
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	1,094,232,684.18	787,095,848.83
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	214,422,099.96	255,731,108.45
净资产合计		1,308,654,784.14	1,042,826,957.28
负债和净资产总计		1,312,496,436.61	1,045,659,577.12

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.2742 元，C 类基金份额净值 0.9911 元；基金份额总额 1,094,232,684.18 份，其中 A 类基金份额 791,812,084.01 份，C 类基金份额 302,420,600.17 份。

6.2 利润表

会计主体：申万菱信沪深 300 价值指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-83,477,121.14	39,674,426.33
1.利息收入		180,555.90	105,883.91
其中：存款利息收入	6.4.7.9	180,555.90	105,883.91
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-

证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-43,703,390.36	80,846,924.76
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-61,860,077.39	73,496,195.44
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益	6.4.7.13	18,156,687.03	7,350,729.32
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	-40,376,676.25	-41,759,363.25
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	422,389.57	480,980.91
减：二、营业总支出		5,895,235.67	4,620,885.19
1. 管理人报酬		4,360,174.20	2,593,068.95
2. 托管费		1,006,194.06	598,400.48
3. 销售服务费		288,536.93	26,991.63
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.16	240,330.48	1,402,424.13
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-89,372,356.81	35,053,541.14
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-89,372,356.81	35,053,541.14
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-89,372,356.81	35,053,541.14

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：申万菱信沪深 300 价值指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净	787,095,848.83	-	255,731,108.45	1,042,826,957.28

值)				
二、本期期初净资产 (基金净值)	787,095,848.83	-	255,731,108.45	1,042,826,957.28
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	307,136,835.35	-	-41,309,008.49	265,827,826.86
(一)、综合收益总额	-	-	-89,372,356.81	-89,372,356.81
(二)、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)	307,136,835.35	-	48,063,348.32	355,200,183.67
其中: 1.基金申购款	986,502,348.01	-	104,127,689.93	1,090,630,037.94
2.基金赎回款	-679,365,512.66	-	-56,064,341.61	-735,429,854.27
(三)、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)	-	-	-	-
四、本期期末净资产 (基金净值)	1,094,232,684.18	-	214,422,099.96	1,308,654,784.14
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益 (若有)	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 (基金净值)	659,846,333.25	-	298,841,805.42	958,688,138.67
二、本期期初净资产 (基金净值)	659,846,333.25	-	298,841,805.42	958,688,138.67
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-185,636,674.21	-	-68,205,150.67	-253,841,824.88
(一)、综合收益总额	-	-	35,053,541.14	35,053,541.14
(二)、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)	-185,636,674.21	-	-103,258,691.81	-288,895,366.02

号填列)				
其中：1.基金申购款	129,872,628.23	-	58,530,431.29	188,403,059.52
2.基金赎回款	-315,509,302.44	-	-161,789,123.10	-477,298,425.54
(三)、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)	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	474,209,659.04	-	230,636,654.75	704,846,313.79

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：汪涛，主管会计工作负责人：王伟，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

申万菱信沪深 300 价值指数证券投资基金（原名为申万巴黎沪深 300 价值指数证券投资基金，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”）2009 年 11 月 18 日证监许可[2009]1191 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》、《申万巴黎沪深 300 价值指数证券投资基金基金合同》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 925,091,640.13 元。经向中国证监会备案，《申万巴黎沪深 300 价值指数证券投资基金基金合同》于 2010 年 2 月 11 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 925,168,028.22 份基金份额，其中认购资金利息折合 76,388.09 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申请中国证监会备案，将申万巴黎沪深 300 价值指数证券投资基金更名为申万菱信沪深 300 价值指数证券投资基金，并于 2011 年 4 月 6 日公告。

根据《关于申万菱信沪深 300 价值指数证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同的公告》，本基金自 2019 年 8 月 8 日起增加收取销售服务费的 C 类份额，并对本基金的基金合同作相应修改。在本基金增加收取销售服务费的 C 类份额后，原有的基金份额将全部自动转换为本基金 A 类份额。对投资者收取申购费用、赎回时收取赎回费用的，且不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；对投资者不收取申购费用、赎回时收取赎回费用的，且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类两种收费模式并存，由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《申万菱信沪深 300 价值指数证券投资基金基金合同》和最新公布的《申万菱信沪深 300 价值指数证券投资基金更新招募说明书》的有关规定，本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括沪深 300 价值指数成份股、备选成份股、新股（一级市场初次发行或增发）、存托凭证、现金或者到期日在一年以内的政府债券等。本基金的投资资产配置比例为：将不低于 90% 的基金资产净值投资于沪深 300 价值指数成份股和备选成份股，其中备选成份股投资比例不高于 15%，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。本基金以

沪深 300 价值指数为标的指数，业绩比较基准为： $95\% \times \text{沪深 300 价值指数增长率} + 5\% \times \text{银行同业存款利率}$ 。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 6 月 30 日的财务状况、2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

除下文 6.4.5.1 会计政策变更的说明中涉及的变更外，本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金自 2022 年度起执行了财政部发布的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量(修订)》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移(修订)》、《企业会计准则第 24 号——套期会计(修订)》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报(修订)》(统称“新金融工具准则”)和 2022 年中国证监会发布的修订的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》。

(a) 新金融工具准则

根据财政部发布的新金融工具准则相关衔接规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，本基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。

新金融工具准则修订了财政部于 2006 年颁布的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》和《企业会计准则第 24 号——套期保值》以及财政部于 2014 年修订的《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(统称“原金融工具准则”)。

