

# 申万菱信深证成份指数型证券投资基金

## 2023 年中期报告

### 2023 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

送出日期：二〇二三年八月三十一日

## 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 2023 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 2023 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
1.2 目录.....	3
2 基金简介.....	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	8
3 主要财务指标和基金净值表现.....	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	9
4 管理人报告.....	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
5 托管人报告.....	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
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.....	17
6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	19
6.4 报表附注.....	21
7 投资组合报告.....	44
7.1 期末基金资产组合情况.....	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	44
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.....	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	60
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.....	60
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.....	60
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.....	60
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.....	60
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	60

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	60
7.12 投资组合报告附注 .....	61
8 基金份额持有人信息 .....	62
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	62
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	62
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	63
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	63
9 开放式基金份额变动 .....	64
10 重大事件揭示 .....	64
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	64
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 .....	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	64
10.4 基金投资策略的改变 .....	64
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....	64
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	65
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 .....	65
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	65
11 备查文件目录 .....	66
11.1 备查文件目录 .....	66
11.2 存放地点 .....	67
11.3 查阅方式 .....	67



## 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	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 1 月 1 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	305,311,359.17 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2021 年 1 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	301,321,716.43 份	3,989,642.74 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，

	<p>追求尽可能贴近标的指数的表现。</p> <p>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。</p>
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	陈四清

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
----------------	--------

登载基金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	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（2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 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	2,804,639.57	26,004.44
本期利润	1,527,885.46	27,568.51
加权平均基金份额本期利润	0.0049	0.0098
本期加权平均净值利润率	0.80%	1.60%
本期基金份额净值增长率	0.54%	0.39%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 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
期末可供分配利润	-35,837,982.64	-1,613,631.48
期末可供分配基金份额利润	-0.1189	-0.4045
期末基金资产净值	180,143,739.25	2,376,011.26
期末基金份额净值	0.5978	0.5955
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 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



	A	
基金份额累计净值增长率	-20.42%	-8.89%

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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	2.45%	1.00%	2.05%	1.01%	0.40%	-0.01%
过去三个月	-5.05%	0.85%	-5.66%	0.86%	0.61%	-0.01%
过去六个月	0.54%	0.85%	0.12%	0.86%	0.42%	-0.01%
过去一年	-13.03%	1.00%	-13.75%	1.01%	0.72%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-20.42%	1.21%	-22.52%	1.22%	2.10%	-0.01%

申万菱信深证成份指数 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	2.43%	1.00%	2.05%	1.01%	0.38%	-0.01%
过去三个月	-5.13%	0.85%	-5.66%	0.86%	0.53%	-0.01%
过去六个月	0.39%	0.85%	0.12%	0.86%	0.27%	-0.01%
过去一年	-13.31%	1.00%	-13.75%	1.01%	0.44%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-8.89%	1.16%	-9.67%	1.17%	0.78%	-0.01%

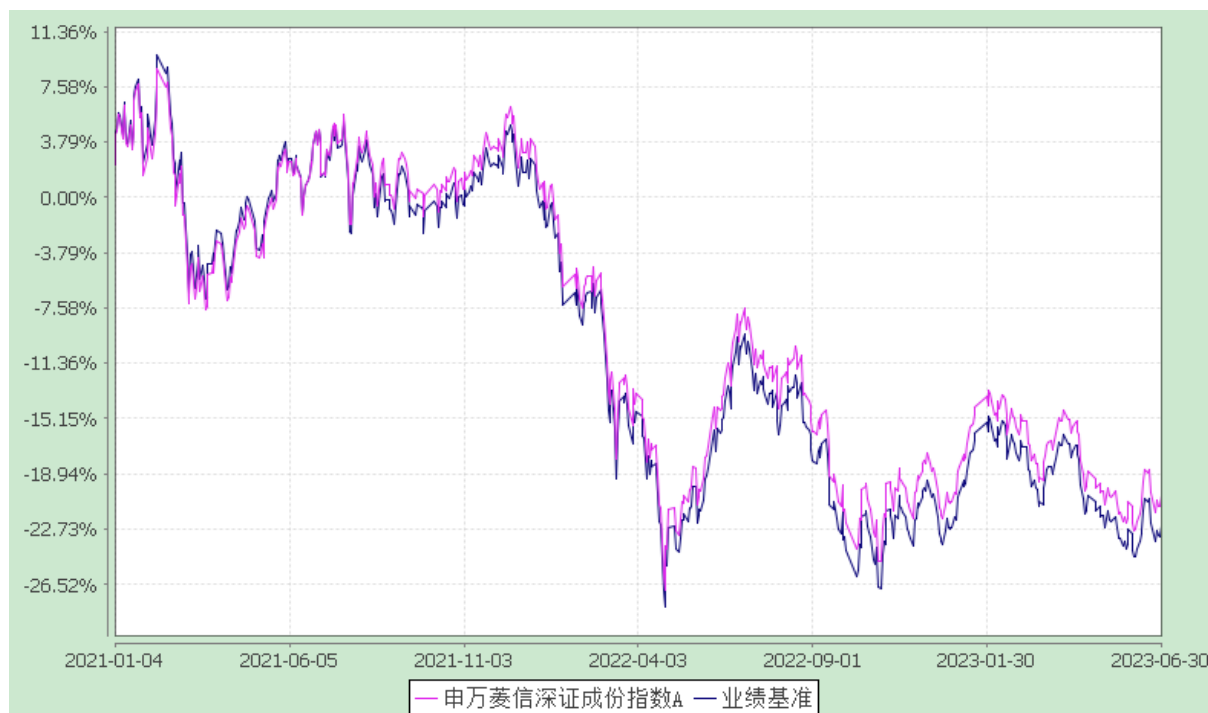
注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本基金业绩比较基准为： $95\% \times \text{深证成指收益率} + 5\% \times \text{银行同业存款利率}$ 。

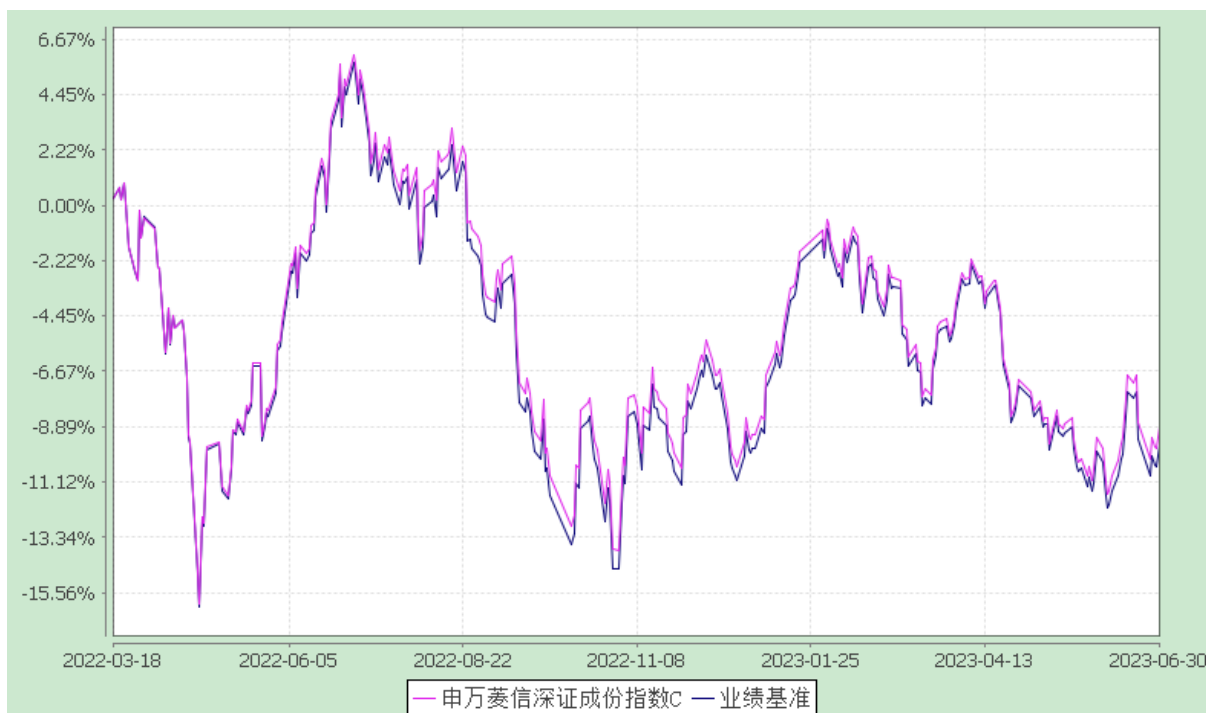
### 3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

