

申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资
产管理计划
2023 年中期报告

2023 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：2023 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 2023 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 2023 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
§ 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	9
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	10
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	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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）	12
6.1 资产负债表	12
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	18
§ 7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
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	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	42
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	42

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	42
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	43
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	43
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	43
7.12 投资组合报告附注	43
§ 8 基金份额持有人信息	44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	44
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	44
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	44
§ 9 开放式基金份额变动	44
§ 10 重大事件揭示	45
10.1 基金份额持有人大会决议	45
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	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	45
10.4 基金投资策略的改变	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	45
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	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	45
10.8 其他重大事件	46
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	46
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	46
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	46
§ 12 备查文件目录	46
12.1 备查文件目录	46
12.2 存放地点	47
12.3 查阅方式	47

§ 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
基金主代码	970015
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	98,392,646.77 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	本集合计划根据各项重要的经济指标分析宏观经济发展变动趋势，判断当前所处的经济周期，进而对未来做出科学预测。在此基础上，结合对流动性及资金流向的分析，综合股市和债市估值及风险分析进行资产配置。 本集合计划主要投资于中国 A 股市场上高增长高分红能力的上市公司。在个股选择上，本集合计划将采用定量和定性分析相结合的系统方法精选受益于分红能力强、成长性较高且估值合理的股票构建股票组合。 本集合计划的投资策略还包括债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、融资投资策略、现金类资产投资策略等。
业绩比较基准	60%×沪深 300 指数+40%×上证国债指数
风险收益特征	本集合计划为混合型集合资产管理计划，其预期收益及预期风险水

	平低于股票型基金、股票型集合资产管理计划，高于债券型基金、债券型集合资产管理计划、货币市场基金及现金管理类集合资产管理计划。
--	--

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		申万宏源证券有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨玉成	王小飞
	联系电话	021-33389888	021-60637103
	电子邮箱	yangyucheng@swhysec.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		95523	021-60637228
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.swhysec.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(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	751,389.40
本期利润	9,817,428.23
加权平均基金份额本期利润	0.0971
本期加权平均净值利润率	10.58%
本期基金份额净值增长率	11.18%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-7,089,615.60
期末可供分配基金份额利润	-0.0721
期末基金资产净值	91,303,031.17
期末基金份额净值	0.9279
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)

基金份额累计净值增长率	-6.61%
-------------	--------

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，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。

