

申万菱信中证 500 指数增强型证券投资基金

2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：申万菱信基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二〇二四年八月三十日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 28 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 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
2 基金简介.....	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
3 主要财务指标和基金净值表现.....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	9
4 管理人报告.....	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
5 托管人报告.....	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	16
6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 净资产变动表.....	19
6.4 报表附注.....	20
6.4.1 基金基本情况.....	20
6.4.2 会计报表的编制基础.....	21
6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明.....	22
6.4.4 重要会计政策和会计估计.....	22
6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明.....	22
6.4.6 税项.....	22
6.4.7 重要财务报表项目的说明.....	24
6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明.....	30
6.4.9 关联方关系.....	30
6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易.....	31
6.4.11 利润分配情况.....	34

6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券	34
6.4.13 金融工具风险及管理	37
6.4.14 公允价值	44
6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项	45
7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
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	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	65
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	67
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	67
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	67
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	67
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	67
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	67
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	68
7.12 投资组合报告附注	68
8 基金份额持有人信息	69
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	69
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	70
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	70
9 开放式基金份额变动	70
10 重大事件揭示	71
10.1 基金份额持有人大会决议	71
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	71
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	71
10.4 基金投资策略的改变	71
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	71
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	71
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	71
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况	72
11 备查文件目录	76
11.1 备查文件目录	76
11.2 存放地点	76
11.3 查阅方式	76

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	申万菱信中证 500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	申万菱信中证 500 指数增强	
基金主代码	002510	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 4 月 21 日	
基金管理人	申万菱信基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	397,223,866.53 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 500 指数增强 A	申万菱信中证 500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	002510	007795
报告期末下属分级基金的份额总额	361,865,558.29 份	35,358,308.24 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 500 指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金为增强型指数基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王菲萍	郭明
	联系电话	021-23261188	010-66105799
	电子邮箱	service@swsmu.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008808588	95588
传真		021-23261199	010-66105798
注册地址		上海市中山南路100号11层	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		上海市中山南路100号11层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		200010	100140
法定代表人		陈晓升	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.swsmu.com
基金中期报告备置地点	申万菱信基金管理有限公司 中国工商银行股份有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	申万菱信基金管理有限公司	上海市中山南路 100 号 10、11 层

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日）	
	申万菱信中证 500 指数增强 A	申万菱信中证 500 指数增强 C
本期已实现收益	1,029,092.98	-263,986.10
本期利润	-12,386,676.60	-1,718,876.12
加权平均基金份额本期利润	-0.0357	-0.0488
本期加权平均净值利润率	-2.58%	-3.34%
本期基金份额净值增长率	-3.11%	-3.26%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
	申万菱信中证 500 指数增强 A	申万菱信中证 500 指数增强 C
期末可供分配利润	122,474,314.45	12,570,670.05
期末可供分配基金份额利润	0.3385	0.3555
期末基金资产净值	484,339,872.74	50,137,758.38
期末基金份额净值	1.3385	1.4180
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
	申万菱信中证 500 指数增强 A	申万菱信中证 500 指数增强 C
基金份额累计净值增长率	33.85%	41.80%

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 500 指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-5.83%	0.92%	-6.55%	0.91%	0.72%	0.01%
过去三个月	-3.41%	0.94%	-6.16%	1.09%	2.75%	-0.15%
过去六个月	-3.11%	1.29%	-8.46%	1.53%	5.35%	-0.24%
过去一年	-14.20%	1.04%	-16.71%	1.21%	2.51%	-0.17%
过去三年	-20.84%	1.15%	-26.01%	1.14%	5.17%	0.01%
自基金合同生效起至今	33.85%	1.24%	-16.32%	1.22%	50.17%	0.02%

申万菱信中证 500 指数增强 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-5.86%	0.92%	-6.55%	0.91%	0.69%	0.01%
过去三个月	-3.49%	0.94%	-6.16%	1.09%	2.67%	-0.15%
过去六个月	-3.26%	1.29%	-8.46%	1.53%	5.20%	-0.24%
过去一年	-14.46%	1.04%	-16.71%	1.21%	2.25%	-0.17%
过去三年	-21.55%	1.15%	-26.01%	1.14%	4.46%	0.01%
自基金合同生效起至今	41.80%	1.26%	7.06%	1.20%	34.74%	0.06%

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 500 指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%。

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 500 指数增强型证券投资基金

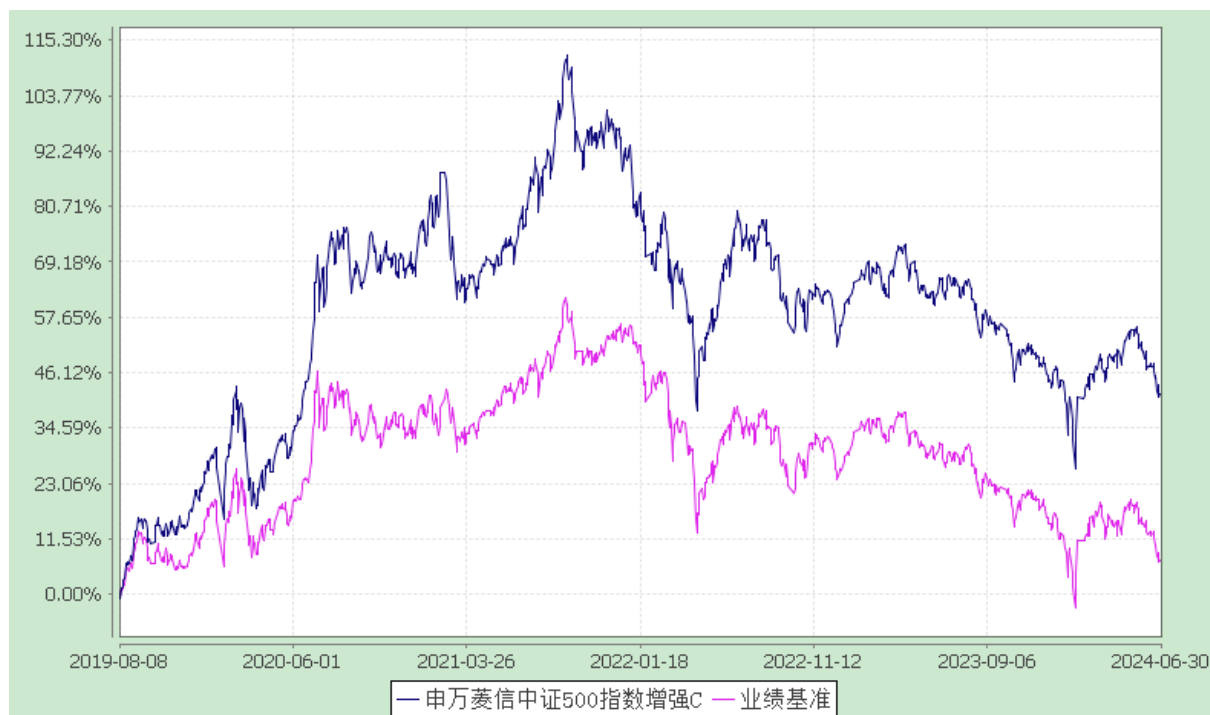
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2016 年 4 月 21 日至 2024 年 6 月 30 日)

申万菱信中证 500 指数增强 A



申万菱信中证 500 指数增强 C



注：本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

申万菱信基金自成立以来，始终将持有人的利益放在首位，秉持“研究至善”的愿景、“长期致胜”的使命，遵循“诚于心、行于矩、敏于变”的企业价值观。近年来，申万菱信基金围绕市场和客户需求，逐渐形成“投资美好生活、创新理财服务”的产品规划；通过努力打造“美好生活”系列权益产品，不断丰富“全市场、宽基指数与增强、主题指数、量化对冲、固收+、另类投资和纯固收”等产品大类，致力于为持有人提供“温暖陪伴”的服务，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 1128.23 亿元，公募产品累计分红 213.53 亿元。（数据截至 2024 年 6 月 30 日）

近年来，申万菱信基金通过建设关键假设平台(Key Assumption Platform)，推动“研究数字化”；通过基金经理的风格开发、稳定和优化，推动“投资风格化”；通过风险管理工作的关口前移，加强市场风险管理支持，推动“风控全流程”，从而不断建设申万菱信基金的“机构理性”，以提升投资业绩。此外，申万菱信基金还持续打造卓越战略与产品管理体系 (Excellent Strategy & Product)、卓越品牌与客户服务体系 (Excellent Branding & Service)，提升面向不同类别客户的全方位专业服务水平。

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

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

(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	2016-04-21	-	14 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基金经理。
----	---------	------------	---	------	--

注：1.任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日；若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

2.证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》及其配套法规的规定，严格遵守基金合同约定，本着诚实信用、勤勉尽责等原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。

本基金投资运作符合法律法规和基金合同的规定,信息披露及时、准确、完整；本基金资产与本基金管理人与公司资产之间严格分开；没有发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为。在基金资产的管理运作中,无任何损害基金持有人利益的行为,并通过稳健经营、规范运作、规避风险,保护了基金持有人的合法权益。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司制定了《公平交易办法》，通过组织结构的设置、工作制度、流程和技术手段全面落实公平交易原则在具体业务（包括研究分析、投资决策、交易执行等）环节中的实现，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；同时，通过对投资交易行为的日常监控和事后分析评估来加强对公平交易过程和结果的监督。

在研究分析方面，本公司建立了规范、完善的研究管理平台，规范了研究人员的投资建议、研究报告的发布流程，使各投资组合经理在获取投资建议的及时性、准确性及深度等方面得到公平对待。

在投资决策方面，首先，公司建立健全投资授权制度，明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限。投资决策委员会和投资总监等管理机构和人员不得对投资经理在授权范围内的投资活动进行干预。投资经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作必须经过严格的审批程序；其次，公司建立投资组合投资信息的管理及保密制度，除分管投资副总及投资总监等因业务管理的需要外，不同投资经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离；另外，公司还建立机制要求公募投资经理与特定客户资产投资经理互相隔离，且不能互相授权投资事宜。

在交易执行方面，本公司设立了独立于投资管理职能的交易部，实行了集中交易制度和公平的交易分配制度：（1）对于交易所公开竞价的同向交易，内部制定了专门的交易规则，保证各投资组合获得公平的交易执行机会；（2）对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，各投资经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，集中交易室按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；（3）对于银行间市场的现券交易，交易部在银行间市场开展独立、公平的询价，并由风险管理部对交易价格的公允性（根据市场公认的第三方信息）、交易对手和交易方式进行事前审核，确保交易得到公平和公允的执行。

在日常监控和事后分析评估方面，本公司风险管理部开展日内和定期的工作对公平交易执行情况作整体监控和效果评估。其中日常监控包括了日内不定点对交易系统的抽查监控；对非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程进行审核和监控；以及对银行间交易过程中投资组合与交易对手之间议价交易的交易方式和交易价格的公允性进行审查。事后

分析评估上，风险管理部在每个季度和每年度的《公平交易执行报告》中，对不同组合间同一投资标的、临近交易日的同向交易和反向交易的合理性开展分析评估。

本公司通过事前的制度规范、事中的监控和事后的分析评估，严格执行了公平交易制度，公平对待了旗下各投资组合。本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司制定了《异常交易监控与报告办法》，明确定义了投资交易过程中出现的各种可能导致不公平交易和利益输送的异常交易类型，并规定且落实了异常交易的日常监控、识别以及事后的分析流程。

