

申万宏源灵通快利短期债券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：兴业银行股份有限公司

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。

基金托管人兴业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 5 月 18 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	5
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	6
3.3 其他指标 .....	8
3.4 过去三年基金的利润分配情况 .....	8
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
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 .....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	13
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
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
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 .....	14
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>14</b>
6.1 审计报告基本信息 .....	14
6.2 审计报告的基本内容 .....	15
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>17</b>
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
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>49</b>

8.1 期末基金资产组合情况 .....	49
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	49
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 .....	50
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	50
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	51
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 .....	51
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 .....	51
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 .....	51
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 .....	52
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	52
8.11 投资组合报告附注 .....	52
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>53</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	53
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	53
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 .....	53
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 .....	54
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>54</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>54</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	54
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 .....	54
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	55
11.4 基金投资策略的改变 .....	55
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	55
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 .....	55
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	55
11.8 其他重大事件 .....	56
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>57</b>
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 .....	57
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	57
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>58</b>
13.1 备查文件目录 .....	58
13.2 存放地点 .....	58
13.3 查阅方式 .....	58

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	申万宏源灵通快利短期债券型集合资产管理计划
基金简称	申万宏源灵通快利短债债券
场内简称	-
基金主代码	970026
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5月18日
基金管理人	申万宏源证券有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	48,468,071.77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为自本集合计划合同生效之日起三年。

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灵通快利短期债券型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）。管理人拟向中国证监会申请公募基金管理资格，在取得公募基金管理资格后，管理人将按照相关监管规定将本集合计划注册变更为公募基金。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本集合计划主要投资于短期固定收益类资产，在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，力求获得超越业绩比较基准的稳健回报，实现集合计划资产长期稳健增值。
投资策略	坚持稳健投资，在严格控制风险的基础上，追求长期持续稳定的合理回报。本集合计划采用债券投资策略、资产支持证券投资策略、国债期货投资策略。其中债券投资策略包括：久期偏离策略、类别选择策略、相对价值策略、个券选择策略、信用债投资策略。
业绩比较基准	中债综合财富（1年以下）指数收益率。
风险收益特征	本集合计划为债券型集合计划，在通常情况下其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金、现金管理型集合计划，低于股票型基金、股票型集合计划、混合型基金和混合型集合计划。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		申万宏源证券有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责	姓名	杨玉成	马宁
	联系电话	021-33389888	021-52629999

人	电子邮箱	yangyucheng@swhysc.com	Maning8710@cib.com.cn
客户服务电话		95523	95561
传真		021-33388414	-
注册地址		上海市徐汇区长乐路 989 号世纪 商贸广场 45 层	福州市湖东路 154 号
办公地址		上海市徐汇区长乐路 989 号世纪 商贸广场 45 层	上海市银城路 167 号
邮政编码		200031	350003
法定代表人		杨玉成	吕家进

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.swhysc.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	上会会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市静安区威海路 755 号文新报业大厦 25 楼
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 5 月 18 日（基金合同生效日）-2021 年 12 月 31 日
本期已实现收益	808,744.55
本期利润	814,675.55
加权平均基金份额本期利润	0.0160
本期加权平均净值利润率	1.59%
本期基金份额净值增长率	1.59%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末
期末可供分配利润	517,687.63
期末可供分配基金份额利润	0.0107
期末基金资产净值	48,994,600.15
期末基金份额净值	1.0109
3.1.3 累计期末指标	2021 年末
基金份额累计净值增长率	1.59%