新金融工具准则将金融资产划分为三个基本分类：(1) 以摊余成本计量的金融资产；(2) 以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产；及 (3) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。在新金融工具准则下，金融资产的分类是基于本基金管理金融资产的业务模式及该资产的合同现金流量特征而确定。新金融工具准则取消了原金融工具准则中规定的持有至到期投资、贷款和应收款项及可供出售金融资产三个分类类别。根据新金融工具准则，嵌入衍生工具不再从金融资产的主合同中分拆出来，而是将混合金融工具整体适用关于金融资产分类的相关规定。

新金融工具准则以“预期信用损失”模型替代了原金融工具准则中的“已发生损失”模型。“预期信用损失”模型要求持续评估金融资产的信用风险，因此在新金融工具准则下，本基金信用损失的确认时点早于原金融工具准则。

本基金按照新金融工具准则的衔接规定，对新金融工具准则施行日（即 2022 年 1 月 1 日）未终止确认的金融工具的分类和计量（含减值）进行追溯调整。本基金未调整比较财务报表数据，将金融工具的原账面价值和在新金融工具准则施行日的新账面价值之间的差额计入 2022 年年初留存收益。

执行新金融工具准则对本基金资产负债表的影响汇总如下：

(i) 金融工具的分类影响

以摊余成本计量的金融资产

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收证券清算款、应收利息、应收股利、应收申购款和其他资产，对应的账面价值分别为人民币 68872903.69 元、1919780.71 元、83986.8 元、0 元、71066.45 元、9517.33 元、0 元、525195.41 元、0 元。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收证券清算款、应收利息、应收股利、应收申购款和其他资产，对应的账面价值分别为人民币 68881429.15 元、1920731 元、84028.38 元、0 元、71066.45 元、0 元、0 元、525195.41 元、0 元。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为交易性金融资产，对应的账面价值为人民币 974177126.73 元。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为交易性金融资产，对应的账面价值为人民币 974177126.73 元。

以摊余成本计量的金融负债

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用、应交税费、应付利息和其他负债，对应的账面价值分别为人民币 0 元、0 元、1314212.61

元、584595.74 元、134906.7 元、11188.28 元、544613.33 元、0 元、0 元、243103.18 元。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用、应交税费、应付利息和其他负债，对应的账面价值分别为人民币 0 元、0 元、1314212.61 元、584595.74 元、134906.7 元、11188.28 元、0 元、0 元、0 元、787716.51 元。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产和卖出回购金融资产款等对应的应计利息余额均列示在应收利息或应付利息科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则，将上述应计利息分别转入银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产和卖出回购金融资产款等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(ii) 采用“预期信用损失”模型的影响

“预期信用损失”模型适用于本基金持有的以摊余成本计量的金融资产。采用“预期信用损失”模型未对本基金 2022 年年初留存收益产生重大影响。

(b) 修订的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》

本基金根据修订的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》编制财务报表时，调整了部分财务报表科目的列报和披露，未对财务报表列报和披露产生重大影响。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《财政部、国家税

务总局、证监会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《财政部、国家税务总局、证监会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》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》（财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号）、财税 [2005] 103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字 [2008] 16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《财政部、国家税务总局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 号文《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 号文《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》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b) 自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，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；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、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股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为

增值税纳税人，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 日以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，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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% 计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴 20% 的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，其股息红利所得暂减按 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。

(e) 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。

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g) 对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

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 2022 年 6 月 30 日
活期存款	87,981,306.95
等于：本金	87,970,104.88
加：应计利息	11,202.07
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	87,981,306.95

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,275,105,016.17	-	1,223,335,398.46	-51,769,617.71
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	1,275,105,016.17	-	1,223,335,398.46	-51,769,617.71

6.4.7.3 衍生金融资产/负债**6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额**

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 其他资产

无余额。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,856.22
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,002,767.24
其中：交易所市场	1,002,767.24
银行间市场	-
应付利息	-
其他应付款_指数使用费	134,159.23
信息披露费	179,507.37
其他应付款_其他	13,737.44
审计费用	37,191.88
合计	1,369,219.38

6.4.7.7 实收基金

申万菱信沪深 300 价值指数

金额单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	744,214,960.55	744,214,960.55
本期申购	367,123,814.80	367,123,814.80
本期赎回（以“-”号填列）	-319,526,691.34	-319,526,691.34
本期末	791,812,084.01	791,812,084.01

申万菱信沪深 300 价值指数 C

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	42,880,888.28	42,880,888.28
本期申购	619,378,533.21	619,378,533.21
本期赎回（以“-”号填列）	-359,838,821.32	-359,838,821.32
本期末	302,420,600.17	302,420,600.17

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

申万菱信沪深 300 价值指数

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	496,651,420.29	-242,832,326.55	253,819,093.74
本期利润	-38,646,909.60	-36,772,573.99	-75,419,483.59
本期基金份额交易产生的变动数	35,971,796.50	2,734,684.45	38,706,480.95
其中：基金申购款	243,547,530.56	-134,656,342.02	108,891,188.54
基金赎回款	-207,575,734.06	137,391,026.47	-70,184,707.59
本期已分配利润	-	-	-
本期末	493,976,307.19	-276,870,216.09	217,106,091.10

申万菱信沪深 300 价值指数 C

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	5,779,069.87	-3,867,055.16	1,912,014.71
本期利润	-10,348,770.96	-3,604,102.26	-13,952,873.22
本期基金份额交易产生的	34,674,839.07	-25,317,971.70	9,356,867.37

变动数			
其中：基金申购款	77,372,396.45	-82,135,895.06	-4,763,498.61
基金赎回款	-42,697,557.38	56,817,923.36	14,120,365.98
本期已分配利润	-	-	-
本期末	30,105,137.98	-32,789,129.12	-2,683,991.14