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

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

2024 年上半年，沪深 A 股整体窄幅震荡。报告期内，市场走势分化，个股波动较大。随着上市公司年报及一季报披露，总体来看，盈利整体低于市场预期，随着新国九条出台，对上市公司公司治理提出更高要求，坚决出清违法违规公司，市场交易逻辑迎来新一轮变化。对于下半年，我们认为，整体估值或基本调整到位，行情驱动主要以聚焦经济是否能回升为先决条件。2024 年上半年，上证综指下跌-0.25%，深证成份指数下跌-7.1%，沪深 300 指数上涨 0.89%，而中证 500 指数下跌-8.96%，中小板 100 下跌-5.86%，创业板指数下跌-10.99%，显示大盘风格占优。

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，最大化的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-3.11%,同期业绩基准表现为-8.46%。

本基金 C 类产品报告期内净值表现为-3.26%,同期业绩基准表现为-8.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024 年经济在库存周期低位小幅复苏。房地产行业下行影响固定资产投资、财政收入、居民消费信心，导致投资和消费相对偏弱。欧美国家补库存，带动出口持续复苏。但是美国、欧盟、墨西

哥等对中国出口新能源汽车等商品加征关税，或将影响未来出口。为了提振经济，国内利率下行、人民币汇率保持低位，各项改革或陆续推进。

展望下半年，国内消费和投资或将维持低增长，而出口有望维持较高增速，因为欧美国家还在库存周期上行途中。新能源、半导体、造船等行业有望保持高增长，带动产业结构升级，板块有望迎来机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金的管理人——申万菱信基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对申万菱信基金管理有限公司编制和披露的本基金 2024 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：申万菱信中证 500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	50,965,301.54	57,014,460.98
结算备付金		2,826,040.12	4,338,798.26
存出保证金		1,902,846.17	2,468,631.60
交易性金融资产	6.4.7.2	484,261,376.00	436,312,188.55
其中：股票投资		484,261,376.00	436,312,188.55
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		2,672,122.11	145,392.46
应收股利		-	-
应收申购款		230,168.18	398,774.16
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		542,857,854.12	500,678,246.01
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 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		5,082,647.43	-
应付赎回款		532,031.02	543,141.67
应付管理人报酬		444,746.18	421,642.65
应付托管费		88,949.20	84,328.55
应付销售服务费		56,838.38	58,627.56
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	2,175,010.79	2,493,875.81
负债合计		8,380,223.00	3,601,616.24
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	397,223,866.53	357,518,558.20
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	137,253,764.59	139,558,071.57
净资产合计		534,477,631.12	497,076,629.77
负债和净资产总计		542,857,854.12	500,678,246.01

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额总额 397,223,866.53 份。A 类基金份额净值 1.3385 元，份额总额 361,865,558.29 份；C 类基金份额净值 1.4180 元，份额总额 35,358,308.24 份。

6.2 利润表

会计主体：申万菱信中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-10,456,356.00	34,122,043.89
1.利息收入		122,461.72	103,458.13
其中：存款利息收入	6.4.7.9	122,461.72	103,458.13
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		4,274,145.48	12,422,512.19
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-3,465,880.44	6,670,985.18
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	870,291.19	-
股利收益	6.4.7.15	6,869,734.73	5,751,527.01
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-14,870,659.60	21,589,229.73
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	17,696.40	6,843.84
减：二、营业总支出		3,649,196.72	3,212,041.12
1. 管理人报酬		2,642,303.52	2,281,652.49
2. 托管费		528,460.74	456,330.57
3. 销售服务费		341,154.23	351,343.22
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		8,323.59	-
8. 其他费用	6.4.7.19	128,954.64	122,714.84
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-14,105,552.72	30,910,002.77
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-14,105,552.72	30,910,002.77
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-14,105,552.72	30,910,002.77

6.3 净资产变动表

会计主体：申万菱信中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	357,518,558.20	-	139,558,071.57	497,076,629.77
二、本期期初净资产	357,518,558.20	-	139,558,071.57	497,076,629.77
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	39,705,308.33	-	-2,304,306.98	37,401,001.35
（一）、综合收益总额	-	-	-14,105,552.72	-14,105,552.72
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	39,705,308.33	-	11,801,245.74	51,506,554.07
其中：1.基金申购款	73,344,427.64	-	25,208,277.21	98,552,704.85
2.基金赎回款	-33,639,119.31	-	-13,407,031.47	-47,046,150.78
（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	397,223,866.53	-	137,253,764.59	534,477,631.12
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	313,959,528.16	-	151,502,503.87	465,462,032.03
二、本期期初净资产	313,959,528.16	-	151,502,503.87	465,462,032.03

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-23,894,739.95	-	15,573,047.44	-8,321,692.51
（一）、综合收益总额	-	-	30,910,002.77	30,910,002.77
（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）	-23,894,739.95	-	-15,336,955.33	-39,231,695.28
其中：1.基金申购款	45,489,880.36	-	26,340,352.34	71,830,232.70
2.基金赎回款	-69,384,620.31	-	-41,677,307.67	-111,061,927.98
（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	290,064,788.21	-	167,075,551.31	457,140,339.52

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：汪涛，主管会计工作负责人：汪涛，会计机构负责人：徐越

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

申万菱信中证 500 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[2015]第 3120 号《关于准予申万菱信中证 500 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》和《申万菱信中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 546,833,443.54 元。经向中国证监会备案，《申万菱信中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2016 年 4 月 21 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 546,955,898.05 份基金份额，其中认购资金利息折合 122,454.51 份基金份额。本基金的基金管理人为申万菱信基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《关于申万菱信中证 500 指数增强型证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同的公告》，本基金自 2019 年 8 月 8 日起增加 C 类份额，并对本基金的基金合同作相应修改。在本基金增加 C 类份额后，原有的基金份额将全部自动转换为本基金 A 类份额。A 类基金份额在投资者申购时收取手续费，不计提销售服务费；C 类基金份额从本类别基金资产中计提销售服务费，不收取手续费。

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 500 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 500 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，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板及其他依法发行、上市的股票）、权证、股指期货、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、证券公司短期公司债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单等固定收益类资产及现金，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。

本基金资产配置比例为：本基金持有的股票资产占基金资产净值的比例不低于 80%，其中投资于中证 500 指数成份股及备选成份股的资产占股票资产的比例不低于 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金投资股指期货、权证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。本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率*95%+银行活期存款利率（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，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012

年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 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 2024 年 6 月 30 日的财务状况、2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

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》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、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》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) 资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

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

(b) 对证券投资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，股权的股息、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。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(c) 对基金从上市公司、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。

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

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

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 2024 年 6 月 30 日
活期存款	50,965,301.54
等于：本金	50,960,593.12
加：应计利息	4,708.42
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	50,965,301.54

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	504,543,912.32	-	484,261,376.00	-20,282,536.32
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	504,543,912.32	-	484,261,376.00	-20,282,536.32	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末			
	2024 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
资产		负债		
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	14,049,471.53	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	14,049,471.53	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2407	IC2407	14.00	13,769,280.00	-280,191.53
合计	-			-280,191.53
减：可抵销期货暂收款	-			-280,191.53
净额	-			-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

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 2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	91.68
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	2,066,755.61
其中：交易所市场	2,066,755.61
银行间市场	-
应付利息	-
应付指数使用费	22,135.74
预提审计费用	26,355.42
预提信息披露费用	59,672.34
合计	2,175,010.79

6.4.7.7 实收基金

申万菱信中证 500 指数增强 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	319,948,322.36	319,948,322.36
本期申购	66,505,746.71	66,505,746.71
本期赎回（以“-”号填列）	-24,588,510.78	-24,588,510.78
本期末	361,865,558.29	361,865,558.29

申万菱信中证 500 指数增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	37,570,235.84	37,570,235.84
本期申购	6,838,680.93	6,838,680.93
本期赎回（以“-”号填列）	-9,050,608.53	-9,050,608.53

本期末	35,358,308.24	35,358,308.24
-----	---------------	---------------

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 500 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	113,585,773.38	8,472,800.18	122,058,573.56
本期期初	113,585,773.38	8,472,800.18	122,058,573.56
本期利润	1,029,092.98	-13,415,769.58	-12,386,676.60
本期基金份额交易产生的变动数	12,989,423.48	-187,005.99	12,802,417.49
其中：基金申购款	21,172,528.78	997,870.37	22,170,399.15
基金赎回款	-8,183,105.30	-1,184,876.36	-9,367,981.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	127,604,289.84	-5,129,975.39	122,474,314.45

申万菱信中证 500 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	13,535,114.61	3,964,383.40	17,499,498.01
本期期初	13,535,114.61	3,964,383.40	17,499,498.01
本期利润	-263,986.10	-1,454,890.02	-1,718,876.12
本期基金份额交易产生的变动数	-700,458.46	-300,713.29	-1,001,171.75
其中：基金申购款	2,355,425.82	682,452.24	3,037,878.06
基金赎回款	-3,055,884.28	-983,165.53	-4,039,049.81
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,570,670.05	2,208,780.09	14,779,450.14

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	85,756.17
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	35,875.97
其他	829.58
合计	122,461.72

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
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	2,038,038,252.76
减：卖出股票成本总额	2,036,327,227.08
减：交易费用	5,176,906.12
买卖股票差价收入	-3,465,880.44

6.4.7.10.2 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期无股票投资收益-证券出借差价收入。

6.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益**6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成**

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	870,291.19

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	6,869,734.73
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	6,869,734.73
----	--------------

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1.交易性金融资产	-14,133,748.07
——股票投资	-14,133,748.07
——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	-736,911.53
——权证投资	-
——期货投资	-736,911.53
4.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	-14,870,659.60

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	17,663.83
基金转换费收入	32.57
合计	17,696.40

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
	2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	26,355.42
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
指数使用费	42,276.88
汇划手续费	650.00
合计	128,954.64

注：本基金的指数使用费从基金财产中列支。在通常情况下，指数许可使用费按前一日的基金资产净值的 0.016% 的年费率计提，逐日累计，每季支付一次。若季度指数使用费下限(人民币 5 万元) 大于按基金资产净值提取的季度指数使用费，超过部分由基金管理人自行承担。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

无。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的 比例	成交金额	占当期股票成交总额的 比例
申万宏源	1,175,842,144.16	28.44%	449,935,837.92	18.01%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的 比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的 比例
申万宏源	1,107,016.84	28.44%	699,478.28	33.84%
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的 比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的 比例
申万宏源	416,480.69	18.00%	302,064.03	26.63%

注：上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除证券公司需承担的费用后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,642,303.52	2,281,652.49
其中：支付销售机构的客户维护费	834,108.37	777,331.99
应支付基金管理人的净管理费	1,808,195.15	1,504,320.50

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	528,460.74	456,330.57

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日

	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	申万菱信中证 500 指数增强 A	申万菱信中证 500 指数增强 C	合计
中国工商银行	9,648.61	676.48	10,325.09
申万菱信	48,195.37	285.62	48,480.99
申万宏源	708.77	-	708.77
合计	58,552.75	962.10	59,514.85
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	申万菱信中证500指数增强A	申万菱信中证500指数增强C	合计
中国工商银行	10,295.50	39.58	10,335.08
申万菱信	27,455.79	37,049.33	64,505.12
申万宏源	447.47	-	447.47
合计	38,198.76	37,088.91	75,287.67

注：（1）本基金 A 类基金份额的销售服务费年费率为 0.10%，销售服务费按前一日 A 类基金份额的基金资产净值的 0.10% 年费率计提。计算方法如下：

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

H 为 A 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为 A 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。

