

申万菱信深证成份指数型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 06 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:2026 年 08 月 31 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年08月27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2026年01月01日起至2026年06月30日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§ 2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
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	52
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	52
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	52
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	52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
7.12 投资组合报告附注	53
§ 8 基金份额持有人信息	54

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
§ 9 开放式基金份额变动	54
§ 10 重大事件揭示	55
10.1 基金份额持有人大会决议	55
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	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
10.4 基金投资策略的改变	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	55
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	55
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	56
10.8 其他重大事件	59
§ 11 备查文件目录	59
11.1 备查文件目录	59
11.2 存放地点	59
11.3 查阅方式	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	申万菱信深证成份指数型证券投资基金	
基金简称	申万菱信深证成份指数	
场内简称	申万深成 LOF	
基金主代码	163109	
基金运作方式	上市契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 01 月 01 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	180,000,429.39 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	2021 年 01 月 25 日	
下属分级基金的基金简称	申万菱信深证成份指数 A	申万菱信深证成份指数 C
下属分级基金的交易代码	163109	015177
报告期末下属分级基金的份 额总额	160,041,334.92 份	19,959,094.47 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。 特殊情况主要是指在标的指数成份股发生变动、增发、配股、分红等公司行为导致申万菱信深证成份指数型证券投资基金招募说明书成份股的构成及权重发生变化时，由于交易成本、交易制度、个别成份股停牌或者流动性不足等原因导致基金无法及时完成投资组合的同步调整，基金管理人需要采用其他合理的投资方法构建尽可能贴近目标指数的基金组合。
业绩比较基准	95%×深证成指收益率+5%×银行同业存款利率
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，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	廖林

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
登载基金中期报告的管理人互联网网址	https://www.swsmu.com
基金中期报告置备地点	基金管理人及基金托管人住所

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（2026 年 01 月 01 日-2026 年 06 月 30 日）	
	申万菱信深证成份指数 A	申万菱信深证成份指数 C
本期已实现收益	18,779,522.48	1,957,294.79
本期利润	27,398,539.20	2,950,593.19
加权平均基金份额本期利润	0.1421	0.1480
本期加权平均净值利润率	17.71%	18.63%
本期基金份额净值增长率	19.21%	19.03%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）	
期末可供分配利润	27,398,745.02	-3,328,939.11
期末可供分配基金份额利润	0.1712	-0.1668
期末基金资产净值	142,113,518.54	17,500,906.39

期末基金份额净值	0.8880	0.8768
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）	
基金份额累计净值增长率	18.21%	34.15%

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）期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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

申万菱信深证成份指数 A 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	19.79%	1.61%	19.19%	1.63%	0.60%	-0.02%
过去六个月	19.21%	1.44%	18.83%	1.46%	0.38%	-0.02%
过去一年	52.47%	1.32%	51.70%	1.33%	0.77%	-0.01%
过去三年	48.54%	1.40%	44.80%	1.42%	3.74%	-0.02%
过去五年	12.96%	1.31%	7.24%	1.33%	5.72%	-0.02%
自基金转型日起至今	18.21%	1.32%	12.18%	1.34%	6.03%	-0.02%

申万菱信深证成份指数 C 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	19.70%	1.61%	19.19%	1.63%	0.51%	-0.02%
过去六个月	19.03%	1.45%	18.83%	1.46%	0.20%	-0.01%
过去一年	52.01%	1.32%	51.70%	1.33%	0.31%	-0.01%
过去三年	47.24%	1.40%	44.80%	1.42%	2.44%	-0.02%
自基金转型日起至今	34.15%	1.33%	30.80%	1.35%	3.35%	-0.02%

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本基金业绩比较基准为：95%×深证成指收益率+5%×银行同业存款利率。

3、业绩比较基准计算过程中日收益率统一四舍五入保留 8 位小数。

3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

申万菱信深证成份指数A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2021年01月01日-2026年06月30日)



申万菱信深证成份指数C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2022年03月18日-2026年06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 81 只，资产管理规模 1463.55 亿元，公募产品累计分红 230.27 亿元。（截至 2026 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。

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！

（注：基金管理人与股东之间实行业务隔离制度）

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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		
周润	本基金基金经理、投资经理	2025-11-10	-	10 年	周润先生，硕士研究生。2015 年起从事金融相关工作，2015 年 8 月加入申万菱信基金管理有限公司，曾任数量研究岗，现任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、申万菱信深证成份指数型证券投资基金、申万菱信中小企业 100 指数证券投资基金（LOF）、申万菱信中证环保产业指数型证券

					投资基金（LOF）基金经理，兼任投资经理。
--	--	--	--	--	-----------------------

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。

4.1.3 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

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
周润	公募基金	5	598,642,273.27	2025-10-29
	私募资产管理计划	3	83,023,934.80	2020-05-27
	其他组合	-	-	-
	合计	8	681,666,208.07	-

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，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。

此外，为防范兼任行为潜在利益冲突，本公司制定了《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理管理办法》，从投资指令、交易行为、交易监测等多方面，对兼任组合进行监控管理和分析评估。本基金基金经理同时兼任私募资产管理计划投资经理。本报告期内兼任组合未出现违反公平交易或异常交易的情况。

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

报告期内，全球大类资产中，原油、纳斯达克指数涨幅居前，全球 AI 产业发展推升算力需求大幅扩张，产业链相关企业表现较好，局部地缘动荡引发石油等资产价格波动。A 股宽基指数行业分布差异较大影响指数表现，风格差异不大。行业分化显著，电子、通信涨幅居前，商贸零售、美容护理跌幅较大。

操作上，本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赎以及成分股定期调整。

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目标指数的跟踪偏离为投资目标，追求跟踪误差的最小化。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金 A 类产品报告期内净值表现为 19.21%，同期业绩基准表现为 18.83%；

本基金 C 类产品报告期内净值表现为 19.03%，同期业绩基准表现为 18.83%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

报告期内，美债收益率小幅抬升，新任联储出席上任，国内资金面较为宽裕，AI 相关产业的发展成为市场主要力量。在头部厂商资本开支扩张下，算力链的需求增长，推动盈利改善，市场呈现行业分化的局面。

产业趋势有较强的惯性，资金先行过程中或发生阶段性失衡，将成为市场波动的主要来源之一。检验产业发展结果要看能带来多少惠及大众的社会价值，在这一路径实现过程中企业原先的竞争壁垒、商业模式、组织关系等都可能重塑，资产价格随之波动，但最终指向的是人的需求。

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分管基金运营的高级管理人员、督察长、分管基金投资研究的高级管理人员、基金研究部门负责人、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

本基金本报告期末未进行利润分配，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遵规守信、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，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

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 2026 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：申万菱信深证成份指数型证券投资基金

报告截止日：2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	10,681,309.48	11,770,217.32
结算备付金		5,430.67	33,161.13
存出保证金		16,079.90	11,794.64
交易性金融资产	6.4.7.2	149,810,691.16	164,321,780.42
其中：股票投资		149,810,691.16	164,321,780.42
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		6,097.27	338,835.61
应收股利		-	-
应收申购款		722,628.17	354,721.73
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		161,242,236.65	176,830,510.85
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 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		-	-
应付赎回款		1,294,966.42	1,376,036.84
应付管理人报酬		128,032.53	149,479.21
应付托管费		25,606.51	29,895.85
应付销售服务费		3,893.94	4,068.46
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	175,312.32	271,286.13
负债合计		1,627,811.72	1,830,766.49
净资产:			
实收基金	6.4.7.7	134,673,867.99	173,692,854.30
未分配利润	6.4.7.8	24,940,556.94	1,306,890.06
净资产合计		159,614,424.93	174,999,744.36
负债和净资产总计		161,242,236.65	176,830,510.85

