申万菱信中证A500指数增强型证券投资基金

2026年中期报告

2026年06月30日

基金管理人:申万菱信基金管理有限公司

基金托管人:中国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 6
§4 管理人报告 7
4.1 基金管理人及基金经理情况 7
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 12
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 12
§5 托管人报告 12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、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 13
6.2 利润表 14
6.3 净资产变动表 15
6.4 报表附注 16
§7 投资组合报告 36
7.1 期末基金资产组合情况 36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细 37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 42
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 42
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 42
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 42
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 42
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 42
7.12 投资组合报告附注 43

§8 基金份额持有人信息 43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 44
§9 开放式基金份额变动 44
§10 重大事件揭示 45
10.1 基金份额持有人大会决议 45
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 45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 45
10.4 基金投资策略的改变 45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 45
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 45
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 46
10.8 其他重大事件 46
§11 备查文件目录 46
11.1 备查文件目录 46
11.2 存放地点 47
11.3 查阅方式 47

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	申万菱信中证 A500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	申万菱信中证 A500 指数增强	
基金主代码	022688	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2024 年 12 月 20 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	35,696,137.26 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	申万菱信中证 A500 指数增强 A	申万菱信中证 A500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	022688	022689
报告期末下属分级基金的份额总额	12,429,235.90 份	23,266,901.36 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型股票指数基金，通过数量化的投资方法与严格的投资纪律约束，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%，同时力求实现超越标的指数的业绩表现，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金在指数化投资的基础上通过数量化模型进行投资组合优化，在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下，力争获得超越标的指数的投资收益。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率*95%+银行人民币活期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金为股票型指数增强基金，其预期风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

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	申万菱信基金管理有限公司	上海市中山南路100号11层

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2026年01月01日-2026年06月30日）	
	申万菱信中证A500指数增强A	申万菱信中证A500指数增强C
本期已实现收益	2,514,893.46	4,257,828.15
本期利润	2,295,148.42	3,871,135.87
加权平均基金份额本期利润	0.1631	0.1612
本期加权平均净值利润率	12.93%	12.83%
本期基金份额净值增长率	13.70%	13.47%
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	4,238,183.29	7,741,871.69
期末可供分配基金份额利润	0.3410	0.3327
期末基金资产净值	16,700,925.88	31,072,744.58
期末基金份额净值	1.3437	1.3355
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	34.37%	33.55%

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

申万菱信中证A500指数增强A净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	14.11%	1.31%	13.54%	1.34%	0.57%	-0.03%
过去六个月	13.70%	1.22%	11.34%	1.22%	2.36%	0.00%
过去一年	30.49%	1.02%	34.41%	1.09%	-3.92%	-0.07%
自基金合同生效起至今	34.37%	0.95%	33.83%	1.07%	0.54%	-0.12%

申万菱信中证A500指数增强C净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	14.00%	1.31%	13.54%	1.34%	0.46%	-0.03%
过去六个月	13.47%	1.22%	11.34%	1.22%	2.13%	0.00%
过去一年	29.98%	1.02%	34.41%	1.09%	-4.43%	-0.07%
自基金合同生效起至今	33.55%	0.95%	33.83%	1.07%	-0.28%	-0.12%

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*95%+银行人民币活期存款利率(税后)*5%。

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





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人才队伍的全方位发展，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		
俞诚	本基金基金经理	2024-12-20	-	16年	俞诚先生，经济学学士、2009年起从事金融相关工作，2009年08月加入申万菱信基金管理有限公司，曾任产品与金融工程总部金融工程师、数量研究员，申万菱信中证申万电子行业投资指数分级证券投资基金、申万菱信中证申万传媒行业投资指数分级证券投资基金、申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金、申万菱信沪深300价值指数证券

					投资基金、申万菱信深证成指分级证券投资基金、申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金、申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金、申万菱信中证军工指数分级证券投资基金、申万菱信价值优享混合型证券投资基金、申万菱信中小板指数证券投资基金（LOF）、申万菱信量化驱动混合型证券投资基金、申万菱信价值优利混合型证券投资基金、申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)基金经理，现任申万菱信中证500指数增强型证券投资基金、申万菱信创业板量化精选股票型证券投资基金、申万菱信中证A500指数增强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

