

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 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：兴业银行股份有限公司

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。

基金托管人兴业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	5
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	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
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	51

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	51
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	51
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	51
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51
7.11 投资组合报告附注	51
§ 8 基金份额持有人信息	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
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	53
§ 9 开放式基金份额变动	54
§ 10 重大事件揭示	54
10.1 基金份额持有人大会决议	54
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	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
10.4 基金投资策略的改变	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	55
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	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	55
10.8 其他重大事件	56
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	56
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	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	56
§ 12 备查文件目录	56
12.1 备查文件目录	56
12.2 存放地点	56
12.3 查阅方式	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	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		
基金简称	申万宏源双季增享 6 个月债券		
基金主代码	970188		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2022 年 10 月 13 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	256,585,238.52 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。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。		
下属分级基金的基金简称	申万宏源双季增享 6 个月债券 A	申万宏源双季增享 6 个月债券 B	申万宏源双季增享 6 个月债券 C
下属分级基金的交易代码	970188	970189	970190
报告期末下属分级基金的份额总额	36,478,781.67 份	178,678,826.68 份	41,427,630.17 份

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双季增享 6 个月持有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	本集合计划在追求本金安全、严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力求为持有人提供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。本集合计划的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。本集合计划的投资策略还包括国债期货投资策略、股票投资策略等。
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*10%
风险收益特征	本集合计划为债券型集合资产管理计划，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
信息披露负责人	姓名	杨玉成	龚小武
	联系电话	021-33389888	021-52629999-212056

电子邮箱	yangyucheng@swhysc.com	gongxiaowu@cib.com.cn
客户服务电话	95523	95561
传真	021-33388414	021-62159217
注册地址	上海市徐汇区长乐路 989 号世纪商贸广场 45 层	福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦
办公地址	上海市徐汇区长乐路 989 号世纪商贸广场 45 层	上海市浦东新区银城路 167 号 4 楼
邮政编码	200031	200120
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	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(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)		
	申万宏源双季增享 6 个月债券 A	申万宏源双季增享 6 个月债券 B	申万宏源双季增享 6 个月债券 C
本期已实现收益	421,219.81	4,101,939.49	260,243.83
本期利润	456,968.43	6,054,509.22	221,695.99
加权平均基金份额本期利润	0.0207	0.0296	0.0168
本期加权平均净值利润率	2.03%	2.92%	1.65%
本期基金份额净值增长	2.72%	2.86%	2.59%

率			
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	875,294.37	4,650,596.16	924,195.86
期末可供分配基金份额利润	0.0240	0.0260	0.0223
期末基金资产净值	37,386,030.65	183,485,899.27	42,388,137.67
期末基金份额净值	1.0249	1.0269	1.0232
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	2.13%	2.40%	1.96%

注：(1) 本期已实现收益指本期利息收入、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

申万宏源双季增享 6 个月债券 A

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	0.49%	0.09%	0.28%	0.09%	0.21%	0.00%
过去三个月	1.00%	0.09%	0.33%	0.08%	0.67%	0.01%
过去六个月	2.72%	0.08%	1.06%	0.08%	1.66%	0.00%
自基金合同生效起至今	2.13%	0.07%	0.91%	0.10%	1.22%	-0.03%

申万宏源双季增享 6 个月债券 B

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	0.51%	0.08%	0.28%	0.09%	0.23%	-0.01%
过去三个月	1.07%	0.09%	0.33%	0.08%	0.74%	0.01%
过去六个月	2.86%	0.08%	1.06%	0.08%	1.80%	0.00%
自基金合同生效起至今	2.40%	0.07%	0.64%	0.10%	1.76%	-0.03%

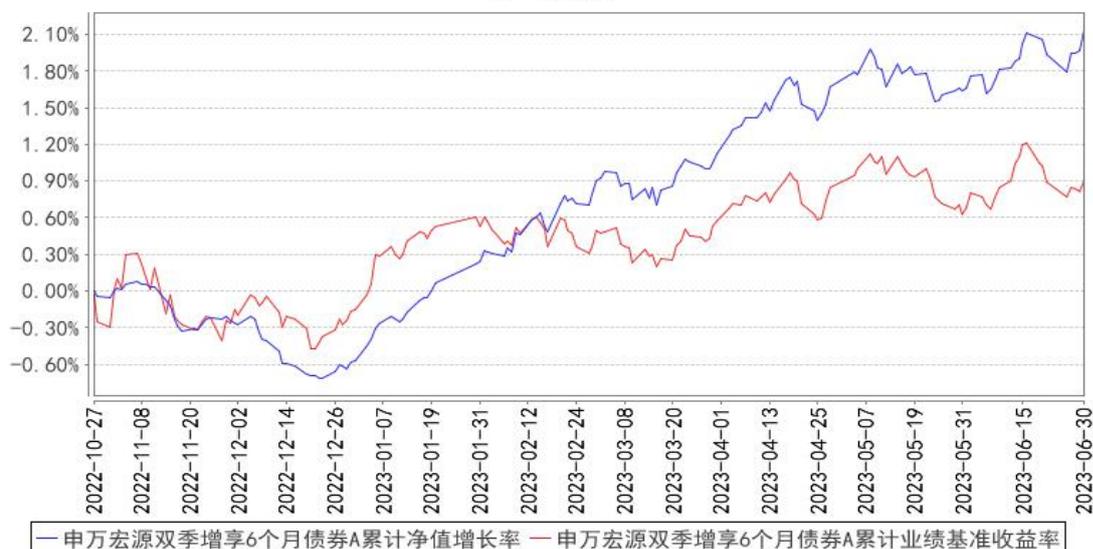
申万宏源双季增享6个月债券C

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	0.47%	0.09%	0.28%	0.09%	0.19%	0.00%
过去三个月	0.94%	0.09%	0.33%	0.08%	0.61%	0.01%
过去六个月	2.59%	0.08%	1.06%	0.08%	1.53%	0.00%
自基金合同生效起至今	1.96%	0.07%	0.91%	0.10%	1.05%	-0.03%

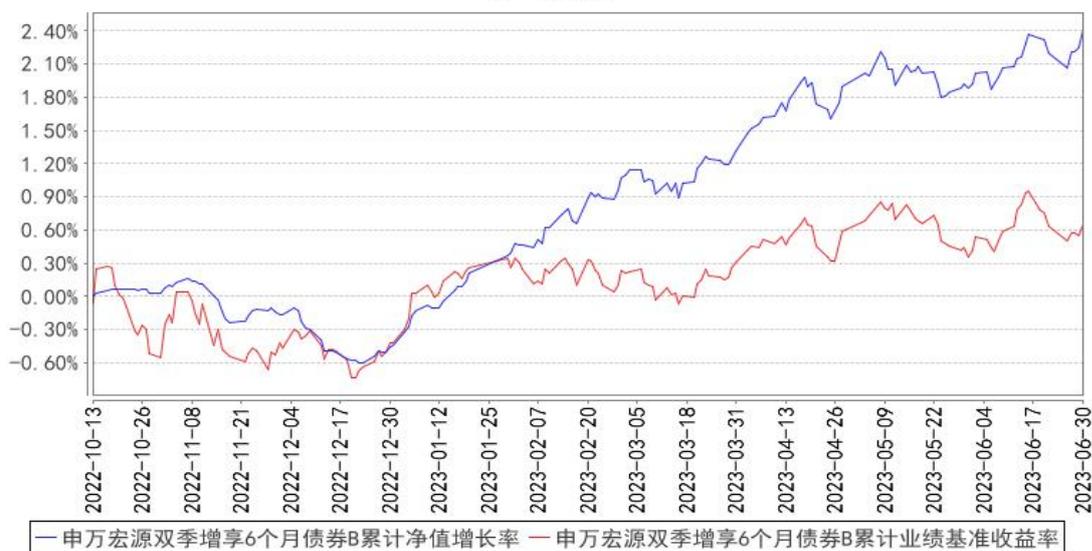
注：本集合计划合同变更生效日为2022年10月13日，申万宏源双季增享6个月债券A类份额和申万宏源双季增享6个月债券C类份额首次确认日是2022年10月27日。

