

申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资 产管理计划 2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：申万宏源证券有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 08 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	52
7.1 期末基金资产组合情况	52
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	53
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	54
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	57
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	58
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	58
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	58
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58
7.12 投资组合报告附注	58
§ 8 基金份额持有人信息	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	60
§ 9 开放式基金份额变动	60
§ 10 重大事件揭示	60
10.1 基金份额持有人大会决议	60
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
10.4 基金投资策略的改变	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	60
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	61
10.8 其他重大事件	61
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	61
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	62
§ 12 备查文件目录	62
12.1 备查文件目录	62
12.2 存放地点	62
12.3 查阅方式	62

§ 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	112,915,247.06 份
基金合同存续期	变更为本集合计划后，本集合计划存续期限自本集合计划合同生效之日起 3 年，但在此期间如同时满足以下条件的，则本集合计划在变更为公募基金后存续期限为不定期，而无需召开集合计划份额持有人大会：1、获得公募基金管理资格或者以独资或者控股方式成立具有独立法人资格的从事资产管理业务的公司并将本集合计划合同中管理人的全部权利和义务转让给前述从事资产管理业务的公司；2、在法律法规规定、集合计划合同约定的范围内，对集合计划份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，根据监管机构的要求将本集合计划变更注册为相应的公募基金。

注：本报告所述的“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。</p>

	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@swhysc.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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网 址	www.swhysc.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-6,697,874.13
本期利润	-21,248,692.29
加权平均基金份额本期利润	-0.1842
本期加权平均净值利润率	-20.16%
本期基金份额净值增长率	-16.65%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)
期末可供分配利润	-11,487,145.67
期末可供分配基金份额利润	-0.1017
期末基金资产净值	101,428,101.39
期末基金份额净值	0.8983
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-9.59%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

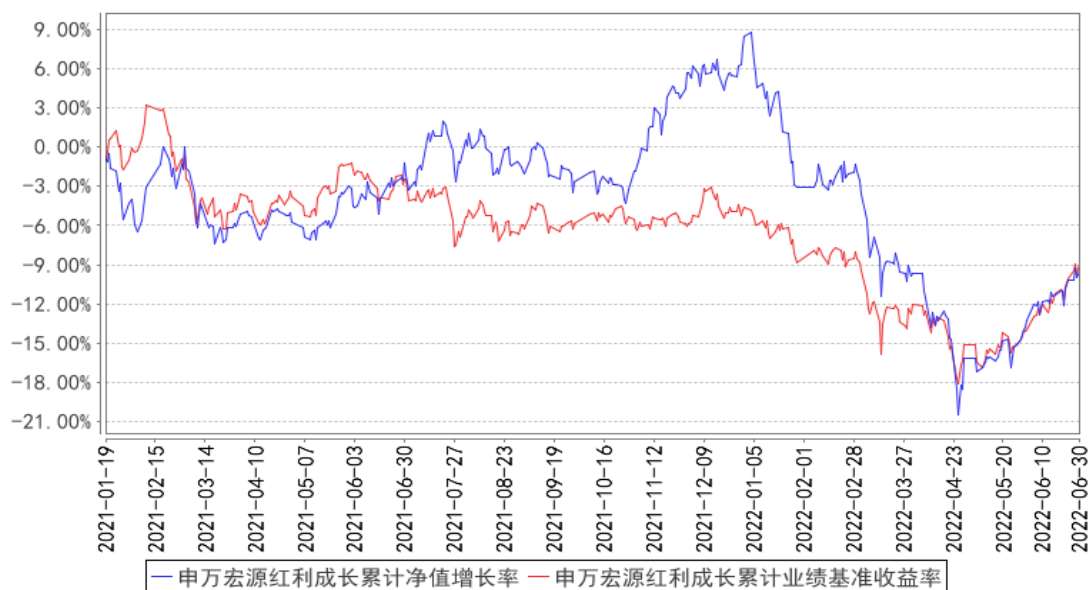
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	5.05%	0.74%	5.78%	0.64%	-0.73%	0.10%
过去三个月	0.26%	1.20%	4.29%	0.86%	-4.03%	0.34%
过去六个月	-16.65%	1.14%	-4.59%	0.87%	-12.06%	0.27%
过去一年	-8.44%	0.98%	-6.66%	0.75%	-1.78%	0.23%
自基金合同生效起至今	-9.59%	0.95%	-8.98%	0.76%	-0.61%	0.19%

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

申万宏源红利成长累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本集合计划业绩比较基准收益率=60%×沪深 300 指数+40%×上证国债指数；

2、本资产管理合同自 2021 年 1 月 19 日起生效，管理人应当自资产管理合同生效之日起 6 个月内使本集合计划的投资组合比例符合资产管理合同的有关约定，目前本集合计划的投资组合比例已符合资产管理合同的有关约定。

3.3 其他指标

单位：人民币元

其他指标	报告期（2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日）
-	-
其他指标	报告期末（2022 年 6 月 30 日）
-	-

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

申万宏源证券有限公司（以下简称“申万宏源”或“公司”），是由新中国第一家股份制证券公司——申银万国证券股份有限公司与国内资本市场第一家上市证券公司——宏源证券股份有限公司，于 2015 年 1 月 16 日合并组建而成。公司注册资本 535 亿元，拥有员工近 10000 名，是国家主权财富基金——中国投资有限责任公司的直管企业。

