

申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资
产管理计划
2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：申万宏源证券资产管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上董事签字同意，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 2024 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 审计报告	14
6.1 审计报告基本信息	14
6.2 审计报告的基本内容	15
§ 7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	17
7.3 净资产变动表	19
7.4 报表附注	21
§ 8 投资组合报告	45

8.1 期末基金资产组合情况	45
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	46
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	53
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	53
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	53
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	53
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	53
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
8.12 投资组合报告附注	53
§ 9 基金份额持有人信息	54
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	55
§ 10 开放式基金份额变动	55
§ 11 重大事件揭示	55
11.1 基金份额持有人大会决议	55
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	55
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
11.4 基金投资策略的改变	55
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	55
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	56
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	56
11.8 其他重大事件	57
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	57
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	57
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	57
§ 13 备查文件目录	58
13.1 备查文件目录	58
13.2 存放地点	58
13.3 查阅方式	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	申万宏源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	申万宏源证券资产管理有限公司
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	125,539,052.44 份
基金合同存续期	本集合计划自集合计划合同变更生效日起存续至 2024 年 12 月 31 日。本集合计划自 2024 年 12 月 31 日后，按照中国证监会相关规定执行。如 2024 年 12 月 31 日后，不符合法律法规或中国证监会的要求而须终止本集合计划的，无须召开集合计划份额持有人大会。

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		申万宏源证券资产管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙兆军	王小飞
	联系电话	021-33389888	021-60637103
	电子邮箱	sunzhj@swhysc.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		95523	021-60637228
传真		-	021-60635778
注册地址		上海市静安区南京西路 993 号 18A-1 室	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 40 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		袁锦	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.swhyzcg1.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	中兴华会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市丰台区丽泽路 20 号丽泽 SOHO B 座 20 层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号恒奥中心 A 座

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间 数据和指标	2023 年	2022 年	2021 年 1 月 19 日(基金合同 生效日) - 2021 年 12 月 31 日
本期已实现 收益	2,079,308.45	-9,628,949.59	18,604,196.88
本期利润	5,546,057.58	-28,162,467.48	19,087,189.19
加权平均基 金份额本期 利润	0.0511	-0.2537	0.1319
本期加权平 均净值利润 率	5.58%	-28.65%	12.41%
本期基金份 额净值增长	6.97%	-22.56%	8.48%

率			
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
期末可供分配利润	-13,462,778.17	-17,017,715.39	9,126,438.58
期末可供分配基金份额利润	-0.1072	-0.1654	0.0778
期末基金资产净值	112,076,274.27	85,892,733.74	126,381,979.26
期末基金份额净值	0.8928	0.8346	1.0778
3.1.3 累计期末指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
基金份额累计净值增长率	-10.14%	-16.00%	8.48%

注：（1）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。

（2）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。

（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。

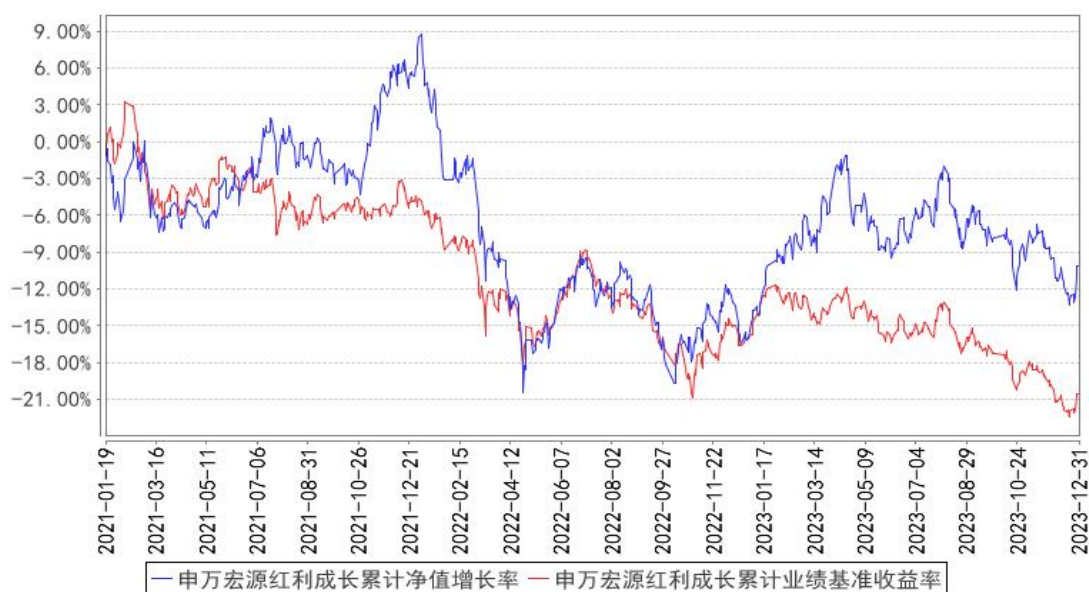
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	-2.55%	0.75%	-3.92%	0.47%	1.37%	0.28%
过去六个月	-3.78%	0.82%	-5.87%	0.51%	2.09%	0.31%
过去一年	6.97%	0.83%	-5.40%	0.51%	12.37%	0.32%
自基金合同生效起至今	-10.14%	0.89%	-20.52%	0.66%	10.38%	0.23%