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 180,000,429.39 份。其中申万菱信深证成份指数 A 基金份额净值 0.8880 元，基金份额总额 160,041,334.92 份。其中申万菱信深证成份指数 C 基金份额净值 0.8768 元，基金份额总额 19,959,094.47 份。

6.2 利润表

会计主体：申万菱信深证成份指数型证券投资基金

本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
一、营业总收入		31,482,049.94	4,357,254.53

1. 利息收入		21,388.68	18,509.35
其中：存款利息收入	6.4.7.9	21,388.68	18,509.35
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		21,777,876.78	4,047,782.86
其中：股票投资收益	6.4.7.10	20,639,136.12	2,388,951.92
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	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	1,138,740.66	1,658,830.94
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	9,612,315.12	272,655.15
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	70,469.36	18,307.17
减：二、营业总支出		1,132,917.55	1,060,382.31
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	845,237.59	786,101.07
2. 托管费	6.4.10.2.2	169,047.54	157,220.19
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	23,318.99	14,604.34
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	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.19	95,313.43	102,456.71
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		30,349,132.39	3,296,872.22
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		30,349,132.39	3,296,872.22
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		30,349,132.39	3,296,872.22

6.3 净资产变动表

会计主体：申万菱信深证成份指数型证券投资基金

本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期		
	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	173,692,854.30	1,306,890.06	174,999,744.36
二、本期期初净资产	173,692,854.30	1,306,890.06	174,999,744.36
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-39,018,986.31	23,633,666.88	-15,385,319.43
（一）、综合收益总额	-	30,349,132.39	30,349,132.39
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-39,018,986.31	-6,715,465.51	-45,734,451.82
其中：1. 基金申购款	91,763,156.76	-17,385,487.79	74,377,668.97
2. 基金赎回款	-130,782,143.07	10,670,022.28	-120,112,120.79
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	134,673,867.99	24,940,556.94	159,614,424.93
项 目	上年度可比期间		
	2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	209,734,237.05	-46,311,307.27	163,422,929.78
二、本期期初净资产	209,734,237.05	-46,311,307.27	163,422,929.78
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-12,035,429.35	5,871,747.24	-6,163,682.11
（一）、综合收益总额	-	3,296,872.22	3,296,872.22
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-12,035,429.35	2,574,875.02	-9,460,554.33
其中：1. 基金申购款	59,799,145.69	-25,452,431.43	34,346,714.26
2. 基金赎回款	-71,834,575.04	28,027,306.45	-43,807,268.59
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	197,698,807.70	-40,439,560.03	157,259,247.67

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：

邱春杨	邱春杨	徐越
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

申万菱信深证成份指数型证券投资基金（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。经向中国证监会备案，《申万巴黎深证成指分级指数基金基金合同》于 2010 年 10 月 22 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 712,484,721.40 份基金份额，其中认购资金利息折合 129,488.89 份基金份额。本基金的基金管理人为申万菱信基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

经中国证监会证监许可[2011]106 号《关于核准申万巴黎基金管理有限公司变更股权、公司名称及修改章程的批复》批准，申万巴黎基金管理有限公司已于 2011 年 3 月 3 日完成相关工商变更登记手续，并于 2011 年 3 月 4 日变更公司名称为“申万菱信基金管理有限公司”。本基金的基金管理人报请中国证监会备案，将申万巴黎深证成指分级证券投资基金更名为“申万菱信深证成指分级证券投资基金”，并于 2011 年 4 月 6 日公告。

根据《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、申万进取份额终止运作、终止上市并修改基金合同的公告》，《申万菱信深证成份指数型证券投资基金基金合同》将于 2021 年 1 月 1 日生效，《申万菱信深证成指分级证券投资基金基金合同》同时失效。因此，申万菱信深证成指分级证券投资基金的基金名称于 2021 年 1 月 1 日起变更为“申万菱信深证成份指数型证券投资基金”。根据《申万菱信基金管理有限公司关于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、申万进取份额基金份额转换结果的公告》，本基金管理人以 2020 年 12 月 31 日为基金份额转换基准日，对登记系统登记在册的申万收益份额和申万进取份额办理向场内申万深成份折算业务。根据《申万菱信深证成份指数型证券投资基金上市交易提示性公告》，本基金于 2021 年 1 月 25 日在深圳证券交易所上市。

根据《关于旗下部分基金增加 C 类基金份额并相应修订基金合同及托管协议的公告》，本基金自 2022 年 3 月 1 日起增加 C 类基金份额。增加 C 类份额后，原有的持有本基金份额的投资人，其基金账户中保留的本基金份额余额为 A 类基金份额。A 类基金份额在投资者申购时收取手续费，不计提销售服务费；C 类基金份额从本类别基金资产中计提销售服务费，不收取手续费。不同基金份额类别之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《申万菱信深证成份指数型证券投资基金基金合同》和最新公布的《申万菱信深证成份指数型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，包括深证成指成份股、备选成份股、新股（首次公开发行或增发）、存托凭证、现金或者到期日在一年以内的政府债券等。其中，深证成指成份股及其

备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的 90%，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的 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。本基金还可投资于法律法规或监管机构允许基金投资的其他金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{深证成指收益率}$

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金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和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《公开募集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》、《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金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要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 06 月 30 日的财务状况、2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

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 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

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

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《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》、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《关于企业所得税若干优惠政策的通

知》、财税〔2016〕36号文《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》、财税〔2023〕39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部税务总局公告2024年第8号《关于延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》、财税〔2025〕4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税〔2026〕10号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》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) 本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照3%的规定征收率计算缴纳增值税。

本基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入，自2026年1月1日至2027年12月31日，免征增值税；对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。自2025年8月8日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在2025年8月8日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(b) 对本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。

对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(c) 对本基金从上市公司、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，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。对本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。

对本基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向本基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

(d) 本基金卖出股票按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。自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

(e) 对本基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照本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附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
活期存款	10,681,309.48
等于：本金	10,680,239.42
加：应计利息	1,070.06
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
减：坏账准备	-
合计	10,681,309.48

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	92,378,337.76	-	149,810,691.16	57,432,353.40
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	92,378,337.76	-	149,810,691.16	57,432,353.40

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,228.54
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	9,522.51
其中：交易所市场	9,522.51
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-信息披露费	59,507.37
预提费用-审计费	35,704.06
其他应付	68,349.84
合计	175,312.32

6.4.7.7 实收基金

申万菱信深证成份指数 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	216,955,748.16	155,510,043.71
本期申购	7,021,627.02	5,032,999.69
本期赎回（以“-”号填列）	-63,936,040.26	-45,828,269.88
本期末	160,041,334.92	114,714,773.52

申万菱信深证成份指数 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	18,182,810.59	18,182,810.59
本期申购	86,730,157.07	86,730,157.07
本期赎回（以“-”号填列）	-84,953,873.19	-84,953,873.19
本期末	19,959,094.47	19,959,094.47

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润
申万菱信深证成份指数 A

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	270,021,040.81	-263,924,616.78	6,096,424.03
本期期初	270,021,040.81	-263,924,616.78	6,096,424.03
本期利润	18,779,522.48	8,619,016.72	27,398,539.20
本期基金份额交易产生的变动数	-73,293,886.38	67,197,668.17	-6,096,218.21
其中：基金申购款	9,037,528.90	-8,338,437.05	699,091.85
基金赎回款	-82,331,415.28	75,536,105.22	-6,795,310.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	215,506,676.91	-188,107,931.89	27,398,745.02

申万菱信深证成份指数 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	-4,843,948.03	54,414.06	-4,789,533.97
本期期初	-4,843,948.03	54,414.06	-4,789,533.97
本期利润	1,957,294.79	993,298.40	2,950,593.19
本期基金份额交易产生的变动数	-442,285.87	-176,961.43	-619,247.30
其中：基金申购款	-20,058,190.70	1,973,611.06	-18,084,579.64
基金赎回款	19,615,904.83	-2,150,572.49	17,465,332.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,328,939.11	870,751.03	-2,458,188.08

