

申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资 产管理计划 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 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：2022 年 3 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。本年度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 2022 年 3 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。

本报告期自 2021 年 01 月 19 日（基金合同生效日）起至 2021 年 12 月 31 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	6
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、基金净值表现及利润分配情况	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
3.4 过去三年基金的利润分配情况	8
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
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	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	14
4.10 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	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§ 7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	19
7.4 报表附注	20
§ 8 投资组合报告	52

8.1 期末基金资产组合情况	52
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	52
8.3 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	53
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	58
8.6 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	58
8.7 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
8.8 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
8.9 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
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	59
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	59
8.12 投资组合报告附注	60
§ 9 基金份额持有人信息	61
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61
9.3 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
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	61
§ 10 开放式基金份额变动	61
§ 11 重大事件揭示	62
11.1 基金份额持有人大会决议	62
11.2 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
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	62
11.4 基金投资策略的改变	63
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	63
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	63
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	63
11.8 其他重大事件	63
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	65
12.1 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
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	65
§ 13 备查文件目录	65
13.1 备查文件目录	65
13.2 存放地点	66
13.3 查阅方式	66

§ 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	117,255,540.68 份
基金合同存续期	<p>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：</p> <ol style="list-style-type: none"> 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	<p>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。</p> <p>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</p>

	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		021-33388414	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 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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.swyhsc.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	中兴华会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市西城区阜外大街 1 号东塔楼 15 层
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2021 年 1 月 19 日（基金合同生效日）-2021 年 12 月 31 日
本期已实现收益	18,604,196.88

本期利润	19,087,189.19
加权平均基金份额本期利润	0.1319
本期加权平均净值利润率	12.41%
本期基金份额净值增长率	8.48%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末
期末可供分配利润	9,126,438.58
期末可供分配基金份额利润	0.0778
期末基金资产净值	126,381,979.26
期末基金份额净值	1.0778
3.1.3 累计期末指标	2021 年末
基金份额累计净值增长率	8.48%

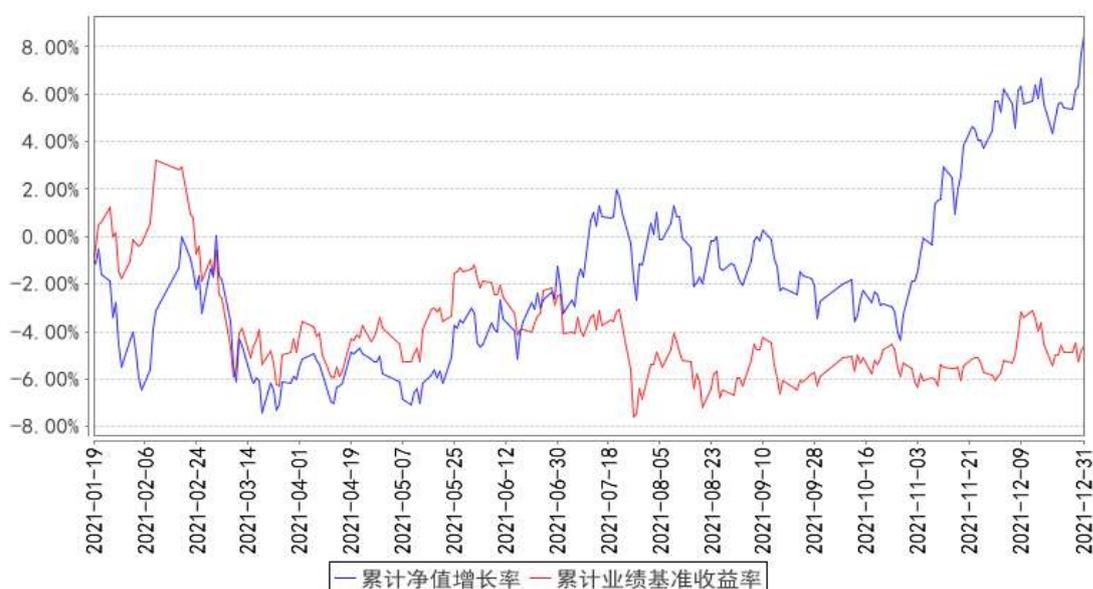
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	11.49%	0.75%	1.37%	0.48%	10.12%	0.27%
过去六个月	9.85%	0.80%	-2.17%	0.61%	12.02%	0.19%
自基金合同生效起至今	8.48%	0.84%	-4.60%	0.69%	13.08%	0.15%

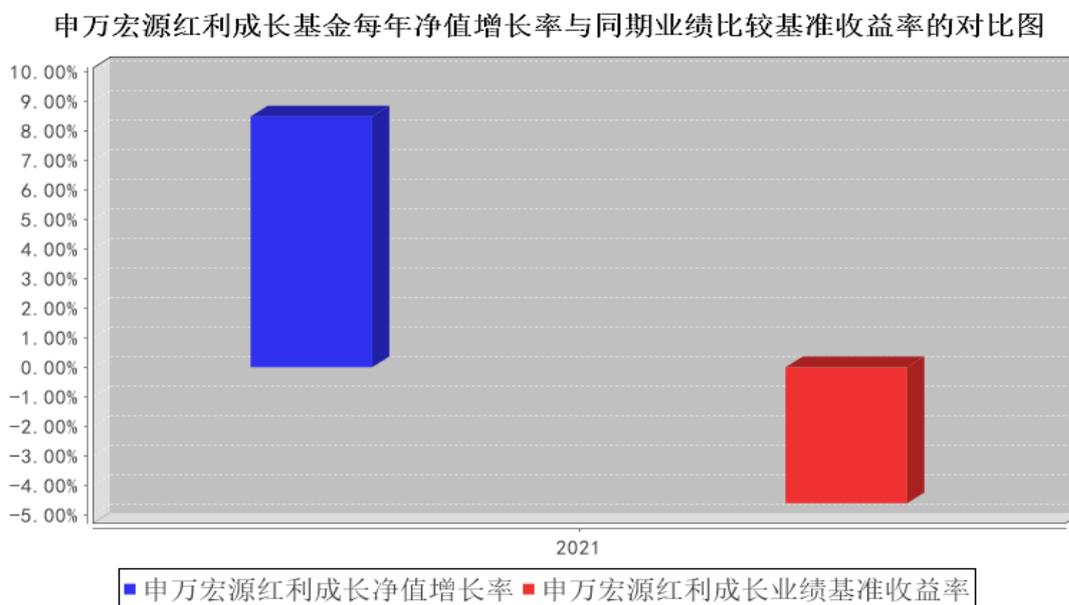
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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：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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金合同生效日为 2021 年 1 月 19 日，本年数据按基金合同生效当年实际存续期计算，未按整个自然年度折算。