### 3.2 基金净值表现

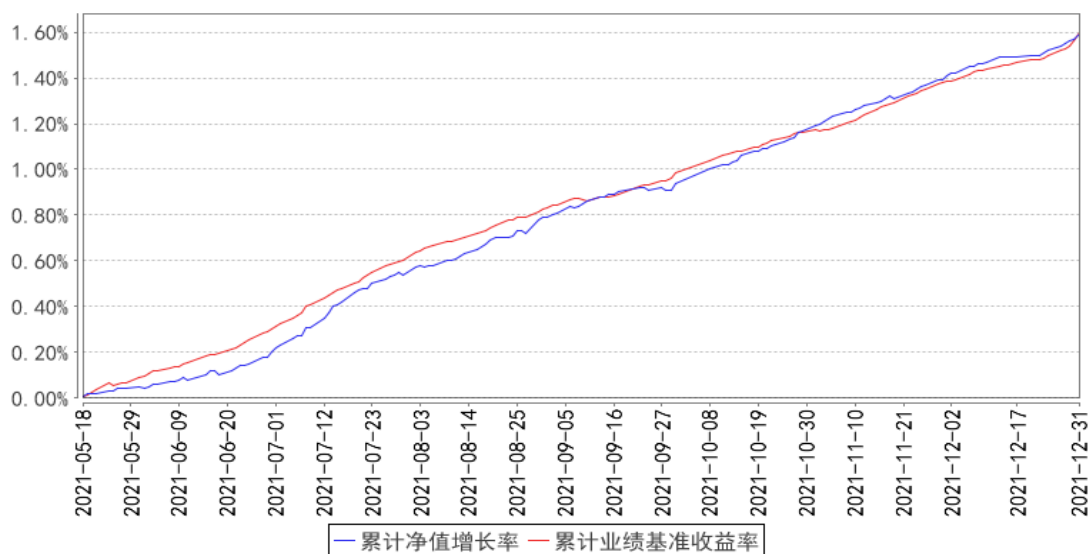
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净	份额净值	业绩比较	业绩比较基准	①-③	②-④
----	-----	------	------	--------	-----	-----

	值增长率①	增长率标准差②	基准收益率③	收益率标准差④		
过去三个月	0.64%	0.01%	0.61%	0.01%	0.03%	0.00%
过去六个月	1.39%	0.01%	1.29%	0.01%	0.10%	0.00%
自基金合同生效起至今	1.59%	0.01%	1.60%	0.01%	- 0.01%	0.00%

### 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

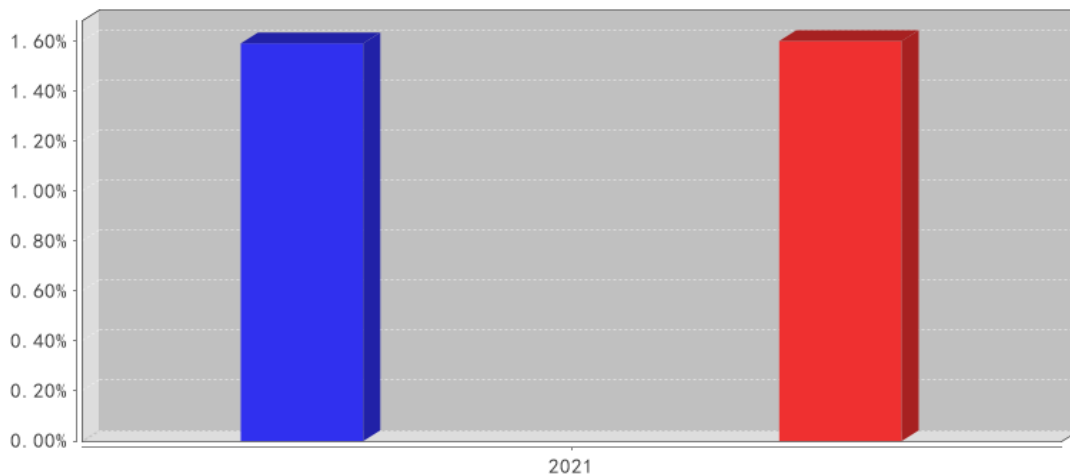
申万宏源灵通快利短债债券累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同于 2021 年 05 月 18 日生效，自基金成立日起 6 个月内为建仓期，截止本报告期末，各项资产配置比例符合合同投资范围及投资限制的比例约定。