（2）本基金 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：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

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自有资金投资本基金的情况

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

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本期末和上年度末，除基金管理人之外的其他关联方，未发生投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2024年1月1日至2024年6月30日		2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	50,965,301.54	85,756.17	28,618,117.20	52,970.83

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2024年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001359	平安电工	2024-03-19	1-6个月(含)	新股限售	17.39	20.61	184.00	3,199.76	3,792.24	-
001379	腾达科技	2024-01-11	1-6个月(含)	新股限售	16.98	13.48	213.00	3,616.74	2,871.24	-
001387	雪祺电气	2024-01-04	1-6个月(含)	新股限售	15.38	15.23	133.00	2,045.54	2,025.59	-
001387	雪祺电气	2024-06-03	1-6个月(含)	新股限售-送股	0.00	15.23	40.00	0.00	609.20	限售期送股
001389	广合科技	2024-03-26	1-6个月(含)	新股限售	17.43	42.03	222.00	3,869.46	9,330.66	-
301392	汇成真真空	2024-05-28	1-6个月(含)	新股限售	12.20	55.87	219.00	2,671.80	12,235.53	-
301502	华阳智能	2024-01-26	1-6个月(含)	新股限售	28.01	37.81	138.00	3,865.38	5,217.78	-
301536	星辰科技	2024-03-20	1-6个月(含)	新股限售	16.16	32.26	481.00	7,772.96	15,517.06	-
301538	骏鼎达	2024-03-13	1-6个月(含)	新股限售	55.82	91.22	107.00	5,972.74	9,760.54	-
301538	骏鼎达	2024-05-22	1-6个月(含)	新股限售-送股	0.00	91.22	43.00	0.00	3,922.46	限售期送股
301539	宏鑫科技	2024-04-03	1-6个月(含)	新股限售	10.64	24.30	361.00	3,841.04	8,772.30	-
301565	中仑新材	2024-06-13	1-6个月(含)	新股限售	11.88	23.32	711.00	8,446.68	16,580.52	-
301566	达利凯普	2023-12-22	1-6个月	新股限售	8.90	16.75	576.00	5,126.40	9,648.00	-

			(含)							
301580	爱迪特	2024-06-19	1-6 个月(含)	新股限售	44.95	74.00	202.00	9,079.90	14,948.00	-
301587	中瑞股份	2024-03-27	1-6 个月(含)	新股限售	21.73	27.10	306.00	6,649.38	8,292.60	-
603082	北自科技	2024-01-23	1-6 个月(含)	新股限售	21.28	29.48	107.00	2,276.96	3,154.36	-
603285	键邦股份	2024-06-28	1 个月内(含)	认购新发证券	18.65	18.65	1,158.00	21,596.70	21,596.70	-
603285	键邦股份	2024-06-28	1-6 个月(含)	新股限售	18.65	18.65	129.00	2,405.85	2,405.85	-
603312	西典新能	2024-01-04	1-6 个月(含)	新股限售	29.02	25.34	130.00	3,772.60	3,294.20	-
603325	博隆技术	2024-01-03	1-6 个月(含)	新股限售	72.46	68.02	66.00	4,782.36	4,489.32	-
603341	龙旗科技	2024-02-23	1-6 个月(含)	新股限售	26.00	37.47	293.00	7,618.00	10,978.71	-
603344	星德胜	2024-03-13	1-6 个月(含)	新股限售	19.18	22.66	182.00	3,490.76	4,124.12	-
603350	安乃达	2024-06-26	1 个月内(含)	认购新发证券	20.56	20.56	945.00	19,429.20	19,429.20	-
603350	安乃达	2024-06-26	1-6 个月(含)	新股限售	20.56	20.56	106.00	2,179.36	2,179.36	-
603375	盛景微	2024-01-17	1-6 个月(含)	新股限售	38.18	38.88	72.00	2,748.96	2,799.36	-
603381	永臻股份	2024-06-19	1-6 个月(含)	新股限售	23.35	26.59	178.00	4,156.30	4,733.02	-
688530	欧莱新材	2024-04-29	1-6 个月(含)	新股限售	9.60	18.96	344.00	3,302.40	6,522.24	-
68869	灿芯	2024-0	1-6 个	新股	19.86	49.38	247.00	4,905.	12,196	-

1	股份	4-02	月 (含)	限售				42	.86	
68869 2	达梦 数据	2024-0 6-04	1-6 个 月 (含)	新股 限售	86.96	209.54	175.00	15,218 .00	36,669 .50	-
68869 5	中创 股份	2024-0 3-06	1-6 个 月 (含)	新股 限售	22.43	31.54	186.00	4,171. 98	5,866. 44	-
68870 9	成都 华微	2024-0 1-31	1-6 个 月 (含)	新股 限售	15.69	18.77	843.00	13,226 .67	15,823 .11	-

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
60022 0	ST 阳 光	2024-06 -14	重大事 项停牌	0.09	-	-	95,500.00	169,075.05	8,595.00	重大 事项
00083 6	ST 富 通	2024-06 -18	重大事 项停牌	0.09	-	-	75,400.00	165,197.04	6,786.00	重大 事项

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为指数增强型基金。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，本基金管理人认为与以上银行相关的信用风险不重大。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成债券等投资品种的交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小，本基金管理人认为在交易所进行的交易涉及的信用风险不重大。

对于银行间债券等品种的交易，本基金管理人主要通过事前检查和控制交易对手信用及交割方式来管理风险。

对于发行者的信用风险控制，本基金管理人主要通过对其投资品种的信用等级评估来选择适当的投资对象来管理。于本期末，本基金持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占净资产的比例为 0%（上期末：0%）。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

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

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短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发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余是流动性较好的可在银行间同业市场交易的金融资产工具、银行存款和结算备付金，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注

6.4.12。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过净资产的 15%。

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	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
-----	--------	--------	----------	-------	-------	-----	----

2024年6月30日							
资产							
货币资金	50,965,301.54	-	-	-	-	-	50,965,301.54
结算备付金	2,826,040.12	-	-	-	-	-	2,826,040.12
存出保证金	112,839.77	-	-	-	-	1,790,006.40	1,902,846.17
交易性金融资产	-	-	-	-	-	484,261,376.00	484,261,376.00
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	2,672,122.11	2,672,122.11
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	230,168.18	230,168.18
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	53,904,181.43	-	-	-	-	488,953,672.69	542,857,854.12
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	5,082,647.43	5,082,647.43
应付赎回款	-	-	-	-	-	532,031.02	532,031.02
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	444,746.18	444,746.18
应付托管费	-	-	-	-	-	88,949.20	88,949.20
应付销售服务费	-	-	-	-	-	56,838.38	56,838.38
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	2,175,010.79	2,175,010.79
负债总计	-	-	-	-	-	8,380,223.0	8,380,223.0

						0	0
利率敏感度缺口	53,904,181.43	-	-	-	-	480,573,449.69	534,477,631.12
上年度末 2023 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	57,014,460.98	-	-	-	-	-	57,014,460.98
结算备付金	4,338,798.26	-	-	-	-	-	4,338,798.26
存出保证金	71,488.80	-	-	-	-	2,397,142.80	2,468,631.60
交易性金融资产	-	-	-	-	-	436,312,188.55	436,312,188.55
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	145,392.46	145,392.46
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	398,774.16	398,774.16
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	61,424,748.04	-	-	-	-	439,253,497.97	500,678,246.01
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	543,141.67	543,141.67
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	421,642.65	421,642.65
应付托管费	-	-	-	-	-	84,328.55	84,328.55
应付销售服务费	-	-	-	-	-	58,627.56	58,627.56
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-

其他负债	-	-	-	-	-	2,493,875.81	2,493,875.81
负债总计	-	-	-	-	-	3,601,616.24	3,601,616.24
利率敏感度缺口	61,424,748.04	-	-	-	-	435,651,881.73	497,076,629.77

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股票资产的比例不低于 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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金	公允价值	占基金

		资产净 值比例 (%)		资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	484,261,376.00	90.60	436,312,188.55	87.78
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	484,261,376.00	90.60	436,312,188.55	87.78

注：其他包含股指期货投资，于本期末，持仓数量为 14 手，合约市值为 13769280 元(附注 6.4.7.3)。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货投资产生的持仓损益，则其他中包含的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得持仓损益)之间按抵消后的金额为 0。

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	基准上升 5%	21,710,000.00	18,010,000.00
	基准下降 5%	-21,710,000.00	-18,010,000.00

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	483,961,078.93	435,922,783.42
第二层次	45,611.11	-
第三层次	254,685.96	389,405.13
合计	484,261,376.00	436,312,188.55

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 2024 年 6 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2023 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 2024 年 6 月 30 日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

7 投资组合报告**7.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	484,261,376.00	89.21
	其中：股票	484,261,376.00	89.21
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-

	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	53,791,341.66	9.91
8	其他各项资产	4,805,136.46	0.89
9	合计	542,857,854.12	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

7.2.1.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	290,704.00	0.05
B	采矿业	28,649,041.00	5.36
C	制造业	229,487,694.70	42.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	34,256,076.36	6.41
E	建筑业	11,563,756.00	2.16
F	批发和零售业	11,339,766.04	2.12
G	交通运输、仓储和邮政业	5,916,663.00	1.11
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	26,927,706.65	5.04

J	金融业	44,892,779.25	8.40
K	房地产业	4,301,882.00	0.80
L	租赁和商务服务业	1,554,456.00	0.29
M	科学研究和技术服务业	157,856.00	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	5,613,097.00	1.05
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	5,420,723.00	1.01
S	综合	-	-
	合计	410,372,201.00	76.78

7.2.1.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	355,159.00	0.07
B	采矿业	1,933,920.00	0.36
C	制造业	50,010,740.45	9.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,779,635.00	0.71
E	建筑业	1,990,748.00	0.37
F	批发和零售业	2,070,721.00	0.39
G	交通运输、仓储和邮政业	4,190,267.00	0.78
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,120,281.43	0.77
J	金融业	3,082,927.00	0.58
K	房地产业	291,056.00	0.05
L	租赁和商务服务业	506,277.12	0.09

M	科学研究和技术服务业	365,915.00	0.07
N	水利、环境和公共设施管理业	943,423.00	0.18
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	172,305.00	0.03
R	文化、体育和娱乐业	75,800.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	73,889,175.00	13.82

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600582	天地科技	1,007,200.00	6,939,608.00	1.30
2	601058	赛轮轮胎	405,000.00	5,670,000.00	1.06
3	000883	湖北能源	919,800.00	5,527,998.00	1.03
4	601611	中国核建	638,200.00	5,163,038.00	0.97
5	002152	广电运通	491,000.00	5,135,860.00	0.96
6	300017	网宿科技	622,400.00	4,916,960.00	0.92
7	002683	广东宏大	241,400.00	4,859,382.00	0.91
8	601665	齐鲁银行	955,000.00	4,689,050.00	0.88
9	002340	格林美	727,100.00	4,631,627.00	0.87
10	600901	江苏金租	912,933.00	4,610,311.65	0.86
11	601128	常熟银行	602,080.00	4,557,745.60	0.85
12	600970	中材国际	338,300.00	4,079,898.00	0.76
13	600098	广州发展	599,800.00	3,838,720.00	0.72
14	600583	海油工程	646,300.00	3,819,633.00	0.71
15	600967	内蒙一机	520,700.00	3,749,040.00	0.70
16	600177	雅戈尔	525,452.00	3,741,218.24	0.70
17	300002	神州泰岳	453,900.00	3,685,668.00	0.69

