

申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资
产管理计划
2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：申万宏源证券有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 08 月 30 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 2021-01-19（基金合同生效日）起至 2021-06-30 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.....	6
2.4 基金投资顾问.....	6
2.5 信息披露方式.....	6
2.6 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
3.3 其他指标.....	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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.....	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
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.....	12
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.....	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
§ 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.....	46

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	47
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.....	47
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.....	47
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.....	48
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.....	48
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	48
7.12 本报告期末各资产单元的净值及占基金资产净值的比例.....	49
7.13 投资组合报告附注.....	49
§ 8 基金份额持有人信息.....	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	50
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.....	50
§ 9 开放式基金份额变动.....	50
§ 10 重大事件揭示.....	51
10.1 基金份额持有人大会决议.....	51
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.....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
10.4 基金投资策略的改变.....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	51
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.....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
10.8 其他重大事件.....	52
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	52
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.....	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	53
§ 12 备查文件目录.....	53
12.1 备查文件目录.....	53
12.2 存放地点.....	53
12.3 查阅方式.....	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划
基金简称	申万宏源红利成长
场内简称	-
基金主代码	970015
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 1 月 19 日
基金管理人	申万宏源证券有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	167,658,814.69 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，但在此期间如同时满足以下条件的，则本集合计划在变更为公募基金后存续期限为不定期，而无需召开集合计划份额持有人大会： 1、获得公募基金管理资格或者以独资或者控股方式成立具有独立法人资格的从事资产管理业务的公司并将本集合计划合同中管理人的全部权利和义务转让给前述从事资产管理业务的公司； 2、在法律法规规定、集合计划合同约定的范围内，对集合计划份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，根据监管机构的要求将本集合计划变更注册为相应的公募基金。

注：本公告所述的“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红利成长灵活配置混合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	本集合计划通过把握中国经济增长所带来投资机会，重点投资于高增长、低估值、具备较好分红能力的上市公司，力争实现集合计划资产的长期稳定增值。
投资策略	本集合计划根据各项重要的经济指标分析宏观经济发展变动趋势，判断当前所处的经济周期，进而对未来做出科学预测。在此基础上，结合对流动性及资金流向的分析，综合股市和债市估值及风险分析进行资产配置。 本集合计划主要投资于中国 A 股市场上高增长高分红能力的上市公司。在个股选择上，本集合计划将采用定量和定性分析相结合的系统方法精选受益于分红能力强、成长性较高且估值合理的股票构建股票组合。

	本集合计划的投资策略还包括债券投资策略、资产支持证券投资策 略、股指期货投资策略、融资投资策略、现金类资产投资策略等。
业绩比较基准	60%×沪深 300 指数+40%×上证国债指数
风险收益特征	本集合计划为混合型集合资产管理计划，其预期收益及预期风险水 平低于股票型基金、股票型集合资产管理计划，高于债券型基金、 债券型集合资产管理计划、货币市场基金及现金管理类集合资产管 理计划。

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		申万宏源证券有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨玉成	李申
	联系电话	021-33389888	021-60637102
	电子邮箱	yangyucheng@swyhsc.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		95523	021-60637111
传真		-	021-60635778
注册地址		上海市徐汇区长乐路 989 号世纪 商贸广场 45 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		上海市徐汇区长乐路 989 号世纪 商贸广场 45 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200031	100033
法定代表人		杨玉成	田国立

2.4 基金投资顾问

序号	投资顾问名称	是否与基金管理 人存在关联关系	是否与其他投资顾问存在关联关 系
-	-	-	-

2.5 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.swyhsc.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

2.6 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(2021 年 1 月 19 日(基金合同生效日) - 2021 年 6 月 30
---------------	--

	日)
本期已实现收益	6,135,766.34
本期利润	5,362,464.33
加权平均基金份额本期利润	0.0406
本期加权平均净值利润率	3.92%
本期基金份额净值增长率	-1.25%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	11,749,149.94
期末可供分配基金份额利润	0.0701
期末基金资产净值	179,407,964.63
期末基金份额净值	1.0701
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-1.25%