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 12 月 31 日）
-	-
其他指标	报告期末（2021 年 12 月 31 日）
-	-

3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	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	年度利润分配合计	备注
2021 年	0.9500	10,383,303.97	655,123.81	11,038,427.78	-
合计	0.9500	10,383,303.97	655,123.81	11,038,427.78	-

§ 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 535 亿元，是国家主权财富基金——中国投资有限责任公司的直管企业。

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 12 月 31 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	-	17 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	-	13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，曾担任宏源证券宏源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；鉴于本集合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）前已担任本集合计划投资经理的，则任职日期为该投资经理首次担任本集合计划投资经理之日。

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。

4.1.3 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
-	公募基金	-	-	-
-	私募资产管理计划	-	-	-
-	其他组合	-	-	-
-	合计	-	-	-

4.1.4 基金经理薪酬机制

-

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 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，管理人建立并严格遵守《申万宏源证券有限公司资产管理事业部公平交易制度》、《申万宏源证券有限公司资产管理事业部公募资产管理业务异常交易监控与报告管理办法》来规范投资交易行为。对资产管理业务的投资交易行为进行监控、分析、评估和核查，监督投资交易的过程和结构，保证公平交易原则的实现。

管理人通过事前控制、事中监控、事后检查及反馈来保证公平交易。事前控制主要通过标准化的审批流程，对关联方审核、价格公允性判断及证券公平分配等相关环节进行控制；通过投资交易系统的可投库、交易对手库及授权管理，对投资标的、交易对手和操作权限进行控制。事中监控的工作确保授权、研究、投资、交易等行为符合规定，各项业务操作根据制度和业务流程进行。事后检查及反馈主要根据公司投资行为编制投资组合公平交易报告，对相邻交易日的同向交易和反向交易的合理性进行分析评估；对同类组合间、不同产品间以及同一投资经理管理不同组合间的交易行为等进行评估。根据法规及公司内部要求，分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的投资行为进行分析、评估，形成分析报告，如果发现涉嫌违背公平交易原则的行为，及时向公司管理层汇报并采取相关控制和改进措施。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内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和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。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。对于反向交易，根据交易价格、交易数量等进行了综合分析，未发现异常情况。综合而言，本公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，未出现违反公平交易的行为。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本集合计划投资经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.3.3 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

2021 年，A 股市场保持震荡态势。上证指数涨 4.80%，沪深 300 跌 5.20%。全年国内宏观经济增速前高后低，CPI 基本保持稳定，稳健的货币政策保持灵活适度，使得流动性总量合理充裕。股票市场风格方面，中小盘股的结构性的机会显著。行业层面上，电力设备、有色、采掘、化工等行业表现相对较好，而家电、非银、房地产等行业表现相对落后。

本集合计划自 2021 年 1 月 19 日成立以来，将主要仓位聚焦于长期看好的智能科技行业，同时也适度持有了一些行业比较体系阶段性看好的其他行业中具备一定性价比的个股。在操作上，本集合计划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，管理人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，本集合计划份额单位净值为 1.0778 元；本报告期基金份额净值增长率为 8.48%，同期业绩比较基准收益率为-4.60%。

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 2022 年的宏观环境，管理人认为上半年政策发力点在于稳信用，预计下半年经济增速将有所回升，预期全年 GDP 增速 5%左右，前低后高。在通胀方面，预计 CPI 将有所上行，但压力可控，PPI 将逐步回落，年底或转负。综合考虑全球的宏观环境，预计央行将维持稳健的货币政策，以结构性宽松为主。结合宏观经济和通胀所处的阶段，预计 2022 上半年国内权益类市场维持区间震荡走势，以结构性机会为主，下半年将迎来明显的整体性机会。

目前时点展望未来，基于以下几点理由，管理人仍然比较看好以 AI 技术为代表的智能科技板块的投资机会。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，依据管理人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，以数字科技、智能科技为代表的新基建是当下宏观经济稳增长措施中比较重要的一条主线；最后，目前该板块整体的估值水平仍位于历史中位数附近，动态估值与其长期成长性匹配度较好，相比其他具有较好增长前景的热门方向，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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本集合计划管理人严格遵循“合规、诚信、专业、稳健”的证券基金行业文化核心理念，从维护集合计划份额持有人利益、保障集合计划合规运作的角度出发，继续重点围绕严守合规底线、履行合规义务、防控重大风险等方面持续完善公司内控体系，稳步推进各项监察稽核工作。

报告期内，本集合计划管理人内部监察工作重点包括以下几个方面：

（一）不断培育合规文化，严守合规底线，管理人通过内外部合规培训、合规考试、法规解读、各类合规工作会议精神宣导等多种形式推动公司合规文化建设，不断提高全体员工合规工作意识，建立合规底线工作思维。

（二）持续加强制度建设，优化内部控制管理流程，管理人根据最新法律法规，结合公司业务开展实际情况，积极建章立制并落实法律法规要求，同时注重制度落实和执行有效性情况，通知制度体系建设和完善，不断推进公司内部工作流程精细化管理。

（三）扎实做好合规审查与检查，建立以合规促进业务发展的常态化工作模式，管理人根据法律法规、监管规定以及公司内部制度有关要求，持续做好对各类业务的法律合规支持工作，并持续对各类业务的合规开展情况进行检查，对发现的问题进行督导整改、查漏补缺，防范发生合规风险。

（四）进一步强化投资组合日常的风险监控，建立科学的风险管理体系，管理人不断提高各类风险防控能力，对各风险大类的风险进行识别、计量、评估、控制，通过梳理并宣导风险案例，完善事先预警、事中监控、事后管理流程，把控风险隐患，同时大力推进统一风险监控平台建设，不断提升信息化管理水平，加强风险控制力度。

（五）全面加强员工执业与投资行为管理，防范利益冲突与道德风险，管理人通过对投资、交易人员的通讯工具施行交易时间段集中管理，并对监控摄像、电子邮件、电话录音和即时通讯工具聊天记录定期进行合规检查，对新进员工开展合规培训并签署执业行为承诺书等方式，对员工日常执业和投资行为进行监督管理，促进员工执业行为规范持续符合监管要求。