18	300502	新易盛	34,500.00	3,641,475.00	0.68
19	300251	光线传媒	428,300.00	3,602,003.00	0.67
20	600066	宇通客车	137,600.00	3,550,080.00	0.66
21	600642	申能股份	391,002.00	3,452,547.66	0.65
22	002128	电投能源	163,300.00	3,445,630.00	0.64
23	603568	伟明环保	166,000.00	3,416,280.00	0.64
24	000598	兴蓉环境	437,600.00	3,290,752.00	0.62
25	000423	东阿阿胶	52,300.00	3,273,980.00	0.61
26	000921	海信家电	100,000.00	3,224,000.00	0.60
27	002532	天山铝业	394,200.00	3,196,962.00	0.60
28	600968	海油发展	768,600.00	3,166,632.00	0.59
29	300253	卫宁健康	528,500.00	3,118,150.00	0.58
30	002850	科达利	40,800.00	3,116,304.00	0.58
31	000738	航发控制	155,100.00	3,112,857.00	0.58
32	600988	赤峰黄金	190,100.00	3,106,234.00	0.58
33	002595	豪迈科技	81,100.00	3,095,587.00	0.58
34	601966	玲珑轮胎	167,000.00	3,067,790.00	0.57
35	600021	上海电力	304,500.00	3,011,505.00	0.56
36	002273	水晶光电	176,800.00	3,002,064.00	0.56
37	603786	科博达	46,500.00	2,982,975.00	0.56
38	002025	航天电器	64,192.00	2,977,224.96	0.56
39	600521	华海药业	174,200.00	2,970,110.00	0.56
40	000830	鲁西化工	254,000.00	2,943,860.00	0.55
41	600566	济川药业	92,400.00	2,930,004.00	0.55
42	688234	天岳先进	62,246.00	2,920,582.32	0.55
43	000155	川能动力	267,810.00	2,884,313.70	0.54
44	300724	捷佳伟创	53,300.00	2,878,733.00	0.54
45	688516	奥特维	68,525.00	2,865,030.25	0.54
46	000887	中鼎股份	232,600.00	2,847,024.00	0.53
47	002507	涪陵榨菜	229,400.00	2,810,150.00	0.53
48	000563	陕国投 A	1,019,300.00	2,803,075.00	0.52
49	600399	抚顺特钢	495,200.00	2,787,976.00	0.52
50	603317	天味食品	240,000.00	2,738,400.00	0.51
51	600315	上海家化	153,000.00	2,720,340.00	0.51
52	002155	湖南黄金	145,000.00	2,624,500.00	0.49
53	002008	大族激光	124,300.00	2,585,440.00	0.48
54	601958	金钼股份	247,400.00	2,575,434.00	0.48
55	000997	新大陆	180,100.00	2,505,191.00	0.47
56	600737	中粮糖业	260,349.00	2,496,746.91	0.47
57	600578	京能电力	758,800.00	2,458,512.00	0.46
58	000400	许继电气	71,400.00	2,456,874.00	0.46
59	000630	铜陵有色	677,200.00	2,444,692.00	0.46
60	002984	森麒麟	100,900.00	2,430,681.00	0.45

61	600863	内蒙华电	513,000.00	2,380,320.00	0.45
62	002078	太阳纸业	168,900.00	2,356,155.00	0.44
63	000683	远兴能源	335,500.00	2,318,305.00	0.43
64	688029	南微医学	37,489.00	2,307,822.84	0.43
65	600325	华发股份	349,600.00	2,272,400.00	0.43
66	600339	中油工程	717,900.00	2,239,848.00	0.42
67	600956	新天绿能	272,700.00	2,227,959.00	0.42
68	002436	兴森科技	213,100.00	2,199,192.00	0.41
69	300070	碧水源	524,300.00	2,196,817.00	0.41
70	600390	五矿资本	542,400.00	2,196,720.00	0.41
71	601577	长沙银行	267,200.00	2,185,696.00	0.41
72	002056	横店东磁	174,900.00	2,181,003.00	0.41
73	688349	三一重能	86,600.00	2,151,144.00	0.40
74	600580	卧龙电驱	176,800.00	2,148,120.00	0.40
75	600095	湘财股份	359,000.00	2,139,640.00	0.40
76	603160	汇顶科技	31,100.00	2,138,125.00	0.40
77	688567	孚能科技	222,235.00	2,133,456.00	0.40
78	000039	中集集团	230,100.00	2,130,726.00	0.40
79	002465	海格通信	205,500.00	2,128,980.00	0.40
80	002202	金风科技	316,400.00	2,126,208.00	0.40
81	600096	云天化	109,400.00	2,124,548.00	0.40
82	002261	拓维信息	191,900.00	2,124,333.00	0.40
83	603056	德邦股份	161,400.00	2,114,340.00	0.40
84	300009	安科生物	245,800.00	2,099,132.00	0.39
85	600867	通化东宝	250,786.00	2,099,078.82	0.39
86	603858	步长制药	138,200.00	2,093,730.00	0.39
87	000932	华菱钢铁	472,400.00	2,092,732.00	0.39
88	002065	东华软件	462,500.00	2,090,500.00	0.39
89	600827	百联股份	282,600.00	2,085,588.00	0.39
90	600348	华阳股份	208,900.00	2,080,644.00	0.39
91	601456	国联证券	215,300.00	2,075,492.00	0.39
92	600739	辽宁成大	247,100.00	2,068,227.00	0.39
93	300054	鼎龙股份	90,500.00	2,052,540.00	0.38
94	688819	天能股份	85,860.00	2,048,619.60	0.38
95	300763	锦浪科技	49,100.00	2,044,524.00	0.38
96	600801	华新水泥	147,800.00	2,032,250.00	0.38
97	600663	陆家嘴	230,100.00	2,029,482.00	0.38
98	688521	芯原股份	75,094.00	2,008,764.50	0.38
99	688188	柏楚电子	10,853.00	2,002,921.15	0.37
100	603379	三美股份	50,900.00	1,992,226.00	0.37
101	600862	中航高科	105,700.00	1,985,046.00	0.37
102	002472	双环传动	90,000.00	1,981,800.00	0.37
103	002625	光启技术	112,600.00	1,953,610.00	0.37
104	603885	吉祥航空	173,100.00	1,902,369.00	0.36

105	603688	石英股份	62,750.00	1,858,027.50	0.35
106	688617	惠泰医疗	4,000.00	1,824,400.00	0.34
107	600282	南钢股份	363,400.00	1,809,732.00	0.34
108	300001	特锐德	87,700.00	1,764,524.00	0.33
109	600062	华润双鹤	89,900.00	1,760,242.00	0.33
110	600529	山东药玻	68,900.00	1,745,926.00	0.33
111	300394	天孚通信	19,460.00	1,720,653.20	0.32
112	601608	中信重工	447,300.00	1,704,213.00	0.32
113	601216	君正集团	461,700.00	1,703,673.00	0.32
114	000060	中金岭南	387,400.00	1,642,576.00	0.31
115	600528	中铁工业	223,700.00	1,637,484.00	0.31
116	601997	贵阳银行	310,200.00	1,634,754.00	0.31
117	688425	铁建重工	443,668.00	1,632,698.24	0.31
118	601158	重庆水务	338,800.00	1,626,240.00	0.30
119	600637	东方明珠	267,000.00	1,623,360.00	0.30
120	000958	电投产融	443,100.00	1,621,746.00	0.30
121	000778	新兴铸管	465,300.00	1,619,244.00	0.30
122	000967	盈峰环境	382,400.00	1,617,552.00	0.30
123	600977	中国电影	149,700.00	1,610,772.00	0.30
124	600056	中国医药	158,200.00	1,600,984.00	0.30
125	000825	太钢不锈	473,100.00	1,599,078.00	0.30
126	600998	九州通	327,100.00	1,596,248.00	0.30
127	601108	财通证券	241,300.00	1,594,993.00	0.30
128	000728	国元证券	262,900.00	1,593,174.00	0.30
129	002500	山西证券	336,000.00	1,579,200.00	0.30
130	601568	北元集团	424,900.00	1,576,379.00	0.29
131	600655	豫园股份	304,900.00	1,570,235.00	0.29
132	600909	华安证券	369,700.00	1,556,437.00	0.29
133	600755	厦门国贸	216,800.00	1,554,456.00	0.29
134	601077	渝农商行	309,000.00	1,551,180.00	0.29
135	600299	安迪苏	159,500.00	1,547,150.00	0.29
136	600925	苏能股份	305,300.00	1,541,765.00	0.29
137	000623	吉林敖东	114,400.00	1,532,960.00	0.29
138	600873	梅花生物	152,700.00	1,530,054.00	0.29
139	000513	丽珠集团	41,000.00	1,525,610.00	0.29
140	601198	东兴证券	191,400.00	1,523,544.00	0.29
141	002926	华西证券	230,100.00	1,516,359.00	0.28
142	002939	长城证券	226,000.00	1,514,200.00	0.28
143	600872	中炬高新	66,600.00	1,511,154.00	0.28
144	601696	中银证券	166,200.00	1,509,096.00	0.28
145	600839	四川长虹	336,000.00	1,508,640.00	0.28
146	601990	南京证券	195,800.00	1,503,744.00	0.28
147	600109	国金证券	198,000.00	1,494,900.00	0.28
148	300529	健帆生物	54,800.00	1,491,108.00	0.28

149	000559	万向钱潮	333,900.00	1,489,194.00	0.28
150	603883	老百姓	81,089.00	1,488,794.04	0.28
151	300776	帝尔激光	32,000.00	1,470,720.00	0.28
152	600765	中航重机	71,340.00	1,455,336.00	0.27
153	600380	健康元	129,247.00	1,443,688.99	0.27
154	603589	口子窖	35,800.00	1,403,002.00	0.26
155	688301	奕瑞科技	11,957.00	1,377,805.11	0.26
156	600483	福能股份	116,800.00	1,361,888.00	0.25
157	601717	郑煤机	89,200.00	1,320,160.00	0.25
158	688520	神州细胞	33,466.00	1,316,887.10	0.25
159	600143	金发科技	195,400.00	1,291,594.00	0.24
160	600699	均胜电子	83,000.00	1,230,060.00	0.23
161	002153	石基信息	213,700.00	1,224,501.00	0.23
162	600316	洪都航空	71,500.00	1,189,045.00	0.22
163	300207	欣旺达	77,000.00	1,168,090.00	0.22
164	000937	冀中能源	168,700.00	1,130,290.00	0.21
165	300487	蓝晓科技	26,400.00	1,102,464.00	0.21
166	603338	浙江鼎力	16,600.00	1,002,972.00	0.19
167	688281	华秦科技	11,918.00	993,007.76	0.19
168	601179	中国西电	113,200.00	910,128.00	0.17
169	002120	韵达股份	112,500.00	870,750.00	0.16
170	601933	永辉超市	342,500.00	849,400.00	0.16
171	603228	景旺电子	25,700.00	817,260.00	0.15
172	300558	贝达药业	24,000.00	781,200.00	0.15
173	002517	恺英网络	78,200.00	746,810.00	0.14
174	002019	亿帆医药	53,300.00	658,788.00	0.12
175	688348	昱能科技	10,300.00	607,700.00	0.11
176	603650	彤程新材	16,500.00	487,575.00	0.09
177	601000	唐山港	92,000.00	432,400.00	0.08
178	002423	中粮资本	39,800.00	298,102.00	0.06
179	600517	国网英大	67,700.00	293,141.00	0.05
180	600392	盛和资源	33,600.00	289,632.00	0.05
181	601598	中国外运	50,800.00	286,004.00	0.05
182	600499	科达制造	33,700.00	284,091.00	0.05
183	601139	深圳燃气	41,600.00	277,888.00	0.05
184	601168	西部矿业	12,100.00	217,195.00	0.04
185	300866	安克创新	3,030.00	215,766.30	0.04
186	002608	江苏国信	27,700.00	214,675.00	0.04
187	002409	雅克科技	3,400.00	213,894.00	0.04
188	002966	苏州银行	28,400.00	213,000.00	0.04
189	600398	海澜之家	22,900.00	211,596.00	0.04
190	600598	北大荒	16,900.00	211,081.00	0.04
191	603596	伯特利	5,400.00	210,060.00	0.04
192	600350	山东高速	23,600.00	208,860.00	0.04