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	168,944.92
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	10,267.68
其他	1,343.30
合计	180,555.90

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	641,815,919.59
减：卖出股票成本总额	701,355,778.65
减：交易费用	2,320,218.33
买卖股票差价收入	-61,860,077.39

6.4.7.11 债券投资收益

无。

6.4.7.12 衍生工具收益

无。

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	18,156,687.03
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-

合计	18,156,687.03
----	---------------

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1.交易性金融资产	-40,376,676.25
——股票投资	-40,376,676.25
——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	-40,376,676.25

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	346,322.11
转换费收入	76,067.46
合计	422,389.57

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构成，其中赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	37,191.88
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	472.00
账户维护费	9,000.00
其他费用_指数使用费	134,159.23

合计	240,330.48
----	------------

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。若季度指数使用费下限(人民币 5 万元)大于按基金资产净值提取的季度指数使用费，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（以下简称“申万菱信”）	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
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。

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		上年度可比期间	
	2022年1月1日至2022年6月30日		2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期股	成交金额	占当期股

		票成交总 额的比例		票成交总 额的比例
申万宏源	300,458,475.95	18.65%	190,972,257.36	27.34%

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 2022年1月1日至2022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	279,183.58	18.66%	202,606.87	20.20%
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	177,503.07	27.41%	113,925.24	32.72%

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 2022年1月1日至2022年6月 30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,360,174.20	2,593,068.95
其中：支付销售机构的客户维护费	790,926.78	658,575.44

注：支付基金管理人申万菱信的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.65% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.65\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6
----	-------------------------	-----------------------------

	30日	月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,006,194.06	598,400.48

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 0.15% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	申万菱信沪深300价值指数	申万菱信沪深300价值指数 C	合计
申万宏源证券	-	143,668.32	143,668.32
申万菱信基金管理有限公司	-	48.80	48.80
合计	-	143,717.12	143,717.12
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	申万菱信沪深300价值指数	申万菱信沪深300价值指数 C	合计
申万菱信基金管理有限公司	-	24.33	24.33
合计	-	24.33	24.33

注：申万菱信沪深 300 价值指数 C 支付基金销售机构的销售服务费按前一日申万菱信沪深 300 价值指数 C 的基金资产净值 0.30% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给申万菱信基金管理有限公司，再由申万菱信基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。日销售服务费 = 申万菱信沪深 300 价值指数 C 前一日基金资产净值 \times 0.30 % / 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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 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。

6.4.10.5.2 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。

6.4.10.6 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	
	2022年1月1日至2022年6月30日		2021年1月1日至2021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
中国工商银行股份有限公司	87,981,306.95	168,944.92	46,791,743.14	101,723.06

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。

6.4.10.7 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。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本报告期末，本基金持有的基金托管人中国工商银行股份有限公司发行的证券“工商银行”（证券代码：601398）合计 29,736,566.37 元，占本基金资产净值的比例为 2.27%。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。

6.4.10.8.2 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

本报告期内，本类基金份额未发生利润分配事项。

6.4.12 期末（2022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

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	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
300834	星辉环材	2022-01-06	6个月-1年(含)	限售期股票	55.57	30.01	635.00	35,286.95	19,056.35	-
301097	天益医疗	2022-03-25	6个月-1年(含)	限售期股票	52.37	48.40	249.00	13,040.13	12,051.60	-
301102	兆讯传媒	2022-03-15	6个月-1年(含)	限售期股票	39.88	31.09	642.00	25,602.96	19,959.78	-
301103	何氏眼科	2022-03-14	6个月-1年(含)	限售期股票	42.50	32.03	390.00	16,575.00	12,491.70	-
301103	何氏眼科	2022-06-01	1个月-6个月(含)	限售期股票	0.00	32.03	117.00	0.00	3,747.51	限售期送股
301109	军信股份	2022-04-06	6个月-1年(含)	限售期股票	34.81	16.22	1,225.00	42,642.25	19,869.50	-
301109	军信股份	2022-06-17	1个月-6个月(含)	限售期股票	0.00	16.22	613.00	0.00	9,942.86	限售期送股
301110	青木股份	2022-03-04	6个月-1年(含)	限售期股票	63.10	39.80	202.00	12,746.20	8,039.60	-
301117	佳缘科技	2022-01-07	6个月-1年(含)	限售期股票	46.80	54.33	262.00	12,261.60	14,234.46	-
301123	奕东电子	2022-01-14	6个月-1年(含)	限售期股票	37.23	25.37	656.00	24,422.88	16,642.72	-
301130	西点药业	2022-02-16	6个月-1年(含)	限售期股票	22.55	37.67	237.00	5,344.35	8,927.79	-
301135	瑞德智能	2022-04-01	6个月-1年(含)	限售期股票	31.98	26.29	338.00	10,809.24	8,886.02	-