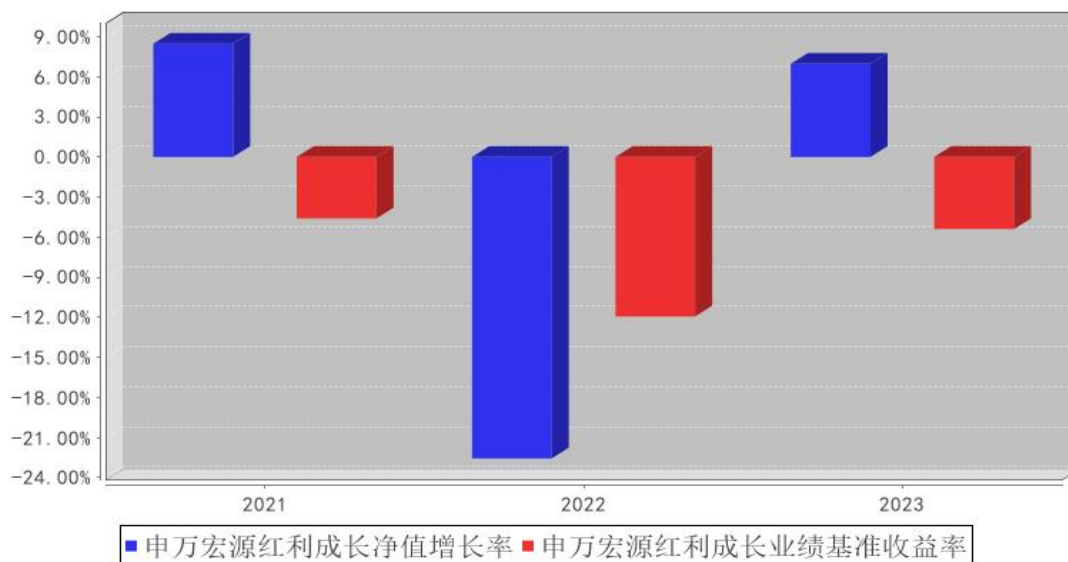
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



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

申万宏源红利成长基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：2021 年数据按《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》生效当年实际存续期计算，未按整个自然年度折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2021 年	0.9500	10,383,303.97	655,123.81	11,038,427.78	

合计	0.9500	10,383,303.97	655,123.81	11,038,427.78
----	--------	---------------	------------	---------------

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

申万宏源证券资产管理有限公司（以下简称“申万宏源资管”或“公司”）正式成立于 2022 年 12 月 20 日，是申万宏源证券有限公司（以下简称“申万宏源证券”或“母公司”）的全资子公司，公司注册资本 25 亿元，是国内目前较大的证券资产管理公司之一。

申万宏源资管已取得《经营证券期货业务许可证》（流水号：000000059581），具备证券资产管理业务资格。

截至 2023 年 12 月 31 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		
陈旻	本基金的基金经理	2019 年 04 月 15 日	-	19 年	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、申万宏源证券有限公司资产管理事业部投资经理，现任申万宏源证券资产管理有限公司公募投资部高级投资经理，拥有丰富的投资运营管理经验，不存在其他兼职情况。已取得投资主办人执业证书，证书编号为：S0900812110010，并已取得基金从业资格，证书编号为：F4530000002658，且最近三年无被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚的经历。
秦庆	本基金的基金经理	2019 年 04 月 15 日	-	15 年	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、原宏源证券北京资管分公司权益投资部、申万宏源证券有限公司资产管理事业部，现任申万宏源证券资产管理有限公司公募投资部投资经理。拥有丰富的投资运营管理经验，不存

					在其他兼职情况。已取得投资主办人执业证书，证书编号为：S1180814050001，并已取得基金从业资格，证书编号为：F4530000002689，且最近三年无被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚的经历。
--	--	--	--	--	----------------------------------------------------------------------------------------------------------

注：1. 任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日；鉴于本集合计划由证券公司大集合资产管理计划变更而来，若投资经理在变更生效日（即基金合同生效日）前已担任本集合计划投资经理的，则任职日期为该投资经理首次担任本集合计划投资经理之日。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 基金经理薪酬机制

不存在需披露的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

同投资组合的投资行为进行分析、评估，形成分析报告，如果发现涉嫌违背公平交易原则的行为，及时向公司管理层汇报并采取相关控制和改进措施。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内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。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本集合计划投资经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023年，A股市场各大类指数普遍下跌，其中上证指数跌3.70%，沪深300跌11.38%，中证500跌7.42%，创业板指跌19.41%。