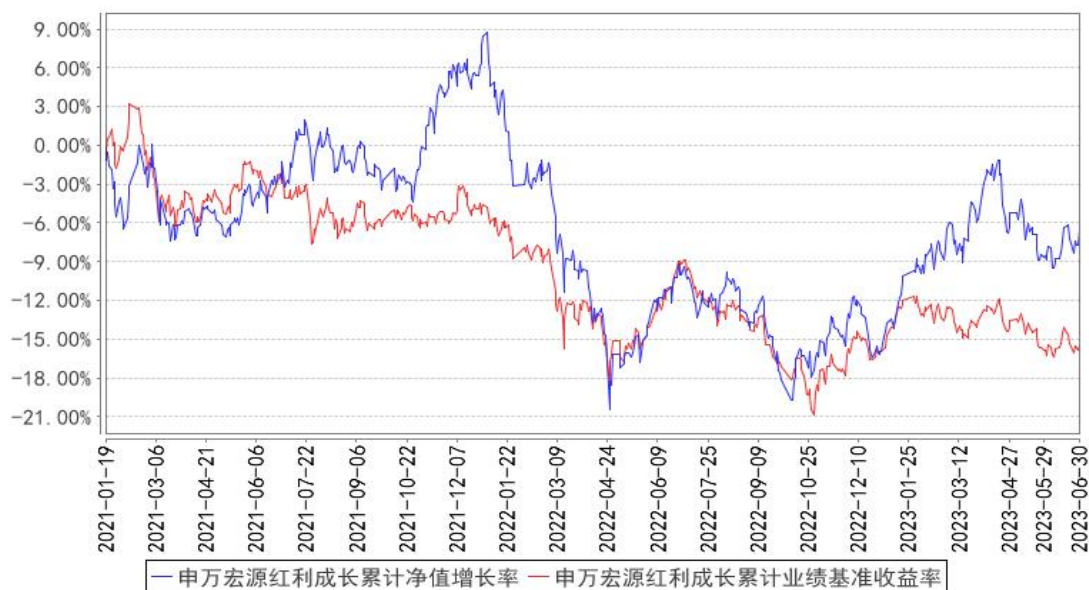
3.2 基金净值表现

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	2.50%	0.78%	0.88%	0.52%	1.62%	0.26%
过去三个月	-1.74%	0.85%	-2.53%	0.49%	0.79%	0.36%
过去六个月	11.18%	0.84%	0.50%	0.51%	10.68%	0.33%
过去一年	3.30%	0.83%	-7.25%	0.59%	10.55%	0.24%
自基金合同生效起至今	-6.61%	0.90%	-15.57%	0.69%	8.96%	0.21%

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

申万宏源红利成长累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金业绩比较基准收益率=60%×沪深 300 指数+40%×上证国债指数；

2、本基金合同自 2021 年 1 月 19 日起生效，管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基

金的投资组合比例符合基金合同的有关约定，目前基金的投资组合比例已符合基金合同的有关约定。

§ 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 2023 年 6 月 30 日，集合资产管理计划管理人共管理 6 只公募集合资产管理计划，分别为申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划、申万宏源灵通快利短期债券型集合资产管理计划、申万宏源天添利货币型集合资产管理计划、申万宏源天天增货币型集合资产管理计划、申万宏源双季增享 6 个月持有期债券型集合资产管理计划、申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
秦庆	本基金的基金经理	2019 年 4 月 15 日	-	15 年	权益投资决策委员会委员、权益公募投资决策小组组长，国籍为中国，工学硕士，曾任职于基金公司、泰康资管权益投资部，从事通信、电子、计算机、传媒等行业研究工作。2013 年 6 月加入原宏源证券北京资管分公司权益投资部，曾担任宏源证券宏源 10 号股债双鑫集合资产管理计划、宏源证券股债双丰集合资产管理计划投资主办人，拥有丰富的投资运营管理经

					验，不存在其他兼职情况。该投资经理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。
陈旻	本基金的基金经理	2019年4月15日	-	19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。该投资经理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。

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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 上半年，A 股市场各大类指数涨跌互现，其中上证指数涨 3.65%，沪深 300 跌 0.75%，中证 500 涨 2.29%，创业板指跌 5.61%。

上半年国内经济整体呈现弱复苏态势，通胀水平回落至历史相对低位。从经济结构角度观察，基建和制造业投资延续一定韧性，地产投资仍较为低迷，销售面积及新开工在一季度释放积压需求后再次平淡；服务消费持续回暖，总体消费持续一定的复苏态势；受外需回落、基数较高等因素影响，出口景气度逐步回落。央行继续实行稳健货币政策，货币政策传导效率增强，信贷整体保持扩张态势。股票市场在整体震荡的环境下，小盘风格表现相对较好。行业层面上，通信、传媒、计算机、机械设备、家用电器等行业表现较好，而商贸零售、房地产、美容护理、建筑材料等行业表现相对落后。

报告期内，本集合计划继续增加了权益类资产的仓位，截至期末，最新权益类资产仓位已达

九成。期间管理人使用景气价值比较体系，对持仓结构进行了动态调整，目前主要聚焦于估值历史分位数偏低、中长期内生增长动力较足、政策支持力度较大的泛高端制造板块（以科技、军工、新能源等行业为代表）以及受益未来经济复苏的质优价值蓝筹核心企业。

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，管理人会根据基于客观数据的各类型基本面和估值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 0.9279 元；本报告期基金份额净值增长率为 11.18%，同期业绩比较基准收益率为 0.50%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望今年下半年到明年，国内有望迎来一轮多维度共振的经济复苏，三季度 PPI、M1 同比增速等宏观经济指标有望触底反弹，CPI、核心 CPI 等通胀指标在年内仍将维持在相对低位，预计货币政策将保持稳健，流动性仍将合理宽裕，整体无忧，信用端将继续积极的扩张态势。在此宏观背景下，未来 12-18 个月，A 股市场有望进入经济向上，场内流动性适度的健康牛。

目前时点展望未来，管理人相对看好以下几方面投资机会：一是科技类中的电子和半导体板块的投资机会，行业从下半年开始周期性向上以及部分领域面临成长性拐点、代表经济转型以及政策支持的方向、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核心企业的性价比为突出；二是其他成长类板块中，经过景气价值体系的比较后，管理人认为军工、新能源车产业链以及智能驾驶等板块的投资机会相对较好；三是传统价值蓝筹板块中，我们认为券商和工业金属板块的投资性价比更高。