2026 年上半年，沪深 A 股维持宽幅震荡格局。报告期内市场板块结构性分化持续放大。随着上市公司年报、一季报集中披露，整体呈现 K 型分化，新兴产业业绩改善，传统内需板块修复不及预期。在产业政策持续加码、流动性维持宽松环境下，AI 算力、半导体等科技成长赛道获得市场青睐，估值显著抬升。资本市场持续完善退市机制，常态化打击财务造假、违规减持等行为，市场估值重塑与定价逻辑持续演进。对于下半年，我们判断，市场整体估值分化或进一步拉大，行情演绎核心取决于新兴产业盈利兑现能力以及内需板块边际改善力度。2026 年上半年，上证综指上涨 3.16%，深证成份指数上涨 19.82%，沪深 300 指数上涨 7.55%，而中证 500 指数上涨 20.97%，中小板 100 上涨 17.26%，创业板指数上涨 35.58%，显示成长与中小盘风格显著占优。

本基金采用的量化模型仍然秉持兼具价值创造和价值回归的主要选股逻辑。未来，本基金将力争控制跟踪误差和偏离度在基金合同的允许范围内，努力提升基金风险收益比率。

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 13.7%,同期业绩基准表现为 11.34%；

本基金 C 类产品报告期内净值表现为 13.47%,同期业绩基准表现为 11.34%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2026 年上半年，产业扶持、结构性降息、高端制造出海等政策推动高技术制造业，海外 AI 资本开支扩张拉动国内机电产品出口高增。但是商品房销售延续弱势，居民消费意愿相对偏弱，传统制造业产能过剩问题尚未完全缓解，上下游 PPI 分化格局延续。市场流动性整体充裕，资金持续向高景气赛道集中，主题投资活跃度较高，如 AI 基础设施、先进封装、人形机器人、储能、商业航天等。

展望下半年，海外科技资本开支节奏存在不确定性，内需复苏节奏仍需观察。产业自主可控相关政策持续落地，有望带动半导体设备、新材料等产业链需求回暖。市场流动性维持合理充裕，预计延续结构性行情，重点关注 AI 产业业绩兑现环节、高端装备出海、资源品供需改善、内需边际修复相关板块。

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

本基金本报告期未进行利润分配，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资产净值低于五千万元的情形。报告期内本基金资产净值恢复至五千万元以上。截至本报告期末，本基金资产净值再次低于五千万元。

§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指数增强型证券投资基金

报告截止日：2026年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	2,870,375.34	2,893,075.20
结算备付金		408,137.80	405,722.45
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	44,648,970.18	43,616,297.83
其中：股票投资		44,621,968.94	43,616,297.83
基金投资		-	-
债券投资		27,001.24	-
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		37,412.99	45,668.71
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		47,964,896.31	46,960,764.19
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2026年06月30日**	**上年度末 2025年12月31日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		104,307.49	279,897.04
应付管理人报酬		31,568.21	35,716.57
应付托管费		3,946.04	4,464.58
应付销售服务费		10,244.71	11,557.79
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	41,159.40	145,000.00
负债合计		191,225.85	476,635.98
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	35,696,137.26	39,435,753.44
未分配利润	6.4.7.8	12,077,533.20	7,048,374.77
净资产合计		47,773,670.46	46,484,128.21
负债和净资产总计		47,964,896.31	46,960,764.19

注：（1）报告截止日2026年06月30日，基金份额总额35,696,137.26份。其中申万菱信中证A500指数增强A基金份额净值1.3437元，基金份额总额12,429,235.90份。其中申万菱信中证A500指数增强C基金份额净值1.3355元，基金份额总额23,266,901.36份。