### 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

申万宏源灵通快利短债债券基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



■ 申万宏源灵通快利短债债券净值增长率 ■ 申万宏源灵通快利短债债券业绩比较基准收益率

注：本基金合同生效日为2021年5月18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5月18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	0.0500	246,137.40	0.00	246,137.40	-
合计	0.0500	246,137.40	0.00	246,137.40	-

## § 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		
季程	本基金的基金经理	2018 年 3 月 29 日	-	8 年	毕业于新加坡南洋理工大学，金融学硕士，曾任职于申银万国证券股份有限公司资产管理事业部，2015 年至今就职于申万宏源证券资产管理事业部，历任交易员、投资助理、投资经理，具有多年资产管理工作经验。目前管理申银万国天天增 1 号、申银万国灵通快利 7 天、申万宏源灵通快利短债债券、宏源证券天添利、宏源证券宏源 10 号股债双鑫等产品，该投资经理已取得投资经理执业证书，该投资经理已取得投资经理执业证书，证书编号为：S0900817090002，并已取得基金从业资格，证书编号为：F4530000002664，不存在其他兼职情况，且最近三年无被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚的经历。
丁杰科	本基金的基金经理	2021 年 12 月 6 日	-	14 年	经济学和法学双学士，产业经济学硕士，中级经济师。先后就职于交银施罗德基金、中国农业银行金融市场部、申万菱信基金，先后从事债券交易、债务投资和公募基金管理工作。拥有 11 年债券交易和投资经验，担任过货币、债券、股债混合等多种类型基金产品的基金经理。不存在其他兼职情况。该投资经理已取得投资经理执业证书，证书编号为：

					S0900819110001，并已取得基金从业资格，证书编号为：F4530000003495，且最近三年无被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚的经历。
--	--	--	--	--	---

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

注：季程和丁杰科未兼任私募资产管理计划投资经理，仅共同作为四只大集合产品的投资经理。上述四只大集合产品正在申请参照公募基金进行改造。

#### 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，本管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和《申万宏源灵通快利短期债券型集合资产管理计划资产管理合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有发生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兼任对标公募基金改造的大集合资产管理计划投资经理。本报告期内，投资经理管理的多个集合资产管理计划间不存在不公平交易的情况。

#### 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

今年收益率呈现震荡下行的走势。今年央行于 7 月及 12 月 2 次全面降准 0.5 个百分点，释放

出长期资金总计 2.4 万亿。十年国债收益率从年初 3.17% 下行至年底的 2.76%。经济数据来看，全年基建投资拖累明显，专项债发行不及预期且资金使用效率低下；同时在疫情反复下消费整体仍显疲软；在房住不炒的坚持原则，政府收紧地产融资的调控下，地产投资断崖式下跌。整体上经济面复苏乏力。信用整体收缩下，可配资产较少，低等级信用债品种也出现一定下行幅度，信用利差压缩至低位。运作上，管理人以谨慎稳健原则，对组合进行合理的流动性管理，严控信用风险。根据市场变化，动态调整组合久期，密切关注经济走势和政策动向，择机择时进行资产配置，在流动性安全的前提下提升组合收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止 2021 年 12 月 31 日，本集合计划份额净值为 1.0109 元；本报告期本集合计划份额净值增长率为 1.59%，同期业绩比较基准收益率为 1.60%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望明年，虽然目前专项债资金项目进展较慢，但在财政部落实实物工作量的要求下，基建投资提速可期；政府对于房地产调控保持坚定不移态度，地产投资仍然不容乐观，但政策边际上已有放松，地产基本面将逐步企稳回温，但绝对值仍将保持低位；在疫情的不确定性，消费心态发生习惯改变的情况下，消费恢复仍然很难有起色；后续海外需求减弱及国内疫情的影响下，需求端具有一定下行压力，工业生产不容乐观。总体而言，经济基本面明年仍然不容乐观。货币政策保持稳健宽松，流动性充裕合理，调控上主动有为。物价方面猪肉价格筑底反弹，CPI 总体可控，PPI 或随着供需关系缓解见顶回落。预计一季度政策以宽松稳健为主，政策利率预测保持平稳向下趋势。债券收益率处于地位，有行情透支的可能性，投资操作上将择机择时谨慎为主。