30113 7	哈焊 华通	2022-0 3-14	6 个月 -1 年 (含)	限售 期股 票	15.37	15.99	644.00	9,898. 28	10,297 .56	-
30113 9	元道 通信	2022-0 6-30	1 个月 以内 (含)	新股 待上 市	38.46	38.46	5,651. 00	217,33 7.46	217,33 7.46	-
30115 1	冠龙 节能	2022-0 3-30	6 个月 -1 年 (含)	限售 期股 票	30.82	21.50	703.00	21,666 .46	15,114 .50	-
30115 8	德石 股份	2022-0 1-07	6 个月 -1 年 (含)	限售 期股 票	15.64	20.34	379.00	5,927. 56	7,708. 86	-
30119 6	唯科 科技	2022-0 1-04	6 个月 -1 年 (含)	限售 期股 票	64.08	37.50	271.00	17,365 .68	10,162 .50	-
30120 6	三元 生物	2022-0 1-26	6 个月 -1 年 (含)	限售 期股 票	109.30	45.67	506.00	55,305 .80	23,109 .02	-
30120 6	三元 生物	2022-0 6-17	1 个月 -6 个 月 (含)	限售 期股 票	0.00	45.67	253.00	0.00	11,554 .51	限售 期送 股
30120 7	华兰 疫苗	2022-0 2-10	6 个月 -1 年 (含)	限售 期股 票	56.88	56.40	569.00	32,364 .72	32,091 .60	-
30121 5	中汽 股份	2022-0 2-28	6 个月 -1 年 (含)	限售 期股 票	3.80	6.39	4,743. 00	18,023 .40	30,307 .77	-
30121 6	万凯 新材	2022-0 3-21	6 个月 -1 年 (含)	限售 期股 票	35.68	29.84	47.00	1,676. 96	1,402. 48	-
30121 7	铜冠 铜箔	2022-0 1-20	6 个月 -1 年 (含)	限售 期股 票	17.27	14.82	3,307. 00	57,111. 89	49,009 .74	-
30121 9	腾远 钴业	2022-0 3-10	6 个月 -1 年 (含)	限售 期股 票	173.98	87.83	236.00	41,059 .28	20,727 .88	-
30121 9	腾远 钴业	2022-0 5-24	1 个月 -6 个 月 (含)	限售 期股 票	0.00	87.83	189.00	0.00	16,599 .87	限售 期送 股
30122 0	亚香 股份	2022-0 6-15	6 个月 -1 年 (含)	限售 期股 票	35.98	40.71	285.00	10,254 .30	11,602 .35	-

30122 2	浙江 恒威	2022-0 3-02	6 个月 -1 年 (含)	限售 期股 票	33.98	28.96	332.00	11,281 .36	9,614. 72	-
30122 8	实朴 检测	2022-0 1-21	6 个月 -1 年 (含)	限售 期股 票	20.08	20.33	373.00	7,489. 84	7,583. 09	-
30123 3	盛帮 股份	2022-0 6-24	1 个月 以内 (含)	新股 待上 市	41.52	41.52	1,576. 00	65,435 .52	65,435 .52	-
30123 5	华康 医疗	2022-0 1-21	6 个月 -1 年 (含)	限售 期股 票	39.30	37.90	418.00	16,427 .40	15,842 .20	-
30123 6	软通 动力	2022-0 3-08	6 个月 -1 年 (含)	限售 期股 票	72.88	31.38	1,114. 00	81,188 .32	34,957 .32	-
30123 6	软通 动力	2022-0 6-09	1 个月 -6 个 月 (含)	限售 期股 票	0.00	31.38	557.00	0.00	17,478 .66	限售 期送 股
30123 7	和顺 科技	2022-0 3-16	6 个月 -1 年 (含)	限售 期股 票	56.69	41.87	261.00	14,796 .09	10,928 .07	-
30123 9	普瑞 眼科	2022-0 6-22	1 个月 以内 (含)	新股 待上 市	33.65	33.65	5,747. 00	193,38 6.55	193,38 6.55	-
30125 8	富士 莱	2022-0 3-21	6 个月 -1 年 (含)	限售 期股 票	48.30	41.69	295.00	14,248 .50	12,298 .55	-
30126 3	泰恩 康	2022-0 3-22	6 个月 -1 年 (含)	限售 期股 票	19.93	31.38	682.00	13,592 .26	21,401 .16	-
30126 8	铭利 达	2022-0 3-29	6 个月 -1 年 (含)	限售 期股 票	28.50	34.92	641.00	18,268 .50	22,383 .72	-
30130 2	华如 科技	2022-0 6-16	6 个月 -1 年 (含)	限售 期股 票	52.03	58.00	466.00	24,245 .98	27,028 .00	-
68810 2	斯瑞 新材	2022-0 3-09	6 个月 -1 年 (含)	限售 期股 票	10.48	12.23	6,030. 00	63,194 .40	73,746 .90	-
68822 5	亚信 安全	2022-0 1-26	6 个月 -1 年 (含)	限售 期股 票	30.51	20.95	5,534. 00	168,84 2.34	115,93 7.30	-
68832	奥比	2022-0	1 个月	新股	30.99	30.99	8,529.	264,31	264,31	-

2	中光	6-30	以内 (含)	待上 市			00	3.71	3.71	
68840 0	凌云 光	2022-0 6-27	1 个月 以内 (含)	新股 待上 市	21.93	21.93	13,111. 00	287,52 4.23	287,52 4.23	-

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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

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，跟踪沪深 300 价值指数。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。

本基金的银行存款存放在本基金的托管行或其他国内大中型商业银行，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和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。于本期末，本基金持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0%（上期末：0%）。

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、投资组合在短期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期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%。

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。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。于本期末，除附注“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”中列示的卖出回购证券款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他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，因此账面余额约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。

于本期末，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 2022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	87,981,306.95	-	-	-	-	-	87,981,306.95
结算备付金	13,455.99	-	-	-	-	-	13,455.99
存出保证金	242,984.33	-	-	-	-	-	242,984.33
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,223,335,398.46	1,223,335,398.46
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	923,290.88	923,290.88
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	88,237,747.	-	-	-	-	1,224,258,6	1,312,496,4