（2）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指数增强型证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026年01月01日至 2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至 2025年06月30日
一、营业总收入		6,481,393.81	9,713,830.92
1.利息收入		7,055.15	236,909.42
其中：存款利息收入	6.4.7.9	7,055.15	70,429.45
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		-	166,479.97
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		7,079,949.49	7,386,115.06
其中：股票投资收益	6.4.7.10	6,604,750.26	5,279,549.85
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	1.24	-978.02
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	475,197.99	2,107,543.23
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	-606,437.32	2,078,146.52
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	826.49	12,659.92

减：二、营业总支出		315,109.52	1,583,714.25
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	190,021.77	1,061,757.14
2.托管费	6.4.10.2.2	23,752.79	132,719.65
3.销售服务费	6.4.10.2.3	59,815.56	301,907.01
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	41,519.40	87,330.45
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6,166,284.29	8,130,116.67
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,166,284.29	8,130,116.67
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		6,166,284.29	8,130,116.67

6.3 净资产变动表

会计主体：申万菱信中证A500指数增强型证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	39,435,753.44	7,048,374.77	46,484,128.21
二、本期期初净资产	39,435,753.44	7,048,374.77	46,484,128.21
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-3,739,616.18	5,029,158.43	1,289,542.25
（一）、综合收益总额	-	6,166,284.29	6,166,284.29
（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）	-3,739,616.18	-1,137,125.86	-4,876,742.04
其中：1.基金申购款	9,713,050.57	2,620,062.76	12,333,113.33
2.基金赎回款	-13,452,666.75	-3,757,188.62	-17,209,855.37
（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	35,696,137.26	12,077,533.20	47,773,670.46
项 目	**上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日**		
	实收基金	**未分配利润**	**净资产合计**

一、上期期末净资产	671,733,201.67	-1,286,190.84	670,447,010.83
二、本期期初净资产	671,733,201.67	-1,286,190.84	670,447,010.83
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-571,871,247.78	4,111,715.57	-567,759,532.21
（一）、综合收益总额	-	8,130,116.67	8,130,116.67
（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）	-571,871,247.78	-4,018,401.10	-575,889,648.88
其中：1.基金申购款	63,056,371.50	-559,844.70	62,496,526.80
2.基金赎回款	-634,927,619.28	-3,458,556.40	-638,386,175.68
（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	99,861,953.89	2,825,524.73	102,687,478.62

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指数增强型证券投资基金（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】1600号《关于准予申万菱信中证A500指数增强型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指数增强型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671,648,729.86元。经向中国证监会备案，《申万菱信中证A500指数增强型证券投资基金基金合同》于2024年12月20日生效。基金合同生效日的基金份额总额为671,733,201.67份基金份额，其中认购资金利息折合基金份额84,471.81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指数增强型证券投资基金基金合同》和最新公布的《申万菱信中证A500指数增强型证券投资基金更新招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股、备选成份股、其他国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板及其他依法发行、上市的股票、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：本基金持有的股票资产占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于标的指数成份股及备选成份股的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；每个交易日日终在扣除国债期货和股指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，本基金应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。股票期权、股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如果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*95%+银行人民币活期存款利率(税后)*5%

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	2,532,905.65
等于：本金	2,532,665.05
加：应计利息	240.60
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	337,469.69
等于：本金	337,446.33
加：应计利息	23.36
减：坏账准备	-
合计	2,870,375.34

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		42,013,013.69	-	44,621,968.94	2,608,955.25
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	27,000.00	1.24	27,001.24	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	27,000.00	1.24	27,001.24	-
资产支持证券		-	-	-	-

基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	42,040,013.69	1.24	44,648,970.18	2,608,955.25

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
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	24,795.19
预提费用-审计费	16,364.21
合计	41,159.40

6.4.7.7 实收基金

申万菱信中证A500指数增强A

金额单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	14,309,977.73	14,309,977.73
本期申购	2,612,916.12	2,612,916.12
本期赎回（以“-”号填列）	-4,493,657.95	-4,493,657.95