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

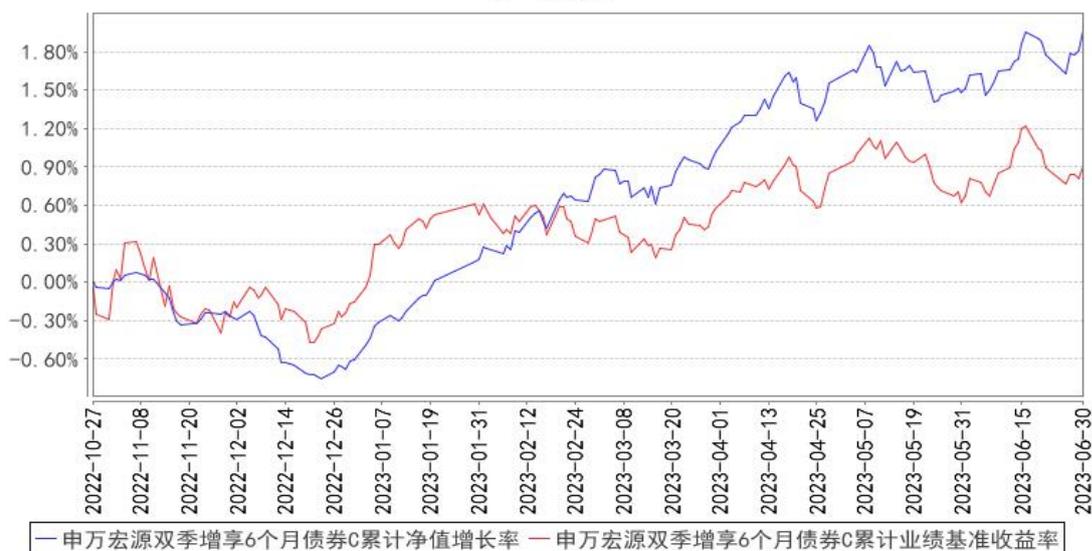
申万宏源双季增享6个月债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



申万宏源双季增享6个月债券B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



申万宏源双季增享6个月债券C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、本基金合同于2022年10月13日生效，自基金成立日起6个月内为建仓期，截至本报告期末，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。

2、申万宏源双季增享6个月债券A类份额和申万宏源双季增享6个月债券C类份额首次确认日是2022年10月27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		
季程	本基金的基金经理	2018 年 3 月 29 日	-	9 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。目前管理申万宏源天天增货币、申万宏源双季增享 6 个月、申万宏源灵通快利短债债券、申万宏源天添利货币、申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券等产品。该投资经理已取得投资主办人执业证书，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	2020 年 1 月 3 日	-	15 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。拥有多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主办人执业证书，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。
秦庆	本基金的基金经理	2022 年 10 月 13 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。

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《申万宏源双季增享 6 个月持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》、《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年上半年，国内经济基本面总体温和修复。受外需回落、通胀下行、基数较高等因素影响，出口景气度逐步回落。基建和制造业投资延续一定韧性，地产投资仍表现低迷，销售面积及新开工在一季度释放积压需求后再次转弱。服务消费持续回暖，总体消费持续弱复苏态势。上半年央行在3月17日宣布降准25bp，于6月13日宣布下调OMO政策利率10BP，维护市场流动性和合理降低利率中枢，呵护经济面修复。上半年资金面总体宽松，10年国债收益率于1月震荡上至2.93%之后总体呈现较为通畅的下行趋势，由2.93%下行至2.61%；降息落地后在止盈情绪下小幅反弹至2.68%，后又在资金宽松及强刺激政策预期转弱的带动下降至2.63%。1年期国债收益率下行明显，收益率曲线呈现出牛平走势。信用债市场在配置力量强和净融资规模增速下降的共同作用下，资产荒现象再现，整体收益率持续修复，信用利差因利率债的快速下行整体被动走阔。

上半年运作上，基于固收+产品的特性，管理人整体上对于债券与权益仓位分别进行了择时优

化配置。固收部分，秉持着固收打底的操作思路，重点关注收益安全垫的稳健性，主投利率债、中高评级信用债，严控信用风险。根据对流动性及资金中枢的研究预判，优化持仓，整体仓位保持了合理杠杆和久期。通过对期限利差的研究，适当择机运用骑乘策略，配置了部分 1 年以上债券及利率债增厚收益。权益部分，管理人在景气价值投资理念的指导下，运用宏观状态择时和稳健多策略体系，逢低逐步增加了权益类资产的配置比重，结构上主要配置中长期内生增长动力较足、估值历史分位数偏低、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，力争在控制权益部分回撤的前提下为整体组合贡献更多的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，申万宏源双季增享 6 个月债券 A 单位净值为 1.0249 元。本报告期基金单位净值增长率为 2.72%，业绩比较基准收益率为 1.06%，申万宏源双季增享 6 个月债券 B 单位净值为 1.0269 元。本报告期基金单位净值增长率为 2.86%，业绩比较基准收益率为 1.06%，申万宏源双季增享 6 个月债券 C 单位净值为 1.0232 元。本报告期基金单位净值增长率为 2.59%，业绩比较基准收益率为 1.06%。

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 2023 年下半年，政府对于经济温和修复的诉求仍将是重点，预计国内经济基本面延续弱复苏格局。财政政策在二季度经济修复边际转弱的情况下，大概率将积极稳健，基建投资保持高韧性概率较大。国内通胀总体可控，货币政策上配合合理宽裕，流动性整体无忧。地产政策上未来可期，但力度上值得关注，预计整体上地产基本面仍将低位探底。消费上政策支持相对积极，总体韧性较高，预计维持弱复苏格局。海外需求减弱仍将承压，需求端具有一定下行压力。在上述宏观背景下，预计权益市场整体相对中性偏乐观，成长类和价值类个股均存有绝对收益投资机会。后期需关注实体经济恢复实际情况和资金面的变化。管理人将继续根据固收+产品的特性进行对债券和权益仓位的优化配置。根据市场走势，动态调整组合久期和杠杆，力争做到收益与回撤的均衡，为投资者获取稳健的收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及集合计划合同约定，本集合计划管理人为准确、及时进行基金估值，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、本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

本托管人认真复核了本中期报告中的财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：申万宏源双季增享 6 个月持有期债券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	936,009.33	3,519,924.71
结算备付金		1,031,676.65	4,089,972.81
存出保证金		7,834.23	5,864.07

交易性金融资产	6.4.7.2	277,216,901.95	245,866,391.92
其中：股票投资		26,124,561.01	15,356,591.92
基金投资		-	-
债券投资		241,076,724.50	230,509,800.00
资产支持证券投资		10,015,616.44	-
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	2,999,460.45	3,771,543.46
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		3,510,616.57	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		285,702,499.18	257,253,696.97
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		22,104,028.95	-
应付清算款		-	2,700,478.13
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		62,913.09	47,599.54
应付托管费		10,907.52	11,501.56
应付销售服务费		8,684.85	531.99
应付投资顾问费		-	-
应交税费		24,313.29	22,899.32
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	231,583.89	3,087,160.03
负债合计		22,442,431.59	5,870,170.57
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	256,585,238.52	251,805,743.13
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	6,674,829.07	-422,216.73
净资产合计		263,260,067.59	251,383,526.40

