

申万菱信中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

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:中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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	4
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	5
§ 4 管理人报告	6
4.1 基金管理人及基金经理情况	6
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	8
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	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	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	11
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	11
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	15
§ 7 投资组合报告	37
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所有股票投资明细	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
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	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
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
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	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	56
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	56
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	56
§ 12 备查文件目录	57
12.1 备查文件目录	57
12.2 存放地点	57
12.3 查阅方式	57

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	申万菱信中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	申万菱信中证 A500ETF
场内简称	A500ETF 申万菱信
基金主代码	560750
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 01 月 22 日
基金管理人	申万菱信基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	66,554,750.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2025 年 02 月 07 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王菲萍	任航
	联系电话	021-23261188	010-66060069
	电子邮箱	service@swsmu.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008808588	95599
传真		021-23261199	010-68121816
注册地址		上海市中山南路 100 号 11 层	北京市东城区建国门内大街 69 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 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		200010	100031
法定代表人		陈晓升	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告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)
本期已实现收益	22,883,714.67
本期利润	22,844,718.57
加权平均基金份额本期利润	0.1810
本期加权平均净值利润率	13.41%
本期基金份额净值增长率	14.18%
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	25,634,612.93
期末可供分配基金份额利润	0.3852
期末基金资产净值	97,929,309.85
期末基金份额净值	1.4714
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	47.14%

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

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	16.27%	1.39%	14.26%	1.41%	2.01%	-0.02%
过去六个月	14.18%	1.27%	11.91%	1.29%	2.27%	-0.02%
过去一年	40.66%	1.13%	36.38%	1.14%	4.28%	-0.01%
自基金合同生效起至今	47.14%	1.11%	40.11%	1.12%	7.03%	-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：中证 A500 指数收益率。

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 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

申万菱信中证A500交易型开放式指数证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2025年01月22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		
王贇杰	本基金基金经理	2025-01-22	-	14 年	王贇杰先生,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(2020年7月至2022年8月)、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(2022年2月至2023年4月)、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，现任申万菱信中证申万证券行业指数证券投资基金、申万菱信上证 50 交易型开放式指数发起式证券投资基金、申万菱信中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金、申万菱信中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、申万菱信中证内地新能源主题交易型开放式指数证券投资基金、申万菱信沪深 300 价值交易型开放式指数证券投资基金、申万菱信中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金、申万菱信沪深 300 价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金、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、申万菱信中证申万医药生物指数型证券投资基金、申万菱信中证沪港深数字经济主题指数型发起式证券投资基金、申万菱信中证申万电子行业投资指数型证券投资基金（LOF）、申万菱信中证红利指数型证券投资基金、申万菱信中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、申万菱信沪深 300 价值指数证券投资基金、申万菱信中证军工指数型证券投资基金、申万菱信中证 A500 红利低波动指数型证券投资基金、申万菱信恒生港股通科技主题指数型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。

4.2 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》，明确定义了在投资交易过程中出现的各种可能导致不公平交易和利益输送的异常交易类型，并规定且落实了异常交易的日常监控、识别以及事后的分析流程。

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期，未发生我司旗下投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况以及其他可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 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 2026 年上半年，权益市场呈现显著的结构性价轮行情，一方面，得益于市场风险偏好的持续改善、AI 算力的强产业趋势支撑等因素影响，以 AI 算力、半导体为代表的科技板块超额明显，另一方面，受制于短期地缘冲突、避险情绪、全球流动性预期等因素，A 股市场的震荡整固随之出现。

市场方面，虽然权益类指数大多收涨，但内部分化显著，其中，创业板指、深证成指、中小 100 涨幅均超 15%。行业方面，电子、通信、建筑材料等行业表现相对较好，报告期涨幅均超过 45%，而商贸零售、农林牧渔、美容护理、食品饮料、钢铁、传媒、汽车、社会服务等行业表现相对偏弱，报告期涨幅均低于-17%。

操作上，本基金运作主要着眼于控制每日跟踪误差、净值表现和业绩比较基准的偏差幅度。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。

作为被动投资型基金产品，本基金将继续坚持既定的指数化投资策略，以严格控制基金相对标的指数的跟踪偏离为投资目标，追求跟踪误差的最小化。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金报告期内净值表现为 14.18%，同期业绩基准表现为 11.91%。

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，虽然国内流动性宽松基调延续、AI 技术与产业出海等依然具备长期性，但海外不确定性及短期极致分化下市场风格再平衡的必要性同样不容忽视。中长期看，在相对宽松、积极的货币与财政政策下，随着经济基本面的进一步复苏，未来权益市场表现或仍值得关注。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、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

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金在本报告期内出现超过连续二十个工作日基金份额持有人数量不满 200 人的情形。报告期内本基金基金份额持有人数量恢复至 200 人以上。截至本报告期末，本基金的基金份额持有人数量再次低于 200 人。

§ 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，中国农业银行股份有限公司（以下简称“本基金托管人”）在本基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，对本基金的投资运作情况进行了必要的监督，对本基金的基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支、利润分配等方面进行了复核，未发现基金管理人有关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

本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，以自身能够获取的数据和信息为限，对本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行核查，以上内容真实、准确、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：申万菱信中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

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	1,709,806.13	5,002,172.48
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	96,275,571.68	291,367,699.14
其中：股票投资		96,275,571.68	291,367,699.14
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		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	60,492.63	-
资产总计		98,045,870.44	296,369,871.62
负 债 和 净 资 产			
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		-	1,586,551.91
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		11,648.91	37,060.44
应付托管费		3,882.99	12,353.48
应付销售服务费		-	-
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	101,028.69	196,356.00
负债合计		116,560.59	1,832,321.83
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	66,554,750.00	228,554,750.00
未分配利润	6.4.7.8	31,374,559.85	65,982,799.79
净资产合计		97,929,309.85	294,537,549.79
负债和净资产总计		98,045,870.44	296,369,871.62

注：（1）报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.4714 元，基金份额总额 66,554,750.00 份。

（2）本基金基金合同于 2025 年 01 月 22 日生效，上年度可比期间为 2025 年 01 月 22 日至 2025 年 06 月 30 日。

（3）货币资金中包含存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.2 利润表

会计主体：申万菱信中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

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 22 日（基 金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日
一、营业总收入		23,172,114.79	16,600,841.99
1. 利息收入		994.07	423,779.86
其中：存款利息收入	6.4.7.9	994.07	4,699.04
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		-	419,080.82
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		22,951,359.50	12,329,022.03
其中：股票投资收益	6.4.7.10	21,959,537.57	11,008,049.00

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	991,821.93	1,320,973.03
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	-38,996.10	2,640,264.69
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	258,757.32	1,207,775.41
减：二、营业总支出		327,396.22	295,757.06
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	128,388.49	135,885.04
2. 托管费	6.4.10.2.2	42,796.22	45,295.04
3. 销售服务费		-	-
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	156,211.51	114,576.98
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		22,844,718.57	16,305,084.93
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		22,844,718.57	16,305,084.93
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		22,844,718.57	16,305,084.93

6.3 净资产变动表

会计主体：申万菱信中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

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	228,554,750.00	65,982,799.79	294,537,549.79
二、本期期初净资产	228,554,750.00	65,982,799.79	294,537,549.79
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-162,000,000.00	-34,608,239.94	-196,608,239.94