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

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 2022 年 6 月 30 日，集合资产管理计划管理人共管理 2 只公募集合资产管理计划，分别为申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划、申万宏源灵通快利短期债券型集合资产管理计划。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈旻	本基金的基金经理	2019 年 4 月 15 日	-	18 年	权益公募投资决策小组成员，国籍为中国，工商管理硕士，经济师职称。曾任申银万国证券股份有限公司证券投资总部投资经理、客户资产管理总部定向理财投资部投资经理、“申万 1 号”和“宝鼎一期”投资主办助理、“申万 3 号”投资主办以及“宝鼎优选定增系列”“宝鼎稳盈系列”“宝鼎系列”等产品投资主办，现为本集合计划投资经理。现任申万宏源证券资产管理事业部高级投资经理，拥有丰富的投资运营管理经验，不存在其他兼职情况；已取得投资主办人执业证书，证书编号为：S0900812110010，并已取得基金从业资格，证书编号为：F4530000002658，且最近三年无被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚的经历。
秦庆	本基金的基金经理	2019 年 4 月 15 日	-	14 年	权益投资决策委员会委员、权益公募投资决策小组组长，国籍为中国，工学硕士，曾任职于基金公司、泰康资管权益投资部，从事通信、电子、计算机、传媒等行业研究工作。2013 年 6 月加入原宏源证券北京资管分公司权益投资部，先后历任宏源证券宏源 10 号股债双鑫集合资产管理计划、宏源证券股债双丰集合资产管理计划投资主办人，拥有丰富的投资运营管理经验，不存在其他兼职情况；已取得投资主办人执业证书，证书编号为：S1180814050001，并已取得基金从业资格，证书编号为：F4530000002689，且最近三年无被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚的经历。

注：1. 任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日；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（即资产管理合同生效日）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	-	-	-

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年上半年，A 股市场整体下跌，其中上证指数跌 6.63%，沪深 300 跌 9.22%，中证 500 跌 12.30%，创业板指跌 15.41%。

上半年，国内宏观经济受周期性趋势以及疫情影响，整体在偏低位运行，5-6 月出现了复苏迹象。通胀数据虽出现向上趋势但仍处于较低水平，央行继续加大稳健货币政策的实施力度，力图发挥好政策工具的总量和结构双重功能，实现跨周期和逆周期调控的有机结合。股票市场在整体下跌的环境下，大盘股表现略好于中小盘股。行业层面上，煤炭、交通运输、美容护理、房地产、有色等行业表现较好，而电子、计算机、传媒、军工等行业表现相对落后。

报告期内，本集合计划以持有符合景气价值投资理念的数字经济、智能科技类成长性企业为主，也适度配置了估值性价比较高的金融类蓝筹资产。

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 0.8983 元；本报告期基金份额净值增长率为 -16.65%，同期业绩比较基准收益率为 -4.59%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年的宏观环境，管理人综合分析国内经济周期所处的阶段以及国内外政策的变化，认为此前一直未能实现的信用扩张将出现积极进展，并将逐步引领经济实现企稳。预计 CPI 将继续上行，但核心 CPI 仍将维持偏低水平，通胀压力整体可控。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，预计下半年国内权益类市场将在震荡中上行，2023 年将迎来明显的整体性机会。

目前时点展望未来，管理人相对较为看好以下几方面投资机会：一是以数字经济和智能化为代表的科技成长板块的投资机会，中长期看，行业本身较为广阔的成长空间、代表经济转型方向

以及稳增长促发的政策支持、板块目前的估值分位数处于历史较低水平等因素使得该领域的性价比较高，短期看，科技类不少细分子行业基本面下半年有望进入上行周期；二是目前市场热门的赛道板块，经过景气价值体系的比较后，管理人相对较为看好军工类核心个股的投资机会；三是宽信用即将进入兑现时，金融类个股的投资价值也将凸显。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及集合计划合同约定，本集合计划管理人为准确、及时进行基金估值和份额净值计价，制定了集合计划估值和份额净值计价的业务管理制度，建立了估值委员会，使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制。本集合计划托管人审阅本集合计划管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查集合计划资产净值和集合计划份额申购、赎回价格。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本集合计划本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

- 1、本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、本报告期内未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元。

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	7,257,557.99	8,711,328.40
结算备付金		2,815,679.78	3,431,606.75
存出保证金		17,793.92	39,466.47
交易性金融资产	6.4.7.2	71,233,567.23	88,583,610.55
其中：股票投资		71,201,767.24	88,583,610.55
基金投资		-	-
债券投资		31,799.99	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	24,103,268.28	29,800,000.00
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		39,442.05	258,122.16
应收股利		-	-
应收申购款		4,995.00	311,044.37
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-10,667.71
资产总计		105,472,304.25	131,124,510.99
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		37,668.69	325,638.88
应付赎回款		22,146.07	258,080.52

应付管理人报酬		97,762.78	137,329.85
应付托管费		12,220.31	17,166.23
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		3,829,259.80	3,944,589.53
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	45,145.21	59,726.72
负债合计		4,044,202.86	4,742,531.73
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	112,915,247.06	117,255,540.68
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-11,487,145.67	9,126,438.58
净资产合计		101,428,101.39	126,381,979.26
负债和净资产总计		105,472,304.25	131,124,510.99

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.8983 元，基金份额总额 112,915,247.06。