本期末	12,429,235.90	12,429,235.90

申万菱信中证A500指数增强C

金额单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	25,125,775.71	25,125,775.71
本期申购	7,100,134.45	7,100,134.45
本期赎回（以“-”号填列）	-8,959,008.80	-8,959,008.80
本期末	23,266,901.36	23,266,901.36

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

申万菱信中证A500指数增强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	2,259,467.73	342,563.26	2,602,030.99
本期期初	2,259,467.73	342,563.26	2,602,030.99
本期利润	2,514,893.46	-219,745.04	2,295,148.42
本期基金份额交易产生的变动数	-536,177.90	-89,311.53	-625,489.43
其中：基金申购款	504,601.14	119,212.15	623,813.29
基金赎回款	-1,040,779.04	-208,523.68	-1,249,302.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,238,183.29	33,506.69	4,271,689.98

申万菱信中证A500指数增强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	3,847,233.43	599,110.35	4,446,343.78
本期期初	3,847,233.43	599,110.35	4,446,343.78
本期利润	4,257,828.15	-386,692.28	3,871,135.87
本期基金份额交易产生的变动数	-363,189.89	-148,446.54	-511,636.43
其中：基金申购款	1,732,349.27	263,900.20	1,996,249.47
基金赎回款	-2,095,539.16	-412,346.74	-2,507,885.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,741,871.69	63,971.53	7,805,843.22

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	4,167.74
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	472.06
结算备付金利息收入	2,415.35
其他	-
合计	7,055.15

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——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	79,173,557.47
减：卖出股票成本总额	72,490,007.04
减：交易费用	78,800.17
买卖股票差价收入	6,604,750.26

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

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
债券投资收益——利息收入	1.24
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	1.24

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	475,197.99
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	475,197.99

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	-606,437.32
——股票投资	-606,437.32
——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	-606,437.32

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	576.09
转换费收入	250.40
合计	826.49

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	16,364.21
信息披露费	24,795.19
证券出借违约金	-
银行汇划费	360.00
合计	41,519.40

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
申万菱信基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
申万宏源证券有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
三菱UFJ信托银行株式会社	基金管理人的股东
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
申万菱信（上海）资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
申万宏源证券有限公司	153,275,672.94	100.00%	2,649,996,489.49	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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
申万宏源证券有限公司	27,000.00	100.00%	15,589,166.00	100.00%

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01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	-	-	253,217,000.00	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	29,377.66	100.00%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
申万宏源证券有限公司	509,181.61	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01日至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	190,021.77	1,061,757.14
其中：应支付销售机构的客户维护费	83,973.57	434,368.78
应支付基金管理人的净管理费	106,048.20	627,388.36

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的0.80%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×基金管理费年费率/当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	23,752.79	132,719.65

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.10%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×基金托管费年费率/当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	申万菱信中证A500指数增强A	申万菱信中证A500指数增强C	合计
中国农业银行股份有限公司	-	15,667.46	15,667.46
申万宏源证券有限公司	-	34,017.15	34,017.15
合计	-	49,684.61	49,684.61

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	申万菱信中证A500指数增强A	申万菱信中证A500指数增强C	合计
中国农业银行股份有限公司	-	46,853.29	46,853.29
申万宏源证券有限公司	-	212,090.44	212,090.44
合计	-	258,943.73	258,943.73

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费 ，C类基金份额的销售服务费年费率为0.40%，销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.40%年费率计提。计算方法如下：

H=E×C类基金销售服务费年费率/当年天数

H为C类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E为C类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内和上年度可比期间内，本基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末和上年度末，除基金管理人之外的其他关联方，未发生投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日	
	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	2,532,905.65	4,167.74	5,383,506.98	41,223.18
申万宏源证券有限公司	337,469.69	472.06	2,120,099.97	24,705.26

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

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（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：债券										
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:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113704	春风转债	2026年06月11日	1个月内（含）	认购新发证券	100.00	100.00	270	27,000.00	27,001.24	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2026年06月30日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出

回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为指数增强型基金。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

本基金为指数增强型基金，属于中高风险品种，在跟踪指数的基础上，采用了量化增强的策略。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，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0.06%（上期末：0%）。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险主要来源于基金兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。