(一)、综合收益总额	-	22,844,718.57	22,844,718.57
(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)	-162,000,000.00	-57,452,958.51	-219,452,958.51
其中: 1. 基金申购款	24,000,000.00	8,513,292.13	32,513,292.13
2. 基金赎回款	-186,000,000.00	-65,966,250.64	-251,966,250.64
(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	66,554,750.00	31,374,559.85	97,929,309.85
项 目	上年度可比期间 2025 年 01 月 22 日(基金合同生效日)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	-	-	-
二、本期期初净资产	474,554,750.00	-	474,554,750.00
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-375,000,000.00	4,584,840.76	-370,415,159.24
(一)、综合收益总额	-	16,305,084.93	16,305,084.93
(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)	-375,000,000.00	-11,720,244.17	-386,720,244.17
其中: 1. 基金申购款	186,000,000.00	4,067,767.68	190,067,767.68
2. 基金赎回款	-561,000,000.00	-15,788,011.85	-576,788,011.85
(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	99,554,750.00	4,584,840.76	104,139,590.76

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

申万菱信中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可【2024】1758 号《关于准予申万菱信中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准，由申万菱信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《申万菱信中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告》发售。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 474,548,000.00 元。经向中国证监会备案,《申万菱信中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2025 年 1 月 22 日生效。基金合同生效日的基金份额总额为 474,554,750.00 份基金份额,其中认购资金利息折合基金份额 6,750.00 份。本基金的基金管理人为申万菱信基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《申万菱信中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和最新公布的《申万菱信中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书》的有关规定,本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。为更好地实现基金的投资目标,本基金可能会少量投资于国内依法发行上市的非成份股(包括主板、创业板及其他依法发行、上市的股票及存托凭证)、债券(含国债、央行票据、金融债、次级债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、可转债及分离交易可转债、可交换债券、地方政府债等)、货币市场工具、债券回购、银行存款、同业存单、股指期货、国债期货、股票期权、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金可以参与融资和转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为:本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%,且不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终,在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金以及股票期权合约需缴纳的现金保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金,其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。股指期货、国债期货、股票期权合约的投资比例遵循国家相关法律法规。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为:中证 A500 指数收益率。

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的要求,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	286,719.07
等于：本金	286,711.07
加：应计利息	8.00
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	1,423,087.06
等于：本金	1,423,046.59
加：应计利息	40.47
减：坏账准备	-
合计	1,709,806.13

注：其他存款本期末余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

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	85,743,342.56	-	96,275,571.68	10,532,229.12
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	85,743,342.56	-	96,275,571.68	10,532,229.12

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

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	60,492.63
合计	60,492.63

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	-
应付证券出借违约金	-

应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
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	27,273.08
预提费用-IOPV 服务费	11,336.09
其他应付	2,912.15
合计	101,028.69

6.4.7.7 实收基金

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	228,554,750.00	228,554,750.00
本期申购	24,000,000.00	24,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-186,000,000.00	-186,000,000.00
本期末	66,554,750.00	66,554,750.00

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	42,256,895.60	23,725,904.19	65,982,799.79
本期期初	42,256,895.60	23,725,904.19	65,982,799.79
本期利润	22,883,714.67	-38,996.10	22,844,718.57
本期基金份额交易产生的变动数	-39,505,997.34	-17,946,961.17	-57,452,958.51
其中：基金申购款	6,733,957.40	1,779,334.73	8,513,292.13
基金赎回款	-46,239,954.74	-19,726,295.90	-65,966,250.64
本期已分配利润	-	-	-
本期末	25,634,612.93	5,739,946.92	31,374,559.85

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	258.75
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	735.32
结算备付金利息收入	-
其他	-

合计	994.07
----	--------

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金产生的利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	16,336,919.69
股票投资收益——赎回差价收入	5,622,617.88
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	21,959,537.57

6.4.7.10.2 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	151,345,774.45
减：卖出股票成本总额	134,882,875.84
减：交易费用	125,978.92
买卖股票差价收入	16,336,919.69

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
赎回基金份额对价总额	251,966,250.64
减：现金支付赎回款总额	121,359,450.64
减：赎回股票成本总额	124,984,182.12
减：交易费用	-
赎回差价收入	5,622,617.88

6.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无股票投资收益-申购差价收入。

6.4.7.10.5 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	991,821.93
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	991,821.93

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	-38,996.10
——股票投资	-38,996.10
——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	-38,996.10

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	-
ETF 基金替代损益-管理端	258,757.32
合计	258,757.32

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	27,273.08
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
注册登记费	59,507.37
银行汇划费	615.00
IOPV 服务费	9,308.69
合计	156,211.51

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
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
中国农业银行股份有限公司	基金托管人
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
申万菱信中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	该基金是本基金的联接基金

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 22 日（基金合同生效日） 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	199,811,636.49	100.00%	892,833,450.34	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

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 22 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
申万宏源证券有限公司	-	-	850,950,000.00	100.00%

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	37,486.51	100.00%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2025 年 01 月 22 日（基金合同生效日）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	169,265.19	100.00%	0.00	0.00%

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 22 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	128,388.49	135,885.04
其中：应支付销售机构的客户维护费	21,565.23	19,076.08
应支付基金管理人的净管理费	106,823.26	116,808.96

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.15% 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 22 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	42,796.22	45,295.04

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.05% 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。

6.4.10.3 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026 年 06 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
申万菱信中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	35,099,000.00	52.74%	137,240,000.00	60.05%
申万宏源证券有限公司	2,141,900.00	3.22%	3,635,000.00	1.59%

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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 01 月 22 日（基金合同生效日）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
中国农业银行股份有限公司	286,719.07	258.75	322,924.78	1,689.87
申万宏源证券有限公司	1,423,087.06	735.32	1,880,042.13	3,009.17

注：本基金券商资金账户的存款为本基金存放于申万宏源证券有限公司专用证券账户的证券交易结算资金，按协议约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期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，本基金持有基金托管人中国农业银行股份有限公司发行的证券农业银行（证券代码：601288）共计 83,200.00 股（上年度末 291,700.00 股），占基金资产净值比例 0.52%（上年度末 0.76%）。

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	305	14,054.40	174,456.95	-
688808	联讯仪器	2026 年 04 月 16 日	1-6 个月(含)	新股限售	81.88	2,086.66	42	3,438.96	87,639.72	-
688820	盛合晶微	2026 年 04 月 13 日	1-6 个月(含)	新股限售	19.68	170.81	277	5,451.36	47,314.37	-
688813	泰金新能	2026 年 03 月 24 日	1-6 个月(含)	新股限售	26.28	182.77	158	4,152.24	28,877.66	-
688785	恒运昌	2026 年 01 月 20 日	1-6 个月(含)	新股限售	92.18	462.56	62	5,715.16	28,678.72	-
001257	盛龙股份	2026 年 03 月 24 日	1-6 个月(含)	新股限售	7.82	25.28	861	6,733.02	21,766.08	-
688635	长进光子	2026 年 05 月 20 日	1-6 个月(含)	新股限售	40.98	405.52	51	2,089.98	20,681.52	-