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	21,323.36
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	37.84
其他	27.48
合计	21,388.68

6.4.7.10 股票投资收益
6.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	62,376,133.30
减：卖出股票成本总额	41,685,902.90
减：交易费用	51,094.28
买卖股票差价收入	20,639,136.12

6.4.7.10.2 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期无股票投资收益-证券出借差价收入。

6.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,138,740.66
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	1,138,740.66

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	9,612,315.12
——股票投资	9,612,315.12
——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	9,612,315.12

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	70,460.41
转换费收入	8.95
合计	70,469.36

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内未发生信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
审计费用	35,704.06
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	102.00
合计	95,313.43

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

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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	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	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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 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
申万宏源证券有限公司	79,592,492.50	100.00%	34,837,603.82	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 基金交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行基金交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 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
申万宏源证券有限公司	14,797.48	100.00%	9,522.51	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 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

申万宏源证券有限公司	6,477.18	100.00%	4,302.61	100.00%
------------	----------	---------	----------	---------

注：上述佣金经本基金的基金管理人与证券公司协商确定，股票交易佣金费率不超过市场平均股票交易佣金费率，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司等第三方收取的费用后的净额列示。

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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	845,237.59	786,101.07
其中：应支付销售机构的客户维护费	224,576.78	172,307.71
应支付基金管理人的净管理费	620,660.81	613,793.36

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.00%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金管理费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	169,047.54	157,220.19

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.2%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金托管费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

	申万菱信深证成份指数 A	申万菱信深证成份指数 C	合计
中国工商银行股份有限公司	-	277.69	277.69
申万菱信基金管理有限公司	-	45.78	45.78
合计	-	323.47	323.47
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	申万菱信深证成份指数 A	申万菱信深证成份指数 C	合计
中国工商银行股份有限公司	-	297.55	297.55
申万菱信基金管理有限公司	-	3.80	3.80
合计	-	301.35	301.35

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.3%，销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.3% 年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times C$ 类基金销售服务费年费率 / 当年天数

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

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

本报告期末和上年度末，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
-------	----	---------

	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 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	10,681,309.48	21,323.36	10,219,382.87	18,459.02

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期末，本基金持有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）共计 65,061.00 股（上年度末 88,661.00 股），占基金资产净值比例 0.18%（上年度末 0.27%）。

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。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 06 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
301666	大普微	2026 年 04 月 08 日	1-6 个月(含)	新股限售	46.08	571.99	262	12,072.96	149,861.38	-
001399	惠科股份	2026 年 06 月 16 日	1-6 个月(含)	新股限售	10.12	35.24	830	8,399.60	29,249.20	-
001257	盛龙股份	2026 年 03 月 24 日	1-6 个月(含)	新股限售	7.82	25.28	711	5,560.02	17,974.08	-
301531	春光集团	2026 年 04 月 28 日	1-6 个月(含)	新股限售	13.30	66.90	216	2,872.80	14,450.40	-

		日								
301669	高特电子	2026年06月02日	1-6个月(含)	新股限售	7.08	37.52	358	2,534.64	13,432.16	-
301696	三瑞智能	2026年03月31日	1-6个月(含)	新股限售	24.68	104.80	110	2,714.80	11,528.00	-
301687	新广益	2025年12月24日	1-6个月(含)	新股限售	21.93	77.78	142	3,114.06	11,044.76	-
301599	理奇智能	2026年04月22日	1-6个月(含)	新股限售	13.91	40.66	228	3,171.48	9,270.48	-
301513	尚水智能	2026年04月10日	1-6个月(含)	新股限售	26.66	63.44	117	3,119.22	7,422.48	-
001365	天海电子	2026年05月11日	1-6个月(含)	新股限售	27.19	36.79	193	5,247.67	7,100.47	-
001393	维通利	2026年05月08日	1-6个月(含)	新股限售	30.38	48.48	137	4,162.06	6,641.76	-
301680	固德电材	2026年02月27日	1-6个月(含)	新股限售	58.00	112.13	58	3,364.00	6,503.54	-
001237	惠康科技	2026年05月15日	1-6个月(含)	新股限售	53.26	65.85	78	4,154.28	5,136.30	-
301683	慧谷新材	2026年03月24日	1-6个月(含)	新股限售	78.38	129.27	39	3,056.82	5,041.53	-
001220	世盟股份	2026年01月27日	1-6个月(含)	新股限售	28.00	27.77	48	1,344.00	1,332.96	-

		日								
001312	福恩股份	2026 年 04 月 14 日	1-6 个月(含)	新股限售	18.38	18.20	64	1,176.32	1,164.80	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场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

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

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，采用完全复制指数策略。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净资产的比例为 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净资产的 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净资产的 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 2026 年 06 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							
货币资金	10,681,309.48	-	-	-	-	-	10,681,309.48
结算备付金	5,430.67	-	-	-	-	-	5,430.67
存出保证金	16,079.90	-	-	-	-	-	16,079.90
交易性金融资产	-	-	-	-	-	149,810,691.16	149,810,691.16
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	6,097.27	6,097.27
应收利息	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	722,628.17	722,628.17
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	10,702,820.05	-	-	-	-	150,539,416.60	161,242,236.65
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算	-	-	-	-	-	-	-

款							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,294,966.42	1,294,966.42
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	128,032.53	128,032.53
应付托管费	-	-	-	-	-	25,606.51	25,606.51
应付销售服务费	-	-	-	-	-	3,893.94	3,893.94
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	175,312.32	175,312.32
负债总计	-	-	-	-	-	1,627,811.72	1,627,811.72
利率敏感度缺口	10,702,820.05	-	-	-	-	148,911,604.88	159,614,424.93
上年度末 2025 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							
货币资金	11,770,217.32	-	-	-	-	-	11,770,217.32
结算备付金	33,161.13	-	-	-	-	-	33,161.13
存出保证金	11,794.64	-	-	-	-	-	11,794.64
交易性金融资产	-	-	-	-	-	164,321,780.42	164,321,780.42
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	338,835.61	338,835.61
应收利息	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-

应收申购款	-	-	-	-	-	354,721.73	354,721.73
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	11,815,173.09	-	-	-	-	165,015,337.76	176,830,510.85
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,376,036.84	1,376,036.84
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	149,479.21	149,479.21
应付托管费	-	-	-	-	-	29,895.85	29,895.85
应付销售服务费	-	-	-	-	-	4,068.46	4,068.46
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	271,286.13	271,286.13
负债总计	-	-	-	-	-	1,830,766.49	1,830,766.49
利率敏感度缺口	11,815,173.09	-	-	-	-	163,184,571.27	174,999,744.36

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净资产的比例为 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，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 2026 年 06 月 30 日		上年度末 2025 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	149,810,691.16	93.86	164,321,780.42	93.90
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	149,810,691.16	93.86	164,321,780.42	93.90

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准（见附注 6.4.1）中的股票指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	基准上升 5%	8,250,000.00	8,610,000.00
	基准下降 5%	-8,250,000.00	-8,610,000.00

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 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	149,513,536.86	163,666,143.58
第二层次	-	541,661.13
第三层次	297,154.30	113,975.71
合计	149,810,691.16	164,321,780.42

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。对于本基金投资的证券交易所上市的证券，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时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑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，确定相关证券公允价值的层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2026 年 06 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具（2025 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以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，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 2026 年 06 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	149,810,691.16	92.91
	其中：股票	149,810,691.16	92.91
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	10,686,740.15	6.63
8	其他各项资产	744,805.34	0.46
9	合计	161,242,236.65	100.00