本基金管理人已经建立涵盖制度、流程、组织架构、制衡机制、风险处置等方面的流动性风险管控体系；建立以压力测试为核心、覆盖全类型产品的基金流动性风险监测与预警制度及风险应对预案。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人已经建立针对公募基金申购赎回状况的监控和预测机制以及建立了巨额赎回审批规程，对于巨额赎回建立严格的流动性评估机制；此外，本基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款，设计了非常情况下赎回资金的处理模式，控制因开放模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对资产的流动性风险，本基金管理人持续监控和预测旗下基金的各项流动性指标，包括组合持仓集中度指标、投资组合在短时间内变现能力的综合指标、组合持仓中变现能力较差的品种的比例控制和流通受限资产的总量控制，通过指标来持续地评估、选择、跟踪和控制投资组合的投资流动性风险。

除了上述日常流动性管理机制外，本基金管理人已建立压力测试制度，针对不同类型投资组合建立流动性压力测试模型，对各相关风险因子进行极端假设，进而评估对投资组合流动性的负面影响。此外，本基金管理人已建立流动性风险应急机制，一旦发生或认为可能发生较大的流动性风险，本基金管理人会立即启动相应的应急流程。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自2017年10月1日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过净资产的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%。完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制。

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

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估

与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。 此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。于本期末，除附注“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”中列示的卖出回购证券款余额（如有）将在1个月内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果、流动性风险管理措施的实施以及本基金的资产和负债情况，本基金管理人认为本基金在本报告期内流动性情况良好。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。

于本期末，本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2026年06月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	2,870,375.34	-	-	-	-	-	2,870,375.34
结算备付金	408,137.80	-	-	-	-	-	408,137.80
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-	27,001.24	44,621,968.94	44,648,970.18

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	-	-	-	-	-	37,412.99	37,412.99
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	3,278,513.14	-	-	-	27,001.24	44,659,381.93	47,964,896.31
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	-	-	-	-	-	104,307.49	104,307.49
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	31,568.21	31,568.21
应付托管费	-	-	-	-	-	3,946.04	3,946.04
应付销售服务费	-	-	-	-	-	10,244.71	10,244.71
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	-	-	-	-	-	41,159.40	41,159.40
负债总计	-	-	-	-	-	191,225.85	191,225.85

利率敏感度缺口	3,278,513.14	-	-	-	27,001.24	44,468,156.08	47,773,670.46
上年度末2025年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	2,893,075.20	-	-	-	-	-	2,893,075.20
结算备付金	405,722.45	-	-	-	-	-	405,722.45
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-	-	43,616,297.83	43,616,297.83
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	-	-	-	-	-	45,668.71	45,668.71
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	3,298,797.65	-	-	-	-	43,661,966.54	46,960,764.19
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	-	-	-	-	-	279,897.04	279,897.04
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	35,716.57	35,716.57

应付托管费	-	-	-	-	-	4,464.58	4,464.58
应付销售服务费	-	-	-	-	-	11,557.79	11,557.79
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	-	-	-	-	-	145,000.00	145,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	476,635.98	476,635.98
利率敏感度缺口	3,298,797.65	-	-	-	-	43,185,330.56	46,484,128.21

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0.06%（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增强型基金，投资于股票资产不低于基金资产净值的80%，其中，投资于指数成份股、备选成份股的资产占非现金基金资产的比例不低于80%，所以存在很高的其他价格风险。

本基金在指数化投资的基础上通过数量化模型进行投资组合优化，在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下，力争获得超越标的指数的投资收益。

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	44,621,968.94	93.40	43,616,297.83	93.83
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	44,621,968.94	93.40	43,616,297.83	93.83

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%	2,310,000.00	2,390,000.00
	基准下降5%	-2,310,000.00	-2,390,000.00

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	44,621,968.94	43,613,741.64
第二层次	27,001.24	-
第三层次	-	2,556.19
合计	44,648,970.18	43,616,297.83