申万菱信深证成份指数型证券投资基金  
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  
(2021 年 1 月 1 日至 2023 年 6 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



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”的产品服务，以努力达成“长期致胜”的使命。公司现有开放式公募基金 82 只，资产管理总规模超过 940.08 亿元，产品累计分红 200.35 亿元（数据截至 2023 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		
王赟杰	本基金基金经理	2020-07-22	-	11 年	王赟杰先生，博士研究生。2011 年起从事金融相关工作，曾任职于海通期货、华鑫证券、海富通基金、中信建投证券等，2020 年 3 月加入申万菱信基金，曾任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，现任申万菱信深证成份指数型证券投资基金、申万菱信中证申万证券行业指数证券投资基金、申万菱信中小企业 100 指数证券投资基金（LOF）、申万菱信中证环保指数型证券投资基金（LOF）、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、申万菱信中证内地新

					能源主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、申万菱信沪深 300 价值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。

#### 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遵规守信情况的说明

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 5 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**

回顾 2023 年上半年,我们既看到了政府对经济的明确支持态度以及疫后经济的逐步复苏,同时,也时刻感受到海外地缘政治、贸易摩擦甚至科技摩擦带来的诸多不确定性,在现实与预期、确定性与不确定性的交织下,波动成了权益市场的主旋律。另一方面,受疫情防控政策优化、国内经济复苏预期波动、存量市场博弈、资金面温和回暖等因素影响,在经济弱复苏背景下,不同板块、主题指数表现明显分化。

映射到数据上,我们会看到,虽然上半年 A 股市场涨幅有限,上证综指、深成指涨幅仅为 3.65%、0.10%,但内部结构性分化显著。具体来看,中证 1000、沪深 300 价值、中证 500 在 2023 年上半年涨幅分别为 5.10%、3.65%、2.29%,而创业板指、上证 50 跌幅则分别达-5.61%、-5.43%;行业方面,通信(50.66%)、传媒(42.75%)、计算机(27.57%)、机械设备(13.44%)、家用电器(13.29%)等行业表现相对较好,而商贸零售(-23.44%)、房地产(-14.29%)、美容护理(-13.06%)、建筑材料(-10.52%)等行业表现偏弱。

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和指数成分股定期调整。

作为被动投资的基金产品,申万菱信深证成份指数型证券投资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 0.54%,同期业绩基准表现为 0.12%。

本基金 C 类产品报告期内净值表现为 0.39%,同期业绩基准表现为 0.12%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,随着近期多项经济政策的密集落地、生产端消费端多项高频经济数据的企稳,前期影响企业盈利的因素正在逐步得到缓解,我们有理由期待经济与盈利的进一步好转。同时,未来 A 股市场受益于政策支持、产业政策变革,基本面预期改善且交易拥挤度尚未过热的板块依然值得持续关注。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、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**

本基金本报告期末进行利润分配，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 2023 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：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	11,761,048.24	13,333,355.77
结算备付金		11,933.18	2,943.15
存出保证金		3,859.87	3,293.97
交易性金融资产	6.4.7.2	171,123,270.76	179,828,761.37
其中：股票投资		171,123,270.76	179,828,761.37
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		69,474.42	25,979.38
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		182,969,586.47	193,194,333.64
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
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		76,618.41	236,455.38
应付管理人报酬		150,679.26	166,212.94
应付托管费		33,149.39	36,566.87
应付销售服务费		688.62	371.56
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	188,700.28	307,732.26
负债合计		449,835.96	747,339.01
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	219,971,364.63	232,745,611.10
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-37,451,614.12	-40,298,616.47
净资产合计		182,519,750.51	192,446,994.63
负债和净资产总计		182,969,586.47	193,194,333.64

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额总额 305,311,359.17 份。A 类基金份额净值 0.5978 元，份额总额 301,321,716.43 份；C 类基金份额净值 0.5955 元，份额总额 3,989,642.74 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		2,842,535.53	-32,277,790.48
1.利息收入		22,759.57	27,516.11
其中：存款利息收入	6.4.7.9	22,759.57	27,516.11
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）		4,081,539.25	7,916,738.30
其中：股票投资收益	6.4.7.10	2,400,874.78	6,211,856.16
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	1,680,664.47	1,704,882.14
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-1,275,190.04	-40,252,096.99
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	13,426.75	30,052.10
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>1,287,081.56</b>	<b>1,497,529.82</b>
1. 管理人报酬		958,926.68	1,137,374.08
2. 托管费		210,963.73	250,222.33
3. 销售服务费		2,546.18	185.47
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	114,644.97	109,747.94
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>1,555,453.97</b>	<b>-33,775,320.30</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>1,555,453.97</b>	<b>-33,775,320.30</b>
五、其他综合收益的税后净额		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>1,555,453.97</b>	<b>-33,775,320.30</b>

### 6.3 净资产（基金净值）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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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）	232,745,611.10	-	-40,298,616.47	192,446,994.63
二、本期期初净资产（基金净值）	232,745,611.10	-	-40,298,616.47	192,446,994.63

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-12,774,246.47	-	2,847,002.35	-9,927,244.12
（一）、综合收益总额	-	-	1,555,453.97	1,555,453.97
（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）	-12,774,246.47	-	1,291,548.38	-11,482,698.09
其中：1.基金申购款	16,328,387.48	-	-5,684,546.32	10,643,841.16
2.基金赎回款	-29,102,633.95	-	6,976,094.70	-22,126,539.25
（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）	219,971,364.63	-	-37,451,614.12	182,519,750.51
项目	上年度可比期间 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（基金净值）	260,340,998.48	-	23,310,475.16	283,651,473.64
二、本期期初净资产（基金净值）	260,340,998.48	-	23,310,475.16	283,651,473.64
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-21,408,423.45	-	-33,264,161.27	-54,672,584.72
（一）、综合收益总额	-	-	-33,775,320.30	-33,775,320.30
（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）	-21,408,423.45	-	511,159.03	-20,897,264.42
其中：1.基金申购款	6,346,374.53	-	-1,014,387.00	5,331,987.53
2.基金赎回	-27,754,797.98	-	1,525,546.03	-26,229,251.95

款				5
(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)	238,932,575.03	-	-9,953,686.11	228,978,888.92

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：徐越

## 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，本基金将分设 A 类和 C 类两类基金份额，分别设置对应的基金代码并分别计算基金份额净值。投资者申购时自主选择 A 类基金份额或 C 类基金份额进行申购。不同基金份额类别之间不能相互转换。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。本基金自 2022 年 3 月 1 日起开始办理 C 类基金份额的申购、赎回、转换与定期定额投资业务。

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。本基金力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{深证成指收益率} + 5\% \times \text{银行同业存款利率}$ 。

#### 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》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

本基金财务报表符合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》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 2023 年 6 月 30 日的财务状况、2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本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 [2014] 81 号文《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税 [2016] 127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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》、中投信〔2021〕20 号《关于香港联合交易所有限公司上调股票交易印花税率有关提示的通知》、财政部公告 2019 年第 93 号《关于继续执行沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财政部税务总局公告 2023 年第 2 号《关于延续实施有关个人所得税优惠政策的公告》、财税〔2014〕81 号《财政

部、国家税务总局、中国证券监督管理委员会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》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，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，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。

对内地个人投资者通过沪港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称中国结算）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。内地个人投资者通过沪港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。个人投资者在国外已缴纳的预提税，可持有效扣税凭证到中国结算的主管税务机关申请税收抵免。

对内地企业投资者通过沪港通投资香港联交所上市股票取得的股息红利所得，计入其收入总额，依法计征企业所得税。其中，内地居民企业连续持有 H 股满 12 个月取得的股息红利所得，依法免征企业所得税。

(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。对于基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