6.2 利润表

会计主体：申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 19 日（基金合 同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-20,535,424.02	6,869,059.32
1. 利息收入		319,019.17	372,503.41
其中：存款利息收入	6.4.7.13	46,287.38	77,144.18
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收 入		-	-
买入返售金融资产收 入		272,731.79	295,359.23
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填 列）		-6,330,861.52	6,397,726.26
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-6,952,676.92	5,324,404.39
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	81.90	-
资产支持证券投资收 益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-

衍生工具收益	6.4.7.18	79,931.67	-
股利收益	6.4.7.19	541,801.83	1,073,321.87
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-14,550,818.16	-773,302.01
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	27,236.49	872,131.66
减：二、营业总支出		713,268.27	1,506,594.99
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	628,742.83	732,349.82
2. 托管费	6.4.10.2.2	78,592.86	91,543.72
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费	6.4.10.2.1.1	-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		1,555.06	20,231.17
8. 其他费用	6.4.7.23	4,377.52	662,470.28
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-21,248,692.29	5,362,464.33
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-21,248,692.29	5,362,464.33
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-21,248,692.29	5,362,464.33

注：上期其他费用中含交易费用。

6.3 净资产（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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	117,255,540.68	-	9,126,438.58	126,381,979.26

加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期末期初净资产(基金净值)	117,255,540.68	-	9,126,438.58	126,381,979.26
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-4,340,293.62	-	-20,613,584.25	-24,953,877.87
(一)、综合收益总额	-	-	-21,248,692.29	-21,248,692.29
(二)、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)	-4,340,293.62	-	635,108.04	-3,705,185.58
其中:1.基金申购款	13,648,433.40	-	-751,645.14	12,896,788.26
2.基金赎回款	-17,988,727.02	-	1,386,753.18	-16,601,973.84
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值	-	-	-	-

变动(净值减少以“-”号填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	112,915,247.06	-	-11,487,145.67	101,428,101.39
项目	上年度可比期间 2021年1月19日(基金合同生效日)至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	-	-	-	-
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	66,700,266.22	-	5,585,535.18	72,285,801.40
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	100,958,548.47	-	6,163,614.76	107,122,163.23
(一)、综合收益总额	-	-	5,362,464.33	5,362,464.33
(二)、本期基金份额交易产	100,958,548.47	-	801,150.43	101,759,698.90

生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）				
其中：1. 基金申购款	242,965,575.10	-	5,929,212.17	248,894,787.27
2. 基金赎回款	-142,007,026.63	-	-5,128,061.74	-147,135,088.37
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产（基金净值）	167,658,814.69	-	11,749,149.94	179,407,964.63

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”或“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%×沪深 300 指数+40%×上证国债指数。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》和中国证监会、中国基金业协会允许的如财务报表附注 7.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计估计与最近一期的年度报告相一致，采用的会计政策与最近一年度报告金融工具准则发生变更，具体见下文 6.4.5.1 会计政策变更的说明。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

执行新金融工具准则导致的会计政策变更

根据《资产管理产品相关会计处理规定》资产管理产品自 2022 年 1 月 1 日起首次执行《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量（2017 年修订）》（财会〔2017〕7 号）、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移（2017 年修订）》（财会〔2017〕8 号）、《企业会计准则第 24 号——套期会计（2017 年修订）》（财会〔2017〕9 号）和《企业会计准则第 37 号——金融工具列报（2017 年修订）》（财会〔2017〕14 号）（上述准则统称“新金融工具准则”），应当遵循上述准则的衔接规定。

在新金融工具准则下所有已确认金融资产，其后续均按摊余成本或公允价值计量。资产管理产品应当根据其管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，将金融资产划分为以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

在新金融工具准则下，对以摊余成本计量的金融资产和分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产，以预期信用损失为基础进行减值会计处理并确认损失准备。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本集合计划本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本集合计划本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 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，对管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税。

参照财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	7,257,557.99
等于：本金	7,256,106.16
加：应计利息	1,451.83
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
-	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	7,257,557.99

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	79,808,669.16	-	71,201,767.24	-8,606,901.92	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	31,446.78	303.29	31,799.99	49.92
	银行间市场	-	-	-	-
	-	-	-	-	-
	合计	31,446.78	303.29	31,799.99	49.92
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	79,840,115.94	303.29	71,233,567.23	-8,606,852.00	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生 工具	-	-	-	
其中： 国债期 货投资	-	-	-	
货币衍生 工具	-	-	-	
其中： 远期外 汇投资	-	-	-	
权益衍生 工具	-	-	-	
其中： 股指期 货投资	-	-	-	
其他衍生 工具	-	-	-	
合计	-	-	-	

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
----	----	----------	------	--------

-	-	-	-
合计			
减：可抵销期货 暂收款			
净额			

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	市值	公允价值变动
-	-	-	-	-
合计				
减：可抵销期货 暂收款				
净额				

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	24,103,268.28	-
银行间市场	-	-
-	-	-
合计	24,103,268.28	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日						
	债券代码	债券名称	约定 返售日	估值单价	数量 (张)	估值 总额	其中：已出售 或再质押总额
-	-	-	-	-	-	-	-
合计							

注：本集合计划本报告期末无买断式逆回购交易。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

-

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日

		初始成本	利息调整	应计利息	减值准备	账面价值
债券	交易所市场	-	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-	-
	-	-	-	-	-	-
	小计	-	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-	-
其他		-	-	-	-	-
合计		-	-	-	-	-

