

申万宏源双季增享 6 个月持有期债券型集
合资产管理计划
2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：申万宏源证券资产管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 30 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董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 08 月 29 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 01 月 01 日起至 06 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	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
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	12
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	13
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	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	59
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	59

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	59
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	59
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	59
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	59
7.11 投资组合报告附注	60
§ 8 基金份额持有人信息	61
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61
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情况	61
§ 9 开放式基金份额变动	62
§ 10 重大事件揭示	62
10.1 基金份额持有人大会决议	62
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	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	63
10.4 基金投资策略的改变	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	63
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	63
10.8 其他重大事件	64
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	65
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	65
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	65
§ 12 备查文件目录	65
12.1 备查文件目录	65
12.2 存放地点	65
12.3 查阅方式	65

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	申万宏源双季增享 6 个月持有期债券型集合资产管理计划		
基金简称	申万宏源双季增享 6 个月债券		
基金主代码	970188		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2022 年 10 月 13 日		
基金管理人	申万宏源证券资产管理有限公司		
基金托管人	兴业银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	271,355,005.25 份		
基金合同存续期	变更为本集合计划后，本集合计划存续期限自本集合计划合同生效之日起 3 年。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。		
下属分级基金的基金简称	申万宏源双季增享 6 个月债券 A	申万宏源双季增享 6 个月债券 B	申万宏源双季增享 6 个月债券 C
下属分级基金的交易代码	970188	970189	970190
报告期末下属分级基金的份额总额	103,859,582.24 份	136,224,823.24 份	31,270,599.77 份

注：本报告所述的“基金”系指按照《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》的要求完成合同变更后的证券公司大集合资产管理计划申万宏源双季增享 6 个月持有期债券型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）。管理人拟向中国证监会申请公募基金管理资格，在取得公募基金管理资格后，管理人将按照相关监管规定将本集合计划注册变更为公募基金。

2.2 基金产品说明

投资目标	本集合计划在追求本金安全、严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力求为持有人提供超越业绩比较基准的稳健回报，实现集合计划资产长期稳健增值。
投资策略	坚持稳健投资，在严格控制风险的基础上，追求长期持续稳定的合理回报。本集合计划的债券投资策略包括久期偏离策略、类别选择策略、相对价值策略、个券选择策略、信用债投资策略。本集合计划的投资策略还包括国债期货投资策略、股票投资策略等。
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*10%
风险收益特征	本集合计划为债券型集合资产管理计划，在通常情况下其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金、现金管理型集合计划，低于股票型基金、股票型集合计划、混合型基金和混合型集合计划。

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	申万宏源证券资产管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙兆军
	联系电话	021-33389888
		龚小武
		021-52629999-212056

电子邮箱	sunzhj@swyhsc.com	gongxiaowu@cib.com.cn
客户服务电话	95523	95561
传真	-	021-62159217
注册地址	上海市徐汇区长乐路 989 号 40 层	福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦
办公地址	上海市徐汇区长乐路 989 号 40 层	上海市浦东新区银城路 167 号 4 楼
邮政编码	200031	200120
法定代表人	袁锦	吕家进

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.swyzcg1.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号 恒奥中心 A 座

§ 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-2024 年 6 月 30 日)		
	申万宏源双季增享 6 个月债券 A	申万宏源双季增享 6 个月债券 B	申万宏源双季增享 6 个月债券 C
本期已实现收益	1,445,246.32	2,036,209.09	445,459.62
本期利润	1,838,116.22	2,616,050.03	270,051.31
加权平均基金份额本期利润	0.0157	0.0181	0.0081
本期加权平均净值利润率	1.51%	1.73%	0.78%
本期基金份额净值增长	1.64%	1.78%	1.51%

率			
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)		
期末可供分配利润	5,360,766.63	7,730,994.78	1,479,084.18
期末可供分配基金份额利润	0.0516	0.0568	0.0473
期末基金资产净值	109,245,835.45	143,990,923.09	32,757,585.44
期末基金份额净值	1.0519	1.0570	1.0476
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)		
基金份额累计净值增长率	4.82%	5.40%	4.39%

注：(1) 本期已实现收益指本期利息收入、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) 所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。

(3) 期末可供分配利润采用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

申万宏源双季增享 6 个月债券 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	0.12%	0.08%	0.25%	0.05%	-0.13%	0.03%
过去三个月	0.87%	0.09%	0.75%	0.07%	0.12%	0.02%
过去六个月	1.64%	0.12%	2.31%	0.09%	-0.67%	0.03%
过去一年	2.63%	0.10%	1.96%	0.09%	0.67%	0.01%
自基金合同生效起至今	4.82%	0.09%	2.88%	0.09%	1.94%	0.00%

申万宏源双季增享 6 个月债券 B

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	0.14%	0.07%	0.25%	0.05%	-0.11%	0.02%
过去三个月	0.94%	0.09%	0.75%	0.07%	0.19%	0.02%
过去六个月	1.78%	0.12%	2.31%	0.09%	-0.53%	0.03%
过去一年	2.93%	0.10%	1.96%	0.09%	0.97%	0.01%
自基金合同生效起至今	5.40%	0.09%	2.61%	0.09%	2.79%	0.00%

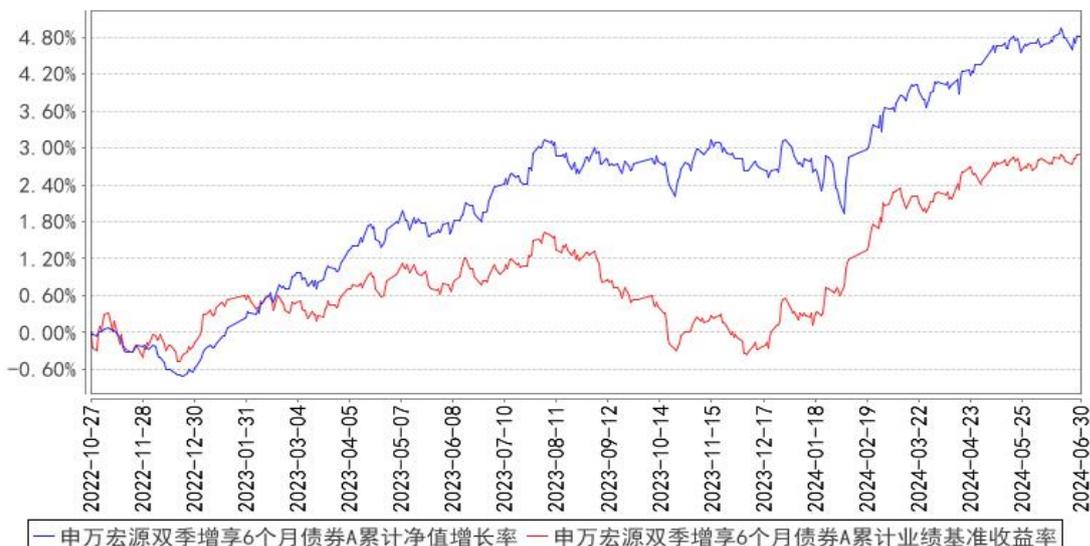
申万宏源双季增享 6 个月债券 C

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	0.11%	0.07%	0.25%	0.05%	-0.14%	0.02%
过去三个月	0.82%	0.09%	0.75%	0.07%	0.07%	0.02%
过去六个月	1.51%	0.12%	2.31%	0.09%	-0.80%	0.03%
过去一年	2.38%	0.10%	1.96%	0.09%	0.42%	0.01%
自基金合同生效起至今	4.39%	0.09%	2.88%	0.09%	1.51%	0.00%

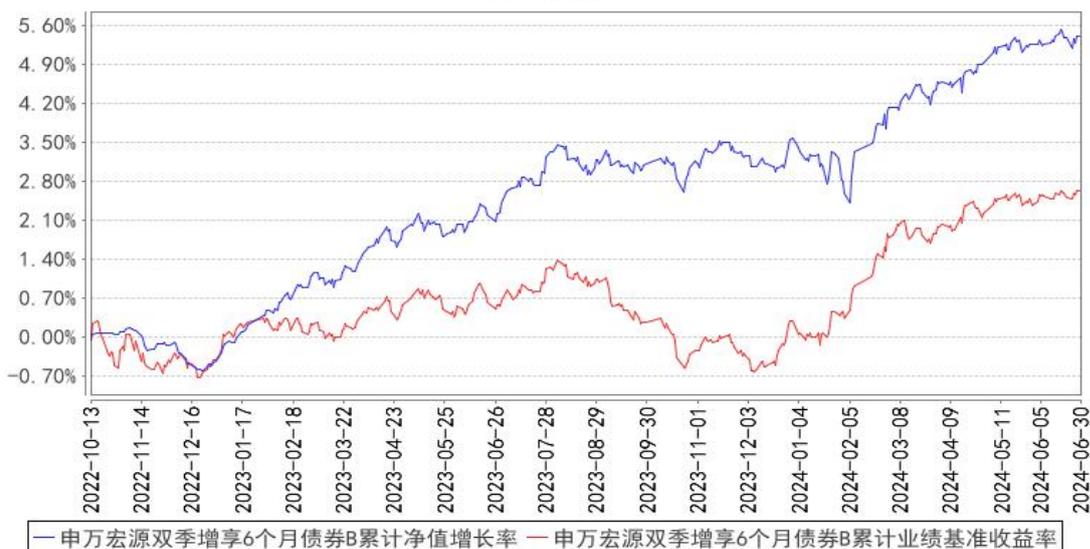
注：本集合计划合同变更生效日为 2022 年 10 月 13 日，申万宏源双季增享 6 个月债券 A 类份额和申万宏源双季增享 6 个月债券 C 类份额首次确认日是 2022 年 10 月 27 日。

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

申万宏源双季增享6个月债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



申万宏源双季增享6个月债券B累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



申万宏源双季增享6个月债券C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：申万宏源双季增享 6 个月债券 A 类份额和申万宏源双季增享 6 个月债券 C 类份额首次确认日是 2022 年 10 月 27 日。

§ 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

申万宏源证券资产管理有限公司（以下简称“申万宏源资管”或“公司”）正式成立于 2022 年 12 月 20 日，是申万宏源证券有限公司（以下简称“申万宏源证券”或“母公司”）的全资子公司，公司注册资本 25 亿元，是国内目前较大的证券资产管理公司之一。

申万宏源资管已取得《经营证券期货业务许可证》（流水号：000000059581），具备证券资产管理业务资格。

截至 2024 年 6 月 30 日，集合资产管理计划管理人共管理 6 只公募集合资产管理计划，分别为申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划、申万宏源灵通快利短期债券型集合资产管理计划、申万宏源天添利货币型集合资产管理计划、申万宏源天天增货币型集合资产管理计划、申万宏源双季增享 6 个月持有期债券型集合资产管理计划、申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划。

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		
季程	本基金的	2018 年 3	-	10 年	毕业于新加坡南洋理工大学，金融学硕士，