		日		售						
688811	有研复材	2026 年 04 月 01 日	1-6 个月(含)	新股限售	6.41	27.75	645	4,134.45	17,898.75	-
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	1-6 个月(含)	新股限售	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
301531	春光集团	2026 年 04 月 28 日	1-6 个月(含)	新股限售	13.30	66.90	208	2,766.40	13,915.20	-
301696	三瑞智能	2026 年 03 月 31 日	1-6 个月(含)	新股限售	24.68	104.80	132	3,257.76	13,833.60	-
603459	红板科技	2026 年 03 月 31 日	1-6 个月(含)	新股限售	17.70	99.76	136	2,407.20	13,567.36	-
301599	理奇智能	2026 年 04 月 22 日	1-6 个月(含)	新股限售	13.91	40.66	221	3,074.11	8,985.86	-
301669	高特电子	2026 年 06 月 02 日	1-6 个月(含)	新股限售	7.08	37.52	219	1,550.52	8,216.88	-
301513	尚水智能	2026 年 04 月 10 日	1-6 个月(含)	新股限售	26.66	63.44	126	3,359.16	7,993.44	-
301680	固德电材	2026 年 02 月 27 日	1-6 个月(含)	新股限售	58.00	112.13	70	4,060.00	7,849.10	-
001365	天海电子	2026 年 05 月 11 日	1-6 个月(含)	新股限售	27.19	36.79	186	5,057.34	6,842.94	-
001393	维通利	2026 年 05 月 08 日	1-6 个月(含)	新股限	30.38	48.48	129	3,919.02	6,253.92	-

		日		售						
301683	慧谷新材	2026 年 03 月 24 日	1-6 个月(含)	新股限售	78.38	129.27	46	3,605.48	5,946.42	-
688816	易思维	2026 年 02 月 04 日	1-6 个月(含)	新股限售	55.95	57.08	96	5,371.20	5,479.68	-
601112	振石股份	2026 年 01 月 21 日	1-6 个月(含)	新股限售	11.18	17.57	231	2,582.58	4,058.67	-
603435	嘉德利	2026 年 05 月 15 日	1-6 个月(含)	新股限售	15.76	60.62	61	961.36	3,697.82	-
001237	惠康科技	2026 年 05 月 15 日	1-6 个月(含)	新股限售	53.26	65.85	54	2,876.04	3,555.90	-
688781	视涯科技	2026 年 03 月 18 日	1-6 个月(含)	新股限售	22.68	47.60	66	1,496.88	3,141.60	-
603284	林平发展	2026 年 02 月 03 日	1-6 个月(含)	新股限售	37.88	34.86	46	1,742.48	1,603.56	-
001220	世盟股份	2026 年 01 月 27 日	1-6 个月(含)	新股限售	28.00	27.77	57	1,596.00	1,582.89	-
603293	埃泰克	2026 年 04 月 09 日	1-6 个月(含)	新股限售	33.49	38.45	35	1,172.15	1,345.75	-
001312	福恩股份	2026 年 04 月 14 日	1-6 个月(含)	新股限售	18.38	18.20	70	1,286.60	1,274.00	-

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
688072	拓荆科技	2026-06-29	重大事项停牌	832.00	2026-07-13	890.99	500	118,465.64	416,000.00	-

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之内。

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，其他存款存放在本基金的结算机构的证券账户内，本基金管理人认为与以上银行及结算机构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。本基金为跨市场 ETF 基金，该类基金的流动性风险主要来自于投资组合中的成分股数量或现金大幅减少，甚至接近于 0，从而导致赎回的投资者无法获得相应的股票或现金。

为应对上述流动性风险，本基金管理人一方面已建立日常对标的指数成份股公司行为信息以及指数调整事项进行紧密跟踪的机制，通过分析这些信息对指数的影响，合理设置成份股的现金替代方式；另一方面，本基金管理人已经建立日常针对申购赎回状况等的系统化动态监控机制，评估对于现金以及成份股持仓的影响，对可能出现的流动性风险的情形及早发现并及时处理，防范风险；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来应对。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金主要采取完全复制法，复制中证 A500 指数，因此本基金拟投资市场、行业及资产的流动性良好，流动性风险相对可控。此外，本基金为上交所跨市场 ETF，其中上交所上市的成分股主要采用实物申赎，即当 ETF 基金持有人赎回份额的时候，基金管理人将一篮子股票交回持有人，而不需要在市场上直接卖出股票，从而避免了由于大额赎回而被迫大量卖出股票的情况。深交所上市的成份股采用退补现金替代方式，即指在赎回基金份额时，该成份证券必须使用现金作为替代，根据基金管理人代卖情况，与投资者进行退款或补款。本基金标的指数成份股的变现能力较好，可满足大比例赎回变现需求。但在极端行情下，由于成分股停牌等原因，可能存在无法满足大额赎回需求的问题，基金管理人将审慎操作，通过 1）更改 PCF 清单标志；2）借助金融衍生品；3）设定赎回

上限等方法，应对基金流动性风险。因此，大额赎回给基金带来的流动性风险较小。

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。

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%。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。

综合上述分析，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	1,709,806 .13	-	-	-	-	-	1,709,806 .13
结算备付 金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证 金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金 融资产	-	-	-	-	-	96,275,57 1.68	96,275,57 1.68
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融 资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售	-	-	-	-	-	-	-

金融资产							
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	60,492.63	60,492.63
资产总计	1,709,806.13	-	-	-	-	96,336,064.31	98,045,870.44
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	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	11,648.91	11,648.91
应付托管费	-	-	-	-	-	3,882.99	3,882.99
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	101,028.69	101,028.69
负债总计	-	-	-	-	-	116,560.59	116,560.59
利率敏感度缺口	1,709,806.13	-	-	-	-	96,219,503.72	97,929,309.85
上年度末	1 个月以	1-3 个月	3 个月-1	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

2025 年 12 月 31 日	内		年				
资产							
货币资金	5,002,172.48	-	-	-	-	-	5,002,172.48
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-	-	291,367,699.14	291,367,699.14
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	5,002,172.48	-	-	-	-	291,367,699.14	296,369,871.62
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	-	-	-	-	-	1,586,551.91	1,586,551.91
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	37,060.44	37,060.44
应付托管费	-	-	-	-	-	12,353.48	12,353.48
应付销售	-	-	-	-	-	-	-

服务费							
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	-	-	-	-	-	196,356.0 0	196,356.0 0
负债总计	-	-	-	-	-	1,832,321 .83	1,832,321 .83
利率敏感 度缺口	5,002,172 .48	-	-	-	-	289,535,3 77.31	294,537,5 49.79

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，标的指数成份股和备选成份股的资产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份股构成及其权重构建基金股票投资组合。当预期成份股发生调整，成份股发生分红、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	96,275,571.68	98.31	291,367,699.14	98.92
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	96,275,571.68	98.31	291,367,699.14	98.92

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%	5,380,000.00	15,550,000.00
	基准下降 5%	-5,380,000.00	-15,550,000.00

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	95,297,946.22	289,396,616.48
第二层次	416,000.00	1,706,394.36
第三层次	561,625.46	264,688.30
合计	96,275,571.68	291,367,699.14

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	96,275,571.68	98.19
	其中：股票	96,275,571.68	98.19
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	1,709,806.13	1.74
8	其他各项资产	60,492.63	0.06
9	合计	98,045,870.44	100.00