2023年国内经济基本面总体温和修复。受海外经济周期和加息影响，外需回落压力较大，出口景气度回落；在财政持续发力下，基建投资增长保持高韧性；制造业景气度回暖，投资同比增速上行；地产投资整体表现低迷，处于低位筑底阶段，供需两端政策持续加码；服务消费持续回暖，可选消费动能相对一般，居民消费意愿仍有提升空间。全年整体货币政策维持稳健宽松，流动性保持合理宽裕。股票市场在整体下跌的环境下，小盘风格表现相对抗跌。行业层面上，通信、

传媒、计算机、电子、石油石化等行业表现较好，而美容护理、商贸零售、房地产、电力设备、建筑材料等行业表现相对落后。

报告期内，本集合计划保持了较高的权益类资产的仓位，实现了一定幅度的绝对收益。期间管理人使用宏观状态指引下的风格比较、行业比较体系及景气度与估值指标综合考量的个股比较体系构成的自上而下策略进行产品的投资运作，以此为依据对持仓结构实行动态优化。权益仓位主要覆盖在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及受益未来经济复苏的质优价值蓝筹板块，并在低位适度配置了高股息板块，全年主要把握了科技股、金融股、资源股以及智能车产业链的一些核心个股的投资机会。

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。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末本基金份额单位净值为 0.8928 元；本报告期基金份额净值增长率为 6.97%，同期业绩比较基准收益率为-5.40%。

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 2024 年，管理人预计国内财政政策将延续积极态势，货币政策上延续稳健宽松，流动性整体无忧，对于资金中枢及资金价格的波动仍需关注，通胀水平总体维持在相对低位。其中基建投资预计继续保持较高韧性，制造业投资持续稳定升温，地产在供需政策加码下，恢复情况仍有待观察，预计整体上地产基本面低位筑底；消费上政策支持仍有空间，总体韧性较高，预计维持弱复苏格局；加息周期结束，海外需求压力缓解，出口有望转暖。总体而言，国内宏观经济基本面预计将保持温和修复，货币政策稳健宽松，流动性充裕合理。

在上述宏观背景下，预计权益市场整体赚钱效应好于 2023 年，在当前状态空间下，管理人将继续把握其中低估值分位数、景气变化积极的优质个股投资机会，后期需关注实体经济恢复实际情况和资金面的变化，一旦各类数据转向更优的积极状态，权益部分的操作将更追求弹性。

目前时点展望未来，管理人相对更看好以下几方面投资机会：一是以智能车等新型终端需求以及 AI 等新技术为主要基本面驱动力的电子、计算机、化工新材料等行业核心个股的投资机会，这些类别的个股目前有望兼具基本面的拐点、代表经济转型以及政策支持的方向、较低的历史估值分位数等有利因素，目前时刻显得性价比为突出；二是其他泛高端制造业板块中，经过景气度与估值指标综合考量的个股比较体系权衡后，管理人认为军工、机械设备、电力设备中的一些细分板块目前的投资机会相对较好；三是传统价值蓝筹板块中，我们认为目前非银金融、工业金

属、能源金属、航运、工程机械等板块具有更好的投资价值。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本集合计划管理人持续完善内部控制机制，建立健全内部控制制度体系，根据有关法律法规、公司规章制度要求，不断加强合规风控、内审稽核工作，有效保障了公司各项业务合规有序开展。

本报告期内，本集合计划管理人监察稽核工作主要包括以下几个方面：

1、进一步健全制度管理体系，根据法律法规要求，持续开展对业务制度覆盖情况的评估，及时启动制度制定、修订工作。从管理制度和业务流程上进行风险控制，进一步强化内部控制的执行力度，通过不断完善制度体系，公司形成了以制度规范业务开展的常态化工作模式，为公司合规展业，打下了坚实的制度基础。

2、继续做好全流程投资交易监督，严格投资监控，切实履行日常风险管理职责，坚持岗位分离、相互制衡的内控机制，形成不同岗位之间的有效制衡，不断完善公平交易、异常交易等监测管控，增强风险防控的前瞻性、主动性，对可能发生的风险情况进行提前预判和充分论证，明确风险应对措施，持续强化风险控制措施和风险管理水平。

3、持续开展合规风控文化建设，建立常态化宣传培训工作机制，重点围绕公司员工执业行为规范、投研交易、廉洁从业、销售管理等方面，通过收集案例警示员工在业务开展过程中可能存在的风险管理薄弱环节，组织开展形式多样的宣传活动，强化公司全员合规工作意识，营造合规人人有责的文化氛围。

4、深入实践“风险为本”方法，在持续夯实现行反洗钱履职工作的基础上，进一步探索适用于各类业务的反洗钱管理策略及工作方法论，重点优化了以客户为中心的反洗钱可疑交易监测体系，完善可疑交易监测指标，同时健全反洗钱制度体系，加大对客户反洗钱的审查力度，提升员工反洗钱工作意识。

5、不断提高防范和化解风险的能力，持续提升监察稽核及合规审查工作质效，构建适用于当前业务发展的内审稽核工作流程，形成以合规风控及其他职能部门为牵头主体的日常检查监督机制，做强内控部门的联动，主动发力，加大对资产管理业务合规检查及内审稽核的力度，排查业务风险隐患，严防合规漏洞，切实保护投资者合法权益。