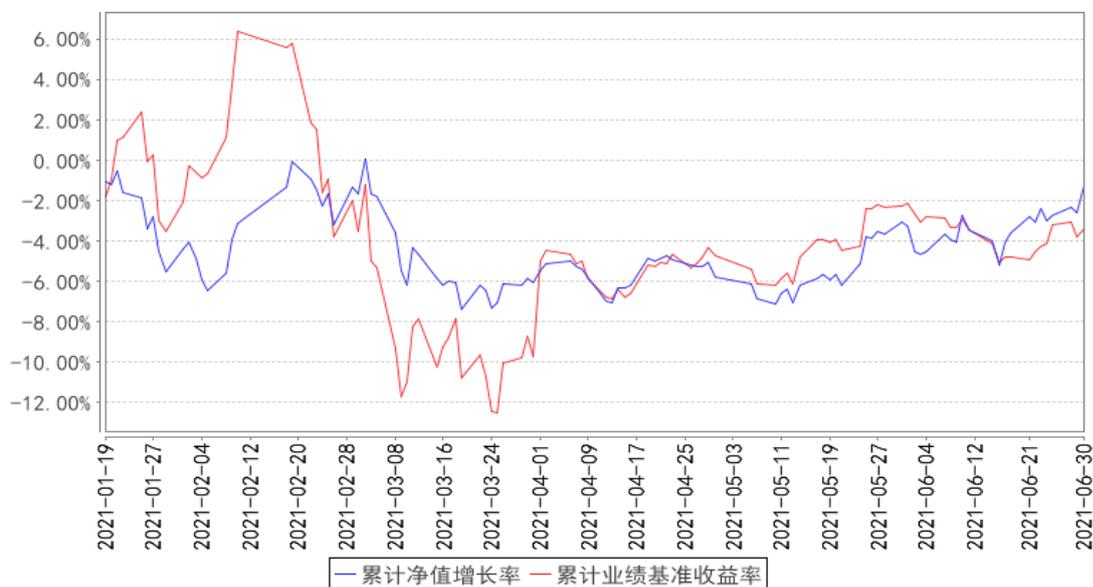
3.2 基金净值表现

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

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	1.82%	0.79%	-1.15%	0.49%	2.97%	0.30%
过去三个月	5.08%	0.65%	2.49%	0.59%	2.59%	0.06%
自基金合同生效起至今	-1.25%	0.88%	-2.48%	0.78%	1.23%	0.10%

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

申万宏源红利成长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：1、本基金业绩比较基准收益率=60%×沪深 300 指数+40%×上证国债指数；

2、本基金合同自 2021 年 1 月 19 日起生效，管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定，目前基金的投资组合比例已符合基金合同的有关约定。

3.3 其他指标

单位：人民币元

其他指标	报告期（2021 年 1 月 19 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日）
-	-
其他指标	报告期末（2021 年 6 月 30 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

申万宏源证券有限公司（以下简称“申万宏源”或“公司”），是由新中国第一家股份制证券公司——申银万国证券股份有限公司与国内资本市场第一家上市证券公司——宏源证券股份有限公司，于 2015 年 1 月 16 日合并组建而成。公司注册资本 520 亿元，拥有员工近 10000 名，是国家主权财富基金——中国投资有限责任公司的直管企业。公司营业网点遍布全国，实现了 32 个省市自治区全覆盖，共设有 41 家证券分公司和 2 家期货分公司、308 家证券营业部和 21 个期货营

业网点，在香港设有子公司，并设有伦敦、东京、新加坡、首尔等海外分支机构。

申万宏源证券有限公司目前拥有全面的证券类业务资格，主要包括：许可项目：证券业务；证券投资咨询；证券投资基金销售服务；证券投资基金托管。（依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动，具体经营项目以相关部门批准文件或许可证件为准）一般项目：证券公司为期货公司提供中间介绍业务。（除依法须经批准的项目外，凭营业执照依法自主开展经营活动）。

截至 2021 年 6 月 30 日，集合资产管理计划管理人共管理 2 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。

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		
陈旻	本基金的基金经理	2019 年 4 月 15 日	-	16 年	权益公募投资决策小组成员，国籍为中国，工商管理硕士，经济师职称。曾任申银万国证券股份有限公司证券投资总部投资经理、客户资产管理总部定向理财投资部投资经理、“申万 1 号”和“宝鼎一期”投资主办助理、“申万 3 号”投资主办以及“宝鼎优选定增系列”“宝鼎稳盈系列”“宝鼎系列”等产品投资主办，现为本集合计划投资经理。现任申万宏源证券资产管理事业部高级投资经理，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：S0900812110010，并已取得基金从业资格，证书编号为：F4530000002658，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	2019 年 4 月 15 日	-	12 年	权益投资决策委员会委员、权益公募投资决策小组组长，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，从事通信、电子、计算机、传媒等行业研究工作。2013 年 6 月加入原宏源证券北京资管分公司权益投资部，先后历任宏源证券宏源 10 号股债双鑫集合资产管理计划、宏源证券股债双丰集合资产管理计划投资主办人，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：S1180814050001，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。
--	--	--	--	--	--

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。

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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
秦庆	公募基金	1	179,407,964.63	2019年04月15日
	私募资产管理计划	-	-	-
	其他组合	-	-	-
	合计	1	179,407,964.63	-

注：本基金基金经理秦庆在报告期内曾管理一只混合类产品宏源证券宏源 5 号优选成长集合资产管理计划，该集合计划已于 2021 年 4 月 12 日终止。

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《申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》、《申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划招募说明书》等有关本集合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

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，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动和环节得到公平对待，各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易，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，本基金交易执行环节未发现存在异常交易的行为。

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

2021 年上半年，A 股市场小幅上涨，上证指数涨 3.40%，沪深 300 涨 0.24%，中证 500 涨 6.93%。

上半年，宏观经济保持稳中向好态势，通胀数据有所抬头，货币政策总量稳健。股票市场在整体上涨的环境下，中小盘股相对大盘股的超额收益明显。行业层面上，电气设备、钢铁、化工、采掘、有色等行业表现较好，而家电、非银金融、军工等行业表现相对落后。

报告期内，本产品处于建仓期，我们重点买入了长期看好的智能科技行业中核心企业，也适度配置了目前景气程度较高的新能源、半导体等行业细分领域性价比较高的个股。

在操作上，本基金主要通过精选具有核心竞争力、成长性较高且价值低估的优质公司，赚取这批公司中长期业绩增长的收益，并依靠这些公司出色且持续的成长能力来抵御经济和行业的不确定性，力争使产品获得超越基准的长期回报。在上述总体原则的基础上，我们会根据行业基本面景气指标比较系统和公司竞争优势比较系统来进行适度的动态优化，提高组合内资金使用效率。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末，本基金份额净值为 1.0701 元；本报告期基金份额净值增长率为-1.25%，同期业绩比较基准收益率为-2.48%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年的宏观环境，我们认为国内经济虽有一定的回落风险但整体可控，考虑全球通胀水平处于近年来的高位且国内核心 CPI 等关键通胀指标下半年存有上行趋势，预计央行将维持稳健的货币政策，以结构性宽松为主。在此大环境下，我们认为场内流动性整体在边际上难以大的改善，但快速回落的概率也较低。结合宏观经济和通胀所处的阶段，预计下半年国内权益类市场将在一个更宽幅的区间内震荡，结构性机会应较为显著。