负债和净资产总计		285,702,499.18	257,253,696.97
----------	--	----------------	----------------

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 256,585,238.52 份，其中申万宏源双季增享 6 个月债券 A 基金份额总额 36,478,781.67 份，基金份额净值 1.0249 元。申万宏源双季增享 6 个月债券 B 基金份额总额 178,678,826.68 份，基金份额净值 1.0269 元。申万宏源双季增享 6 个月债券 C 基金份额总额 41,427,630.17 份，基金份额净值 1.0232 元；

6.2 利润表

会计主体：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

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
一、营业总收入		7,232,869.26
1. 利息收入		100,924.38
其中：存款利息收入	6.4.7.9	14,734.13
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		86,190.25
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		5,182,174.37
其中：股票投资收益	6.4.7.10	906,040.92
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	3,902,840.57
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	15,161.64
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	358,131.24
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	1,949,770.51
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	-
减：二、营业总支出		499,695.62
1. 管理人报酬		293,181.50
2. 托管费		60,280.43
3. 销售服务费		16,142.19
4. 投资顾问费		-

5. 利息支出		40,193.08
其中：卖出回购金融资产支出		40,193.08
6. 信用减值损失		-
7. 税金及附加		16,258.34
8. 其他费用	6.4.7.18	73,640.08
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6,733,173.64
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,733,173.64
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		6,733,173.64

注：本基金合同生效日为2022年10月13日，无上年度可比期间对比数据。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：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

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）	251,805,743.13	-	-422,216.73	251,383,526.40
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）	251,805,743.13	-	-422,216.73	251,383,526.40
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	4,779,495.39	-	7,097,045.80	11,876,541.19
（一）、综合收益总额	-	-	6,733,173.64	6,733,173.64

(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)	4,779,495.39	-	363,872.16	5,143,367.55
其中：1. 基金申购款	71,626,918.88	-	1,211,481.67	72,838,400.55
2. 基金赎回款	-66,847,423.49	-	-847,609.51	-67,695,033.00
(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)	256,585,238.52	-	6,674,829.07	263,260,067.59

注：本基金合同生效日为 2022 年 10 月 13 日，无上年度可比期间对比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

杨玉成

基金管理人负责人

陈秀清

主管会计工作负责人

李青海

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

申万宏源双季增享 6 个月持有期债券型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）于 2022 年 5 月 31 日经中国证监会《关于准予申银万国灵通快利 7 天集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函【2022】1040 号）批准，《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资产管理合同》于 2022 年 10 月 13 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《申万宏源双季增享 6 个月持有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，包括国内依法发行上市的股票（含主板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票）、债券（包括国内依法发行的国债、地方政府债、政府支持机构债、央行票据、金融债券（含次级债券）、政策性金融债券、企业债券、公司债券、可转换债券（含分离交易可转债、可交换债券）、证券公司发行的短期公司债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据）、债券回购、银行存款（包括协议存款、通知存款、定期存款）、货币市场工具、同业存单、资产支持证券、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

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总资产的 80%；投资于股票、可转换债券（含分离交易可转债、可交换债券）等权益类资产的投资比例合计不超过集合计划总资产的 20%；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，现金或者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%，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品种或对投资比例要求发生变更，集合计划管理人在履行适当程序后，可以相应调整本集合计划的投资范围和投资比例规定。

本集合计划的业绩比较基准为中债综合全价（总值）指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*10%。

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,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。

(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[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	936,009.33
等于：本金	935,895.49
加：应计利息	113.84
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	936,009.33

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	26,059,612.79	-	26,124,561.01	64,948.22	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	61,164,851.36	1,956,526.30	63,895,257.70	773,880.04
	银行间市场	173,588,428.41	3,608,766.80	177,181,466.80	-15,728.41
	合计	234,753,279.77	5,565,293.10	241,076,724.50	758,151.63
资产支持证券	10,000,000.00	15,616.44	10,015,616.44	0.00	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	270,812,892.56	5,580,909.54	277,216,901.95	823,099.85	

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：本报告期末本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本报告期末本基金未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本报告期末本基金未持有黄金衍生品。

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	2,999,460.45	-
银行间市场	-	-
合计	2,999,460.45	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本报告期末本基金未持有买断式逆回购中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产。

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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	8,809.00
其中：交易所市场	4,656.99
银行间市场	4,152.01
应付利息	-
预提费用	222,774.89
合计	231,583.89

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

申万宏源双季增享6个月债券A

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	4,079,971.65	4,079,971.65
本期申购	32,608,017.68	32,608,017.68
本期赎回（以“-”号填列）	-209,207.66	-209,207.66
本期末	36,478,781.67	36,478,781.67

申万宏源双季增享6个月债券B

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	245,215,405.81	245,215,405.81
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-66,536,579.13	-66,536,579.13
本期末	178,678,826.68	178,678,826.68

申万宏源双季增享6个月债券C

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	2,510,365.67	2,510,365.67
本期申购	39,018,901.20	39,018,901.20
本期赎回（以“-”号填列）	-101,636.70	-101,636.70
本期末	41,427,630.17	41,427,630.17

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

申万宏源双季增享6个月债券A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	21,500.42	-30,523.79	-9,023.37
本期利润	421,219.81	35,748.62	456,968.43
本期基金份额交易产生的变动数	432,574.14	26,729.78	459,303.92
其中：基金申购款	436,335.41	27,655.79	463,991.20
基金赎回款	-3,761.27	-926.01	-4,687.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	875,294.37	31,954.61	907,248.98

申万宏源双季增享6个月债券B

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,427,940.04	-1,834,565.59	-406,625.55
本期利润	4,101,939.49	1,952,569.73	6,054,509.22
本期基金份额交易产生的变动数	-879,283.37	38,472.29	-840,811.08
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-879,283.37	38,472.29	-840,811.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,650,596.16	156,476.43	4,807,072.59

申万宏源双季增享6个月债券C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	12,213.19	-18,781.00	-6,567.81
本期利润	260,243.83	-38,547.84	221,695.99
本期基金份额交易产生的变动数	651,738.84	93,640.48	745,379.32
其中：基金申购款	653,504.06	93,986.41	747,490.47
基金赎回款	-1,765.22	-345.93	-2,111.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	924,195.86	36,311.64	960,507.50

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	4,297.39
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	10,167.29
其他	269.45
合计	14,734.13

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	906,040.92
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	906,040.92

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	28,582,712.98
减：卖出股票成本总额	27,628,289.23
减：交易费用	48,382.83
买卖股票差价收入	906,040.92

6.4.7.10.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期无证券出借差价收入。

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	4,033,481.42
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-130,640.85
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	3,902,840.57

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	136,474,702.43
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	133,095,589.25
减：应计利息总额	3,502,747.15
减：交易费用	7,006.88
买卖债券差价收入	-130,640.85

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

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
资产支持证券投资收益——利息收入	15,161.64
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	15,161.64

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	358,131.24
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	358,131.24

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	1,949,770.51
股票投资	218,963.06
债券投资	1,730,807.45
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	1,949,770.51

6.4.7.17 其他收入

注：本基金本报告期无其他收入。

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	2,382.85
账户维护费	9,300.00
TA 服务费	-1,517.66
合计	73,640.08

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，本基金无需要说明的重大或有事项。

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（“申万宏源证券”）	基金管理人、基金销售机构
兴业银行股份有限公司（“兴业银行”）	基金托管人
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

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	
	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	65,635,180.96	100.00

注：本基金合同生效日为2022年10月13日，无上年度可比期间对比数据。

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	
	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	43,890,849.14	100.00