本集合计划管理人持续贯彻落实“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化要求，积极培育合规文化，持续加强风险防范，严守合规底线，不断提升公司监察稽核工作管理水平，努力防范和控制各类风险，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，保障集合计划份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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，本基金报告期未进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
------------	---

审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	中兴华审字（2024）第 010060 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划全体持有人
审计意见	<p>我们审计了后附的申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划（以下简称“集合计划”）的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表、净资产变动表以及财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的有关规定编制，公允反映了集合计划 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于集合计划，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	<p>集合计划的管理人申万宏源证券资产管理有限公司管理层（以下简称“申万资管管理层”）对其他信息负责。其他信息包括集合计划 2023 年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>申万资管管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>申万资管治理层负责监督集合计划的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p>

	<p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价申万资管管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与申万资管治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	中兴华会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	傅虎	谭军英
会计师事务所的地址	北京市丰台区丽泽路 20 号丽泽 SOHO B 座 20 层	
审计报告日期	2024 年 3 月 15 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	8,061,500.33	6,805,978.48
结算备付金		2,075,833.74	2,371,657.47
存出保证金		10,982.79	9,979.72
交易性金融资产	7.4.7.2	101,052,048.12	74,459,611.33
其中：股票投资		100,601,074.98	73,898,038.08
基金投资		-	-
债券投资		450,973.14	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	4,949,563.02	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		68,741.20	353,736.76
应收股利		-	-
应收申购款		76,523.46	3,996.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		116,295,192.66	90,447,830.66
负债和净资产	附注号	本期末 2023年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		48,252.11	577,543.47
应付赎回款		2,275.21	-
应付管理人报酬		113,582.54	89,802.87
应付托管费		14,197.82	11,225.37
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		3,828,405.26	3,828,634.09
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	212,205.45	47,891.12
负债合计		4,218,918.39	4,555,096.92
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	125,539,052.44	102,910,449.13
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	-13,462,778.17	-17,017,715.39
净资产合计		112,076,274.27	85,892,733.74
负债和净资产总计		116,295,192.66	90,447,830.66

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.8928 元，基金份额总额 125,539,052.44 份。

7.2 利润表

会计主体：申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		7,062,070.83	-26,821,749.74
1. 利息收入		185,560.66	490,731.38
其中：存款利息收入	7.4.7.9	82,149.82	89,010.35
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		103,410.84	401,721.03
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		3,153,625.11	-8,822,030.98
其中：股票投资收益	7.4.7.10	1,245,393.11	-10,232,938.67
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	17,922.46	3,322.81
资产支持证券投资	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	-	79,931.67
股利收益	7.4.7.14	1,890,309.54	1,327,653.21
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）	7.4.7.15	3,466,749.13	-18,533,517.89
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	256,135.93	43,067.75
减：二、营业总支出		1,516,013.25	1,340,717.74
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,193,723.58	1,182,450.28
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	149,215.44	147,806.28
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
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		7,419.23	2,021.18

8. 其他费用	7.4.7.17	165,655.00	8,440.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5,546,057.58	-28,162,467.48
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5,546,057.58	-28,162,467.48
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		5,546,057.58	-28,162,467.48

7.3 净资产变动表

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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	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	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）	22,628,603.31	-	3,554,937.22	26,183,540.53
（一）、综合收益总额	-	-	5,546,057.58	5,546,057.58
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	22,628,603.31	-	-1,991,120.36	20,637,482.95
其中：1. 基金申购款	92,958,120.48	-	-7,937,497.37	85,020,623.11
2. 基金赎回款	-70,329,517.17	-	5,946,377.01	-64,383,140.16
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净	-	-	-	-

资产变动（净资产减少以“-”号填列）				
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	125,539,052.44	-	-13,462,778.17	112,076,274.27
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	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	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）	-14,345,091.55	-	-26,144,153.97	-40,489,245.52
（一）、综合收益总额	-	-	-28,162,467.48	-28,162,467.48
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-14,345,091.55	-	2,018,313.51	-12,326,778.04
其中：1. 基金申购款	16,474,148.22	-	-1,129,872.75	15,344,275.47
2. 基金赎回款	-30,819,239.77	-	3,148,186.26	-27,671,053.51
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-

四、本期期末净资产	102,910,449.13	-	-17,017,715.39	85,892,733.74
-----------	----------------	---	----------------	---------------

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>袁锦</u>	<u>王伟</u>	<u>王一蕊</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

申万宏源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，自集合计划合同变更生效日起存续至 2024 年 12 月 31 日。本集合计划的管理人为申万宏源证券资产管理有限公司，托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》的有关规定，本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括境内依法发行的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票，不包含港股）、债券（含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券等）、货币市场工具、同业存单、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许集合计划投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本集合计划可以参与融资交易；不可以参与融券交易，不得将其持有的股票作为融券标的证券出借给证券金融公司，但法律法规另有规定的除外。