	基金经理	月 29 日			曾任职于申银万国证券股份有限公司资产管理事业部、申万宏源证券有限公司资产管理事业部，现任申万宏源证券资产管理有限公司公募投资部投资经理，具有多年资产管理工作经验。已取得投资主办人执业证书，证书编号为：Z0140824030008，并已取得基金从业资格，证书编号为：F4530000002664，不存在其他兼职情况，且最近三年无被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚的经历。
丁杰科	本基金的基金经理	2020年1月3日	-	16年	经济学和法学双学士，产业经济学硕士，中级经济师。先后就职于交银施罗德基金、中国农业银行金融市场部、申万菱信基金、申万宏源证券有限公司资产管理事业部，现任申万宏源证券资产管理有限公司公募投资部投资经理，拥有多年债券交易和投资经验，担任过货币、债券，股债混合等多种类型基金产品的基金经理。不存在其他兼职情况。已取得投资主办人执业证书，证书编号为：Z0140824030009，并已取得基金从业资格，证书编号为：F4530000003495，且最近三年无被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚的经历。
秦庆	本基金的基金经理	2022年10月13日	-	16年	国籍为中国，工学硕士，曾任职于基金公司、泰康资管权益投资部、原宏源证券北京资管分公司权益投资部、申万宏源证券有限公司资产管理事业部，现任申万宏源证券资产管理有限公司公募投资部投资经理。拥有丰富的投资运营管理经验，不存在其他兼职情况。已取得投资主办人执业证书，证书编号为：Z0140824030010，并已取得基金从业资格，证书编号为：F4530000002689，且最近三年无被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚的经历。
叶蕊	本基金的基金经理	2023年12月27日	-	15年	金融学硕士，具有多年固定收益类资产投资管理经验。曾任职于长盛基金管理有限公司研究交易岗、中信建投证券股份有限公司固定收益部投资岗、申万宏源证券有限公司资产管理事业部固定收益部负责人，现任申万宏源证券资产管理有限公司公募投资部负责人。已取得证券执业证书，证书编号为：Z0140124030111，并已取得基金从业资格并在基金业协会登记为投资

					经理，证书编号为：F4530000003408，不存在其他兼职情况，且最近三年无被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚的经历。
--	--	--	--	--	------------------------------------------------------------------

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；鉴于本集计划由证券公司大集合资产管理计划变更而来，若投资经理在变更生效日（即基金合同生效日）前已担任本集计划投资经理的，则任职日期为该投资经理首次担任本集计划投资经理之日。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》等有关法律法规及《申万宏源双季增享 6 个月持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》、《申万宏源双季增享 6 个月持有期债券型集合资产管理计划招募说明书》等有关本集计划法律文件的规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期内基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》建立并健全了有效的公平交易执行体系，同时建立了科学规范的投资决策体系，采用集中交易管理加强交易执行环节的内部控制，通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现；通过建立层级完备的公司股票池和债券库，完善各类具体资产管理业务组织结构，规范各项业务之间的关系，在保证各投资组合既具有相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过对异常交易行为的监控、分析评估、监察稽核和信息披露确保公平交易过程和结果的有效监督。

本报告期内，本公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，按照时间优先、价格优先的原则，对满足限价条件且对同一证券有相同交易需求的基金等投资组合，均采用了系统中的公平交易模块进行操作，严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易。按日内、3 日内、5 日内三个不同的时间窗口，对管理人管理的全部投资组合在本报告期内的交易情况进行了同向交易价差分析，各投资组合交易过程中不存在显著的交易价差，不存在不公平交易的情况。本报告期内未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本集合计划各项交易均严格按照相关法律法规、本集合计划资产管理合同的有关要求执行。报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易行为。

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，国内经济基本面呈现弱复苏态势。在全球制造业景气修复和海外补库存的支撑下，出口增速保持较高增长；基建在财政发力稍显滞后的影响下，同比增速尚可但仍保持一定韧性；制造业持续回暖，投资增速提升明显；房地产整体仍显羸弱，需求端改善不及预期，后续期待政策进一步加码。货币政策方面，央行维持整体流动性相对合理充裕，同时也兼顾防风险防空转等。上半年央行降准 1 次 50bp，未调降 OMO 及 MLF 利率，为后续政策操作留有空间。从十年国债收益率走势来看，1-2 月，在股市大幅走弱、资金面宽松、资产荒、银行保险强配置力量等共同作用下，收益率从 2.56% 一路下行至 2.27%；3 月-4 月中旬，在股市企稳回暖、经济数据超预期、止盈盘压力等因素下，收益率在 2.23-2.35% 窄幅震荡。4 月中下旬在央行发文提示当前长期国债收益率与长期经济增长率不匹配的利空下，收益率从 2.23% 回升至 2.35%。5-6 月，在资金面宽松、资产荒、银行理财大幅增长、经济刺激政策相对克制等共同影响下，收益率从 2.35% 一路下行至 2.21%。

组合运作上，基于固收+产品的特性，管理人整体上对于债券与权益仓位分别进行了择时优化配置。固收部分，秉持着固收打底的思路，重点关注收益安全垫的稳健性，主投利率债、中高评级信用债，严控信用风险。根据对流动性及资金中枢的研究预判，优化持仓，动态调整合理杠杆和久期。通过对期限利差的研究，适当择机运用骑乘策略，配置了部分 3 年以上债券及利率债增厚收益。权益部分，24 年上半年继续采用宏观状态择时和稳健多策略体系，动态调整权益类资产的配置比例，仓位目前主要聚焦在代表新质生产力方向、基本面趋势向好、估值分位数偏低的泛科技类以及一些低估值价值蓝筹类，行业层面上主要把握了工业金属、航运以及电子链条的一些核心个股的投资机会，力求在控制权益部分回撤的前提下为整体组合贡献更多的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，申万宏源双季增享 6 个月债券 A 单位净值为 1.0519 元。本报告期基金单位净值增长率为 1.64%，业绩比较基准收益率为 2.31%，申万宏源双季增享 6 个月债券 B 单位净值为 1.0570 元。本报告期基金单位净值增长率为 1.78%，业绩比较基准收益率为 2.31%，申万宏源双季增享 6 个月债券 C 单位净值为 1.0476 元。本报告期基金单位净值增长率为 1.51%，业绩比较基准收益率为 2.31%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2024 年下半年,经济高质量稳步复苏仍为重心,国内经济基本面将延续边际弱复苏态势。政府债发行预计提速,财政相对上半年将更为积极,基建投资增速将有所提升。国内通胀总体可控,货币政策上延续稳健宽松,流动性整体无忧,对于监管导向需紧密关注。地产在供需政策加码下,恢复情况仍有待观察,预计地产基本面低位寻底概率较大。消费上政策持续支持,总体韧性较高,预计维持复苏格局。出口方面,在海外需求高韧性下,仍将保持一定支撑。总体而言,经济基本面预计保持弱修复态势,货币政策稳健宽松,流动性充裕合理,债券市场相对中性乐观。权益市场方面,预计下半年主要机会存在于科技类、军工类以及一些估值分位数偏低的传统蓝筹方向,在当前状态空间下,计划积极把握其中基本面趋势向好的优质个股投资机会。管理人后期将继续紧盯宏观经济的恢复进度以及场内流动性的变化情况,并根据固收+产品的特性对债券和权益仓位进行进一步的优化配置以及持仓风格的动态调整,同时根据市场走势动态调整组合久期和杠杆,力争做到收益与回撤的均衡,为投资者获取稳健的收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及集合计划合同约定,本集合计划管理人为准确、及时进行基金估值和份额净值计价,制定了集合计划估值和份额净值计价的业务管理制度,建立了估值委员会,使用可靠的估值业务系统,设有完善的风险监测、控制和报告机制。本集合计划托管人审阅本集合计划管理人采用的估值原则及技术,并复核、审查集合计划资产净值和集合计划份额申购、赎回价格。会计师事务所在估值调整导致集合计划资产净值的变化在 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。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内,本基金未实施利润分配,符合本基金基金合同的相关规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

- 1、本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形;
- 2、本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 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

报告期内,本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,诚信、尽责地履行了基金托管人义务,不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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：申万宏源双季增享6个月持有期债券型集合资产管理计划

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	2,193,851.89	1,443,718.84
结算备付金		729,565.88	316,808.08
存出保证金		4,473.36	9,562.97
交易性金融资产	6.4.7.2	322,600,271.52	362,641,034.07
其中：股票投资		23,947,984.68	36,494,121.85
基金投资		-	-
债券投资		298,652,286.84	315,953,734.14
资产支持证券投资		-	10,193,178.08
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	7,711,038.56	2,599,802.70
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	167,384.34
应收股利		-	-

应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		333,239,201.21	367,178,311.00
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		47,009,471.65	2,500,544.41
应付清算款		19,723.68	78,518.91
应付赎回款		-	111,211.63
应付管理人报酬		83,252.57	113,298.85
应付托管费		11,863.39	15,582.09
应付销售服务费		7,311.98	11,561.00
应付投资顾问费		-	-
应交税费		13,311.85	17,506.84
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	99,922.11	296,706.47
负债合计		47,244,857.23	3,144,930.20
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	271,355,005.25	351,349,888.16
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	14,639,338.73	12,683,492.64
净资产合计		285,994,343.98	364,033,380.80
负债和净资产总计		333,239,201.21	367,178,311.00

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 271,355,005.25 份，其中申万宏源双季增享 6 个月债券 A 基金份额总额 103,859,582.24 份，基金份额净值 1.0519 元。申万宏源双季增享 6 个月债券 B 基金份额总额 136,224,823.24 份，基金份额净值 1.0570 元。申万宏源双季增享 6 个月债券 C 基金份额总额 31,270,599.77 份，基金份额净值 1.0476 元；

6.2 利润表

会计主体：申万宏源双季增享 6 个月持有期债券型集合资产管理计划

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		5,942,739.93	7,232,869.26

1. 利息收入		59,559.85	100,924.38
其中：存款利息收入	6.4.7.9	10,719.45	14,734.13
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		48,840.40	86,190.25
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		5,085,877.55	5,182,174.37
其中：股票投资收益		-866,565.41	906,040.92
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	5,471,551.20	3,902,840.57
资产支持证券投资	6.4.7.12	163,711.12	15,161.64
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	317,180.64	358,131.24
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	797,302.53	1,949,770.51
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-	-
减：二、营业总支出		1,218,522.37	499,695.62
1. 管理人报酬		538,584.38	293,181.50
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费		76,389.32	60,280.43
3. 销售服务费		42,388.76	16,142.19
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		456,674.44	40,193.08
其中：卖出回购金融资产支出		456,674.44	40,193.08
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		9,841.61	16,258.34
8. 其他费用	6.4.7.17	94,643.86	73,640.08
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,724,217.56	6,733,173.64
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”		4,724,217.56	6,733,173.64

号填列)			
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		4,724,217.56	6,733,173.64

6.3 净资产变动表

会计主体：申万宏源双季增享6个月持有期债券型集合资产管理计划

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	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	351,349,888.16	-	12,683,492.64	364,033,380.80
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	351,349,888.16	-	12,683,492.64	364,033,380.80
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-79,994,882.91	-	1,955,846.09	-78,039,036.82
(一)、综合收益总额	-	-	4,724,217.56	4,724,217.56
(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)	-79,994,882.91	-	-2,768,371.47	-82,763,254.38
其中：1.基金申购款	32,104,597.35	-	1,243,751.56	33,348,348.91
2.基金赎回款	-112,099,480.26	-	-4,012,123.03	-116,111,603.29
(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)、其他综合	-	-	-	-