注：上述股票投资包括可退替代款估值增值。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	302,057.00	0.31
B	采矿业	3,972,516.44	4.06
C	制造业	68,030,544.68	69.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,089,435.00	2.13
E	建筑业	1,170,246.00	1.19
F	批发和零售业	756,768.00	0.77
G	交通运输、仓储和邮政业	2,144,696.89	2.19
H	住宿和餐饮业	44,135.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,435,866.07	5.55
J	金融业	9,315,156.00	9.51
K	房地产业	536,507.00	0.55
L	租赁和商务服务业	692,274.00	0.71
M	科学研究和技术服务业	1,151,224.00	1.18
N	水利、环境和公共设施管理业	164,990.60	0.17
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	32,220.00	0.03
Q	卫生和社会工作	187,775.00	0.19
R	文化、体育和娱乐业	73,304.00	0.07
S	综合	175,856.00	0.18
	合计	96,275,571.68	98.31

注：上述股票投资组合不包括可退替代款估值增值。

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

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	3,200	4,064,000.00	4.15
2	300750	宁德时代	7,700	3,026,177.00	3.09
3	300502	新易盛	4,044	2,454,708.00	2.51
4	600519	贵州茅台	1,800	2,133,882.00	2.18
5	688256	寒武纪	976	1,557,256.80	1.59
6	603986	兆易创新	1,900	1,548,500.00	1.58
7	601318	中国平安	30,900	1,475,166.00	1.51
8	600036	招商银行	35,900	1,274,450.00	1.30
9	601899	紫金矿业	47,800	1,201,692.00	1.23
10	002371	北方华创	1,295	1,145,505.20	1.17

11	000333	美的集团	14,100	1,064,973.00	1.09
12	002475	立讯精密	14,800	1,041,920.00	1.06
13	688008	澜起科技	3,232	1,001,596.80	1.02
14	688012	中微公司	2,082	975,417.00	1.00
15	002384	东山精密	3,700	970,695.00	0.99
16	688041	海光信息	2,584	956,855.20	0.98
17	600900	长江电力	35,400	937,038.00	0.96
18	000725	京东方 A	105,300	914,004.00	0.93
19	688981	中芯国际	5,689	903,526.98	0.92
20	603259	药明康德	7,200	896,472.00	0.92
21	600030	中信证券	28,300	813,059.00	0.83
22	601166	兴业银行	49,090	812,930.40	0.83
23	300059	东方财富	36,700	747,946.00	0.76
24	600183	生益科技	4,200	728,280.00	0.74
25	600276	恒瑞医药	12,900	671,316.00	0.69
26	300274	阳光电源	4,200	667,884.00	0.68
27	601398	工商银行	93,700	662,459.00	0.68
28	300408	三环集团	3,900	650,910.00	0.66
29	002594	比亚迪	7,900	629,630.00	0.64
30	300476	胜宏科技	1,800	623,574.00	0.64
31	600487	亨通光电	5,700	623,238.00	0.64
32	002463	沪电股份	3,900	595,920.00	0.61
33	601211	国泰海通	32,700	595,140.00	0.61
34	300394	天孚通信	1,904	576,302.72	0.59
35	688498	源杰科技	300	565,800.00	0.58
36	688525	佰维存储	1,100	544,203.00	0.56
37	000988	华工科技	2,900	535,369.00	0.55
38	600176	中国巨石	7,000	510,160.00	0.52
39	601288	农业银行	83,200	505,024.00	0.52
40	601328	交通银行	77,300	497,039.00	0.51
41	301308	江波龙	700	492,660.00	0.50
42	000651	格力电器	13,000	487,500.00	0.50
43	600522	中天科技	7,900	479,372.00	0.49
44	603019	中科曙光	4,200	450,366.00	0.46
45	688521	芯原股份	1,200	445,368.00	0.45
46	603993	洛阳钼业	25,300	444,015.00	0.45
47	300604	长川科技	1,295	442,138.90	0.45
48	600150	中国船舶	13,067	441,533.93	0.45
49	600887	伊利股份	18,300	438,468.00	0.45
50	000338	潍柴动力	15,600	425,100.00	0.43
51	600584	长电科技	4,100	424,555.00	0.43
52	688072	拓荆科技	500	416,000.00	0.42
53	000858	五粮液	5,600	414,400.00	0.42

54	688347	华虹宏力	1,200	403,560.00	0.41
55	601816	京沪高铁	85,000	385,050.00	0.39
56	002916	深南电路	830	380,057.00	0.39
57	600309	万华化学	5,400	369,414.00	0.38
58	300124	汇川技术	5,500	364,815.00	0.37
59	002415	海康威视	10,600	362,520.00	0.37
60	002008	大族激光	2,400	360,264.00	0.37
61	002281	光迅科技	1,400	359,716.00	0.37
62	688120	华海清科	1,109	357,297.62	0.36
63	000100	TCL 科技	60,300	350,946.00	0.36
64	600111	北方稀土	7,300	350,765.00	0.36
65	300857	协创数据	1,000	339,900.00	0.35
66	000063	中兴通讯	9,300	336,567.00	0.34
67	300136	信维通信	2,800	333,900.00	0.34
68	600000	浦发银行	38,600	332,346.00	0.34
69	600089	特变电工	14,600	328,500.00	0.34
70	601857	中国石油	37,500	325,500.00	0.33
71	601088	中国神华	8,000	312,320.00	0.32
72	002028	思源电气	1,800	311,400.00	0.32
73	300433	蓝思科技	5,800	311,228.00	0.32
74	300475	香农芯创	1,000	300,000.00	0.31
75	600031	三一重工	17,200	297,216.00	0.30
76	300014	亿纬锂能	4,424	287,692.72	0.29
77	002050	三花智控	6,500	284,895.00	0.29
78	000001	平安银行	28,100	282,405.00	0.29
79	601601	中国太保	9,900	282,348.00	0.29
80	000792	盐湖股份	9,200	277,748.00	0.28
81	002714	牧原股份	7,900	276,421.00	0.28
82	002353	杰瑞股份	1,800	274,500.00	0.28
83	300223	北京君正	1,100	273,790.00	0.28
84	600549	厦门钨业	3,200	272,640.00	0.28
85	600406	国电南瑞	11,628	265,699.80	0.27
86	002156	通富微电	3,500	265,545.00	0.27
87	601668	中国建筑	59,900	259,966.00	0.27
88	002436	兴森科技	4,900	249,655.00	0.25
89	000657	中钨高新	2,600	248,872.00	0.25
90	300760	迈瑞医疗	1,800	244,494.00	0.25
91	601919	中远海控	18,200	241,332.00	0.25
92	002602	世纪华通	17,100	241,110.00	0.25
93	601988	中国银行	41,500	237,380.00	0.24
94	603501	豪威集团	2,500	237,125.00	0.24
95	601728	中国电信	45,000	233,550.00	0.24
96	300054	鼎龙股份	2,200	233,134.00	0.24