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	44,621,968.94	93.03
	其中：股票	44,621,968.94	93.03
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	27,001.24	0.06
	其中：债券	27,001.24	0.06
	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	3,278,513.14	6.84
8	其他各项资产	37,412.99	0.08
9	合计	47,964,896.31	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	2,682,184.00	5.61
C	制造业	29,647,554.79	62.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,332,811.00	2.79
E	建筑业	24,255.00	0.05
F	批发和零售业	416,184.00	0.87
G	交通运输、仓储和邮政业	1,527,645.00	3.20
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,899,101.90	6.07
J	金融业	3,690,439.25	7.72
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	353,804.00	0.74
M	科学研究和技术服务业	821,766.00	1.72
N	水利、环境和公共设施管理业	811,572.00	1.70
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	414,652.00	0.87
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	44,621,968.94	93.40

7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	300308	中际旭创	1,800	2,286,000.00	4.79
2	300750	宁德时代	4,600	1,807,846.00	3.78
3	300502	新易盛	2,100	1,274,700.00	2.67
4	603986	兆易创新	1,400	1,141,000.00	2.39
5	688256	寒武纪	600	957,330.00	2.00
6	601899	紫金矿业	37,600	945,264.00	1.98

7	000333	美的集团	11,500	868,595.00	1.82
8	603259	药明康德	6,600	821,766.00	1.72
9	600900	长江电力	30,100	796,747.00	1.67
10	600030	中信证券	26,999	775,681.27	1.62
11	300059	东方财富	35,500	723,490.00	1.51
12	002371	北方华创	700	619,192.00	1.30
13	601328	交通银行	94,700	608,921.00	1.27
14	600176	中国巨石	8,300	604,904.00	1.27
15	600519	贵州茅台	500	592,745.00	1.24
16	600150	中国船舶	17,500	591,325.00	1.24
17	600887	伊利股份	24,300	582,228.00	1.22
18	000338	潍柴动力	20,900	569,525.00	1.19
19	002384	东山精密	2,100	550,935.00	1.15
20	000001	平安银行	49,200	494,460.00	1.04
21	000792	盐湖股份	16,300	492,097.00	1.03
22	688111	金山办公	2,300	490,015.00	1.03
23	688002	睿创微纳	3,152	487,582.88	1.02
24	000408	藏格矿业	6,700	464,444.00	0.97
25	603799	华友钴业	9,600	463,296.00	0.97
26	601600	中国铝业	56,100	461,142.00	0.97
27	603659	璞泰来	15,900	459,987.00	0.96
28	600183	生益科技	2,600	450,840.00	0.94
29	601816	京沪高铁	98,900	448,017.00	0.94
30	600489	中金黄金	24,700	445,835.00	0.93
31	603129	春风动力	1,700	434,860.00	0.91
32	002558	巨人网络	15,700	432,692.00	0.91
33	300450	先导智能	10,600	431,632.00	0.90
34	600233	圆通速递	27,200	428,400.00	0.90
35	002463	沪电股份	2,800	427,840.00	0.90
36	603288	海天味业	12,900	427,764.00	0.90
37	002340	格林美	63,800	421,718.00	0.88
38	601877	正泰电器	16,800	421,176.00	0.88
39	300972	万辰集团	2,400	416,184.00	0.87
40	300919	中伟新材	9,500	415,625.00	0.87
41	002532	天山铝业	38,700	415,251.00	0.87
42	002001	新和成	14,600	414,932.00	0.87
43	300015	爱尔眼科	50,200	414,652.00	0.87
44	600499	科达制造	30,000	414,000.00	0.87
45	002266	浙富控股	81,700	413,402.00	0.87
46	002414	高德红外	30,900	409,734.00	0.86
47	688266	泽璟制药	3,507	409,126.62	0.86
48	000301	东方盛虹	35,700	408,765.00	0.86
49	002294	信立泰	12,800	408,192.00	0.85