目前时点展望未来，基于以下三点理由，我们相对更为看好以 AI 技术为代表的智能科技板块的投资机会。首先国内经济转型的方向带来了该板块的长期需求，相关产业近年来一直是结构性政策着力支持的重要方向之一，这一点在未来相当长的时间内很难发生变化，依据我们对该板块

中观和微观的调研分析，未来 3-5 年智能科技核心和配套产业将保持较为快速的增长；其次，该板块偏宏观经济后周期受益，相关公司的中期基本面趋势展望良好；最后，目前该板块整体的估值水平位于历史中位数，动态估值与其长期成长性匹配度较好，相比其他热门赛道，投资该板块有望在中长期获取其更为完整的成长性收益。

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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

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、本基金自 2021 年 01 月 19 日（基金合同生效日）起至 2021 年 06 月 30 日止，基金资产净值未出现连续低于五千万元。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在托管本基金的过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§ 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：申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	11,511,944.37
结算备付金		6,082,442.99
存出保证金		43,314.98
交易性金融资产	6.4.7.2	132,898,287.00
其中：股票投资		132,898,287.00
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	32,600,000.00
应收证券清算款		6,415,528.41
应收利息	6.4.7.5	10,461.38
应收股利		-
应收申购款		470,614.18
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		190,032,593.31
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		5,217,561.62
应付赎回款		1,179,798.15
应付管理人报酬		191,952.02
应付托管费		23,994.00
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	142,112.38
应交税费		3,856,038.99
应付利息		-

应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	13,171.52
负债合计		10,624,628.68
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	167,658,814.69
未分配利润	6.4.7.10	11,749,149.94
所有者权益合计		179,407,964.63
负债和所有者权益总计		190,032,593.31

注：本基金合同生效日为 2021 年 01 月 19 日，本报告期自基金合同生效日 2021 年 01 月 19 日起至 2021 年 06 月 30 日止。本基金为本报告期内基金合同生效的基金，无上年度末对比数据。报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0701 元，基金份额总额 167,658,814.69 份。

6.2 利润表

会计主体：申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划

本报告期：2021 年 1 月 19 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 1 月 19 日（基金合同 生效日）至 2021 年 6 月 30 日
一、收入		6,869,059.32
1. 利息收入		372,503.41
其中：存款利息收入	6.4.7.11	77,144.18
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		295,359.23
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		6,397,726.26
其中：股票投资收益	6.4.7.12	5,324,404.39
基金投资收益	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	1,073,321.87
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-773,302.01
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	872,131.66

减：二、费用		1,506,594.99
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	732,349.82
2. 托管费	6.4.10.2.2	91,543.72
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.19	651,535.19
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		20,231.17
7. 其他费用	6.4.7.20	10,935.09
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		5,362,464.33
减：所得税费用		-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		5,362,464.33

注：本基金合同生效日为 2021 年 01 月 19 日，本报告期自基金合同生效日 2021 年 01 月 19 日起至 2021 年 06 月 30 日止。本基金为本报告期内基金合同生效的基金，无上年度末对比数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划

本报告期：2021 年 1 月 19 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 19 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	66,700,266.22	5,585,535.18	72,285,801.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,362,464.33	5,362,464.33
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	100,958,548.47	801,150.43	101,759,698.90
其中：1. 基金申购款	242,965,575.10	5,929,212.17	248,894,787.27
2. 基金赎回款	-142,007,026.63	-5,128,061.74	-147,135,088.37
四、本期向基金份额持有人分配利润产生	-	-	-

的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	167,658,814.69	11,749,149.94	179,407,964.63

注：本基金合同生效日为 2021 年 01 月 19 日，本报告期自基金合同生效日 2021 年 01 月 19 日起至 2021 年 06 月 30 日止。本基金为本报告期内基金合同生效的基金，无上年度末对比数据。

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：

<u>杨玉成</u>	<u>方荣义</u>	<u>王慧晶</u>
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

申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）于 2020 年 8 月 31 日经中国证监会《关于准予宏源证券宏源 3 号红利成长集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函【2020】2384 号）批准，《申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》于 2021 年 1 月 19 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有限公司，托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《申万宏源红利成长灵活配置混合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，包括境内依法发行的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票，不包含港股）、债券（含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券等）、货币市场工具、同业存单、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许集合计划投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本集合计划可以参与融资交易；不可以参与融券交易，不得将其持有的股票作为融券标的证券出借给证券金融公司，但法律法规另有规定的除外。

法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种的，管理人在履行合同变更程序后，可以将其纳入本集合计划的投资范围。

本集合计划的投资组合比例为：股票资产占集合计划资产的比例为 0%—95%（投资于境内依

法发行上市的股票占集合计划资产的 0%-95%); 投资同业存单不超过集合计划资产的 20%; 每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后, 集合计划保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于集合计划资产净值的 5%, 其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如因证券/期货市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等证券公司之外的因素, 造成集合计划投资比例超标, 管理人应在 10 个交易日内将投资比例降至许可范围内。