193	603218	日月股份	20,300.00	208,481.00	0.04
194	002739	万达电影	17,200.00	207,948.00	0.04
195	603816	顾家家居	6,400.00	206,656.00	0.04
196	300146	汤臣倍健	15,200.00	205,960.00	0.04
197	003022	联泓新科	14,900.00	204,279.00	0.04
198	688777	中控技术	5,400.00	203,580.00	0.04
199	301236	软通动力	5,700.00	200,697.00	0.04
200	300212	易华录	11,900.00	200,277.00	0.04
201	688006	杭可科技	11,300.00	197,185.00	0.04
202	000156	华数传媒	31,300.00	196,564.00	0.04
203	002738	中矿资源	7,300.00	195,640.00	0.04
204	603712	七一二	10,600.00	192,814.00	0.04
205	600497	驰宏锌锗	15,300.00	81,702.00	0.02
206	300296	利亚德	18,100.00	81,450.00	0.02
207	003035	南网能源	18,500.00	81,400.00	0.02
208	600928	西安银行	24,800.00	81,096.00	0.02
209	600549	厦门钨业	4,700.00	81,075.00	0.02
210	600707	彩虹股份	11,900.00	81,039.00	0.02
211	000591	太阳能	17,200.00	81,012.00	0.02
212	600820	隧道股份	12,400.00	80,972.00	0.02
213	601228	广州港	26,400.00	80,520.00	0.02
214	600704	物产中大	18,500.00	80,290.00	0.02
215	600352	浙江龙盛	9,300.00	79,887.00	0.01
216	000998	隆平高科	8,100.00	79,623.00	0.01
217	300383	光环新网	9,400.00	79,430.00	0.01
218	002797	第一创业	15,500.00	78,895.00	0.01
219	688169	石头科技	200.00	78,520.00	0.01
220	600369	西南证券	21,900.00	78,402.00	0.01
221	300012	华测检测	7,600.00	76,456.00	0.01
222	600377	宁沪高速	1,700.00	21,420.00	0.00
223	000987	越秀资本	4,200.00	20,832.00	0.00
224	688120	华海清科	82.00	15,545.56	0.00

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300849	锦盛新材	23,000.00	292,790.00	0.05
2	600273	嘉化能源	41,000.00	292,740.00	0.05
3	600019	宝钢股份	44,000.00	292,600.00	0.05
4	600033	福建高速	87,200.00	292,120.00	0.05
5	600905	三峡能源	66,900.00	291,684.00	0.05
6	601658	邮储银行	57,500.00	291,525.00	0.05

7	601319	中国人保	56,500.00	290,975.00	0.05
8	600020	中原高速	82,000.00	290,280.00	0.05
9	000755	山西高速	69,400.00	290,092.00	0.05
10	601816	京沪高铁	54,000.00	289,980.00	0.05
11	601326	秦港股份	91,400.00	289,738.00	0.05
12	600623	华谊集团	49,900.00	288,422.00	0.05
13	000690	宝新能源	56,500.00	288,150.00	0.05
14	601375	中原证券	84,100.00	286,781.00	0.05
15	601686	友发集团	57,000.00	286,710.00	0.05
16	600717	天津港	67,000.00	286,090.00	0.05
17	601018	宁波港	83,900.00	285,260.00	0.05
18	600248	陕建股份	78,400.00	284,592.00	0.05
19	601700	风范股份	64,600.00	283,594.00	0.05
20	601968	宝钢包装	60,300.00	282,204.00	0.05
21	002658	雪迪龙	55,000.00	282,150.00	0.05
22	600713	南京医药	66,000.00	278,520.00	0.05
23	600698	湖南天雁	82,000.00	277,980.00	0.05
24	600740	山西焦化	69,300.00	271,656.00	0.05
25	301182	凯旺科技	10,700.00	237,326.00	0.04
26	002371	北方华创	700.00	223,923.00	0.04
27	688159	有方科技	5,800.00	219,588.00	0.04
28	603936	博敏电子	26,100.00	219,240.00	0.04
29	301456	盘古智能	8,400.00	219,156.00	0.04
30	688123	聚辰股份	3,600.00	218,988.00	0.04
31	603390	通达电气	25,900.00	218,596.00	0.04
32	000543	皖能电力	24,700.00	218,595.00	0.04
33	600011	华能国际	22,700.00	218,374.00	0.04
34	688517	金冠电气	15,614.00	218,283.72	0.04
35	600875	东方电气	11,800.00	217,710.00	0.04
36	688506	百利天恒	1,200.00	217,680.00	0.04
37	300709	精研科技	8,600.00	217,408.00	0.04
38	688551	科威尔	6,900.00	217,350.00	0.04
39	600522	中天科技	13,700.00	217,145.00	0.04
40	605488	福莱新材	16,700.00	217,100.00	0.04
41	600183	生益科技	10,300.00	216,918.00	0.04
42	601600	中国铝业	28,400.00	216,692.00	0.04
43	301329	信音电子	11,200.00	216,496.00	0.04
44	688143	长盈通	10,100.00	216,342.00	0.04
45	600482	中国动力	11,100.00	216,228.00	0.04
46	003816	中国广核	46,700.00	216,221.00	0.04
47	601899	紫金矿业	12,300.00	216,111.00	0.04
48	603993	洛阳钼业	25,400.00	215,900.00	0.04
49	688418	震有科技	12,600.00	215,838.00	0.04
50	603556	海兴电力	4,600.00	215,418.00	0.04

51	688125	安达智能	6,900.00	215,418.00	0.04
52	600505	西昌电力	18,900.00	215,271.00	0.04
53	301321	翰博高新	18,700.00	215,237.00	0.04
54	688311	盟升电子	10,500.00	215,145.00	0.04
55	688210	统联精密	9,700.00	214,855.00	0.04
56	000807	云铝股份	15,900.00	214,809.00	0.04
57	600160	巨化股份	8,900.00	214,757.00	0.04
58	301013	利和兴	20,100.00	214,668.00	0.04
59	600531	豫光金铅	33,300.00	214,452.00	0.04
60	600795	国电电力	35,800.00	214,442.00	0.04
61	600961	株冶集团	22,700.00	214,288.00	0.04
62	300885	海昌新材	24,100.00	214,249.00	0.04
63	301011	华立科技	13,900.00	214,199.00	0.04
64	600026	中远海能	13,700.00	213,857.00	0.04
65	300706	阿石创	11,200.00	213,696.00	0.04
66	600547	山东黄金	7,800.00	213,564.00	0.04
67	688662	富信科技	8,751.00	213,524.40	0.04
68	688501	青达环保	15,602.00	213,435.36	0.04
69	600886	国投电力	11,700.00	213,408.00	0.04
70	300679	电连技术	5,300.00	213,219.00	0.04
71	000603	盛达资源	18,000.00	212,940.00	0.04
72	300980	祥源新材	13,500.00	212,760.00	0.04
73	002955	鸿合科技	9,100.00	212,758.00	0.04
74	688035	德邦科技	6,600.00	212,652.00	0.04
75	605169	洪通燃气	27,100.00	212,464.00	0.04
76	301516	中远通	11,400.00	212,382.00	0.04
77	603088	宁波精达	28,200.00	212,346.00	0.04
78	688646	逸飞激光	6,800.00	212,228.00	0.04
79	002648	卫星化学	11,800.00	212,164.00	0.04
80	600803	新奥股份	10,200.00	212,160.00	0.04
81	688355	明志科技	15,807.00	212,129.94	0.04
82	688077	大地熊	13,400.00	212,122.00	0.04
83	002911	佛燃能源	23,200.00	212,048.00	0.04
84	688028	沃尔德	12,900.00	211,947.00	0.04
85	688160	步科股份	5,300.00	211,947.00	0.04
86	600674	川投能源	11,300.00	211,875.00	0.04
87	000426	兴业银锡	15,600.00	211,848.00	0.04
88	000923	河钢资源	12,300.00	211,806.00	0.04
89	688589	力合微	8,400.00	211,764.00	0.04
90	600236	桂冠电力	27,600.00	211,692.00	0.04
91	301021	英诺激光	13,500.00	211,680.00	0.04
92	301488	豪恩汽电	4,400.00	211,640.00	0.04
93	300940	南极光	16,600.00	211,484.00	0.04
94	300800	力合科技	20,400.00	211,344.00	0.04

95	688582	芯动联科	7,500.00	211,200.00	0.04
96	002105	信隆健康	51,500.00	211,150.00	0.04
97	688360	德马科技	17,535.00	211,121.40	0.04
98	600600	青岛啤酒	2,900.00	211,033.00	0.04
99	603085	天成自控	23,600.00	210,984.00	0.04
100	600269	赣粤高速	40,800.00	210,936.00	0.04
101	601311	骆驼股份	26,300.00	210,926.00	0.04
102	300504	天邑股份	17,300.00	210,887.00	0.04
103	688138	清溢光电	9,800.00	210,700.00	0.04
104	300331	苏大维格	13,100.00	210,648.00	0.04
105	601827	三峰环境	24,800.00	210,552.00	0.04
106	688789	宏华数科	1,952.00	210,425.60	0.04
107	301006	迈拓股份	18,000.00	210,420.00	0.04
108	688381	帝奥微	10,800.00	210,384.00	0.04
109	600641	万业企业	17,900.00	210,325.00	0.04
110	000983	山西焦煤	20,400.00	210,324.00	0.04
111	688237	超卓航科	10,488.00	210,284.40	0.04
112	605158	华达新材	32,700.00	210,261.00	0.04
113	603260	合盛硅业	4,500.00	210,195.00	0.04
114	300283	温州宏丰	34,800.00	210,192.00	0.04
115	002868	绿康生化	15,800.00	210,140.00	0.04
116	688636	智明达	9,200.00	209,760.00	0.04
117	001336	楚环科技	9,600.00	209,760.00	0.04
118	688648	中邮科技	9,600.00	209,664.00	0.04
119	601838	成都银行	13,800.00	209,622.00	0.04
120	300187	永清环保	50,000.00	209,500.00	0.04
121	000408	藏格矿业	8,700.00	209,409.00	0.04
122	002134	天津普林	22,400.00	208,992.00	0.04
123	300347	泰格医药	4,300.00	208,980.00	0.04
124	605133	嵘泰股份	11,400.00	208,962.00	0.04
125	301003	江苏博云	9,700.00	208,647.00	0.04
126	000065	北方国际	20,100.00	208,437.00	0.04
127	300211	亿通科技	39,400.00	208,426.00	0.04
128	300371	汇中股份	24,900.00	208,413.00	0.04
129	688586	江航装备	22,393.00	208,254.90	0.04
130	300810	中科海讯	13,600.00	208,216.00	0.04
131	688620	安凯微	25,579.00	208,213.06	0.04
132	300354	东华测试	6,700.00	208,169.00	0.04
133	688479	友车科技	13,100.00	208,159.00	0.04
134	603237	五芳斋	8,440.00	208,130.40	0.04
135	688548	广钢气体	22,790.00	208,072.70	0.04
136	002404	嘉欣丝绸	39,300.00	207,897.00	0.04
137	300902	国安达	10,460.00	207,840.20	0.04
138	688001	华兴源创	9,200.00	207,736.00	0.04