97	600660	福耀玻璃	4,600	232,024.00	0.24
98	601012	隆基绿能	17,596	230,859.52	0.24
99	002230	科大讯飞	5,600	228,704.00	0.23
100	601225	陕西煤业	11,200	227,920.00	0.23
101	600941	中国移动	2,600	223,938.00	0.23
102	600690	海尔智家	10,900	222,469.00	0.23
103	002352	顺丰控股	7,000	218,820.00	0.22
104	002460	赣锋锂业	3,300	215,820.00	0.22
105	688777	中控技术	1,835	215,612.50	0.22
106	601985	中国核电	23,800	214,914.00	0.22
107	603799	华友钴业	4,400	212,344.00	0.22
108	300033	同花顺	880	212,080.00	0.22
109	002709	天赐材料	4,100	210,863.00	0.22
110	002938	鹏鼎控股	2,000	210,760.00	0.22
111	000977	浪潮信息	3,000	210,000.00	0.21
112	600160	巨化股份	3,900	206,739.00	0.21
113	002851	麦格米特	1,200	200,616.00	0.20
114	300442	润泽科技	2,400	199,368.00	0.20
115	000425	徐工机械	23,800	192,542.00	0.20
116	002202	金风科技	8,000	191,200.00	0.20
117	300567	精测电子	600	190,560.00	0.19
118	000938	紫光股份	6,600	190,476.00	0.19
119	601600	中国铝业	23,000	189,060.00	0.19
120	300346	南大光电	2,040	189,006.00	0.19
121	600028	中国石化	42,200	188,212.00	0.19
122	688126	沪硅产业	4,700	187,483.00	0.19
123	600938	中国海油	6,900	187,335.00	0.19
124	600460	士兰微	3,400	185,844.00	0.19
125	300757	罗博特科	300	185,700.00	0.19
126	002466	天齐锂业	3,000	183,960.00	0.19
127	002600	领益智造	10,600	183,804.00	0.19
128	601766	中国中车	35,200	183,040.00	0.19
129	600050	中国联通	45,300	181,200.00	0.19
130	300661	圣邦股份	1,240	177,915.20	0.18
131	002049	紫光国微	2,000	177,500.00	0.18
132	002837	英维克	2,210	175,827.60	0.18
133	301666	大普微	305	174,456.95	0.18
134	601100	恒立液压	1,601	172,203.56	0.18
135	002185	华天科技	7,700	171,787.00	0.18
136	002080	中材科技	1,900	171,000.00	0.17
137	002179	中航光电	3,700	170,940.00	0.17
138	002407	多氟多	3,400	170,782.00	0.17
139	601628	中国人寿	4,800	169,680.00	0.17

140	002138	顺络电子	2,300	168,130.00	0.17
141	601872	招商轮船	9,400	165,158.00	0.17
142	000568	泸州老窖	2,100	162,792.00	0.17
143	002241	歌尔股份	7,200	162,216.00	0.17
144	600879	航天电子	7,600	161,804.00	0.17
145	300395	菲利华	1,200	160,476.00	0.16
146	000408	藏格矿业	2,300	159,436.00	0.16
147	603288	海天味业	4,800	159,168.00	0.16
148	601006	大秦铁路	34,500	159,045.00	0.16
149	300390	天华新能	1,700	158,967.00	0.16
150	601658	邮储银行	31,900	157,267.00	0.16
151	605117	德业股份	1,464	155,447.52	0.16
152	688002	睿创微纳	1,000	154,690.00	0.16
153	688469	芯联集成	14,500	153,845.00	0.16
154	600905	三峡能源	41,400	153,594.00	0.16
155	600489	中金黄金	8,400	151,620.00	0.15
156	002625	光启技术	5,000	151,600.00	0.15
157	601888	中国中免	2,800	150,388.00	0.15
158	600893	航发动力	3,900	149,526.00	0.15
159	000630	铜陵有色	23,300	148,188.00	0.15
160	600673	东阳光	4,400	147,752.00	0.15
161	601127	赛力斯	2,400	147,000.00	0.15
162	600010	宝钢股份	65,500	146,065.00	0.15
163	688271	联影医疗	1,417	143,442.91	0.15
164	300058	蓝色光标	10,400	143,104.00	0.15
165	002273	水晶光电	4,000	141,920.00	0.14
166	002027	分众传媒	29,300	141,812.00	0.14
167	300751	迈为股份	500	141,230.00	0.14
168	601689	拓普集团	2,500	141,050.00	0.14
169	600118	中国卫星	1,700	139,485.00	0.14
170	300037	新宙邦	1,500	139,275.00	0.14
171	600019	宝钢股份	25,200	136,836.00	0.14
172	688396	华润微	1,400	136,570.00	0.14
173	600760	中航沈飞	3,300	135,630.00	0.14
174	000426	兴业银锡	4,100	135,136.00	0.14
175	000807	云铝股份	6,000	132,840.00	0.14
176	300450	先导智能	3,200	130,304.00	0.13
177	601168	西部矿业	4,800	130,272.00	0.13
178	600989	宝丰能源	6,400	130,112.00	0.13
179	600362	江西铜业	3,000	129,900.00	0.13
180	600104	上汽集团	13,300	129,808.00	0.13
181	601727	上海电气	18,300	128,100.00	0.13
182	002001	新和成	4,500	127,890.00	0.13

183	605589	圣泉集团	2,000	127,140.00	0.13
184	600875	东方电气	4,400	126,588.00	0.13
185	600988	赤峰黄金	4,800	126,336.00	0.13
186	688017	绿的谐波	300	125,358.00	0.13
187	002126	银轮股份	2,500	124,500.00	0.13
188	002738	中矿资源	2,100	123,879.00	0.13
189	601390	中国中铁	29,700	123,849.00	0.13
190	000960	锡业股份	2,900	123,801.00	0.13
191	688099	晶晨股份	1,200	123,480.00	0.13
192	002422	科伦药业	3,200	123,264.00	0.13
193	000538	云南白药	2,600	123,162.00	0.13
194	600667	太极实业	4,200	122,556.00	0.13
195	600885	宏发股份	3,540	122,094.60	0.12
196	000831	中国稀土	2,200	122,078.00	0.12
197	600392	盛和资源	4,100	122,057.00	0.12
198	600795	国电电力	25,800	120,486.00	0.12
199	600547	山东黄金	5,200	120,068.00	0.12
200	600418	江淮汽车	4,600	118,818.00	0.12
201	600585	海螺水泥	7,000	118,650.00	0.12
202	601669	中国电建	25,000	117,500.00	0.12
203	002648	卫星化学	4,900	115,101.00	0.12
204	300316	晶盛机电	1,900	114,760.00	0.12
205	688111	金山办公	538	114,620.90	0.12
206	300782	卓胜微	1,040	113,963.20	0.12
207	301358	湖南裕能	1,500	113,805.00	0.12
208	002812	恩捷股份	1,700	113,747.00	0.12
209	002129	TCL 中环	9,400	112,988.00	0.12
210	600141	兴发集团	2,400	112,728.00	0.12
211	600096	云天化	3,700	112,480.00	0.11
212	300015	爱尔眼科	13,500	111,510.00	0.11
213	601179	中国西电	7,400	110,408.00	0.11
214	600482	中国动力	3,300	108,240.00	0.11
215	601868	中国能建	40,500	108,135.00	0.11
216	600346	恒力石化	6,100	108,031.00	0.11
217	002558	巨人网络	3,900	107,484.00	0.11
218	002195	岩山科技	16,400	107,256.00	0.11
219	000066	中国长城	5,600	106,680.00	0.11
220	600497	驰宏锌锗	8,800	106,568.00	0.11
221	600580	卧龙电驱	3,200	105,920.00	0.11
222	300418	昆仑万维	2,600	104,936.00	0.11
223	000625	长安汽车	14,400	103,248.00	0.11
224	600426	华鲁恒升	4,300	102,856.00	0.11
225	600066	宇通客车	3,800	101,878.00	0.10