本集合计划的业绩比较基准为 $60\% \times$ 沪深 300 指数 $+40\% \times$ 上证国债指数。

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>》和中国证监会、中国基金业协会允许的如财务报表附注 7.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

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 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1、金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为: 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融

资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

2、金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债包括交易性金融负债及衍生金融负债等。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利、债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债按照公允价值进行后续计量，应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

1、存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

2、当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

3、如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。对于曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

境内基金投资在持有期间应取得的现金红利于除息日确认为投资收益；境外基金投资在持有期间应取得的基金分红收益扣除基金交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。境内股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益；境外股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。境内债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。境外债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在交易所在地适用的预缴所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价

值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红权益再投资日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 外币交易

本基金本报告期无外币交易。

6.4.4.13 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。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

1、对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

2、对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》进行估值。

3、对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资

基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场交易的固定收益品种，按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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

本基金本报告期无会计政策变更。

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

目前国家有关资产管理计划的税收法规中，仅有财政部、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]140号)、《关于资管产品增值税有关问题的通知》(财税[2017]56号)及《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》(财税[2017]90号)对增值税做出相关规定。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，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。实践中，除增值税外资产管理计划通常比照证券投资基金的相关税务法规及其他相关税务法规计提和缴纳税款，若遇政策法规调整，相关的税务问题将按照调整后的政策法规执行。主要税项列示如下：

(1) 增值税

根据财税[2016]140号文件的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。

根据财税[2017]56号文件的规定，自 2018 年 1 月 1 日(含)起，资管产品管理人(以下称管理人)运营资管产品过程中发生的增值税应税行为(以下称资管产品运营业务)，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

根据财税[2017]90号文件的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提

供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：（一）提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；（二）转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

本基金增值税的附加税费，包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等，按照实际缴纳增值税税额的适用比例计算，由管理人申报缴纳。

（2）印花税

比照《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》财税字[1998]55 号)和《财政部、国家税务总局关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》(财税[2002]128 号)文件的规定，基金管理人运用资产管理计划买卖股票卖出股票按 1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	11,511,944.37
定期存款	-
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	-
合计	11,511,944.37

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	128,210,615.16	132,898,287.00	4,687,671.84
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	-	-	-

	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
	合计	128,210,615.16	132,898,287.00	4,687,671.84

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
其中：国债期货投资	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
其中：远期外汇投资	-	-	-	
权益衍生工具	-	-	-	
其中：股指期货投资	-	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	-	-	-	

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 2021年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	32,600,000.00	-
银行间市场	-	-
-	-	-
合计	32,600,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日

	债券代码	债券名称	约定 返售日	估值单价	数量 (张)	估值 总额	其中：已出售 或再质押总额
-	-	-	-	-	-	-	-
合计					-	-	-

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	2,311.85
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	2,737.10
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	5,392.93
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	19.50
合计	10,461.38

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
其他应收款	-
待摊费用	-
-	-
合计	-

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	142,112.38
银行间市场应付交易费用	-
-	-
合计	142,112.38

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,195.88

应付证券出借违约金	-
预提费用	10,975.64
合计	13,171.52

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月19日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	66,700,266.22	66,700,266.22
本期申购	242,965,575.10	242,965,575.10
本期赎回（以“-”号填列）	-142,007,026.63	-142,007,026.63
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	167,658,814.69	167,658,814.69

注：本基金合同生效日为2021年01月19日，本报告期自基金合同生效日2021年01月19日起至2021年06月30日止。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	27,187,723.33	-21,602,188.15	5,585,535.18
本期利润	6,135,766.34	-773,302.01	5,362,464.33
本期基金份额交易产生的变动数	44,087,983.33	-43,286,832.90	801,150.43
其中：基金申购款	108,386,397.59	-102,457,185.42	5,929,212.17
基金赎回款	-64,298,414.26	59,170,352.52	-5,128,061.74
本期已分配利润	-	-	-
本期末	77,411,473.00	-65,662,323.06	11,749,149.94

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月19日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
	活期存款利息收入	60,349.64
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	16,615.43	
其他	179.11	
合计	77,144.18	

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月19日（基金合同生效日）至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	5,324,404.39
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	5,324,404.39

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月19日（基金合同生效日）至2021年6月30日
卖出股票成交总额	140,357,957.81
减：卖出股票成本总额	135,033,553.42
买卖股票差价收入	5,324,404.39

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月19日（基金合同生效日）至2021年6月30日
出借证券现金清偿总额	-
减：出借证券成本总额	-
减：应收证券出借利息	-
证券出借差价收入	-

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月19日（基金合同生效日）至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-

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	-

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月19日（基金合同生效日）至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	-
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	-
减：应收利息总额	-
买卖债券差价收入	-

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月19日（基金合同生效日）至2021年6月30日
赎回基金份额对价总额	-
减：现金支付赎回款总额	-
减：赎回债券成本总额	-
减：赎回债券应收利息总额	-
赎回差价收入	-

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月19日（基金合同生效日）至2021年6月30日
申购基金份额对价总额	-
减：现金支付申购款总额	-
减：申购债券成本总额	-
减：申购债券应收利息总额	-
-	-
申购差价收入	-

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月19日（基金合同生效日）至2021年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	-
减：卖出资产支持证券成本总额	-
减：应收利息总额	-
资产支持证券投资收益	-

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月19日（基金合同生效日）至2021年6月30日
贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入	-
贵金属投资收益——赎回差价收入	-
贵金属投资收益——申购差价收入	-
合计	-