（六）深入完善内审稽核工作，强化重点业务检查力度，管理人通过开展内部专项及常规稽核审计、聘请外部第三方机构开展独立稽核审计等方式，加强稽核审计工作，对于发现的问题，要求责任部门举一反三、即查即改，并加强问责力度，督促落实整改，进一步强化并完善了公司内控治理体系。

（七）继续夯实反洗钱工作基础，加强洗钱风险管控，管理人以风险为本作为管控原则，持续优化公司反洗钱工作治理体系，并积极尝试运用新技术提升反洗钱工作质量，制定有针对性的

反洗钱工作方案，不断完善客户身份识别工作，开展反洗钱培训和宣传，加强反洗钱可疑交易监测，推动反洗钱重点工作提质增效，提高反洗钱合规和风险管理水平。

通过上述工作，管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各类风险，保障集合计划份额持有人的合法权益。

4.7 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。会计师事务所对估值调整导致集合计划资产净值的变化在 0.25%以上时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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金实施利润分配 1 次，共分配 11,038,427.78 元，符合本集合计划合同的相关规定。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 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

报告期内，本基金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或者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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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

本报告期内，本托管人根据《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，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算以及基金费用开

支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金对基金份额持有人进行了 1 次利润分配，分配金额为人民币 11,038,427.78 元。

5.3 托管人对本年度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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	中兴华审字（2022）第 010072 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划全体持有人
审计意见	我们审计了后附的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“集合计划”）的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度的利润表、所有者权益表以及财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的有关规定编制，公允反映了集合计划 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和所有者权益变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于集合计划，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	集合计划的管理人申万宏源证券有限公司管理层（以下简称“申万宏源管理层”）对其他信息负责。其他信息包括集合计划 2021 年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，

	<p>在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>申万宏源管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。申万宏源治理层负责监督集合计划的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价申万宏源管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与申万宏源治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	中兴华会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	傅虎 谭军英
会计师事务所的地址	北京市丰台区丽泽路 20 号丽泽 SOHO B 座 20 层
审计报告日期	2022 年 03 月 08 日

§ 7 年度财务报表

7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	8,711,328.40
结算备付金		3,431,606.75
存出保证金		39,466.47
交易性金融资产	7.4.7.2	88,583,610.55
其中：股票投资		88,583,610.55
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	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	29,800,000.00
应收证券清算款		258,122.16
应收利息	7.4.7.5	-10,667.71
应收股利		-
应收申购款		311,044.37
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		131,124,510.99
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		325,638.88
应付赎回款		258,080.52
应付管理人报酬		137,329.85
应付托管费		17,166.23
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	53,625.04
应交税费		3,944,589.53
应付利息		-

应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	6,101.68
负债合计		4,742,531.73
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	117,255,540.68
未分配利润	7.4.7.10	9,126,438.58
所有者权益合计		126,381,979.26
负债和所有者权益总计		131,124,510.99

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 12 月 31 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 12 月 31 日，基金份额净值 1.0778 元，基金份额总额 117,255,540.68 份。

7.2 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 12 月 31 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 12 月 31 日
一、收入		22,497,169.27
1. 利息收入		878,751.98
其中：存款利息收入	7.4.7.11	145,058.78
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		733,693.20
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		19,691,784.61
其中：股票投资收益	7.4.7.12	18,345,176.81
基金投资收益	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-57,413.59
股利收益	7.4.7.16	1,404,021.39
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	482,992.31
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	1,443,640.37
减：二、费用		3,409,980.08

1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,752,112.63
2. 托管费	7.4.10.2.2	219,014.06
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-
4. 交易费用	7.4.7.19	1,353,312.91
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		68,477.26
7. 其他费用	7.4.7.20	17,063.22
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		19,087,189.19
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		19,087,189.19

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 12 月 31 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。

7.3 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 12 月 31 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 12 月 31 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）	-	19,087,189.19	19,087,189.19
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）	50,555,274.46	-4,507,858.01	46,047,416.45
其中：1. 基金申购款	335,767,654.76	12,931,342.87	348,698,997.63
2. 基金赎回款	-285,212,380.30	-17,439,200.88	-302,651,581.18
四、本期向基金份额持有人分	-	-11,038,427.78	-11,038,427.78

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）	117,255,540.68	9,126,438.58	126,381,979.26

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 12 月 31 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 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

杨玉成

陈秀清

王慧晶

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 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。

7.4.2 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。

7.4.3 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。

7.4.4 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。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 19 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 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。

7.4.4.4 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。

7.4.4.5 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。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。

7.4.4.8 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。

7.4.4.9 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。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。

7.4.4.10 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。

7.4.4.11 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。

7.4.4.12 外币交易

本基金本报告期无外币交易。

7.4.4.13 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。

7.4.4.14 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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

本公司主要的应纳税项列示如下：

（一）流转税及附加税费

集合计划管理人运用集合计划买卖股票印花税率为 1%，为单边征收。

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。

（二）企业所得税

参照财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）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，对证券投资基金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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日
----	-------------------------

活期存款	8,711,328.40
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	8,711,328.40

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	82,639,644.39	88,583,610.55	5,943,966.16
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	82,639,644.39	88,583,610.55	5,943,966.16

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 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	-	-	-	

资				
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	29,800,000.00	-
银行间市场	-	-
-	-	-
合计	29,800,000.00	-

7.4.7.4.2 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12月31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					-	-	-

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日
应收活期存款利息	1,801.77
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	1,297.30
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	-13,786.36
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	19.58
合计	-10,667.71

7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日
其他应收款	-
待摊费用	-
-	-
合计	-

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	53,625.04
银行间市场应付交易费用	-
-	-
合计	53,625.04

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	101.68
应付证券出借违约金	-
预提费用	6,000.00
合计	6,101.68

7.4.7.9 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 12 月 31 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	335,767,654.76	335,767,654.76
本期赎回（以“-”号填列）	-285,212,380.30	-285,212,380.30
- 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	117,255,540.68	117,255,540.68

7.4.7.10 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	18,604,196.88	482,992.31	19,087,189.19
本期基金份额交易产生的变动数	18,459,118.60	-22,966,976.61	-4,507,858.01
其中：基金申购款	153,502,658.56	-140,571,315.69	12,931,342.87
基金赎回款	-135,043,539.96	117,604,339.08	-17,439,200.88
本期已分配利润	-11,038,427.78	-	-11,038,427.78
本期末	53,212,611.03	-44,086,172.45	9,126,438.58

7.4.7.11 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12月31日	
活期存款利息收入		105,114.05
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		39,358.53
其他		586.20
合计		145,058.78

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 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12月31日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		18,345,176.81
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		18,345,176.81