#### 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。会计师事务所在估值调整导致集合计划资产净值的变化在 0.25%以上时对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

#### 4.8 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 246,137.40 元，符合本基金基金合同的相关规定。

#### 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

- 1、本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形；
- 2、本基金本报告期内自 2021 年 11 月 04 日起至 2021 年 12 月 05 日止，基金资产净值连续二十个工作日低于五千万元。

## § 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

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

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

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

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## § 6 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	上会师报字（2022）第 0155 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	申万宏源灵通快利短期债券型集合资产管理计划全体份额持有人
审计意见	我们审计了申万宏源灵通快利短期债券型集合资产管理计划(以下简称“申万宏源快利短期债券型集合计划”)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、基金净值变动表以及相关财务报表附注。我们认为,后附申万宏源快利短期债券型集合计划的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》、《申万宏源灵通快利短期债券型集合资产管理计划资产管理合同》以及中国证券监督管理委员会和中国证券业协会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,公允反映了申万宏源快利短期债券型集合计划 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和净值变动情况。
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,我们独立于申万宏源快利短期债券型集合计划,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	-
其他事项	我们提醒财务报表使用者关注后附财务报表附注中对编制基础的说明。同时该财务报表系申万宏源快利短期债券型集合计划管理人(以下简称“管理人”)根据《申万宏源灵通快利短期债券型集合资产管理计划资产管理合同》的规定为其基金份额持有人编制的,因此财务报表可能不适用于其他用途。本报告仅供管理人提供申万宏源快利短期债券型集合计划份额持有人和向中国证券监督管理委员会及其派出机构报送使用,不得用于其他目的。
其他信息	管理人对其他信息负责。其他信息包括申万宏源快利短期债券型集合计划 2021 年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,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。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。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理人负责按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》、《申万宏源灵通快利短期债券型集合资产管理计划

	<p>资产管理合同》以及中国证券监督管理委员会和中国证券业协会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，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。在编制财务报表时，管理人负责评估申万宏源快利短期债券型集合计划的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项，并运用持续经营假设，除非基金进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</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。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、评价管理人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、对管理人使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对申万宏源快利短期债券型集合计划持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致申万宏源快利短期债券型集合计划不能持续经营。</p> <p>5、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。我们与管理人就申万宏源快利短期债券型集合计划的审计范围、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	上会会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	陈大愚	江嘉炜
会计师事务所的地址	上海市静安区威海路 755 号文新报业大厦 25 楼	
审计报告日期	2022 年 03 月 16 日	



## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：申万宏源灵通快利短期债券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
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	2,442,849.21
结算备付金		173,181.83
存出保证金		207.39
交易性金融资产	7.4.7.2	45,706,510.00
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		45,706,510.00
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	1,800,009.00
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	706,702.27
应收股利		-
应收申购款		107,000.00
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		50,936,459.70
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>		
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		1,800,000.00
应付赎回款		-
应付管理人报酬		100,773.08
应付托管费		14,396.16
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	5,569.12
应交税费		14,986.86
应付利息		-

应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	6,134.33
负债合计		1,941,859.55
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	7.4.7.9	48,468,071.77
未分配利润	7.4.7.10	526,528.38
所有者权益合计		48,994,600.15
负债和所有者权益总计		50,936,459.70

注：本基金合同生效日为 2021 年 05 月 18 日，本报告期自基金合同生效日 2021 年 05 月 18 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 1.0109 元，基金份额总额 48,468,071.77 份。