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月19日（基金合同生效日）至2021年6月30日
卖出贵金属成交总额	-
减：卖出贵金属成本总额	-
减：买卖贵金属差价收入应缴纳增值税额	-
买卖贵金属差价收入	-

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月19日（基金合同生效日）至2021年6月30日
赎回贵金属份额对价总额	-
减：现金支付赎回款总额	-
减：赎回贵金属成本总额	-
赎回差价收入	-

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021 年 1 月 19 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
申购贵金属份额总额	-
减：现金支付申购款总额	-
减：申购贵金属成本总额	-
-	-
申购差价收入	-

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 19 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
卖出权证成交总额	-
减：卖出权证成本总额	-
减：买卖权证差价收入应缴纳 增值税额	-
买卖权证差价收入	-

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2021 年 1 月 19 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
-	-

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 19 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,073,321.87
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	1,073,321.87

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021 年 1 月 19 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-773,302.01
股票投资	-773,302.01
债券投资	-
资产支持证券投资	-

基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
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	-773,302.01

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月19日（基金合同生效日）至2021年6月30日
基金赎回费收入	872,131.66
-	-
合计	872,131.66

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月19日（基金合同生效日）至2021年6月30日
交易所市场交易费用	651,535.19
银行间市场交易费用	-
-	-
合计	651,535.19

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月19日（基金合同生效日）至2021年6月30日
审计费用	2,679.72
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行费用	6,655.37
其他	1,600.00
合计	10,935.09

6.4.7.21 分部报告

-

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，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

新型冠状病毒感染的肺炎疫情于 2020 年初爆发以来，相关防控工作在持续进行。新冠肺炎疫情对全球和国内整体经济运行和企业经营造成一定影响，并在一定程度上影响到资本市场和证券市场，进而可能在短期内影响本基金资产质量或收益水平。本基金将继续密切关注肺炎疫情发展情况和各项调控政策，评估和积极应对新冠肺炎疫情对本基金财务状况、经营成果等方面的影响。

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

本报告期不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。

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
申万宏源证券有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
申万宏源西部子公司	基金管理人子公司、基金代销机构

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 2021 年 1 月 19 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日	
	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	352,530,321.37	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 2021 年 1 月 19 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例（%）
-	-	-

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 2021年1月19日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
	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	2,444,900,000.00	100.00

6.4.10.1.4 权证交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月19日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
	成交金额	占当期权证 成交总额的比例（%）
-	-	-

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 2021年1月19日（基金合同生效日）至2021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	479,902.68	100.00	142112.38	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 2021年1月19日（基金合同生效日）至2021年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费
其中：支付销售机构的客户维护费	-

注：本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的1.2%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.2\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的集合计划管理费

E为前一日的集合计划资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021 年 1 月 19 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	91,543.72

注：本集合计划的托管费按前一日集合计划资产净值的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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

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 2021 年 1 月 19 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费 申万宏源红利成长
-	-
合计	-

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

单位：人民币元

本期 2021 年 1 月 19 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-

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

单位：人民币元

本期 2021 年 1 月 19 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借 业务余额	期末应收利息余额
-	-	-	-	-

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

单位：人民币元

本期
-

2021 年 1 月 19 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量(单位: 张)	出借期限(单位: 天)	费率	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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 2021 年 1 月 19 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日	
	基金合同生效日（2021 年 1 月 19 日）持有的基金份额	
报告期初持有的基金份额		-
报告期间申购/买入总份额		-
报告期间因拆分变动份额		-
减：报告期间赎回/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		-

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

关联方名称	本期末 2021 年 6 月 30 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）
-	-	-

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 2021 年 1 月 19 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	11,511,944.37	60,349.64

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期

2021 年 1 月 19 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 张）	总金额
-	-	-	-	-	-

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

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		每 10 份 基金份额 分红数	现金形 式 发放总 额	再投资 形式 发放总 额	本期利 润分配 合计	备注
		场内	场外					
-	-	-	-	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-	-	-	-

6.4.12 期末(2021 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流通 日	流通受限 类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 (单 位：股)	期末 成本总额	期末估值 总额	备注
301007	德迈仕	2021 年 6 月 4 日	2021 年 12 月 16 日	新股锁 定	5.29	19.12	147	777.63	2,810.64	-
301010	晶雪节 能	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 20 日	新股锁 定	7.83	22.62	100	783.00	2,262.00	-
301013	利和兴	2021 年 6 月 21 日	2021 年 12 月 29 日	新股锁 定	8.72	35.33	210	1,831.20	7,419.30	-
301015	百洋医 药	2021 年 6 月 22 日	2021 年 12 月 30 日	新股锁 定	7.64	54.81	199	1,520.36	10,907.19	-
301016	雷尔伟	2021 年 6 月 23 日	2021 年 12 月 30 日	新股锁 定	13.75	41.07	108	1,485.00	4,435.56	-
301017	漱玉平 民	2021 年 6 月 23 日	2021 年 7 月 5 日	新股流 通受限	8.86	8.86	3,654	32,374.44	32,374.44	-
301018	申菱环 境	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 7 日	新股流 通受限	8.29	8.29	2,672	22,150.88	22,150.88	-

		日	日							
301021	英诺激 光	2021 年 6 月 28 日	2021 年 07 月 06 日	新股流 通受限	9.46	9.46	1,258	11,900.68	11,900.68	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流通 日	流通受限 类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 (单 位：张)	期末 成本总额	期末估值 总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