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，制定了集合计划估值的业务管理制度，建立了估值委员会，使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制。本集合计划托管人审阅本集合计划管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查集合计划资产净值和集合计划份额申购、赎回价格。会计师事务所在估值调整导致集合计划资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未实施利润分配，符合本基金基金合同的相关规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

- 1、本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的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	7,367,322.58	6,805,978.48
结算备付金		1,983,448.53	2,371,657.47
存出保证金		7,276.99	9,979.72
交易性金融资产	6.4.7.2	82,577,967.38	74,459,611.33
其中：股票投资		82,132,837.92	73,898,038.08
基金投资		-	-
债券投资		445,129.46	561,573.25
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	3,398,938.23	6,442,870.90
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		169,195.58	353,736.76
应收股利		-	-
应收申购款		274,725.27	3,996.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		95,778,874.56	90,447,830.66
负债和净资产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022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		318,671.98	577,543.47
应付赎回款		10,721.30	-
应付管理人报酬		89,621.40	89,802.87
应付托管费		11,202.65	11,225.37
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		3,828,344.16	3,828,634.09
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	217,281.90	47,891.12
负债合计		4,475,843.39	4,555,096.92
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	98,392,646.77	102,910,449.13
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-7,089,615.60	-17,017,715.39
净资产合计		91,303,031.17	85,892,733.74
负债和净资产总计		95,778,874.56	90,447,830.66

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.9279 元，基金份额总额 98,392,646.77 份。

6.2 利润表

会计主体：申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		10,528,388.65	-20,535,424.02
1. 利息收入		95,551.28	319,019.17
其中：存款利息收入	6.4.7.9	38,901.53	46,287.38
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		56,649.75	272,731.79
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,267,004.04	-6,330,861.52
其中：股票投资收益	6.4.7.10	223,325.24	-6,952,676.92
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	5,832.07	81.90
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	79,931.67
股利收益	6.4.7.15	1,037,846.73	541,801.83
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）	6.4.7.16	9,066,038.83	-14,550,818.16
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	99,794.50	27,236.49
减：二、营业总支出		710,960.42	713,268.27
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	552,220.67	628,742.83
2. 托管费	6.4.10.2.2	69,027.55	78,592.86
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-

5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		7,242.31	1,555.06
8. 其他费用	6.4.7.18	82,469.89	4,377.52
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		9,817,428.23	-21,248,692.29
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		9,817,428.23	-21,248,692.29
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		9,817,428.23	-21,248,692.29

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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	102,910,449.13	-	-17,017,715.39	85,892,733.74
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）	102,910,449.13	-	-17,017,715.39	85,892,733.74
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-4,517,802.36	-	9,928,099.79	5,410,297.43
（一）、综合收益总	-	-	9,817,428	9,817,428.

额			.23	23
(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)	-4,517,802.36	-	110,671.56	-4,407,130.80
其中：1. 基金申购款	20,597,286.73	-	-1,519,972.94	19,077,313.79
2. 基金赎回款	-25,115,089.09	-	1,630,644.50	-23,484,444.59
(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、本期期末净资产 (基金净值)	98,392,646.77	-	-7,089,615.60	91,303,031.17
项目	上年度可比期间 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、本期期末净资产	112,915,247.06	-	-11,487,1	101,428,10

(基金净值)			45.67	1.39
--------	--	--	-------	------

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>杨玉成</u>	<u>陈秀清</u>	<u>李青海</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”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 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

(1) 印花税

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

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

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

暂免征收印花税。

(2) 增值税

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

(3) 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

(4) 企业所得税

参照财政部、国家税务总局财税字[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。

(5) 个人所得税

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
活期存款	7,367,322.58
等于: 本金	7,365,864.54
加: 应计利息	1,458.04
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	7,367,322.58

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	85,658,878.81	-	82,132,837.92	-3,526,040.89
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	3,428.06	445,129.46	2,527.99
	银行间市场	-	-	-
	合计	3,428.06	445,129.46	2,527.99
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	86,098,052.22	3,428.06	82,577,967.38	-3,523,512.90

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	3,398,938.23	-

银行间市场	-	-
合计	3,398,938.23	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	9.69
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	135,197.32
其中：交易所市场	135,197.32
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	82,074.89
合计	217,281.90