7.4.7.12.2 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12月31日	
卖出股票成交总额		341,771,070.58
减：卖出股票成本总额		323,425,893.77
买卖股票差价收入		18,345,176.81

7.4.7.12.3 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12月31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	-

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 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12月31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	-

7.4.7.13.2 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12月31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	-

7.4.7.13.3 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12月31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	-

7.4.7.13.4 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12月31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	-

7.4.7.13.5 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12月31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	-

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 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12月31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	-

7.4.7.14.2 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12月31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	-

7.4.7.14.3 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12月31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	-

7.4.7.14.4 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12月31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	-

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 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12月31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	-

7.4.7.15.2 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12月31日

股指期货投资收益	-57,413.59
----------	------------

7.4.7.16 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12月31日
股票投资产生的股利收益	1,404,021.39
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	1,404,021.39

7.4.7.17 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12月31日
1. 交易性金融资产	482,992.31
股票投资	482,992.31
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	-
期货投资	-
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	482,992.31

7.4.7.18 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12月31日
基金赎回费收入	1,443,640.37
-	-
合计	1,443,640.37

7.4.7.19 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12月31日

交易所市场交易费用	1,352,874.77
银行间市场交易费用	-
股指期货交易费用	438.14
合计	1,353,312.91

7.4.7.20 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 12月31日
审计费用	5,704.08
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行费用	9,759.14
其他	1,600.00
合计	17,063.22

7.4.7.21 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。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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、基金销售机构
申万宏源集团股份有限公司	基金管理人的股东
申万宏源西部证券有限公司	基金管理人的子公司、基金销售机构
上海申银万国证券研究所有限公司	基金管理人的子公司
申万宏源（国际）集团有限公司	基金管理人的子公司
申银万国期货有限公司	基金管理人的子公司
申万菱信基金管理有限公司	基金管理人的子公司
申银万国投资有限公司	基金管理人的子公司
申银万国创新证券投资有限公司	基金管理人的子公司
申万宏源证券承销保荐有限责任公司	基金管理人的子公司
申万宏源投资有限公司	基金管理人的股东的子公司

申万宏源产业投资管理有限责任公司	基金管理人的股东的子公司
宏源期货有限公司	基金管理人的股东的子公司
宏源汇富创业投资有限公司	基金管理人的股东的子公司
宏源汇智投资有限公司	基金管理人的股东的子公司
上海申银万国综合服务有限公司	基金管理人实际控制的企业
上海证申信息服务有限公司	基金管理人实际控制的企业
富国基金管理有限公司	基金管理人参股的公募基金公司

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

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
申万宏源证券	696,920,199.16	100.00

7.4.10.1.2 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12月31日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例（%）
-	-	-

7.4.10.1.3 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12月31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	4,822,100,000.00	100.00

7.4.10.1.4 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12月31日	
	成交金额	占当期权证 成交总额的比例（%）
-	-	-

注：本报告期内，本集合计划未通过关联方交易单元进行权证交易。本集合计划合同生效日为2021年1月19日，无上年度同期对比数据。

7.4.10.1.5 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12月31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	948,727.12	100.00	53,625.04	100.00

注：上述佣金按市场佣金率计算，已扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 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12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,752,112.63
其中：支付销售机构的客户维护费	259,426.44

7.4.10.2.2 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12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	219,014.06

7.4.10.2.3 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 12 月 31 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	-

7.4.10.3 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 12 月 31 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
-	-	-	-	-	-	-

注：本报告期内，本集合计划未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。本集合计划合同生效日为 2021 年 1 月 19 日，无上年度同期对比数据。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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 12 月 31 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
-	-	-	-	-

注：本报告期内，本集合计划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。本集合计划合同生效日为 2021 年 1 月 19 日，无上年度同期对比数据。

7.4.10.4.2 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 12 月 31 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)	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

					张)						
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

注：本报告期内，本集合计划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。本集合计划合同生效日为 2021 年 1 月 19 日，无上年度同期对比数据。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 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 12 月 31 日
基金合同生效日（2021 年 1 月 19 日）持有的基金份额	11,000,000.00
报告期初持有的基金份额	11,000,000.00
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	11,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	9.38%

7.4.10.5.2 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 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 (%)
-	-	-

7.4.10.6 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 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	8,711,328.40	105,114.05

7.4.10.7 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 12 月 31 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
	-	-	-	-	-

注：本报告期内，本集合计划未发生本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况。本集合计划合同生效日为 2021 年 1 月 19 日，无上年度同期对比数据。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 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					
1	2021 年 12 月 27 日	-	2021 年 12 月 27 日	0.9500	10,383,303.97	655,123.81	11,038,427.78	-
合计	-	-	-	0.9500	10,383,303.97	655,123.81	11,038,427.78	-

7.4.12 期末(2021 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
300774	倍杰特	2021 年 7 月 26 日	2022 年 02 月 16 日	新股锁定	4.57	21.07	185	845.45	3,897.95	-
300814	中富电 路	2021 年 8 月 4 日	2022 年 2 月 14 日	新股锁定	8.40	23.80	165	1,386.00	3,927.00	-
300854	中兰环 保	2021 年 9 月 8 日	2022 年 3 月 16 日	新股锁定	9.96	27.28	83	826.68	2,264.24	-
300994	久祺股 份	2021 年 8 月 2 日	2022 年 2 月 14 日	新股锁定	11.90	45.42	155	1,844.50	7,040.10	-
301017	漱玉平	2021 年	2022 年	新股锁定	8.86	23.76	366	3,242.76	8,696.16	-

	民	6月23日	1月5日							
301018	申菱环境	2021年6月28日	2022年1月7日	新股锁定	8.29	26.02	268	2,221.72	6,973.36	-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2022年1月6日	新股锁定	9.46	41.39	126	1,191.96	5,215.14	-
301025	读客文化	2021年7月6日	2022年1月19日	新股锁定	1.55	20.84	127	196.85	2,646.68	-
301026	浩通科技	2021年7月8日	2022年1月17日	新股锁定	18.03	62.64	87	1,568.61	5,449.68	-
301027	华蓝集团	2021年7月8日	2022年1月19日	新股锁定	11.45	16.61	135	1,545.75	2,242.35	-
301028	东亚机械	2021年7月12日	2022年1月20日	新股锁定	5.31	13.49	390	2,070.90	5,261.10	-
301029	怡合达	2021年7月14日	2022年1月24日	新股锁定	14.14	89.74	182	2,573.48	16,332.68	-
301032	新柴股份	2021年7月15日	2022年1月24日	新股锁定	4.97	12.49	214	1,063.58	2,672.86	-
301035	润丰股份	2021年7月21日	2022年1月28日	新股锁定	22.04	56.23	173	3,812.92	9,727.79	-
301040	中环海陆	2021年7月26日	2022年02月07日	新股锁定	13.57	38.45	88	1,194.16	3,383.60	-
301041	金百泽	2021年8月2日	2022年2月11日	新股锁定	7.31	28.18	95	694.45	2,677.10	-
301046	能辉科技	2021年8月10日	2022年2月17日	新股锁定	8.34	48.96	141	1,175.94	6,903.36	-
301048	金鹰重工	2021年8月11日	2022年2月18日	新股锁定	4.13	12.95	391	1,614.83	5,063.45	-
301049	超越科技	2021年8月17日	2022年2月24日	新股锁定	19.34	32.88	92	1,779.28	3,024.96	-