## 7.2 利润表

会计主体：申万宏源灵通快利短期债券型集合资产管理计划

本报告期：2021 年 5 月 18 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 5 月 18 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
一、收入		1,110,493.88
1. 利息收入		1,072,071.54
其中：存款利息收入	7.4.7.11	11,235.43
债券利息收入		958,803.34
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		102,032.77
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		24,719.65
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	24,719.65
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	-
股利收益	7.4.7.16	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	5,931.00
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	7,771.69
减：二、费用		295,818.33

1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	226,642.97
2. 托管费	7.4.10.2.2	32,377.56
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-
4. 交易费用	7.4.7.19	7,118.74
5. 利息支出		10,484.59
其中：卖出回购金融资产支出		10,484.59
6. 税金及附加		3,401.85
7. 其他费用	7.4.7.20	15,792.62
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		814,675.55
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		814,675.55

注：本基金合同生效日为 2021 年 05 月 18 日，本报告期自基金合同生效日 2021 年 05 月 18 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：申万宏源灵通快利短期债券型集合资产管理计划

本报告期：2021 年 5 月 18 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 5 月 18 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）	51,575,176.59	-	51,575,176.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	814,675.55	814,675.55
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）	-3,107,104.82	-42,009.77	-3,149,114.59
其中：1. 基金申购款	143,445,927.84	1,261,264.31	144,707,192.15
2. 基金赎回款	-146,553,032.66	-1,303,274.08	-147,856,306.74
四、本期向基金份额持有人分	-	-246,137.40	-246,137.40

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）	48,468,071.77	526,528.38	48,994,600.15

注：

本基金合同生效日为 2021 年 05 月 18 日，本报告期自基金合同生效日 2021 年 05 月 18 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：

<u>杨玉成</u>	<u>陈秀清</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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

申万宏源灵通快利短期债券型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）于 2021 年 1 月 22 日经中国证监会《关于准申银万国灵通快利 14 天集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函【2021】260 号）批准，《申万宏源灵通快利短期债券型集合资产管理计划资产管理合同》于 2021 年 5 月 18 日起正式变更生效。本集合计划为契约型开放式，存续期限为自本集合计划合同生效之日起三年。本集合计划的管理人为申万宏源证券有限公司，托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《申万宏源灵通快利短期债券型集合资产管理计划资产管理合同》的有关规定，本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国债、地方政府债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、资产支持证券、债券回购、银行存款（包含活期存款、定期存款、协议存款和其他存款等）、同业存单、国债期货等法律法规或中国证监会允许的其他金融工具。

本集合计划不投资于股票资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。

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

本集合计划的投资组合比例为：投资于债券的比例不低于集合计划资产的 80%，投资于短期债券的比例不低于集合计划非现金资产的 80%，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本集合计划所指的短期债券是指剩余期限不超过 397 天(含)的债券资产，包括国债、地方政府债、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、可分离交易可转债的纯债部分等金融工具及剩余期限不超过 397 天(含)的资产支持证券等。本集合计划管理人将基于审慎原则，根据法律法规或中国证监会的规定或参照行业公认的方法，并与集合计划托管人协商一致，计算其剩余期限。

本集合计划的业绩比较基准为：中债综合财富（1 年以下）指数收益率。

#### 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 5 月 18 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

根据财政部、国家税务总局国家税务局财税[1998]55号《关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》、财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《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[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、国发[1985]19号发布和国务院令[2011]第588号修订的《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、国务院令[2005]第448号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1、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。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，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。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，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。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、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。

2、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，暂不缴纳企业所得税。

3、对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

4、本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 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	2,442,849.21
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	2,442,849.21	

## 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	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	6,212,280.00	-6,420.00
	银行间市场	39,488,299.00	12,351.00
	-	-	-
	合计	45,700,579.00	5,931.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	45,700,579.00	45,706,510.00	5,931.00