6.4.12.1.3 受限证券类别：资产支持证券

证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流通 日	流通受限 类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 (单 位：张)	期末 成本总额	期末估值 总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

6.4.12.1.4 受限证券类别：权证

证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流通 日	流通受限 类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 (单 位：份)	期末 成本总额	期末估值 总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票 代码	股票名 称	停牌日 期	停牌原 因	期末 估值单价	复牌日 期	复牌 开盘单价	数量 (股)	期末 成本总额	期末 估值总 额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

-

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
-	-	-	-	-	-
合计					-

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

-

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量(单位:股)	期末估值总额
-	-	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-	-

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

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括市场风险、流动性风险及信用风险。本基金管理人制定了相应的政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了由风险管理总部、审计总部、法律合规总部组成的风险控制职能部门，独立开展对业务和相关操作的风险评价。风险管理总部、审计总部、法律合规总部等互相配合，建立信息沟通机制，从事前、事中、事后全面进行业务风险监控。此外，业务部门也建立了自身的内部控制机制，主要由授权体系和业务后台部门信息监控机制组成。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，在银行间同业市场交易前对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

于 2021 年 06 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券投资。

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 2021年6月30日
A-1	-
A-1 以下	-
-	-
未评级	-
合计	-

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日
A-1	-
A-1 以下	-
-	-
未评级	-
合计	-

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日
A-1	-
A-1 以下	-
-	-
未评级	-
合计	-

6.4.13.2.4 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 2021 年 6 月 30 日
AAA	-
AAA 以下	-
-	-
未评级	-
合计	-

6.4.13.2.5 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 2021 年 6 月 30 日
AAA	-
AAA 以下	-
-	-
未评级	-
合计	-

6.4.13.2.6 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
--------	-----

	2021 年 6 月 30 日
AAA	-
AAA 以下	-
-	-
未评级	-
合计	-

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是在市场或持有资产流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。流动性风险一般存在两种形式：资产变现风险和现金流风险。

(1) 资产变现风险

资产变现风险是指由于基金持有的某个券种的头寸相对于市场正常的交易量过大，或由于停牌造成交易无法在当前的市场价格下成交。本基金管理人应用定量方法对各持仓品种的变现能力进行测算和分析，以对资产变现风险进行管理。

(2) 现金流风险

现金流风险是指基金因现金流不足导致无法应对正常基金支付义务的风险。本基金管理人对基金每日和每周净赎回比例进行测算和分析，以对该风险进行跟踪和管理。此外，本基金管理人建立了现金头寸控制机制，以确保赎回款项的及时支付。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

单位：人民币元

本期末 2021 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
资产				
-	-	-	-	-
资产总计	-	-	-	-
负债				
-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	-
流动性净额	-	-	-	-

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

在日常运作中，本基金的流动性安排能够与基金合同约定的申购赎回安排以及投资者的申购赎回规律相匹配。

在资产端，本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具。基金管理人持续

监测本基金持有资产的市场交易量、交易集中度等涉及资产流动性水平的风险指标，并定期开展压力测试，详细评估在不同的压力情景下资产变现情况的变化。

在负债端，基金管理人持续监测本基金开放期内投资者历史申购、投资者类型和结构变化等数据，审慎评估不同市场环境可能带来的投资者潜在赎回需求，当市场环境或投资者结构发生变化时，及时调整组合资产结构及比例，预留充足现金头寸，保持基金资产可变现规模和期限与负债赎回规模和期限的匹配。

如遭遇极端市场情形或投资者非预期巨额赎回情形，基金管理人将采用本基金合同约定的赎回申请处理方式及其他各类流动性风险管理工具，控制极端情况下的潜在流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金、存出保证金和买入返售金融资产等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021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	11,511,944.37	-	-	-	11,511,944.37
结算备付金	6,082,442.99	-	-	-	6,082,442.99
存出保证金	43,314.98	-	-	-	43,314.98
交易性金融资产	-	-	-	132,898,287.00	132,898,287.00
买入返售金融资产	32,600,000.00	-	-	-	32,600,000.00
应收利息	-	-	-	10,461.38	10,461.38
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	470,614.18	470,614.18
应收证券清算款	-	-	-	6,415,528.41	6,415,528.41

其他资产	-	-	-	-
资产总计	50,237,702.34	-	139,794,890.97	190,032,593.31
负债				
应付赎回款	-	-	1,179,798.15	1,179,798.15
应付管理人报酬	-	-	191,952.02	191,952.02
应付托管费	-	-	23,994.00	23,994.00
应付证券清算款	-	-	5,217,561.62	5,217,561.62
卖出回购金融资产款	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	142,112.38	142,112.38
应付利息	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-
应交税费	-	-	3,856,038.99	3,856,038.99
其他负债	-	-	13,171.52	13,171.52
负债总计	-	-	10,624,628.68	10,624,628.68
利率敏感度缺口	50,237,702.34	-	129,170,262.29	179,407,964.63

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	-	
	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（2021年6月30日）
分析	-	-

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。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-

交易性金融资产	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-
其它资产	-	-	-	-
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净额	-	-	-	-

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	-	
	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（2021年6月30日）
分析	-	-

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 2021年6月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	132,898,287.00	74.08
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-
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	132,898,287.00	74.08

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	-	
	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（2021年6月30日）
分析	-	-