注：本基金合同生效日为2022年10月13日，无上年度可比期间对比数据。

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	
	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	899,749,000.00	100.00

注：本基金合同生效日为2022年10月13日，无上年度可比期间对比数据。

6.4.10.1.4 权证交易

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。本基金合同生效日为2022年10月13日，无上年度可比期间对比数据。

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	24,340.35	100.00	4,656.99	100.00

注：本基金合同生效日为2022年10月13日，无上年度可比期间对比数据。

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
当期发生的基金应支付的管理费	293,181.50
其中：支付销售机构的客户维护费	1.77

注：本集合计划 A 类、C 类计划份额的固定管理费按前一日集合计划资产净值的 0.5% 年费率计提，B 类计划份额的固定管理费按前一日集合计划资产净值的 0.2% 年费率计提。各类计划份额的固定管理费的计算方法如下：

$$H = E \times \text{各类计划份额年固定管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日该类计划份额应计提的集合计划固定管理费

E 为前一日该类计划份额的集合计划资产净值

集合计划管理人对本集合计划 B 类计划份额提取业绩报酬，A 类、C 类计划份额不提取业绩报酬。

对于 B 类计划份额，本集合计划采用逐笔计提法提取业绩报酬，若单个集合计划份额持有人的单笔份额在其持有期间的年化收益率超过业绩报酬计提基准（4%）时，按照超过业绩报酬计提基准部分的 20% 提取业绩报酬。本集合计划业绩报酬在集合计划份额持有人赎回/转出集合计划份额或集合计划合同终止清算时收取。

（1）计提起始日

业绩报酬计提起始日为集合计划合同生效日。

（2）计提基准日

集合计划份额持有人申请赎回或转出集合计划份额时，计提基准日为集合计划份额持有人提出申请赎回或转出集合计划份额的工作日；集合计划合同终止时，计提基准日为集合计划最后运作日。

（3）计提基准及比例

本集合计划业绩报酬计提基准为 4%，业绩报酬计提比例为超过业绩报酬计提基准部分的 20%。因法律法规、监管政策调整而需要修订业绩报酬计提基准和计提比例的，无需召开集合计划份额持有人大会。

（4）计提方式

在集合计划份额持有人申请赎回或转出集合计划份额时，业绩报酬从赎回款项或转出金额中计提；在集合计划合同终止时，业绩报酬从集合计划合同终止清算资金中计提。

(5) 业绩报酬计算方式

$$\text{业绩报酬} = \max \{ Q \times P \times [(P1 - P0) / P \times 365 / T - 4\%] \times 20\% \times T / 365, 0 \}$$

其中：

Q：应计提业绩报酬的集合计划份额数量

P1：应计提业绩报酬的集合计划份额在计提基准日的集合计划份额累计净值

P0：应计提业绩报酬的集合计划份额在计提起始日的集合计划份额累计净值

P：应计提业绩报酬的集合计划份额在计提起始日的集合计划份额净值

T：应计提业绩报酬的集合计划份额在业绩报酬计提周期内的实际持有自然天数（即集合计划合同生效日（含）至赎回/转出/终止清算确认日（不含）间的自然天数）

业绩报酬按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位。因取值精度原因，实际业绩报酬计提结果以登记机构计算结果为准。因涉及相关数据，集合计划管理人的业绩报酬的计算和复核工作由集合计划管理人完成，相关信息以登记机构计算结果为准。

本基金合同生效日为 2022 年 10 月 13 日，无上年度可比期间对比数据。

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
当期发生的基金应支付的托管费	60,280.43

注：本集合计划的托管费按前一日集合计划资产净值的 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

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

本基金合同生效日为 2022 年 10 月 13 日，无上年度可比期间对比数据。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

	本期			
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
获得销售服务费的	当期发生的基金应支付的销售服务费			
各关联方名称	申万宏源双季增享 6 个月债券 A	申万宏源双季增享 6 个月债券 B	申万宏源双季增享 6 个月债券 C	合计
		B	C	

申万宏源西部证 券有限公司	-	-	2,663.61	2,663.61
申万宏源证券有 限公司	-	-	13,478.58	13,478.58
合计	-	-	16,142.19	16,142.19

注：销售服务费可用于本集合计划市场推广、销售以及份额持有人服务等各项费用。本集合计划 A、B 类计划份额不收取销售服务费，C 类计划份额的销售服务费年费率为 0.25%。C 类计划份额的销售服务费按前一日 C 类计划份额资产净值的 0.25% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年销售服务费率} \div 365$$

H 为 C 类集合计划份额应计提的销售服务费

E 为 C 类集合计划份额前一日的集合计划资产净值

本基金合同生效日为 2022 年 10 月 13 日，无上年度可比期间对比数据。

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 2022 年 10 月 13 日，无上年度同期对比数据。

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 2022 年 10 月 13 日，无上年度同期对比数据。

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 2022 年 10 月 13 日，无上年度同期对比数据。

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	本期	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
	申万宏源双季增享 6 个月债券 A	申万宏源双季增享 6 个月 债券 B	申万宏源双季增享 6 个月债券 C
基金合同生效日 (2022 年 10 月 13	-	-	-

日)持有的基金份额			
报告期初持有的基金份额	-	6,557,144.41	-
报告期内申购/买入总份额	-	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-	-
减:报告期内赎回/卖出总份额	-	-	-
报告期末持有的基金份额	-	6,557,144.41	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	2.56%	-

注:本集合计划合同生效日为 2022 年 10 月 13 日,无上年度同期对比数据。

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
兴业银行股份有限公司	936,009.33	4,297.39

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 2022 年 10 月 13 日,无上年度同期对比数据。

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

注：本基金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
160210	16 国开 10	2023 年 7 月 3 日	102.80	79,000	8,120,876.23
220211	22 国开 11	2023 年 7 月 3 日	101.60	100,000	10,160,128.77
合计				179,000	18,281,005.00

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 5,098,504.35 元，于 2023 年 7 月 3 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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。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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	10,112,147.54	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	35,651,367.73	93,857,013.01
合计	45,763,515.27	93,857,013.01

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。

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	49,018,469.93	53,404,588.56
AAA 以下	74,933,594.00	45,331,234.83
未评级	5,053,857.92	19,229,403.02
合计	129,005,921.85	117,965,226.41

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

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	10,015,616.44	-
AAA 以下	0.00	-
未评级	0.00	-
合计	10,015,616.44	-

注：本表主要列示资产支持证券，债券评级取自第三方评级机构的最新债项评级。

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	38,232,726.67	-
AAA 以下	0.00	-
未评级	0.00	-
合计	38,232,726.67	-

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	936,009.33	-	-	-	936,009.33
结算备付金	1,031,676.65	-	-	-	1,031,676.65
存出保证金	7,834.23	-	-	-	7,834.23
交易性金融资产	139,911,627.12	90,727,343.96	20,453,369.86	26,124,561.01	277,216,901.95
买入返售金融资产	2,999,460.45	-	-	-	2,999,460.45
应收证券清算款	-	-	-	3,510,616.57	3,510,616.57