301055	张小泉	2021年 8月26 日	2022年 03月 07日	新股锁定	6.90	21.78	156	1,076.40	3,397.68	-
301056	森赫股份	2021年 8月27 日	2022年 3月7 日	新股锁定	3.93	11.09	245	962.85	2,717.05	-
301057	汇隆新材	2021年 8月31 日	2022年 3月9 日	新股锁定	8.03	19.01	107	859.21	2,034.07	-
301060	兰卫医学	2021年 9月6 日	2022年 03月 14日	新股锁定	4.17	30.93	151	629.67	4,670.43	-
301062	上海艾录	2021年 9月7 日	2022年 3月14 日	新股锁定	3.31	17.01	224	741.44	3,810.24	-
301063	海锅股份	2021年 9月9 日	2022年 3月24 日	新股锁定	17.40	36.13	75	1,305.00	2,709.75	-
301068	大地海洋	2021年 9月16 日	2022年 3月28 日	新股锁定	13.98	28.36	63	880.74	1,786.68	-
301069	凯盛新材	2021年 9月16 日	2022年 3月28 日	新股锁定	5.17	44.15	249	1,287.33	10,993.35	-
301072	中捷精工	2021年 9月22 日	2022年 3月29 日	新股锁定	7.46	33.38	95	708.70	3,171.10	-
301073	君亭酒店	2021年 9月22 日	2022年 3月30 日	新股锁定	12.24	32.06	72	881.28	2,308.32	-
301079	邵阳液压	2021年 10月 11日	2022年 4月19 日	新股锁定	11.92	29.17	63	750.96	1,837.71	-
301083	百胜智能	2021年 10月 13日	2022年 4月21 日	新股锁定	9.08	15.23	130	1,180.40	1,979.90	-
301088	戎美股份	2021年 10月 19日	2022年 4月28 日	新股锁定	33.16	24.99	100	3,316.00	2,499.00	-
301089	拓新药业	2021年 10月 20日	2022年 4月27 日	新股锁定	19.11	69.92	76	1,452.36	5,313.92	-
301090	华润材料	2021年 10月	2022年 4月26	新股锁定	10.45	12.19	349	3,647.05	4,254.31	-

		19 日	日							
301098	金埔园林	2021 年 11 月 4 日	2022 年 5 月 12 日	新股锁定	12.36	26.38	193	2,385.48	5,091.34	-
301149	隆华新材	2021 年 11 月 3 日	2022 年 5 月 10 日	新股锁定	10.07	19.07	226	2,275.82	4,309.82	-
301188	力诺特玻	2021 年 11 月 4 日	2022 年 5 月 11 日	新股锁定	13.00	23.25	156	2,028.00	3,627.00	-

7.4.12.1.2 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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

7.4.12.1.3 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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

7.4.12.1.4 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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

7.4.12.2 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
002683	广东宏大	2021 年 12 月 20 日	重大事项停牌	30.12	2022 年 1 月 4 日	31.00	8,400	233,309.01	253,008.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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	数量（张）	期末估值总额
------	------	-------	-------	-------	--------

			价		
-	-	-	-	-	-
合计				-	-

注：本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

7.4.12.3.2 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。

7.4.12.4 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	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

本集合计划是混合型集合资产管理计划，其预期风险和收益水平高于债券型基金、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，低于股票型基金、股票型集合资产管理计划。本集合计划在日常投资管理中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。本集合计划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。

本集合计划管理人秉承全面风险管理的理念，遵循申万宏源证券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执行委员会层面对公司的风险进行的预防和控制。公司执行委员会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资产管理业务下设独立的风险管理部和信评中心对资产管理业务风险进行的预防和控制；三道风险防范是指资产管理业务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。

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本集合计划在日常经营活动中主要面临的金融工具风险包括：市场风险、信用风险及流动性风险。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。

本集合计划管理人秉承全面风险管理的理念，遵循申万宏源证券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执行委员会层面对公司的风险进行的预防和控制。公司执行委员会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资产管理业务下设独立的风险管理部和信评中心对资产管理业务风险进行的预防和控制；三道风险防范是指资产管理业务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。

7.4.13.2 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。

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。

本集合计划于 2021 年 12 月 31 日无债券投资。

7.4.13.2.1 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 12 月 31 日
A-1	-
A-1 以下	-
-	-
未评级	-
合计	-

7.4.13.2.2 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 12 月 31 日
A-1	-
A-1 以下	-
-	-
未评级	-
合计	-

7.4.13.2.3 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 12 月 31 日
A-1	-
A-1 以下	-
-	-
未评级	-
合计	-

7.4.13.2.4 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 12 月 31 日
AAA	-
AAA 以下	-
-	-
未评级	-
合计	-

7.4.13.2.5 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 12 月 31 日
AAA	-
AAA 以下	-
-	-
未评级	-
合计	-

7.4.13.2.6 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 12 月 31 日
AAA	-
AAA 以下	-
-	-
未评级	-
合计	-

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 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 12 月 31 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	-	-	-	-

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本集合计划管理人严格按照《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。

