

申万菱信收益宝货币市场基金

2023 年第 2 季度报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：申万菱信基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年七月二十一日

§ 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规定，于 2023 年 7 月 19 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 2023 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	申万菱信收益宝货币
基金主代码	310338
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006 年 7 月 7 日
报告期末基金份额总额	6,904,624,550.29 份
投资目标	在力保基金资产安全和高流动性的基础上，追求稳定的高于业绩基准的回报。
投资策略	本基金基于市场价值分析，平衡投资组合的流动性和收益性，以价值研究为导向，利用基本分析和数量化分析方法，通过对短期金融工具的积极投资，在控制风险和保证流动性的基础上，追求稳定的当期收益。
业绩比较基准	银行活期存款利率（税后）

风险收益特征	低风险、高流动性和持续稳定收益。		
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	申万菱信收益宝货币 A	申万菱信收益宝货币 B	申万菱信收益宝货币 E
下属分级基金的交易代码	310338	310339	010325
报告期末下属分级基金的份额总额	880,943,754.72 份	5,872,213,260.49 份	151,467,535.08 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(2023年4月1日-2023年6月30日)		
	申万菱信收益宝货币 A	申万菱信收益宝货币 B	申万菱信收益宝货币 E
1. 本期已实现收益	5,134,889.61	35,500,516.39	875,805.28
2. 本期利润	5,134,889.61	35,500,516.39	875,805.28
3. 期末基金资产净值	880,943,754.72	5,872,213,260.49	151,467,535.08

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，固定净值型货币市场基金公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

(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 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1、申万菱信收益宝货币 A:

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.5075%	0.0016%	0.0873%	0.0000%	0.4202%	0.0016%
过去六个月	0.9786%	0.0013%	0.1736%	0.0000%	0.8050%	0.0013%
过去一年	1.7614%	0.0019%	0.3500%	0.0000%	1.4114%	0.0019%
过去三年	5.4321%	0.0016%	1.0537%	0.0000%	4.3784%	0.0016%
过去五年	9.9896%	0.0016%	1.7633%	0.0000%	8.2263%	0.0016%
自基金合同生效起至今	53.9125%	0.0047%	13.9318%	0.0025%	39.9807%	0.0022%

2、申万菱信收益宝货币 B:

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.5677%	0.0016%	0.0873%	0.0000%	0.4804%	0.0016%
过去六个月	1.0991%	0.0013%	0.1736%	0.0000%	0.9255%	0.0013%
过去一年	2.0062%	0.0019%	0.3500%	0.0000%	1.6562%	0.0019%
过去三年	6.1951%	0.0016%	1.0537%	0.0000%	5.1414%	0.0016%
过去五年	11.3208%	0.0016%	1.7633%	0.0000%	9.5575%	0.0016%
自份额级别新增至今	35.7697%	0.0039%	3.7166%	0.0000%	32.0531%	0.0039%

3、申万菱信收益宝货币 E:

阶段	净值收益	净值收益	业绩比较	业绩比较	①-③	②-④
----	------	------	------	------	-----	-----

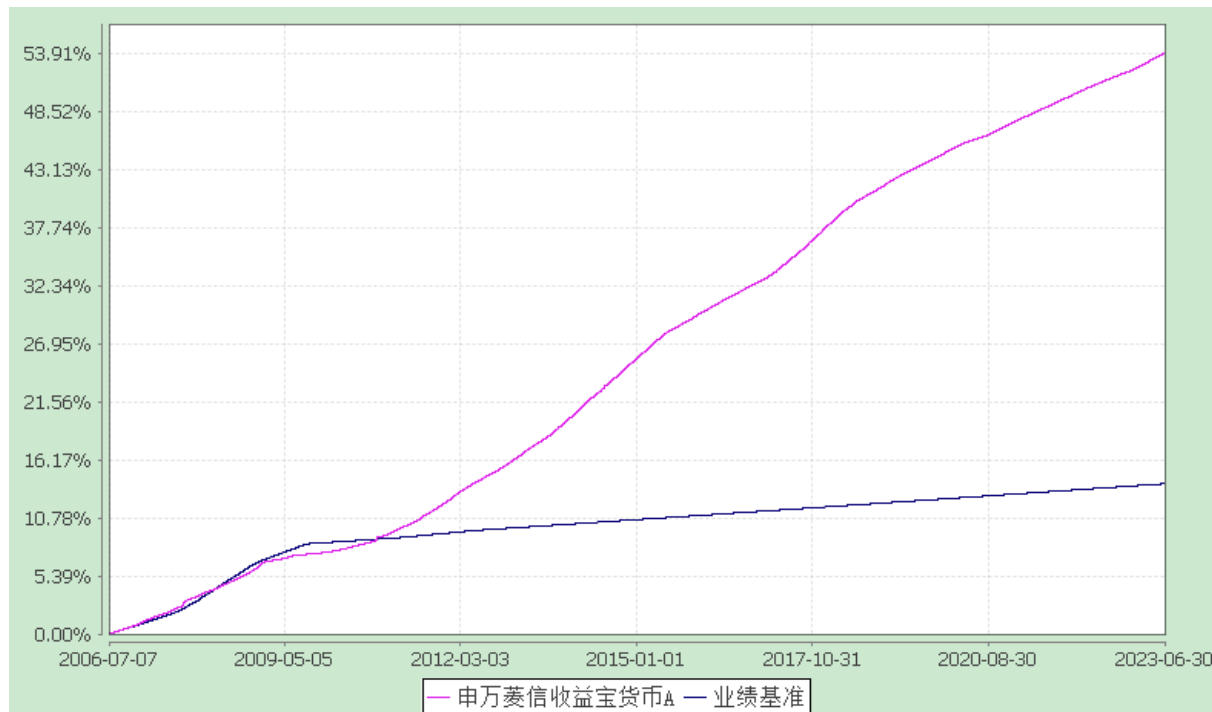
	率①	率标准差 ②	基准收益 率③	基准收益 率标准差 ④		
过去三个月	0.5576%	0.0016%	0.0873%	0.0000%	0.4703%	0.0016%
过去六个月	1.0789%	0.0013%	0.1736%	0.0000%	0.9053%	0.0013%
过去一年	1.9651%	0.0019%	0.3500%	0.0000%	1.6151%	0.0019%
自份额级别 新增至今	5.6378%	0.0016%	0.9708%	0.0000%	4.6670%	0.0016%