## 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	-	-	-	-
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	1,800,009.00	-
银行间市场	-	-
-	-	-
合计	1,800,009.00	-

##### 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	171.81
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	85.69
应收债券利息	706,444.66
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
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	0.11

合计	706,702.27
----	------------

#### 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	1,090.62
银行间市场应付交易费用	4,478.50
-	-
合计	5,569.12

#### 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	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	6,000.00
其他	134.33
合计	6,134.33

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 5 月 18 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	51,575,176.59	51,575,176.59
本期申购	143,445,927.84	143,445,927.84
本期赎回（以“-”号填列）	-146,553,032.66	-146,553,032.66
- 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	48,468,071.77	48,468,071.77

#### 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	-	-	-
本期利润	808,744.55	5,931.00	814,675.55
本期基金份额交易产生的变动数	-44,919.52	2,909.75	-42,009.77
其中：基金申购款	1,151,420.19	109,844.12	1,261,264.31
基金赎回款	-1,196,339.71	-106,934.37	-1,303,274.08
本期已分配利润	-246,137.40	-	-246,137.40
本期末	517,687.63	8,840.75	526,528.38

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年5月18日（基金合同生效日）至2021年12月31日
活期存款利息收入	7,404.40
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	3,829.26
其他	1.77
合计	11,235.43

#### 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5月18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	-
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	-

##### 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5月18日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出股票成交总额	-

减：卖出股票成本总额	-
买卖股票差价收入	-

#### 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5月18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5月18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	24,719.65
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	24,719.65

##### 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5月18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	57,050,957.81
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	56,107,685.30
减：应收利息总额	918,552.86
买卖债券差价收入	24,719.65

##### 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5月18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5月18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5月18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5月18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 5 月 18 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 5 月 18 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 5 月 18 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 5 月 18 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5月18日（基金合同生效日）至2021年12月31日
-	-

## 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年5月18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	-
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	-

## 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5月18日（基金合同生效日）至2021年12月31日
1. 交易性金融资产	5,931.00
股票投资	-
债券投资	5,931.00
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	5,931.00

## 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年5月18日（基金合同生效日）至2021年12月31日
基金赎回费收入	7,771.69
-	-
合计	7,771.69

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年5月18日（基金合同生效日）至2021年12月31日
交易所市场交易费用	627.49
银行间市场交易费用	6,491.25
-	-
合计	7,118.74

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年5月18日（基金合同生效日）至2021年12月31日
审计费用	3,747.72
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行费用	2,744.90
账户维护费	9,300.00
合计	15,792.62

#### 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
兴业银行股份有限公司	基金托管人
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5月18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（%）
-	-	-

注：本报告期内，本集合计划未通过关联方交易单元进行股票交易。本集合计划合同生效日为2021年5月18日，无上年度同期对比数据

##### 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5月18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（%）
申万宏源证券	6,212,280.00	100.00

##### 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5月18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	360,200,000.00	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5月18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 5 月 18 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5月18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	2,862.08	100.00	1,090.62	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5月18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	226,642.97
其中：支付销售机构的客户维护费	0.52

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 5 月 18 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	32,377.56

#### 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 5 月 18 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
	申万宏源灵通快利短债债券
	-
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 5 月 18 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 5 月 18 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 5 月 18 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 5 月 18 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 5 月 18 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：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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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 5 月 18 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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2021 年 5 月 18 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2021 年 5 月 18 日）持有的基金份额	4,385,047.27
报告期初持有的基金份额	4,385,047.27
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	4,385,047.27
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	9.05%

##### 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5月18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
兴业银行股份有限公司	2,442,849.21	7,404.40

## 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5月18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5月18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	0.0500	246,137.40	-	246,137.40	-
合计	-	-	-	0.0500	246,137.40	-	246,137.40	-

## 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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券	证券	成功	可流通	流通受限	认购	期末估	数量	期末	期末估	备注