法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种的，管理人在履行合同变更程序后，可以将其纳入本集合计划的投资范围。

本集合计划的投资组合比例为：股票资产占集合计划资产的比例为 0%—95%（投资于境内依法发行上市的股票占集合计划资产的 0%—95%）；投资同业存单不超过集合计划资产的 20%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，集合计划保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于集合计划资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如因证券/期货市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等证券公司之外的因素，造成集合计划投资比例超标，管理人应在 10 个交易日内将投资比例降至许可范围内。

本集合计划的业绩比较基准为 $60\% \times$ 沪深 300 指数 $+40\% \times$ 上证国债指数。

7.4.2 会计报表的编制基础

本集合计划的财务报表按照财政部颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》和中国证监会、中国基金业协会允许的如财务报表附注 7.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产(或负债)，并形成其他单位的金融负债(或资产)或权益工具的合同。

1、金融资产的分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

2、金融负债的分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(1) 金融资产及金融负债的确认和初始计量 金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具

合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

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

(2) 金融资产的分类和后续计量

(a) 本基金金融资产的分类

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

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；

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

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

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资

产的业务模式。

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

(b) 本基金金融资产的后续计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失(包括利息和股利收入)计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

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

(3) 金融资产的终止确认

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

(4) 金融负债的后续计量和终止确认

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产

或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认，并于期末全额转入未分配利润。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、本集合计划每一份额享有同等分配权；

2、在符合有关集合计划收益分配条件的前提下，本集合计划每个会计年度收益分配次数至少为 1 次，本集合资产管理计划每年收益分配次数最多为 4 次，每个会计年度累计分配金额不得低于年末可供分配利润的 70%。若合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

3、集合计划收益分配后，收益分配基准日的份额净值减去每单位份额收益分配金额后不能低于面值；

4、本集合计划收益分配方式分为两种：现金红利与红利再投资，红利再投资增加的份额计入集合计划份额总规模，投资人可选择现金红利或将现金红利转为集合计划份额进行再投资；若投资人不选择，本集合计划默认的收益分配方式是现金红利；

5、选择采取红利再投资形式的，分红资金将按除息日的份额净值转成相应的份额。投资人在不同销售机构处可以选择不同的分红方式；

6、法律、法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 外币交易

本基金本报告期无外币交易。

7.4.4.13 分部报告

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本集合计划本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	8,061,500.33	6,805,978.48
等于：本金	8,059,627.58	6,804,533.08
加：应计利息	1,872.75	1,445.40

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	8,061,500.33	6,805,978.48

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	109,698,984.53	-	100,601,074.98	-9,097,909.55	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	471,173.41	4,692.78	450,973.14	-24,893.05
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	471,173.41	4,692.78	450,973.14	-24,893.05
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	110,170,157.94	4,692.78	101,052,048.12	-9,122,802.60	
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	86,469,333.87	-	73,898,038.08	-12,571,295.79	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	575,214.94	4,614.25	561,573.25	-18,255.94
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	575,214.94	4,614.25	561,573.25	-18,255.94
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	0.00	0.00	0.00	0.00	
合计	87,044,548.81	4,614.25	74,459,611.33	-12,589,551.73	

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

7.4.7.3.2 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。

7.4.7.3.3 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。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	4,949,563.02	-
银行间市场	-	-
合计	4,949,563.02	-
项目	上年度末 2022年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	6,442,870.90	-
银行间市场	-	-
合计	6,442,870.90	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	1.11	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	47,004.34	39,891.12
其中：交易所市场	47,004.34	39,891.12
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	165,200.00	8,000.00

合计	212,205.45	47,891.12
----	------------	-----------

7.4.7.7 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12月31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	92,958,120.48	92,958,120.48
本期赎回（以“-”号填列）	-70,329,517.17	-70,329,517.17
本期末	125,539,052.44	125,539,052.44

7.4.7.8 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
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	37,856,818.69	-54,874,534.08	-17,017,715.39
本期利润	2,079,308.45	3,466,749.13	5,546,057.58
本期基金份额交易产生的变动数	8,615,108.35	-10,606,228.71	-1,991,120.36
其中：基金申购款	35,321,264.32	-43,258,761.69	-7,937,497.37
基金赎回款	-26,706,155.97	32,652,532.98	5,946,377.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	48,551,235.49	-62,014,013.66	-13,462,778.17

7.4.7.9 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12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
	活期存款利息收入	58,035.30
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	23,975.50	36,612.64

其他	139.02	316.54
合计	82,149.82	89,010.35

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 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12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,245,393.11	-10,232,938.67
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	1,245,393.11	-10,232,938.67

7.4.7.10.2 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12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出股票成交总额	63,758,015.10	79,753,303.92
减：卖出股票成本总额	62,264,291.57	89,655,300.68
减：交易费用	248,330.42	330,941.91
买卖股票差价收入	1,245,393.11	-10,232,938.67

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 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12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
债券投资收益——利息收入	8,885.94	1,386.56
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到	9,036.52	1,936.25