注：本基金收益分配方式为“按日分配收益，按日结转份额”。

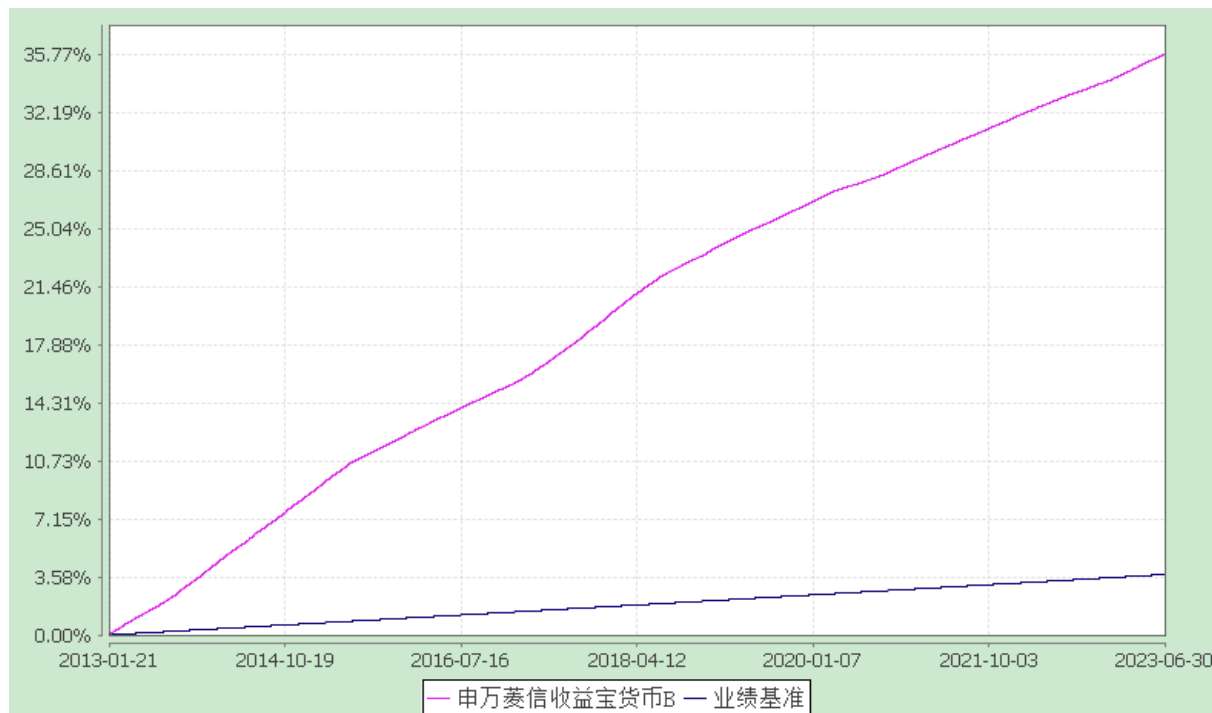
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

申万菱信收益宝货币市场基金
份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2006 年 7 月 7 日至 2023 年 6 月 30 日)