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	102,910,449.13	102,910,449.13
本期申购	20,597,286.73	20,597,286.73
本期赎回（以“-”号填列）	-25,115,089.09	-25,115,089.09
本期末	98,392,646.77	98,392,646.77

6.4.7.8 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
上年度末	37,856,818.69	-54,874,534.08	-17,017,715.39
本期利润	751,389.40	9,066,038.83	9,817,428.23
本期基金份额交易产生的变动数	-1,689,171.59	1,799,843.15	110,671.56
其中：基金申购款	7,690,663.27	-9,210,636.21	-1,519,972.94
基金赎回款	-9,379,834.86	11,010,479.36	1,630,644.50
本期已分配利润	-	-	-
本期末	36,919,036.50	-44,008,652.10	-7,089,615.60

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	26,279.74
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	12,555.86
其他	65.93
合计	38,901.53

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	223,325.24
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	223,325.24

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	40,814,526.49
减：卖出股票成本总额	40,455,074.12
减：交易费用	136,127.13
买卖股票差价收入	223,325.24

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	4,744.88
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,087.19
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	5,832.07

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	138,353.40
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	136,041.53
减：应计利息总额	1,210.85
减：交易费用	13.83
买卖债券差价收入	1,087.19

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

6.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,037,846.73
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,037,846.73

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	9,066,038.83
股票投资	9,045,254.90
债券投资	20,783.93

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	9,066,038.83

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	99,794.50
合计	99,794.50

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	3,967.52
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	35.00
账户维护费	360.00
其他	18,600.00
合计	82,469.89

6.4.7.19 分部报告

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无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，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本集合计划本报告期存在控制关系或其他重大影响关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
申万宏源证券有限公司	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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
申万宏源证券有限公司	69,491,934.82	100.00	102,788,182.23	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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)
申万宏源证券有限公司	138,353.40	100.00	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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
申万宏源证券有限公司	589,976,000.00	100.00	1,511,320,000.00	100.00

6.4.10.1.4 权证交易

注：本报告期及上年度可比期间内，本集合计划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 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
申万宏源证券有 限公司	95,306.20	100.00	135,197.32	100.00
关联方名称	上年度可比期间 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 (%)
申万宏源证券有 限公司	140,406.83	100.00	41,177.69	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 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	552,220.67	628,742.83
其中：支付销售机构的客户维护费	101,869.07	104,825.40

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 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	69,027.55	78,592.86

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

注：无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本报告期及上年度可比期间内，本集合计划未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

注：本报告期及上年度可比期间内，本集合计划未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

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

注：本报告期及上年度可比期间内，本集合计划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	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年6月30日	2022年1月1日至2022年6月30日
基金合同生效日（2021年1月19日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	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	11.18%	9.74%

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

注：本报告期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方，均未发生投资本基金的情况。

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		上年度可比期间	
	2023年1月1日至2023年6月30日		2022年1月1日至2022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	7,367,322.58	26,279.74	7,257,557.99	26,620.73
------------------	--------------	-----------	--------------	-----------

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

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

6.4.12 期末（2023年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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
601298	青岛港	2023年6月28日	重大事项停牌	6.97	2023年07月03日	7.40	76,000	413,675.24	529,720.00	-

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

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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本集合计划是混合型集合资产管理计划，其预期风险和收益水平高于债券型基金、债券型集合资产管理计划、货币市场基金及现金管理类集合资产管理计划，低于股票型基金、股票型集合

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

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

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本期末及上年度末均不涉及。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本期末及上年度末均不涉及。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本期末及上年度末均不涉及。

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	151,329.28	209,853.95
AAA 以下	293,800.18	351,719.30
AA	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	445,129.46	561,573.25

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

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本期末及上年度末均不涉及。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本期末及上年度末均不涉及。

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

注：无

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度管理等措施来管理本集合计划从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 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	7,367,322.58	-	-	-	7,367,322.58
结算备付金	1,983,448.53	-	-	-	1,983,448.53
存出保证金	7,276.99	-	-	-	7,276.99
交易性金融资产	293,800.18	151,329.28	0.00	82,132,837.92	82,577,967.38
买入返售金融资产	3,398,938.23	-	-	-	3,398,938.23
应收申购款	-	-	-	274,725.27	274,725.27
应收证券清算款	-	-	-	169,195.58	169,195.58
资产总计	13,050,786.51	151,329.28	0.00	82,576,758.77	95,778,874.56