根据香港联合交易所有限公司（以下简称联交所）上调股票交易印花税公告，自 2021 年 8 月 1 日起，香港市场的股票交易印花税由按成交金额的 0.1% 双向收取，上调为按成交金额的 0.13% 双向收取（取整到元，不足一元按一元计）。按照《上海证券交易所沪港通业务实施办法》第七十六条的有关规定，投资者进行沪港通下的港股通交易，应按照联交所市场的有关规定交纳相关费用。

(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。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得和通过基金互认买卖香港基金份额取得的转让差价所得，自 2019 年 12 月 5 日起至 2023 年 12 月 31 日止，继续暂免征收个人所得税。对内地企业投资者通过沪港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得，计入其收入总额，依法征收企业所得税。

(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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	11,761,048.24
等于：本金	11,759,886.61
加：应计利息	1,161.63
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	11,761,048.24

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	144,725,738.02	-	171,123,270.76	26,397,532.74
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	144,725,738.02	-	171,123,270.76	26,397,532.74

### 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

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 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1.08
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	15,824.64
其中：交易所市场	15,824.64
银行间市场	-
应付利息	-
应付指数使用费	9,313.29
预提审计费用	35,704.06
预提信息披露费	59,507.37
其他应付款	68,349.84

合计	188,700.28
----	------------

**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 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	321,098,972.58	230,158,024.91
本期申购	3,945,144.66	2,827,787.03
本期赎回（以“-”号填列）	-23,722,400.81	-17,004,090.05
本期末	301,321,716.43	215,981,721.89

**申万菱信深证成份指数 C**

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,587,586.19	2,587,586.19
本期申购	13,500,600.45	13,500,600.45
本期赎回（以“-”号填列）	-12,098,543.90	-12,098,543.90
本期末	3,989,642.74	3,989,642.74

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	375,414,460.20	-414,660,460.69	-39,246,000.49
本期利润	2,804,639.57	-1,276,754.11	1,527,885.46
本期基金份额交易产生的变动数	-23,178,242.39	25,058,374.78	1,880,132.39
其中：基金申购款	4,629,252.96	-5,044,288.67	-415,035.71
基金赎回款	-27,807,495.35	30,102,663.45	2,295,168.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	355,040,857.38	-390,878,840.02	-35,837,982.64

**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	-869,538.58	-183,077.40	-1,052,615.98
本期利润	26,004.44	1,564.07	27,568.51
本期基金份额交易产生的变动数	-464,743.18	-123,840.83	-588,584.01
其中：基金申购款	-4,481,618.02	-787,892.59	-5,269,510.61
基金赎回款	4,016,874.84	664,051.76	4,680,926.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,308,277.32	-305,354.16	-1,613,631.48

**6.4.7.9 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	22,641.75
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	92.07
其他	25.75
合计	22,759.57

**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
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	19,974,603.55
减：卖出股票成本总额	17,524,212.76
减：交易费用	49,516.01
买卖股票差价收入	2,400,874.78

**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 债券投资收益——买卖债券差价收入****6.4.7.12.1 债券投资收益——申购差价收入**

无。

**6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益项目构成**

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
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,680,664.47
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	1,680,664.47

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
1.交易性金融资产	-1,275,190.04
——股票投资	-1,275,190.04
——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	-1,275,190.04

**6.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	13,424.40
转换费收入	2.35
合计	13,426.75

**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
	2023年1月1日至2023年6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	-
指数使用费	19,178.54
汇划手续费	255.00
合计	114,644.97

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

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.4.8.1 或有事项**

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
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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的 比例	成交金额	占当期股票成交总额的 比例
申万宏源	18,223,732.95	61.69%	17,868,693.51	36.55%

##### 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 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023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	16,789.77	61.69%	11,466.65	72.46%
关联方名称	上年度可比期间 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	16,407.41	36.59%	11,403.27	40.84%

注：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，以扣除证券公司需承担的费用后的净额列示。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。

#### 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	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年6月 30日	2022年1月1日至2022年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	958,926.68	1,137,374.08
其中：支付销售机构的客户维护费	145,073.22	160,650.23

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	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年6月 30日	2022年1月1日至2022年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	210,963.73	250,222.33

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.22% 的年费率计提。计算方法如下：

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

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

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：

$$H=E \times \text{C 类基金销售服务费年费率} / \text{当年天数}$$

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

本期末和上年度末，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 6.4.10.6 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 2023年1月1日至2023年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	11,761,048.24	22,641.75	15,046,930.61	27,146.82

#### 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

##### 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）合计 611,045.82 元，占本基金资产净值的比例为 0.33%。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

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2023 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
301157	华塑科技	2023-03-01	6个月(含)	新股限售	56.50	52.92	96.00	5,424.00	5,080.32	-
301260	格力博	2023-01-20	6个月(含)	新股限售	30.85	23.62	346.00	10,674.10	8,172.52	-
301303	真兰仪表	2023-02-13	6个月(含)	新股限售	26.80	22.32	318.00	8,522.40	7,097.76	-
301322	绿通科技	2023-02-27	6个月(含)	新股限售	131.11	53.20	59.00	7,735.49	3,138.80	-
301322	绿通科技	2023-05-25	6个月(含)	新股限售-送股	0.00	53.20	30.00	0.00	1,596.00	限售期送股
301358	湖南裕能	2023-02-01	6个月(含)	新股限售	23.77	42.86	268.00	6,370.36	11,486.48	-
30137	凌玮	2023-0	6个月	新股	33.73	31.84	177.00	5,970.	5,635.	-

3	科技	1-20	(含)	限售				21	68
---	----	------	-----	----	--	--	--	----	----

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300346	南大光电	2023-06-26	重大事项停牌	34.39	2023-07-06	35.60	6,810.00	179,962.70	234,195.90	重大事项

#### 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 2023 年 6 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 2023 年 6 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上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余是流动性较好的可在银行间同业市场交易的金融资产工具、银行存款和结算备付金，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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 2023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	11,761,048.24	-	-	-	-	-	11,761,048.24
结算备付金	11,933.18	-	-	-	-	-	11,933.18
存出保证金	3,859.87	-	-	-	-	-	3,859.87
交易性金融资产	-	-	-	-	-	171,123,270.76	171,123,270.76
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-

应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	69,474.42	69,474.42
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	11,776,841.29	-	-	-	-	171,192,745.18	182,969,586.47
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	-	-	-	-	-	76,618.41	76,618.41
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	150,679.26	150,679.26
应付托管费	-	-	-	-	-	33,149.39	33,149.39
应付销售服务费	-	-	-	-	-	688.62	688.62
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	188,700.28	188,700.28
负债总计	-	-	-	-	-	449,835.96	449,835.96
利率敏感度缺口	11,776,841.29	-	-	-	-	170,742,909.22	182,519,750.51
上年度末 2022 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	13,333,355.77	-	-	-	-	-	13,333,355.77
结算备付金	2,943.15	-	-	-	-	-	2,943.15
存出保证金	3,293.97	-	-	-	-	-	3,293.97
交易性金融资产	-	-	-	-	-	179,828,761.37	179,828,761.37
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算	-	-	-	-	-	-	-



款							
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	25,979.38	25,979.38
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	13,339,592.89	-	-	-	-	179,854,740.75	193,194,333.64
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	-	-	-	-	-	236,455.38	236,455.38
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	166,212.94	166,212.94
应付托管费	-	-	-	-	-	36,566.87	36,566.87
应付销售服务费	-	-	-	-	-	371.56	371.56
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	307,732.26	307,732.26
负债总计	-	-	-	-	-	747,339.01	747,339.01
利率敏感度缺口	13,339,592.89	-	-	-	-	179,107,401.74	192,446,994.63

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，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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	171,123,270.76	93.76	179,828,761.37	93.44
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	171,123,270.76	93.76	179,828,761.37	93.44

#### 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（见附件 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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日

	基准上升 5%	8,740,000.00	9,000,000.00
	基准下降 5%	-8,740,000.00	-9,000,000.00

#### 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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	170,846,867.30	179,334,537.86
第二层次	234,195.90	154,512.00
第三层次	42,207.56	339,711.51
合计	171,123,270.76	179,828,761.37

###### 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 2023 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(2022 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 2023 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	171,123,270.76	93.53
	其中：股票	171,123,270.76	93.53
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	11,772,981.42	6.43
8	其他各项资产	73,334.29	0.04
9	合计	182,969,586.47	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