期兑付) 差价收入		
债券投资收益——赎回 差价收入		
债券投资收益——申购 差价收入		
合计	17,922.46	3,322.81

7.4.7.11.2 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12月31 日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31 日
卖出债券（债转股及债券 到期兑付）成交总额	178,314.36	140,079.10
减：卖出债券（债转股及 债券到期兑付）成本总额	168,041.53	136,412.94
减：应计利息总额	1,218.48	1,644.25
减：交易费用	17.83	85.66
买卖债券差价收入	9,036.52	1,936.25

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

7.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.13 衍生工具收益

7.4.7.13.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12 月31日
股指期货投资收益	-	79,931.67

7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
股票投资产生的股利 收益	1,890,309.54	1,327,653.21
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	1,890,309.54	1,327,653.21
----	--------------	--------------

7.4.7.15 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 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
1. 交易性金融资产	3,466,749.13	-18,533,517.89
股票投资	3,473,386.24	-18,515,261.95
债券投资	-6,637.11	-18,255.94
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	3,466,749.13	-18,533,517.89

7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
基金赎回费收入	256,135.93	43,067.75
合计	256,135.93	43,067.75

7.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31 日
审计费用	8,000.00	8,000.00
信息披露费	120,000.00	-
证券出借违约金	-	-
银行费用	95.00	440.00
账户维护费	360.00	-
其他	37,200.00	-
合计	165,655.00	8,440.00

7.4.7.18 分部报告

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本集合计划无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
申万宏源证券资产管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
申万宏源证券有限公司	基金管理人的股东，基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	138,284,746.60	100.00	173,208,267.51	100.00

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	178,314.36	100.00	856,564.10	100.00

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	1,078,995,000.00	100.00	2,707,076,000.00	100.00

7.4.10.1.4 权证交易

注：本报告期及上年度可比期间内，本基金均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
申万宏源证券有 限公司	189,785.73	100.00	47,004.34	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
申万宏源证券有 限公司	237,030.11	100.00	39,891.12	100.00

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费	1,193,723.58
其中：应支付销售机构的客户维护 费	315,349.98	203,479.21
应支付基金管理人的净管理费	878,373.60	978,971.07

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

集合计划管理费每日计提，逐日累计至每月末，按月支付。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	149,215.44	147,806.28

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

集合计划托管费每日计提，逐日累计至每月末，按月支付。

7.4.10.2.3 销售服务费

注：本报告期及上年度可比期间内，本基金均未与关联方产生销售服务费。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：本报告期及上年度可比期间内，本集合计划均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。

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

注：本报告期及上年度可比期间内，本集合计划均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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2021 年 1 月 19 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	0.00	-

报告期间申购/买入总份额	16,539,966.14	-
报告期间因拆分变动份额	0.00	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	-
报告期末持有的基金份额	16,539,966.14	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	13.18%	-

注：根据《关于申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划管理人及自有资金跟投主体变更的公告》，自 2023 年 10 月 9 日起，本集合计划管理人由“申万宏源证券有限公司”变更为“申万宏源证券资产管理有限公司”。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023 年 12 月 31 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)
申万宏源证券 有限公司	-	-	11,000,000.00	10.6889

注：根据《关于申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划管理人及自有资金跟投主体变更的公告》，自 2023 年 10 月 9 日起，本集合计划管理人由“申万宏源证券有限公司”变更为“申万宏源证券资产管理有限公司”。根据《申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划自有资金置换公告》，申万宏源证券有限公司持有的全部份额共计 1100 万份已于 2023 年 12 月 22 日全部赎回。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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	8,061,500.33	58,035.30	6,805,978.48	52,081.17

7.4.10.7 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，本集合计划均未发生本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

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。

7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人秉承全面风险管理的理念，遵循申万宏源证券资产管理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经营管理层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公司下设风险管理部及信评部门对资产管理业务风险进行的预防和控制；三道风险防范是指投资部门对自身业务工作风险进行的自我检查和控制。各部门负责人为其所在部门风险管理的第一责任人，公司员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。风险管理部门对公司的风险管理进行独立评估、监控、检查并及时向管理层汇报。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指集合计划在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者集合计划所投资证券

之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致集合计划资产损失和收益变化的风险。

本基金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。

7.4.13.2.1 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12月31日	上年度末 2022年12月31日
AAA	150,736.41	209,853.95
AAA以下	300,236.73	351,719.30
AA+	262,154.30	351,719.30
AA-	38,082.43	-
未评级	-	-
合计	450,973.14	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。

7.4.13.3 流动性风险

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

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

针对第二类投资品种的流动性风险，管理人持续监控各项流动性指标，包括组合持仓集中度、投资组合在短期内变现能力、流通受限资产的比例等指标，通过指标来持续地评估、选择、跟踪和控制投资组合的投资流动性风险。管理人已建立压力测试机制，针对不同类型投资组合建立流动性压力测试模型，对各相关风险因子进行极端假设，进而评估对投资组合流动性的负面影响。