收益结转留存收益				
四、本期期末净资产	271,355,005.25	-	14,639,338.73	285,994,343.98
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	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	251,805,743.13	-	-422,216.73	251,383,526.40
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	251,805,743.13	-	-422,216.73	251,383,526.40
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	4,779,495.39	-	7,097,045.80	11,876,541.19
(一)、综合收益总额	-	-	6,733,173.64	6,733,173.64
(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)	4,779,495.39	-	363,872.16	5,143,367.55
其中：1. 基金申购款	71,626,918.88	-	1,211,481.67	72,838,400.55
2. 基金赎回款	-66,847,423.49	-	-847,609.51	-67,695,033.00
(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)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	256,585,238.52	-	6,674,829.07	263,260,067.59

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：

袁锦

袁锦

王一蕊

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

申万宏源双季增享 6 个月持有期债券型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）于 2022 年 5 月 31 日经中国证监会《关于准予申银万国灵通快利 7 天集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函【2022】1040 号）批准，《申万宏源双季增享 6 个月持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》于 2022 年 10 月 13 日起正式变更生效。本集合计划为契约型开放式，自合同变更生效日起存续期不得超过 3 年。本集合计划的管理人为申万宏源证券资产管理有限公司，托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《申万宏源双季增享 6 个月持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》的有关规定，本集合计划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（含主板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票）、债券（包括国内依法发行的国债、地方政府债、政府支持机构债、央行票据、金融债券（含次级债券）、政策性金融债券、企业债券、公司债券、可转换债券（含分离交易可转债、可交换债券）、证券公司发行的短期公司债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据）、债券回购、银行存款（包括协议存款、通知存款、定期存款）、货币市场工具、同业存单、资产支持证券、国债期货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相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本集合计划的投资组合比例为：投资于债券的比例不低于集合计划总资产的 80%；投资于股票、可转换债券（含分离交易可转债、可交换债券）等权益类资产的投资比例合计不超过集合计划总资产的 20%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的 5%，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品种或对投资比例要求发生变更，集合计划管理人在履行适当程序后，可以相应调整本集合计划的投资范围和投资比例规定。

本集合计划的业绩比较基准为中债综合全价（总值）指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*10%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

(1) 印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自 2008 年 4 月 24 日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由原先的 3‰调整为 1‰;

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自 2008 年 9 月 19 日起,调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税,受让方不再征收,税率不变;

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让,暂免征收印花税。

(2) 增值税

根据财政部和国家税务总局《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[2016]14号）、《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》（财税[2017]2号）以及《关于资管产品增值税有关问题的通知》（财税[2017]56号）规定，管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，自2018年1月1日(含)起，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

(3)城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

(4)企业所得税

参照财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，对管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税。

参照财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对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。

(5)个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

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	2,193,851.89
等于：本金	2,193,645.62
加：应计利息	206.27
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-

存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	2,193,851.89

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	26,031,830.84	-	23,947,984.68	-2,083,846.16	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	42,889,114.73	1,458,720.54	45,119,220.54	771,385.27
	银行间市场	247,229,057.41	5,445,566.30	253,533,066.30	858,442.59
	合计	290,118,172.14	6,904,286.84	298,652,286.84	1,629,827.86
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	316,150,002.98	6,904,286.84	322,600,271.52	-454,018.30	

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

注：本报告期末本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本报告期末本基金未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本报告期末本基金未持有黄金衍生品。

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

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	7,711,038.56	-
银行间市场	-	-
合计	7,711,038.56	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本报告期末本基金未持有买断式逆回购中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产。

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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	18,971.25
其中：交易所市场	754.45
银行间市场	18,216.80
应付利息	-
预提费用	80,950.86
合计	99,922.11

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

申万宏源双季增享 6 个月债券 A

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	139,852,798.77	139,852,798.77
本期申购	7,592,247.66	7,592,247.66
本期赎回（以“-”号填列）	-43,585,464.19	-43,585,464.19
本期末	103,859,582.24	103,859,582.24

申万宏源双季增享 6 个月债券 B

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	158,647,785.40	158,647,785.40
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-22,422,962.16	-22,422,962.16
本期末	136,224,823.24	136,224,823.24

申万宏源双季增享 6 个月债券 C

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	52,849,303.99	52,849,303.99
本期申购	24,512,349.69	24,512,349.69

本期赎回（以“-”号填列）	-46,091,053.91	-46,091,053.91
本期末	31,270,599.77	31,270,599.77

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

申万宏源双季增享 6 个月债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,387,172.64	-507,921.33	4,879,251.31
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	5,387,172.64	-507,921.33	4,879,251.31
本期利润	1,445,246.32	392,869.90	1,838,116.22
本期基金份额交易产生的变动数	-1,471,652.33	140,538.01	-1,331,114.32
其中：基金申购款	302,628.67	17,472.58	320,101.25
基金赎回款	-1,774,281.00	123,065.43	-1,651,215.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,360,766.63	25,486.58	5,386,253.21

申万宏源双季增享 6 个月债券 B

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,690,992.42	-576,270.21	6,114,722.21
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	6,690,992.42	-576,270.21	6,114,722.21
本期利润	2,036,209.09	579,840.94	2,616,050.03
本期基金份额交易产生的变动数	-996,206.73	31,534.34	-964,672.39
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-996,206.73	31,534.34	-964,672.39
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,730,994.78	35,105.07	7,766,099.85

申万宏源双季增享 6 个月债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,881,352.94	-191,833.82	1,689,519.12
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	1,881,352.94	-191,833.82	1,689,519.12
本期利润	445,459.62	-175,408.31	270,051.31
本期基金份额交易产生的变动数	-847,728.38	375,143.62	-472,584.76
其中：基金申购款	879,231.65	44,418.66	923,650.31

基金赎回款	-1,726,960.03	330,724.96	-1,396,235.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,479,084.18	7,901.49	1,486,985.67

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		6,179.79
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		4,497.55
其他		42.11
合计		10,719.45

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		-866,565.41
股票投资收益——赎回差价收入		-
股票投资收益——申购差价收入		-
股票投资收益——证券出借差价收入		-
合计		-866,565.41

6.4.7.10.2 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		39,959,465.31
减：卖出股票成本总额		40,785,904.31
减：交易费用		40,126.41
买卖股票差价收入		-866,565.41

6.4.7.10.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期无证券出借差价收入。

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
债券投资收益——利息收入		5,205,546.83

债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	266,004.37
债券投资收益——赎回差价收入	—
债券投资收益——申购差价收入	—
合计	5,471,551.20

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	139,154,911.16
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	135,825,819.02
减：应计利息总额	3,060,424.22
减：交易费用	2,663.55
买卖债券差价收入	266,004.37

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

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
资产支持证券投资收益——利息收入	163,711.12
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	—
资产支持证券投资收益——赎回差价收入	—
资产支持证券投资收益——申购差价收入	—
合计	163,711.12

6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	10,375,835.62
减：卖出资产支持证券成本总额	10,000,000.00
减：应计利息总额	375,835.62
减：交易费用	—
资产支持证券投资收益	0.00

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.14 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	317,180.64
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	317,180.64

6.4.7.15 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	797,302.53
股票投资	7,140.51
债券投资	776,162.02
资产支持证券投资	14,000.00
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	797,302.53

6.4.7.16 其他收入

注：本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.17 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	3,978.52
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	12,393.00
账户维护费	18,600.00
合计	94,643.86

6.4.7.18 分部报告

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

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

本集合计划本报告期存在控制关系或其他重大影响关系的关联方未发生变化。

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
申万宏源证券资产管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
兴业银行股份有限公司	基金托管人
申万宏源证券有限公司	基金管理人的股东，基金销售机构

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（%）
申万宏源证券有限公司	68,192,091.94	100.00	65,635,180.96	100.00

6.4.10.1.2 债券交易

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	占当期债券 成交总额的比 例（%）	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例（%）
申万宏源证券有限公司	10,503.20	100.00	43,890,849.14	100.00

6.4.10.1.3 债券回购交易

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	占当期债券回 购 成交总额的比 例(%)	成交金额	占当期债券回 购 成交总额的比 例(%)
申万宏源证券有限 公司	690,924,000.00	100.00	899,749,000.00	100.00

6.4.10.1.4 权证交易

注：本报告期及上年度可比期间内，本集合计划均未通过关联方交易单元进行权证交易。

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(%)
申万宏源证券有 限公司	19,226.97	100.00	754.45	100.00
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(%)
申万宏源证券有 限公司	24,340.35	100.00	4,656.99	100.00

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	538,584.38
其中：应支付销售机构的客户维护 费	216,650.43	1.77
应支付基金管理人的净管理费	321,933.95	293,179.73

注：本集合计划A类、C类计划份额的固定管理费按前一日集合计划资产净值的0.5%年费率计提，B类计划份额的固定管理费按前一日集合计划资产净值的0.2%年费率计提。各类计划份额的固定管理费的计算方法如下：

$$H = E \times \text{各类计划份额年固定管理费率} \div \text{当年天数}$$

H为每日该类计划份额应计提的集合计划固定管理费

E 为前一日该类计划份额的集合计划资产净值

集合计划固定管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

集合计划管理人对本集合计划 B 类计划份额提取业绩报酬，A 类、C 类计划份额不提取业绩报酬。

对于 B 类计划份额，本集合计划采用逐笔计提法提取业绩报酬，若单个集合计划份额持有人的单笔份额在其持有期间的年化收益率超过业绩报酬计提基准（4%）时，按照超过业绩报酬计提基准部分的 20% 提取业绩报酬。本集合计划业绩报酬在集合计划份额持有人赎回/转出集合计划份额或集合计划合同终止清算时收取。

（1）计提起始日

业绩报酬计提起始日为集合计划合同生效日。

（2）计提基准日

集合计划份额持有人申请赎回或转出集合计划份额时，计提基准日为集合计划份额持有人提出申请赎回或转出集合计划份额的工作日；集合计划合同终止时，计提基准日为集合计划最后运作日。

（3）计提基准及比例

本集合计划业绩报酬计提基准为 4%，业绩报酬计提比例为超过业绩报酬计提基准部分的 20%。因法律法规、监管政策调整而需要修订业绩报酬计提基准和计提比例的，无需召开集合计划份额持有人大会。

（4）计提方式

在集合计划份额持有人申请赎回或转出集合计划份额时，业绩报酬从赎回款项或转出金额中计提；在集合计划合同终止时，业绩报酬从集合计划合同终止清算资金中计提。

（5）业绩报酬计算方式

$$\text{业绩报酬} = \max \{ Q \times P \times [(P1 - P0) / P \times 365 / T - 4\%] \times 20\% \times T / 365, 0 \}$$

其中：

Q：应计提业绩报酬的集合计划份额数量

P1：应计提业绩报酬的集合计划份额在计提基准日的集合计划份额累计净值

P0：应计提业绩报酬的集合计划份额在计提起始日的集合计划份额累计净值

P：应计提业绩报酬的集合计划份额在计提起始日的集合计划份额净值

T：应计提业绩报酬的集合计划份额在业绩报酬计提周期内的实际持有自然天数（即集合计划合同生效日（含）至赎回/转出/终止清算确认日（不含）间的自然天数）

业绩报酬按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位。因取值精度原因，实际业绩报酬计提结果以登记机构计算结果为准。因涉及相关数据，集合计划管理人的业绩报酬的计算和复核工作由集合计划管理人完成，相关信息以登记机构计算结果为准。