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

假设	-	
	-	
	-	
分析	风险价值 （单位：人民币元）	本期末（2021年6月30日）
	-	-

	合计	-
--	----	---

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

-

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	132,898,287.00	69.93
	其中：股票	132,898,287.00	69.93
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	32,600,000.00	17.15
	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	17,594,387.36	9.26
-	-	-	-
8	其他各项资产	6,939,918.95	3.65
9	合计	190,032,593.31	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	-	-
B	采矿业	705,358.00	0.39
C	制造业	65,173,500.05	36.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	344,000.00	0.19
E	建筑业	560,000.00	0.31
F	批发和零售业	918,285.63	0.51
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	59,194,562.80	32.99
J	金融业	-	-

K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,503,831.52	1.95
M	科学研究和技术服务业	1,715,571.00	0.96
N	水利、环境和公共设施管理业	783,178.00	0.44
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	132,898,287.00	74.08

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
-	-	-
合计	-	-

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	002415	海康威视	163,500	10,545,750.00	5.88
2	300253	卫宁健康	632,500	10,290,775.00	5.74
3	002439	启明星辰	347,000	10,066,470.00	5.61
4	603678	火炬电子	108,700	7,337,250.00	4.09
5	002230	科大讯飞	105,300	7,116,174.00	3.97
6	000977	浪潮信息	251,700	7,080,321.00	3.95
7	300379	东方通	214,400	6,108,256.00	3.40
8	300348	长亮科技	236,700	4,331,610.00	2.41
9	600570	恒生电子	46,100	4,298,825.00	2.40
10	300451	创业慧康	449,620	3,974,640.80	2.22
11	300226	上海钢联	54,200	3,227,610.00	1.80
12	002236	大华股份	143,000	3,017,300.00	1.68
13	002008	大族激光	74,500	3,009,055.00	1.68
14	603186	华正新材	79,000	2,880,340.00	1.61
15	300166	东方国信	179,700	2,221,092.00	1.24
16	002859	洁美科技	66,500	2,079,455.00	1.16
17	002436	兴森科技	173,000	1,903,000.00	1.06
18	002475	立讯精密	41,000	1,886,000.00	1.05
19	688388	嘉元科技	20,000	1,819,200.00	1.01
20	300058	蓝色光标	300,000	1,815,000.00	1.01
21	002555	三七互娱	74,000	1,777,480.00	0.99
22	603859	能科股份	47,300	1,715,571.00	0.96
23	002027	分众传媒	179,472	1,688,831.52	0.94

24	300073	当升科技	29,000	1,629,510.00	0.91
25	002937	兴瑞科技	114,200	1,619,356.00	0.90
26	000725	京东方 A	250,000	1,560,000.00	0.87
27	603019	中科曙光	56,000	1,546,160.00	0.86
28	300502	新易盛	45,000	1,406,250.00	0.78
29	002929	润建股份	54,200	1,388,604.00	0.77
30	600845	宝信软件	25,740	1,310,166.00	0.73
31	002129	中环股份	33,000	1,273,800.00	0.71
32	300014	亿纬锂能	12,000	1,247,160.00	0.70
33	000661	长春高新	3,000	1,161,000.00	0.65
34	600438	通威股份	26,000	1,125,020.00	0.63
35	000333	美的集团	15,400	1,099,098.00	0.61
36	600872	中炬高新	26,000	1,092,520.00	0.61
37	688378	奥来德	15,000	969,000.00	0.54
38	603939	益丰药房	15,600	875,004.00	0.49
39	600050	中国联通	200,000	864,000.00	0.48
40	601360	三六零	70,000	854,700.00	0.48
41	002335	科华数据	35,000	796,950.00	0.44
42	601200	上海环境	65,000	778,050.00	0.43
43	600588	用友网络	23,000	764,980.00	0.43
44	002683	宏大爆破	25,400	705,358.00	0.39
45	688276	百克生物	6,000	627,480.00	0.35
46	002402	和而泰	25,000	599,250.00	0.33
47	002185	华天科技	38,000	584,820.00	0.33
48	002920	德赛西威	5,300	583,424.00	0.33
49	002156	通富微电	24,000	576,960.00	0.32
50	000498	山东路桥	100,000	560,000.00	0.31
51	600584	长电科技	14,300	538,824.00	0.30
52	603005	晶方科技	9,000	533,070.00	0.30
53	002376	新北洋	56,600	517,324.00	0.29
54	603897	长城科技	21,000	511,350.00	0.29
55	300294	博雅生物	13,000	469,950.00	0.26
56	000060	中金岭南	100,000	452,000.00	0.25
57	002446	盛路通信	60,000	390,000.00	0.22
58	002777	久远银海	22,000	389,180.00	0.22
59	600027	华电国际	100,000	344,000.00	0.19
60	300627	华测导航	10,000	341,100.00	0.19
61	002429	兆驰股份	50,000	303,500.00	0.17
62	002649	博彦科技	20,000	210,000.00	0.12
63	301017	漱玉平民	3,654	32,374.44	0.02
64	301018	申菱环境	2,672	22,150.88	0.01
65	301021	英诺激光	1,258	11,900.68	0.01