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（指数投资）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	1,483,915.68	0.93
B	采矿业	1,532,861.34	0.96
C	制造业	124,592,016.70	78.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,267,742.40	0.79
E	建筑业	206,155.00	0.13
F	批发和零售业	1,507,387.00	0.94
G	交通运输、仓储和邮政业	1,265,242.80	0.79
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,557,762.52	4.11
J	金融业	7,405,018.39	4.64
K	房地产业	490,774.17	0.31
L	租赁和商务服务业	1,201,685.57	0.75
M	科学研究和技术服务业	767,255.75	0.48
N	水利、环境和公共设施管理业	162,595.95	0.10
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	77,580.00	0.05
Q	卫生和社会工作	430,094.10	0.27
R	文化、体育和娱乐业	503,139.64	0.32
S	综合	—	—
	合计	149,451,227.01	93.63

7.2.2 报告期末（积极投资）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	17,974.08	0.01
C	制造业	340,157.11	0.21
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	1,332.96	0.00
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
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	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	359,464.15	0.23

7.2.3 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。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

7.3.1 期末指数投资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	300308	中际旭创	6,793	8,627,110.00	5.40
2	300750	宁德时代	20,411	8,021,727.11	5.03
3	300502	新易盛	9,764	5,926,748.00	3.71
4	000333	美的集团	37,802	2,855,185.06	1.79
5	002371	北方华创	3,170	2,804,055.20	1.76
6	002384	东山精密	9,864	2,587,820.40	1.62
7	002475	立讯精密	36,567	2,574,316.80	1.61
8	000725	京东方 A	254,471	2,208,808.28	1.38
9	300059	东方财富	100,233	2,042,748.54	1.28
10	300274	阳光电源	11,351	1,805,036.02	1.13

11	300476	胜宏科技	4,738	1,641,385.34	1.03
12	300408	三环集团	9,772	1,630,946.80	1.02
13	002463	沪电股份	10,580	1,616,624.00	1.01
14	002594	比亚迪	19,776	1,576,147.20	0.99
15	300394	天孚通信	4,840	1,464,971.20	0.92
16	301308	江波龙	1,800	1,266,840.00	0.79
17	000651	格力电器	33,372	1,251,450.00	0.78
18	300604	长川科技	3,500	1,194,970.00	0.75
19	000988	华工科技	6,449	1,190,549.89	0.75
20	001309	德明利	1,200	1,131,480.00	0.71
21	000338	潍柴动力	39,342	1,072,069.50	0.67
22	000858	五粮液	14,154	1,047,396.00	0.66
23	300124	汇川技术	15,709	1,041,977.97	0.65
24	002415	海康威视	28,791	984,652.20	0.62
25	002281	光迅科技	3,783	972,004.02	0.61
26	002008	大族激光	6,244	937,286.84	0.59
27	002916	深南电路	1,960	897,484.00	0.56
28	000063	中兴通讯	24,762	896,136.78	0.56
29	000100	TCL 科技	149,485	870,002.70	0.55
30	300857	协创数据	2,480	842,952.00	0.53
31	300433	蓝思科技	15,141	812,466.06	0.51
32	002142	宁波银行	26,585	789,308.65	0.49
33	300475	香农芯创	2,600	780,000.00	0.49
34	000792	盐湖股份	25,800	778,902.00	0.49
35	002028	思源电气	4,485	775,905.00	0.49
36	300136	信维通信	6,256	746,028.00	0.47
37	002050	三花智控	16,692	731,610.36	0.46
38	300014	亿纬锂能	11,190	727,685.70	0.46
39	002353	杰瑞股份	4,662	710,955.00	0.45
40	300223	北京君正	2,803	697,666.70	0.44
41	002156	通富微电	9,100	690,417.00	0.43
42	000657	中钨高新	7,200	689,184.00	0.43
43	300285	国瓷材料	6,550	675,829.00	0.42
44	002714	牧原股份	19,278	674,537.22	0.42
45	000001	平安银行	65,767	660,958.35	0.41
46	300760	迈瑞医疗	4,757	646,143.31	0.40
47	002602	世纪华通	44,700	630,270.00	0.39
48	002230	科大讯飞	15,063	615,172.92	0.39
49	002436	兴森科技	11,700	596,115.00	0.37
50	300666	江丰电子	1,600	589,760.00	0.37
51	002352	顺丰控股	18,600	581,436.00	0.36
52	300054	鼎龙股份	5,400	572,238.00	0.36
53	002460	赣锋锂业	8,684	567,933.60	0.36

54	000977	浪潮信息	7,939	555,730.00	0.35
55	002709	天赐材料	10,804	555,649.72	0.35
56	000776	广发证券	23,530	550,602.00	0.34
57	300033	同花顺	2,262	545,142.00	0.34
58	002938	鹏鼎控股	5,100	537,438.00	0.34
59	002851	麦格米特	3,200	534,976.00	0.34
60	300498	温氏股份	43,314	533,628.48	0.33
61	000425	徐工机械	65,670	531,270.30	0.33
62	000021	深科技	8,242	529,713.34	0.33
63	002428	云南锗业	4,200	504,756.00	0.32
64	300548	长芯博创	1,800	500,400.00	0.31
65	300757	罗博特科	800	495,200.00	0.31
66	002466	天齐锂业	8,000	490,560.00	0.31
67	002080	中材科技	5,376	483,840.00	0.30
68	000938	紫光股份	16,639	480,201.54	0.30
69	002202	金风科技	20,080	479,912.00	0.30
70	000636	风华高科	6,600	476,784.00	0.30
71	300567	精测电子	1,500	476,400.00	0.30
72	002409	雅克科技	2,108	473,246.00	0.30
73	300661	圣邦股份	3,271	469,323.08	0.29
74	002837	英维克	5,752	457,629.12	0.29
75	002185	华天科技	20,450	456,239.50	0.29
76	002049	紫光国微	5,073	450,228.75	0.28
77	000568	泸州老窖	5,805	450,003.60	0.28
78	300442	润泽科技	5,400	448,578.00	0.28
79	002241	歌尔股份	19,672	443,210.16	0.28
80	300395	菲利华	3,300	441,309.00	0.28
81	002484	江海股份	4,200	441,000.00	0.28
82	002600	领益智造	24,720	428,644.80	0.27
83	300346	南大光电	4,492	416,183.80	0.26
84	002179	中航光电	8,909	411,595.80	0.26
85	300390	天华新能	4,400	411,444.00	0.26
86	301526	国际复材	8,700	406,029.00	0.25
87	002407	多氟多	8,040	403,849.20	0.25
88	002138	顺络电子	5,363	392,035.30	0.25
89	000408	藏格矿业	5,600	388,192.00	0.24
90	300058	蓝色光标	28,045	385,899.20	0.24
91	002625	光启技术	12,536	380,091.52	0.24
92	002027	分众传媒	78,471	379,799.64	0.24
93	300620	光库科技	1,000	378,200.00	0.24
94	000630	铜陵有色	58,850	374,286.00	0.23
95	000807	云铝股份	16,237	359,487.18	0.23
96	300672	国科微	1,200	354,000.00	0.22