139	002060	广东建工	60,700.00	207,594.00	0.04
140	300303	聚飞光电	42,700.00	207,522.00	0.04
141	688045	必易微	6,900.00	207,483.00	0.04
142	001309	德明利	2,400.00	207,360.00	0.04
143	688018	乐鑫科技	2,100.00	207,228.00	0.04
144	688203	海正生材	24,375.00	207,187.50	0.04
145	600436	片仔癀	1,000.00	207,170.00	0.04
146	002897	意华股份	5,500.00	207,130.00	0.04
147	000869	张裕 A	9,700.00	207,095.00	0.04
148	603330	天洋新材	43,200.00	206,928.00	0.04
149	300549	优德精密	15,300.00	206,856.00	0.04
150	688189	南新制药	36,741.00	206,851.83	0.04
151	300523	辰安科技	13,700.00	206,733.00	0.04
152	300129	泰胜风能	30,300.00	206,646.00	0.04
153	603176	汇通集团	55,400.00	206,642.00	0.04
154	300512	中亚股份	34,900.00	206,608.00	0.04
155	688261	东微半导	4,021.00	206,598.98	0.04
156	688598	金博股份	7,300.00	206,590.00	0.04
157	300896	爱美客	1,200.00	206,520.00	0.04
158	605128	上海沿浦	7,400.00	206,386.00	0.04
159	688147	微导纳米	8,287.00	206,346.30	0.04
160	300456	赛微电子	13,000.00	206,310.00	0.04
161	600562	国睿科技	15,100.00	206,266.00	0.04
162	300652	雷迪克	10,400.00	206,232.00	0.04
163	601882	海天精工	9,000.00	206,190.00	0.04
164	688580	伟思医疗	7,700.00	206,052.00	0.04
165	300077	国民技术	23,600.00	206,028.00	0.04
166	301318	维海德	7,500.00	206,025.00	0.04
167	603118	共进股份	30,700.00	205,690.00	0.04
168	301192	泰祥股份	11,900.00	205,394.00	0.04
169	300052	中青宝	17,100.00	205,371.00	0.04
170	002541	鸿路钢构	12,100.00	205,337.00	0.04
171	003016	欣贺股份	32,800.00	205,328.00	0.04
172	688078	龙软科技	8,914.00	205,289.42	0.04
173	688658	悦康药业	11,500.00	205,160.00	0.04
174	605151	西上海	14,000.00	205,100.00	0.04
175	603511	爱慕股份	16,700.00	205,076.00	0.04
176	688310	迈得医疗	15,604.00	205,036.56	0.04
177	600152	维科技术	42,700.00	204,960.00	0.04
178	000708	中信特钢	15,100.00	204,907.00	0.04
179	688207	格灵深瞳	17,843.00	204,659.21	0.04
180	300645	正元智慧	16,200.00	204,606.00	0.04
181	688401	路维光电	7,800.00	204,360.00	0.04
182	300708	聚灿光电	22,700.00	204,300.00	0.04

183	688236	春立医疗	14,400.00	204,192.00	0.04
184	603681	永冠新材	16,000.00	204,000.00	0.04
185	688262	国芯科技	11,200.00	203,952.00	0.04
186	600276	恒瑞医药	5,300.00	203,838.00	0.04
187	688312	燕麦科技	8,400.00	203,700.00	0.04
188	300222	科大智能	38,000.00	203,680.00	0.04
189	300760	迈瑞医疗	700.00	203,637.00	0.04
190	688382	益方生物	28,152.00	203,538.96	0.04
191	688371	菲沃泰	20,263.00	203,440.52	0.04
192	600184	光电股份	23,900.00	203,389.00	0.04
193	300669	沪宁股份	15,300.00	203,337.00	0.04
194	688280	精进电动	49,954.00	203,312.78	0.04
195	603369	今世缘	4,400.00	203,280.00	0.04
196	600410	华胜天成	52,500.00	203,175.00	0.04
197	300597	吉大通信	28,100.00	203,163.00	0.04
198	002863	今飞凯达	49,900.00	203,093.00	0.04
199	688515	裕太微	3,500.00	203,000.00	0.04
200	300667	必创科技	15,000.00	202,950.00	0.04
201	603106	恒银科技	47,600.00	202,776.00	0.04
202	688162	巨一科技	10,404.00	202,669.92	0.04
203	002674	兴业科技	19,800.00	202,356.00	0.04
204	688432	有研硅	20,873.00	202,259.37	0.04
205	600782	新钢股份	60,900.00	202,188.00	0.04
206	600309	万华化学	2,500.00	202,150.00	0.04
207	001266	宏英智能	9,300.00	201,996.00	0.04
208	002304	洋河股份	2,500.00	201,850.00	0.04
209	300856	科思股份	6,300.00	201,663.00	0.04
210	002851	麦格米特	7,800.00	201,552.00	0.04
211	300449	汉邦高科	48,100.00	201,539.00	0.04
212	688687	凯因科技	7,900.00	201,529.00	0.04
213	688369	致远互联	12,800.00	201,344.00	0.04
214	603198	迎驾贡酒	3,500.00	201,250.00	0.04
215	301160	翔楼新材	5,400.00	201,150.00	0.04
216	688323	瑞华泰	19,968.00	201,077.76	0.04
217	601975	招商南油	56,000.00	201,040.00	0.04
218	300011	鼎汉技术	40,200.00	200,598.00	0.04
219	301261	恒工精密	5,400.00	200,178.00	0.04
220	002862	实丰文化	14,800.00	200,096.00	0.04
221	688627	精智达	4,300.00	199,606.00	0.04
222	002095	生意宝	16,300.00	199,512.00	0.04
223	300499	高澜股份	18,400.00	199,456.00	0.04
224	002484	江海股份	15,000.00	198,750.00	0.04
225	603031	安孚科技	8,800.00	198,704.00	0.04
226	603926	铁流股份	23,900.00	198,370.00	0.04

227	688239	航宇科技	5,700.00	198,360.00	0.04
228	688110	东芯股份	10,400.00	198,328.00	0.04
229	688357	建龙微纳	8,500.00	198,050.00	0.04
230	001206	依依股份	15,200.00	197,904.00	0.04
231	301039	中集车辆	23,000.00	197,800.00	0.04
232	002722	物产金轮	17,500.00	197,750.00	0.04
233	688345	博力威	11,700.00	197,613.00	0.04
234	688185	康希诺	4,800.00	197,232.00	0.04
235	600395	盘江股份	32,800.00	197,128.00	0.04
236	301055	张小泉	16,600.00	196,876.00	0.04
237	002068	黑猫股份	27,700.00	196,670.00	0.04
238	300978	东箭科技	21,300.00	196,599.00	0.04
239	001283	豪鹏科技	4,600.00	196,420.00	0.04
240	603359	东珠生态	54,100.00	196,383.00	0.04
241	603169	兰石重装	43,500.00	195,750.00	0.04
242	002479	富春环保	55,600.00	195,712.00	0.04
243	300328	宜安科技	45,600.00	195,168.00	0.04
244	603306	华懋科技	10,800.00	195,156.00	0.04
245	605566	福莱蒾特	12,800.00	194,944.00	0.04
246	300022	吉峰科技	54,900.00	194,895.00	0.04
247	300035	中科电气	22,900.00	194,879.00	0.04
248	688119	中钢洛耐	59,191.00	194,738.39	0.04
249	000735	罗牛山	44,900.00	194,417.00	0.04
250	605068	明新旭腾	14,700.00	193,746.00	0.04
251	603585	苏利股份	19,700.00	192,272.00	0.04
252	688246	嘉和美康	9,400.00	191,384.00	0.04
253	001278	一彬科技	12,100.00	191,301.00	0.04
254	603193	润本股份	10,400.00	191,256.00	0.04
255	601116	三江购物	25,100.00	191,011.00	0.04
256	001301	尚太科技	4,400.00	190,168.00	0.04
257	000607	华媒控股	61,400.00	189,726.00	0.04
258	688680	海优新材	6,600.00	189,684.00	0.04
259	301129	瑞纳智能	7,500.00	189,300.00	0.04
260	301262	海看股份	8,300.00	187,165.00	0.04
261	688556	高测股份	15,500.00	184,295.00	0.03
262	688212	澳华内镜	4,400.00	176,044.00	0.03
263	002524	光正眼科	54,700.00	172,305.00	0.03
264	002903	宇环数控	9,500.00	165,965.00	0.03
265	688678	福立旺	13,712.00	148,500.96	0.03
266	600519	贵州茅台	100.00	146,739.00	0.03
267	688199	久日新材	9,853.00	132,030.20	0.02
268	688271	联影医疗	778.00	85,346.60	0.02
269	300962	中金辐照	6,200.00	84,568.00	0.02
270	002233	塔牌集团	11,400.00	83,334.00	0.02

271	600982	宁波能源	23,200.00	82,824.00	0.02
272	600018	上港集团	14,300.00	82,654.00	0.02
273	601333	广深铁路	25,500.00	82,620.00	0.02
274	002546	新联电子	25,400.00	82,550.00	0.02
275	601728	中国电信	13,400.00	82,410.00	0.02
276	603618	杭电股份	18,800.00	82,344.00	0.02
277	601989	中国重工	16,700.00	82,331.00	0.02
278	000880	潍柴重机	10,300.00	82,297.00	0.02
279	600219	南山铝业	21,600.00	82,296.00	0.02
280	600050	中国联通	17,500.00	82,250.00	0.02
281	600028	中国石化	13,000.00	82,160.00	0.02
282	002510	天汽模	21,100.00	82,079.00	0.02
283	002204	大连重工	19,200.00	81,984.00	0.02
284	002226	江南化工	18,300.00	81,984.00	0.02
285	002300	太阳电缆	15,500.00	81,840.00	0.02
286	600577	精达股份	20,600.00	81,782.00	0.02
287	600320	振华重工	23,900.00	81,738.00	0.02
288	601187	厦门银行	15,300.00	81,549.00	0.02
289	601618	中国中冶	26,300.00	81,530.00	0.02
290	601609	金田股份	14,400.00	81,504.00	0.02
291	601390	中国中铁	12,500.00	81,500.00	0.02
292	300224	正海磁材	8,800.00	81,488.00	0.02
293	601186	中国铁建	9,500.00	81,415.00	0.02
294	600210	紫江企业	15,300.00	81,396.00	0.02
295	600908	无锡银行	15,300.00	81,396.00	0.02
296	001213	中铁特货	20,600.00	81,370.00	0.02
297	601121	宝地矿业	14,300.00	81,367.00	0.02
298	600558	大西洋	22,600.00	81,360.00	0.02
299	002249	大洋电机	17,200.00	81,356.00	0.02
300	002334	英威腾	13,600.00	81,328.00	0.02
301	600888	新疆众和	11,500.00	81,305.00	0.02
302	600029	南方航空	13,800.00	81,282.00	0.02
303	601339	百隆东方	15,600.00	81,276.00	0.02
304	600502	安徽建工	18,900.00	81,270.00	0.02
305	601068	中铝国际	19,300.00	81,253.00	0.02
306	601668	中国建筑	15,300.00	81,243.00	0.02
307	002615	哈尔斯	13,100.00	81,220.00	0.02
308	002083	孚日股份	19,200.00	81,216.00	0.02
309	000548	湖南投资	20,200.00	81,204.00	0.02
310	002839	张家港行	20,200.00	81,204.00	0.02
311	002057	中钢天源	11,600.00	81,200.00	0.02
312	000429	粤高速 A	7,800.00	81,198.00	0.02
313	600125	铁龙物流	13,600.00	81,192.00	0.02
314	600051	宁波联合	15,400.00	81,158.00	0.02