66	301015	百洋医药	199	10,907.19	0.01
67	301013	利和兴	210	7,419.30	0.00
68	001207	联科科技	174	5,761.14	0.00
69	000888	峨眉山 A	800	5,128.00	0.00
70	301016	雷尔伟	108	4,435.56	0.00
71	001208	华菱线缆	545	4,212.85	0.00
72	301007	德迈仕	147	2,810.64	0.00
73	301010	晶雪节能	100	2,262.00	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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300253	卫宁健康	10,703,716.46	5.97
2	002415	海康威视	9,986,067.00	5.57
3	002439	启明星辰	9,424,483.00	5.25
4	603678	火炬电子	9,253,214.00	5.16
5	000977	浪潮信息	7,413,489.92	4.13
6	002230	科大讯飞	7,310,640.00	4.07
7	300379	东方通	5,574,939.00	3.11
8	300348	长亮科技	5,376,902.00	3.00
9	002236	大华股份	5,130,347.00	2.86
10	002966	苏州银行	4,750,895.00	2.65
11	601398	工商银行	4,562,200.00	2.54
12	600570	恒生电子	4,518,854.00	2.52
13	002008	大族激光	4,337,988.00	2.42
14	300451	创业慧康	4,211,066.00	2.35
15	300226	上海钢联	3,969,465.00	2.21
16	603186	华正新材	3,826,723.00	2.13
17	002027	分众传媒	3,371,724.72	1.88
18	601117	中国化学	3,311,700.00	1.85
19	000333	美的集团	3,085,721.00	1.72
20	600050	中国联通	3,031,000.00	1.69

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	601117	中国化学	5,287,108.00	2.95
2	002966	苏州银行	4,973,380.00	2.77
3	601398	工商银行	4,458,200.00	2.48
4	601318	中国平安	3,676,163.00	2.05
5	600050	中国联通	3,021,000.00	1.68
6	600585	海螺水泥	2,825,934.00	1.58

7	603678	火炬电子	2,824,083.00	1.57
8	601166	兴业银行	2,619,955.00	1.46
9	600895	张江高科	2,609,865.00	1.45
10	600919	江苏银行	2,561,800.00	1.43
11	600036	招商银行	2,512,189.00	1.40
12	601288	农业银行	2,432,000.00	1.36
13	601618	中国中冶	2,311,000.00	1.29
14	600827	百联股份	2,310,430.00	1.29
15	002138	顺络电子	2,196,539.00	1.22
16	002230	科大讯飞	2,154,969.15	1.20
17	600703	三安光电	2,108,324.00	1.18
18	601998	中信银行	2,081,493.50	1.16
19	601899	紫金矿业	2,056,337.00	1.15
20	300059	东方财富	2,027,753.00	1.13

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	212,417,431.29
卖出股票收入（成交）总额	140,357,957.81

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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
-	-	-	-
9	其他	-	-
10	合计	-	-

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（%）
-	-	-	-	-	-

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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
-	-	-	-	-	-

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

金额单位：人民币元

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
-	-	-	-	-	-

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

金额单位：人民币元

序号	权证代码	权证名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
-	-	-	-	-	-

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股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值(元)	公允价值变动（元）	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计（元）					-
股指期货投资本期收益（元）					-
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-

注：本报告期本基金无股指期货交易。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的定量化研究，结合股指期货的定价模型寻求合理的估值水平，并与现货资产进行匹配，在法律法规允许的范围内，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

-

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值(元)	公允价值变动（元）	风险指标说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计（元）					-
国债期货投资本期收益（元）					-

国债期货投资本期公允价值变动（元）	-
-------------------	---

注：本报告期本基金无国债期货交易。

7.11.3 本期国债期货投资评价

-

7.12 本报告期末各资产单元的净值及占基金资产净值的比例

资产单元	投资顾问名称	报告期末资产单元资产净值（元）	占期末基金资产净值比例（%）
-	-	-	-

7.13 投资组合报告附注

7.13.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

7.13.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.13.3 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	43,314.98
2	应收证券清算款	6,415,528.41
3	应收股利	-
4	应收利息	10,461.38
5	应收申购款	470,614.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
-	-	-
8	其他	-
9	合计	6,939,918.95

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
-	-	-	-	-

注：本报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

7.13.5 期末前十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	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
-	-	-	-	-	-

注：本报告期末本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

-

§ 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

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 (%)
2,235	75,015.13	12,109,314.25	7.22	155,549,500.44	92.78

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	15,294,800.00	9.12

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	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2021 年 1 月 19 日) 基金份额总额	66,700,266.22
基金合同生效日起至报告期期末基金 总申购份额	242,965,575.10
减：基金合同生效日起至报告期期末基 金总赎回份额	142,007,026.63
基金合同生效日起至报告期期末基金 拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	0.00
本报告期期末基金份额总额	167,658,814.69

§ 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，管理人董事变动如下：

2021 年 1 月 21 日起，冯戎同志不再担任副董事长、董事；

2021 年 5 月 26 日起，陈建民同志不再担任董事。

本报告期内，管理人监事会因换届，变动如下：

2021 年 5 月 26 日，陈燕、邱瑜分别出任监事、职工监事；温锋、龚波、王焱不再担任监事，陈明、于辉、徐涛不再担任职工监事。

本报告期内，管理人高级管理人员变动如下：

2021 年 2 月 4 日，李雪峰、房庆利出任公司执行委员成员；

2021 年 2 月 25 日，管理人分管资产管理业务的高级管理人员由朱敏杰调整为杨玉成；

2021 年 4 月 29 日起，陈晓升、谢晨不再担任公司总经理助理。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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，无涉及基金管理业务、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

本基金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改聘会计师事务所。

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

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

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	1	352,530,321.37	100.00%	479,902.68	100.00%	-

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	-	-	2,444,900,000.00	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
-	-	-	-

§ 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							

-

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、《申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》；
- 2、《申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划托管协议》；
- 3、《申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划招募说明书》；
- 4、《申万宏源红利成长灵活配置混合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：<http://www.swhysc.com>

申万宏源证券有限公司

2021 年 8 月 31 日