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	76,389.32	60,280.43

注：本集合计划的托管费按前一日集合计划资产净值的 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的集合计划托管费

E 为前一日的集合计划资产净值

集合计划托管费每日计提，逐日累计至每月月末，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			
	申万宏源双季增享 6 个月债券 A	申万宏源双季增享 6 个月债券 B	申万宏源双季增享 6 个月债券 C	合计
申万宏源证券有限 公司	-	-	39,937.94	39,937.94
合计	-	-	39,937.94	39,937.94
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			
	申万宏源双季增享 6 个月债券 A	申万宏源双季增享 6 个月债券 B	申万宏源双季增享 6 个月债券 C	合计
申万宏源证券有限 公司	-	-	13,478.58	13,478.58
合计	-	-	13,478.58	13,478.58

注：销售服务费可用于本集合计划市场推广、销售以及份额持有人服务等各项费用。本集合计划 A、B 类计划份额不收取销售服务费，C 类计划份额的销售服务费年费率为 0.3%。C 类计划份额的

销售服务费按前一日 C 类计划份额资产净值的 0.3% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年销售服务费率} \div 365$$

H 为 C 类集合计划份额应计提的销售服务费

E 为 C 类集合计划份额前一日的集合计划资产净值

集合计划销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

销售服务费的优惠活动以管理人相关公告为准。

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

注：本报告期及上年度可比期间内，本集合计划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

注：本报告期及上年度可比期间内，本集合计划均未发生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。

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

注：本报告期及上年度可比期间内，本集合计划均未发生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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2024年1月1日至2024年 6月30日	本期 2024年1月1日至 2024年6月30日	本期 2024年1月1日至 2024年6月30日
	申万宏源双季增享6个月 债券A	申万宏源双季增享6 个月债券B	申万宏源双季增享6 个月债券C
基金合同生效日 (2022年10月13 日)持有的基金份额	0.00	-	-
报告期初持有的基金 份额	0.00	-	-
报告期间申购/买入 总份额	6,574,198.50	-	-
报告期间因拆分变动	0.00	-	-

份额			
减：报告期内赎回/卖出总份额	0.00	-	-
报告期末持有的基金份额	6,574,198.50	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	6.33%	-	-
项目	上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日
	申万宏源双季增享6个月债券A	申万宏源双季增享6个月债券B	申万宏源双季增享6个月债券C
基金合同生效日（2022年10月13日）持有的基金份额	-	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-	-
报告期内申购/买入总份额	-	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	-

注：根据《关于申万宏源双季增享 6 个月持有期债券型集合资产管理计划管理人及自有资金跟投主体变更的公告》，自 2023 年 10 月 9 日起，本集合计划管理人由“申万宏源证券有限公司”变更为“申万宏源证券资产管理有限公司”。本报告期期末持有的本基金份额占 A 类基金总份额比例为 6.33%，本报告期期末持有的本基金份额占 A 类、B 类、C 类基金合计总份额比例为 2.42%。

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

份额单位：份

申万宏源双季增享 6 个月债券 B

关联方名称	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日

	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)
申万宏源 证券有限 公司	-	-	6,557,144.41	4.1331

注：根据《申万宏源双季增享 6 个月持有期债券型集合资产管理计划自有资金置换公告》，申万宏源证券有限公司持有的全部份额共计 6,557,144.41 份已于 2024 年 3 月 13 日全部赎回。申万宏源证券有限公司上年度末持有的本基金份额占 B 类基金总份额比例为 4.1331%，上年度末持有的本基金份额占 A 类、B 类、C 类基金合计总份额比例为 1.8663%。

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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行股份有限 公司	2,193,851.89	6,179.79	936,009.33	4,297.39

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本报告期及上年度可比期间内，本集合计划均未发生本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

注：根据相关法律法规的规定和基金合同的约定，以及本基金的实际运作情况，本基金报告期末未进行利润分配。

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

注：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回

购证券款余额为人民币 47,009,471.65 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
092280108	22 中行二级资本债 02A	2024 年 7 月 1 日	104.82	127,000	13,312,722.95
242380028	23 绍兴银行永续债 01	2024 年 7 月 1 日	110.91	100,000	11,090,650.27
242480003	24 广州农商行永续债 01	2024 年 7 月 1 日	101.83	100,000	10,182,895.89
102101677	21 昌吉州 MTN002	2024 年 7 月 5 日	103.67	189,000	19,593,423.44
合计				516,000	54,179,692.55

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本集合计划是一只债券型集合资产管理计划，主要面临的金融工具风险包括：信用风险、流动性风险和市场风险，其中市场风险部分主要是利率风险。管理人制定了管理机制和监控指标来识别及分析这些风险，并针对各风险类型设定适当的风险限额及内部控制流程。

本基金管理人秉承全面风险管理的理念，遵循申万宏源证券资产管理有限公司的风险管理架构，将风险管理融入业务中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。建立的风险管理体系由三道风险防范层级构成。一道风险防范层级是指公司经营管理层下设风险管理委员会，负责公司风险的控制、管理、监督和评价；二道风险防范层级是指公司下设风险管理部及信评部门对资产管理业务风险进行的预防和控制；三道风险防范是指投资部门对自身业务工作风险进行的自我检查和控制。各部门负责人为其所在部门风险管理的第一责任人，公司员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。风险管理部门对公司的风险管理进行独立评估、监控、检查并及时向管理层汇报。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指集合计划在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者集合计划所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致集合计划资产损失和收益变化的风险。

本基金管理人建立了信用风险评估与管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制信用风险，通过分散化投资以分散信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。

内部信用评级体系全面考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险、信用产品的条款和担保人的情况等。

本集合计划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证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本集合计划在进行银行间同业市场交易均通过事前检查和控制对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

本集合计划报告期末债券投资按短期信用评级及长期信用评级列示的情况如下，其中不包括本集合计划所持有的国债、央行票据、政策性金融债。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	10,010,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	30,814,329.24	50,069,000.00
合计	30,814,329.24	60,079,000.00

注：本表主要列示短期融资券和超短期融资券，债券评级取自第三方评级机构的债项评级，未评级债券列示其他短期融资券和超短期融资券。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	134,151,925.47	82,260,748.66
AAA 以下	78,131,282.62	56,059,451.96
AA+	67,040,632.35	56,059,451.96
AA	11,090,650.27	0.00
未评级	5,101,958.90	5,180,877.05
合计	217,385,166.99	143,501,077.67

注：本表主要列示除短融和超短融之外的信用债，债券评级取自第三方评级机构的最新债项评级。

6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	0.00	10,193,178.08
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	10,193,178.08

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	19,659,711.34	38,047,200.00
AAA 以下	0.00	-
未评级	0.00	-
合计	19,659,711.34	38,047,200.00

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指管理人未能以合理价格及时变现集合计划资产以支付投资者赎回款项的风险。本集合计划的流动性风险一方面来自于份额持有人可随时要求赎回其持有的集合计划份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对第一类兑付赎回资金的流动性风险，管理人已经建立针对本集合计划申购赎回状况的监控和预测机制以及巨额赎回审批规程，对于巨额赎回建立严格的流动性评估机制；同时在资产管理合同约定巨额赎回条款，明确巨额赎回资金的处理模式，有效保障持有人利益。

针对第二类投资品种的流动性风险，管理人持续监控各项流动性指标，包括组合持仓集中度、投资组合在短时间内变现能力、流通受限资产的比例等指标，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。管理人已建立压力测试机制，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。同时，建立流动性风险应急机制，在发生或发现潜在较大的流动性风险时，管理人会立即启动应急机制。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金管理人严格按照《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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本集合计划组合资产的流动性风险进行管理。

本基金管理人采用监控集合计划组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、集合计划组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本集合计划的申购赎回情况进行监控，保持集合计划投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本集合计划资产的变现能力与投资者赎回需求相匹配。

本基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度。通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等方面进行尽职调查，严格落实准入管理；对交易对手实施交易额度管理等措施来管理本集合计划从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。

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集合计划的资产和负债情况，本集合计划本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指集合计划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

利率风险是指集合计划的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本集合计划的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

管理人通过由风险管理人员定期监控组合的利率敏感性缺口，对利率水平进行分析和预测，及时调整投资组合久期等方法管理利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,193,851.89	-	-	-	2,193,851.89
结算备付金	729,565.88	-	-	-	729,565.88
存出保证金	4,473.36	-	-	-	4,473.36
交易性金融资产	122,648,154.94	92,295,918.80	83,708,213.10	23,947,984.68	322,600,271.52
买入返售金融资产	7,711,038.56	-	-	-	7,711,038.56
资产总计	133,287,084.63	92,295,918.80	83,708,213.10	23,947,984.68	333,239,201.21
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	83,252.57	83,252.57
应付托管费	-	-	-	11,863.39	11,863.39
应付清算款	-	-	-	19,723.68	19,723.68
卖出回购金融资产款	47,009,471.65	-	-	-	47,009,471.65
应付销售服务费	-	-	-	7,311.98	7,311.98
应付交易费用	-	-	-	18,971.25	18,971.25
应交税费	-	-	-	13,311.85	13,311.85
预提费用	-	-	-	80,950.86	80,950.86
负债总计	47,009,471.65	-	-	235,385.58	47,244,857.23
利率敏感度缺口	86,277,612.98	92,295,918.80	83,708,213.10	23,712,599.10	285,994,343.98
上年度末	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

2023年12月31日					
资产					
银行存款	1,443,718.84	-	-	-	1,443,718.84
结算备付金	316,808.08	-	-	-	316,808.08
存出保证金	9,562.97	-	-	-	9,562.97
交易性金融资产	-254,530,873.70	71,616,038.52	36,494,121.85		362,641,034.07
买入返售金融资产	2,599,802.70	-	-	-	2,599,802.70
应收证券清算款	-	-	167,384.34		167,384.34
资产总计	4,369,892.59	254,530,873.70	71,616,038.52	36,661,506.19	367,178,311.00
负债					
卖出回购金融资产款	2,500,544.41	-	-	-	2,500,544.41
应付证券清算款	-	-	78,518.91		78,518.91
应付赎回款	-	-	111,211.63		111,211.63
应付管理人报酬	-	-	113,298.85		113,298.85
应付托管费	-	-	15,582.09		15,582.09
应付销售服务费	-	-	11,561.00		11,561.00
应付交易费用	-	-	9,406.47		9,406.47
应交税费	-	-	17,506.84		17,506.84
预提费用	-	-	287,300.00		287,300.00
负债总计	2,500,544.41	-	-	644,385.79	3,144,930.20
利率敏感度缺口	1,869,348.18	254,530,873.70	71,616,038.52	36,017,120.40	364,033,380.80

注：上表统计了本集合计划的利率风险敞口。表中所示为本集合计划资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率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）
	市场利率下降25个基点	2,230,877.53	1,498,853.09
	市场利率上升25个基点	-2,230,877.53	-1,498,853.09

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

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。本基金的其他价格风险主要为市场价格变化或波动所引起的股票和债券等资产损失的可能性。

