

申万菱信收益宝货币市场基金

2024 年第 2 季度报告

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

报告送出日期：二〇二四年七月十九日

§ 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 2024 年 7 月 17 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 2024 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	11,435,519,361.98 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	933,442,124.97 份	10,133,017,497.19 份	369,059,739.82 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(2024年4月1日-2024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	4,446,488.09	57,722,624.82	1,751,217.05
2. 本期利润	4,446,488.09	57,722,624.82	1,751,217.05
3. 期末基金资产净值	933,442,124.97	10,133,017,497.19	369,059,739.82

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	0.4307%	0.0013%	0.0871%	0.0000%	0.3436%	0.0013%
过去六个月	0.9465%	0.0015%	0.1742%	0.0000%	0.7723%	0.0015%
过去一年	1.9388%	0.0014%	0.3511%	0.0000%	1.5877%	0.0014%
过去三年	5.5586%	0.0017%	1.0560%	0.0000%	4.5026%	0.0017%
过去五年	9.5302%	0.0015%	1.7659%	0.0000%	7.7643%	0.0015%
自基金合同生效起至今	56.8962%	0.0046%	14.4567%	0.0024%	42.4395%	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	0.4907%	0.0013%	0.0871%	0.0000%	0.4036%	0.0013%
过去六个月	1.0669%	0.0015%	0.1742%	0.0000%	0.8927%	0.0015%
过去一年	2.1841%	0.0014%	0.3511%	0.0000%	1.8330%	0.0014%
过去三年	6.3226%	0.0017%	1.0560%	0.0000%	5.2666%	0.0017%
过去五年	10.8568%	0.0015%	1.7659%	0.0000%	9.0909%	0.0015%
自份额级别新增至今	38.7348%	0.0038%	4.0861%	0.0000%	34.6487%	0.0038%

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	0.4807%	0.0013%	0.0871%	0.0000%	0.3936%	0.0013%
过去六个月	1.0468%	0.0015%	0.1742%	0.0000%	0.8726%	0.0015%
过去一年	2.1431%	0.0014%	0.3511%	0.0000%	1.7920%	0.0014%
过去三年	6.1918%	0.0017%	1.0560%	0.0000%	5.1358%	0.0017%
自份额级别 新增至今	7.9017%	0.0016%	1.3265%	0.0000%	6.5752%	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”。

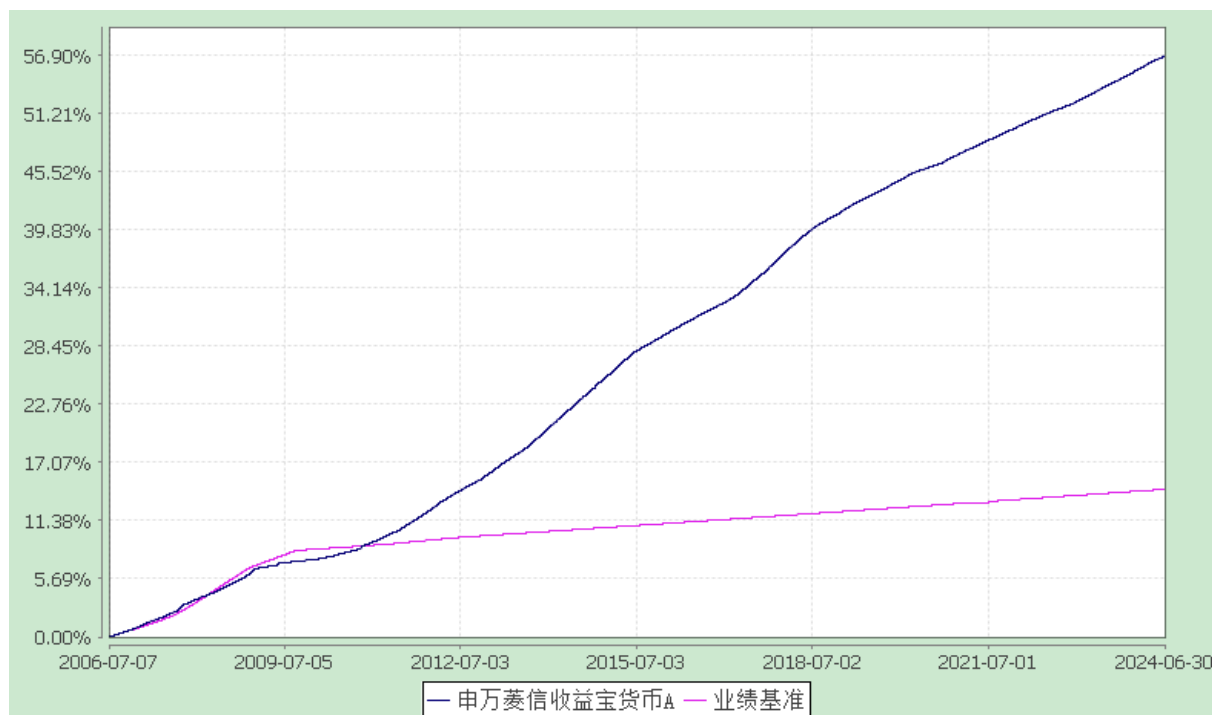
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