315	600794	保税科技	25,600.00	81,152.00	0.02
316	002121	科陆电子	21,400.00	81,106.00	0.02
317	000582	北部湾港	10,900.00	81,096.00	0.02
318	601288	农业银行	18,600.00	81,096.00	0.02
319	000088	盐田港	17,900.00	81,087.00	0.02
320	601956	东贝集团	17,700.00	81,066.00	0.02
321	000498	山东路桥	15,500.00	81,065.00	0.02
322	600874	创业环保	14,500.00	81,055.00	0.02
323	603587	地素时尚	6,600.00	81,048.00	0.02
324	000928	中钢国际	14,600.00	81,030.00	0.02
325	002061	浙江交科	22,200.00	81,030.00	0.02
326	600468	百利电气	18,800.00	81,028.00	0.02
327	600919	江苏银行	10,900.00	80,987.00	0.02
328	000725	京东方 A	19,800.00	80,982.00	0.02
329	000790	华神科技	23,400.00	80,964.00	0.02
330	002392	北京利尔	25,700.00	80,955.00	0.02
331	002540	亚太科技	15,300.00	80,937.00	0.02
332	000417	合肥百货	19,500.00	80,925.00	0.02
333	600346	恒力石化	5,800.00	80,910.00	0.02
334	600926	杭州银行	6,200.00	80,910.00	0.02
335	601006	大秦铁路	11,300.00	80,908.00	0.02
336	000900	现代投资	22,100.00	80,886.00	0.02
337	000055	方大集团	23,100.00	80,850.00	0.02
338	601107	四川成渝	15,400.00	80,850.00	0.02
339	600787	中储股份	16,800.00	80,808.00	0.02
340	002516	旷达科技	22,200.00	80,808.00	0.02
341	600916	中国黄金	8,400.00	80,808.00	0.02
342	601368	绿城水务	20,000.00	80,800.00	0.02
343	600351	亚宝药业	14,400.00	80,784.00	0.02
344	301175	中科环保	18,400.00	80,776.00	0.02
345	000968	蓝焰控股	12,700.00	80,772.00	0.02
346	002346	柘中股份	10,600.00	80,772.00	0.02
347	600917	重庆燃气	14,900.00	80,758.00	0.02
348	600168	武汉控股	20,600.00	80,752.00	0.02
349	000685	中山公用	11,200.00	80,752.00	0.02
350	601200	上海环境	9,500.00	80,750.00	0.02
351	002051	中工国际	11,600.00	80,736.00	0.02
352	601678	滨化股份	23,200.00	80,736.00	0.02
353	600064	南京高科	13,300.00	80,731.00	0.02
354	600016	民生银行	21,300.00	80,727.00	0.02
355	603012	创力集团	18,100.00	80,726.00	0.02
356	002139	拓邦股份	7,600.00	80,712.00	0.02
357	601528	瑞丰银行	17,100.00	80,712.00	0.02
358	300569	天能重工	19,400.00	80,704.00	0.02

359	000153	丰原药业	15,000.00	80,700.00	0.02
360	601328	交通银行	10,800.00	80,676.00	0.02
361	002627	三峡旅游	16,700.00	80,661.00	0.02
362	601727	上海电气	21,800.00	80,660.00	0.02
363	600000	浦发银行	9,800.00	80,654.00	0.02
364	600619	海立股份	15,600.00	80,652.00	0.02
365	000800	一汽解放	10,300.00	80,649.00	0.02
366	600015	华夏银行	12,600.00	80,640.00	0.02
367	002029	七匹狼	16,000.00	80,640.00	0.02
368	601065	江盐集团	9,300.00	80,631.00	0.02
369	600115	中国东航	20,100.00	80,601.00	0.02
370	002745	木林森	10,000.00	80,600.00	0.02
371	601169	北京银行	13,800.00	80,592.00	0.02
372	600279	重庆港	22,200.00	80,586.00	0.02
373	600929	雪天盐业	15,200.00	80,560.00	0.02
374	002758	浙农股份	10,300.00	80,546.00	0.02
375	600681	百川能源	23,900.00	80,543.00	0.02
376	002948	青岛银行	23,900.00	80,543.00	0.02
377	600356	恒丰纸业	13,600.00	80,512.00	0.02
378	002400	省广集团	16,600.00	80,510.00	0.02
379	601008	连云港	23,400.00	80,496.00	0.02
380	603578	三星新材	6,652.00	80,489.20	0.02
381	600987	航民股份	11,400.00	80,484.00	0.02
382	002108	沧州明珠	26,300.00	80,478.00	0.02
383	600540	新赛股份	23,600.00	80,476.00	0.02
384	600742	一汽富维	10,800.00	80,460.00	0.02
385	000059	华锦股份	19,200.00	80,448.00	0.02
386	600834	申通地铁	12,300.00	80,442.00	0.02
387	601111	中国国航	10,900.00	80,442.00	0.02
388	600104	上汽集团	5,800.00	80,388.00	0.02
389	601988	中国银行	17,400.00	80,388.00	0.02
390	002135	东南网架	20,300.00	80,388.00	0.02
391	002469	三维化学	14,100.00	80,370.00	0.02
392	603833	欧派家居	1,500.00	80,340.00	0.02
393	002038	双鹭药业	10,900.00	80,333.00	0.02
394	002081	金螳螂	26,500.00	80,295.00	0.02
395	600513	联环药业	9,900.00	80,289.00	0.02
396	000488	晨鸣纸业	23,200.00	80,272.00	0.02
397	002772	众兴菌业	13,400.00	80,266.00	0.02
398	600186	莲花控股	23,400.00	80,262.00	0.02
399	600741	华域汽车	4,900.00	80,262.00	0.02
400	000905	厦门港务	14,200.00	80,230.00	0.02
401	601789	宁波建工	21,800.00	80,224.00	0.02
402	002283	天润工业	18,700.00	80,223.00	0.02

403	002687	乔治白	19,100.00	80,220.00	0.02
404	600628	新世界	14,800.00	80,216.00	0.02
405	601818	光大银行	25,300.00	80,201.00	0.02
406	000001	平安银行	7,900.00	80,185.00	0.02
407	000419	通程控股	19,600.00	80,164.00	0.01
408	600120	浙江东方	24,000.00	80,160.00	0.01
409	000597	东北制药	20,700.00	80,109.00	0.01
410	600308	华泰股份	25,500.00	80,070.00	0.01
411	603759	海天股份	13,500.00	80,055.00	0.01
412	000501	武商集团	12,000.00	80,040.00	0.01
413	300194	福安药业	21,400.00	80,036.00	0.01
414	600180	瑞茂通	21,000.00	80,010.00	0.01
415	000090	天健集团	19,900.00	79,998.00	0.01
416	002293	罗莱生活	9,900.00	79,992.00	0.01
417	002375	亚厦股份	24,600.00	79,950.00	0.01
418	605500	森林包装	13,000.00	79,950.00	0.01
419	601939	建设银行	10,800.00	79,920.00	0.01
420	300352	北信源	20,800.00	79,872.00	0.01
421	000822	山东海化	13,700.00	79,871.00	0.01
422	002419	天虹股份	19,100.00	79,838.00	0.01
423	000917	电广传媒	15,800.00	79,790.00	0.01
424	002783	凯龙股份	10,900.00	79,788.00	0.01
425	000931	中关村	22,600.00	79,778.00	0.01
426	000795	英洛华	14,400.00	79,776.00	0.01
427	600819	耀皮玻璃	18,900.00	79,758.00	0.01
428	002215	诺普信	10,700.00	79,715.00	0.01
429	002224	三力士	20,700.00	79,695.00	0.01
430	002062	宏润建设	22,900.00	79,692.00	0.01
431	600039	四川路桥	10,100.00	79,689.00	0.01
432	002478	常宝股份	16,000.00	79,680.00	0.01
433	002221	东华能源	9,700.00	79,637.00	0.01
434	000012	南玻 A	15,800.00	79,632.00	0.01
435	601236	红塔证券	12,400.00	79,608.00	0.01
436	300026	红日药业	26,100.00	79,605.00	0.01
437	600328	中盐化工	11,600.00	79,576.00	0.01
438	000652	泰达股份	26,700.00	79,566.00	0.01
439	600176	中国巨石	7,200.00	79,560.00	0.01
440	002344	海宁皮城	26,000.00	79,560.00	0.01
441	301216	万凯新材	7,100.00	79,449.00	0.01
442	601377	兴业证券	15,700.00	79,442.00	0.01
443	002004	华邦健康	20,900.00	79,420.00	0.01
444	002349	精华制药	12,100.00	79,376.00	0.01
445	000969	安泰科技	10,000.00	79,300.00	0.01
446	002345	潮宏基	16,800.00	79,296.00	0.01

447	600292	远达环保	16,900.00	79,261.00	0.01
448	000776	广发证券	6,500.00	79,105.00	0.01
449	600061	国投资本	14,000.00	79,100.00	0.01
450	600327	大东方	24,700.00	79,040.00	0.01
451	603126	中材节能	14,500.00	79,025.00	0.01
452	600728	佳都科技	21,300.00	79,023.00	0.01
453	000973	佛塑科技	21,400.00	78,966.00	0.01
454	601238	广汽集团	10,200.00	78,948.00	0.01
455	603339	四方科技	8,700.00	78,909.00	0.01
456	600586	金晶科技	13,600.00	78,880.00	0.01
457	600918	中泰证券	13,900.00	78,813.00	0.01
458	600507	方大特钢	21,000.00	78,540.00	0.01
459	600138	中青旅	8,100.00	78,246.00	0.01
460	000716	黑芝麻	21,600.00	78,192.00	0.01
461	601226	华电重工	15,900.00	77,910.00	0.01
462	600999	招商证券	5,600.00	77,896.00	0.01
463	600335	国机汽车	13,500.00	77,895.00	0.01
464	600812	华北制药	18,900.00	77,868.00	0.01
465	002390	信邦制药	23,500.00	77,785.00	0.01
466	600958	东方证券	10,200.00	77,520.00	0.01
467	002020	京新药业	7,400.00	77,478.00	0.01
468	600305	恒顺醋业	10,700.00	77,361.00	0.01
469	600488	津药药业	22,500.00	77,175.00	0.01
470	300039	上海凯宝	14,400.00	77,040.00	0.01
471	603043	广州酒家	4,800.00	76,656.00	0.01
472	600596	新安股份	10,000.00	76,000.00	0.01
473	000061	农产品	15,600.00	75,816.00	0.01
474	600825	新华传媒	20,000.00	75,800.00	0.01
475	688692	达梦数据	175.00	36,669.50	0.01
476	301526	国际复材	8,147.00	27,129.51	0.01
477	603285	键邦股份	1,287.00	24,002.55	0.00
478	603350	安乃达	1,051.00	21,608.56	0.00
479	301565	中仑新材	711.00	16,580.52	0.00
480	601096	宏盛华源	3,918.00	16,024.62	0.00
481	688709	成都华微	843.00	15,823.11	0.00
482	301536	星宸科技	481.00	15,517.06	0.00
483	301580	爱迪特	202.00	14,948.00	0.00
484	301538	骏鼎达	150.00	13,683.00	0.00
485	301392	汇成真空	219.00	12,235.53	0.00
486	688691	灿芯股份	247.00	12,196.86	0.00
487	603341	龙旗科技	293.00	10,978.71	0.00
488	301566	达利凯普	576.00	9,648.00	0.00
489	001389	广合科技	222.00	9,330.66	0.00
490	301413	安培龙	213.00	8,807.55	0.00