应收申购款	-	-	-	0.00	0.00
资产总计	144,886,607.78	90,727,343.96	20,453,369.86	29,635,177.58	285,702,499.18
负债					
卖出回购金融资产款	22,104,028.95	-	-	-	22,104,028.95
应付证券清算款	-	-	-	0.00	0.00
应付管理人报酬	-	-	-	62,913.09	62,913.09
应付托管费	-	-	-	10,907.52	10,907.52
应付销售服务费	-	-	-	8,684.85	8,684.85
应交税费	-	-	-	24,313.29	24,313.29
其他负债	-	-	-	231,583.89	231,583.89
负债总计	22,104,028.95	0.00	0.00	338,402.64	22,442,431.59
利率敏感度缺口	122,782,578.83	90,727,343.96	20,453,369.86	29,296,774.94	263,260,067.59
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	3,519,924.71	-	-	-	3,519,924.71
结算备付金	4,089,972.81	-	-	-	4,089,972.81
存出保证金	5,864.07	-	-	-	5,864.07
交易性金融资产	149,440,553.64	61,315,054.58	19,754,191.78	15,356,591.92	245,866,391.92
买入返售金融资产	3,771,543.46	-	-	-	3,771,543.46
资产总计	160,827,858.69	61,315,054.58	19,754,191.78	15,356,591.92	257,253,696.97
负债					
应付证券清算款	-	-	-	2,700,478.13	2,700,478.13
应付管理人报酬	-	-	-	47,599.54	47,599.54
应付托管费	-	-	-	11,501.56	11,501.56
应付交易费用	-	-	-	20,101.11	20,101.11
应交税费	-	-	-	22,899.32	22,899.32
其他应付款	-	-	-	2,890,458.92	2,890,458.92
预提费用	-	-	-	176,600.00	176,600.00
应付销售服务费	-	-	-	531.99	531.99
负债总计	-	-	-	5,870,170.57	5,870,170.57
利率敏感度缺口	160,827,858.69	61,315,054.58	19,754,191.78	9,486,421.35	251,383,526.40

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)
	市场利率下降25个基点	763,109.78	696,512.61
	市场利率上升25个基点	-763,109.78	-696,512.61

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	26,124,561.01	9.92	15,356,591.92	6.11
交易性金融资产—基金投资	0.00	0.00	-	-
交易性金融资产—债券投资	241,076,724.50	91.57	230,509,800.00	91.70
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	10,015,616.44	3.80	-	-
合计	277,216,901.95	105.30	245,866,391.92	97.81

注：“其他”为交易性资产支持证券投资。

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	对资产负债表日基金资产净值的

	动	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. 业绩比较基准 上升 5%	6,850,566.09	9,524,305.41
	2. 业绩比较基准 下降 5%	-6,850,566.09	-9,524,305.41

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	26,136,802.68	17,689,827.86
第二层次	251,080,099.27	228,176,564.06
第三层次	-	-
合计	277,216,901.95	245,866,391.92

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	26,124,561.01	9.14
	其中：股票	26,124,561.01	9.14
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	251,092,340.94	87.89
	其中：债券	241,076,724.50	84.38
	资产支持证券	10,015,616.44	3.51
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	2,999,460.45	1.05
	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	1,967,685.98	0.69
8	其他各项资产	3,518,450.80	1.23
9	合计	285,702,499.18	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	15,820.00	0.01
B	采矿业	1,252,516.00	0.48
C	制造业	14,783,138.51	5.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	678,734.00	0.26
E	建筑业	860,359.80	0.33
F	批发和零售业	243,753.00	0.09
G	交通运输、仓储和邮政业	413,178.00	0.16

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	405,913.15	0.15
J	金融业	6,183,058.00	2.35
K	房地产业	780,092.00	0.30
L	租赁和商务服务业	49,845.20	0.02
M	科学研究和技术服务业	94,273.35	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	110,260.00	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	51,996.00	0.02
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	141,072.00	0.05
S	综合	60,552.00	0.02
	合计	26,124,561.01	9.92

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	601688	华泰证券	83,700	1,152,549.00	0.44
2	600030	中信证券	54,100	1,070,098.00	0.41
3	600372	中航电子	61,061	926,905.98	0.35
4	002475	立讯精密	27,900	905,355.00	0.34
5	600362	江西铜业	46,300	878,774.00	0.33
6	600497	驰宏锌锗	145,500	730,410.00	0.28
7	601108	财通证券	96,000	695,040.00	0.26
8	600038	中直股份	12,800	509,696.00	0.19
9	000725	京东方 A	123,000	503,070.00	0.19
10	000630	铜陵有色	167,100	482,919.00	0.18
11	600741	华域汽车	25,400	468,884.00	0.18
12	000060	中金岭南	95,000	451,250.00	0.17
13	601211	国泰君安	31,500	440,685.00	0.17
14	000738	航发控制	17,500	427,000.00	0.16
15	000100	TCL 科技	100,500	395,970.00	0.15
16	603920	世运电路	20,100	392,553.00	0.15
17	000001	平安银行	34,800	390,804.00	0.15
18	601318	中国平安	8,200	380,480.00	0.14
19	601377	兴业证券	58,300	356,796.00	0.14
20	000776	广发证券	21,400	314,794.00	0.12
21	002466	天齐锂业	4,500	314,595.00	0.12
22	000898	鞍钢股份	108,000	300,240.00	0.11

23	601168	西部矿业	22,200	233,322.00	0.09
24	600958	东方证券	24,000	232,800.00	0.09
25	002738	中矿资源	4,300	219,042.00	0.08
26	603215	比依股份	11,600	208,104.00	0.08
27	300447	全信股份	10,000	191,900.00	0.07
28	601619	嘉泽新能	39,000	177,450.00	0.07
29	601919	中远海控	18,200	171,080.00	0.06
30	600498	烽火通信	8,200	167,034.00	0.06
31	000002	万科 A	11,900	166,838.00	0.06
32	601127	赛力斯	4,500	165,465.00	0.06
33	601857	中国石油	22,000	164,340.00	0.06
34	601009	南京银行	20,300	162,400.00	0.06
35	601668	中国建筑	26,700	153,258.00	0.06
36	002273	水晶光电	11,900	142,086.00	0.05
37	601618	中国中冶	35,300	140,141.00	0.05
38	000408	藏格矿业	6,200	139,934.00	0.05
39	000783	长江证券	23,400	135,720.00	0.05
40	601238	广汽集团	12,700	132,334.00	0.05
41	603118	共进股份	9,500	126,255.00	0.05
42	002459	晶澳科技	3,020	125,934.00	0.05
43	600048	保利发展	9,300	121,179.00	0.05
44	002056	横店东磁	6,100	111,081.00	0.04
45	600808	马钢股份	43,000	110,510.00	0.04
46	601827	三峰环境	14,900	110,260.00	0.04
47	002130	沃尔核材	13,300	107,996.00	0.04
48	603399	吉翔股份	9,200	106,444.00	0.04
49	000333	美的集团	1,800	106,056.00	0.04
50	601601	中国太保	4,000	103,920.00	0.04
51	603466	风语筑	7,400	102,860.00	0.04
52	300481	濮阳惠成	5,000	102,800.00	0.04
53	600162	香江控股	49,200	97,908.00	0.04
54	300127	银河磁体	5,400	97,902.00	0.04
55	000517	荣安地产	32,000	97,600.00	0.04
56	600681	百川能源	20,800	97,136.00	0.04
57	600170	上海建工	35,900	96,571.00	0.04
58	600510	黑牡丹	15,900	96,513.00	0.04
59	002171	楚江新材	13,500	96,120.00	0.04
60	002062	宏润建设	17,600	95,216.00	0.04
61	600064	南京高科	14,400	95,184.00	0.04
62	000878	云南铜业	8,600	95,030.00	0.04
63	600033	福建高速	30,300	94,839.00	0.04
64	003816	中国广核	30,400	94,544.00	0.04
65	600820	隧道股份	15,600	93,756.00	0.04