负债					
应付证券清算款	-	-	-	318,671.98	318,671.98
应付赎回款	-	-	-	10,721.30	10,721.30
应付管理人报酬	-	-	-	89,621.40	89,621.40
应付托管费	-	-	-	11,202.65	11,202.65
应交税费	-	-	-	3,828,344.16	3,828,344.16
其他负债	-	-	-	217,281.90	217,281.90
负债总计	0.00	0.00	0.00	4,475,843.39	4,475,843.39
利率敏感度缺口	13,050,786.51	151,329.28	0.00	78,100,915.38	91,303,031.17
上年度末 2022 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	6,805,978.48	-	-	-	6,805,978.48
结算备付金	2,371,657.47	-	-	-	2,371,657.47
存出保证金	9,979.72	-	-	-	9,979.72
交易性金融资产	-	561,573.25	-	73,898,038.08	74,459,611.33
买入返售金融资产	6,442,870.90	-	-	-	6,442,870.90
应收证券清算款	-	-	-	353,736.76	353,736.76
应收申购款	-	-	-	3,996.00	3,996.00
资产总计	15,630,486.57	561,573.25	-	74,255,770.84	90,447,830.66
负债					
应付证券清算款	-	-	-	577,543.47	577,543.47
应付管理人报酬	-	-	-	89,802.87	89,802.87
应付托管费	-	-	-	11,225.37	11,225.37
应付交易费用	-	-	-	39,891.12	39,891.12
应交税费	-	-	-	3,828,634.09	3,828,634.09
预提费用	-	-	-	8,000.00	8,000.00
负债总计	0.00	-	-	4,555,096.92	4,555,096.92
利率敏感度缺口	15,630,486.57	561,573.25	0.00	69,700,673.92	85,892,733.74

注：1. 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。

2. 由于 I9 改造，本期报告应付交易费用、其他应付款、预提费用合并计入其他负债。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	1. 市场利率下降	1,419.12	2,511.92

	25 个基点		
	2. 市场利率上升 25 个基点	-1,419.12	-2,511.92

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	82,132,837.92	89.96	73,898,038.08	86.04
交易性金融资产—基金投资	0.00	0.00	0.00	0.00
交易性金融资产—债券投资	445,129.46	0.49	561,573.25	0.65
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	82,577,967.38	90.45	74,459,611.33	86.69

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）

	业绩比较基准上升 5%	5,758,201.24	5,184,094.13
	业绩比较基准下降 5%	-5,758,201.24	-5,184,094.13

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	82,048,247.38	73,433,950.33
第二层次	529,720.00	1,025,661.00
第三层次	-	-
合计	82,577,967.38	74,459,611.33

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。本基金本报告期持有的持续以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这

些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	82,132,837.92	85.75
	其中：股票	82,132,837.92	85.75
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	445,129.46	0.46
	其中：债券	445,129.46	0.46
	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	3,398,938.23	3.55
	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	9,350,771.11	9.76
8	其他各项资产	451,197.84	0.47
9	合计	95,778,874.56	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	3,664,363.00	4.01
C	制造业	48,709,884.04	53.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,144,961.00	2.35
E	建筑业	1,565,618.00	1.71
F	批发和零售业	321,594.70	0.35
G	交通运输、仓储和邮政业	1,189,312.00	1.30
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,774,948.78	1.94
J	金融业	20,942,709.40	22.94
K	房地产业	1,157,050.00	1.27

L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	169,519.00	0.19
N	水利、环境和公共设施管理业	435,718.00	0.48
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	57,160.00	0.06
S	综合	-	-
	合计	82,132,837.92	89.96

