申万菱信深证成份指数型证券投资基金

2026 年第 3 季度报告

2026 年 09 月 30 日

基金管理人:申万菱信基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

报告送出日期:2026 年 10 月 27 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年07月01日起至2026年09月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	申万菱信深证成份指数
场内简称	申万深成 LOF
基金主代码	163109
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 01 月 01 日
报告期末基金份额总额	192,853,433.00 份
投资目标	本基金采取指数化投资方式，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%，实现对深证成指的有效跟踪。
投资策略	本基金采取完全复制法进行投资，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。但在因特殊情况导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近标的指数的表现。 特殊情况主要是指在标的指数成份股发生变动、增发、配股、分红等公司行为导致申万菱信深证成份指数型证券投资基金招募说明书成份股的构成及权重发生变化时，由于交易成本、交易制度、个别成份股停牌或者流动性不足等原因导致基金无法及时完成投资组合的同步调整，基金管理人需要采用其他合理的投资方法构建尽可能贴近目标指数的基金组合。
业绩比较基准	95%×深证成指收益率+5%×银行同业存款利率

风险收益特征	本基金为股票型指数基金，其风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金。	
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	
下属分级基金的基金简称	申万菱信深证成份指数 A	申万菱信深证成份指数 C
下属分级基金的交易代码	163109	015177
报告期末下属分级基金的份额总额	155,890,386.73 份	36,963,046.27 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2026 年 07 月 01 日-2026 年 09 月 30 日）	
	申万菱信深证成份指数 A	申万菱信深证成份指数 C
1.本期已实现收益	3,377,000.42	578,794.77
2.本期利润	-26,019,433.22	-4,150,798.86
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1653	-0.1405
4.期末基金资产净值	112,784,274.65	26,387,121.81
5.期末基金份额净值	0.7235	0.7139

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

申万菱信深证成份指数 A 净值表现

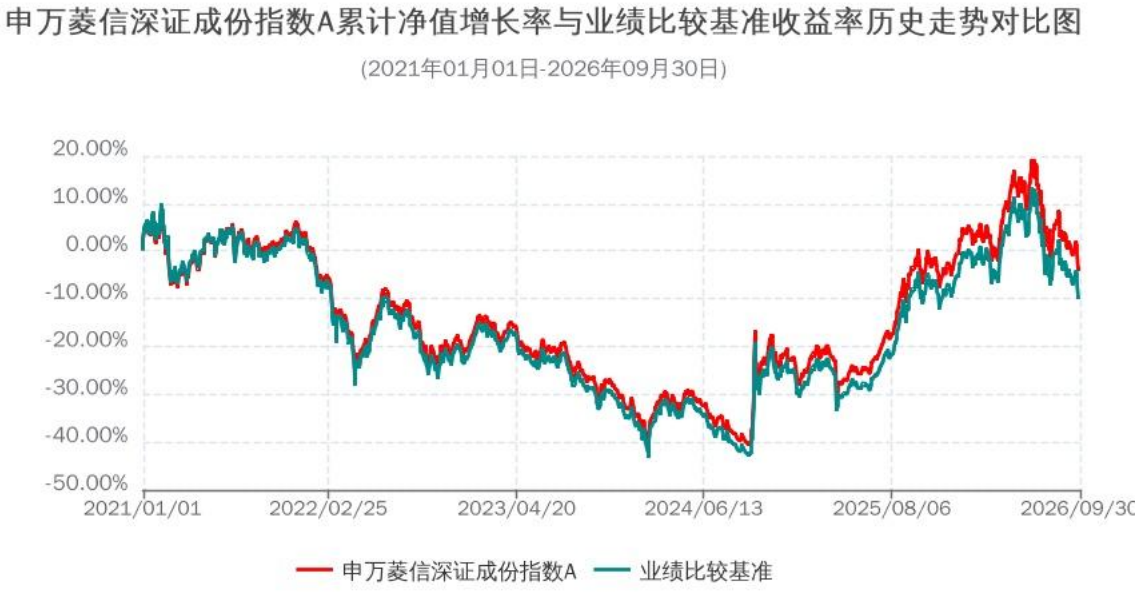
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-18.52%	1.84%	-19.50%	1.88%	0.98%	-0.04%
过去六个月	-2.40%	1.75%	-4.06%	1.79%	1.66%	-0.04%
过去一年	-2.70%	1.52%	-4.33%	1.55%	1.63%	-0.03%
过去三年	31.12%	1.48%	26.55%	1.51%	4.57%	-0.03%
过去五年	-3.87%	1.35%	-8.83%	1.38%	4.96%	-0.03%
自基金转型日起至今	-3.69%	1.35%	-9.70%	1.37%	6.01%	-0.02%

申万菱信深证成份指数 C 净值表现

阶段	净值增长率①	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	-18.58%	1.84%	-19.50%	1.88%	0.92%	-0.04%
过去六个月	-2.54%	1.75%	-4.06%	1.79%	1.52%	-0.04%
过去一年	-2.99%	1.52%	-4.33%	1.55%	1.34%	-0.03%
过去三年	29.97%	1.48%	26.55%	1.51%	3.42%	-0.03%
自基金转型日起至今	9.23%	1.37%	5.29%	1.39%	3.94%	-0.02%