本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。此外，本基金管理人对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法进行风险度量和分析，以对风险进行跟踪和控制。

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	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	23,947,984.68	8.37	36,494,121.85	10.02
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	298,652,286.84	104.43	315,953,734.14	86.79
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	322,600,271.52	112.80	352,447,855.99	96.82

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）
	1. 业绩比较基准上升5%	7,250,271.59	8,873,663.21
2. 业绩比较基准下降5%	-7,250,271.59	-8,873,663.21	

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无

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：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：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	23,947,984.68	36,505,044.95
第二层次	298,652,286.84	326,135,989.12
第三层次	-	-
合计	322,600,271.52	362,641,034.07

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。本基金本报告期及上年度可比期间持有的持续以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	23,947,984.68	7.19
	其中：股票	23,947,984.68	7.19
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	298,652,286.84	89.62
	其中：债券	298,652,286.84	89.62
	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	7,711,038.56	2.31
	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	2,923,417.77	0.88
8	其他各项资产	4,473.36	0.00
9	合计	333,239,201.21	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

金额单位：人民币元

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	29,191.00	0.01
B	采矿业	646,967.00	0.23
C	制造业	14,593,492.34	5.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	675,874.00	0.24
E	建筑业	487,033.00	0.17
F	批发和零售业	228,270.00	0.08
G	交通运输、仓储和邮政业	554,979.30	0.19
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,300,828.44	0.45
J	金融业	4,927,972.60	1.72
K	房地产业	280,228.00	0.10
L	租赁和商务服务业	93,246.00	0.03
M	科学研究和技术服务业	11,648.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	13,804.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	6,160.00	0.00

Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	98,291.00	0.03
S	综合	-	-
	合计	23,947,984.68	8.37

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：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

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000725	京东方A	215,100	879,759.00	0.31
2	601688	华泰证券	57,900	717,381.00	0.25
3	601108	财通证券	107,700	711,897.00	0.25
4	600372	中航机载	55,161	660,277.17	0.23
5	601318	中国平安	13,100	541,816.00	0.19
6	002475	立讯精密	11,900	467,789.00	0.16
7	000776	广发证券	35,500	432,035.00	0.15
8	600030	中信证券	20,700	377,361.00	0.13
9	600038	中直股份	8,900	365,879.00	0.13
10	002138	顺络电子	13,300	365,218.00	0.13
11	000100	TCL科技	81,300	351,216.00	0.12
12	000001	平安银行	32,900	333,935.00	0.12
13	000738	航发控制	16,600	333,162.00	0.12
14	300481	濮阳惠成	24,000	331,200.00	0.12
15	601211	国泰君安	23,400	317,070.00	0.11
16	688300	联瑞新材	6,488	312,072.80	0.11
17	600741	华域汽车	19,000	311,220.00	0.11
18	601128	常熟银行	39,380	298,106.60	0.10
19	300373	扬杰科技	7,400	287,860.00	0.10
20	600183	生益科技	13,500	284,310.00	0.10
21	600362	江西铜业	11,800	279,424.00	0.10
22	000630	铜陵有色	64,200	231,762.00	0.08
23	600900	长江电力	7,100	205,332.00	0.07
24	600497	驰宏锌锗	38,300	204,522.00	0.07
25	600887	伊利股份	7,900	204,136.00	0.07
26	603920	世运电路	10,300	203,322.00	0.07
27	600585	海螺水泥	8,400	198,156.00	0.07
28	688589	力合微	7,680	193,612.80	0.07
29	002029	七匹狼	35,300	177,912.00	0.06
30	000060	中金岭南	41,500	175,960.00	0.06
31	688028	沃尔德	10,700	175,801.00	0.06
32	000768	中航西飞	7,300	175,419.00	0.06

33	603078	江化微	12,600	168,714.00	0.06
34	600048	保利发展	19,100	167,316.00	0.06
35	600862	中航高科	8,700	163,386.00	0.06
36	002371	北方华创	500	159,945.00	0.06
37	002415	海康威视	5,000	154,550.00	0.05
38	600958	东方证券	20,300	154,280.00	0.05
39	300547	川环科技	9,100	148,785.00	0.05
40	600519	贵州茅台	100	146,739.00	0.05
41	601668	中国建筑	27,200	144,432.00	0.05
42	002352	顺丰控股	3,900	139,191.00	0.05
43	601377	兴业证券	23,600	119,416.00	0.04
44	002517	恺英网络	12,500	119,375.00	0.04
45	605358	立昂微	5,000	115,700.00	0.04
46	601233	桐昆股份	7,200	114,912.00	0.04
47	603225	新凤鸣	7,300	113,807.00	0.04
48	000898	鞍钢股份	51,800	109,816.00	0.04
49	300674	宇信科技	9,500	105,260.00	0.04
50	000783	长江证券	20,500	99,015.00	0.03
51	601390	中国中铁	14,700	95,844.00	0.03
52	601619	嘉泽新能	31,000	93,930.00	0.03
53	002025	航天电器	2,000	92,760.00	0.03
54	300750	宁德时代	500	90,015.00	0.03
55	002273	水晶光电	5,300	89,994.00	0.03
56	002139	拓邦股份	8,400	89,208.00	0.03
57	300760	迈瑞医疗	300	87,273.00	0.03
58	603059	倍加洁	4,400	86,856.00	0.03
59	600036	招商银行	2,500	85,475.00	0.03
60	300682	朗新集团	9,800	83,398.00	0.03
61	600879	航天电子	10,600	82,362.00	0.03
62	300592	华凯易佰	7,000	80,010.00	0.03
63	601009	南京银行	7,500	77,925.00	0.03
64	601919	中远海控	5,000	77,450.00	0.03
65	300450	先导智能	4,600	76,498.00	0.03
66	600760	中航沈飞	1,900	76,190.00	0.03
67	300969	恒帅股份	1,100	76,043.00	0.03
68	688008	澜起科技	1,300	74,308.00	0.03
69	600699	均胜电子	5,000	74,100.00	0.03
70	002439	启明星辰	4,200	72,492.00	0.03
71	000333	美的集团	1,100	70,950.00	0.02
72	601601	中国太保	2,500	69,650.00	0.02
73	002466	天齐锂业	2,300	68,793.00	0.02
74	601899	紫金矿业	3,800	66,766.00	0.02
75	600584	长电科技	2,100	66,591.00	0.02

76	300638	广和通	3,800	64,980.00	0.02
77	002422	科伦药业	2,100	63,693.00	0.02
78	600428	中远海特	10,400	63,648.00	0.02
79	300782	卓胜微	800	62,192.00	0.02
80	601618	中国中冶	20,000	62,000.00	0.02
81	600970	中材国际	5,000	60,300.00	0.02
82	601728	中国电信	9,400	57,810.00	0.02
83	600050	中国联通	12,200	57,340.00	0.02
84	600765	中航重机	2,800	57,120.00	0.02
85	000932	华菱钢铁	12,600	55,818.00	0.02
86	300447	全信股份	4,300	53,234.00	0.02
87	603993	洛阳铝业	6,100	51,850.00	0.02
88	601717	郑煤机	3,500	51,800.00	0.02
89	601398	工商银行	8,900	50,730.00	0.02
90	002409	雅克科技	800	50,328.00	0.02
91	605589	圣泉集团	2,400	48,696.00	0.02
92	603297	永新光学	800	48,392.00	0.02
93	601126	四方股份	2,400	46,128.00	0.02
94	600219	南山铝业	12,100	46,101.00	0.02
95	688111	金山办公	200	45,500.00	0.02
96	002373	千方科技	5,000	45,350.00	0.02
97	600521	华海药业	2,600	44,330.00	0.02
98	003816	中国广核	9,500	43,985.00	0.02
99	002532	天山铝业	5,400	43,794.00	0.02
100	000568	泸州老窖	300	43,047.00	0.02
101	002064	华峰化学	6,000	43,020.00	0.02
102	002738	中矿资源	1,600	42,880.00	0.01
103	600809	山西汾酒	200	42,176.00	0.01
104	002236	大华股份	2,700	41,742.00	0.01
105	600989	宝丰能源	2,400	41,592.00	0.01
106	603019	中科曙光	1,000	41,500.00	0.01
107	002384	东山精密	2,000	41,400.00	0.01
108	002602	世纪华通	12,000	41,160.00	0.01
109	300253	卫宁健康	6,900	40,710.00	0.01
110	002315	焦点科技	1,500	40,440.00	0.01
111	000625	长安汽车	3,000	40,290.00	0.01
112	600919	江苏银行	5,400	40,122.00	0.01
113	600803	新奥股份	1,900	39,520.00	0.01
114	300428	立中集团	2,100	39,039.00	0.01
115	002249	大洋电机	8,200	38,786.00	0.01
116	600875	东方电气	2,100	38,745.00	0.01
117	300308	中际旭创	280	38,606.40	0.01
118	002179	中航光电	1,000	38,050.00	0.01

119	603859	能科科技	1,776	37,331.52	0.01
120	000683	远兴能源	5,400	37,314.00	0.01
121	002215	诺普信	5,000	37,250.00	0.01
122	002984	森麒麟	1,540	37,098.60	0.01
123	601319	中国人保	7,200	37,080.00	0.01
124	601658	邮储银行	7,300	37,011.00	0.01
125	002126	银轮股份	2,100	36,561.00	0.01
126	002463	沪电股份	1,000	36,500.00	0.01
127	600035	楚天高速	8,400	36,036.00	0.01
128	002508	老板电器	1,600	35,360.00	0.01
129	600905	三峡能源	8,100	35,316.00	0.01
130	002212	天融信	7,200	35,064.00	0.01
131	002906	华阳集团	1,300	34,788.00	0.01
132	002001	新和成	1,800	34,560.00	0.01
133	300251	光线传媒	4,100	34,481.00	0.01
134	601877	正泰电器	1,800	34,308.00	0.01
135	601700	风范股份	7,800	34,242.00	0.01
136	603337	杰克股份	1,300	34,216.00	0.01
137	601868	中国能建	16,100	34,132.00	0.01
138	600512	腾达建设	18,000	34,020.00	0.01
139	600011	华能国际	3,500	33,670.00	0.01
140	600660	福耀玻璃	700	33,530.00	0.01
141	300687	赛意信息	2,400	33,408.00	0.01
142	600062	华润双鹤	1,700	33,286.00	0.01
143	600693	东百集团	11,800	33,158.00	0.01
144	601991	大唐发电	10,700	32,207.00	0.01
145	600601	方正科技	10,700	32,100.00	0.01
146	601916	浙商银行	11,600	32,016.00	0.01
147	600575	淮河能源	8,200	31,898.00	0.01
148	600795	国电电力	5,300	31,747.00	0.01
149	300502	新易盛	300	31,665.00	0.01
150	002128	电投能源	1,500	31,650.00	0.01
151	000723	美锦能源	6,600	31,416.00	0.01
152	603688	石英股份	1,050	31,090.50	0.01
153	000795	英洛华	5,600	31,024.00	0.01
154	688208	道通科技	1,244	30,030.16	0.01
155	601336	新华保险	1,000	30,030.00	0.01
156	600926	杭州银行	2,300	30,015.00	0.01
157	300115	长盈精密	2,500	29,975.00	0.01
158	600420	国药现代	2,800	29,904.00	0.01
159	002662	京威股份	9,800	29,792.00	0.01
160	000563	陕国投 A	10,700	29,425.00	0.01
161	300408	三环集团	1,000	29,190.00	0.01