代码	名称	认购日	日	类型	价格	值单价	(单 位: 张)	成本总额	值总额	
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

## 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 价	数量（张）	期末估值总额
-	-	-	-	-	-
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

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本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。

本集合计划管理人建立了信用风险评估与管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制信用风险，通过分散化投资以分散信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部信用评级体系全面考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险、信用产品的条款和担保人的情况等。

本集合计划在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此交收违约风险发生的可能性很小；本集合计划在进行银行间同业市场交易均通过事前检查和控制对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

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

## 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	1,512,450.00
A-1 以下	0.00
-	-
未评级	40,193,260.00
合计	41,705,710.00

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

## 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	2,205,060.00
AAA 以下	-
AA+	0.00
AA	0.00

未评级	0.00
合计	2,205,060.00

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

#### 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	0.00
AAA 以下	0.00
-	0.00
未评级	0.00
合计	0.00

#### 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、投资组合在短期内变现能力、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
<b>资产</b>					
银行存款	2,442,849.21	-	-	-	2,442,849.21
结算备付金	173,181.83	-	-	-	173,181.83
存出保证金	207.39	-	-	-	207.39
交易类债券投资	45,706,510.00	-	-	-	45,706,510.00
买入返售金融资产	1,800,009.00	-	-	-	1,800,009.00
应收利息	-	-	-	706,702.27	706,702.27
应收申购款	-	-	-	107,000.00	107,000.00
其他资产	-	-	-	-	-
<b>资产总计</b>	<b>50,122,757.43</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>813,702.27</b>	<b>50,936,459.70</b>
<b>负债</b>					
应付管理人报酬	-	-	-	100,773.08	100,773.08
应付托管费	-	-	-	14,396.16	14,396.16
应付交易费用	-	-	-	5,569.12	5,569.12
应交税费	-	-	-	14,986.86	14,986.86
其他应付款	-	-	-	134.33	134.33
预提费用	-	-	-	6,000.00	6,000.00
证券清算款	-	-	-	1,800,000.00	1,800,000.00
其他负债	-	-	-	-	-
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>1,941,859.55</b>	<b>1,941,859.55</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>50,122,757.43</b>	<b>0.00</b>	<b>0</b>	<b>-1,128,157.28</b>	<b>48,994,600.15</b>

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

## 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
	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	1. 市场利率下降 25个基点	35,242.61
	2. 市场利率上升25 个基点	-35,242.61

## 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。本集合计划持有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 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。本报告期内，本集合计划未投资股票、权证等资产。与本期末和上一年末，无重大其他市场价格风险。

##### 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	-	-

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	-	-

注：其他价格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除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固定收益品种，因此无其他重大价格风险。

#### 7.4.13.4.3.2 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12月31日）
分析	-	-

#### 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	45,706,510.00	89.73
	其中：债券	45,706,510.00	89.73
	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	1,800,009.00	3.53
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,616,031.04	5.14
-	-	-	-
8	其他各项资产	813,909.66	1.60
9	合计	50,936,459.70	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	-	-
C	制造业	-	-

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	-	-
J	金融业	-	-
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	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	-	-

### 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（%）
-	-	-	-	-	-

### 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（%）
-	-	-	-	-

#### 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（%）
-	-	-	-	-

#### 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	-
卖出股票收入（成交）总额	-

### 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	4,000,800.00	8.17
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	2,205,060.00	4.50
5	企业短期融资券	39,500,650.00	80.62
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
-	-	-	-
9	其他	-	-
10	合计	45,706,510.00	93.29

### 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（%）
1	012102429	21 日照港 SCP003	40,000	4,001,200.00	8.17
2	019649	21 国债 01	40,000	4,000,800.00	8.17
3	042100310	21 华远陆港 CP001	40,000	3,999,600.00	8.16
4	012103674	21 吴江交投 SCP002	40,000	3,998,800.00	8.16
5	012102950	21 国联 SCP008	40,000	3,998,400.00	8.16