## 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

## 7.2.1.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

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	3,688,972.32	2.02
B	采矿业		

		1,632,639.98	0.89
C	制造业	127,082,808.06	69.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,956,283.24	1.07
E	建筑业	301,023.88	0.16
F	批发和零售业	1,284,141.94	0.70
G	交通运输、仓储和邮政业	2,320,056.71	1.27
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,073,137.15	6.07
J	金融业	11,396,522.07	6.24
K	房地产业	2,485,420.79	1.36
L	租赁和商务服务业	1,916,001.47	1.05
M	科学研究和技术服务业	1,720,585.94	0.94
N	水利、环境和公共设施管理业	476,598.27	0.26
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	255,210.00	0.14
Q	卫生和社会工作	1,825,737.56	1.00
R	文化、体育和娱乐业	1,292,724.65	0.71
S	综合	290,042.10	0.16
	合计	170,997,906.13	93.69

#### 7.2.1.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	53,455.50	0.03

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业		-
E	建筑业		-
F	批发和零售业		-
G	交通运输、仓储和邮政业		-
H	住宿和餐饮业		-
I	信息传输、软件和信息技术服务业		-
J	金融业		-
K	房地产业	71,909.13	0.04
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	125,364.63	0.07

### 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所有股票投资明细

#### 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	300750	宁德时代	37,411.00	8,559,262.69	4.69
2	000858	五粮液	27,254.00	4,457,936.78	2.44
3	000333	美的集团	73,202.00	4,313,061.84	2.36
4	002594	比亚迪	12,792.00	3,303,789.84	1.81

5	300059	东方财富	186,233.00	2,644,508.60	1.45
6	000651	格力电器	66,772.00	2,437,845.72	1.34
7	000568	泸州老窖	11,105.00	2,327,274.85	1.28
8	002475	立讯精密	68,167.00	2,212,019.15	1.21
9	300760	迈瑞医疗	7,357.00	2,205,628.60	1.21
10	000063	中兴通讯	46,962.00	2,138,649.48	1.17
11	000725	京东方 A	477,871.00	1,954,492.39	1.07
12	002415	海康威视	56,891.00	1,883,661.01	1.03
13	300124	汇川技术	28,509.00	1,830,562.89	1.00
14	002230	科大讯飞	26,363.00	1,791,629.48	0.98
15	300274	阳光电源	15,008.00	1,750,383.04	0.96
16	002352	顺丰控股	35,200.00	1,587,168.00	0.87
17	002714	牧原股份	37,178.00	1,567,052.70	0.86
18	002129	TCL 中环	44,045.00	1,462,294.00	0.80
19	300498	温氏股份	79,614.00	1,460,916.90	0.80
20	000001	平安银行	126,867.00	1,424,716.41	0.78
21	002142	宁波银行	52,885.00	1,337,990.50	0.73
22	300308	中际旭创	9,052.00	1,334,717.40	0.73
23	000002	万 科 A	91,873.00	1,288,059.46	0.71
24	002371	北方华创	3,933.00	1,249,317.45	0.68
25	002304	洋河股份	8,938.00	1,174,006.30	0.64
26	300015	爱尔眼科	61,277.00	1,136,688.35	0.62
27	300014	亿纬锂能	18,690.00	1,130,745.00	0.62
28	000792	盐湖股份	58,000.00	1,111,860.00	0.61
29	002466	天齐锂业	15,400.00	1,076,614.00	0.59
30	002027	分众传媒	151,271.00	1,030,155.51	0.56
31	002460	赣锋锂业	16,784.00	1,023,152.64	0.56
32	002459	晶澳科技	23,420.00	976,614.00	0.54
33	000338	潍柴动力	77,042.00	959,943.32	0.53
34	002049	紫光国微	9,773.00	911,332.25	0.50
35	000100	TCL 科技	224,885.00	886,046.90	0.49
36	002050	三花智控	28,192.00	853,089.92	0.47
37	000938	紫光股份	25,939.00	826,157.15	0.45
38	000625	长安汽车	62,711.00	810,853.23	0.44
39	002555	三七互娱	22,475.00	783,928.00	0.43
40	002271	东方雨虹	28,680.00	781,816.80	0.43
41	002179	中航光电	16,409.00	744,148.15	0.41
42	002812	恩捷股份	7,660.00	738,041.00	0.40
43	002709	天赐材料	17,904.00	737,465.76	0.40
44	300122	智飞生物	16,498.00	729,211.60	0.40
45	000977	浪潮信息	14,639.00	709,991.50	0.39
46	002241	歌尔股份	36,772.00	652,703.00	0.36
47	300316	晶盛机电	9,090.00	644,481.00	0.35
48	300142	沃森生物	24,338.00	643,740.10	0.35

49	002410	广联达	19,448.00	631,865.52	0.35
50	300502	新易盛	9,214.00	626,275.58	0.34
51	000776	广发证券	42,430.00	624,145.30	0.34
52	000166	申万宏源	132,261.00	611,045.82	0.33
53	002602	世纪华通	79,583.00	604,034.97	0.33
54	000661	长春高新	4,414.00	601,628.20	0.33
55	300896	爱美客	1,300.00	578,435.00	0.32
56	002920	德赛西威	3,600.00	560,916.00	0.31
57	001979	招商蛇口	42,299.00	551,155.97	0.30
58	002311	海大集团	11,659.00	546,107.56	0.30
59	000596	古井贡酒	2,200.00	544,236.00	0.30
60	300408	三环集团	18,472.00	542,153.20	0.30
61	300450	先导智能	14,882.00	538,281.94	0.29
62	002252	上海莱士	71,603.00	537,738.53	0.29
63	000538	云南白药	10,092.00	529,628.16	0.29
64	002493	荣盛石化	45,413.00	528,607.32	0.29
65	300347	泰格医药	8,061.00	520,256.94	0.29
66	000768	中航西飞	19,417.00	519,404.75	0.28
67	002236	大华股份	26,211.00	517,667.25	0.28
68	000733	振华科技	5,400.00	517,590.00	0.28
69	300033	同花顺	2,944.00	516,024.32	0.28
70	002340	格林美	72,177.00	498,743.07	0.27
71	000425	徐工机械	73,370.00	496,714.90	0.27
72	002384	东山精密	19,064.00	493,757.60	0.27
73	000963	华东医药	11,370.00	493,116.90	0.27
74	300496	中科创达	5,087.00	490,132.45	0.27
75	300782	卓胜微	5,071.00	490,010.73	0.27
76	000988	华工科技	12,449.00	473,186.49	0.26
77	002180	纳思达	13,470.00	461,347.50	0.25
78	300418	昆仑万维	11,336.00	456,614.08	0.25
79	000157	中联重科	67,080.00	452,790.00	0.25
80	002422	科伦药业	15,224.00	451,848.32	0.25
81	002074	国轩高科	15,596.00	430,761.52	0.24
82	002517	恺英网络	26,700.00	420,258.00	0.23
83	002202	金风科技	39,480.00	419,277.60	0.23
84	300724	捷佳伟创	3,700.00	415,695.00	0.23
85	300003	乐普医疗	18,356.00	415,029.16	0.23
86	000066	中国长城	29,958.00	414,319.14	0.23
87	002463	沪电股份	19,680.00	412,099.20	0.23
88	300012	华测检测	21,000.00	409,500.00	0.22
89	002738	中矿资源	7,840.00	399,369.60	0.22
90	000807	云铝股份	31,237.00	397,647.01	0.22
91	300454	深信服	3,500.00	396,375.00	0.22
92	002028	思源电气	8,385.00	391,747.20	0.21