申万菱信收益宝货币市场基金

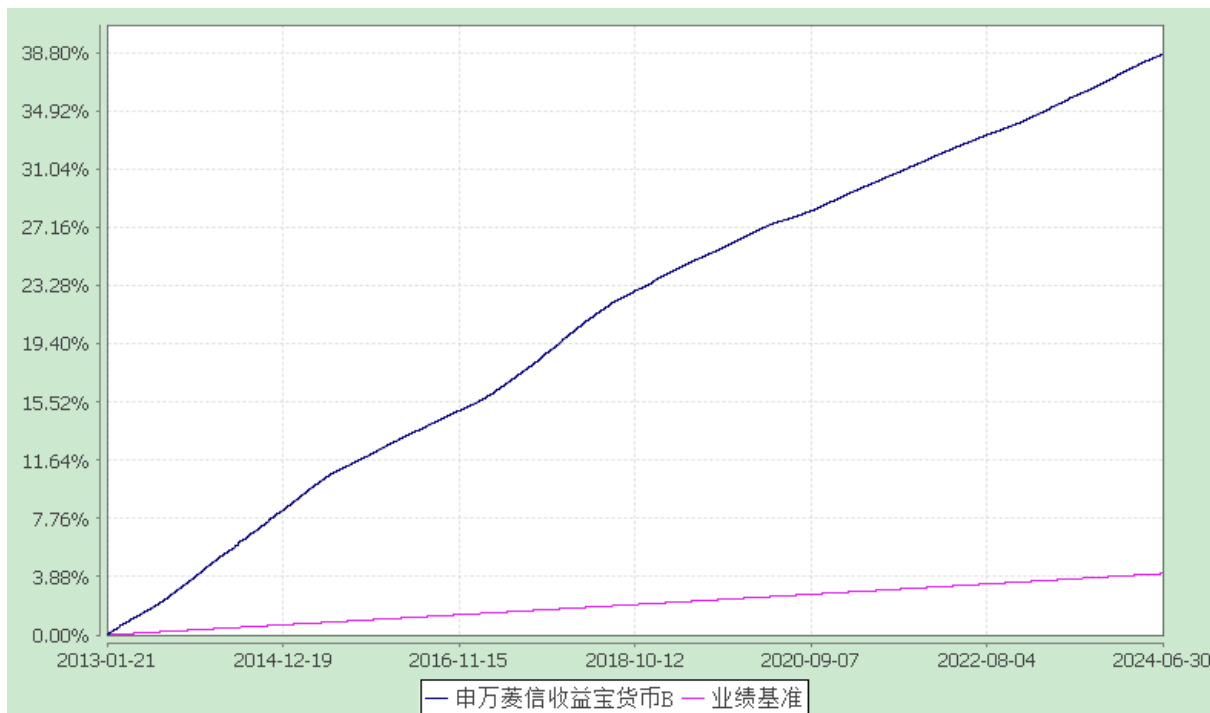
份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2006 年 7 月 7 日至 2024 年 6 月 30 日)