226	600157	永泰能源	63,200	101,752.00	0.10
227	002532	天山铝业	9,400	100,862.00	0.10
228	300803	指南针	1,100	100,837.00	0.10
229	600221	海航控股	74,500	100,575.00	0.10
230	600895	张江高科	2,700	100,575.00	0.10
231	000157	中联重科	14,400	100,368.00	0.10
232	688036	传音控股	1,700	100,215.00	0.10
233	605499	东鹏饮料	810	99,978.30	0.10
234	600711	盛屯矿业	9,000	98,730.00	0.10
235	600436	片仔癀	900	98,352.00	0.10
236	002340	格林美	14,800	97,828.00	0.10
237	000933	神火股份	4,600	97,520.00	0.10
238	002821	凯莱英	600	97,200.00	0.10
239	600011	华能国际	12,700	96,393.00	0.10
240	600048	保利发展	20,800	96,304.00	0.10
241	600143	金发科技	6,200	95,790.00	0.10
242	600438	通威股份	7,800	94,458.00	0.10
243	600115	中国东航	24,700	94,107.00	0.10
244	002236	大华股份	5,700	93,993.00	0.10
245	300017	网宿科技	7,200	93,672.00	0.10
246	002493	荣盛石化	8,700	93,525.00	0.10
247	600570	恒生电子	4,400	93,236.00	0.10
248	600886	国投电力	7,000	93,170.00	0.10
249	002131	利欧股份	19,600	93,100.00	0.10
250	688047	龙芯中科	600	92,802.00	0.09
251	002456	欧菲光	9,750	92,235.00	0.09
252	600352	浙江龙盛	7,500	90,825.00	0.09
253	603659	璞泰来	3,100	89,683.00	0.09
254	003816	中国广核	22,800	89,148.00	0.09
255	601233	桐昆股份	4,100	88,765.00	0.09
256	300339	润和软件	2,300	88,573.00	0.09
257	000301	东方盛虹	7,700	88,165.00	0.09
258	688235	百济神州	346	88,095.06	0.09
259	601360	三六零	10,100	87,769.00	0.09
260	601058	赛轮轮胎	7,606	87,697.18	0.09
261	688808	联讯仪器	42	87,639.72	0.09
262	300759	康龙化成	3,000	86,790.00	0.09
263	600026	中远海能	4,800	86,112.00	0.09
264	002074	国轩高科	3,100	85,281.00	0.09
265	002555	三七互娱	4,500	84,915.00	0.09
266	600009	上海机场	3,600	83,160.00	0.08
267	600196	复星医药	3,700	83,139.00	0.08
268	002472	双环传动	2,000	83,020.00	0.08

269	300438	鹏辉能源	1,000	82,850.00	0.08
270	000768	中航西飞	4,000	81,920.00	0.08
271	601111	中国国航	13,500	81,675.00	0.08
272	300207	欣旺达	4,300	81,657.00	0.08
273	688122	西部超导	1,300	81,653.00	0.08
274	000975	山金国际	4,800	81,600.00	0.08
275	688213	思特威	761	81,480.27	0.08
276	002517	恺英网络	5,000	81,250.00	0.08
277	600029	南方航空	15,600	80,808.00	0.08
278	600415	小商品城	7,900	80,264.00	0.08
279	600219	南山铝业	20,000	79,800.00	0.08
280	300001	特锐德	2,100	79,443.00	0.08
281	600674	川投能源	5,600	79,352.00	0.08
282	601186	中国铁建	13,300	79,135.00	0.08
283	002601	龙佰集团	4,800	79,104.00	0.08
284	300458	全志科技	2,000	78,920.00	0.08
285	600233	圆通速递	5,000	78,750.00	0.08
286	002128	电投能源	3,403	78,677.36	0.08
287	002595	豪迈科技	1,675	78,055.00	0.08
288	601117	中国化学	10,600	77,910.00	0.08
289	601877	正泰电器	3,100	77,717.00	0.08
290	688578	艾力斯	709	77,422.80	0.08
291	603129	春风动力	300	76,740.00	0.08
292	301236	软通动力	1,800	76,410.00	0.08
293	002155	湖南黄金	3,200	76,384.00	0.08
294	600372	中航机载	7,000	75,950.00	0.08
295	300115	长盈精密	2,700	75,438.00	0.08
296	600839	四川长虹	10,700	74,686.00	0.08
297	002465	海格通信	5,800	74,066.00	0.08
298	002920	德赛西威	900	73,350.00	0.07
299	300568	星源材质	3,900	73,008.00	0.07
300	300347	泰格医药	1,500	72,000.00	0.07
301	600741	华域汽车	4,600	71,392.00	0.07
302	000547	航天发展	3,700	70,855.00	0.07
303	000963	华东医药	2,500	70,300.00	0.07
304	300024	机器人	3,600	69,588.00	0.07
305	603650	彤程新材	700	68,586.00	0.07
306	002130	沃尔核材	3,600	68,256.00	0.07
307	300496	中科创达	1,100	67,969.00	0.07
308	300012	华测检测	4,900	67,914.00	0.07
309	688676	金盘科技	800	67,712.00	0.07
310	300454	深信服	700	67,340.00	0.07
311	002497	雅化集团	3,300	67,221.00	0.07

312	001979	招商蛇口	10,400	66,872.00	0.07
313	000878	云南铜业	4,200	66,696.00	0.07
314	300474	景嘉微	1,100	66,528.00	0.07
315	000034	神州数码	2,360	65,490.00	0.07
316	300083	创世纪	4,800	65,376.00	0.07
317	002444	巨星科技	2,100	65,310.00	0.07
318	002271	东方雨虹	5,500	65,285.00	0.07
319	688331	荣昌生物	500	65,130.00	0.07
320	002414	高德红外	4,900	64,974.00	0.07
321	603979	金诚信	1,100	64,933.00	0.07
322	601021	春秋航空	1,400	63,812.00	0.07
323	002432	九安医疗	900	63,612.00	0.06
324	300763	锦浪科技	700	63,245.00	0.06
325	601319	中国人保	9,300	62,868.00	0.06
326	300866	安克创新	600	62,700.00	0.06
327	300073	当升科技	1,300	62,452.00	0.06
328	000733	振华科技	1,100	62,304.00	0.06
329	002756	永兴材料	1,100	62,304.00	0.06
330	300748	金力永磁	2,000	61,700.00	0.06
331	300919	中伟新材	1,400	61,250.00	0.06
332	002078	太阳纸业	4,900	61,201.00	0.06
333	002025	航天电器	800	60,976.00	0.06
334	600699	均胜电子	2,800	60,508.00	0.06
335	300432	富临精工	3,000	60,270.00	0.06
336	601615	明阳智能	5,200	60,164.00	0.06
337	000661	长春高新	900	59,940.00	0.06
338	603606	东方电缆	1,440	59,774.40	0.06
339	601677	明泰铝业	3,600	59,760.00	0.06
340	300142	沃森生物	4,600	59,754.00	0.06
341	600039	四川路桥	7,600	59,432.00	0.06
342	000423	东阿阿胶	1,300	58,968.00	0.06
343	601800	中国交建	10,300	58,813.00	0.06
344	688266	泽璟制药	500	58,330.00	0.06
345	000002	万科 A	19,700	58,312.00	0.06
346	002252	上海莱士	13,400	58,156.00	0.06
347	688599	天合光能	4,100	57,892.00	0.06
348	600226	亨通股份	6,000	57,540.00	0.06
349	603087	甘李药业	1,000	56,760.00	0.06
350	688223	晶科能源	11,900	56,525.00	0.06
351	300724	捷佳伟创	800	56,480.00	0.06
352	002064	华峰化学	5,800	55,042.00	0.06
353	601633	长城汽车	3,600	54,324.00	0.06
354	000786	北新建材	3,000	54,270.00	0.06