93	000895	双汇发展	15,983.00	391,423.67	0.21
94	300223	北京君正	4,403.00	388,828.93	0.21
95	002648	卫星化学	25,952.00	388,241.92	0.21
96	002405	四维图新	32,756.00	379,314.48	0.21
97	002821	凯莱英	3,200.00	377,152.00	0.21
98	000876	新希望	31,792.00	371,330.56	0.20
99	002601	龙佰集团	22,500.00	371,250.00	0.20
100	300037	新宙邦	7,140.00	370,494.60	0.20
101	300661	圣邦股份	4,501.00	369,667.13	0.20
102	000301	东方盛虹	31,100.00	367,602.00	0.20
103	002001	新和成	23,761.00	365,919.40	0.20
104	300751	迈为股份	2,135.00	361,626.30	0.20
105	002736	国信证券	41,015.00	358,060.95	0.20
106	002185	华天科技	38,850.00	357,420.00	0.20
107	002156	通富微电	15,800.00	357,080.00	0.20
108	000423	东阿阿胶	6,666.00	356,297.70	0.20
109	002472	双环传动	9,800.00	355,740.00	0.19
110	300146	汤臣倍健	14,801.00	354,927.98	0.19
111	002841	视源股份	5,222.00	349,038.48	0.19
112	002558	巨人网络	19,366.00	347,232.38	0.19
113	002436	兴森科技	22,400.00	347,200.00	0.19
114	300058	蓝色光标	35,704.00	345,257.68	0.19
115	300433	蓝思科技	29,041.00	341,522.16	0.19
116	002007	华兰生物	15,169.00	339,937.29	0.19
117	300769	德方纳米	3,080.00	339,508.40	0.19
118	300207	欣旺达	20,642.00	336,877.44	0.18
119	300999	金龙鱼	8,414.00	336,475.86	0.18
120	000999	华润三九	5,544.00	336,299.04	0.18
121	000786	北新建材	13,685.00	335,419.35	0.18
122	002797	第一创业	56,979.00	325,919.88	0.18
123	003816	中国广核	104,600.00	325,306.00	0.18
124	300759	康龙化成	8,450.00	323,466.00	0.18
125	002008	大族激光	12,344.00	323,412.80	0.18
126	000975	银泰黄金	27,466.00	321,352.20	0.18
127	300285	国瓷材料	11,650.00	319,210.00	0.17
128	002624	完美世界	18,843.00	318,258.27	0.17
129	002223	鱼跃医疗	8,809.00	317,035.91	0.17
130	300413	芒果超媒	9,250.00	316,442.50	0.17
131	002625	光启技术	20,736.00	316,431.36	0.17
132	000799	酒鬼酒	3,500.00	315,525.00	0.17
133	002385	大北农	47,719.00	314,945.40	0.17
134	300763	锦浪科技	3,020.00	314,382.00	0.17
135	002044	美年健康	43,736.00	310,962.96	0.17
136	000783	长江证券	53,179.00	308,438.20	0.17

137	002966	苏州银行	46,810.00	306,605.50	0.17
138	300073	当升科技	6,043.00	304,144.19	0.17
139	002439	启明星辰	10,184.00	303,075.84	0.17
140	300474	景嘉微	3,357.00	302,096.43	0.17
141	000630	铜陵有色	103,850.00	300,126.50	0.16
142	300395	菲利华	6,100.00	300,120.00	0.16
143	002409	雅克科技	4,108.00	299,391.04	0.16
144	000933	神火股份	22,900.00	297,700.00	0.16
145	002603	以岭药业	11,585.00	297,618.65	0.16
146	300568	星源材质	17,230.00	296,183.70	0.16
147	002600	领益智造	42,220.00	291,740.20	0.16
148	000009	中国宝安	24,030.00	290,042.10	0.16
149	002568	百润股份	7,972.00	289,782.20	0.16
150	300024	机器人	17,323.00	288,774.41	0.16
151	000021	深科技	14,442.00	288,695.58	0.16
152	000932	华菱钢铁	60,399.00	288,103.23	0.16
153	002756	永兴材料	4,560.00	285,501.60	0.16
154	300253	卫宁健康	26,277.00	284,317.14	0.16
155	002407	多氟多	14,140.00	280,820.40	0.15
156	000723	美锦能源	37,200.00	280,488.00	0.15
157	000683	远兴能源	38,700.00	278,253.00	0.15
158	300567	精测电子	2,900.00	275,935.00	0.15
159	300390	天华新能	7,600.00	272,080.00	0.15
160	002497	雅化集团	15,300.00	272,034.00	0.15
161	002176	江特电机	22,800.00	271,776.00	0.15
162	300459	汤姆猫	41,849.00	271,600.01	0.15
163	300919	中伟股份	4,500.00	271,125.00	0.15
164	300144	宋城演艺	21,851.00	270,952.40	0.15
165	000831	中国稀土	9,115.00	269,804.00	0.15
166	000591	太阳能	39,654.00	268,854.12	0.15
167	002465	海格通信	25,695.00	265,686.30	0.15
168	002850	科达利	2,000.00	264,500.00	0.14
169	000983	山西焦煤	29,017.00	264,054.70	0.14
170	000617	中油资本	36,238.00	262,000.74	0.14
171	300832	新产业	4,400.00	259,600.00	0.14
172	000728	国元证券	39,774.00	259,326.48	0.14
173	002025	航天电器	4,062.00	259,155.60	0.14
174	000818	航锦科技	7,700.00	256,949.00	0.14
175	002607	中公教育	54,300.00	255,210.00	0.14
176	300054	鼎龙股份	10,300.00	254,719.00	0.14
177	300118	东方日升	9,765.00	250,276.95	0.14
178	002865	钧达股份	1,638.00	249,844.14	0.14
179	000738	航发控制	10,237.00	249,782.80	0.14
180	000069	华侨城 A	56,758.00	249,735.20	0.14

181	002078	太阳纸业	23,255.00	248,595.95	0.14
182	002368	太极股份	6,008.00	247,349.36	0.14
183	000860	顺鑫农业	7,213.00	243,005.97	0.13
184	300699	光威复材	7,864.00	242,604.40	0.13
185	300604	长川科技	5,100.00	242,199.00	0.13
186	300136	信维通信	12,056.00	242,084.48	0.13
187	002262	恩华药业	7,848.00	241,953.84	0.13
188	300628	亿联网络	6,800.00	238,476.00	0.13
189	000408	藏格矿业	10,500.00	236,985.00	0.13
190	000998	隆平高科	15,407.00	236,497.45	0.13
191	300777	中简科技	5,000.00	236,300.00	0.13
192	002138	顺络电子	9,863.00	235,824.33	0.13
193	002673	西部证券	36,974.00	234,784.90	0.13
194	000878	云南铜业	21,220.00	234,481.00	0.13
195	300346	南大光电	6,810.00	234,195.90	0.13
196	300487	蓝晓科技	3,750.00	234,075.00	0.13
197	002430	杭氧股份	6,800.00	233,648.00	0.13
198	300601	康泰生物	9,200.00	233,588.00	0.13
199	002268	电科网安	8,379.00	233,522.73	0.13
200	002444	巨星科技	10,626.00	232,496.88	0.13
201	002195	二三四五	79,292.00	229,153.88	0.13
202	300438	鹏辉能源	4,700.00	225,788.00	0.12
203	002281	光迅科技	6,083.00	225,618.47	0.12
204	002152	广电运通	19,236.00	225,445.92	0.12
205	000519	中兵红箭	12,400.00	224,316.00	0.12
206	000513	丽珠集团	5,746.00	223,576.86	0.12
207	002065	东华软件	31,556.00	222,785.36	0.12
208	002353	杰瑞股份	8,862.00	222,702.06	0.12
209	000729	燕京啤酒	17,858.00	222,689.26	0.12
210	000400	许继电气	9,642.00	222,248.10	0.12
211	002294	信立泰	7,125.00	222,228.75	0.12
212	000960	锡业股份	14,247.00	221,540.85	0.12
213	300595	欧普康视	7,330.00	221,292.70	0.12
214	300383	光环新网	20,469.00	220,041.75	0.12
215	002056	横店东磁	12,063.00	219,667.23	0.12
216	002938	鹏鼎控股	9,000.00	218,610.00	0.12
217	002747	埃斯顿	7,800.00	218,400.00	0.12
218	002739	万达电影	17,400.00	218,196.00	0.12
219	300017	网宿科技	30,445.00	216,463.95	0.12
220	000629	钒钛股份	55,200.00	215,832.00	0.12
221	002595	豪迈科技	6,141.00	215,733.33	0.12
222	002273	水晶光电	17,976.00	214,633.44	0.12
223	002080	中材科技	10,376.00	212,915.52	0.12
224	002373	千方科技	15,577.00	212,470.28	0.12