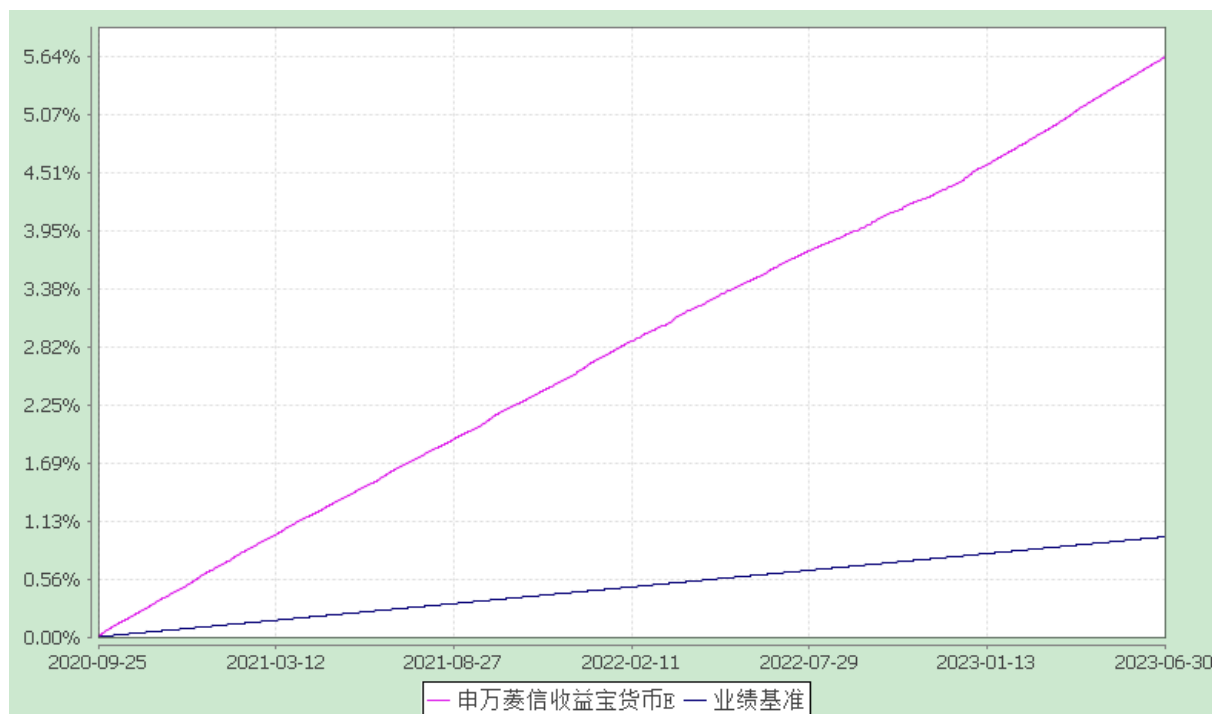
1、申万菱信收益宝货币 A



2、申万菱信收益宝货币 B



3、申万菱信收益宝货币 E



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		
叶瑜珍	本基金原基金经理	2013-07-30	2023-06-15	18 年	叶瑜珍女士，硕士研究生，2005 年 01 月加入申万菱信基金管理有限公司，曾任风险分析师、信用分析师、基金经理助理，申万菱信添益宝债券型证券投资基金、申万菱信安鑫精选混合型证券投资基金、申万菱信可转换债券债券型证券投资基金、申万菱信安泰惠利纯债债券型证券投资基金（2018 年 8 月至 2020 年 2 月）、申万菱信安泰广利 63 个月定期开放债券型证券投资基金、申万菱信收益宝货币市场基金基金经理，现任申万菱信安鑫优选混合型证券投资基金、申万菱信安泰瑞利中短债债券型证券投资基金、申万菱信安泰鼎利一年定期开放债券型发起式证券投资基金、申万菱信安泰鑫利纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、申万菱信安泰惠利纯债债券型证券投资基金、申万菱信安泰富利三年定期

					开放债券型证券投资基金、申万菱信稳鑫 60 天滚动持有中短债债券型证券投资基金基金经理。
翟振	本基金基金经理	2023-01-05	-	7 年	翟振先生，硕士研究生。2016 年起从事金融相关工作，曾任职于中国外汇交易中心等，2019 年 04 月加入申万菱信基金，曾任固定收益研究员、基金经理助理，现任申万菱信收益宝货币市场基金、申万菱信绿色纯债债券型发起式证券投资基金、申万菱信安泰永利利率债一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。
沈夏	本基金基金经理	2023-06-15	-	7 年	沈夏女士，硕士研究生。2015 年起从事金融相关工作，曾任职于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、新沃基金管理有限公司，2022 年 11 月加入申万菱信基金，曾任产品经理，现任申万菱信收益宝货币市场基金、申万菱信稳鑫 90 天滚动持有中短债债券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。

3. 本报告期内，公司聘任沈夏担任本基金基金经理，叶瑜珍不再担任本基金基金经理，

具体详见本基金管理人的相关公告。

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 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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年二季度，从基本面来看，经济总量可能回升，但是边际斜率可能持续放缓。随着 PMI 阶段性下行至荣枯线下方，经济修复弱预期或已基本成为共识，短期以消费驱动的经济修复动能或已基本反应，外贸数据走弱，CPI、PPI 低于预期，地产数据等的预期偏弱，而存款利息下调、MLF 下降 10 个基点对债券形成直接利好。6 月处于政策窗口博弈期，市场行情一致性偏强，债市情绪总体仍处于看多状态。

货币市场方面，二季度总体资金面稳中偏松。央行对资金面呵护态度明确，流动性继续维持相对较为充裕的格局。降息如预期落地，资金面大幅波动的概率或不大，短端套息策略仍相对明朗，银行间质押式回购成交量周度平均值大幅高于历史同期，市场杠杆依旧较高。季末资金面前紧后松，流动性分层问题依然存在，DR001 处于历史低位，但是非银融资成本居高不下。季末最后一天资金面边际转松，超出市场预期，各机构平稳跨月。