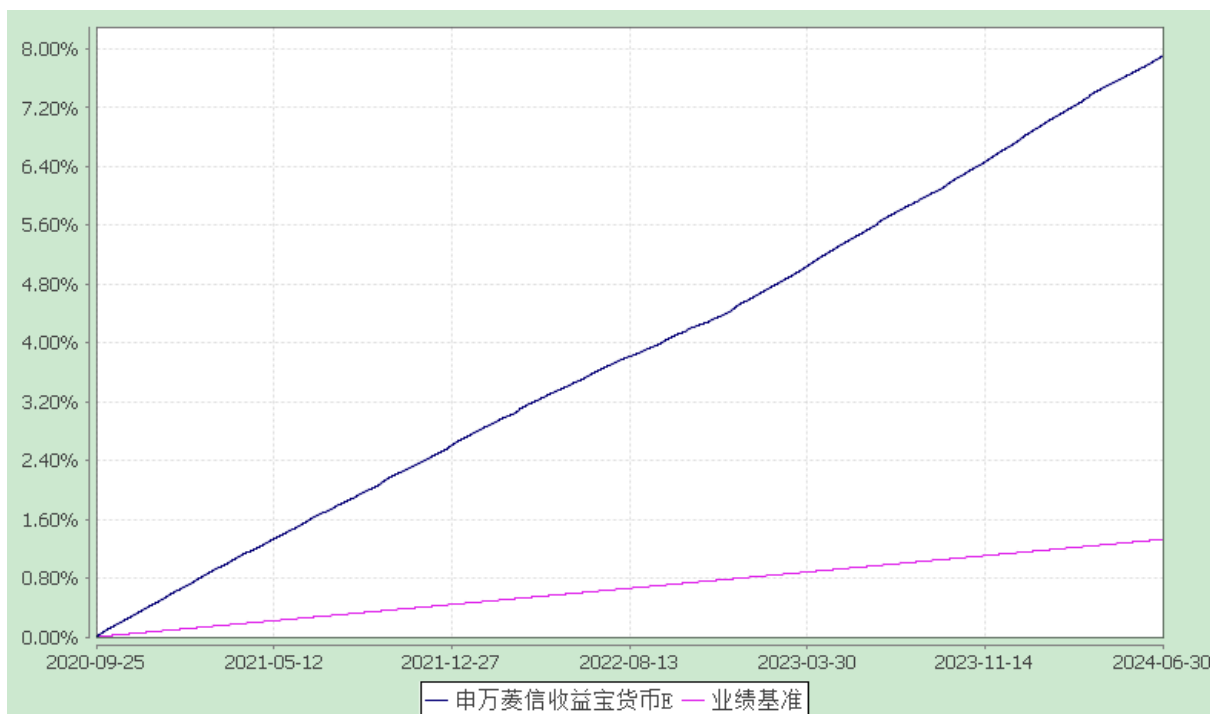
1、申万菱信收益宝货币 A



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		
翟振	本基金原基金经理	2023-01-05	2024-05-28	8 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，曾任申万菱信收益宝货币市场基金基金经理，现任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、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、申万菱信安泰裕利纯债债券型证券投资基金基金经理。
沈夏	本基金基金经理	2023-06-15	-	8 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、申万菱信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期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，翟振不再担任本基金基金经理，具体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、操纵市场和不正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

2024 年二季度，从基本面来看，经济延续弱复苏格局。出口延续温和复苏，PMI 处于荣枯线以下弱于市场预期。工业生产持续偏强，制造业景气度相对较高，商品、餐饮消费持续走弱。制造业投资韧性较强，地产销售、投资等数据依然偏弱，社融同比偏弱显示融资需求不足，CPI 小幅上涨。基本面和政策环境对债券市场仍然利多。

资金面方面，二季度总体流动性格局较之前有所改变，呈现了存款搬家，非银规模

增加，市场杠杆下降，资金波动明显减小的特征。禁止手工贴息等政策使得流动性从银行流向非银，有利于平衡银行间市场资金面。目前，大行逆回购占比不断下降，处于相对较低水平，净融出规模距离高点减少了 2 万亿左右，而非银逆回购占比不断提升，供需格局和供给结构都发生了变化，流动分层持续缓解，这也可能是推动后续债市走势的一个非常重要的力量。另外，季末央行对资金面呵护态度明确，投放较多跨季资金，资金分层现象明显扩大，非银融资成本显著抬升，但仍符合季节性水平。从 6 月前 4 个交易日的资金情况看，DR007 已重新回到政策利率下方位置，背后反映监管持续了半年有余的融资利率下限管控，可能会出现松动，对后续资金面依然保持谨慎乐观的态度。

二季度，优质资产相对较少的格局没有发生变化。4 月初，自律机构发布禁止手工贴息的通知之后，高息存款逐步消失，追求更高收益且要求稳健的机构和个人可能会选择将存款转存其他存款利率更高的中小行或投向非银。手工贴息的影响范围、规模和力度都较大。对于非银来说，基金和理财负债规模持续扩容，存款资产性价比下降，中短端品种受关注，因此中短端品种收益率下行明显。其中同业存单呈现震荡下行的行情，收益率持续走强，曲线牛平，且信用利差逐步缩小。二季度的行情主要由资金面和供需结构主导，4 月份收益率震荡向下，但是在 4 月底由于债券市场的调整导致同业存单收益率也出现向上回调，最高接近 15BP。5、6 两个月供需双方震荡博弈，由于资金面中性偏宽松且市场预期乐观，票息资产较少，同业存单性价比凸显，配置力量边际转强，1 年期国股同业存单从 5 月初的 2.07% 一路下行至 6 月末的 1.97%，突破年内低点。从比价效应来看，同业存单依然是短端性价比较优的产品，具有较强的防御属性。信用债方面，4、5 两个月调整幅度较大，AAA 高等级资质信用债扣税后收益率甚至低于同期限同业存单，6 月信用债的性价比慢慢回升，关注更好的机会。