97	002273	水晶光电	9,976	353,948.48	0.22
98	300450	先导智能	8,582	349,459.04	0.22
99	300751	迈为股份	1,235	348,838.10	0.22
100	300037	新宙邦	3,740	347,259.00	0.22
101	300373	扬杰科技	2,200	345,906.00	0.22
102	000426	兴业银锡	10,400	342,784.00	0.21
103	002001	新和成	11,961	339,931.62	0.21
104	002422	科伦药业	8,824	339,900.48	0.21
105	301511	德福科技	2,300	330,855.00	0.21
106	300570	太辰光	1,300	320,723.00	0.20
107	000960	锡业股份	7,447	317,912.43	0.20
108	002648	卫星化学	13,452	315,987.48	0.20
109	002812	恩捷股份	4,560	305,109.60	0.19
110	002126	银轮股份	6,000	298,800.00	0.19
111	301217	铜冠铜箔	1,800	297,126.00	0.19
112	000066	中国长城	15,558	296,379.90	0.19
113	000831	中国稀土	5,315	294,929.35	0.18
114	300782	卓胜微	2,671	292,688.18	0.18
115	002738	中矿资源	4,940	291,410.60	0.18
116	300316	晶盛机电	4,790	289,316.00	0.18
117	300015	爱尔眼科	34,777	287,258.02	0.18
118	000166	申万宏源	65,061	286,268.40	0.18
119	002222	福晶科技	3,100	286,068.00	0.18
120	001389	广合科技	1,200	284,700.00	0.18
121	002850	科达利	1,500	283,950.00	0.18
122	300418	昆仑万维	6,836	275,900.96	0.17
123	301377	鼎泰高科	500	275,450.00	0.17
124	002129	TCL 中环	22,845	274,596.90	0.17
125	000538	云南白药	5,792	274,367.04	0.17
126	300803	指南针	2,940	269,509.80	0.17
127	000625	长安汽车	37,211	266,802.87	0.17
128	002195	岩山科技	40,792	266,779.68	0.17
129	002311	海大集团	5,959	265,830.99	0.17
130	301358	湖南裕能	3,500	265,545.00	0.17
131	000157	中联重科	37,980	264,720.60	0.17
132	002821	凯莱英	1,600	259,200.00	0.16
133	000933	神火股份	12,200	258,640.00	0.16
134	300776	帝尔激光	1,180	253,652.80	0.16
135	002532	天山铝业	23,600	253,228.00	0.16
136	002558	巨人网络	9,166	252,614.96	0.16
137	002340	格林美	37,477	247,722.97	0.16
138	002203	海亮股份	10,800	246,780.00	0.15
139	002240	盛新锂能	5,500	246,565.00	0.15

140	002236	大华股份	14,711	242,584.39	0.15
141	002074	国轩高科	8,496	233,724.96	0.15
142	002261	拓维信息	8,300	232,483.00	0.15
143	300438	鹏辉能源	2,800	231,980.00	0.15
144	000783	长江证券	23,679	230,870.25	0.14
145	002456	欧菲光	24,404	230,861.84	0.14
146	300339	润和软件	5,900	227,209.00	0.14
147	000975	山金国际	13,166	223,822.00	0.14
148	300236	上海新阳	1,700	223,550.00	0.14
149	002517	恺英网络	13,700	222,625.00	0.14
150	300759	康龙化成	7,675	222,037.75	0.14
151	300017	网宿科技	17,045	221,755.45	0.14
152	003031	中瓷电子	1,220	219,966.00	0.14
153	002493	荣盛石化	20,313	218,364.75	0.14
154	300458	全志科技	5,527	218,095.42	0.14
155	301611	珂玛科技	1,200	216,084.00	0.14
156	002472	双环传动	5,200	215,852.00	0.14
157	002736	国信证券	21,515	214,934.85	0.13
158	002131	利欧股份	44,933	213,431.75	0.13
159	002555	三七互娱	11,275	212,759.25	0.13
160	300001	特锐德	5,618	212,528.94	0.13
161	003816	中国广核	54,300	212,313.00	0.13
162	002595	豪迈科技	4,524	210,818.40	0.13
163	002245	蔚蓝锂芯	11,176	209,102.96	0.13
164	002966	苏州银行	29,910	208,173.60	0.13
165	300870	欧陆通	600	207,414.00	0.13
166	000768	中航西飞	10,117	207,196.16	0.13
167	301236	软通动力	4,850	205,882.50	0.13
168	300115	长盈精密	7,343	205,163.42	0.13
169	002601	龙佰集团	12,200	201,056.00	0.13
170	300207	欣旺达	10,542	200,192.58	0.13
171	002056	横店东磁	6,563	200,040.24	0.13
172	002797	第一创业	30,179	198,276.03	0.12
173	000547	航天发展	10,245	196,191.75	0.12
174	300088	长信科技	16,864	195,622.40	0.12
175	300347	泰格医药	4,061	194,928.00	0.12
176	002155	湖南黄金	8,158	194,731.46	0.12
177	000301	东方盛虹	17,000	194,650.00	0.12
178	300456	赛微电子	4,500	191,115.00	0.12
179	301269	华大九天	1,600	191,072.00	0.12
180	000060	中金岭南	25,060	189,704.20	0.12
181	000703	恒逸石化	13,846	187,890.22	0.12
182	002920	德赛西威	2,300	187,450.00	0.12

183	002465	海格通信	14,595	186,378.15	0.12
184	000895	双汇发展	8,283	185,539.20	0.12
185	300866	安克创新	1,760	183,920.00	0.12
186	300454	深信服	1,900	182,780.00	0.11
187	300024	机器人	9,423	182,146.59	0.11
188	301200	大族数控	500	180,325.00	0.11
189	301536	星宸科技	1,400	180,194.00	0.11
190	000893	亚钾国际	4,400	179,916.00	0.11
191	002487	大金重工	3,100	179,707.00	0.11
192	002128	电投能源	7,674	177,422.88	0.11
193	000034	神州数码	6,380	177,045.00	0.11
194	002304	洋河股份	4,638	176,939.70	0.11
195	002432	九安医疗	2,500	176,700.00	0.11
196	300568	星源材质	9,430	176,529.60	0.11
197	000733	振华科技	3,100	175,584.00	0.11
198	300623	捷捷微电	3,900	175,461.00	0.11
199	002429	兆驰股份	16,839	174,957.21	0.11
200	002414	高德红外	13,064	173,228.64	0.11
201	002335	科华数据	4,050	171,922.50	0.11
202	002271	东方雨虹	14,480	171,877.60	0.11
203	300811	铂科新材	1,800	170,802.00	0.11
204	000878	云南铜业	10,720	170,233.60	0.11
205	001979	招商蛇口	26,299	169,102.57	0.11
206	002444	巨星科技	5,426	168,748.60	0.11
207	301205	联特科技	500	167,050.00	0.10
208	000963	华东医药	5,926	166,639.12	0.10
209	300496	中科创达	2,687	166,029.73	0.10
210	001267	汇绿生态	3,100	165,850.00	0.10
211	002025	航天电器	2,162	164,787.64	0.10
212	300432	富临精工	8,160	163,934.40	0.10
213	002157	正邦科技	58,300	163,823.00	0.10
214	300748	金力永磁	5,288	163,134.80	0.10
215	002497	雅化集团	8,000	162,960.00	0.10
216	300142	沃森生物	12,538	162,868.62	0.10
217	002402	和而泰	6,300	162,729.00	0.10
218	002252	上海莱士	37,103	161,027.02	0.10
219	300474	景嘉微	2,657	160,695.36	0.10
220	000423	东阿阿胶	3,466	157,217.76	0.10
221	002756	永兴材料	2,760	156,326.40	0.10
222	300763	锦浪科技	1,720	155,402.00	0.10
223	000728	国元证券	20,674	154,848.26	0.10
224	000002	万科 A	52,173	154,432.08	0.10
225	002078	太阳纸业	12,355	154,313.95	0.10