162	600959	江苏有线	11,000	29,040.00	0.01
163	601311	骆驼股份	3,600	28,872.00	0.01
164	002570	贝因美	12,300	28,782.00	0.01
165	601512	中新集团	3,700	28,194.00	0.01
166	601628	中国人寿	900	27,945.00	0.01
167	000999	华润三九	650	27,677.00	0.01
168	688018	乐鑫科技	280	27,630.40	0.01
169	601101	昊华能源	3,000	27,570.00	0.01
170	600114	东睦股份	1,900	27,341.00	0.01
171	300054	鼎龙股份	1,200	27,216.00	0.01
172	601985	中国核电	2,500	26,650.00	0.01
173	600285	羚锐制药	1,100	26,631.00	0.01
174	002053	云南能投	2,200	26,598.00	0.01
175	600808	马钢股份	13,000	26,260.00	0.01
176	600256	广汇能源	3,900	26,130.00	0.01
177	002324	普利特	3,000	25,650.00	0.01
178	000858	五粮液	200	25,608.00	0.01
179	601702	华峰铝业	1,400	25,564.00	0.01
180	600812	华北制药	6,200	25,544.00	0.01
181	600690	海尔智家	900	25,542.00	0.01
182	688210	统联精密	1,141	25,273.15	0.01
183	300194	福安药业	6,700	25,058.00	0.01
184	600664	哈药股份	9,400	24,816.00	0.01
185	688219	会通股份	3,140	24,397.80	0.01
186	600309	万华化学	300	24,258.00	0.01
187	002332	仙琚制药	2,100	23,961.00	0.01
188	002543	万和电气	2,400	23,904.00	0.01
189	600429	三元股份	6,400	23,872.00	0.01
190	601018	宁波港	7,000	23,800.00	0.01
191	600598	北大荒	1,900	23,731.00	0.01
192	688005	容百科技	1,000	23,280.00	0.01
193	000415	渤海租赁	9,100	23,205.00	0.01
194	601616	广电电气	7,900	22,989.00	0.01
195	688150	莱特光电	1,168	22,659.20	0.01
196	601918	新集能源	2,300	22,425.00	0.01
197	600236	桂冠电力	2,900	22,243.00	0.01
198	603025	大豪科技	1,600	22,112.00	0.01
199	002020	京新药业	2,100	21,987.00	0.01
200	600547	山东黄金	800	21,904.00	0.01
201	002773	康弘药业	1,000	21,650.00	0.01
202	300100	双林股份	2,000	21,540.00	0.01
203	601288	农业银行	4,900	21,364.00	0.01
204	000758	中色股份	4,200	21,336.00	0.01

205	000975	银泰黄金	1,300	21,177.00	0.01
206	300181	佐力药业	1,400	21,168.00	0.01
207	000596	古井贡酒	100	21,107.00	0.01
208	601058	赛轮轮胎	1,500	21,000.00	0.01
209	600863	内蒙华电	4,500	20,880.00	0.01
210	300451	创业慧康	6,000	20,760.00	0.01
211	600908	无锡银行	3,900	20,748.00	0.01
212	000425	徐工机械	2,900	20,735.00	0.01
213	600489	中金黄金	1,400	20,720.00	0.01
214	002106	莱宝高科	1,900	20,710.00	0.01
215	601857	中国石油	2,000	20,640.00	0.01
216	603806	福斯特	1,400	20,580.00	0.01
217	600033	福建高速	6,100	20,435.00	0.01
218	600299	安迪苏	2,100	20,370.00	0.01
219	600643	爱建集团	5,400	20,358.00	0.01
220	603358	华达科技	700	20,195.00	0.01
221	600377	宁沪高速	1,600	20,160.00	0.01
222	002028	思源电气	300	20,070.00	0.01
223	002376	新北洋	3,700	19,943.00	0.01
224	600196	复星医药	900	19,926.00	0.01
225	600282	南钢股份	4,000	19,920.00	0.01
226	603501	韦尔股份	200	19,874.00	0.01
227	688689	银河微电	906	19,234.38	0.01
228	600351	亚宝药业	3,400	19,074.00	0.01
229	300441	鲍斯股份	3,200	18,976.00	0.01
230	002558	巨人网络	2,000	18,880.00	0.01
231	002688	金河生物	5,200	18,876.00	0.01
232	601958	金钼股份	1,800	18,738.00	0.01
233	600993	马应龙	700	18,669.00	0.01
234	600426	华鲁恒升	700	18,648.00	0.01
235	601872	招商轮船	2,200	18,590.00	0.01
236	600208	新湖中宝	11,700	18,486.00	0.01
237	603408	建霖家居	1,400	18,466.00	0.01
238	600662	外服控股	4,600	18,446.00	0.01
239	300628	亿联网络	500	18,385.00	0.01
240	000417	合肥百货	4,400	18,260.00	0.01
241	600031	三一重工	1,100	18,150.00	0.01
242	601225	陕西煤业	700	18,039.00	0.01
243	688033	天宜上佳	3,000	18,000.00	0.01
244	603181	皇马科技	2,000	17,980.00	0.01
245	603618	杭电股份	4,100	17,958.00	0.01
246	300002	神州泰岳	2,200	17,864.00	0.01
247	000786	北新建材	600	17,796.00	0.01

248	000533	顺钠股份	5,400	17,766.00	0.01
249	002062	宏润建设	5,100	17,748.00	0.01
250	600332	白云山	600	17,598.00	0.01
251	601169	北京银行	3,000	17,520.00	0.01
252	600016	民生银行	4,600	17,434.00	0.01
253	301062	上海艾录	1,700	17,357.00	0.01
254	300073	当升科技	500	17,155.00	0.01
255	603701	德宏股份	1,600	16,928.00	0.01
256	000883	湖北能源	2,800	16,828.00	0.01
257	600685	中船防务	600	16,740.00	0.01
258	603328	依顿电子	2,100	16,506.00	0.01
259	300529	健帆生物	600	16,326.00	0.01
260	601975	招商南油	4,500	16,155.00	0.01
261	300679	电连技术	400	16,092.00	0.01
262	601865	福莱特	800	16,080.00	0.01
263	600830	香溢融通	2,300	16,008.00	0.01
264	601229	上海银行	2,200	15,972.00	0.01
265	600582	天地科技	2,300	15,847.00	0.01
266	002195	岩山科技	6,300	15,813.00	0.01
267	300031	宝通科技	1,100	15,807.00	0.01
268	603031	安孚科技	700	15,806.00	0.01
269	688517	金冠电气	1,125	15,727.50	0.01
270	002152	广电运通	1,500	15,690.00	0.01
271	601816	京沪高铁	2,900	15,573.00	0.01
272	601939	建设银行	2,100	15,540.00	0.01
273	600066	宇通客车	600	15,480.00	0.01
274	601012	隆基绿能	1,100	15,422.00	0.01
275	000823	超声电子	1,800	15,318.00	0.01
276	601669	中国电建	2,700	15,093.00	0.01
277	688586	江航装备	1,619	15,056.70	0.01
278	603939	益丰药房	600	14,730.00	0.01
279	300872	天阳科技	1,100	14,575.00	0.01
280	300493	润欣科技	1,800	14,562.00	0.01
281	600757	长江传媒	1,800	14,508.00	0.01
282	600160	巨化股份	600	14,478.00	0.01
283	002537	海联金汇	2,800	14,476.00	0.01
284	000983	山西焦煤	1,400	14,434.00	0.01
285	002892	科力尔	1,500	14,400.00	0.01
286	002267	陕天然气	1,900	14,364.00	0.01
287	601006	大秦铁路	2,000	14,320.00	0.01
288	300034	钢研高纳	900	14,301.00	0.01
289	603299	苏盐井神	1,500	14,250.00	0.00
290	603121	华培动力	2,000	14,240.00	0.00

291	603203	快克智能	600	14,148.00	0.00
292	603320	迪贝电气	1,000	14,140.00	0.00
293	002311	海大集团	300	14,115.00	0.00
294	601998	中信银行	2,100	14,070.00	0.00
295	001979	招商蛇口	1,600	14,064.00	0.00
296	002550	千红制药	2,600	14,014.00	0.00
297	000709	河钢股份	7,200	13,968.00	0.00
298	600269	赣粤高速	2,700	13,959.00	0.00
299	601326	秦港股份	4,400	13,948.00	0.00
300	600586	金晶科技	2,400	13,920.00	0.00
301	600027	华电国际	2,000	13,880.00	0.00
302	002237	恒邦股份	1,200	13,812.00	0.00
303	600261	阳光照明	5,100	13,770.00	0.00
304	600480	凌云股份	1,400	13,762.00	0.00
305	688678	福立旺	1,236	13,385.88	0.00
306	002093	国脉科技	2,200	13,354.00	0.00
307	600320	振华重工	3,900	13,338.00	0.00
308	601375	中原证券	3,900	13,299.00	0.00
309	688510	航亚科技	721	13,273.61	0.00
310	300522	世名科技	1,200	13,260.00	0.00
311	605016	百龙创园	650	13,240.50	0.00
312	300589	江龙船艇	1,100	13,068.00	0.00
313	600237	铜峰电子	2,500	13,050.00	0.00
314	601600	中国铝业	1,700	12,971.00	0.00
315	600558	大西洋	3,600	12,960.00	0.00
316	000973	佛塑科技	3,500	12,915.00	0.00
317	603015	弘讯科技	1,700	12,852.00	0.00
318	688513	苑东生物	254	12,773.66	0.00
319	601038	一拖股份	800	12,648.00	0.00
320	301299	卓创资讯	300	12,600.00	0.00
321	002493	荣盛石化	1,300	12,558.00	0.00
322	603009	北特科技	700	12,551.00	0.00
323	000505	京粮控股	2,300	12,512.00	0.00
324	300279	和晶科技	3,000	12,510.00	0.00
325	002498	汉缆股份	3,800	12,502.00	0.00
326	002440	闰土股份	2,300	12,489.00	0.00
327	601898	中煤能源	1,000	12,480.00	0.00
328	600882	妙可蓝多	1,000	12,470.00	0.00
329	603103	横店影视	900	12,456.00	0.00
330	300230	永利股份	3,700	12,432.00	0.00
331	603387	基蛋生物	1,600	12,416.00	0.00
332	000558	莱茵体育	5,800	12,412.00	0.00
333	688468	科美诊断	1,943	12,299.19	0.00