本集合计划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。

本集合计划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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	8,711,328.40	-	-	-	8,711,328.40
结算备付金	3,431,606.75	-	-	-	3,431,606.75
存出保证金	39,466.47	-	-	-	39,466.47
交易性金融资产	-	-	-	88,583,610.55	88,583,610.55
买入返售金融资产	29,800,000.00	-	-	-	29,800,000.00
应收利息	-	-	-	-10,667.71	-10,667.71
应收申购款	-	-	-	311,044.37	311,044.37
应收证券清算款	-	-	-	258,122.16	258,122.16
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	41,982,401.62	-	-	89,142,109.37	131,124,510.99
负债					
应付赎回款	-	-	-	258,080.52	258,080.52
应付赎回费	-	-	-	101.68	101.68
应付管理人报酬	-	-	-	137,329.85	137,329.85
应付托管费	-	-	-	17,166.23	17,166.23
应付交易费用	-	-	-	53,625.04	53,625.04
应交税费	-	-	-	3,944,589.53	3,944,589.53
预提费用	-	-	-	6,000.00	6,000.00
应付证券清算款	-	-	-	325,638.88	325,638.88
负债总计	0.00	-	-	4,742,531.73	4,742,531.73
利率敏感度缺口	41,982,401.62	-	-	84,399,577.64	126,381,979.26

注：表中所示为本集计划资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 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 12 月 31 日）
分析	-	-

注：于 2021 年 12 月 31 日，本集计划未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本集计划资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31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 外汇风险敞口净 额	-	-	-	-
------------------------	---	---	---	---

7.4.13.4.2.2 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12月31日）	
分析	-		-

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格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处市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本集合计划主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本集合计划通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本集合计划管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31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	88,583,610.55	70.09
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	88,583,610.55	70.09

7.4.13.4.3.2 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	
		对资产负债表日基金资产净值的

	相关风险变量的变动	影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2021年12月31日）
分析	业绩比较基准上升 5%	6,200,852.74
	业绩比较基准下降 5%	-6,200,852.74

7.4.13.4.4 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12月31日）
	-	-
	合计	-

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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。两个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

(a) 第二层次的公允价值计量

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层次。

(b) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2021年12月31日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.2 其他金融工具的公允价值(期末非以公允价值计量的项目)

其他金融工具主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	88,583,610.55	67.56
	其中：股票	88,583,610.55	67.56
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	29,800,000.00	22.73
	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	12,142,935.15	9.26
-	-	-	-
8	其他各项资产	597,965.29	0.46
9	合计	131,124,510.99	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	504,608.00	0.40
C	制造业	59,098,355.56	46.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	634,000.00	0.50
E	建筑业	5,091.34	0.00
F	批发和零售业	2,927,688.76	2.32
G	交通运输、仓储和邮政业	170,700.00	0.14
H	住宿和餐饮业	2,308.32	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,376,003.60	13.75
J	金融业	4,855,720.00	3.84
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,568,962.71	1.24
N	水利、环境和公共设施管理业	455,117.15	0.36

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,670.43	0.00
R	文化、体育和娱乐业	980,384.68	0.78
S	综合	-	-
	合计	88,583,610.55	70.09

8.2.2 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	-	-

8.3 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	121,100	6,335,952.00	5.01
2	600372	中航电子	232,700	5,210,153.00	4.12
3	000738	航发控制	166,800	5,050,704.00	4.00
4	002236	大华股份	190,000	4,461,200.00	3.53
5	000547	航天发展	259,600	4,335,320.00	3.43
6	002439	启明星辰	144,200	4,114,026.00	3.26
7	300253	卫宁健康	240,500	4,030,780.00	3.19
8	000977	浪潮信息	106,200	3,805,146.00	3.01
9	002212	天融信	125,200	2,400,084.00	1.90
10	600733	北汽蓝谷	225,000	2,254,500.00	1.78
11	601398	工商银行	470,000	2,176,100.00	1.72
12	002230	科大讯飞	36,200	1,900,862.00	1.50
13	000768	中航西飞	46,500	1,697,250.00	1.34
14	603859	能科科技	39,300	1,559,817.00	1.23
15	601998	中信银行	330,000	1,524,600.00	1.21
16	002008	大族激光	27,500	1,485,000.00	1.18
17	600038	中直股份	16,100	1,292,830.00	1.02
18	688586	江航装备	36,449	1,235,621.10	0.98
19	688519	南亚新材	24,436	1,231,818.76	0.97
20	002013	中航机电	67,400	1,225,332.00	0.97
21	603186	华正新材	28,400	1,186,836.00	0.94
22	300627	华测导航	25,400	1,168,400.00	0.92
23	300790	宇瞳光学	24,900	1,124,982.00	0.89
24	601012	隆基股份	12,500	1,077,500.00	0.85
25	600456	宝钛股份	14,800	1,062,344.00	0.84
26	601607	上海医药	52,000	1,033,240.00	0.82
27	600862	中航高科	27,900	997,704.00	0.79

28	002007	华兰生物	34,000	990,760.00	0.78
29	000028	国药一致	26,500	979,970.00	0.78
30	300379	东方通	32,800	968,584.00	0.77
31	002436	兴森科技	65,900	922,600.00	0.73
32	002475	立讯精密	18,000	885,600.00	0.70
33	002727	一心堂	22,700	874,177.00	0.69
34	600399	抚顺特钢	35,000	866,950.00	0.69
35	000001	平安银行	50,000	824,000.00	0.65
36	300114	中航电测	45,700	807,976.00	0.64
37	600050	中国联通	200,000	786,000.00	0.62
38	600183	生益科技	33,000	777,150.00	0.61
39	688788	科思科技	5,300	724,510.00	0.57
40	688300	联瑞新材	6,270	695,154.90	0.55
41	000938	紫光股份	29,000	662,650.00	0.52
42	300348	长亮科技	41,700	653,439.00	0.52
43	600521	华海药业	30,000	649,800.00	0.51
44	600795	国电电力	200,000	634,000.00	0.50
45	601928	凤凰传媒	75,400	609,986.00	0.48
46	002859	洁美科技	15,600	580,320.00	0.46
47	603087	甘李药业	8,100	569,754.00	0.45
48	002373	千方科技	38,000	568,100.00	0.45
49	600765	中航重机	11,000	555,390.00	0.44
50	688168	安博通	8,600	533,802.00	0.42
51	002777	久远银海	18,700	517,055.00	0.41
52	603678	火炬电子	6,300	476,595.00	0.38
53	601200	上海环境	35,000	440,650.00	0.35
54	000848	承德露露	35,000	379,750.00	0.30
55	003006	百亚股份	20,000	358,600.00	0.28
56	300075	数字政通	18,900	340,200.00	0.27
57	002745	木林森	22,000	332,860.00	0.26
58	300451	创业慧康	29,620	331,151.60	0.26
59	600837	海通证券	27,000	331,020.00	0.26
60	600438	通威股份	7,000	314,720.00	0.25
61	000021	深科技	19,000	300,960.00	0.24
62	603722	阿科力	5,500	296,560.00	0.23
63	600373	中文传媒	23,000	284,280.00	0.22
64	002683	广东宏大	8,400	253,008.00	0.20
65	601898	中煤能源	40,000	251,600.00	0.20
66	002253	川大智胜	13,000	231,920.00	0.18
67	601298	青岛港	30,000	170,700.00	0.14
68	002304	洋河股份	1,000	164,730.00	0.13
69	300037	新宙邦	1,000	113,000.00	0.09