50	688065	凯赛生物	8,481	405,815.85	0.85
51	600323	瀚蓝环境	14,500	398,170.00	0.83
52	600018	上港集团	84,000	396,480.00	0.83
53	688498	源杰科技	200	377,200.00	0.79
54	603766	隆鑫通用	31,400	374,602.00	0.78
55	600346	恒力石化	21,100	373,681.00	0.78
56	000975	山金国际	21,800	370,600.00	0.78
57	000988	华工科技	2,000	369,220.00	0.77
58	002064	华峰化学	38,800	368,212.00	0.77
59	600166	福田汽车	126,500	368,115.00	0.77
60	000933	神火股份	17,300	366,760.00	0.77
61	002916	深南电路	800	366,320.00	0.77
62	000100	TCL科技	62,600	364,332.00	0.76
63	000423	东阿阿胶	8,000	362,880.00	0.76
64	002027	分众传媒	73,100	353,804.00	0.74
65	300223	北京君正	1,400	348,460.00	0.73
66	300857	协创数据	1,000	339,900.00	0.71
67	600989	宝丰能源	16,300	331,379.00	0.69
68	300014	亿纬锂能	4,900	318,647.00	0.67
69	300442	润泽科技	3,800	315,666.00	0.66
70	600938	中国海油	11,500	312,225.00	0.65
71	601318	中国平安	6,427	306,824.98	0.64
72	688213	思特威	2,700	289,089.00	0.61
73	601988	中国银行	49,600	283,712.00	0.59
74	600885	宏发股份	7,400	255,226.00	0.53
75	600026	中远海能	14,200	254,748.00	0.53
76	300866	安克创新	2,400	250,800.00	0.52
77	002236	大华股份	15,200	250,648.00	0.52
78	605117	德业股份	2,360	250,584.80	0.52
79	688981	中芯国际	1,462	232,194.84	0.49
80	600036	招商银行	6,300	223,650.00	0.47
81	000617	中油资本	33,900	223,401.00	0.47
82	688188	柏楚电子	2,040	217,668.00	0.46
83	600886	国投电力	16,300	216,953.00	0.45
84	688099	晶晨股份	1,911	196,641.90	0.41
85	002271	东方雨虹	16,400	194,668.00	0.41
86	601168	西部矿业	6,800	184,552.00	0.39
87	002493	荣盛石化	16,600	178,450.00	0.37
88	688180	君实生物	5,000	169,100.00	0.35
89	300073	当升科技	3,400	163,336.00	0.34
90	601727	上海电气	23,200	162,400.00	0.34
91	601857	中国石油	18,700	162,316.00	0.34
92	600674	川投能源	11,400	161,538.00	0.34

93	003816	中国广核	40,300	157,573.00	0.33
94	000538	云南白药	3,300	156,321.00	0.33
95	600362	江西铜业	3,600	155,880.00	0.33
96	002648	卫星化学	6,600	155,034.00	0.32
97	000807	云铝股份	6,400	141,696.00	0.30
98	300394	天孚通信	460	139,232.80	0.29
99	600988	赤峰黄金	5,100	134,232.00	0.28
100	300395	菲利华	1,000	133,730.00	0.28
101	002128	电投能源	5,500	127,160.00	0.27
102	300432	富临精工	5,900	118,531.00	0.25
103	688012	中微公司	200	93,700.00	0.20
104	002475	立讯精密	1,300	91,520.00	0.19
105	688041	海光信息	200	74,060.00	0.16
106	688578	艾力斯	635	69,342.00	0.15
107	688008	澜起科技	200	61,980.00	0.13
108	601100	恒立液压	400	43,024.00	0.09
109	601658	邮储银行	5,500	27,115.00	0.06
110	000725	京东方A	2,900	25,172.00	0.05
111	601117	中国化学	3,300	24,255.00	0.05
112	601166	兴业银行	1,400	23,184.00	0.05
113	002202	金风科技	400	9,560.00	0.02
114	600309	万华化学	100	6,841.00	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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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	688256	寒武纪	1,894,716.00	4.08
2	600166	福田汽车	1,562,215.00	3.36
3	688213	思特威	1,120,025.46	2.41
4	601328	交通银行	1,117,773.00	2.40
5	000333	美的集团	866,674.00	1.86
6	600036	招商银行	856,455.00	1.84
7	300450	先导智能	841,465.00	1.81
8	600900	长江电力	778,530.00	1.67
9	600150	中国船舶	771,677.41	1.66
10	688111	金山办公	765,183.40	1.65
11	000338	潍柴动力	740,992.00	1.59