### 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国债期货交易情况说明

#### 8.10.1 本期国债期货投资政策

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

#### 8.10.2 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）					-

#### 8.10.3 本期国债期货投资评价

本集合计划本报告期末未投资国债期货。

### 8.11 投资组合报告附注

#### 8.11.1

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。

#### 8.11.2

本集合计划本报告期不涉及股票投资。

#### 8.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	207.39
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	706,702.27

5	应收申购款	107,000.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
-	-	-
8	其他	-
9	合计	813,909.66

#### 8.11.4 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。

#### 8.11.5 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。

#### 8.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

-

## § 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 (%)
253	191,573.40	4,751,267.94	9.80	43,716,803.83	90.20

### 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	2,762,540.67	5.70

### 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	0

部门负责人持有本开放式基金	
本基金基金经理持有本开放式基金	0

#### 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5月18日） 基金份额总额	51,575,176.59
基金合同生效日起至报告期期末基金 总申购份额	143,445,927.84
减：基金合同生效日起至报告期期末 基金总赎回份额	146,553,032.66
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）	-
本报告期末基金份额总额	48,468,071.77

### § 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

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。

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

本报告期本集合计划投资策略无改变

### 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	-	-	2,862.08	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	6,212,280.00	100.00%	360,200,000.00	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	申万宏源灵通快利短期债券型集合资产管理计划募集说明书	中国证监会规定披露媒介	2021年5月17日
2	申万宏源灵通快利短期债券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5月17日
3	申万宏源灵通快利短期债券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5月17日
4	申万宏源灵通快利短期债券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5月17日
5	申银万国灵通快利14天集合资产管理计划正式变更为申万宏源灵通快利短期债券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5月17日
6	申万宏源灵通快利短期债券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7月14日
7	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
8	申万宏源灵通快利短期债券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
9	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
10	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
11	申万宏源灵通快利短期债券型集合资产管理计划资产管理合同（2021年12月）	中国证监会规定披露媒介	2021年12月6日
12	申万宏源灵通快利短期债券型集合资产管理计划托管协议（2021年12月）	中国证监会规定披露媒介	2021年12月6日



13	申万宏源灵通快利短期债券型集合资产管理计划募集说明书（2021 年 12 月）	中国证监会规定披露媒介	2021 年 12 月 6 日
14	申万宏源灵通快利短期债券型集合资产管理计划基金产品资料概要更新（2021 年 12 月）	中国证监会规定披露媒介	2021 年 12 月 6 日
15	申万宏源灵通快利短期债券型集合资产管理计划基金经理变更公告	中国证监会规定披露媒介	2021 年 12 月 6 日
16	申万宏源灵通快利短期债券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

- 1、本报告期内，根据《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》等法律法规和资产管理合同的约定，经与托管人协商一致，管理人决定自 2021 年 12 月 06 日起，对本集合计划的资产管理合同、招募说明书、托管协议等法律文件进行修订，增加《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》规定的相关内容。具体可参见管理人于 2021 年 12 月 06 日发布的修订后的资产管理合同、招募说明书及托管协议；
- 2、本报告期内，新增丁杰科女士为本集合计划的投资经理，丁杰科女士任职日期为 2021 年 12 月 06 日。详见本管理人于 2021 年 12 月 06 日发布的相关公告；
- 3、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 0.0500 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、《申万宏源灵通快利短期债券型集合资产管理计划资产管理合同》；
- 2、《申万宏源灵通快利短期债券型集合资产管理计划托管协议》；
- 3、《申万宏源灵通快利短期债券型集合资产管理计划招募说明书》；
- 4、《申万宏源灵通快利短期债券型集合资产管理计划基金产品资料概要》；
- 5、管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内披露的各项公告。

### 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：95523/4008895523

公司网址：www.swhysc.com

申万宏源证券有限公司

2022 年 3 月 31 日