报告期内，本基金秉承稳健投资原则，谨慎操作，以维持组合流动性为第一要求，以同业存单、存款和短期逆回购为主要配置资产，整体组合维持较低的杠杆率 and 中性久期，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 0.4307%，同期业绩基准表现为 0.0871%。

本基金 B 类产品报告期内净值表现为 0.4907%，同期业绩基准表现为 0.0871%。

本基金 E 类产品报告期内净值表现为 0.4807%，同期业绩基准表现为 0.0871%。

§ 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	7,442,998,440.02	60.21
	其中：债券	7,442,998,440.02	60.21
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	2,730,282,399.17	22.09
	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	2,053,310,960.89	16.61
4	其他资产	134,883,792.42	1.09
5	合计	12,361,475,592.50	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	2.14	
	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	923,114,495.89	8.07
	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	89
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	91
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	63

注：本货币市场基金合同约定：“本基金投资组合的平均剩余期限不超过120天。”

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	35.18	8.07
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天（含）—60天	11.31	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-

3	60天（含）—90天	22.25	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天（含）—120天	4.81	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天（含）—397天（含）	33.36	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		106.92	8.07

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	145,119,280.92	1.27
2	央行票据	-	-
3	金融债券	452,796,471.81	3.96
	其中：政策性金融债	452,796,471.81	3.96
4	企业债券	51,133,551.05	0.45
5	企业短期融资券	1,745,114,256.53	15.26
6	中期票据	336,077,873.12	2.94
7	同业存单	4,712,757,006.59	41.21
8	其他	-	-
9	合计	7,442,998,440.02	65.09

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	230306	23 进出 06	2,300,000.00	233,765,659.31	2.04
2	112317188	23 光大银行 CD188	1,500,000.00	149,593,954.33	1.31
3	112314143	23 江苏银行 CD143	1,000,000.00	99,726,793.81	0.87
4	112420058	24 广发银行 CD058	1,000,000.00	99,680,169.54	0.87
5	112304040	23 中国银行 CD040	1,000,000.00	99,642,738.78	0.87
6	112303204	23 农业银行 CD204	1,000,000.00	99,598,511.30	0.87
7	112421085	24 渤海银行 CD085	1,000,000.00	99,504,360.53	0.87
8	112304042	23 中国银行 CD042	1,000,000.00	99,488,502.17	0.87
9	112315511	23 民生银行 CD511	1,000,000.00	99,094,873.52	0.87
10	112403080	24 农业银行 CD080	1,000,000.00	98,891,543.05	0.86

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	0.0800%
报告期内偏离度的最低值	0.0418%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0672%

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 本基金投资的前十名证券的发行主体中，其中，中国农业银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、广发银行股份有限公司、江苏银行股份有限公司、中国光大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。

5.9.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	12,095.19
2	应收证券清算款	18,682.19
3	应收利息	-
4	应收申购款	134,853,015.04
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-

8	合计	134,883,792.42
---	----	----------------

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	879,775,353.34	8,481,892,902.83	316,028,908.40
报告期期间基金总申购份额	4,290,317,224.01	10,505,155,402.84	332,280,210.19
报告期期间基金总赎回份额	4,236,650,452.38	8,854,030,808.48	279,249,378.77
报告期期间基金拆分变动份 额	-	-	-
报告期期末基金份额总额	933,442,124.97	10,133,017,497.19	369,059,739.82

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	2024-04-01	10,766.41	-	-
2	红利再投	2024-04-02	11,980.13	-	-
3	红利再投	2024-04-03	10,408.38	-	-
4	红利再投	2024-04-04	9,832.68	-	-
5	红利再投	2024-04-0	9,675.28	-	-

		5			
6	红利再投	2024-04-06	9,675.70	-	-
7	红利再投	2024-04-07	9,676.14	-	-
8	红利再投	2024-04-08	10,536.12	-	-
9	红利再投	2024-04-09	9,524.46	-	-
10	红利再投	2024-04-10	13,249.68	-	-
11	红利再投	2024-04-11	9,320.87	-	-
12	红利再投	2024-04-12	9,515.61	-	-
13	红利再投	2024-04-13	13,932.89	-	-
14	红利再投	2024-04-14	9,701.50	-	-
15	红利再投	2024-04-15	9,701.68	-	-
16	红利再投	2024-04-16	9,662.98	-	-
17	红利再投	2024-04-17	9,648.17	-	-
18	红利再投	2024-04-18	13,087.87	-	-
19	红利再投	2024-04-19	9,564.50	-	-
20	红利再投	2024-04-20	10,827.44	-	-
21	红利再投	2024-04-21	9,369.80	-	-
22	红利再投	2024-04-22	9,370.00	-	-
23	红利再投	2024-04-23	9,307.38	-	-
24	红利再投	2024-04-24	10,174.47	-	-
25	红利再投	2024-04-25	9,130.72	-	-