12	603799	华友钴业	721,688.00	1.55
13	603659	璞泰来	686,456.00	1.48
14	002294	信立泰	677,314.00	1.46
15	601816	京沪高铁	659,588.00	1.42
16	601727	上海电气	648,276.00	1.39
17	601088	中国神华	642,663.00	1.38
18	688012	中微公司	641,629.50	1.38
19	300059	东方财富	623,322.00	1.34
20	000975	山金国际	622,266.00	1.34

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	002475	立讯精密	1,434,104.00	3.09
2	688256	寒武纪	1,410,578.80	3.03
3	601088	中国神华	1,303,507.00	2.80
4	300408	三环集团	1,205,519.00	2.59
5	600166	福田汽车	1,139,195.00	2.45
6	600036	招商银行	1,110,665.00	2.39
7	002008	大族激光	1,070,133.00	2.30
8	601318	中国平安	1,068,181.00	2.30
9	688008	澜起科技	1,022,931.19	2.20
10	688213	思特威	978,975.14	2.11
11	688041	海光信息	901,811.70	1.94
12	000338	潍柴动力	898,312.60	1.93
13	000333	美的集团	854,587.00	1.84
14	601398	工商银行	830,719.00	1.79
15	002463	沪电股份	822,530.00	1.77
16	688012	中微公司	818,434.05	1.76
17	603993	洛阳钼业	799,261.00	1.72
18	603986	兆易创新	745,619.00	1.60
19	600150	中国船舶	744,836.00	1.60
20	600183	生益科技	732,848.00	1.58

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	74,102,115.47
卖出股票收入（成交）总额	79,173,557.47

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	27,001.24	0.06
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	27,001.24	0.06

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113704	春风转债	270	27,001.24	0.06

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

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

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同约定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	37,412.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	37,412.99

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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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
申万菱信中证A500指数增强A	403	30,841.78	0.00	0.00%	12,429,235.90	100.00%
申万菱信中证A500指数增强C	602	38,649.34	1,050,043.05	4.51%	22,216,858.31	95.49%
合计	985	36,239.73	1,050,043.05	2.94%	34,646,094.21	97.06%

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

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	申万菱信中证A500指数增强A	1,759.71	0.0142%
	申万菱信中证A500指数增强C	0.00	0.0000%
	合计	1,759.71	0.0049%

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	申万菱信中证A500指数增强A	申万菱信中证A500指数增强C
基金合同生效日（2024年12月20日）基金份额总额	230,458,514.48	441,274,687.19
本报告期期初基金份额总额	14,309,977.73	25,125,775.71
本报告期基金总申购份额	2,612,916.12	7,100,134.45
减：本报告期基金总赎回份额	4,493,657.95	8,959,008.80
本报告期基金拆分变动份额	-	-

本报告期期末基金份额总额	12,429,235.90	23,266,901.36

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

无

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内，经基金管理人股东会决议，同意公司董事由上野由喜先生变更为染谷知先生。

2、本报告期内，经基金管理人股东会决议，同意公司董事由汪涛先生变更为邱春杨先生。

3、本报告期内，经基金管理人董事会决议，同意公司总经理由汪涛先生变更为邱春杨先生。

4、本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、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

10.7.1 基金租用或者通过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	
申万宏源证券有限公司	3	153,275,672.94	100.00%	29,377.66	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。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
申万宏源证券有限公司	27,000.00	100.00%	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

无。

§11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

基金合同；

招募说明书及其更新；

产品资料概要及其更新；

成立公告；

定期报告；

其他临时公告。

11.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

11.3 查阅方式

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