491	301539	宏鑫科技	361.00	8,772.30	0.00
492	600220	ST 阳光	95,500.00	8,595.00	0.00
493	301587	中瑞股份	306.00	8,292.60	0.00
494	301459	丰茂股份	208.00	8,259.68	0.00
495	000836	ST 富通	75,400.00	6,786.00	0.00
496	688530	欧莱新材	344.00	6,522.24	0.00
497	301578	辰奕智能	154.00	6,093.78	0.00
498	688695	中创股份	186.00	5,866.44	0.00
499	300388	节能国祯	1,000.00	5,540.00	0.00
500	301502	华阳智能	138.00	5,217.78	0.00
501	002435	ST 长康	57,000.00	5,130.00	0.00
502	603381	永臻股份	178.00	4,733.02	0.00
503	603325	博隆技术	66.00	4,489.32	0.00
504	603344	星德胜	182.00	4,124.12	0.00
505	001359	平安电工	184.00	3,792.24	0.00
506	603004	鼎龙科技	195.00	3,305.25	0.00
507	603312	西典新能	130.00	3,294.20	0.00
508	603082	北自科技	107.00	3,154.36	0.00
509	001379	腾达科技	213.00	2,871.24	0.00
510	603375	盛景微	72.00	2,799.36	0.00
511	603231	索宝蛋白	161.00	2,743.44	0.00
512	001387	雪祺电气	173.00	2,634.79	0.00
513	001358	兴欣新材	122.00	2,503.44	0.00
514	603373	安邦护卫	88.00	2,419.12	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	600582	天地科技	16,887,497.00	3.40
2	601128	常熟银行	15,344,396.55	3.09
3	000883	湖北能源	13,720,273.00	2.76
4	600299	安迪苏	13,513,772.21	2.72
5	601158	重庆水务	12,890,069.00	2.59
6	600598	北大荒	12,444,227.00	2.50
7	000825	太钢不锈	12,312,272.00	2.48
8	600377	宁沪高速	11,573,386.00	2.33
9	000089	深圳机场	11,542,360.00	2.32

10	000967	盈峰环境	11,425,244.00	2.30
11	002128	电投能源	11,248,680.17	2.26
12	600566	济川药业	11,177,888.00	2.25
13	600583	海油工程	11,007,406.00	2.21
14	002408	齐翔腾达	10,960,547.18	2.21
15	002595	豪迈科技	10,793,339.00	2.17
16	688819	天能股份	10,721,947.55	2.16
17	600901	江苏金租	10,579,853.40	2.13
18	601665	齐鲁银行	10,512,897.00	2.11
19	600516	方大炭素	10,504,583.00	2.11
20	000513	丽珠集团	10,503,984.15	2.11
21	000932	华菱钢铁	10,242,682.00	2.06
22	603156	养元饮品	10,085,051.00	2.03
23	600062	华润双鹤	9,952,840.00	2.00
24	600998	九州通	9,950,247.60	2.00

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	002966	苏州银行	15,701,961.32	3.16
2	601128	常熟银行	15,527,168.00	3.12
3	600582	天地科技	14,819,311.00	2.98
4	601158	重庆水务	14,682,111.00	2.95
5	000883	湖北能源	13,764,115.00	2.77
6	600642	申能股份	12,914,498.00	2.60
7	600299	安迪苏	12,621,578.50	2.54
8	601778	晶科科技	12,362,006.00	2.49
9	600598	北大荒	12,170,216.00	2.45
10	600901	江苏金租	11,934,190.60	2.40
11	600377	宁沪高速	11,882,606.00	2.39
12	002028	思源电气	11,657,778.00	2.35
13	000089	深圳机场	11,589,949.79	2.33
14	688349	三一重能	11,284,720.15	2.27
15	600352	浙江龙盛	11,083,258.00	2.23
16	688169	石头科技	10,998,127.68	2.21
17	601187	厦门银行	10,771,884.00	2.17
18	002595	豪迈科技	10,630,681.00	2.14
19	002408	齐翔腾达	10,551,657.09	2.12
20	601139	深圳燃气	10,459,793.11	2.10

21	002128	电投能源	10,410,899.40	2.09
22	600516	方大炭素	10,238,729.66	2.06
23	000825	太钢不锈	10,125,373.00	2.04
24	600566	济川药业	9,947,055.00	2.00

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,098,410,162.60
卖出股票收入（成交）总额	2,038,038,252.76

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

本基金根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货，并主要投资

于流动性好、交易活跃且与基金投资目标匹配的期货合约。本基金的股指期货套保策略主要用于实现两项投资目标：第一、在合适的交易价格上建立股指期货多头套保仓位，力争获得相对于目标指数的超额收益；第二、在基金组合管理中，将股指期货合约作为高效管理权益仓位的投资工具，力争降低权益仓位调整的交易成本。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，其中，齐鲁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没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,902,846.17
2	应收清算款	2,672,122.11
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	230,168.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,805,136.46

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

本基金本报告期末积极投资前五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

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 500 指数增强 A	18,395	19,671.95	161,122,073.07	44.53%	200,743,485.22	55.47%
申万菱信中证 500 指数增强 C	9,275	3,812.22	1,379,424.61	3.90%	33,978,883.63	96.10%
合计	27,482	14,453.97	162,501,497.68	40.91%	234,722,368.85	59.09%

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 500 指数增强 A	91,511.74	0.03%
	申万菱信中证 500 指数增强 C	0.00	0.00%
	合计	91,511.74	0.02%

注：注：分级基金管理人的从业人员持有基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金总额）。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	申万菱信中证 500 指数增强 A	-
	申万菱信中证 500 指数增强 C	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	申万菱信中证 500 指数增强 A	0~10
	申万菱信中证 500 指数增强 C	0
	合计	0~10

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	申万菱信中证 500 指数增强 A	申万菱信中证 500 指数增强 C
基金合同生效日（2016 年 4 月 21	546,955,898.05	-

日) 基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	319,948,322.36	37,570,235.84
本报告期基金总申购份额	66,505,746.71	6,838,680.93
减: 本报告期基金总赎回份额	24,588,510.78	9,050,608.53
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	361,865,558.29	35,358,308.24

注: 申购含红利再投、转换入份额, 赎回含转换出份额。

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内, 经基金管理人股东会决议, 同意免去安田敬之先生、福井雄介先生董事职务, 由川上丰先生、四宫大辅先生继任公司董事会董事, 并授权川上丰先生履行股东代表相应职责。

2、本报告期内, 基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.4 基金投资策略的改变

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

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘用毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)负责基金审计事务, 未发生改聘会计师事务所事宜。

10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.7.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内, 基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比 例	佣金	占当期佣金总量的比 例	
申万宏源证券	2	1,175,842,144.16	28.44%	1,107,016.84	28.44%	-
国泰君安证券	2	643,872,766.90	15.57%	608,137.90	15.62%	-
长江证券	1	265,239,377.97	6.41%	250,882.16	6.45%	-
天风证券	2	235,311,682.32	5.69%	222,580.38	5.72%	-
财通证券	2	214,423,703.57	5.19%	201,491.02	5.18%	-
兴业证券	1	164,967,227.77	3.99%	154,391.66	3.97%	-
海通证券	2	150,260,522.71	3.63%	140,631.01	3.61%	-
方正证券	2	137,141,354.87	3.32%	128,678.30	3.31%	-
国金证券	2	132,622,568.30	3.21%	125,400.90	3.22%	-
东兴证券	1	107,792,657.36	2.61%	100,885.27	2.59%	-
国投证券	1	106,498,254.67	2.58%	99,673.52	2.56%	-
长城证券	3	90,305,067.34	2.18%	85,417.06	2.19%	-
民生证券	1	75,966,895.61	1.84%	71,097.45	1.83%	-
信达证券	1	75,201,934.63	1.82%	70,381.32	1.81%	-
西南证券	2	63,168,425.65	1.53%	59,749.19	1.53%	-
广发证券	1	61,346,081.82	1.48%	57,414.12	1.47%	-
中邮证券	1	58,690,930.76	1.42%	54,931.27	1.41%	新增
华泰证券	1	54,330,945.85	1.31%	50,848.08	1.31%	-
光大证券	1	52,967,546.15	1.28%	49,572.32	1.27%	-
国元证券	1	45,327,688.33	1.10%	42,874.92	1.10%	-
东北证券	2	41,672,867.40	1.01%	39,419.36	1.01%	-
中信证券	3	34,634,783.00	0.84%	32,415.03	0.83%	-
东方证券	1	22,809,992.80	0.55%	21,348.04	0.55%	-
太平洋证券	1	21,090,939.06	0.51%	19,948.72	0.51%	-
东吴证券	1	20,056,397.84	0.49%	18,770.97	0.48%	-
华金证券	2	18,291,044.26	0.44%	17,301.92	0.44%	-
华创证券	1	16,087,451.96	0.39%	15,217.06	0.39%	-
银河证券	1	15,938,600.84	0.39%	14,917.18	0.38%	-
招商证券	2	13,539,408.00	0.33%	12,671.77	0.33%	-
中泰证券	3	13,336,613.25	0.32%	12,582.86	0.32%	-
国信证券	1	5,375,478.76	0.13%	5,030.85	0.13%	-
西部证券	1	850,974.35	0.02%	796.34	0.02%	-

中银国际	1	129,840.00	0.00%	121.52	0.00%	-
中信建投证券	2	5,894.36	0.00%	5.57	0.00%	-
华融证券	2	-	-	-	-	-
华信证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	2	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
五矿证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
北京高华	2	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-

注：(1)交易单元选择的标准:1、经营行为规范,在近一年内无重大违规行为;2、公司财务状况良好;3、有良好的内控制度,在业内有良好的声誉;4、有较强的研究能力,能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告,并能根据基金投资的特殊要求,提供专门的研究报告;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。(2)本基金本报告期内退租申港证券交易席位1个。

10.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江	-	-	-	-	-	-	-	-

证券									
天风 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
财通 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
海通 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
方正 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国金 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国投 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
长城 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
民生 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
信达 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
西南 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
广发 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中邮 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
光大 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国元 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东北 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东方 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
太平 洋证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-

东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华信证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
第一	-	-	-	-	-	-	-	-	-

创业								
东方 财富 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
北京 高华	-	-	-	-	-	-	-	-
申港 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银 证券	-	-	-	-	-	-	-	-

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

基金合同；

招募说明书及其更新；

产品资料概要及其更新；

发售公告；

成立公告；

定期报告；

其他临时公告。

11.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

11.3 查阅方式

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

www.swsmu.com。

申万菱信基金管理有限公司
二〇二四年八月三十日