同时，建立流动性风险应急机制，在发生或发现潜在较大的流动性风险时，管理人会立即启动应急机制。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金管理人严格按照《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。

本基金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。

本基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度。通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等方面进行尽职调查，严格落实准入管理；对交易对手实施交易额度管理等措施来管理本集合计划从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					

银行存款	8,061,500.33	-	-	-	8,061,500.33
结算备付金	2,075,833.74	-	-	-	2,075,833.74
存出保证金	10,982.79	-	-	-	10,982.79
交易性金融资产	-	412,890.71	38,082.43	100,601,074.98	101,052,048.12
买入返售金融资产	4,949,563.02	-	-	-	4,949,563.02
应收申购款	-	-	-	76,523.46	76,523.46
应收证券清算款	-	-	-	68,741.20	68,741.20
资产总计	15,097,879.88	412,890.71	38,082.43	100,746,339.64	116,295,192.66
负债					
应付证券清算款	-	-	-	48,252.11	48,252.11
应付赎回款	-	-	-	2,275.21	2,275.21
应付赎回费	-	-	-	1.11	1.11
应付管理人报酬	-	-	-	113,582.54	113,582.54
应付托管费	-	-	-	14,197.82	14,197.82
应付交易费用	-	-	-	47,004.34	47,004.34
应交税费	-	-	-	3,828,405.26	3,828,405.26
其他负债	-	-	-	165,200.00	165,200.00
负债总计	0.00	-	-	4,218,918.39	4,218,918.39
利率敏感度缺口	15,097,879.88	412,890.71	38,082.43	96,527,421.25	112,076,274.27
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	-	-	-	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：上表统计了本集合计划的利率风险敞口。表中所示为本集合计划资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
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12月31日）	上年度末（2022年12月31日）
	1. 市场利率下降 25个基点	1,330.08	2,511.92
2. 市场利率上升 25个基点	-1,330.08	-2,511.92	

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 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股票和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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31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	100,601,074.98	89.76	73,898,038.08	86.04
交易性金融资产—基金投资	-	0.00	0.00	0.00
交易性金融资产—债券投资	450,973.14	0.40	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	101,052,048.12	90.16	74,459,611.33	86.69
----	----------------	-------	---------------	-------

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
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12月31日）	上年度末（2022年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	7,051,094.71	5,184,094.13
业绩比较基准下降5%	-7,051,094.71	-5,184,094.13	

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：本集合计划不涉及采用风险价值法管理风险

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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12月31日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	101,052,048.12	73,433,950.33
第二层次	-	1,025,661.00
第三层次	-	-
合计	101,052,048.12	74,459,611.33

7.4.14.2.2 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。本基金本报告期及上年度可比期间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。

7.4.14.3 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。

7.4.14.4 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。

7.4.15 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。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	100,601,074.98	86.50
	其中：股票	100,601,074.98	86.50
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	450,973.14	0.39
	其中：债券	450,973.14	0.39
	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	4,949,563.02	4.26
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	10,137,334.07	8.72
8	其他各项资产	156,247.45	0.13
9	合计	116,295,192.66	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	4,342,313.00	3.87

C	制造业	61,883,033.50	55.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,626,127.00	2.34
E	建筑业	1,653,028.00	1.47
F	批发和零售业	162,464.30	0.14
G	交通运输、仓储和邮政业	3,592,106.00	3.21
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,741,767.58	1.55
J	金融业	22,680,437.60	20.24
K	房地产业	1,037,150.00	0.93
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	475,391.00	0.42
N	水利、环境和公共设施管理业	405,194.00	0.36
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,063.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	100,601,074.98	89.76

注：本报告期末按文化、体育和娱乐业行业分类的境内股票投资组合的公允价值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。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600372	中航机载	485,728	6,401,895.04	5.71
2	002475	立讯精密	122,300	4,213,235.00	3.76
3	601688	华泰证券	236,600	3,300,570.00	2.94
4	000725	京东方 A	724,900	2,827,110.00	2.52
5	600038	中直股份	68,900	2,654,717.00	2.37
6	600030	中信证券	125,400	2,554,398.00	2.28
7	601211	国泰君安	165,500	2,462,640.00	2.20
8	000776	广发证券	164,400	2,349,276.00	2.10
9	002465	海格通信	176,000	2,261,600.00	2.02
10	601919	中远海控	221,600	2,122,928.00	1.89
11	601318	中国平安	47,400	1,910,220.00	1.70
12	601108	财通证券	240,360	1,865,193.60	1.66
13	601899	紫金矿业	149,100	1,857,786.00	1.66
14	000738	航发控制	93,100	1,852,690.00	1.65
15	601166	兴业银行	102,700	1,664,767.00	1.49
16	600362	江西铜业	92,700	1,655,622.00	1.48