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

单位：人民币元

减值准备	第一阶段	第二阶段	第三阶段	合计
	未来 12 个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失(未发生信用减值)	整个存续期预期信用损失(已发生信用减值)	
期初余额	-	-	-	-
本期从其他阶段转入	-	-	-	-
本期转出至其他阶段	-	-	-	-
本期新增	-	-	-	-
本期转回	-	-	-	-
其他变动	-	-	-	-
期末余额	-	-	-	-

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日					
	初始成本	利息调整	应计利息	公允价值变动	账面价值	累计减值准备
债券	交易所市场	-	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-	-
	-	-	-	-	-	-
	小计	-	-	-	-	-
资产支持证		-	-	-	-	-

券						
其他	-	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-	-

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

单位：人民币元

减值准备	第一阶段	第二阶段	第三阶段	合计
	未来 12 个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失(未发生信用减值)	整个存续期预期信用损失(已发生信用减值)	
期初余额	-	-	-	-
本期从其他阶段转入	-	-	-	-
本期转出至其他阶段	-	-	-	-
本期新增	-	-	-	-
本期转回	-	-	-	-
其他变动	-	-	-	-
期末余额	-	-	-	-

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
-	-	-	-
合计	-	-	-

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日					
	指定为以公允价值计量且其变动计	本期确认的股利收入	累计利得	累计损失	其他综合收益转入留存收益的金额	其他综合收益转入留存收益

	入其他综合收益的原因					的原因
-	-	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-	-

6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	-
应计利息	-
合计	-

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	41,177.69
其中：交易所市场	41,177.69
银行间市场	-
-	-
应付利息	-
预提费用	3,967.52
合计	45,145.21

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	117,255,540.68	117,255,540.68
本期申购	13,648,433.40	13,648,433.40
本期赎回（以“-”号填列）	-17,988,727.02	-17,988,727.02
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	112,915,247.06	112,915,247.06

6.4.7.11 其他综合收益

单位：人民币元

项目	期初余额	本期发生金额				期末余额
		本期所得税前发生额	减：前期计入其他综合收益当期转入损益	减：前期计入其他综合收益当期转入留存收益	减：所得税费用	
一、不能重分类进损益的其他综合收益	-	-	-	-	-	-
其中：其他权益工具投资公允价值变动	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
二、将重分类进损益的其他综合收益	-	-	-	-	-	-
其中：其他债权投资公允价值变动	-	-	-	-	-	-
其他债权投资信用减值准备	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-	-

6.4.7.12 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
本期期初	53,212,611.03	-44,086,172.45	9,126,438.58
本期利润	-6,697,874.13	-14,550,818.16	-21,248,692.29
本期基金份额交易产生的变动数	-1,872,924.87	2,508,032.91	635,108.04
其中：基金申购款	5,955,571.28	-6,707,216.42	-751,645.14
基金赎回款	-7,828,496.15	9,215,249.33	1,386,753.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	44,641,812.03	-56,128,957.70	-11,487,145.67

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日

活期存款利息收入	26,620.73
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	19,438.64
其他	228.01
合计	46,287.38

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-6,952,676.92
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	-6,952,676.92

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	49,447,514.93
减：卖出股票成本总额	56,201,669.10
减：交易费用	198,522.75
买卖股票差价收入	-6,952,676.92

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
出借证券现金清偿总额	-
减：出借证券成本总额	-
减：应收证券出借利息	-
减：交易费用	-
证券出借差价收入	-

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	85.07

债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-3.17
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	81.90

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-
减：应计利息总额	-
减：交易费用	3.17
买卖债券差价收入	-3.17

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
赎回基金份额对价总额	-
减：现金支付赎回款总额	-
减：赎回债券成本总额	-
减：赎回债券应计利息总额	-
减：交易费用	-
赎回差价收入	-

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
申购基金份额对价总额	-
减：现金支付申购款总额	-
减：申购债券成本总额	-
减：申购债券应计利息总额	-
减：交易费用	-
-	-
申购差价收入	-

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
资产支持证券投资收益——利息收入	-
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券 差价收入	-
资产支持证券投资收益——赎回差价收入	-
资产支持证券投资收益——申购差价收入	-
合计	-

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	-
减：卖出资产支持证券成本总额	-
减：应计利息总额	-
减：交易费用	-
资产支持证券投资收益	-

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
赎回基金份额对价总额	-
减：现金支付赎回款总额	-
减：赎回资产支持证券成本总额	-
减：赎回资产支持证券应计利息总额	-
减：交易费用	-
赎回差价收入	-

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
申购基金份额对价总额	-
减：现金支付申购款总额	-
减：申购资产支持证券成本总额	-
减：申购资产支持证券应计利息总额	-
减：交易费用	-
-	-
申购差价收入	-

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入	-
贵金属投资收益——赎回差价收入	-
贵金属投资收益——申购差价收入	-
合计	-

6.4.7.17.2 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
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出贵金属成交总额	-
减：卖出贵金属成本总额	-
减：交易费用	-
减：买卖贵金属差价收入应缴纳增值税额	-
买卖贵金属差价收入	-

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
赎回贵金属份额对价总额	-
减：现金支付赎回款总额	-
减：赎回贵金属成本总额	-
减：交易费用	-
赎回差价收入	-

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
申购贵金属份额总额	-
减：现金支付申购款总额	-
减：申购贵金属成本总额	-
减：交易费用	-
-	-
申购差价收入	-