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600372	中航电子	354,428	5,380,217.04	5.89
2	601688	华泰证券	262,300	3,611,871.00	3.96
3	002465	海格通信	252,300	2,608,782.00	2.86
4	000725	京东方 A	603,900	2,469,951.00	2.71
5	600030	中信证券	117,100	2,316,238.00	2.54
6	002475	立讯精密	70,200	2,277,990.00	2.49
7	601211	国泰君安	146,000	2,042,540.00	2.24
8	601318	中国平安	43,500	2,018,400.00	2.21
9	600038	中直股份	44,700	1,779,954.00	1.95
10	000738	航发控制	71,900	1,754,360.00	1.92
11	000001	平安银行	153,900	1,728,297.00	1.89
12	600905	三峡能源	312,000	1,675,440.00	1.84
13	601108	财通证券	209,960	1,520,110.40	1.66
14	601899	紫金矿业	124,400	1,414,428.00	1.55
15	002129	TCL 中环	41,475	1,376,970.00	1.51
16	601166	兴业银行	87,300	1,366,245.00	1.50
17	688300	联瑞新材	28,194	1,318,069.50	1.44
18	000776	广发证券	77,800	1,144,438.00	1.25
19	300627	华测导航	34,860	1,131,904.20	1.24
20	600497	驰宏锌锗	213,000	1,069,260.00	1.17
21	600362	江西铜业	52,500	996,450.00	1.09
22	600498	烽火通信	45,100	918,687.00	1.01
23	300059	东方财富	63,600	903,120.00	0.99
24	600741	华域汽车	48,700	899,002.00	0.98
25	600837	海通证券	96,000	885,120.00	0.97
26	601288	农业银行	245,000	864,850.00	0.95
27	002236	大华股份	43,400	857,150.00	0.94

28	002459	晶澳科技	20,440	852,348.00	0.93
29	688518	联赢激光	30,000	835,800.00	0.92
30	000333	美的集团	13,100	771,852.00	0.85
31	600958	东方证券	79,000	766,300.00	0.84
32	000408	藏格矿业	33,900	765,123.00	0.84
33	600808	马钢股份	290,000	745,300.00	0.82
34	002466	天齐锂业	10,400	727,064.00	0.80
35	300861	美畅股份	16,500	715,605.00	0.78
36	603306	华懋科技	24,200	702,284.00	0.77
37	002738	中矿资源	13,780	701,953.20	0.77
38	000002	万科 A	50,000	701,000.00	0.77
39	002415	海康威视	21,000	695,310.00	0.76
40	601668	中国建筑	118,000	677,320.00	0.74
41	002138	顺络电子	27,300	652,743.00	0.71
42	601168	西部矿业	61,000	641,110.00	0.70
43	603920	世运电路	31,500	615,195.00	0.67
44	000898	鞍钢股份	219,000	608,820.00	0.67
45	300447	全信股份	30,700	589,133.00	0.65
46	601117	中国化学	70,000	579,600.00	0.63
47	600862	中航高科	22,000	556,820.00	0.61
48	600585	海螺水泥	23,400	555,516.00	0.61
49	603118	共进股份	41,000	544,890.00	0.60
50	601298	青岛港	76,000	529,720.00	0.58
51	300481	濮阳惠成	25,700	528,392.00	0.58
52	601998	中信银行	87,000	520,260.00	0.57
53	000625	长安汽车	39,900	515,907.00	0.57
54	002008	大族激光	18,900	495,180.00	0.54
55	688012	中微公司	3,120	488,124.00	0.53
56	000651	格力电器	13,200	481,932.00	0.53
57	000768	中航西飞	18,000	481,500.00	0.53
58	600918	中泰证券	68,000	469,880.00	0.51
59	002439	启明星辰	15,100	449,376.00	0.49
60	601619	嘉泽新能	96,100	437,255.00	0.48
61	000893	亚钾国际	18,500	424,390.00	0.46
62	002273	水晶光电	35,000	417,900.00	0.46
63	000060	中金岭南	85,000	403,750.00	0.44
64	601857	中国石油	53,500	399,645.00	0.44
65	002460	赣锋锂业	6,500	396,240.00	0.43
66	600500	中化国际	70,000	389,200.00	0.43
67	002405	四维图新	33,000	382,140.00	0.42
68	601127	赛力斯	10,000	367,700.00	0.40
69	601377	兴业证券	60,000	367,200.00	0.40
70	600048	保利发展	27,000	351,810.00	0.39