同业存单市场供需两旺，资金的持续宽松，叠加前期机构普遍配置较低，不断推动各期限收益率下行接近 40 BP。3M 的收益率从最高点 2.43%附近下行至 2.03%附近，1Y

期国股同业存单收益率从最高点 2.63%下行至 2.26%。一级市场上加权发行期限略有提升，因近期收益率一直处于历史相对低位的水平，发行人对长端 1Y 期的供给更为迫切，二级交投整体非常活跃。考虑到供求结构可能不会发生太大的改变，预计长期限存单维持小幅波动的可能性较大。

报告期内，本基金秉承稳健投资原则，谨慎操作，以组合流动性为第一要求，以同业存单和短期逆回购为主要配置资产，同时配置部分 AAA 高等级信用债以期增厚收益，并把握资产下行时机积极参与长端 CD 的交易盘。整体组合维持较低的杠杆率，同时投资了较多的高流动性资产，密切跟踪持有人结构的变化，争取为持有人提供长期稳定的业绩。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金 A 类产品报告期内净值表现为 0.5075%，同期业绩基准表现为 0.0873%。

本基金 B 类产品报告期内净值表现为 0.5677%，同期业绩基准表现为 0.0873%。

本基金 E 类产品报告期内净值表现为 0.5576%，同期业绩基准表现为 0.0873%。

§ 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	固定收益投资	4,556,095,432.43	63.51
	其中：债券	4,556,095,432.43	63.51
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,517,076,714.16	21.15
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	1,029,743,343.84	14.35
4	其他资产	70,672,488.43	0.99

5	合计	7,173,587,978.86	100.00
---	----	------------------	--------

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	2.89	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	267,015,870.82	3.87
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值比例取报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	87
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	92
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	77

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金本报告期内无投资组合平均剩余期限违规超过120天的情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30天以内	37.84	3.87
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天（含）—60天	13.36	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天（含）—90天	15.10	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天（含）—120天	8.62	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天（含）—397天（含）	27.95	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	102.87	3.87

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本基金本报告期内无投资组合平均剩余存续期违规超过240天的情况。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
----	------	---------	--------------

1	国家债券	51,177,143.34	0.74
2	央行票据	-	-
3	金融债券	323,922,388.97	4.69
	其中：政策性金融债	323,922,388.97	4.69
4	企业债券	50,034,520.55	0.72
5	企业短期融资券	1,137,600,647.89	16.48
6	中期票据	44,412,746.94	0.64
7	同业存单	2,948,947,984.74	42.71
8	其他	-	-
9	合计	4,556,095,432.43	65.99
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量 (张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	112382032	23 东莞农村商业银行 CD117	2,000,000.00	199,641,577.04	2.89
2	112320030	23 广发银行 CD030	1,000,000.00	99,776,105.03	1.45
3	112209135	22 浦发银行 CD135	1,000,000.00	99,721,726.35	1.44
4	112211108	22 平安银行 CD108	1,000,000.00	99,591,332.94	1.44
5	112303099	23 农业银行 CD099	1,000,000.00	98,446,435.85	1.43
6	220211	22 国开 11	900,000.00	91,429,270.29	1.32
7	220306	22 进出 06	900,000.00	91,373,493.09	1.32
8	112398520	23 杭州银行 CD121	700,000.00	69,822,485.72	1.01
9	072310129	23 东财证券	600,000.00	60,047,265.57	0.87

		CP008			
10	112397021	23 天津银行 CD144	600,000.00	59,929,203.06	0.87

5.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	-次
报告期内偏离度的最高值	0.0815%
报告期内偏离度的最低值	0.0190%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0503%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内无负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本基金本报告期内无正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

5.8 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价，即计价对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率每日计提利息，并考虑其买入时的溢价与折价在其剩余期限内平均摊销。