225	002916	深南电路	2,808.00	211,638.96	0.12
226	002456	欧菲光	37,704.00	211,142.40	0.12
227	000997	新大陆	11,167.00	211,056.30	0.12
228	300476	胜宏科技	8,738.00	210,673.18	0.12
229	300866	安克创新	2,400.00	210,000.00	0.12
230	300676	华大基因	3,500.00	209,965.00	0.12
231	002507	涪陵榨菜	11,440.00	209,466.40	0.11
232	000623	吉林敖东	12,984.00	208,263.36	0.11
233	000032	深桑达 A	6,300.00	207,270.00	0.11
234	002531	天顺风能	13,540.00	206,214.20	0.11
235	300001	特锐德	9,918.00	206,096.04	0.11
236	300182	捷成股份	32,437.00	204,677.47	0.11
237	300633	开立医疗	3,743.00	203,993.50	0.11
238	300212	易华录	6,100.00	202,703.00	0.11
239	002402	和而泰	11,900.00	202,062.00	0.11
240	000708	中信特钢	12,671.00	200,708.64	0.11
241	000703	恒逸石化	29,546.00	200,321.88	0.11
242	002203	海亮股份	16,600.00	199,366.00	0.11
243	000516	国际医学	23,700.00	199,317.00	0.11
244	000690	宝新能源	28,363.00	199,108.26	0.11
245	002131	利欧股份	86,233.00	198,335.90	0.11
246	002683	广东宏大	6,700.00	197,248.00	0.11
247	002851	麦格米特	5,400.00	196,938.00	0.11
248	000547	航天发展	19,645.00	196,450.00	0.11
249	300296	利亚德	29,883.00	195,135.99	0.11
250	002192	融捷股份	2,900.00	193,807.00	0.11
251	002389	航天彩虹	8,600.00	191,006.00	0.10
252	300682	朗新科技	8,200.00	190,896.00	0.10
253	002120	韵达股份	19,953.00	190,750.68	0.10
254	300666	江丰电子	2,800.00	190,288.00	0.10
255	000039	中集集团	27,587.00	190,074.43	0.10
256	002506	协鑫集成	64,400.00	188,692.00	0.10
257	002414	高德红外	24,164.00	187,754.28	0.10
258	002557	洽洽食品	4,517.00	187,681.35	0.10
259	002372	伟星新材	9,106.00	187,037.24	0.10
260	000762	西藏矿业	6,300.00	186,669.00	0.10
261	002092	中泰化学	28,735.00	185,340.75	0.10
262	002532	天山铝业	30,800.00	184,492.00	0.10
263	300088	长信科技	30,564.00	184,300.92	0.10
264	000970	中科三环	14,305.00	183,390.10	0.10
265	300458	全志科技	6,705.00	182,711.25	0.10
266	002151	北斗星通	5,166.00	181,636.56	0.10
267	002926	华西证券	21,800.00	181,158.00	0.10
268	300803	指南针	3,700.00	179,783.00	0.10

269	000893	亚钾国际	7,800.00	178,932.00	0.10
270	300244	迪安诊断	6,975.00	178,769.25	0.10
271	300373	扬杰科技	4,400.00	178,508.00	0.10
272	000636	风华高科	11,600.00	177,944.00	0.10
273	002064	华峰化学	25,900.00	177,674.00	0.10
274	000060	中金岭南	37,360.00	177,460.00	0.10
275	000750	国海证券	52,679.00	176,474.65	0.10
276	300456	赛微电子	7,200.00	176,256.00	0.10
277	300558	贝达药业	3,654.00	175,501.62	0.10
278	002508	老板电器	6,891.00	174,273.39	0.10
279	000155	川能动力	12,000.00	172,800.00	0.09
280	300251	光线传媒	21,062.00	170,391.58	0.09
281	300748	金力永磁	5,680.00	169,945.60	0.09
282	000877	天山股份	20,860.00	169,800.40	0.09
283	002153	石基信息	12,105.00	169,470.00	0.09
284	002299	圣农发展	8,849.00	169,458.35	0.09
285	300034	钢研高纳	4,300.00	169,377.00	0.09
286	300957	贝泰妮	1,900.00	168,872.00	0.09
287	002617	露笑科技	21,400.00	168,632.00	0.09
288	002015	协鑫能科	12,200.00	163,846.00	0.09
289	002500	山西证券	29,133.00	162,562.14	0.09
290	002936	郑州银行	70,412.00	161,947.60	0.09
291	002484	江海股份	7,600.00	161,804.00	0.09
292	000921	海信家电	6,000.00	161,700.00	0.09
293	000739	普洛药业	9,100.00	161,434.00	0.09
294	002939	长城证券	19,800.00	160,974.00	0.09
295	002019	亿帆医药	10,965.00	160,089.00	0.09
296	002541	鸿路钢构	5,540.00	159,607.40	0.09
297	000830	鲁西化工	15,100.00	159,456.00	0.09
298	300009	安科生物	15,897.00	158,970.00	0.09
299	000887	中鼎股份	12,140.00	158,912.60	0.09
300	000050	深天马 A	17,256.00	158,410.08	0.09
301	002245	蔚蓝锂芯	14,400.00	157,680.00	0.09
302	002317	众生药业	9,200.00	156,308.00	0.09
303	300294	博雅生物	4,300.00	156,004.00	0.09
304	002128	电投能源	11,774.00	155,652.28	0.09
305	002429	兆驰股份	28,239.00	155,314.50	0.09
306	002145	中核钛白	26,190.00	154,259.10	0.08
307	002958	青农商行	56,700.00	154,224.00	0.08
308	000875	吉电股份	28,600.00	154,154.00	0.08
309	300026	红日药业	28,091.00	152,253.22	0.08
310	002212	天融信	15,663.00	151,931.10	0.08
311	300529	健帆生物	6,538.00	151,550.84	0.08
312	000778	新兴铸管	36,863.00	150,401.04	0.08

313	000951	中国重汽	8,920.00	150,302.00	0.08
314	300451	创业慧康	17,876.00	149,800.88	0.08
315	002030	达安基因	14,943.00	148,981.71	0.08
316	300775	三角防务	4,400.00	148,632.00	0.08
317	301236	软通动力	5,450.00	148,294.50	0.08
318	002396	星网锐捷	6,562.00	148,235.58	0.08
319	300363	博腾股份	5,000.00	147,950.00	0.08
320	301269	华大九天	1,200.00	147,408.00	0.08
321	300638	广和通	6,466.00	146,648.88	0.08
322	002643	万润股份	8,401.00	146,261.41	0.08
323	002155	湖南黄金	11,929.00	145,533.80	0.08
324	000686	东北证券	20,900.00	145,046.00	0.08
325	002487	大金重工	4,700.00	144,948.00	0.08
326	002244	滨江集团	16,354.00	144,242.28	0.08
327	002326	永太科技	9,400.00	143,726.00	0.08
328	300677	英科医疗	6,520.00	143,440.00	0.08
329	300674	宇信科技	8,099.00	143,190.32	0.08
330	000528	柳工	18,080.00	142,832.00	0.08
331	300070	碧水源	26,619.00	142,677.84	0.08
332	002408	齐翔腾达	22,300.00	142,051.00	0.08
333	300747	锐科激光	4,610.00	140,512.80	0.08
334	002266	浙富控股	33,989.00	140,374.57	0.08
335	002518	科士达	3,500.00	140,035.00	0.08
336	002831	裕同科技	5,720.00	139,510.80	0.08
337	002706	良信股份	12,380.00	139,275.00	0.08
338	300115	长盈精密	11,643.00	138,668.13	0.08
339	300773	拉卡拉	7,948.00	138,613.12	0.08
340	300357	我武生物	4,090.00	137,546.70	0.08
341	002572	索菲亚	7,830.00	136,398.60	0.07
342	002249	大洋电机	23,841.00	135,893.70	0.07
343	002183	怡亚通	26,340.00	134,334.00	0.07
344	002675	东诚药业	9,100.00	133,861.00	0.07
345	000403	派林生物	6,700.00	133,732.00	0.07
346	002585	双星新材	10,500.00	131,880.00	0.07
347	000709	河钢股份	58,077.00	131,254.02	0.07
348	000810	创维数字	8,000.00	129,360.00	0.07
349	002727	一心堂	4,900.00	129,360.00	0.07
350	300679	电连技术	3,900.00	128,895.00	0.07
351	002099	海翔药业	15,000.00	128,850.00	0.07
352	002312	川发龙蟒	15,700.00	127,641.00	0.07
353	000027	深圳能源	19,178.00	126,383.02	0.07
354	000825	太钢不锈	32,500.00	125,775.00	0.07
355	300432	富临精工	10,800.00	125,496.00	0.07
356	002221	东华能源	14,500.00	125,425.00	0.07