66	600461	洪城环境	11,400	93,138.00	0.04
67	000709	河钢股份	41,200	93,112.00	0.04
68	000685	中山公用	12,300	93,111.00	0.04
69	000906	浙商中拓	10,400	92,768.00	0.04
70	000012	南玻 A	15,400	91,784.00	0.03
71	601012	隆基绿能	3,200	91,744.00	0.03
72	300059	东方财富	6,000	85,200.00	0.03
73	600036	招商银行	2,600	85,176.00	0.03
74	600039	四川路桥	8,680	85,150.80	0.03
75	600908	无锡银行	15,400	82,544.00	0.03
76	300861	美畅股份	1,900	82,403.00	0.03
77	601669	中国电建	14,100	80,934.00	0.03
78	002460	赣锋锂业	1,300	79,248.00	0.03
79	002212	天融信	8,000	77,600.00	0.03
80	002170	芭田股份	11,200	76,944.00	0.03
81	601628	中国人寿	2,200	76,912.00	0.03
82	600028	中国石化	12,000	76,320.00	0.03
83	603027	千禾味业	3,600	76,032.00	0.03
84	605266	健之佳	900	75,447.00	0.03
85	605158	华达新材	9,700	73,720.00	0.03
86	605167	利柏特	7,500	72,600.00	0.03
87	600219	南山铝业	24,000	72,480.00	0.03
88	002576	通达动力	3,600	71,964.00	0.03
89	688005	容百科技	1,300	70,226.00	0.03
90	000932	华菱钢铁	14,600	69,642.00	0.03
91	301168	通灵股份	1,100	68,530.00	0.03
92	002422	科伦药业	2,300	68,264.00	0.03
93	600918	中泰证券	9,800	67,718.00	0.03
94	002843	泰嘉股份	3,100	64,976.00	0.02
95	002611	东方精工	11,300	64,862.00	0.02
96	603105	芯能科技	3,800	64,182.00	0.02
97	600585	海螺水泥	2,700	64,098.00	0.02
98	000628	高新发展	3,900	62,907.00	0.02
99	300943	春晖智控	3,700	62,752.00	0.02
100	002997	瑞鹄模具	2,100	62,433.00	0.02
101	688559	海目星	1,327	62,382.27	0.02
102	601163	三角轮胎	3,900	61,893.00	0.02
103	688348	昱能科技	328	61,608.24	0.02
104	605300	佳禾食品	2,800	60,872.00	0.02
105	603066	音飞储存	5,100	60,741.00	0.02
106	300839	博汇股份	4,560	60,602.40	0.02
107	600603	广汇物流	8,700	60,552.00	0.02
108	002038	双鹭药业	6,000	60,540.00	0.02

109	600736	苏州高新	11,900	60,333.00	0.02
110	603191	望变电气	3,100	60,295.00	0.02
111	000030	富奥股份	11,800	59,472.00	0.02
112	600312	平高电气	4,800	59,472.00	0.02
113	301087	可孚医疗	1,200	59,160.00	0.02
114	603093	南华期货	5,400	58,806.00	0.02
115	002733	雄韬股份	3,400	58,786.00	0.02
116	002489	浙江永强	14,500	58,725.00	0.02
117	603690	至纯科技	1,680	58,531.20	0.02
118	600883	博闻科技	7,700	58,443.00	0.02
119	000651	格力电器	1,600	58,416.00	0.02
120	603697	有友食品	6,280	57,587.60	0.02
121	600517	国网英大	10,100	57,570.00	0.02
122	688536	思瑞浦	262	57,116.00	0.02
123	600642	申能股份	8,000	55,920.00	0.02
124	300693	盛弘股份	1,500	55,380.00	0.02
125	002987	京北方	2,520	55,238.40	0.02
126	002500	山西证券	9,800	54,684.00	0.02
127	601128	常熟银行	8,000	54,560.00	0.02
128	300014	亿纬锂能	900	54,450.00	0.02
129	300908	仲景食品	1,200	54,420.00	0.02
130	601319	中国人保	9,300	54,312.00	0.02
131	300194	福安药业	13,700	53,156.00	0.02
132	688029	南微医学	648	52,850.88	0.02
133	601766	中国中车	8,100	52,650.00	0.02
134	688599	天合光能	1,235	52,623.35	0.02
135	300192	科德教育	4,200	51,996.00	0.02
136	600438	通威股份	1,500	51,465.00	0.02
137	605168	三人行	580	49,845.20	0.02
138	002415	海康威视	1,500	49,665.00	0.02
139	300443	金雷股份	1,400	49,630.00	0.02
140	300750	宁德时代	200	45,758.00	0.02
141	688516	奥特维	200	37,680.00	0.01
142	600500	中化国际	5,800	32,248.00	0.01
143	000977	浪潮信息	600	29,100.00	0.01
144	603306	华懋科技	1,000	29,020.00	0.01
145	002138	顺络电子	1,200	28,692.00	0.01
146	000423	东阿阿胶	500	26,725.00	0.01
147	300969	恒帅股份	300	26,445.00	0.01
148	688018	乐鑫科技	200	25,964.00	0.01
149	600862	中航高科	1,000	25,310.00	0.01
150	300073	当升科技	500	25,165.00	0.01
151	002126	银轮股份	1,400	24,780.00	0.01

152	601186	中国铁建	2,500	24,625.00	0.01
153	688608	恒玄科技	200	24,206.00	0.01
154	603179	新泉股份	500	21,945.00	0.01
155	002851	麦格米特	600	21,882.00	0.01
156	605123	派克新材	200	21,730.00	0.01
157	603197	保隆科技	400	21,700.00	0.01
158	000921	海信家电	800	21,560.00	0.01
159	688281	华秦科技	105	21,262.50	0.01
160	603298	杭叉集团	900	21,195.00	0.01
161	601137	博威合金	1,300	20,228.00	0.01
162	600761	安徽合力	1,000	19,930.00	0.01
163	300130	新国都	700	19,831.00	0.01
164	002011	盾安环境	1,400	19,362.00	0.01
165	600583	海油工程	3,300	19,305.00	0.01
166	600572	康恩贝	2,800	19,180.00	0.01
167	300185	通裕重工	6,800	18,972.00	0.01
168	688698	伟创电气	474	18,950.52	0.01
169	300777	中简科技	400	18,904.00	0.01
170	600729	重庆百货	600	18,864.00	0.01
171	603279	景津装备	600	18,816.00	0.01
172	688408	中信博	223	18,805.59	0.01
173	300487	蓝晓科技	300	18,726.00	0.01
174	002605	姚记科技	400	18,572.00	0.01
175	301039	中集车辆	1,400	18,522.00	0.01
176	601126	四方股份	1,200	18,228.00	0.01
177	688106	金宏气体	670	18,224.00	0.01
178	000063	中兴通讯	400	18,216.00	0.01
179	688300	联瑞新材	388	18,139.00	0.01
180	688639	华恒生物	200	18,096.00	0.01
181	000969	安泰科技	1,900	17,993.00	0.01
182	603877	太平鸟	700	17,696.00	0.01
183	600587	新华医疗	500	17,665.00	0.01
184	600580	卧龙电驱	1,200	17,532.00	0.01
185	300866	安克创新	200	17,500.00	0.01
186	688025	杰普特	200	17,470.00	0.01
187	002017	东信和平	1,300	17,043.00	0.01
188	600531	豫光金铅	2,700	17,010.00	0.01
189	002139	拓邦股份	1,300	16,965.00	0.01
190	600635	大众公用	5,100	16,932.00	0.01
191	601886	江河集团	1,900	16,891.00	0.01
192	688366	昊海生科	200	16,844.00	0.01
193	600717	天津港	3,800	16,834.00	0.01
194	600458	时代新材	1,400	16,786.00	0.01