	27					89.34	36.61
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	-	-	-	-	-	12.65	12.65
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,585,104.27	1,585,104.27
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	674,055.11	674,055.11
应付托管费	-	-	-	-	-	155,551.18	155,551.18
应付销售服务费	-	-	-	-	-	57,709.88	57,709.88
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,002,767.24	1,002,767.24
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	366,452.14	366,452.14
负债总计	-	-	-	-	-	3,841,652.47	3,841,652.47
利率敏感度缺口	88,237,747.27	-	-	-	-	1,220,417.036.87	1,308,654.784.14
上年度末 2021 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	68,872,903.69	-	-	-	-	-	68,872,903.69
结算备付金	1,919,780.71	-	-	-	-	-	1,919,780.71
存出保证金	83,986.80	-	-	-	-	-	83,986.80
交易性金融资产	-	-	-	-	-	974,177,126.73	974,177,126.73
买入返售金融	-	-	-	-	-	-	-

资产							
应收证券清算款	-	-	-	-	-	71,066.45	71,066.45
应收利息	-	-	-	-	-	9,517.33	9,517.33
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	525,195.41	525,195.41
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	70,876,671.20	-	-	-	-	974,782,905.92	1,045,659,577.12
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	-	-	-	-	-	1,314,212.61	1,314,212.61
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	584,595.74	584,595.74
应付托管费	-	-	-	-	-	134,906.70	134,906.70
应付销售服务费	-	-	-	-	-	11,188.28	11,188.28
应付交易费用	-	-	-	-	-	544,613.33	544,613.33
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	243,103.18	243,103.18
负债总计	-	-	-	-	-	2,832,619.84	2,832,619.84
利率敏感度缺口	70,876,671.20	-	-	-	-	971,950,286.08	1,042,826,957.28

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

于本期末，本基金持有交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0%（上期末：0%），

因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上期末：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，沪深 300 价值指数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 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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	1,223,335,398.46	93.48	974,177,126.73	93.42
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	1,223,335,39	93.48	974,177,126.7	93.42
	8.46		3	

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1.以沪深 300 价值指数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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	基准上升 5%	增加约 6,190	增加约 4,736
	基准下降 5%	减少约 6,190	减少约 4,736

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	1,221,544,662.77	970,734,172.23
第二层次	1,027,997.47	3,442,954.50
第三层次	762,738.22	-
合计	1,223,335,398.46	974,177,126.73

6.4.14.2.2 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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2021 年 12 月 31 日：无)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2022 年 6 月 30 日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

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	1,223,335,398.46	93.21
	其中：股票	1,223,335,398.46	93.21
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	87,994,762.94	6.70
8	其他各项资产	1,166,275.21	0.09
9	合计	1,312,496,436.61	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	-	-
B	采矿业	66,095,769.54	5.05
C	制造业	250,546,059.16	19.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	83,296,998.29	6.37
E	建筑业	66,535,442.71	5.08
F	批发和零售业	2,449,841.16	0.19
G	交通运输、仓储和邮政业	25,846,996.54	1.98
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	20,266,256.68	1.55
J	金融业	626,246,593.00	47.85
K	房地产业	69,742,085.42	5.33
L	租赁和商务服务业	12,016,184.78	0.92
M	科学研究和技术服务业	53,733.06	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	29,812.36	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	209,625.76	0.02
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,223,335,398.46	93.48

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金未开通港股通交易机制投资于港股。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600036	招商银行	2,201,777.00	92,914,989.40	7.10

2	601318	中国平安	1,927,177.0 0	89,979,894.13	6.88
3	601166	兴业银行	2,586,820.0 0	51,477,718.00	3.93
4	600900	长江电力	2,022,693.0 0	46,764,662.16	3.57
5	600030	中信证券	1,736,201.0 0	37,606,113.66	2.87
6	601398	工商银行	6,234,081.0 0	29,736,566.37	2.27
7	000651	格力电器	841,712.00	28,382,528.64	2.17
8	000725	京东方 A	6,671,500.0 0	26,285,710.00	2.01
9	000001	平安银行	1,726,030.0 0	25,855,929.40	1.98
10	000002	万 科 A	1,211,280.0 0	24,831,240.00	1.90
11	601328	交通银行	4,887,826.0 0	24,341,373.48	1.86
12	600048	保利发展	1,265,736.0 0	22,099,750.56	1.69
13	601668	中国建筑	3,695,243.0 0	19,658,692.76	1.50
14	601088	中国神华	581,333.00	19,358,388.90	1.48
15	600690	海尔智家	667,042.00	18,316,973.32	1.40
16	600089	特变电工	667,900.00	18,293,781.00	1.40
17	601288	农业银行	5,624,708.0 0	16,986,618.16	1.30
18	600837	海通证券	1,701,600.0 0	16,692,696.00	1.28
19	600000	浦发银行	2,069,431.0 0	16,576,142.31	1.27
20	600016	民生银行	4,375,277.0 0	16,276,030.44	1.24
21	601919	中远海控	1,115,052.0 0	15,499,222.80	1.18
22	600585	海螺水泥	422,806.00	14,916,595.68	1.14
23	600919	江苏银行	2,081,480.0 0	14,820,137.60	1.13
24	601688	华泰证券	1,036,981.0 0	14,725,130.20	1.13
25	600104	上汽集团	823,498.00	14,666,499.38	1.12
26	601225	陕西煤业	683,362.00	14,473,607.16	1.11
27	601601	中国太保	603,325.00	14,196,237.25	1.08