357	300672	国科微	1,500.00	125,025.00	0.07
358	000883	湖北能源	27,308.00	124,524.48	0.07
359	300298	三诺生物	4,600.00	124,384.00	0.07
360	000581	威孚高科	7,818.00	123,133.50	0.07
361	001227	兰州银行	43,000.00	122,980.00	0.07
362	002984	森麒麟	3,900.00	122,694.00	0.07
363	300776	帝尔激光	1,880.00	122,012.00	0.07
364	002085	万丰奥威	17,500.00	121,275.00	0.07
365	001965	招商公路	12,600.00	120,960.00	0.07
366	000012	南玻A	20,245.00	120,660.20	0.07
367	002701	奥瑞金	26,658.00	120,227.58	0.07
368	300888	稳健医疗	2,880.00	120,009.60	0.07
369	002791	坚朗五金	1,850.00	119,713.50	0.07
370	003022	联泓新科	4,800.00	119,520.00	0.07
371	002985	北摩高科	2,702.00	119,212.24	0.07
372	002690	美亚光电	4,628.00	119,171.00	0.07
373	000422	湖北宜化	10,200.00	117,096.00	0.06
374	300725	药石科技	2,390.00	115,747.70	0.06
375	000035	中国天楹	24,617.00	112,745.86	0.06
376	002511	中顺洁柔	10,098.00	112,592.70	0.06
377	003035	南网能源	15,800.00	112,496.00	0.06
378	002745	木林森	12,219.00	112,414.80	0.06
379	300979	华利集团	2,300.00	112,102.00	0.06
380	000156	华数传媒	12,881.00	112,064.70	0.06
381	000401	冀东水泥	15,200.00	112,024.00	0.06
382	002597	金禾实业	4,738.00	111,816.80	0.06
383	000785	居然之家	29,300.00	111,633.00	0.06
384	000028	国药一致	2,549.00	111,161.89	0.06
385	002250	联化科技	10,600.00	110,876.00	0.06
386	002004	华邦健康	22,156.00	110,780.00	0.06
387	300035	中科电气	9,200.00	110,584.00	0.06
388	301050	雷电微力	1,700.00	110,381.00	0.06
389	301035	润丰股份	1,400.00	109,998.00	0.06
390	002867	周大生	6,100.00	108,458.00	0.06
391	002032	苏泊尔	2,150.00	107,500.00	0.06
392	300618	寒锐钴业	3,308.00	107,212.28	0.06
393	003031	中瓷电子	800.00	106,496.00	0.06
394	000987	越秀资本	16,656.00	105,765.60	0.06
395	300910	瑞丰新材	2,100.00	105,630.00	0.06
396	000598	兴蓉环境	19,452.00	105,624.36	0.06
397	002091	江苏国泰	14,000.00	105,560.00	0.06
398	000930	中粮科技	12,793.00	103,623.30	0.06
399	000555	神州信息	8,387.00	103,160.10	0.06
400	300482	万孚生物	3,860.00	102,791.80	0.06

401	002127	南极电商	26,700.00	102,261.00	0.06
402	002124	天邦食品	22,508.00	102,186.32	0.06
403	000800	一汽解放	12,097.00	101,251.89	0.06
404	300850	新强联	2,700.00	100,926.00	0.06
405	000559	万向钱潮	18,501.00	100,830.45	0.06
406	002468	申通快递	9,307.00	100,701.74	0.06
407	301155	海力风电	1,300.00	100,204.00	0.05
408	300685	艾德生物	4,123.00	100,023.98	0.05
409	300861	美畅股份	2,300.00	99,751.00	0.05
410	300623	捷捷微电	5,400.00	97,848.00	0.05
411	300463	迈克生物	6,432.00	97,251.84	0.05
412	000902	新洋丰	9,403.00	96,662.84	0.05
413	000415	渤海租赁	45,914.00	96,419.40	0.05
414	002773	康弘药业	5,039.00	96,345.68	0.05
415	002010	传化智联	18,034.00	95,940.88	0.05
416	000089	深圳机场	13,671.00	95,013.45	0.05
417	002505	鹏都农牧	49,883.00	94,278.87	0.05
418	002081	金螳螂	20,788.00	93,753.88	0.05
419	300457	赢合科技	5,300.00	93,598.00	0.05
420	001914	招商积余	6,200.00	93,310.00	0.05
421	002048	宁波华翔	6,928.00	92,835.20	0.05
422	000539	粤电力 A	12,700.00	92,710.00	0.05
423	301268	铭利达	2,200.00	92,114.00	0.05
424	000898	鞍钢股份	32,586.00	90,589.08	0.05
425	002237	恒邦股份	8,288.00	90,256.32	0.05
426	301071	力量钻石	2,040.00	89,760.00	0.05
427	300726	宏达电子	2,000.00	89,440.00	0.05
428	300257	开山股份	5,798.00	87,955.66	0.05
429	002423	中粮资本	10,900.00	87,200.00	0.05
430	300737	科顺股份	9,500.00	87,020.00	0.05
431	300171	东富龙	3,800.00	86,450.00	0.05
432	000712	锦龙股份	6,918.00	86,336.64	0.05
433	002948	青岛银行	27,390.00	85,730.70	0.05
434	002705	新宝股份	4,600.00	82,938.00	0.05
435	002041	登海种业	5,400.00	82,458.00	0.05
436	000563	陕国投 A	26,996.00	82,337.80	0.05
437	000958	电投产融	18,900.00	81,837.00	0.04
438	000967	盈峰环境	16,000.00	80,800.00	0.04
439	002626	金达威	4,300.00	80,797.00	0.04
440	000537	广宇发展	6,900.00	80,523.00	0.04
441	002906	华阳集团	2,300.00	78,637.00	0.04
442	000927	中国铁物	28,200.00	78,396.00	0.04
443	000402	金融街	17,344.00	78,394.88	0.04
444	000627	天茂集团	25,934.00	77,802.00	0.04



445	300630	普利制药	3,970.00	77,613.50	0.04
446	002925	盈趣科技	3,980.00	77,212.00	0.04
447	002434	万里扬	8,600.00	76,970.00	0.04
448	002967	广电计量	3,800.00	76,342.00	0.04
449	301029	怡合达	1,644.00	73,453.92	0.04
450	002670	国盛金控	8,353.00	73,339.34	0.04
451	000966	长源电力	13,100.00	73,098.00	0.04
452	002216	三全食品	4,690.00	73,070.20	0.04
453	300761	立华股份	3,820.00	70,402.60	0.04
454	002608	江苏国信	9,300.00	70,401.00	0.04
455	000959	首钢股份	19,950.00	69,825.00	0.04
456	301078	孩子王	6,100.00	69,723.00	0.04
457	002498	汉缆股份	17,300.00	69,373.00	0.04
458	002612	朗姿股份	2,900.00	68,962.00	0.04
459	301047	义翘神州	800.00	68,560.00	0.04
460	300973	立高食品	1,000.00	68,420.00	0.04
461	002110	三钢闽光	16,193.00	68,334.46	0.04
462	001203	大中矿业	6,100.00	67,771.00	0.04
463	000990	诚志股份	8,808.00	67,116.96	0.04
464	002563	森马服饰	10,786.00	67,088.92	0.04
465	300428	立中集团	2,900.00	66,874.00	0.04
466	002653	海思科	2,800.00	66,080.00	0.04
467	000688	国城矿业	4,300.00	65,231.00	0.04
468	000935	四川双马	3,675.00	61,887.00	0.03
469	001872	招商港口	3,500.00	60,445.00	0.03
470	301219	腾远钴业	1,610.00	60,149.60	0.03
471	300841	康华生物	900.00	59,301.00	0.03
472	000672	上峰水泥	6,360.00	58,066.80	0.03
473	301095	广立微	700.00	57,855.00	0.03
474	002242	九阳股份	3,855.00	57,632.25	0.03
475	002945	华林证券	4,200.00	57,456.00	0.03
476	002320	海峡股份	9,321.00	56,298.84	0.03
477	000582	北部湾港	7,400.00	56,240.00	0.03
478	000062	深圳华强	4,734.00	54,062.28	0.03
479	001213	中铁特货	11,900.00	52,479.00	0.03
480	000869	张裕 A	1,704.00	52,244.64	0.03
481	300894	火星人	2,000.00	51,080.00	0.03
482	301308	江波龙	500.00	50,880.00	0.03
483	301238	瑞泰新材	2,400.00	48,816.00	0.03
484	300821	东岳硅材	5,000.00	48,700.00	0.03
485	002461	珠江啤酒	5,500.00	48,455.00	0.03
486	001289	龙源电力	2,100.00	47,250.00	0.03
487	002399	海普瑞	4,068.00	46,659.96	0.03
488	000553	安道麦 A	5,316.00	44,867.04	0.02