71	002859	洁美科技	12,600	349,020.00	0.38
72	300253	卫宁健康	31,329	338,979.78	0.37
73	601919	中远海控	35,100	329,940.00	0.36
74	300073	当升科技	6,500	327,145.00	0.36
75	600196	复星医药	10,500	324,450.00	0.36
76	600908	无锡银行	60,000	321,600.00	0.35
77	000630	铜陵有色	107,000	309,230.00	0.34
78	605123	派克新材	2,700	293,355.00	0.32
79	300782	卓胜微	3,000	289,890.00	0.32
80	600219	南山铝业	93,000	280,860.00	0.31
81	300398	飞凯材料	15,800	271,602.00	0.30
82	600183	生益科技	18,900	268,380.00	0.29
83	000028	国药一致	6,070	264,712.70	0.29
84	605358	立昂微	7,200	264,456.00	0.29
85	000932	华菱钢铁	55,000	262,350.00	0.29
86	002601	龙佰集团	15,000	247,500.00	0.27
87	002352	顺丰控股	5,400	243,486.00	0.27
88	300760	迈瑞医疗	800	239,840.00	0.26
89	002730	电光科技	25,000	239,500.00	0.26
90	300969	恒帅股份	2,700	238,005.00	0.26
91	601200	上海环境	25,000	237,250.00	0.26
92	601238	广汽集团	22,500	234,450.00	0.26
93	000902	新洋丰	22,800	234,384.00	0.26
94	000938	紫光股份	7,200	229,320.00	0.25
95	600323	瀚蓝环境	10,000	189,300.00	0.21
96	603663	三祥新材	11,800	176,410.00	0.19
97	603297	永新光学	2,200	175,780.00	0.19
98	600438	通威股份	5,000	171,550.00	0.19
99	603355	莱克电气	6,400	162,624.00	0.18
100	300379	东方通	7,800	160,446.00	0.18
101	300373	扬杰科技	3,800	154,166.00	0.17
102	601186	中国铁建	15,000	147,750.00	0.16
103	688115	思林杰	3,800	146,794.00	0.16
104	600028	中国石化	22,000	139,920.00	0.15
105	301221	光庭信息	2,500	139,575.00	0.15
106	603650	彤程新材	4,200	137,760.00	0.15
107	603078	江化微	8,200	136,038.00	0.15
108	002212	天融信	14,000	135,800.00	0.15
109	601390	中国中铁	17,600	133,408.00	0.15
110	600552	凯盛科技	11,000	130,240.00	0.14
111	688608	恒玄科技	1,000	121,030.00	0.13
112	603259	药明康德	1,900	118,389.00	0.13
113	002327	富安娜	14,000	117,880.00	0.13

114	688175	高凌信息	3,500	115,920.00	0.13
115	603722	阿科力	2,100	104,538.00	0.11
116	001979	招商蛇口	8,000	104,240.00	0.11
117	000858	五粮液	600	98,142.00	0.11
118	601198	东兴证券	12,000	96,240.00	0.11
119	688168	安博通	2,700	96,120.00	0.11
120	603215	比依股份	5,000	89,700.00	0.10
121	600879	航天电子	10,000	84,900.00	0.09
122	603309	维力医疗	5,400	83,538.00	0.09
123	000429	粤高速 A	10,000	78,400.00	0.09
124	000977	浪潮信息	1,600	77,600.00	0.08
125	300593	新雷能	2,860	65,522.60	0.07
126	300294	博雅生物	1,700	61,676.00	0.07
127	000100	TCL 科技	15,000	59,100.00	0.06
128	603859	能科科技	1,000	51,130.00	0.06
129	688707	振华新材	1,600	49,264.00	0.05
130	000878	云南铜业	4,000	44,200.00	0.05
131	300393	中来股份	3,000	42,120.00	0.05
132	688303	大全能源	998	40,369.10	0.04
133	600373	中文传媒	3,000	39,960.00	0.04
134	301219	腾远钴业	1,040	38,854.40	0.04
135	688295	中复神鹰	1,000	36,680.00	0.04
136	600406	国电南瑞	1,440	33,264.00	0.04
137	600803	新奥股份	1,700	32,266.00	0.04
138	600655	豫园股份	4,500	30,870.00	0.03
139	600873	梅花生物	3,400	30,362.00	0.03
140	688538	和辉光电	11,700	29,718.00	0.03
141	300376	易事特	4,400	29,480.00	0.03
142	300496	中科创达	300	28,905.00	0.03
143	002340	格林美	4,000	27,640.00	0.03
144	600284	浦东建设	4,500	27,540.00	0.03
145	600782	新钢股份	7,400	27,454.00	0.03
146	603108	润达医疗	1,400	26,012.00	0.03
147	603019	中科曙光	500	25,450.00	0.03
148	600060	海信视像	1,000	24,750.00	0.03
149	603688	石英股份	200	22,768.00	0.02
150	600757	长江传媒	2,000	17,200.00	0.02
151	002920	德赛西威	100	15,581.00	0.02
152	301087	可孚医疗	300	14,790.00	0.02
153	300308	中际旭创	100	14,745.00	0.02
154	688425	铁建重工	2,000	9,620.00	0.01
155	000888	峨眉山 A	800	9,168.00	0.01
156	000063	中兴通讯	200	9,108.00	0.01