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出权证成交总额	-
减：卖出权证成本总额	-

减：交易费用	-
减：买卖权证差价收入应缴纳 增值税额	-
买卖权证差价收入	-

6.4.7.18.2 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	79,931.67

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	541,801.83
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	541,801.83

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-14,550,818.16
股票投资	-14,550,868.08
债券投资	49.92
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	-14,550,818.16

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	27,236.49
-	-

合计	27,236.49
----	-----------

6.4.7.22 信用减值损失

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
银行存款	-
买入返售金融资产	-
债权投资	-
其他债权投资	-
其他	-
-	-
合计	-

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	3,967.52
信息披露费	-
证券出借违约金	-
汇划手续费	50.00
银行账户维护费	360.00
合计	4,377.52

6.4.7.24 分部报告

本集合计划目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本集合计划无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本集合计划无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本集合计划本报告期存在控制关系或其他重大影响关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
申万宏源证券有限公司	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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月19日（基金合同生效日） 至2021年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 （%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 （%）
申万宏源证券	102,788,182.23	100.00	385,853,383.97	100.00

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月19日（基金合同生效日）至 2021年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 （%）	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 （%）
申万宏源证券	31,665.00	100.00	-	-

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月19日（基金合同生效日） 至2021年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 （%）	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 （%）
申万宏源证券	1,511,320,000.00	100.00	2,444,900,000.00	100.00

6.4.10.1.4 权证交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月19日（基金合同生效日）至 2021年6月30日	
	成交金额	占当期权证 成交总额的比例 （%）	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。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
申万宏源证券	140,406.83	100.00	41,177.69	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月19日（基金合同生效日）至2021年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
申万宏源证券	479,902.68	100.00	142,112.38	100.00

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 2021年1月19日（基金合 同生效日）至2021年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	628,742.83	732,349.82
其中：支付销售机构的客户维护费	104,825.40	126,472.47

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

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

H 为每日应计提的集合计划管理费

E 为前一日的集合计划资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 2021年1月19日（基金合 同生效日）至2021年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	78,592.86	91,543.72

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

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

H 为每日应计提的集合计划托管费

E 为前一日的集合计划资产净值

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	当期发生的基金应支付的销售服务费	
	申万宏源红利成长	
-	-	
合计	-	
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021 年 1 月 19 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日	
	当期发生的基金应支付的销售服务费	
	申万宏源红利成长	
-	-	
合计	-	

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2021 年 1 月 19 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-

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。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

单位：人民币元

本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
-	-	-	-	-
上年度可比期间 2021 年 1 月 19 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额

-	-	-	-	-
---	---	---	---	---

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。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

单位：人民币元

本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量（单位：股）	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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2021 年 1 月 19 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量（单位：股）	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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 19 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2021 年 1 月 19 日）持有的基金份额	-	11,000,000.00
报告期初持有的基金份额	11,000,000.00	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	11,000,000.00

报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	9.7400%	6.5600%
-------------------------	---------	---------

注：管理人投资本集合计划按照公告的费率条款执行，不存在费率优惠的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2022年6月30日		上年度末 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（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）
-	-	-	-	-

注：本集合计划除基金管理人之外的其他关联方本报告期末及上年度末均未投资本集合计划。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30 日		上年度可比期间 2021年1月19日（基金合同生效日）至2021 年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份 有限公司	7,257,557.99	26,620.73	11,514,256.22	64,000.43

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2022年1月1日至2022年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 张）	总金额
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2021年1月19日（基金合同生效日）至2021年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 张）	总金额
-	-	-	-	-	-

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。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

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

注：本集合计划本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末(2022年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	受限期	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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	受限期	流通受限 类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 (单 位：张)	期末 成本总额	期末估 值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6.4.12.1.3 受限证券类别：资产支持证券										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	受限期	流通受限 类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 (单 位：张)	期末 成本总额	期末估 值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6.4.12.1.4 受限证券类别：权证										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	受限期	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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

注：本集合计划无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

注：本集合计划本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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：本集合计划本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本集合计划本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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：本集合计划本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本集合计划是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。

6.4.13.2 信用风险

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

本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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
-	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
-	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
-	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	31,496.70	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
-	-	-
未评级	0.00	0.00
合计	31,496.70	0.00

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
-	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
-	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

6.4.13.3 流动性风险

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

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

针对第二类投资品种的流动性风险，管理人持续监控各项流动性指标，包括组合持仓集中度、投资组合在短时间内变现能力、流通受限资产的比例等指标，通过指标来持续地评估、选择、跟踪和控制投资组合的投资流动性风险。管理人已建立压力测试机制，针对不同类型投资组合建立

流动性压力测试模型，对各相关风险因子进行极端假设，进而评估对投资组合流动性的负面影响。同时，建立流动性风险应急机制，在发生或发现潜在较大的流动性风险时，管理人会立即启动应急机制。

6.4.13.3.1 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 2022 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
资产				
-	-	-	-	-
资产总计	-	-	-	-
负债				
-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	-
流动性净额	-	-	-	-
上年度末 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	-	-	-	-

6.4.13.3.2 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管理措施来管理本集合计划从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。