195	600477	杭萧钢构	4,100	16,769.00	0.01
196	002959	小熊电器	200	16,700.00	0.01
197	603383	顶点软件	300	16,626.00	0.01
198	000528	柳工	2,100	16,590.00	0.01
199	688401	路维光电	441	16,555.14	0.01
200	002641	公元股份	2,900	16,356.00	0.01
201	002651	利君股份	2,100	16,317.00	0.01
202	603129	春风动力	100	16,190.00	0.01
203	002314	南山控股	4,900	16,170.00	0.01
204	600469	风神股份	2,500	16,100.00	0.01
205	600285	羚锐制药	1,000	16,060.00	0.01
206	688526	科前生物	674	16,034.46	0.01
207	603297	永新光学	200	15,980.00	0.01
208	002772	众兴菌业	1,400	15,820.00	0.01
209	603611	诺力股份	600	15,804.00	0.01
210	002779	中坚科技	600	15,786.00	0.01
211	002215	诺普信	2,100	15,771.00	0.01
212	000680	山推股份	2,800	15,764.00	0.01
213	601686	友发集团	2,300	15,732.00	0.01
214	688100	威胜信息	524	15,620.44	0.01
215	688102	斯瑞新材	1,280	15,616.00	0.01
216	003006	百亚股份	900	15,552.00	0.01
217	605259	绿田机械	400	15,528.00	0.01
218	002448	中原内配	2,200	15,400.00	0.01
219	002249	大洋电机	2,700	15,390.00	0.01
220	603859	能科科技	300	15,339.00	0.01
221	002334	英威腾	1,200	15,288.00	0.01
222	600537	亿晶光电	2,000	15,280.00	0.01
223	002454	松芝股份	1,800	15,246.00	0.01
224	688628	优利德	311	15,111.49	0.01
225	600558	大西洋	3,800	15,086.00	0.01
226	300206	理邦仪器	1,000	15,080.00	0.01
227	688338	赛科希德	271	15,026.95	0.01
228	002746	仙坛股份	1,900	14,972.00	0.01
229	688132	邦彦技术	550	14,949.00	0.01
230	600696	岩石股份	600	14,934.00	0.01
231	300768	迪普科技	900	14,913.00	0.01
232	688626	翔宇医疗	326	14,836.26	0.01
233	688819	天能股份	402	14,809.68	0.01
234	603331	百达精工	1,000	14,780.00	0.01
235	300308	中际旭创	100	14,745.00	0.01
236	002990	盛视科技	400	14,720.00	0.01
237	601336	新华保险	400	14,708.00	0.01

238	600020	中原高速	4,000	14,680.00	0.01
239	688510	航亚科技	738	14,678.82	0.01
240	002381	双箭股份	1,900	14,668.00	0.01
241	002737	葵花药业	600	14,604.00	0.01
242	002053	云南能投	1,300	14,586.00	0.01
243	002133	广宇集团	4,300	14,577.00	0.01
244	600961	株冶集团	1,800	14,562.00	0.01
245	688208	道通科技	480	14,548.80	0.01
246	000751	锌业股份	4,400	14,520.00	0.01
247	603507	振江股份	400	14,504.00	0.01
248	600397	安源煤业	5,000	14,500.00	0.01
249	688080	映翰通	295	14,425.50	0.01
250	600831	广电网络	2,400	14,400.00	0.01
251	002223	鱼跃医疗	400	14,396.00	0.01
252	300532	今天国际	700	14,392.00	0.01
253	300697	电工合金	1,200	14,376.00	0.01
254	002613	北玻股份	3,100	14,353.00	0.01
255	002946	新乳业	1,000	14,350.00	0.01
256	000552	靖远煤电	4,300	14,319.00	0.01
257	688389	普门科技	608	14,281.92	0.01
258	603628	清源股份	900	14,247.00	0.01
259	688718	唯赛勃	822	14,228.82	0.01
260	600351	亚宝药业	2,000	14,200.00	0.01
261	000739	普洛药业	800	14,192.00	0.01
262	300316	晶盛机电	200	14,180.00	0.01
263	002763	汇洁股份	1,600	14,176.00	0.01
264	300041	回天新材	1,200	14,160.00	0.01
265	688150	莱特光电	632	14,156.80	0.01
266	605066	天正电气	1,500	14,115.00	0.01
267	600863	内蒙华电	3,400	14,110.00	0.01
268	002969	嘉美包装	3,600	14,076.00	0.01
269	603689	皖天然气	1,600	14,032.00	0.01
270	002443	金洲管道	2,100	13,986.00	0.01
271	002588	史丹利	2,300	13,984.00	0.01
272	688600	皖仪科技	560	13,882.40	0.01
273	600035	楚天高速	3,400	13,872.00	0.01
274	600109	国金证券	1,600	13,872.00	0.01
275	600859	王府井	700	13,853.00	0.01
276	601107	四川成渝	3,400	13,838.00	0.01
277	002154	报喜鸟	2,500	13,800.00	0.01
278	601086	国芳集团	3,100	13,795.00	0.01
279	600325	华发股份	1,400	13,790.00	0.01
280	688052	纳芯微	87	13,778.19	0.01

281	601000	唐山港	3,900	13,767.00	0.01
282	002966	苏州银行	2,100	13,755.00	0.01
283	002391	长青股份	2,000	13,740.00	0.01
284	000531	穗恒运 A	1,900	13,737.00	0.01
285	000750	国海证券	4,100	13,735.00	0.01
286	300232	洲明科技	1,500	13,710.00	0.01
287	601717	郑煤机	1,100	13,695.00	0.01
288	603367	辰欣药业	900	13,662.00	0.01
289	600229	城市传媒	1,600	13,632.00	0.01
290	002179	中航光电	300	13,605.00	0.01
291	001218	丽臣实业	600	13,566.00	0.01
292	002352	顺丰控股	300	13,527.00	0.01
293	300017	网宿科技	1,900	13,509.00	0.01
294	600488	津药药业	2,400	13,488.00	0.01
295	600079	人福医药	500	13,470.00	0.01
296	002419	天虹股份	2,300	13,455.00	0.01
297	000563	陕国投 A	4,400	13,420.00	0.01
298	002345	潮宏基	1,700	13,362.00	0.01
299	688588	凌志软件	842	13,093.10	0.00
300	603102	百合股份	300	12,957.00	0.00
301	002025	航天电器	200	12,760.00	0.00
302	002275	桂林三金	700	12,607.00	0.00
303	601928	凤凰传媒	1,100	12,540.00	0.00
304	603328	依顿电子	1,500	12,420.00	0.00
305	688655	迅捷兴	752	12,362.88	0.00
306	002937	兴瑞科技	500	12,300.00	0.00
307	300389	艾比森	600	12,222.00	0.00
308	600757	长江传媒	1,400	12,040.00	0.00
309	603883	老百姓	400	11,940.00	0.00
310	688088	虹软科技	278	11,884.50	0.00
311	300624	万兴科技	100	11,715.00	0.00
312	002284	亚太股份	1,300	11,661.00	0.00
313	688508	芯朋微	200	11,598.00	0.00
314	603688	石英股份	100	11,384.00	0.00
315	300833	浩洋股份	100	10,943.00	0.00
316	601800	中国交建	1,000	10,910.00	0.00
317	603309	维力医疗	700	10,829.00	0.00
318	300811	铂科新材	180	10,699.20	0.00
319	002484	江海股份	500	10,645.00	0.00
320	688589	力合微	254	10,347.96	0.00
321	002465	海格通信	1,000	10,340.00	0.00
322	603019	中科曙光	200	10,180.00	0.00
323	688002	睿创微纳	226	10,124.80	0.00