28	601988	中国银行	3,714,666.0 0	12,109,811.16	0.93
29	601211	国泰君安	794,200.00	12,071,840.00	0.92
30	002027	分众传媒	1,782,500.0 0	11,996,225.00	0.92
31	000338	潍柴动力	956,006.00	11,921,394.82	0.91
32	601169	北京银行	2,609,553.0 0	11,847,370.62	0.91
33	000100	TCL 科技	2,473,100.0 0	11,846,149.00	0.91
34	601229	上海银行	1,752,390.0 0	11,478,154.50	0.88
35	601985	中国核电	1,660,752.0 0	11,392,758.72	0.87
36	600050	中国联通	3,276,600.0 0	11,337,036.00	0.87
37	601766	中国中车	2,143,020.0 0	11,143,704.00	0.85
38	601390	中国中铁	1,808,488.0 0	11,104,116.32	0.85
39	601669	中国电建	1,347,729.0 0	10,606,627.23	0.81
40	601658	邮储银行	1,916,700.0 0	10,331,013.00	0.79
41	000776	广发证券	521,313.00	9,748,553.10	0.74
42	600028	中国石化	2,357,806.0 0	9,619,848.48	0.74
43	601009	南京银行	908,337.00	9,464,871.54	0.72
44	600019	宝钢股份	1,569,862.0 0	9,450,569.24	0.72
45	600999	招商证券	654,200.00	9,427,022.00	0.72
46	601628	中国人寿	293,774.00	9,130,495.92	0.70
47	601857	中国石油	1,711,790.0 0	9,072,487.00	0.69
48	000895	双汇发展	305,300.00	8,945,290.00	0.68
49	601818	光大银行	2,914,773.0 0	8,773,466.73	0.67
50	600346	恒力石化	372,100.00	8,275,504.00	0.63
51	600926	杭州银行	522,863.00	7,832,487.74	0.60
52	001979	招商蛇口	563,322.00	7,565,414.46	0.58
53	601939	建设银行	1,195,612.0 0	7,245,408.72	0.55
54	002202	金风科技	486,499.00	7,200,185.20	0.55
55	601006	大秦铁路	1,058,086.0	6,972,786.74	0.53

			0		
56	601138	工业富联	700,700.00	6,894,888.00	0.53
57	601377	兴业证券	952,870.00	6,717,733.50	0.51
58	601600	中国铝业	1,395,700.0 0	6,629,575.00	0.51
59	600741	华域汽车	280,322.00	6,447,406.00	0.49
60	600383	金地集团	477,410.00	6,416,390.40	0.49
61	601186	中国铁建	811,539.00	6,411,158.10	0.49
62	600188	兖矿能源	161,300.00	6,368,124.00	0.49
63	601838	成都银行	382,000.00	6,333,560.00	0.48
64	600795	国电电力	1,570,751.0 0	6,141,636.41	0.47
65	601117	中国化学	645,500.00	6,074,155.00	0.46
66	003816	中国广核	2,079,900.0 0	5,823,720.00	0.45
67	601800	中国交建	620,830.00	5,761,302.40	0.44
68	600015	华夏银行	1,084,780.0 0	5,651,703.80	0.43
69	600886	国投电力	526,032.00	5,523,336.00	0.42
70	600011	华能国际	775,500.00	5,459,520.00	0.42
71	000157	中联重科	875,870.00	5,395,359.20	0.41
72	000425	徐工机械	965,254.00	5,202,719.06	0.40
73	002601	龙佰集团	252,019.00	5,052,980.95	0.39
74	601916	浙商银行	1,474,000.0 0	4,893,680.00	0.37
75	002736	国信证券	508,100.00	4,862,517.00	0.37
76	600941	中国移动	79,400.00	4,803,700.00	0.37
77	000069	华侨城 A	729,076.00	4,731,703.24	0.36
78	601336	新华保险	146,858.00	4,727,359.02	0.36
79	600352	浙江龙盛	458,700.00	4,669,566.00	0.36
80	601618	中国中冶	1,259,315.0 0	4,407,602.50	0.34
81	601155	新城控股	161,132.00	4,097,586.76	0.31
82	000703	恒逸石化	388,063.00	4,078,542.13	0.31
83	600332	白云山	125,100.00	3,951,909.00	0.30
84	600489	中金黄金	517,400.00	3,823,586.00	0.29
85	000708	中信特钢	179,800.00	3,622,970.00	0.28
86	601728	中国电信	965,500.00	3,601,315.00	0.28
87	601898	中煤能源	325,600.00	3,379,728.00	0.26
88	600018	上港集团	578,900.00	3,374,987.00	0.26
89	601216	君正集团	599,600.00	2,926,048.00	0.22
90	600061	国投资本	456,700.00	2,904,612.00	0.22
91	601319	中国人保	568,800.00	2,878,128.00	0.22
92	600606	绿地控股	634,290.00	2,511,788.40	0.19