355	600588	用友网络	5,900	54,162.00	0.06
356	001965	招商公路	5,900	54,044.00	0.06
357	688188	柏楚电子	504	53,776.80	0.05
358	002831	裕同科技	1,500	53,340.00	0.05
359	688169	石头科技	560	53,183.20	0.05
360	302132	中航成飞	900	52,488.00	0.05
361	300972	万辰集团	300	52,023.00	0.05
362	002294	信立泰	1,600	51,024.00	0.05
363	300677	英科医疗	1,300	50,921.00	0.05
364	600516	方大炭素	8,200	50,594.00	0.05
365	000519	中兵红箭	2,400	50,568.00	0.05
366	601618	中国中冶	20,700	50,508.00	0.05
367	600177	雅戈尔	6,700	50,451.00	0.05
368	603806	福斯特	3,000	50,370.00	0.05
369	000623	吉林敖东	2,800	49,644.00	0.05
370	601607	上海医药	3,200	49,280.00	0.05
371	002176	江特电机	4,900	49,049.00	0.05
372	300699	光威复材	1,700	48,705.00	0.05
373	603260	合盛硅业	1,000	48,260.00	0.05
374	000617	中油资本	7,300	48,107.00	0.05
375	688065	凯赛生物	1,000	47,850.00	0.05
376	002318	久立特材	2,000	47,800.00	0.05
377	002085	万丰奥威	4,300	47,687.00	0.05
378	688180	君实生物	1,405	47,517.10	0.05
379	688820	盛合晶微	277	47,314.37	0.05
380	300342	天银机电	1,000	47,000.00	0.05
381	002459	晶澳科技	5,800	46,980.00	0.05
382	300251	光线传媒	4,200	46,578.00	0.05
383	002065	东华软件	6,500	46,410.00	0.05
384	600085	同仁堂	2,000	46,220.00	0.05
385	300832	新产业	1,100	46,200.00	0.05
386	002266	浙富控股	9,100	46,046.00	0.05
387	300409	道氏技术	2,300	45,839.00	0.05
388	002044	美年健康	9,100	45,773.00	0.05
389	301550	斯菱智驱	500	45,715.00	0.05
390	300558	贝达药业	700	45,549.00	0.05
391	600499	科达制造	3,300	45,540.00	0.05
392	600515	海南机场	16,600	45,484.00	0.05
393	603596	伯特利	1,820	45,208.80	0.05
394	000032	深桑达 A	1,800	44,910.00	0.05
395	002405	四维图新	6,900	44,643.00	0.05
396	605090	九丰能源	1,200	44,604.00	0.05
397	000400	许继电气	2,050	44,485.00	0.05

398	688472	阿特斯	4,100	44,362.00	0.05
399	688005	容百科技	1,443	44,155.80	0.05
400	000415	渤海租赁	10,800	43,956.00	0.04
401	300003	乐普医疗	3,700	43,845.00	0.04
402	601216	君正集团	9,800	43,708.00	0.04
403	002223	鱼跃医疗	1,700	43,622.00	0.04
404	600862	中航高科	2,400	43,272.00	0.04
405	000683	博源化工	7,500	43,200.00	0.04
406	600521	华海药业	3,000	43,200.00	0.04
407	000039	中集集团	5,300	42,983.00	0.04
408	603766	隆鑫通用	3,600	42,948.00	0.04
409	000999	华润三九	1,897	42,663.53	0.04
410	600803	新奥股份	2,700	42,660.00	0.04
411	600704	物产中大	9,000	42,480.00	0.04
412	600312	平高电气	2,400	42,384.00	0.04
413	688116	天奈科技	1,100	42,020.00	0.04
414	603605	珀莱雅	700	41,944.00	0.04
415	600018	上港集团	8,800	41,536.00	0.04
416	000887	中鼎股份	2,300	41,147.00	0.04
417	000967	盈峰环境	3,900	41,067.00	0.04
418	300122	智飞生物	3,500	40,915.00	0.04
419	688390	固德威	377	40,908.27	0.04
420	600166	福田汽车	13,800	40,158.00	0.04
421	600332	白云山	2,000	40,080.00	0.04
422	600765	中航重机	3,100	40,052.00	0.04
423	600153	建发股份	5,000	39,650.00	0.04
424	000830	鲁西化工	3,300	39,600.00	0.04
425	002410	广联达	4,800	39,168.00	0.04
426	002007	华兰生物	3,200	39,008.00	0.04
427	600323	瀚蓝环境	1,400	38,444.00	0.04
428	603568	伟明环保	2,420	37,219.60	0.04
429	688608	恒玄科技	220	36,781.80	0.04
430	600398	海澜之家	7,000	36,610.00	0.04
431	601799	星宇股份	400	36,248.00	0.04
432	002603	以岭药业	2,400	36,000.00	0.04
433	601000	唐山港	8,600	35,690.00	0.04
434	601018	宁波港	11,300	35,595.00	0.04
435	002389	航天彩虹	2,000	35,540.00	0.04
436	603486	科沃斯	700	35,525.00	0.04
437	600486	扬农化工	700	35,490.00	0.04
438	688009	中国通号	7,383	35,143.08	0.04
439	600529	山东药玻	1,900	35,055.00	0.04
440	603885	吉祥航空	3,400	34,986.00	0.04

441	300896	爱美客	400	34,880.00	0.04
442	600008	首创环保	12,800	34,816.00	0.04
443	600208	衢州发展	12,300	34,809.00	0.04
444	000738	航发控制	1,900	34,751.00	0.04
445	000932	华菱钢铁	9,900	34,353.00	0.04
446	600998	九州通	7,300	34,237.00	0.03
447	600170	上海建工	15,400	34,188.00	0.03
448	600161	天坛生物	2,900	33,582.00	0.03
449	600316	洪都航空	1,200	33,528.00	0.03
450	600820	隧道股份	6,400	33,344.00	0.03
451	601238	广汽集团	6,400	32,512.00	0.03
452	300118	东方日升	2,600	32,370.00	0.03
453	603939	益丰药房	1,800	32,364.00	0.03
454	002607	中公教育	17,900	32,220.00	0.03
455	603816	顾家家居	1,409	31,505.24	0.03
456	300049	福瑞医科	800	31,104.00	0.03
457	688114	华大智造	600	30,648.00	0.03
458	600763	通策医疗	900	30,492.00	0.03
459	688303	大全能源	1,743	30,380.49	0.03
460	600038	中直股份	1,200	30,348.00	0.03
461	601567	三星电气	2,000	29,880.00	0.03
462	603392	万泰生物	1,100	29,667.00	0.03
463	688506	百利天恒	100	29,403.00	0.03
464	601880	辽港股份	21,300	29,394.00	0.03
465	600535	天士力	2,200	29,106.00	0.03
466	688813	泰金新能	158	28,877.66	0.03
467	688785	恒运昌	62	28,678.72	0.03
468	600511	国药股份	1,100	28,644.00	0.03
469	300573	兴齐眼药	699	28,491.24	0.03
470	000833	粤桂股份	1,200	28,104.00	0.03
471	300676	华大基因	800	28,048.00	0.03
472	688166	博瑞医药	800	28,008.00	0.03
473	600816	建元信托	11,400	27,816.00	0.03
474	300100	双林股份	1,000	27,780.00	0.03
475	002244	滨江集团	3,600	27,360.00	0.03
476	300144	宋城演艺	4,600	26,726.00	0.03
477	002120	韵达股份	4,200	26,712.00	0.03
478	601155	新城控股	2,600	26,676.00	0.03
479	688063	派能科技	500	26,635.00	0.03
480	000998	隆平高科	3,400	25,636.00	0.03
481	002544	普天科技	1,400	25,508.00	0.03
482	601866	中远海发	11,300	24,973.00	0.03
483	600064	南京高科	3,500	24,955.00	0.03