70	000858	五粮液	500	111,330.00	0.09
71	603308	应流股份	4,000	89,280.00	0.07
72	000719	中原传媒	11,100	83,472.00	0.07
73	688126	沪硅产业	2,500	64,550.00	0.05
74	688007	光峰科技	1,000	34,350.00	0.03
75	301088	戎美股份	991	25,575.90	0.02
76	301029	怡合达	182	16,332.68	0.01
77	301069	凯盛新材	249	10,993.35	0.01
78	301035	润丰股份	173	9,727.79	0.01
79	301017	漱玉平民	366	8,696.16	0.01
80	300994	久祺股份	155	7,040.10	0.01
81	301018	申菱环境	268	6,973.36	0.01
82	301046	能辉科技	141	6,903.36	0.01
83	301015	百洋医药	199	6,029.70	0.00
84	301026	浩通科技	87	5,449.68	0.00
85	301013	利和兴	210	5,397.00	0.00
86	301089	拓新药业	76	5,313.92	0.00
87	000888	峨眉山 A	800	5,280.00	0.00
88	301028	东亚机械	390	5,261.10	0.00
89	301021	英诺激光	126	5,215.14	0.00
90	301098	金埔园林	193	5,091.34	0.00
91	301048	金鹰重工	391	5,063.45	0.00
92	301060	兰卫医学	151	4,670.43	0.00
93	301149	隆华新材	226	4,309.82	0.00
94	301090	华润材料	349	4,254.31	0.00
95	300814	中富电路	165	3,927.00	0.00
96	300774	倍杰特	185	3,897.95	0.00
97	301062	上海艾录	224	3,810.24	0.00
98	301188	力诺特玻	156	3,627.00	0.00
99	301055	张小泉	156	3,397.68	0.00
100	301040	中环海陆	88	3,383.60	0.00
101	301072	中捷精工	95	3,171.10	0.00
102	301049	超越科技	92	3,024.96	0.00
103	301016	雷尔伟	108	2,799.36	0.00
104	301056	森赫股份	245	2,717.05	0.00
105	301063	海锅股份	75	2,709.75	0.00
106	301041	金百泽	95	2,677.10	0.00
107	301032	新柴股份	214	2,672.86	0.00
108	301025	读客文化	127	2,646.68	0.00
109	301073	君亭酒店	72	2,308.32	0.00
110	300854	中兰环保	83	2,264.24	0.00
111	301027	华蓝集团	135	2,242.35	0.00

112	301057	汇隆新材	107	2,034.07	0.00
113	301083	百胜智能	130	1,979.90	0.00
114	301079	邵阳液压	63	1,837.71	0.00
115	301068	大地海洋	63	1,786.68	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	002439	启明星辰	13,227,054.00	10.47
2	300253	卫宁健康	12,556,016.46	9.93
3	002415	海康威视	12,109,353.00	9.58
4	000977	浪潮信息	10,131,895.47	8.02
5	603678	火炬电子	9,253,214.00	7.32
6	600372	中航电子	8,399,200.00	6.65
7	002236	大华股份	7,956,941.00	6.30
8	002230	科大讯飞	7,714,915.00	6.10
9	000738	航发控制	6,924,998.00	5.48
10	601398	工商银行	6,758,400.00	5.35
11	002859	洁美科技	6,310,026.00	4.99
12	300379	东方通	6,164,667.00	4.88
13	000547	航天发展	5,941,289.00	4.70
14	300348	长亮科技	5,376,902.00	4.25
15	600522	中天科技	5,201,100.00	4.12
16	002966	苏州银行	4,750,895.00	3.76
17	600570	恒生电子	4,518,854.00	3.58
18	300451	创业慧康	4,448,666.00	3.52
19	002008	大族激光	4,337,988.00	3.43
20	603186	华正新材	4,293,294.00	3.40
21	300226	上海钢联	4,084,065.00	3.23
22	300627	华测导航	3,986,257.75	3.15
23	601618	中国中冶	3,899,100.00	3.09
24	600050	中国联通	3,862,000.00	3.06
25	601998	中信银行	3,759,900.00	2.98
26	002027	分众传媒	3,754,524.72	2.97
27	002475	立讯精密	3,679,510.52	2.91
28	601117	中国化学	3,311,700.00	2.62
29	002013	中航机电	3,304,031.00	2.61
30	000333	美的集团	3,085,721.00	2.44
31	600038	中直股份	2,916,450.00	2.31
32	000768	中航西飞	2,832,273.00	2.24
33	600733	北汽蓝谷	2,793,030.00	2.21

34	000938	紫光股份	2,702,071.00	2.14
35	688300	联瑞新材	2,677,393.23	2.12
36	300166	东方国信	2,663,340.00	2.11
37	603859	能科科技	2,633,162.00	2.08
38	601288	农业银行	2,610,000.00	2.07
39	600456	宝钛股份	2,598,075.00	2.06
40	000725	京东方 A	2,577,250.00	2.04
41	002436	兴森科技	2,570,459.00	2.03
42	002212	天融信	2,563,654.00	2.03

8.4.2 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	603678	火炬电子	10,595,896.38	8.38
2	002439	启明星辰	10,104,452.00	8.00
3	300253	卫宁健康	7,952,868.00	6.29
4	002859	洁美科技	7,847,872.60	6.21
5	000977	浪潮信息	7,811,684.05	6.18
6	300379	东方通	6,466,143.00	5.12
7	002230	科大讯飞	6,408,574.15	5.07
8	601117	中国化学	5,287,108.00	4.18
9	600406	国电南瑞	5,152,045.00	4.08
10	002966	苏州银行	4,973,380.00	3.94
11	600372	中航电子	4,513,537.00	3.57
12	601398	工商银行	4,458,200.00	3.53
13	600522	中天科技	4,346,986.00	3.44
14	300348	长亮科技	4,264,419.00	3.37
15	600570	恒生电子	4,260,256.06	3.37
16	002415	海康威视	4,229,210.00	3.35
17	300627	华测导航	4,043,317.00	3.20
18	300451	创业慧康	4,032,192.00	3.19
19	600050	中国联通	3,876,000.00	3.07
20	601618	中国中冶	3,810,000.00	3.01
21	002236	大华股份	3,687,110.00	2.92
22	601318	中国平安	3,676,163.00	2.91
23	002475	立讯精密	3,277,631.00	2.59
24	603186	华正新材	3,253,001.00	2.57
25	002027	分众传媒	3,192,994.52	2.53
26	002008	大族激光	3,141,217.00	2.49
27	300226	上海钢联	3,093,189.00	2.45
28	688300	联瑞新材	3,068,577.30	2.43
29	000938	紫光股份	2,952,925.00	2.34