93	600655	豫园股份	257,250.00	2,428,440.00	0.19
94	601998	中信银行	506,859.00	2,407,580.25	0.18
95	600025	华能水电	313,500.00	2,191,365.00	0.17
96	002064	华峰化学	259,300.00	2,188,492.00	0.17
97	601881	中国银河	224,500.00	2,170,915.00	0.17
98	000800	一汽解放	157,600.00	1,471,984.00	0.11
99	000877	天山股份	105,600.00	1,298,880.00	0.10
100	601825	沪农商行	167,900.00	1,052,733.00	0.08
101	688400	凌云光	13,111.00	287,524.23	0.02
102	688322	奥比中光	8,529.00	264,313.71	0.02
103	301139	元道通信	5,651.00	217,337.46	0.02
104	301239	普瑞眼科	5,747.00	193,386.55	0.01
105	688225	亚信安全	5,534.00	115,937.30	0.01
106	688227	品高股份	4,164.00	89,192.88	0.01
107	688102	斯瑞新材	6,030.00	73,746.90	0.01
108	301233	盛帮股份	1,576.00	65,435.52	0.01
109	301236	软通动力	1,671.00	52,435.98	0.00
110	301217	铜冠铜箔	3,307.00	49,009.74	0.00
111	301219	腾远钴业	425.00	37,327.75	0.00
112	601089	福元医药	1,749.00	36,816.45	0.00
113	301206	三元生物	759.00	34,663.53	0.00
114	301207	华兰疫苗	569.00	32,091.60	0.00
115	301215	中汽股份	4,743.00	30,307.77	0.00
116	301109	军信股份	1,838.00	29,812.36	0.00
117	301302	华如科技	466.00	27,028.00	0.00
118	301268	铭利达	641.00	22,383.72	0.00
119	301263	泰恩康	682.00	21,401.16	0.00
120	301102	兆讯传媒	642.00	19,959.78	0.00
121	300834	星辉环材	635.00	19,056.35	0.00
122	301123	奕东电子	656.00	16,642.72	0.00
123	301103	何氏眼科	507.00	16,239.21	0.00
124	301235	华康医疗	418.00	15,842.20	0.00
125	301151	冠龙节能	725.00	15,625.34	0.00
126	301117	佳缘科技	262.00	14,234.46	0.00
127	301258	富士莱	295.00	12,298.55	0.00
128	301097	天益医疗	249.00	12,051.60	0.00
129	301220	亚香股份	285.00	11,602.35	0.00
130	001268	联合精密	409.00	11,337.48	0.00
131	301237	和顺科技	261.00	10,928.07	0.00
132	301137	哈焊华通	644.00	10,297.56	0.00
133	301196	唯科科技	271.00	10,162.50	0.00
134	301222	浙江恒威	332.00	9,614.72	0.00
135	301130	西点药业	237.00	8,927.79	0.00
136	301135	瑞德智能	338.00	8,886.02	0.00

137	301110	青木股份	202.00	8,039.60	0.00
138	301158	德石股份	379.00	7,708.86	0.00
139	301228	实朴检测	373.00	7,583.09	0.00
140	301216	万凯新材	47.00	1,402.48	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	600036	招商银行	74,685,633.00	7.16
2	601318	中国平安	70,172,529.31	6.73
3	601166	兴业银行	40,904,249.00	3.92
4	600900	长江电力	34,894,805.00	3.35
5	600030	中信证券	34,178,780.02	3.28
6	601398	工商银行	22,318,831.24	2.14
7	000725	京东方 A	21,821,987.00	2.09
8	000651	格力电器	21,434,503.00	2.06
9	000001	平安银行	20,353,850.00	1.95
10	600089	特变电工	17,958,837.00	1.72
11	601328	交通银行	17,709,762.00	1.70
12	000002	万科 A	17,273,721.00	1.66
13	600048	保利发展	15,339,922.00	1.47
14	601668	中国建筑	15,036,719.00	1.44
15	601288	农业银行	13,533,623.00	1.30
16	601919	中远海控	12,928,060.00	1.24
17	600837	海通证券	12,834,101.00	1.23
18	600000	浦发银行	12,286,390.80	1.18
19	600690	海尔智家	12,198,423.00	1.17
20	600585	海螺水泥	12,092,441.16	1.16

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	600036	招商银行	44,412,921.53	4.26
2	601318	中国平安	44,108,230.68	4.23
3	601166	兴业银行	26,222,973.00	2.51
4	600900	长江电力	23,863,210.00	2.29
5	600030	中信证券	21,121,645.63	2.03

6	300498	温氏股份	19,827,182.62	1.90
7	601398	工商银行	14,835,769.26	1.42
8	000651	格力电器	13,839,068.00	1.33
9	000001	平安银行	12,741,222.00	1.22
10	600958	东方证券	12,679,826.12	1.22
11	601328	交通银行	11,778,217.00	1.13
12	000002	万 科 A	10,848,142.00	1.04
13	601288	农业银行	10,780,519.00	1.03
14	601668	中国建筑	10,339,417.00	0.99
15	000725	京东方 A	10,143,905.00	0.97
16	600048	保利发展	10,069,645.30	0.97
17	601877	正泰电器	9,173,643.89	0.88
18	601088	中国神华	8,872,533.00	0.85
19	601919	中远海控	8,299,469.30	0.80
20	600690	海尔智家	8,236,029.00	0.79

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	990,890,726.63
卖出股票的收入（成交）总额	641,815,919.59

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 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，本基金不得参与国债期货交易。

7.11.2 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十大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。本基金投资的前十大证券的发行主体除平安银行(000001.SZ)、工商银行(601398.SH)、兴业银行(601166.SH)、招商银行(600036.SH)外，在报告编制日前一年内，没有收到公开谴责和处罚的情形。

2022 年 3 月 25 日，平安银行股份有限公司公告，平安银行股份有限公司存在涉嫌违法违规行为，中国银行保险监督管理委员会根据相关法律法规对公司公开处罚，罚款人民币约为 400 万元。

2022 年 3 月 25 日，中国工商银行股份有限公司公告，中国工商银行股份有限公司存在涉嫌违法违规行为，中国银行保险监督管理委员会根据相关法律法规对公司公开处罚，罚款人民币约为 360 万元。

2022 年 3 月 25 日，兴业银行股份有限公司公告，兴业银行股份有限公司存在涉嫌违法违规行为，中国银行保险监督管理委员会根据相关法律法规对公司公开处罚，罚款人民币约为 350 万元。2021 年 8 月 20 日，兴业银行股份有限公司公告，兴业银行股份有限公司存在涉嫌违法违规行为，中国人民银行根据相关法律法规对公司公开处罚，罚款人民币约为 5 万元。