334	601218	吉鑫科技	4,400	12,276.00	0.00
335	002613	北玻股份	3,500	12,180.00	0.00
336	300979	华利集团	200	12,170.00	0.00
337	002228	合兴包装	5,200	12,168.00	0.00
338	603708	家家悦	1,500	12,165.00	0.00
339	000807	云铝股份	900	12,159.00	0.00
340	000927	中国铁物	5,100	12,138.00	0.00
341	300207	欣旺达	800	12,136.00	0.00
342	002441	众业达	1,600	12,128.00	0.00
343	688291	金橙子	701	12,071.22	0.00
344	002375	亚厦股份	3,700	12,025.00	0.00
345	688590	新致软件	923	11,906.70	0.00
346	002437	誉衡药业	7,000	11,900.00	0.00
347	300458	全志科技	500	11,755.00	0.00
348	002065	东华软件	2,600	11,752.00	0.00
349	600161	天坛生物	480	11,712.00	0.00
350	600096	云天化	600	11,652.00	0.00
351	603909	建发合诚	1,400	11,648.00	0.00
352	300861	美畅股份	600	11,610.00	0.00
353	600845	宝信软件	360	11,494.80	0.00
354	600864	哈投股份	2,400	11,400.00	0.00
355	600872	中炬高新	500	11,345.00	0.00
356	601555	东吴证券	1,900	11,210.00	0.00
357	000513	丽珠集团	300	11,163.00	0.00
358	600089	特变电工	800	11,096.00	0.00
359	002027	分众传媒	1,800	10,908.00	0.00
360	002707	众信旅游	1,900	10,906.00	0.00
361	300724	捷佳伟创	200	10,802.00	0.00
362	000639	西王食品	4,500	10,710.00	0.00
363	603156	养元饮品	500	10,635.00	0.00
364	002035	华帝股份	1,700	10,591.00	0.00
365	002916	深南电路	100	10,577.00	0.00
366	600325	华发股份	1,600	10,400.00	0.00
367	002129	TCL 中环	1,200	10,380.00	0.00
368	601008	连云港	3,000	10,320.00	0.00
369	000157	中联重科	1,300	9,984.00	0.00
370	600718	东软集团	1,200	9,924.00	0.00
371	002444	巨星科技	400	9,880.00	0.00
372	002519	银河电子	2,000	9,820.00	0.00
373	601881	中国银河	900	9,774.00	0.00
374	605066	天正电气	1,750	9,747.50	0.00
375	688772	珠海冠宇	651	9,699.90	0.00
376	300476	胜宏科技	300	9,678.00	0.00

377	300140	节能环保	1,600	9,552.00	0.00
378	688166	博瑞医药	272	9,520.00	0.00
379	600004	白云机场	1,000	9,480.00	0.00
380	688273	麦澜德	474	9,385.20	0.00
381	603236	移远通信	200	9,346.00	0.00
382	002412	汉森制药	1,800	9,306.00	0.00
383	000830	鲁西化工	800	9,272.00	0.00
384	002635	安洁科技	600	9,264.00	0.00
385	600018	上港集团	1,600	9,248.00	0.00
386	002429	兆驰股份	1,900	9,139.00	0.00
387	601127	赛力斯	100	9,112.00	0.00
388	002966	苏州银行	1,200	9,000.00	0.00
389	601328	交通银行	1,200	8,964.00	0.00
390	002533	金杯电工	900	8,955.00	0.00
391	002803	吉宏股份	800	8,904.00	0.00
392	300394	天孚通信	100	8,842.00	0.00
393	300144	宋城演艺	1,100	8,833.00	0.00
394	600711	盛屯矿业	2,400	8,808.00	0.00
395	600216	浙江医药	800	8,784.00	0.00
396	000027	深圳能源	1,200	8,760.00	0.00
397	600761	安徽合力	400	8,656.00	0.00
398	600901	江苏金租	1,700	8,585.00	0.00
399	002958	青农商行	3,200	8,576.00	0.00
400	688183	生益电子	439	8,507.82	0.00
401	002500	山西证券	1,800	8,460.00	0.00
402	300643	万通智控	600	8,460.00	0.00
403	002815	崇达技术	900	8,442.00	0.00
404	601801	皖新传媒	1,200	8,316.00	0.00
405	603348	文灿股份	300	8,307.00	0.00
406	600116	三峡水利	1,200	8,280.00	0.00
407	603568	伟明环保	400	8,232.00	0.00
408	600517	国网英大	1,900	8,227.00	0.00
409	601138	工业富联	300	8,220.00	0.00
410	300348	长亮科技	1,200	8,184.00	0.00
411	600150	中国船舶	200	8,142.00	0.00
412	002304	洋河股份	100	8,074.00	0.00
413	002145	中核钛白	2,400	7,872.00	0.00
414	300232	洲明科技	1,500	7,830.00	0.00
415	002241	歌尔股份	400	7,804.00	0.00
416	000541	佛山照明	1,600	7,792.00	0.00
417	002292	奥飞娱乐	1,300	7,774.00	0.00
418	601216	君正集团	2,100	7,749.00	0.00
419	600276	恒瑞医药	200	7,692.00	0.00

420	600496	精工钢构	3,000	7,680.00	0.00
421	002340	格林美	1,200	7,644.00	0.00
422	601228	广州港	2,500	7,625.00	0.00
423	601969	海南矿业	1,200	7,608.00	0.00
424	002003	伟星股份	600	7,530.00	0.00
425	300233	金城医药	500	7,460.00	0.00
426	300773	拉卡拉	600	7,458.00	0.00
427	002452	长高电新	900	7,452.00	0.00
428	601609	金田股份	1,300	7,358.00	0.00
429	002023	海特高新	800	7,320.00	0.00
430	002380	科远智慧	400	7,320.00	0.00
431	000977	浪潮信息	200	7,274.00	0.00
432	002876	三利谱	300	7,236.00	0.00
433	601369	陕鼓动力	900	7,218.00	0.00
434	000969	安泰科技	900	7,137.00	0.00
435	002651	利君股份	1,300	7,137.00	0.00
436	001213	中铁特货	1,800	7,110.00	0.00
437	003006	百亚股份	300	7,110.00	0.00
438	300432	富临精工	1,100	7,084.00	0.00
439	600458	时代新材	700	7,070.00	0.00
440	600888	新疆众和	1,000	7,070.00	0.00
441	600409	三友化工	1,400	7,028.00	0.00
442	601567	三星医疗	200	7,000.00	0.00
443	600623	华谊集团	1,200	6,936.00	0.00
444	600335	国机汽车	1,200	6,924.00	0.00
445	600158	中体产业	900	6,921.00	0.00
446	688093	世华科技	380	6,904.60	0.00
447	300409	道氏技术	800	6,848.00	0.00
448	603096	新经典	400	6,760.00	0.00
449	300790	宇瞳光学	500	6,750.00	0.00
450	603507	振江股份	200	6,564.00	0.00
451	600988	赤峰黄金	400	6,536.00	0.00
452	000636	风华高科	500	6,530.00	0.00
453	300304	云意电气	1,000	6,510.00	0.00
454	605488	福莱新材	500	6,500.00	0.00
455	301003	江苏博云	300	6,453.00	0.00
456	000921	海信家电	200	6,448.00	0.00
457	300102	乾照光电	1,000	6,420.00	0.00
458	002322	理工能科	400	6,408.00	0.00
459	002449	国星光电	900	6,408.00	0.00
460	600657	信达地产	2,100	6,405.00	0.00
461	600525	长园集团	1,500	6,390.00	0.00
462	301298	东利机械	500	6,375.00	0.00

463	601198	东兴证券	800	6,368.00	0.00
464	000968	蓝焰控股	1,000	6,360.00	0.00
465	603633	徕木股份	800	6,328.00	0.00
466	603206	嘉环科技	500	6,315.00	0.00
467	002788	鹭燕医药	800	6,304.00	0.00
468	000600	建投能源	1,000	6,300.00	0.00
469	605389	长龄液压	300	6,297.00	0.00
470	605166	聚合顺	600	6,294.00	0.00
471	300415	伊之密	300	6,234.00	0.00
472	600619	海立股份	1,200	6,204.00	0.00
473	605183	确成股份	400	6,184.00	0.00
474	002098	浔兴股份	1,100	6,182.00	0.00
475	000526	学大教育	100	6,160.00	0.00
476	301028	东亚机械	700	6,139.00	0.00
477	600790	轻纺城	1,900	6,118.00	0.00
478	002953	日丰股份	780	6,115.20	0.00
479	000551	创元科技	700	6,111.00	0.00
480	603856	东宏股份	600	6,108.00	0.00
481	002787	华源控股	900	6,084.00	0.00
482	688247	宣泰医药	739	6,074.58	0.00
483	600982	宁波能源	1,700	6,069.00	0.00
484	002948	青岛银行	1,800	6,066.00	0.00
485	600368	五洲交通	1,690	6,033.30	0.00
486	300218	安利股份	400	6,032.00	0.00
487	300691	联合光电	400	6,020.00	0.00
488	600880	博瑞传播	1,600	6,016.00	0.00
489	001914	招商积余	600	6,012.00	0.00
490	600336	澳柯玛	1,400	5,992.00	0.00
491	300011	鼎汉技术	1,200	5,988.00	0.00
492	603809	豪能股份	740	5,979.20	0.00
493	000534	万泽股份	600	5,958.00	0.00
494	000055	方大集团	1,700	5,950.00	0.00
495	600415	小商品城	800	5,936.00	0.00
496	603893	瑞芯微	100	5,917.00	0.00
497	605058	澳弘电子	300	5,904.00	0.00
498	600858	银座股份	1,500	5,895.00	0.00
499	603298	杭叉集团	300	5,892.00	0.00
500	002686	亿利达	1,400	5,866.00	0.00
501	688203	海正生材	690	5,865.00	0.00
502	601366	利群股份	1,300	5,850.00	0.00
503	603116	红蜻蜓	1,300	5,850.00	0.00
504	002017	东信和平	700	5,831.00	0.00
505	002538	司尔特	1,300	5,824.00	0.00

506	600736	苏州高新	1,400	5,824.00	0.00
507	002540	亚太科技	1,100	5,819.00	0.00
508	000570	苏常柴 A	1,300	5,811.00	0.00
509	002300	太阳电缆	1,100	5,808.00	0.00
510	603697	有友食品	1,000	5,800.00	0.00
511	688087	英科再生	224	5,797.12	0.00
512	603053	成都燃气	600	5,796.00	0.00
513	603601	再升科技	2,100	5,796.00	0.00
514	600300	维维股份	2,400	5,760.00	0.00
515	300453	三鑫医疗	900	5,751.00	0.00
516	300145	中金环境	2,300	5,750.00	0.00
517	002410	广联达	600	5,748.00	0.00
518	000688	国城矿业	600	5,712.00	0.00
519	605339	南侨食品	400	5,688.00	0.00
520	002779	中坚科技	200	5,668.00	0.00
521	000509	华塑控股	2,200	5,654.00	0.00
522	000931	中关村	1,600	5,648.00	0.00
523	000919	金陵药业	900	5,634.00	0.00
524	002479	富春环保	1,600	5,632.00	0.00
525	603811	诚意药业	900	5,625.00	0.00
526	688398	赛特新材	319	5,608.02	0.00
527	603676	卫信康	700	5,607.00	0.00
528	300071	福石控股	2,700	5,589.00	0.00
529	688480	赛恩斯	200	5,572.00	0.00
530	605333	沪光股份	200	5,570.00	0.00
531	300328	宜安科技	1,300	5,564.00	0.00
532	002132	恒星科技	2,600	5,512.00	0.00
533	001256	炜冈科技	400	5,488.00	0.00
534	601118	海南橡胶	1,200	5,460.00	0.00
535	300473	德尔股份	400	5,444.00	0.00
536	300604	长川科技	200	5,434.00	0.00
537	300953	震裕科技	100	5,420.00	0.00
538	600170	上海建工	2,500	5,375.00	0.00
539	601886	江河集团	1,100	5,368.00	0.00
540	300993	玉马遮阳	600	5,364.00	0.00
541	601689	拓普集团	100	5,361.00	0.00
542	601155	新城控股	600	5,322.00	0.00
543	002004	华邦健康	1,400	5,320.00	0.00
544	603322	超讯通信	200	5,302.00	0.00
545	605198	安德利	200	5,280.00	0.00
546	603112	华翔股份	500	5,255.00	0.00
547	002851	麦格米特	200	5,168.00	0.00
548	000633	合金投资	1,300	5,122.00	0.00