489	300741	华宝股份	1,800.00	38,556.00	0.02
490	301207	华兰疫苗	1,100.00	36,586.00	0.02
491	002978	安宁股份	1,100.00	35,321.00	0.02
492	003039	顺控发展	1,900.00	32,224.00	0.02
493	001308	康冠科技	1,070.00	29,382.20	0.02
494	002901	大博医疗	900.00	27,972.00	0.02
495	301200	大族数控	700.00	27,916.00	0.02
496	001322	箭牌家居	1,500.00	25,110.00	0.01
497	301177	迪阿股份	600.00	23,058.00	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	000656	金科股份	64,783.00	71,909.13	0.04
2	301358	湖南裕能	268.00	11,486.48	0.01
3	001278	一彬科技	473.00	11,247.94	0.01
4	301260	格力博	346.00	8,172.52	0.00
5	301303	真兰仪表	318.00	7,097.76	0.00
6	301373	凌玮科技	177.00	5,635.68	0.00
7	301157	华塑科技	96.00	5,080.32	0.00
8	301322	绿通科技	89.00	4,734.80	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	742,995.00	0.39
2	002517	恺英网络	455,080.00	0.24
3	300212	易华录	230,186.00	0.12
4	000858	五粮液	194,562.00	0.10
5	002015	协鑫能科	180,532.00	0.09
6	002317	众生药业	161,584.00	0.08
7	000422	湖北宣化	157,032.00	0.08
8	300760	迈瑞医疗	151,517.00	0.08
9	301269	华大九天	147,610.00	0.08
10	000333	美的集团	145,223.00	0.08

11	002326	永太科技	136,225.00	0.07
12	002607	中公教育	134,548.00	0.07
13	002594	比亚迪	126,835.00	0.07
14	300910	瑞丰新材	124,193.00	0.06
15	300059	东方财富	114,913.00	0.06
16	300376	易事特	107,850.00	0.06
17	301236	软通动力	107,784.00	0.06
18	301260	格力博	106,494.20	0.06
19	001227	兰州银行	100,608.00	0.05
20	002555	三七互娱	96,222.00	0.05

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	720,436.00	0.37
2	000858	五粮液	588,261.00	0.31
3	000333	美的集团	441,281.00	0.23
4	002594	比亚迪	388,509.00	0.20
5	300059	东方财富	353,787.00	0.18
6	002013	中航机电	340,624.50	0.18
7	000568	泸州老窖	299,762.00	0.16
8	002415	海康威视	284,293.00	0.15
9	000651	格力电器	277,608.00	0.14
10	300376	易事特	227,240.00	0.12
11	000725	京东方 A	222,583.00	0.12
12	002475	立讯精密	219,886.00	0.11
13	300760	迈瑞医疗	192,025.00	0.10
14	000001	平安银行	188,941.00	0.10
15	300274	阳光电源	185,265.00	0.10
16	300498	温氏股份	177,321.00	0.09
17	000166	申万宏源	175,794.90	0.09
18	002142	宁波银行	175,327.00	0.09
19	002714	牧原股份	174,216.39	0.09
20	000002	万科 A	170,072.00	0.09

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

金额单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	10,093,912.19
卖出股票收入（成交）总额	19,974,603.55

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

##### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

##### 7.11.2 本期国债期货投资评价

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	3,859.87
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	69,474.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	73,334.29

### 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	301358	湖南裕能	11,486.48	0.01	新股限售
2	301260	格力博	8,172.52	0.00	新股限售
3	301303	真兰仪表	7,097.76	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	19,422	15,514.45	24,660,568.03	8.18%	276,661,148.40	91.82%
申万菱信深证成份指数 C	555	7,188.55	25,288.70	0.63%	3,964,354.04	99.37%
合计	19,945	15,307.66	24,685,856.73	8.09%	280,625,502.44	91.91%

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 期末上市基金前十名持有人

申万菱信深证成份指数A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中国华能集团有限公司企业年金计划—中国工商银行股份有限公司	12,750,304.00	5.23%
2	卢文星	11,814,265.00	4.84%
3	陈恒	10,278,374.00	4.22%
4	栾天	9,940,165.00	4.08%
5	泰康资产管理有限责任公	6,709,859.00	2.75%

	司一开泰一稳健增值投资 产品		
6	李秀芹	6,297,180.00	2.58%
7	王放	4,325,502.00	1.77%
8	漆志涛	3,920,191.00	1.61%
9	秦华曾	3,752,628.00	1.54%
10	夏建白	3,320,280.00	1.36%

申万菱信深证成份指数C

以上数据由中国证券登记结算有限责任公司提供。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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	166.57	0.00%
	申万菱信深证成份指数 C	0.00	0.00%
	合计	166.57	0.00%

注：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）。

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	申万菱信深证成份指数 A	0
	申万菱信深证成份指数 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	申万菱信深证成份指数 A	0
	申万菱信深证成份指数	0

	C	
	合计	0

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	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 1 月 1 日）基金份额总额	712,484,721.40	-
本报告期期初基金份额总额	321,098,972.58	2,587,586.19
本报告期基金总申购份额	3,945,144.66	13,500,600.45
减：本报告期基金总赎回份额	23,722,400.81	12,098,543.90
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	301,321,716.43	3,989,642.74

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

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，基金管理人董事、监事和高级管理人员未发生变更。
- 2、本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的，与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金管理人的基金投资策略严格遵循本基金《招募说明书》中披露的基本投资策略，未发生显著的改变。

### 10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。



## 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

### 10.7.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 10.7.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 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	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
申万宏源证券	2	18,223,732.95	61.69%	16,789.77	61.69%	-
西部证券	1	2,368,004.00	8.02%	2,181.84	8.02%	-
中泰证券	1	2,198,026.28	7.44%	2,025.04	7.44%	-
长城证券	2	1,311,241.24	4.44%	1,208.00	4.44%	-
财通证券	2	1,016,098.18	3.44%	936.03	3.44%	-
东方证券	1	1,005,048.81	3.40%	925.95	3.40%	-
平安证券	1	796,138.41	2.70%	733.51	2.70%	-
光大证券	1	634,730.56	2.15%	584.77	2.15%	-
东方财富证券	2	607,530.17	2.06%	559.71	2.06%	-
民生证券	1	447,892.87	1.52%	412.62	1.52%	-
东吴证券	1	382,504.25	1.29%	352.42	1.29%	-
广发证券	1	362,351.75	1.23%	333.86	1.23%	-
国信证券	1	71,940.88	0.24%	66.28	0.24%	-
兴业证券	1	31,224.49	0.11%	28.77	0.11%	-
信达证券	1	21,760.79	0.07%	20.04	0.07%	-
银河证券	1	19,315.90	0.07%	17.80	0.07%	-
国金证券	2	14,941.70	0.05%	13.77	0.05%	-
东兴证券	1	13,745.60	0.05%	12.67	0.05%	-
中信建投证券	2	13,171.16	0.04%	12.13	0.04%	-
华融证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
华信证券	1	-	-	-	-	-

中航证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	新增
华泰证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
五矿证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安证券	1	-	-	-	-	-
北京高华	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-

注：交易单元选择的标准：1、经营行为规范，在近一年内无重大违规行为；2、公司财务状况良好；3、有良好的内控制度，在业内有良好的声誉；4、有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；5、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

## 11 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；

发售公告；

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.swsmu.com](http://www.swsmu.com)。

申万菱信基金管理有限公司  
二〇二三年八月三十一日