26	红利再投	2024-04-26	9,403.72	-	-
27	红利再投	2024-04-27	9,184.13	-	-
28	红利再投	2024-04-28	9,151.44	-	-
29	红利再投	2024-04-29	9,151.68	-	-
30	红利再投	2024-04-30	9,362.78	-	-
31	红利再投	2024-05-01	13,155.67	-	-
32	红利再投	2024-05-02	9,266.15	-	-
33	红利再投	2024-05-03	9,266.38	-	-
34	红利再投	2024-05-04	9,239.38	-	-
35	红利再投	2024-05-05	9,239.60	-	-
36	红利再投	2024-05-06	9,248.01	-	-
37	红利再投	2024-05-07	10,934.37	-	-
38	红利再投	2024-05-08	9,649.60	-	-
39	红利再投	2024-05-09	9,831.10	-	-
40	红利再投	2024-05-10	8,600.30	-	-
41	红利再投	2024-05-11	10,829.88	-	-
42	红利再投	2024-05-12	8,792.84	-	-
43	红利再投	2024-05-13	8,806.21	-	-
44	红利再投	2024-05-14	11,268.26	-	-
45	红利再投	2024-05-15	8,982.44	-	-
46	红利再投	2024-05-16	11,289.45	-	-

		6			
47	红利再投	2024-05-17	11,277.33	-	-
48	红利再投	2024-05-18	8,565.18	-	-
49	红利再投	2024-05-19	8,587.69	-	-
50	红利再投	2024-05-20	8,587.98	-	-
51	红利再投	2024-05-21	10,234.76	-	-
52	红利再投	2024-05-22	9,502.02	-	-
53	红利再投	2024-05-23	10,241.50	-	-
54	红利再投	2024-05-24	10,769.14	-	-
55	红利再投	2024-05-25	9,588.28	-	-
56	红利再投	2024-05-26	8,616.65	-	-
57	红利再投	2024-05-27	8,628.09	-	-
58	红利再投	2024-05-28	11,127.64	-	-
59	红利再投	2024-05-29	8,682.37	-	-
60	红利再投	2024-05-30	8,692.46	-	-
61	红利再投	2024-05-31	10,656.70	-	-
62	红利再投	2024-06-01	13,170.56	-	-
63	红利再投	2024-06-02	8,685.91	-	-
64	红利再投	2024-06-03	8,686.22	-	-
65	红利再投	2024-06-04	17,515.53	-	-
66	红利再投	2024-06-05	8,518.81	-	-

67	红利再投	2024-06-06	8,467.71	-	-
68	红利再投	2024-06-07	8,467.84	-	-
69	红利再投	2024-06-08	10,830.40	-	-
70	红利再投	2024-06-09	8,372.73	-	-
71	红利再投	2024-06-10	8,357.88	-	-
72	红利再投	2024-06-11	8,358.23	-	-
73	红利再投	2024-06-12	13,798.23	-	-
74	红利再投	2024-06-13	10,034.06	-	-
75	红利再投	2024-06-14	15,629.78	-	-
76	红利再投	2024-06-15	9,826.19	-	-
77	红利再投	2024-06-16	7,794.90	-	-
78	红利再投	2024-06-17	7,786.31	-	-
79	红利再投	2024-06-18	16,587.55	-	-
80	红利再投	2024-06-19	14,200.43	-	-
81	红利再投	2024-06-20	8,028.88	-	-
82	红利再投	2024-06-21	14,886.91	-	-
83	红利再投	2024-06-22	12,153.56	-	-
84	红利再投	2024-06-23	7,563.19	-	-
85	红利再投	2024-06-24	7,556.41	-	-
86	红利再投	2024-06-25	14,869.10	-	-
87	红利再投	2024-06-26	17,787.54	-	-

		6			
88	红利再投	2024-06-27	15,815.68	-	-
89	红利再投	2024-06-28	8,914.60	-	-
90	红利再投	2024-06-29	20,797.80	-	-
91	红利再投	2024-06-30	9,163.81	-	-
合计			948,678.79	-	

§ 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

二〇二四年七月十九日