549	600383	金地集团	1,500	5,100.00	0.00
550	601566	九牧王	600	5,052.00	0.00
551	301050	雷电微力	100	4,816.00	0.00
552	000096	广聚能源	500	4,750.00	0.00
553	002697	红旗连锁	1,000	4,630.00	0.00
554	603369	今世缘	100	4,620.00	0.00
555	600968	海油发展	1,100	4,532.00	0.00
556	601016	节能风电	1,500	4,485.00	0.00
557	000920	沃顿科技	600	4,398.00	0.00
558	000733	振华科技	100	4,153.00	0.00
559	002043	兔宝宝	400	4,148.00	0.00
560	600379	宝光股份	500	4,145.00	0.00
561	688330	宏力达	200	4,078.00	0.00
562	603351	威尔药业	200	4,052.00	0.00
563	000651	格力电器	100	3,922.00	0.00
564	600596	新安股份	500	3,800.00	0.00
565	601860	紫金银行	1,500	3,750.00	0.00
566	601168	西部矿业	200	3,590.00	0.00
567	600987	航民股份	500	3,530.00	0.00
568	601808	中海油服	200	3,440.00	0.00
569	000338	潍柴动力	200	3,248.00	0.00
570	000063	中兴通讯	100	2,797.00	0.00
571	600000	浦发银行	300	2,469.00	0.00
572	300768	迪普科技	200	2,370.00	0.00
573	300059	东方财富	200	2,112.00	0.00
574	002646	天佑德酒	200	2,046.00	0.00
575	000933	神火股份	100	2,023.00	0.00
576	002011	盾安环境	100	983.00	0.00
577	603323	苏农银行	200	962.00	0.00
578	002051	中工国际	100	696.00	0.00
579	000002	万科A	100	693.00	0.00
580	002394	联发股份	100	616.00	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	002138	顺络电子	285,445.00	0.08
2	002025	航天电器	234,290.00	0.06
3	688028	沃尔德	192,477.60	0.05
4	601108	财通证券	184,006.00	0.05
5	002517	恺英网络	177,033.00	0.05
6	603688	石英股份	171,643.00	0.05

7	600900	长江电力	165,078.00	0.05
8	601390	中国中铁	156,472.00	0.04
9	300682	朗新集团	147,813.00	0.04
10	603059	倍加洁	133,083.00	0.04
11	300450	先导智能	128,013.00	0.04
12	601233	桐昆股份	126,204.00	0.03
13	603225	新凤鸣	123,822.00	0.03
14	688188	柏楚电子	118,336.12	0.03
15	600183	生益科技	115,865.00	0.03
16	300760	迈瑞医疗	115,278.00	0.03
17	600879	航天电子	111,605.00	0.03
18	000725	京东方 A	110,133.00	0.03
19	300674	宇信科技	105,410.00	0.03
20	000568	泸州老窖	104,037.00	0.03

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	600362	江西铜业	915,084.00	0.25
2	002475	立讯精密	791,523.00	0.22
3	600497	驰宏锌锗	778,380.00	0.21
4	600030	中信证券	769,694.00	0.21
5	601919	中远海控	764,548.00	0.21
6	000630	铜陵有色	692,136.00	0.19
7	600038	中直股份	619,667.00	0.17
8	600372	中航机载	600,141.00	0.16
9	601688	华泰证券	591,258.00	0.16
10	600027	华电国际	406,677.00	0.11
11	000738	航发控制	373,731.00	0.10
12	000338	潍柴动力	253,476.00	0.07
13	601108	财通证券	242,475.00	0.07
14	002738	中矿资源	240,755.80	0.07
15	600887	伊利股份	237,301.00	0.07
16	601318	中国平安	237,117.00	0.07
17	002352	顺丰控股	232,794.00	0.06
18	300447	全信股份	227,732.00	0.06
19	601857	中国石油	224,577.00	0.06
20	605358	立昂微	212,000.00	0.06

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	28,232,626.63
卖出股票收入（成交）总额	39,959,465.31

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,793,079.27	10.77
	其中：政策性金融债	30,793,079.27	10.77
4	企业债券	45,119,220.54	15.78
5	企业短期融资券	30,814,329.24	10.77
6	中期票据	57,042,762.17	19.95
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	19,659,711.34	6.87
9	其他	115,223,184.28	40.29
10	合计	298,652,286.84	104.43

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	092280108	22 中行二级资本债 02A	200,000	20,964,918.03	7.33
2	1920046	19 宁波银行二级	200,000	20,871,551.91	7.30
3	101901358	19 港兴港投 MTN003	200,000	20,806,114.75	7.28
4	102101677	21 昌吉州 MTN002	200,000	20,733,781.42	7.25
5	242400005	24 农行永续债 01	200,000	20,565,556.16	7.19

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

注：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

注：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

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

本集合计划对国债期货的投资根据风险管理原则，以套期保值为目的。结合国债交易市场和期货市场的收益性、流动性等情况，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作，获取超

额收益。

7.10.2 本期国债期货投资评价

本报告期本基金无国债期货交易。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司、江苏银行股份有限公司、中国工商银行股份有限公司、中国邮政储蓄银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局、中国人民银行、银保监会的处罚。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

除此之外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，且在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚的情形。

7.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未出现超出基金合同规定的备选股票库的情形。

7.11.3 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	4,473.36
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,473.36

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本报告期末本基金未持有可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本报告期末本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

7.11.6 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，投资组合报告中市值占净值比例的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 (%)
申万宏源 双季增享 6 个月债 券 A	90	1,153,995.36	84,225,886.08	81.10	19,633,696.16	18.90
申万宏源 双季增享 6 个月债 券 B	421	323,574.40	12,749,447.42	9.36	123,475,375.82	90.64
申万宏源 双季增享 6 个月债 券 C	44	710,695.45	4,818,348.27	15.41	26,452,251.50	84.59
合计	555	488,927.94	101,793,681.77	37.51	169,561,323.48	62.49

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	申万宏源双季增享 6 个月债券 A	0.00	0.0000
	申万宏源双季增享 6 个月债券 B	0.00	0.0000
	申万宏源双季增享 6 个月债券 C	0.00	0.0000
	合计	0.00	0.0000

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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	申万宏源双季增享 6 个月债券 A	0
	申万宏源双季增享 6 个月债券 B	0
	申万宏源双季增享 6 个月债券 C	0
	合计	0

本基金基金经理持有本 开放式基金	申万宏源双季增享 6 个月债券 A	0
	申万宏源双季增享 6 个月债券 B	0
	申万宏源双季增享 6 个月债券 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	申万宏源双季增享 6 个月债券 A	申万宏源双季增享 6 个月债券 B	申万宏源双季增享 6 个月债券 C
基金合同生效日（2022 年 10 月 13 日）基金份额总额	-	380,979,531.67	-
本报告期期初基金份额总额	139,852,798.77	158,647,785.40	52,849,303.99
本报告期基金总申购份额	7,592,247.66	-	24,512,349.69
减：本报告期基金总赎回份额	43,585,464.19	22,422,962.16	46,091,053.91
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	103,859,582.24	136,224,823.24	31,270,599.77

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本集合计划未召开份额持有人大会。

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

本报告期内，管理人高级管理人员变动情况如下：

- (1) 2024 年 1 月 2 日起，王伟同志担任总经理助理；
- (2) 2024 年 2 月 2 日，免去李琦同志总经理职务；
- (3) 2024 年 2 月 2 日起，袁锦同志担任总经理，免去副总经理职务；
- (4) 2024 年 2 月 2 日，免去唐卫江同志董事会秘书职务
- (5) 2024 年 2 月 2 日起，财务总监叶枫同志兼任董事会秘书；

(6) 2024年4月12日，免去姜山同志副经理职务；

(7) 2024年5月23日，免去吴惧同志总经理助理职务。

本报告期内，管理人董事变动情况如下：

(1) 2024年01月19日起，袁锦同志担任董事；

(2) 2024年2月2日起，李琦同志担任董事长；

(3) 2024年04月19日起，王胜同志担任董事，周海晨同志不再担任董事职务。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本集合计划本报告期投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未发生改聘会计师事务所事宜。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：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。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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 (%)	
申万宏源证券有限公司	2	68,192,091.94	100.00	19,226.97	100.00	-

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

门的研究报告；5、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。本报告期内本基金租用券商交易单元无变更。

10.7.2 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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
申万宏源证券有限公司	10,503.20	100.00	690,924,000.00	100.00	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	申万宏源证券资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会规定披露媒介	2024年1月3日
2	申万宏源双季增享6个月持有期债券型集合资产管理计划新增销售机构的公告	中国证监会规定披露媒介	2024年1月4日
3	申万宏源证券资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会规定披露媒介	2024年2月2日
4	申万宏源双季增享6个月持有期债券型集合资产管理计划自有资金置换公告	中国证监会规定披露媒介	2024年3月11日
5	申万宏源双季增享6个月持有期债券型集合资产管理计划自有资金参与与结果公告	中国证监会规定披露媒介	2024年3月15日
6	申万宏源证券资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会规定披露媒介	2024年4月12日
7	申万宏源证券资产管理有限公司关于董事变更的公告	中国证监会规定披露媒介	2024年4月23日
8	申万宏源证券资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会规定披露媒介	2024年5月23日
9	申万宏源证券资产管理有限公司住所变更公告	中国证监会规定披露媒介	2024年5月23日
10	申万宏源双季增享6个月持有期债券型集合资产管理计划(A类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会规定披露媒介	2024年5月31日
11	申万宏源双季增享6个月持有期债券型集合资产管理计划(B类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会规定披露媒介	2024年5月31日

12	申万宏源双季增享 6 个月持有期债券型集合资产管理计划（C 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定披露媒介	2024 年 5 月 31 日
----	----------------------------------------------	-------------	-----------------

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，未发现影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、《申万宏源双季增享 6 个月持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》；
- 2、《申万宏源双季增享 6 个月持有期债券型集合资产管理计划托管协议》；
- 3、《申万宏源双季增享 6 个月持有期债券型集合资产管理计划招募说明书》；
- 4、《申万宏源双季增享 6 个月持有期债券型集合资产管理计划基金产品资料概要》；
- 5、管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内披露的各项公告。

12.2 存放地点

上海市徐汇区长乐路 989 号 40 层

12.3 查阅方式

投资者可到管理人、托管人的办公场所或管理人网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：95523

公司网址：www.swhyzcgl.com

申万宏源证券资产管理有限公司

2024 年 8 月 30 日