30	002013	中航机电	2,869,885.00	2.27
31	300166	东方国信	2,855,235.00	2.26
32	000738	航发控制	2,840,846.00	2.25
33	600585	海螺水泥	2,825,934.00	2.24
34	300059	东方财富	2,732,594.00	2.16
35	002929	润建股份	2,700,617.00	2.14
36	000333	美的集团	2,669,017.00	2.11
37	300058	蓝色光标	2,653,361.00	2.10
38	000725	京东方 A	2,641,744.00	2.09
39	601166	兴业银行	2,619,955.00	2.07
40	600895	张江高科	2,609,865.00	2.07
41	002436	兴森科技	2,562,190.00	2.03
42	600919	江苏银行	2,561,800.00	2.03

8.4.3 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	355,398,533.01
卖出股票收入（成交）总额	341,771,070.58

8.5 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	-	-

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.6 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（%）
-	-	-	-	-	-

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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）					-57,413.59
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本集合计划在股指期货投资时，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其合理的估值水平，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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

8.11.2 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/	合约市值	公允价值变动	风险指标说明
----	----	--------	------	--------	--------

		卖)	(元)	(元)	
-	-	-	-	-	-
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)					-

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

本集合计划投资的前十名证券的发行主体本期未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。

8.12.2

本集合计划本报告期末投资股票，没有出现投资的前十名股票超出资产管理合同规定的备选股票库的情况。

8.12.3 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	39,466.47
2	应收证券清算款	258,122.16
3	应收股利	-
4	应收利息	-10,667.71
5	应收申购款	311,044.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
-	-	-
8	其他	-
9	合计	597,965.29

8.12.4 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：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 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：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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 (%)
1,569	74,732.66	12,072,902.34	10.30	105,182,638.34	89.70

9.2 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	10,929,281.82	9.32

9.3 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	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的产品份额总量的数量区间 (万份)
-	公募基金	-
-	私募资产管理计划	-
-	合计	-

§ 10 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	335,767,654.76
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	285,212,380.30
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）	-
本报告期期末基金份额总额	117,255,540.68

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

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。

2021 年 9 月 22 日起，张英新任公司董事。

本报告期内，管理人监事变动如下：

2021 年 5 月 26 日起，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、徐涛不再担任职工监事。

2021 年 9 月 30 日，方荣义担任监事会主席，徐宜阳不再担任监事会主席。

本报告期内，管理人高级管理人员变动如下：

2021 年 2 月 4 日起，李雪峰、房庆利、张剑出任公司执行委员会成员；

2021 年 2 月 25 日起，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，陈晓升不再担任公司总经理助理，谢晨不再担任公司总经理助理。

2021 年 9 月 30 日起，张剑出任副总经理；王苏龙、吴萌、汤俊出任执行委员会成员；方荣义不再担任副总经理、执行委员会委员、财务总监、董事会秘书

2021 年 10 月 27 日起，杨玉成代行合规总监职责，房庆利协助分管资产管理事业部；薛军不再担任执行委员会委员、合规总监；

2021 年 11 月 15 日起，陈秀清出任执行委员会成员、财务总监。

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。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，未改聘会计师事务所。该审计机构已经连续 1 年为本基金提供审计服务。报告期内本基金应支付给会计师事务所的报酬为 8,000.00 元人民币。

11.6 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，基金管理人收到中国证券监督管理委员会上海证监局《关于对申万宏源证券有限公司采取出具警示函措施的决定》，并对公司相关人员出具了警示函。公司高度重视，按照法律法规相关要求梳理了相关业务流程，制定了整改措施，并积极落实整改工作。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	2	696,920,199.16	100.00%	948,727.12	100.00%	-

11.7.2 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	-	-	-4,822,100,000.00	100.00%	-	-

11.8 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	中国证监会规定披露媒介	2021 年 1 月 18 日
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	中国证监会规定披露媒介	2021 年 1 月 18 日
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	中国证监会规定披露媒介	2021 年 1 月 18 日

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	中国证监会规定披露媒介	2021 年 1 月 19 日
5	宏源证券宏源 3 号红利成长集合资产管理计划正式变更为申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划及合同生效公告	中国证监会规定披露媒介	2021 年 1 月 19 日
6	申万宏源证券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	2021 年 2 月 27 日
7	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开放日常申购（赎回、转换、定期定额投资）业务公告	中国证监会规定披露媒介	2021 年 3 月 16 日
8	关于申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划参与销售渠道开展申购费率优惠活动的公告	中国证监会规定披露媒介	2021 年 3 月 16 日
9	申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划 2021 年第 1 季度报告	中国证监会规定披露媒介	2021 年 4 月 22 日
10	申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划 2021 年第 2 季度报告	中国证监会规定披露媒介	2021 年 7 月 21 日
11	申万宏源证券有限公司旗下基金中期报告提示性公告	中国证监会规定披露媒介	2021 年 8 月 31 日
12	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	中国证监会规定披露媒介	2021 年 8 月 31 日
13	申万宏源证券有限公司基金行业高级管理人员变更公告（2021 年 10 月）	中国证监会规定披露媒介	2021 年 10 月 2 日
14	申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划 2021 年第 3 季度报告	中国证监会规定披露媒介	2021 年 10 月 27 日
15	申万宏源证券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	2021 年 10 月 29 日
16	申万宏源证券有限公司基金行业高级管理人员变更公告（2021 年 11 月）	中国证监会规定披露媒介	2021 年 11 月 16 日
17	申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划分红公告	中国证监会规定披露媒介	2021 年 12 月 23 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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：本集合计划本报告期无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本管理人向截至 2021 年 12 月 27 日登记在册的本集合计划份额持有人按每 10 份集合计划份额派发 0.9500 元。详见本基金管理人于 2021 年 12 月 23 日发布的相关公告。

§ 13 备查文件目录

13.1 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。

13.2 存放地点

上海市徐汇区长乐路 989 号 40 层

13.3 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

2022 年 3 月 31 日