综合上述各项流动性指标的监测结果、流动性风险管理措施的实施以及本集合计划的资产和负债情况，本集合计划本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	7,257,557.99	-	-	-	7,257,557.99
结算备付金	2,815,679.78	-	-	-	2,815,679.78
存出保证金	17,793.92	-	-	-	17,793.92
交易性股票投资	-	-	-	71,201,767.24	71,201,767.24
交易性债券投资	31799.99	-	-	-	31799.99
买入返售金融资产	24,103,268.28	-	-	-	24,103,268.28
应收申购款	-	-	-	4,995.00	4,995.00
应收证券清算款	-	-	-	39,442.05	39,442.05
资产总计	34,226,099.96	-	-	71,246,204.29	105,472,304.25
负债					
应付赎回款	-	-	-	22,146.07	22,146.07
应付管理人报酬	-	-	-	97,762.78	97,762.78
应付托管费	-	-	-	12,220.31	12,220.31
应付交易费用	-	-	-	41,177.69	41,177.69
应交税费	-	-	-	3,829,259.80	3,829,259.80
预提费用	-	-	-	3,967.52	3,967.52
应付证券清算款	-	-	-	37,668.69	37,668.69
负债总计	0.00	-	-	4,044,202.86	4,044,202.86
利率敏感度缺口	34,226,099.96	-	-	67,202,001.43	101,428,101.39
上年度末 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	-	-	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：表中所示为本集合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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
	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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	1. 市场利率下降 25个基点	259.85	-
	2. 市场利率上升 25个基点	-259.85	-

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本集合计划的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
银行存款	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资 产	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
其它资产	-	-	-	-
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的 负债				
应付清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报 酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务 费	-	-	-	-
应付投资顾问 费	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净	-	-	-	-

额				
项目	上年度末 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	-	-	-	-

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	-		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	-	-	-

6.4.13.4.3 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集合计划所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日		上年度末 2021年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	71,201,767.24	70.20	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	31,799.99	0.03	-	-
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	71,233,567.23	70.23	88,583,610.55	70.09

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
	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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）

			31 日)
分析	业绩比较基准上升 5%	4,984,759.71	6,200,852.74
	业绩比较基准下降 5%	-4,984,759.71	-6,200,852.74

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

假设	-		
	-		
	-		
分析	风险价值 (单位: 人民币元)	本期末 (2022 年 6 月 30 日)	上年度末 (2021 年 12 月 31 日)
	-	-	-
	合计	-	-

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

(1) 金融资产及金融负债的确认和初始计量 金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时, 于资产负债表内确认。

在初始确认时, 金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债, 相关交易费用直接计入当期损益; 对于其他类别的金融资产或金融负债, 相关交易费用计入初始确认金额。对于未包含重大融资成分或不考虑不超过一年的合同中的融资成分的应收账款, 本基金按照预期有权收取的对价作为初始确认金额。

(2) 金融资产的分类和后续计量

(a) 本基金金融资产的分类

本基金通常根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征, 在初始确认时将金融资产分为不同类别: 以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式, 在此情形下, 所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类, 否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融

资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

—本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；

—该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产：

—本基金管理该金融资产的业务模式既以收取合同现金流量为目标又以出售该金融资产为目标；

—该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

对于非交易性权益工具投资，本基金可在初始确认时将其不可撤销地指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。该指定在单项投资的基础上作出，且相关投资从发行者的角度符合权益工具的定义。

除上述以摊余成本计量和以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产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。在初始确认时，如果能够消除或显著减少会计错配，本基金可以将本应以摊余成本计量或以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产不可撤销地指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

(b) 本基金金融资产的后续计量

—以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产初始确认后，对于该类金融资产以公

允价值进行后续计量，产生的利得或损失(包括利息和股利收入)计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

一以摊余成本计量的金融资产初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

一以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的债权投资

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量。采用实际利率法计算的利息、减值损失或利得及汇兑损益计入当期损益，其他利得或损失计入其他综合收益。终止确认时，将之前计入其他综合收益的累计利得或损失从其他综合收益中转出，计入当期损益。

一以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的权益工具投资初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量。股利收入计入损益，其他利得或损失计入其他综合收益。终止确认时，将之前计入其他综合收益的累计利得或损失从其他综合收益中转出，计入留存收益。

(3) 金融负债的分类和后续计量

本基金将金融负债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、财务担保负债及以摊余成本计量的金融负债。

一以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债(含属于金融负债的衍生工具)和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失(包括利息费用)计入当期损益。

一财务担保负债财务担保合同指，当特定债务人到期不能按照最初或修改后的债务工具条款偿付债务时，要求本基金向蒙受损失的合同持有人赔付特定金额的合同。

初始确认后，财务担保合同相关收益依据相关会计政策的规定分摊计入当期损益。财务担保负债以按照依据金融工具的减值原则所确定的损失准备金额以及其初始确认金额扣除财务担保合同相关收益的累计摊销额后的余额孰高进行后续计量。一以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	71,233,567.23	88,160,691.32
第二层次	-	253,008.00
第三层次	-	169,911.23
合计	71,233,567.23	88,583,610.55

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本集合计划本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本集合计划本期未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本集合计划本期未持有不以公允价值计量的金融工具。

6.4.15 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：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

(a) 第二层次的公允价值计量

对于本集合计划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，本集合计划不会于停牌期间、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。本集合计划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