484	688617	惠泰医疗	135	24,510.60	0.03
485	600635	大众公用	5,600	23,968.00	0.02
486	600754	锦江酒店	1,300	23,387.00	0.02
487	300457	赢合科技	1,100	23,188.00	0.02
488	000035	中国天楹	4,800	23,184.00	0.02
489	600655	豫园股份	5,600	23,016.00	0.02
490	603899	晨光股份	1,100	22,693.00	0.02
491	600004	白云机场	3,000	21,780.00	0.02
492	001257	盛龙股份	861	21,766.08	0.02
493	300601	康泰生物	1,900	21,546.00	0.02
494	600663	陆家嘴	3,400	21,352.00	0.02
495	600859	王府井	2,300	21,114.00	0.02
496	600258	首旅酒店	1,900	20,748.00	0.02
497	688635	长进光子	51	20,681.52	0.02
498	002091	江苏国泰	2,800	20,244.00	0.02
499	300070	碧水源	6,300	20,097.00	0.02
500	000069	华侨城 A	11,600	19,024.00	0.02
501	600864	哈投股份	3,600	18,684.00	0.02
502	688811	有研新材	645	17,898.75	0.02
503	301078	孩子王	2,600	17,576.00	0.02
504	002292	奥飞娱乐	2,600	17,056.00	0.02
505	002891	中宠股份	600	16,032.00	0.02
506	301687	新广益	195	15,167.10	0.02
507	603833	欧派家居	500	15,055.00	0.02
508	600325	华发股份	6,400	14,784.00	0.02
509	301531	春光集团	208	13,915.20	0.01
510	301696	三瑞智能	132	13,833.60	0.01
511	603459	红板科技	136	13,567.36	0.01
512	002572	索菲亚	1,700	12,410.00	0.01
513	301599	理奇智能	221	8,985.86	0.01
514	301669	高特电子	219	8,216.88	0.01
515	301513	尚水智能	126	7,993.44	0.01
516	301680	固德电材	70	7,849.10	0.01
517	001365	天海电子	186	6,842.94	0.01
518	001393	维通利	129	6,253.92	0.01
519	301683	慧谷新材	46	5,946.42	0.01
520	688816	易思维	96	5,479.68	0.01
521	601112	振石股份	231	4,058.67	0.00
522	603435	嘉德利	61	3,697.82	0.00
523	001237	惠康科技	54	3,555.90	0.00
524	688781	视涯科技	66	3,141.60	0.00
525	300627	华测导航	80	2,272.00	0.00
526	603284	林平发展	46	1,603.56	0.00

527	001220	世盟股份	57	1,582.89	0.00
528	002245	蔚蓝锂芯	72	1,347.12	0.00
529	603293	埃泰克	35	1,345.75	0.00
530	001312	福恩股份	70	1,274.00	0.00
531	000009	中国宝安	20	124.60	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入 金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	2,625,693.00	0.89
2	300750	宁德时代	2,423,485.00	0.82
3	002371	北方华创	1,687,985.00	0.57
4	600519	贵州茅台	1,253,416.00	0.43
5	688041	海光信息	1,109,945.49	0.38
6	300394	天孚通信	840,251.00	0.29
7	000333	美的集团	650,139.01	0.22
8	300476	胜宏科技	594,061.00	0.20
9	002594	比亚迪	541,801.00	0.18
10	002384	东山精密	496,279.00	0.17
11	300502	新易盛	471,499.00	0.16
12	300604	长川科技	467,486.00	0.16
13	000858	五粮液	467,469.00	0.16
14	688008	澜起科技	452,835.00	0.15
15	002475	立讯精密	436,435.00	0.15
16	688777	中控技术	432,663.09	0.15
17	688498	源杰科技	429,705.60	0.15
18	300803	指南针	425,114.00	0.14
19	688036	传音控股	406,766.98	0.14
20	688396	华润微	401,926.73	0.14

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	10,013,605.00	3.40
2	300308	中际旭创	8,374,215.00	2.84
3	300502	新易盛	3,882,667.00	1.32
4	000333	美的集团	3,484,131.00	1.18
5	002371	北方华创	3,245,980.00	1.10

6	002475	立讯精密	2,649,921.00	0.90
7	002594	比亚迪	2,505,910.00	0.85
8	300059	东方财富	2,318,679.00	0.79
9	688256	寒武纪	2,314,431.47	0.79
10	300274	阳光电源	1,957,428.00	0.66
11	300476	胜宏科技	1,952,111.00	0.66
12	000858	五粮液	1,896,659.00	0.64
13	300394	天孚通信	1,760,426.00	0.60
14	002384	东山精密	1,681,531.01	0.57
15	000651	格力电器	1,500,609.00	0.51
16	300124	汇川技术	1,379,021.00	0.47
17	000725	京东方 A	1,377,741.00	0.47
18	002028	思源电气	1,166,965.00	0.40
19	000338	潍柴动力	1,163,938.00	0.40
20	002714	牧原股份	1,146,148.00	0.39

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	49,205,684.60
卖出股票收入（成交）总额	151,345,774.45

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中，其中，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责或/及处罚。

本基金对上述主体发行证券的投资决策程序符合公司投资管理制度的相关规定。

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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	60,492.63
8	其他	-
9	合计	60,492.63

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

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

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		中国农业银行股份有限公司—申万菱信中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总份 额比例
156	426,633.01	64,237,250.00	96.52%	2,317,500.00	3.48%	35,099,000.00	52.74%

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“中国农业银行股份有限公司—申万菱信中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	14,700.00	0.0221%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2025 年 01 月 22 日）基金份额总额	474,554,750.00
本报告期期初基金份额总额	228,554,750.00
本报告期基金总申购份额	24,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	186,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	66,554,750.00

§ 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、基金托管业务相关的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

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

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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	5	199,811,636.49	100.00%	37,486.51	100.00%	-

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

10.8 其他重大事件

无。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20260101-20260428	56,107,400.00	0.00	56,107,400.00	0.00	0.00%
申万菱信中证 A500 交易型开放式	1	20260101-20260630	137,240,000.00	2,100,000.00	104,241,000.00	35,099,000.00	52.74%

指 数 证 券 投 资 基 金 联 接 基 金							
产品特有风险							
本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况。在单一投资者持有基金份额比例较高的情况下，如投资者集中赎回，可能会给基金带来流动性冲击。基金管理人将专业审慎、勤勉尽责地管控基金的流动性风险，保护持有人利益。							

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

12.3 查阅方式

上述文件均可到本基金管理人的住所进行查阅，也可在本基金管理人的网站进行查阅，查询网
址：www.swsmu.com。

申万菱信基金管理有限公司
二〇二六年八月三十一日