226	000661	长春高新	2,314	154,112.40	0.10
227	301626	苏州天脉	400	153,584.00	0.10
228	002130	沃尔核材	8,000	151,680.00	0.10
229	300012	华测检测	10,900	151,074.00	0.09
230	300073	当升科技	3,143	150,989.72	0.09
231	002747	埃斯顿	4,000	149,320.00	0.09
232	300724	捷佳伟创	2,100	148,260.00	0.09
233	002653	海思科	2,200	145,948.00	0.09
234	300919	中伟新材	3,280	143,500.00	0.09
235	002617	露笑科技	13,800	142,002.00	0.09
236	002831	裕同科技	3,974	141,315.44	0.09
237	000519	中兵红箭	6,600	139,062.00	0.09
238	300383	光环新网	11,169	138,942.36	0.09
239	002378	章源钨业	4,100	137,268.00	0.09
240	000786	北新建材	7,585	137,212.65	0.09
241	300953	震裕科技	1,020	136,374.00	0.09
242	000617	中油资本	20,338	134,027.42	0.08
243	300747	锐科激光	2,510	133,255.90	0.08
244	001965	招商公路	14,500	132,820.00	0.08
245	000969	安泰科技	5,400	132,516.00	0.08
246	002624	完美世界	10,643	132,186.06	0.08
247	002716	湖南白银	16,200	131,058.00	0.08
248	300677	英科医疗	3,320	130,044.40	0.08
249	302132	中航成飞	2,200	128,304.00	0.08
250	300558	贝达药业	1,954	127,146.78	0.08
251	002064	华峰化学	13,300	126,217.00	0.08
252	300679	电连技术	2,100	125,979.00	0.08
253	000559	万向钱潮	9,701	125,433.93	0.08
254	300628	亿联网络	3,700	125,134.00	0.08
255	000623	吉林敖东	6,984	123,826.32	0.08
256	002673	西部证券	19,074	123,790.26	0.08
257	002044	美年健康	24,336	122,410.08	0.08
258	300102	乾照光电	4,700	122,388.00	0.08
259	000766	通化金马	6,300	122,220.00	0.08
260	002180	奔图科技	7,470	122,209.20	0.08
261	300972	万辰集团	700	121,387.00	0.08
262	300487	蓝晓科技	2,050	120,642.50	0.08
263	300251	光线传媒	10,862	120,459.58	0.08
264	002065	东华软件	16,856	120,351.84	0.08
265	000958	电投产融	21,300	120,132.00	0.08
266	001203	大中矿业	4,000	119,800.00	0.08
267	300255	常山药业	5,100	119,442.00	0.07
268	300699	光威复材	4,164	119,298.60	0.07

269	000750	国海证券	32,379	119,154.72	0.07
270	002294	信立泰	3,725	118,790.25	0.07
271	002223	鱼跃医疗	4,609	118,266.94	0.07
272	300832	新产业	2,800	117,600.00	0.07
273	000032	深桑达 A	4,700	117,265.00	0.07
274	000683	博源化工	20,300	116,928.00	0.07
275	001696	宗申动力	5,600	116,536.00	0.07
276	000415	渤海租赁	28,500	115,995.00	0.07
277	000039	中集集团	14,287	115,867.57	0.07
278	301171	易点天下	3,400	115,464.00	0.07
279	002085	万丰奥威	10,400	115,336.00	0.07
280	002739	儒意电影	12,000	115,200.00	0.07
281	002318	久立特材	4,800	114,720.00	0.07
282	002176	江特电机	11,400	114,114.00	0.07
283	002459	晶澳科技	14,020	113,562.00	0.07
284	002506	协鑫集成	35,700	113,526.00	0.07
285	000887	中鼎股份	6,340	113,422.60	0.07
286	000983	山西焦煤	19,517	113,198.60	0.07
287	000970	中科三环	7,405	112,481.95	0.07
288	300002	神州泰岳	14,400	112,464.00	0.07
289	300627	华测导航	3,960	112,464.00	0.07
290	000629	钒钛股份	33,400	111,556.00	0.07
291	002405	四维图新	17,156	110,999.32	0.07
292	002015	协鑫能科	6,800	110,976.00	0.07
293	301550	斯菱智驱	1,200	109,716.00	0.07
294	300003	乐普医疗	9,256	109,683.60	0.07
295	000999	华润三九	4,873	109,593.77	0.07
296	000050	深天马 A	11,056	109,564.96	0.07
297	000688	国城矿业	3,200	109,536.00	0.07
298	000400	许继电气	5,042	109,411.40	0.07
299	300364	中文在线	4,600	108,514.00	0.07
300	000155	川能动力	9,000	107,820.00	0.07
301	000967	盈峰环境	10,200	107,406.00	0.07
302	002266	浙富控股	21,089	106,710.34	0.07
303	301095	广立微	900	106,245.00	0.07
304	002151	北斗星通	3,266	103,695.50	0.06
305	000876	新希望	16,492	103,404.84	0.06
306	300122	智飞生物	8,798	102,848.62	0.06
307	300999	金龙鱼	4,414	102,669.64	0.06
308	002683	广东宏大	3,500	102,515.00	0.06
309	002518	科士达	1,900	101,821.00	0.06
310	002841	视源股份	2,922	100,896.66	0.06
311	000737	北方铜业	7,500	99,150.00	0.06

312	002430	杭氧股份	3,200	99,072.00	0.06
313	000875	电投绿能	19,000	97,850.00	0.06
314	002249	大洋电机	13,041	97,807.50	0.06
315	300296	利亚德	17,183	96,224.80	0.06
316	002007	华兰生物	7,869	95,923.11	0.06
317	000738	航发控制	5,237	95,784.73	0.06
318	002145	钛能化学	20,290	95,565.90	0.06
319	000591	太阳能	20,554	94,548.40	0.06
320	002152	广电运通	10,036	94,137.68	0.06
321	002237	恒邦股份	6,388	93,839.72	0.06
322	000729	燕京啤酒	9,258	93,783.54	0.06
323	000830	鲁西化工	7,800	93,600.00	0.06
324	002926	华西证券	11,400	93,138.00	0.06
325	300773	拉卡拉	6,087	93,131.10	0.06
326	300253	卫宁健康	13,777	92,719.21	0.06
327	300896	爱美客	1,060	92,432.00	0.06
328	000997	新大陆	5,667	92,372.10	0.06
329	000528	柳工	12,180	91,959.00	0.06
330	002603	以岭药业	6,085	91,275.00	0.06
331	002958	青农商行	33,300	91,242.00	0.06
332	000686	东北证券	10,800	90,720.00	0.06
333	002389	航天彩虹	5,000	88,850.00	0.06
334	301165	锐捷网络	1,104	88,816.80	0.06
335	000951	中国重汽	4,520	88,185.20	0.06
336	000932	华菱钢铁	25,399	88,134.53	0.06
337	000596	古井贡酒	1,100	87,780.00	0.05
338	300459	汤姆猫	25,849	87,628.11	0.05
339	002410	广联达	10,648	86,887.68	0.05
340	001280	中国铀业	1,300	86,710.00	0.05
341	300182	捷成股份	18,237	86,625.75	0.05
342	002939	长城证券	10,200	85,068.00	0.05
343	300726	宏达电子	1,000	84,570.00	0.05
344	001287	中电港	2,700	84,105.00	0.05
345	002048	宁波华翔	3,628	83,444.00	0.05
346	000987	越秀资本	10,656	83,329.92	0.05
347	000708	中信特钢	6,571	82,926.02	0.05
348	000422	湖北宜化	5,900	82,895.00	0.05
349	000921	海信家电	3,000	81,960.00	0.05
350	000973	佛塑科技	5,700	81,795.00	0.05
351	000582	北部湾港	7,600	81,548.00	0.05
352	000062	深圳华强	2,534	80,631.88	0.05
353	300573	兴齐眼药	1,974	80,460.24	0.05
354	000009	中国宝安	12,830	79,930.90	0.05