2022 年 3 月 25 日，招商银行股份有限公司公告，招商银行股份有限公司存在涉嫌违法违规行为，中国银行保险监督管理委员会根据相关法律法规对公司公开处罚，罚款人民币约为 300 万元。

本基金采用完全复制方式被动跟踪标的指数，上述证券为本基金业绩基准的成分股，所以不影响基金管理人对该证券的投资决策。

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	242,984.33
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	923,290.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,166,275.21

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的情况。

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
申万菱信沪深 300 价值指数	73,207	10,816.07	436,584,013.46	55.14%	355,228,070.55	44.86%
申万菱信沪深 300 价值指数 C	5,620	53,811.49	248,052,536.17	82.02%	54,368,064.00	17.98%
合计	78,425	13,952.60	684,636,549.63	62.57%	409,596,134.55	37.43%

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 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	申万菱信沪深 300 价值指数	41,391.68	0.01%
	申万菱信沪深 300 价值指数 C	9,341.43	0.00%
	合计	50,733.11	0.00%

注：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）。

8.3 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	申万菱信沪深 300 价值指数	0
	申万菱信沪深 300 价值指数 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	申万菱信沪深 300 价值指数	0
	申万菱信沪深 300 价值指数 C	0
	合计	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	申万菱信沪深 300 价值指数	申万菱信沪深 300 价值指数 C
基金合同生效日（2010 年 2 月 11 日）基金份额总额	925,168,028.22	-
本报告期期初基金份额总额	744,214,960.55	42,880,888.28
本报告期基金总申购份额	367,123,814.80	619,378,533.21
减：本报告期基金总赎回份额	319,526,691.34	359,838,821.32
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	791,812,084.01	302,420,600.17

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，经基金管理人股东会决议，同意公司董事由李琦先生变更为姜山先生。
- 2、本报告期内，经基金管理人股东会决议，同意公司独立董事由白虹女士变更为马晨光女士。
- 3、本报告期内，经基金管理人股东会决议，同意公司独立董事由白硕先生变更为卓福民先生。
- 4、本报告期内，经基金管理人董事会决议，免去张丽红女士公司副总经理职务。
- 5、本报告期内，经基金管理人董事会决议，聘任史莉珠女士担任公司副总经理兼财务负责人。
- 6、本报告期内，经基金管理人董事会决议，免去王伟先生副总经理职务，聘任其为公司总经理助理。
- 7、本报告期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 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘用毕马威华振会计师事务所（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。

10.7 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。

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

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	佣金	占当期佣金总量的	

			额的比例		比例	
东方财富证券	2	527,226,711.63	32.73%	490,804.78	32.81%	-
申万宏源证券	2	300,458,475.95	18.65%	279,183.58	18.66%	-
中泰证券	2	125,169,129.48	7.77%	116,570.50	7.79%	-
长江证券	1	115,169,337.99	7.15%	107,256.86	7.17%	-
中信建投证券	2	107,272,120.05	6.66%	99,815.57	6.67%	-
太平洋证券	1	80,013,383.08	4.97%	74,516.31	4.98%	-
天风证券	2	64,338,298.65	3.99%	59,918.91	4.01%	-
信达证券	1	64,077,214.60	3.98%	58,884.72	3.94%	-
银河证券	1	36,737,888.39	2.28%	33,792.80	2.26%	-
安信证券	1	24,828,841.96	1.54%	22,683.10	1.52%	-
华泰证券	1	24,637,396.88	1.53%	22,452.04	1.50%	-
东吴证券	2	21,331,270.49	1.32%	19,484.28	1.30%	-
西南证券	2	21,081,355.55	1.31%	19,632.91	1.31%	-
平安证券	1	19,958,941.00	1.24%	18,190.15	1.22%	-
民生证券	1	17,023,869.30	1.06%	15,659.15	1.05%	-
东方证券	1	13,902,023.78	0.86%	12,760.96	0.85%	-
国元证券	1	13,768,115.00	0.85%	12,822.30	0.86%	-
方正证券	2	11,708,797.31	0.73%	10,904.53	0.73%	-
中信证券	2	10,109,862.53	0.63%	9,213.24	0.62%	-
第一创业	1	5,502,473.35	0.34%	5,124.54	0.34%	-
国信证券	1	2,754,514.96	0.17%	2,510.27	0.17%	-
财通证券	2	2,656,400.00	0.16%	2,473.95	0.17%	-
西部证券	2	1,329,923.57	0.08%	1,212.18	0.08%	-
东兴证券	1	16,625.22	-	15.32	-	-
北京高华	2	-	-	-	-	-
红塔证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	2	-	-	-	-	-
华信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
五矿证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-

长城证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	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。

10.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
北京高华	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-

华融证券	-	-	-	-	-	-
华信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-

10.9 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	申万菱信沪深 300 价值指数证券投资基金(申万菱信沪深 300 价值指数 C)产品资料概要更新	上海证券报、规定互联网站	2022-03-17
2	申万菱信沪深 300 价值指数证券投资基金(申万菱信沪深 300 价值指数)产品资料概要更新	上海证券报、规定互联网站	2022-03-17
3	申万菱信沪深 300 价值指数证券投资基金更新招募说明书(2022 年第 1 号)	上海证券报、规定互联网站	2022-03-17
4	申万菱信沪深 300 价值指数证券投资基金基金经理变更公告	上海证券报、规定互联网站	2022-03-16
5	申万菱信基金管理有限公司申万菱信沪深 300 价值指数证券投资基金基金经理变更公告	上海证券报、规定互联网站	2022-03-15

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

		20%的时间区间					
机构	1	20220426—20220512	145,026,933.70	226,277,783.88	371,304,717.58	0.00	0.00%
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。							

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。

12.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

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

二〇二二年八月三十一日