324	600789	鲁抗医药	1,500	9,630.00	0.00
325	000875	吉电股份	1,600	8,624.00	0.00
326	300852	四会富仕	200	8,292.00	0.00
327	688248	南网科技	165	6,334.35	0.00
328	688676	金盘科技	200	6,058.00	0.00
329	301221	光庭信息	100	5,583.00	0.00
330	600633	浙数文化	300	4,863.00	0.00
331	300627	华测导航	100	3,247.00	0.00
332	600887	伊利股份	100	2,832.00	0.00
333	600557	康缘药业	100	2,746.00	0.00
334	603108	润达医疗	100	1,858.00	0.00
335	600694	大商股份	100	1,773.00	0.00
336	002478	常宝股份	200	1,490.00	0.00
337	688082	盛美上海	1	110.40	0.00
338	688220	翱捷科技	1	75.39	0.00
339	688234	天岳先进	1	73.94	0.00
340	688107	安路科技	1	55.39	0.00
341	688778	厦钨新能	1	49.50	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	969,665.00	0.39
2	000630	铜陵有色	630,389.00	0.25
3	600362	江西铜业	618,776.00	0.25
4	601688	华泰证券	612,236.00	0.24
5	002475	立讯精密	586,352.00	0.23
6	601108	财通证券	579,679.00	0.23
7	600038	中直股份	567,884.00	0.23
8	600497	驰宏锌锗	530,647.00	0.21
9	600030	中信证券	516,679.00	0.21
10	000776	广发证券	488,717.00	0.19
11	000738	航发控制	439,974.00	0.18
12	002466	天齐锂业	391,542.00	0.16
13	601377	兴业证券	376,599.00	0.15
14	000100	TCL 科技	375,364.00	0.15
15	601619	嘉泽新能	330,690.00	0.13
16	000898	鞍钢股份	319,932.00	0.13
17	002738	中矿资源	307,137.00	0.12
18	601211	国泰君安	285,660.00	0.11
19	601318	中国平安	284,890.00	0.11
20	600741	华域汽车	276,888.00	0.11

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	576,730.00	0.23
2	300308	中际旭创	348,533.00	0.14
3	688300	联瑞新材	348,473.16	0.14
4	603019	中科曙光	315,804.00	0.13
5	600033	福建高速	300,292.00	0.12
6	603108	润达医疗	274,744.00	0.11
7	000932	华菱钢铁	267,078.00	0.11
8	300447	全信股份	244,345.00	0.10
9	601668	中国建筑	242,123.00	0.10
10	000977	浪潮信息	241,698.00	0.10
11	600887	伊利股份	241,235.00	0.10
12	600350	山东高速	236,275.00	0.09
13	300750	宁德时代	225,032.40	0.09
14	000776	广发证券	220,650.00	0.09
15	600502	安徽建工	210,569.00	0.08
16	601390	中国中铁	201,040.00	0.08
17	600724	宁波富达	189,759.00	0.08
18	000517	荣安地产	183,772.00	0.07
19	600376	首开股份	181,492.00	0.07
20	601688	华泰证券	181,362.00	0.07

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	38,177,295.26
卖出股票收入（成交）总额	28,582,712.98

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	7,634,841.78	2.90
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,439,718.93	7.76
	其中：政策性金融债	20,439,718.93	7.76
4	企业债券	56,248,174.25	21.37
5	企业短期融资券	45,763,515.27	17.38
6	中期票据	72,745,505.93	27.63
7	可转债（可交换债）	12,241.67	0.00
8	同业存单	38,232,726.67	14.52
9	其他	-	-
10	合计	241,076,724.50	91.57

注：本报告期末本基金持有的可转债（可交换债）占基金资产净值比例数值较小，经四舍五入后，表中“占基金资产净值比例（%）”为0.00。

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	102101677	21 昌吉州 MTN002	200,000	20,845,452.05	7.92
2	101901358	19 港兴港投 MTN003	200,000	20,453,369.86	7.77
3	112313102	23 浙商银行 CD102	190,000	18,610,637.05	7.07
4	188743	21 国都 G1	150,000	15,421,684.93	5.86
5	127846	18 洋口 02	200,000	13,142,564.38	4.99

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（%）
1	199899	23 华发 6A	100,000	10,015,616.44	3.80

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 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 本期国债期货投资评价

本集合计划在本报告期内未投资国债期货。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1

本基金投资的 21 国都 G1，发行主体国都证券股份有限公司发布《国都证券股份有限公司关于公司收到北京证监局警示函的公告》。根据公司公告，2023 年 5 月 4 日，国都证券股份有限公司从中国证券监督管理委员会北京监管局取得《关于对国都证券股份有限公司采取出具警示函行

政监管措施的决定》，指出公司私募资产管理业务存在个别产品未设置明确终止日期；交易管理制度执行不规范；压力测试间隔规定不符合要求的情况。根据该公司公告，上述行政监管措施不会影响公司整体的正常运营，不会对本公司经营产生重大不良影响。目前公司财务方面一切正常，上述行政监管措施不会对本公司财务产生重大不良影响。本次监管警示函对公司生产经营、财务状况及偿债能力无重大不利影响，未显著影响发行主体的信用评级。本公司对以上证券的投资决策程序符合法律法规及公司制度的相关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为。除此之外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，且在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚的情形。

7.11.2

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。

7.11.3 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	7,834.23
2	应收清算款	3,510,616.57
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,518,450.80

7.11.4 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(%)
1	127006	敖东转债	12,241.67	0.00

注：本报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券“敖东转债”（债券代码：127006）占基金资产净值比例数值较小，经四舍五入后，表中“占基金资产净值比例(%)”为0.00。

7.11.5 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。

7.11.6 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

份额级别	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 (%)
申万宏源双季增享 6 个月债券 A	98	372,232.47	0.00	-	36,478,781.67	100.00
申万宏源双季增享 6 个月债券 B	542	329,665.73	20,101,591.83	11.25	158,577,234.85	88.75
申万宏源双季增享 6 个月债券 C	44	941,537.05	29,411,764.71	71.00	12,015,865.46	29.00
合计	684	375,124.62	49,513,356.54	19.30	207,071,881.98	80.70

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	申万宏源双季增享 6 个月债券 A	80,787.24	0.2215
	申万宏源双季增享 6 个月债券 B	3,485,959.10	1.9510
	申万宏源双季增享 6 个月债券 C	609,407.88	1.4710
	合计	4,176,154.22	1.6276

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	份额级别	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	申万宏源双季增享 6 个月债券 A	0
	申万宏源双季增享 6 个月债券 B	0
	申万宏源双季增享 6 个月债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	申万宏源双季增享 6 个月债券 A	0
	申万宏源双季增享 6 个月债券 B	0

	券 B	
	申万宏源双季增享 6 个月债券 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	申万宏源双季增享 6 个月债券 A	申万宏源双季增享 6 个月债券 B	申万宏源双季增享 6 个月债券 C
基金合同生效日(2022 年 10 月 13 日)基金份额总额	-	380,979,531.67	-
本报告期期初基金份额总额	4,079,971.65	245,215,405.81	2,510,365.67
本报告期基金总申购份额	32,608,017.68	-	39,018,901.20
减：本报告期基金总赎回份额	209,207.66	66,536,579.13	101,636.70
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期末基金份额总额	36,478,781.67	178,678,826.68	41,427,630.17

§ 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的重大人事变动如下：自 2023 年 4 月 11 日起，陈启女士担任基金托管人资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作，叶文煌先生不再担任基金托管人资产托管部总经理。

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 (%)	
申万宏源证券有限公司	2	65,635,180.96	100.00	24,340.35	100.00	-

注：我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	43,890,849.14	100.00	899,749,000.00	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、《申万宏源双季增享 6 个月持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》；
- 2、《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托管协议》；
- 3、《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招募说明书》；
- 4、《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