355	002262	恩华药业	4,248	79,650.00	0.05
356	301297	富乐德	1,300	79,612.00	0.05
357	000682	东方电子	6,300	79,569.00	0.05
358	301029	怡合达	2,944	79,517.44	0.05
359	000799	酒鬼酒	1,800	78,660.00	0.05
360	300765	石药创新	2,880	78,422.40	0.05
361	002139	拓邦股份	8,200	78,064.00	0.05
362	002607	中公教育	43,100	77,580.00	0.05
363	301219	腾远钴业	1,413	77,432.40	0.05
364	300779	惠城环保	1,540	77,308.00	0.05
365	002270	华明装备	4,100	77,285.00	0.05
366	002312	川发龙蟒	8,400	77,028.00	0.05
367	002500	山西证券	14,833	76,538.28	0.05
368	000513	丽珠集团	2,646	76,442.94	0.05
369	002895	川恒股份	2,600	75,920.00	0.05
370	300229	拓尔思	5,400	74,628.00	0.05
371	002948	青岛银行	14,690	74,625.20	0.05
372	002385	大北农	27,019	74,572.44	0.05
373	000723	美锦能源	22,200	74,370.00	0.05
374	300676	华大基因	2,100	73,626.00	0.05
375	300777	中简科技	2,800	73,584.00	0.05
376	002244	滨江集团	9,654	73,370.40	0.05
377	000739	普洛药业	4,400	73,304.00	0.05
378	003022	联泓新科	2,800	72,520.00	0.05
379	300144	宋城演艺	12,451	72,340.31	0.05
380	300468	四方精创	3,400	71,434.00	0.04
381	300413	芒果超媒	4,850	70,955.50	0.04
382	301316	慧博云通	1,800	70,884.00	0.04
383	300735	光弘科技	3,100	70,494.00	0.04
384	002299	圣农发展	4,649	70,478.84	0.04
385	000778	新兴铸管	18,763	69,610.73	0.04
386	300009	安科生物	8,797	69,056.45	0.04
387	300146	汤臣倍健	7,601	68,713.04	0.04
388	002439	启明星辰	5,384	68,107.60	0.04
389	002583	海能达	8,800	67,672.00	0.04
390	002568	百润股份	3,972	67,206.24	0.04
391	002468	申通快递	4,607	67,077.92	0.04
392	002545	东方铁塔	4,100	66,502.00	0.04
393	300775	三角防务	3,000	66,120.00	0.04
394	000598	兴蓉环境	10,252	65,817.84	0.04
395	000998	隆平高科	8,707	65,650.78	0.04
396	300674	宇信科技	4,299	64,699.95	0.04
397	000563	陕国投 A	23,296	64,296.96	0.04

398	300638	广和通	3,466	64,155.66	0.04
399	002507	涪陵榨菜	5,940	64,152.00	0.04
400	002120	韵达股份	10,053	63,937.08	0.04
401	300100	双林股份	2,300	63,894.00	0.04
402	002544	普天科技	3,500	63,770.00	0.04
403	000581	威孚高科	3,718	63,280.36	0.04
404	300457	赢合科技	3,000	63,240.00	0.04
405	300034	钢研高纳	3,680	63,075.20	0.04
406	301275	汉朔科技	1,400	62,860.00	0.04
407	000628	高新发展	1,300	61,620.00	0.04
408	003021	兆威机电	700	61,145.00	0.04
409	300718	长盛轴承	1,000	60,970.00	0.04
410	002531	天顺风能	7,140	60,190.20	0.04
411	000027	深圳能源	9,578	59,383.60	0.04
412	000935	四川双马	2,275	59,354.75	0.04
413	000543	皖能电力	7,700	58,289.00	0.04
414	002701	奥瑞金	13,658	58,183.08	0.04
415	002984	森麒麟	4,440	58,030.80	0.04
416	002373	千方科技	8,077	57,992.86	0.04
417	002698	博实股份	4,800	57,936.00	0.04
418	000883	湖北能源	13,408	57,922.56	0.04
419	000825	太钢不锈	16,900	57,629.00	0.04
420	000709	河钢股份	29,377	56,991.38	0.04
421	002423	中粮资本	6,900	56,787.00	0.04
422	300601	康泰生物	5,000	56,700.00	0.04
423	300070	碧水源	17,519	55,885.61	0.04
424	001286	陕西能源	5,500	55,770.00	0.03
425	000099	中信海直	3,800	55,328.00	0.03
426	002268	电科网安	4,279	55,199.10	0.03
427	000429	粤高速 A	4,000	54,600.00	0.03
428	000088	盐田港	13,300	54,397.00	0.03
429	000801	四川九洲	4,200	54,348.00	0.03
430	300682	朗新科技	5,400	53,460.00	0.03
431	002091	江苏国泰	7,300	52,779.00	0.03
432	002508	老板电器	3,591	52,500.42	0.03
433	002019	亿帆医药	5,565	52,032.75	0.03
434	002773	康弘药业	2,539	51,922.55	0.03
435	000800	一汽解放	8,697	51,747.15	0.03
436	300529	健帆生物	3,338	51,405.20	0.03
437	002670	国盛证券	4,653	51,183.00	0.03
438	000902	新洋丰	4,403	50,898.68	0.03
439	000555	神州信息	4,787	49,306.10	0.03
440	002925	盈趣科技	1,980	48,826.80	0.03

441	301606	绿联科技	800	48,816.00	0.03
442	300357	我武生物	2,090	48,738.80	0.03
443	000029	深深房 A	2,200	48,510.00	0.03
444	300660	江苏雷利	1,720	47,919.20	0.03
445	300957	贝泰妮	1,500	47,265.00	0.03
446	000791	甘肃能源	6,200	47,120.00	0.03
447	002408	齐翔腾达	10,000	46,900.00	0.03
448	001391	国货航	11,500	46,805.00	0.03
449	002368	太极股份	3,308	46,278.92	0.03
450	300761	立华股份	2,820	46,276.20	0.03
451	301345	涛涛车业	200	46,200.00	0.03
452	003035	南网能源	7,900	45,978.00	0.03
453	000069	华侨城 A	27,658	45,359.12	0.03
454	000156	华数传媒	7,181	45,312.11	0.03
455	000539	粤电力 A	6,600	44,946.00	0.03
456	002906	华阳集团	1,800	44,928.00	0.03
457	002153	石基信息	6,205	44,862.15	0.03
458	002416	爱施德	5,000	44,800.00	0.03
459	301589	诺瓦星云	300	44,694.00	0.03
460	300979	华利集团	1,500	44,625.00	0.03
461	000966	长源电力	11,000	43,120.00	0.03
462	000089	深圳机场	7,071	42,638.13	0.03
463	300910	瑞丰新材	1,490	41,779.60	0.03
464	002032	苏泊尔	1,050	41,580.00	0.03
465	301238	瑞泰新材	1,700	41,480.00	0.03
466	301039	中集车辆	5,800	40,890.00	0.03
467	002010	传化智联	9,134	40,828.98	0.03
468	301301	川宁生物	5,000	39,700.00	0.02
469	000877	天山股份	10,860	39,421.80	0.02
470	002372	伟星新材	4,806	39,361.14	0.02
471	300888	稳健医疗	1,380	38,626.20	0.02
472	300428	立中集团	2,100	38,178.00	0.02
473	000537	绿发电力	5,100	37,281.00	0.02
474	002608	江苏国信	5,400	37,260.00	0.02
475	002847	盐津铺子	800	35,680.00	0.02
476	000959	首钢股份	10,150	35,626.50	0.02
477	002690	美亚光电	2,428	34,793.24	0.02
478	000927	中国铁物	15,300	34,731.00	0.02
479	000937	冀中能源	8,580	34,148.40	0.02
480	001872	招商港口	1,700	33,031.00	0.02
481	002096	易普力	3,700	32,486.00	0.02
482	002755	奥赛康	2,300	31,326.00	0.02
483	002265	建设工业	1,800	31,320.00	0.02