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	71,201,767.24	67.51

	其中：股票	71,201,767.24	67.51
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	31,799.99	0.03
	其中：债券	31,799.99	0.03
	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	24,103,268.28	22.85
	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	10,073,237.77	9.55
-	-	-	-
8	其他各项资产	62,230.97	0.06
9	合计	105,472,304.25	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	168,850.00	0.17
B	采矿业	-	-
C	制造业	38,615,988.24	38.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,647,130.00	2.61
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	550,740.00	0.54
G	交通运输、仓储和邮政业	76,580.00	0.08
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,352,744.00	8.24
J	金融业	16,039,993.00	15.81
K	房地产业	1,934,530.00	1.91
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,900,536.00	1.87
N	水利、环境和公共设施管理业	362,936.00	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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	551,740.00	0.54
S	综合	-	-
	合计	71,201,767.24	70.20

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000977	浪潮信息	166,700	4,414,216.00	4.35
2	002013	中航机电	357,400	4,413,890.00	4.35
3	002465	海格通信	453,400	4,121,406.00	4.06
4	002415	海康威视	89,100	3,225,420.00	3.18
5	601688	华泰证券	217,000	3,081,400.00	3.04
6	002236	大华股份	157,000	2,577,940.00	2.54
7	000001	平安银行	153,000	2,291,940.00	2.26
8	000738	航发控制	80,800	2,270,480.00	2.24
9	600905	三峡能源	332,000	2,088,280.00	2.06
10	603859	能科科技	62,600	1,900,536.00	1.87
11	600372	中航电子	93,700	1,816,843.00	1.79
12	601398	工商银行	380,000	1,812,600.00	1.79
13	601166	兴业银行	81,000	1,611,900.00	1.59
14	601211	国泰君安	106,000	1,611,200.00	1.59
15	601318	中国平安	34,100	1,592,129.00	1.57
16	601288	农业银行	500,000	1,510,000.00	1.49
17	002230	科大讯飞	36,200	1,492,164.00	1.47
18	000792	盐湖股份	42,600	1,276,296.00	1.26
19	300253	卫宁健康	130,500	1,145,790.00	1.13
20	600837	海通证券	115,000	1,128,150.00	1.11
21	300627	华测导航	31,360	1,078,470.40	1.06
22	600050	中国联通	300,000	1,038,000.00	1.02
23	002439	启明星辰	50,400	1,004,472.00	0.99
24	002777	久远银海	69,300	996,534.00	0.98
25	000002	万科 A	47,000	963,500.00	0.95
26	002407	多氟多	18,000	880,380.00	0.87
27	601998	中信银行	185,000	878,750.00	0.87
28	002008	大族激光	25,900	858,067.00	0.85
29	688518	联赢激光	25,000	849,750.00	0.84
30	002212	天融信	75,200	763,280.00	0.75
31	688012	中微公司	6,500	758,875.00	0.75
32	688300	联瑞新材	9,270	719,815.50	0.71
33	600048	保利发展	41,000	715,860.00	0.71
34	300481	濮阳惠成	30,000	705,000.00	0.70

35	002138	顺络电子	24,000	654,000.00	0.64
36	300790	宇瞳光学	33,000	630,960.00	0.62
37	002405	四维图新	40,000	602,800.00	0.59
38	688519	南亚新材	21,236	601,615.88	0.59
39	000938	紫光股份	29,000	562,600.00	0.55
40	600038	中直股份	12,100	546,920.00	0.54
41	002475	立讯精密	14,000	473,060.00	0.47
42	600196	复星医药	10,500	462,945.00	0.46
43	601928	凤凰传媒	60,400	431,860.00	0.43
44	000028	国药一致	14,100	420,039.00	0.41
45	603087	甘李药业	8,600	412,542.00	0.41
46	600089	特变电工	14,000	383,460.00	0.38
47	600733	北汽蓝谷	40,000	370,800.00	0.37
48	600163	中闽能源	43,000	363,350.00	0.36
49	601200	上海环境	35,000	355,600.00	0.35
50	688168	安博通	9,800	351,820.00	0.35
51	300379	东方通	19,800	348,678.00	0.34
52	002859	洁美科技	12,600	346,752.00	0.34
53	600183	生益科技	20,000	339,800.00	0.34
54	600908	无锡银行	60,000	337,800.00	0.33
55	300348	长亮科技	31,700	306,222.00	0.30
56	600438	通威股份	5,000	299,300.00	0.30
57	600552	凯盛科技	25,000	283,250.00	0.28
58	603722	阿科力	5,500	277,365.00	0.27
59	688268	华特气体	3,700	259,962.00	0.26
60	000768	中航西飞	8,500	257,465.00	0.25
61	001979	招商蛇口	19,000	255,170.00	0.25
62	000060	中金岭南	45,000	200,700.00	0.20
63	300236	上海新阳	6,000	198,600.00	0.20
64	600795	国电电力	50,000	195,500.00	0.19
65	600585	海螺水泥	5,500	194,040.00	0.19
66	601128	常熟银行	24,100	184,124.00	0.18
67	300480	光力科技	9,479	170,053.26	0.17
68	002253	川大智胜	13,000	161,720.00	0.16
69	300447	全信股份	7,800	158,886.00	0.16
70	300451	创业慧康	19,620	141,264.00	0.14
71	002727	一心堂	5,700	130,701.00	0.13
72	600373	中文传媒	12,000	119,880.00	0.12
73	000547	航天发展	10,000	119,400.00	0.12
74	600521	华海药业	5,000	113,500.00	0.11
75	300114	中航电测	9,700	113,296.00	0.11
76	002714	牧原股份	2,000	110,540.00	0.11