157	601000	唐山港	2,200	7,766.00	0.01
158	688041	海光信息	100	6,827.00	0.01
159	002230	科大讯飞	100	6,796.00	0.01
160	002777	久远银海	100	3,547.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600372	中航电子	5,743,422.00	6.69
2	002475	立讯精密	1,815,215.00	2.11
3	002129	TCL 中环	1,427,346.00	1.66
4	600030	中信证券	1,404,140.00	1.63
5	601108	财通证券	1,268,154.80	1.48
6	000776	广发证券	1,246,731.00	1.45
7	600038	中直股份	993,989.00	1.16
8	601127	赛力斯	912,364.00	1.06
9	002013	中航机电	869,276.00	1.01
10	600498	烽火通信	856,180.00	1.00
11	002466	天齐锂业	785,880.00	0.91
12	000408	藏格矿业	783,188.00	0.91
13	002459	晶澳科技	770,871.00	0.90
14	601012	隆基绿能	762,551.00	0.89
15	600362	江西铜业	759,101.00	0.88
16	002738	中矿资源	747,523.00	0.87
17	002415	海康威视	732,015.00	0.85
18	601688	华泰证券	726,716.00	0.85
19	600497	驰宏锌锗	706,280.00	0.82
20	300481	濮阳惠成	636,760.00	0.74

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	002013	中航机电	5,842,592.00	6.80
2	000977	浪潮信息	4,108,056.00	4.78
3	002236	大华股份	2,623,446.00	3.05
4	002415	海康威视	2,361,501.00	2.75
5	688300	联瑞新材	1,727,099.88	2.01
6	600372	中航电子	1,400,008.00	1.63
7	688012	中微公司	1,170,671.20	1.36
8	300308	中际旭创	1,014,015.00	1.18

9	601688	华泰证券	986,193.00	1.15
10	002230	科大讯飞	980,271.00	1.14
11	002465	海格通信	918,500.00	1.07
12	000792	盐湖股份	851,574.00	0.99
13	601288	农业银行	843,380.00	0.98
14	002777	久远银海	824,669.00	0.96
15	603019	中科曙光	790,127.00	0.92
16	000063	中兴通讯	789,327.00	0.92
17	300627	华测导航	713,399.00	0.83
18	601127	赛力斯	604,992.00	0.70
19	300059	东方财富	592,774.00	0.69
20	601012	隆基绿能	544,222.00	0.63

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	39,644,619.06
卖出股票收入（成交）总额	40,814,526.49

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）	445,129.46	0.49
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	445,129.46	0.49

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	127006	敖东转债	2,400	293,800.18	0.32
2	110059	浦发转债	1,400	151,329.28	0.17

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无

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	7,276.99
2	应收清算款	169,195.58
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	274,725.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	451,197.84

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	127006	敖东转债	293,800.18	0.32
2	110059	浦发转债	151,329.28	0.17

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本报告期末本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 (%)
1,154	85,262.26	11,389,883.91	11.58	87,002,762.86	88.42

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	5,791,502.34	5.8861

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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§ 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	102,910,449.13
本报告期基金总申购份额	20,597,286.73
减：本报告期基金总赎回份额	25,115,089.09
本报告期基金拆分变动份额	-

本报告期末基金份额总额	98,392,646.77
-------------	---------------

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本集合计划未召开份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未发生改聘会计师事务所事宜。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，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	4	69,491,934.82	100.00	95,306.20	100.00	-

源证券 有限公 司						
-----------------	--	--	--	--	--	--

注：我公司对交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的。本报告期内本基金租用券商交易单元无变更。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
申万宏源证券有限公司	138,353.40	100.00	589,976,000.00	100.00	-	-

10.8 其他重大事件

注：无

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，未发现影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、《申万宏源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：95523/4008895523

公司网址：www.swhysc.com

申万宏源证券有限公司

2023 年 8 月 31 日