本基金通过每日分配收益使基金份额净值保持在 1.00 元。

5.9.2 本基金投资的前十大证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查的情形。

本基金投资的前十大证券的发行主体除 23 杭州银行 CD121(112398520. IB)、23 农业银行 CD099(112303099. IB)外，在报告编制日前一年内，没有收到公开谴责和处罚的情形。

公开信息显示，2022 年 8 月 5 日，杭州银行股份有限公司存在涉嫌违法违规行为，中国银行保险监督管理委员会及其派出机构根据相关法律法规对公司公开处罚，罚款人民币约为 80 万元。

公开信息显示,2023 年 4 月 10 日,中国农业银行股份有限公司存在涉嫌违法违规行为,中国银行保险监督管理委员会及其派出机构根据相关法律法规对公司公开处罚,罚款人民币约为 20 万元。2022 年 11 月 1 日,中国农业银行股份有限公司存在涉嫌违法违规行为,中国银行保险监督管理委员会根据相关法律法规对公司公开处罚,罚款人民币约为 150 万元。

本基金管理人认为上述事件不会对该证券的投资价值构成影响,因此也不影响基金管理人对该证券的投资决策。

5.9.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,616.67
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	70,670,871.76
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	70,672,488.43

5.9.4 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

项目	申万菱信收益宝货 币A	申万菱信收益宝货 币B	申万菱信收益宝货 币E
本报告期期初基金份额总额	958,197,243.88	4,251,222,613.21	172,773,044.68

报告期期间基金总申购份额	4,005,792,543.85	6,513,914,410.64	25,054,635.27
报告期期间基金总赎回份额	4,083,046,033.01	4,892,923,763.36	46,360,144.87
报告期期间基金拆分变动份额	-	-	-
报告期期末基金份额总额	880,943,754.72	5,872,213,260.49	151,467,535.08

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交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	红利再投	2023-04-01	20,328.94	-	-
2	红利再投	2023-04-02	12,842.34	-	-
3	红利再投	2023-04-03	12,842.79	-	-
4	红利再投	2023-04-04	12,761.77	-	-
5	红利再投	2023-04-05	15,038.25	-	-
6	红利再投	2023-04-06	12,012.26	-	-
7	红利再投	2023-04-07	11,662.64	-	-
8	红利再投	2023-04-08	11,251.43	-	-
9	红利再投	2023-04-09	11,168.91	-	-
10	红利再投	2023-04-10	11,095.17	-	-
11	红利再投	2023-04-11	18,041.79	-	-
12	红利再投	2023-04-12	16,020.86	-	-
13	红利再投	2023-04-13	12,400.28	-	-
14	红利再投	2023-04-14	10,707.34	-	-

15	红利再投	2023-04-1 5	10,707.05	-	-
16	红利再投	2023-04-1 6	10,641.85	-	-
17	红利再投	2023-04-1 7	10,642.21	-	-
18	红利再投	2023-04-1 8	15,195.84	-	-
19	红利再投	2023-04-1 9	12,050.05	-	-
20	红利再投	2023-04-2 0	11,012.29	-	-
21	红利再投	2023-04-2 1	11,078.49	-	-
22	红利再投	2023-04-2 2	14,025.97	-	-
23	红利再投	2023-04-2 3	11,433.43	-	-
24	红利再投	2023-04-2 4	11,436.46	-	-
25	红利再投	2023-04-2 5	11,548.84	-	-
26	红利再投	2023-04-2 6	12,105.62	-	-
27	红利再投	2023-04-2 7	11,775.61	-	-
28	红利再投	2023-04-2 8	13,189.14	-	-
29	红利再投	2023-04-2 9	11,858.71	-	-
30	红利再投	2023-04-3 0	11,858.97	-	-
31	红利再投	2023-05-0 1	11,775.17	-	-
32	红利再投	2023-05-0 2	11,775.49	-	-
33	红利再投	2023-05-0 3	11,775.79	-	-
34	红利再投	2023-05-0 4	11,776.11	-	-
35	红利再投	2023-05-0	12,575.98	-	-