77	601012	隆基绿能	1,200	79,956.00	0.08
78	601298	青岛港	14,000	76,580.00	0.08
79	000858	五粮液	300	60,579.00	0.06
80	000998	隆平高科	3,500	58,310.00	0.06
81	688089	嘉必优	1,661	54,397.75	0.05
82	002436	兴森科技	1,900	21,413.00	0.02
83	000888	峨眉山 A	800	7,336.00	0.01
84	301068	大地海洋	63	1,521.45	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601398	工商银行	5,034,500.00	3.98
2	002465	海格通信	4,273,817.00	3.38
3	002013	中航机电	3,689,240.00	2.92
4	601688	华泰证券	3,539,742.00	2.80
5	601211	国泰君安	2,215,790.00	1.75
6	000977	浪潮信息	2,134,649.00	1.69
7	600905	三峡能源	2,095,920.00	1.66
8	601318	中国平安	1,710,450.00	1.35
9	601166	兴业银行	1,616,140.00	1.28
10	000001	平安银行	1,545,810.00	1.22
11	601288	农业银行	1,507,000.00	1.19
12	000792	盐湖股份	1,278,183.00	1.01
13	600837	海通证券	1,050,320.00	0.83
14	603859	能科科技	1,036,499.00	0.82
15	300480	光力科技	887,022.00	0.70
16	000002	万科 A	875,780.00	0.69
17	688518	联赢激光	855,722.56	0.68
18	002777	久远银海	818,936.00	0.65
19	688012	中微公司	770,442.72	0.61
20	002407	多氟多	740,460.00	0.59

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601398	工商银行	5,555,800.00	4.40
2	600372	中航电子	3,080,409.00	2.44
3	000547	航天发展	2,785,406.00	2.20
4	000738	航发控制	2,183,805.00	1.73

5	002439	启明星辰	2,156,327.00	1.71
6	601012	隆基绿能	1,659,613.00	1.31
7	300253	卫宁健康	1,638,704.00	1.30
8	600733	北汽蓝谷	1,491,700.00	1.18
9	601607	上海医药	1,213,095.00	0.96
10	000768	中航西飞	1,185,460.00	0.94
11	002415	海康威视	1,183,480.00	0.94
12	600795	国电电力	1,141,632.00	0.90
13	002212	天融信	1,027,358.00	0.81
14	600456	宝钛股份	910,120.00	0.72
15	002727	一心堂	866,410.00	0.69
16	688586	江航装备	852,715.43	0.67
17	600438	通威股份	844,870.00	0.67
18	601127	赛力斯	742,920.00	0.59
19	601998	中信银行	700,650.00	0.55
20	600038	中直股份	698,690.00	0.55

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	53,370,693.87
卖出股票收入（成交）总额	49,449,888.36

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	31,799.99	0.03
8	同业存单	-	-
-	-	-	-
9	其他	-	-
10	合计	31,799.99	0.03

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110059	浦发转债	300	31,799.99	0.03

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

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

注：本集合计划本报告期末未持有资产支持证券

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

金额单位：人民币元

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

注：本集合计划本报告期末未持有贵金属

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

金额单位：人民币元

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

注：本集合计划本报告期末未持有权证

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 本期国债期货投资政策**

-

7.11.2 本期国债期货投资评价

-

7.12 投资组合报告附注**7.12.1**

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

7.12.2

本集合计划本报告期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。

7.12.3 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	17,793.92
2	应收清算款	39,442.05
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,995.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
-	-	-
8	其他	-
9	合计	62,230.97

7.12.4 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 (%)
1	110059	浦发转债	31,799.99	0.03

7.12.5 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：本报告期末本集合计划前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

-

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
1,448	77,980.14	11,389,883.91	10.09	101,525,363.15	89.91

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
----	------------	--------------

基金管理人所有从业人员持有本基金	6,996,026.06	6.2000
------------------	--------------	--------

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021年1月19日） 基金份额总额	66,700,266.22
本报告期期初基金份额总额	117,255,540.68
本报告期基金总申购份额	13,648,433.40
减：本报告期基金总赎回份额	17,988,727.02
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	112,915,247.06

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本集合计划未召开份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，管理人高级管理人员变动如下：

2022年4月26日起，毛宗平出任合规总监，房庆利不再担任公司执行委员会成员。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本集合计划本报告期投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本集合计划未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
申万宏源证券	2	102,788,182.23	100.00	140,406.83	100.00	-

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
申万宏源证券	31,665.00	100.00	1,511,320,000.00	100.00	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	申万宏源证券有限公司关于旗下资产管理产品执行新金融工具相关会计准则的公告	中国证监会规定披露媒介	2022年1月13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基金产品资料概要更新	中国证监会规定披露媒介	2022年1月19日
3	申万宏源红利成长混合型集合资产管理计划更新招募说明书	中国证监会规定披露媒介	2022年1月19日
4	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	2022年5月06日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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

机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
-							

注：本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，未发现影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、《申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》；
- 2、《申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划托管协议》；
- 3、《申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划招募说明书》；
- 4、《申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划基金产品资料概要》；
- 5、管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内披露的各项公告。

12.2 存放地点

上海市徐汇区长乐路 989 号 40 层

12.3 查阅方式

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

咨询电话：95523

公司网址：<http://www.swhysc.com>

申万宏源证券有限公司

2022 年 8 月 31 日