注：业绩比较基准计算过程中日收益率统一四舍五入保留 8 位小数。

3.2.2 自基金转型以来基金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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
周润	本基金基金经理、投资经理	2025-11-10	-	11 年	周润先生，硕士研究生。2015 年起从事金融相关工作，2015 年 8 月加入申万菱信基金管理有限公司，曾任数量研究岗，现任申万菱信中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金、申万菱信中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、申万菱信深证成份指数型证券投资基金、申万菱信中小企业 100 指数证券投资基金（LOF）、申万菱信中证环保产业指数型证券投资基金（LOF）基金经理，兼任投资经理。

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

2.证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
周润	公募基金	5	483,347,583.83	2025-10-29
	私募资产管理计划	1	9,533,709.51	2020-05-27
	其他组合	-	-	-
	合计	6	492,881,293.34	-

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 公平交易专项说明

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。

在投资和研究方面，本公司投资和研究部门不断完善研究方法和投资决策流程，提高投资决策的科学性和客观性，确保各投资组合享有公平的投资决策机会，建立公平交易的制度环境。

在交易执行方面，本公司的投资管理职能和交易执行职能相隔离，通过实行集中交易制度和公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。

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。风险管理部通过对不同组合之间同向交易的价差率的假设检验、价格占优的次数百分比统计、价差交易模拟贡献与组合收益率差异的比较等方法对本报告期以及连续四个季度期间内、不同时间窗口下公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行了分析；对于场外交易，还特别对比了组合之间发生的同向交易的市场公允价格和交易对手，判断交易是否公平且是否涉及利益输送。

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。

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

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内，全球大类资产中，原油、大豆涨幅居前，十年美债收益率再创阶段新高。年初以来A股宽基指数风格差大幅收敛，红利资产反弹，科技成长类资产下跌。行业上，煤炭、银行涨幅居前，电子、通信跌幅较大。

操作上，本基金运作主要着眼于控制每日跟踪误差、净值表现和业绩基准的偏差幅度。从实际运作结果观察，基金跟踪误差的主要来源是基金日常申赎。

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

4.5 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-18.52%,同期业绩基准表现为-19.5%;

本基金 C 类产品报告期内净值表现为-18.58%,同期业绩基准表现为-19.5%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	130,349,381.71	91.63
	其中：股票	130,349,381.71	91.63
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	11,408,825.80	8.02
8	其他资产	496,382.74	0.35
9	合计	142,254,590.25	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）

A	农、林、牧、渔业	1,946,649.60	1.40
B	采矿业	1,713,530.52	1.23
C	制造业	103,578,867.97	74.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,333,815.26	0.96
E	建筑业	179,191.00	0.13
F	批发和零售业	1,144,294.62	0.82
G	交通运输、仓储和邮政业	1,340,770.58	0.96
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,739,312.73	4.84
J	金融业	7,864,848.51	5.65
K	房地产业	682,360.22	0.49
L	租赁和商务服务业	1,245,432.48	0.89
M	科学研究和技术服务业	1,029,146.15	0.74
N	水利、环境和公共设施管理业	172,289.05	0.12
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	87,135.00	0.06
Q	卫生和社会工作	446,723.90	0.32
R	文化、体育和娱乐业	538,918.01	0.39
S	综合	-	-
	合计	130,043,285.60	93.44

5.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	306,096.11	0.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-

	合计	306,096.11	0.22

5.2.3 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。

5.3 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

5.3.1 报告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前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	22,311	6,494,955.21	4.67
2	300308	中际旭创	7,393	5,976,796.92	4.29
3	300502	新易盛	10,664	4,148,296.00	2.98
4	000333	美的集团	41,302	3,308,290.20	2.38
5	002371	北方华创	3,470	2,137,415.90	1.54
6	002475	立讯精密	40,267	1,990,397.81	1.43
7	300059	东方财富	109,533	1,948,592.07	1.40
8	002594	比亚迪	21,676	1,805,827.56	1.30
9	002384	东山精密	10,764	1,801,893.60	1.29
10	000725	京东方 A	278,171	1,591,138.12	1.14

5.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	301666	大普微	262	86,659.12	0.06
2	301569	联亚药业	4,228	29,596.00	0.02
3	001399	惠科股份	830	16,185.00	0.01
4	001246	力勤资源	257	15,705.27	0.01
5	301716	鸿富诚	28	15,135.12	0.01

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.10 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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受到监管部门立案调查；在报告编制日前一年内没有受到监管部门公开谴责或/及处罚。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	17,930.99
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	478,451.75
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	496,382.74

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 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。

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	301666	大普微	86,659.12	0.06	新股限售
2	301569	联亚药业	29,596.00	0.02	认购新发证券
3	001399	惠科股份	16,185.00	0.01	新股限售
4	001246	力勤资源	15,705.27	0.01	新股限售
5	301716	鸿富诚	15,135.12	0.01	新股限售

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

	申万菱信深证成份指数 A	申万菱信深证成份指数 C
报告期期初基金份额总额	160,041,334.92	19,959,094.47
报告期期间基金总申购份额	2,210,242.93	56,778,922.60
减：报告期期间基金总赎回份额	6,361,191.12	39,774,970.80
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	155,890,386.73	36,963,046.27

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，本基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况。

§8 备查文件目录

8.1 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。

8.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

8.3 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

二〇二六年十月二十七日