		5			
36	红利再投	2023-05-06	11,000.44	-	-
37	红利再投	2023-05-07	11,011.46	-	-
38	红利再投	2023-05-08	11,011.79	-	-
39	红利再投	2023-05-09	11,983.34	-	-
40	红利再投	2023-05-10	11,169.74	-	-
41	红利再投	2023-05-11	12,296.48	-	-
42	红利再投	2023-05-12	10,867.33	-	-
43	红利再投	2023-05-13	14,094.94	-	-
44	红利再投	2023-05-14	10,932.27	-	-
45	红利再投	2023-05-15	10,879.35	-	-
46	红利再投	2023-05-16	11,630.08	-	-
47	红利再投	2023-05-17	14,861.88	-	-
48	红利再投	2023-05-18	11,177.65	-	-
49	红利再投	2023-05-19	11,026.93	-	-
50	红利再投	2023-05-20	11,124.70	-	-
51	红利再投	2023-05-21	11,126.49	-	-
52	红利再投	2023-05-22	11,126.79	-	-
53	红利再投	2023-05-23	11,072.47	-	-
54	红利再投	2023-05-24	11,580.95	-	-
55	红利再投	2023-05-25	10,877.85	-	-

56	红利再投	2023-05-2 6	11,607.85	-	-
57	红利再投	2023-05-2 7	11,106.21	-	-
58	红利再投	2023-05-2 8	11,113.77	-	-
59	红利再投	2023-05-2 9	11,078.21	-	-
60	红利再投	2023-05-3 0	11,715.95	-	-
61	红利再投	2023-05-3 1	15,687.33	-	-
62	红利再投	2023-06-0 1	11,137.69	-	-
63	红利再投	2023-06-0 2	11,105.67	-	-
64	红利再投	2023-06-0 3	12,329.58	-	-
65	红利再投	2023-06-0 4	10,912.01	-	-
66	红利再投	2023-06-0 5	10,912.33	-	-
67	红利再投	2023-06-0 6	14,053.44	-	-
68	红利再投	2023-06-0 7	10,919.92	-	-
69	红利再投	2023-06-0 8	10,855.23	-	-
70	红利再投	2023-06-0 9	10,911.63	-	-
71	红利再投	2023-06-1 0	11,109.91	-	-
72	红利再投	2023-06-1 1	10,341.74	-	-
73	红利再投	2023-06-1 2	10,342.54	-	-
74	红利再投	2023-06-1 3	14,498.88	-	-
75	红利再投	2023-06-1 4	11,333.65	-	-
76	红利再投	2023-06-1	10,341.41	-	-

		5			
77	红利再投	2023-06-1 6	11,387.05	-	-
78	红利再投	2023-06-1 7	14,536.66	-	-
79	红利再投	2023-06-1 8	10,582.50	-	-
80	红利再投	2023-06-1 9	10,582.86	-	-
81	红利再投	2023-06-2 0	14,521.36	-	-
82	赎回	2023-06-2 0	10,014,506.1 9	-10,014,506.1 9	-
83	红利再投	2023-06-2 1	11,546.71	-	-
84	红利再投	2023-06-2 2	11,115.69	-	-
85	红利再投	2023-06-2 3	9,971.12	-	-
86	红利再投	2023-06-2 4	9,971.44	-	-
87	红利再投	2023-06-2 5	9,971.80	-	-
88	红利再投	2023-06-2 6	9,972.13	-	-
89	红利再投	2023-06-2 7	11,107.93	-	-
90	红利再投	2023-06-2 8	10,442.48	-	-
91	红利再投	2023-06-2 9	9,946.56	-	-
92	红利再投	2023-06-3 0	12,618.94	-	-
合计			11,095,463.1 4	-10,014,506.1 9	

§ 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；
发售公告；
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
二〇二三年七月二十一日