484	000898	鞍钢股份	16,586	31,015.82	0.02
485	000785	居然智家	15,500	31,000.00	0.02
486	002320	海峡股份	4,921	30,854.67	0.02
487	301155	海力风电	700	30,030.00	0.02
488	002945	华林证券	2,200	29,546.00	0.02
489	002563	森马服饰	5,686	28,657.44	0.02
490	301498	乖宝宠物	700	28,413.00	0.02
491	002978	安宁股份	1,100	28,193.00	0.02
492	301656	联合动力	1,600	27,568.00	0.02
493	002060	广东建工	9,000	27,270.00	0.02
494	002901	大博医疗	600	25,068.00	0.02
495	002461	珠江啤酒	2,800	21,196.00	0.01
496	001213	中铁特货	6,200	20,770.00	0.01
497	301267	华夏眼科	1,400	20,426.00	0.01
498	001289	龙源电力	1,100	17,193.00	0.01
499	001221	悍高集团	300	12,066.00	0.01
500	001386	马可波罗	800	11,328.00	0.01

7.3.2 期末积极投资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	301666	大普微	262	149,861.38	0.09
2	301680	固德电材	573	68,813.39	0.04
3	001399	惠科股份	830	29,249.20	0.02
4	001257	盛龙股份	711	17,974.08	0.01
5	301531	春光集团	216	14,450.40	0.01
6	301669	高特电子	358	13,432.16	0.01
7	301696	三瑞智能	110	11,528.00	0.01
8	301687	新广益	142	11,044.76	0.01
9	301599	理奇智能	228	9,270.48	0.01
10	301513	尚水智能	117	7,422.48	0.00
11	001365	天海电子	193	7,100.47	0.00
12	001393	维通利	137	6,641.76	0.00
13	001237	惠康科技	78	5,136.30	0.00
14	301683	慧谷新材	39	5,041.53	0.00
15	001220	世盟股份	48	1,332.96	0.00
16	001312	福恩股份	64	1,164.80	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	769,142.00	0.44
2	002602	世纪华通	689,946.00	0.39
3	300394	天孚通信	446,910.20	0.26
4	002428	云南锗业	393,929.00	0.23
5	300502	新易盛	368,017.00	0.21
6	300308	中际旭创	354,244.00	0.20
7	301511	德福科技	338,616.00	0.19
8	300620	光库科技	294,881.00	0.17
9	301308	江波龙	272,711.00	0.16
10	301217	铜冠铜箔	266,671.00	0.15
11	002371	北方华创	242,302.00	0.14
12	000333	美的集团	238,056.00	0.14
13	300059	东方财富	200,807.00	0.11
14	002594	比亚迪	190,169.00	0.11
15	002475	立讯精密	176,231.00	0.10
16	300236	上海新阳	174,393.00	0.10
17	300811	铂科新材	170,809.00	0.10
18	300870	欧陆通	163,565.00	0.09
19	301205	联特科技	160,020.00	0.09
20	001267	汇绿生态	159,786.00	0.09

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 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	300750	宁德时代	3,520,769.00	2.01
2	300308	中际旭创	2,451,018.00	1.40
3	300502	新易盛	1,837,117.00	1.05
4	000333	美的集团	1,325,816.00	0.76
5	002475	立讯精密	1,034,336.00	0.59
6	300059	东方财富	944,317.00	0.54
7	300394	天孚通信	926,450.00	0.53
8	002594	比亚迪	879,325.00	0.50
9	300274	阳光电源	819,679.00	0.47
10	002384	东山精密	762,722.00	0.44
11	002371	北方华创	729,803.00	0.42
12	300476	胜宏科技	703,778.00	0.40
13	000858	五粮液	586,910.00	0.34
14	000651	格力电器	585,604.00	0.33

15	000725	京东方 A	577,723.00	0.33
16	000338	潍柴动力	531,371.00	0.30
17	300124	汇川技术	491,064.00	0.28
18	002463	沪电股份	471,459.00	0.27
19	000063	中兴通讯	419,533.00	0.24
20	002415	海康威视	411,299.00	0.24

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 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

买入股票成本（成交）总额	17,562,498.52
卖出股票收入（成交）总额	62,376,133.30

注：买入股票成本总额、卖出股票收入总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

本基金本报告期内未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

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受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内收到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同约定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库。

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	16,079.90
2	应收清算款	6,097.27
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	722,628.17
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	744,805.34

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

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	301666	大普微	149,861.38	0.09	新股限售
2	001399	惠科股份	29,249.20	0.02	新股限售
3	001257	盛龙股份	17,974.08	0.01	新股限售
4	301531	春光集团	14,450.40	0.01	新股限售
5	301680	固德电材	6,503.54	0.00	新股限售

7.12.6 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。

§ 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
申万菱信深证成份指数 A	16,051	9,970.80	7,275,106.66	4.55%	152,766,228.26	95.45%
申万菱信深证成份指数 C	4,226	4,722.93	15,518.15	0.08%	19,943,576.32	99.92%
合计	20,166	8,925.94	7,290,624.81	4.05%	172,709,804.58	95.95%

注：（1）机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对于下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对于合计数，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）。

（2）若同一持有人同时持有多个类别基金份额，会存在持有人户数合计数小于各份额类别持有人户数总和的情形。

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	申万菱信深证成份指数 A	9,719.20	0.0061%
	申万菱信深证成份指数 C	15,518.15	0.0777%
	合计	25,237.35	0.0140%

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	申万菱信深证成份指数 A	申万菱信深证成份指数 C
基金合同生效日（2021 年 01 月 01 日）基金份额总额	712,484,721.40	—
本报告期期初基金份额总额	216,955,748.16	18,182,810.59
本报告期基金总申购份额	7,021,627.02	86,730,157.07
减：本报告期基金总赎回份额	63,936,040.26	84,953,873.19
本报告期基金拆分变动份额	—	—

本报告期末基金份额总额	160,041,334.92	19,959,094.47
-------------	----------------	---------------

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

无

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，同意公司董事由上野由喜先生变更为染谷知先生。
- 2、本报告期内，经基金管理人股东会决议，同意公司董事由汪涛先生变更为邱春杨先生。
- 3、本报告期内，经基金管理人董事会决议，同意公司总经理由汪涛先生变更为邱春杨先生。
- 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

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产以及基金托管业务需要承担民事或刑事责任的相关诉讼事项。

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

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。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人无重大受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人相关从业人员无重大受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
申万宏源证券有限公司	2	79,592,492.50	100.00%	14,797.48	100.00%	-
上海华信证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东海证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国中金财富证券	1	-	-	-	-	-

有限公司						
中国国际 金融股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中国银河 证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
中航证券 有限公司	1	-	-	-	-	-
中邮证券 有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
中银国际 证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
五矿证券 有限公司	1	-	-	-	-	-
信达证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
光大证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
北京高华 证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
华源证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
国信证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
国元证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-

国投证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国新证券 股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国泰海通 证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
国金证券 股份有限公司	2	-	-	-	-	-
天风证券 股份有限公司	2	-	-	-	-	-
申万宏源 西部证券 有限公司	1	-	-	-	-	-
平安证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
广发证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
德邦证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
招商证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
方正证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
民生证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
浙商证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
渤海证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
红塔证券 股份有限	1	-	-	-	-	-

公司						
西南证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
财通证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

注：(1)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，提供专业的研究报告；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。

(2)本基金本报告期内退租兴业证券股份有限公司交易席位 1 个申万宏源西部证券有限公司交易席位 1 个国新证券股份有限公司交易席位 2 个。

10.8 其他重大事件

无。

§ 11 备查文件目录

11.1 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；
- 成立公告；
- 定期报告；
- 其他临时公告。

11.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

11.3 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.swsml.com。

申万菱信基金管理有限公司

二〇二六年八月三十一日