17	000001	平安银行	157,200	1,476,108.00	1.32
18	000630	铜陵有色	421,900	1,383,832.00	1.23
19	600497	驰宏锌锗	262,200	1,324,110.00	1.18
20	600741	华域汽车	78,200	1,273,096.00	1.14
21	600183	生益科技	65,100	1,191,981.00	1.06
22	600905	三峡能源	267,000	1,166,790.00	1.04
23	600958	东方证券	127,600	1,110,120.00	0.99
24	002415	海康威视	29,500	1,024,240.00	0.91
25	000408	藏格矿业	40,300	1,021,202.00	0.91
26	300627	华测导航	31,260	969,685.20	0.87
27	002138	顺络电子	35,600	961,556.00	0.86
28	603078	江化微	58,610	938,932.20	0.84
29	002439	启明星辰	33,000	891,000.00	0.79
30	300547	川环科技	52,500	884,625.00	0.79
31	000651	格力电器	27,200	875,024.00	0.78
32	002236	大华股份	47,400	874,530.00	0.78
33	600808	马钢股份	320,000	870,400.00	0.78
34	000333	美的集团	15,300	835,839.00	0.75
35	600585	海螺水泥	36,900	832,464.00	0.74
36	300059	东方财富	57,800	811,512.00	0.72
37	002738	中矿资源	21,180	790,225.80	0.71
38	605358	立昂微	28,300	775,137.00	0.69
39	601668	中国建筑	160,000	769,600.00	0.69
40	002273	水晶光电	55,000	744,700.00	0.66
41	600862	中航高科	33,400	739,810.00	0.66
42	600027	华电国际	143,000	735,020.00	0.66
43	601168	西部矿业	51,300	732,051.00	0.65
44	601288	农业银行	200,000	728,000.00	0.65
45	300481	濮阳惠成	41,200	718,940.00	0.64
46	600837	海通证券	74,600	699,002.00	0.62
47	688300	联瑞新材	13,194	698,622.30	0.62
48	600887	伊利股份	24,600	658,050.00	0.59
49	600498	烽火通信	38,700	643,968.00	0.57
50	600428	中远海特	118,200	633,552.00	0.57
51	603306	华懋科技	23,200	628,952.00	0.56
52	002129	TCL 中环	39,575	618,953.00	0.55
53	002466	天齐锂业	10,400	580,216.00	0.52
54	300861	美畅股份	16,500	549,285.00	0.49
55	601117	中国化学	86,000	546,960.00	0.49
56	603297	永新光学	5,300	526,555.00	0.47
57	000002	万科 A	50,000	523,000.00	0.47
58	000625	长安汽车	30,500	513,315.00	0.46
59	000898	鞍钢股份	206,000	512,940.00	0.46

60	300969	恒帅股份	5,700	512,259.00	0.46
61	603920	世运电路	27,300	499,044.00	0.45
62	300447	全信股份	33,800	490,100.00	0.44
63	688518	联赢激光	23,400	479,232.00	0.43
64	002352	顺丰控股	11,600	468,640.00	0.42
65	600918	中泰证券	68,000	466,480.00	0.42
66	600219	南山铝业	158,600	466,284.00	0.42
67	000768	中航西飞	19,700	440,689.00	0.39
68	000060	中金岭南	100,000	432,000.00	0.39
69	002212	天融信	42,700	417,606.00	0.37
70	600760	中航沈飞	9,600	404,928.00	0.36
71	000100	TCL 科技	90,000	387,000.00	0.35
72	002258	利尔化学	31,500	377,055.00	0.34
73	603859	能科科技	9,900	373,527.00	0.33
74	002459	晶澳科技	17,940	371,716.80	0.33
75	601298	青岛港	58,000	358,440.00	0.32
76	601619	嘉泽新能	99,100	349,823.00	0.31
77	300373	扬杰科技	9,500	348,650.00	0.31
78	002029	七匹狼	58,400	334,632.00	0.30
79	601998	中信银行	63,000	333,270.00	0.30
80	600048	保利发展	33,000	326,700.00	0.29
81	300782	卓胜微	2,300	324,300.00	0.29
82	601857	中国石油	45,500	321,230.00	0.29
83	600500	中化国际	70,000	309,400.00	0.28
84	002985	北摩高科	8,900	308,652.00	0.28
85	002008	大族激光	14,300	296,296.00	0.26
86	601377	兴业证券	50,400	295,848.00	0.26
87	600036	招商银行	10,500	292,110.00	0.26
88	002859	洁美科技	11,600	289,420.00	0.26
89	000063	中兴通讯	10,800	285,984.00	0.26
90	600483	福能股份	34,000	281,180.00	0.25
91	002532	天山铝业	46,300	278,263.00	0.25
92	688033	天宜上佳	16,465	278,258.50	0.25
93	002460	赣锋锂业	6,500	278,200.00	0.25
94	603118	共进股份	31,000	277,760.00	0.25
95	000807	云铝股份	22,000	268,840.00	0.24
96	000932	华菱钢铁	52,000	267,800.00	0.24
97	002324	普利特	20,100	264,315.00	0.24
98	600196	复星医药	10,500	262,815.00	0.23
99	002601	龙佰集团	15,000	256,950.00	0.23
100	300398	飞凯材料	16,300	256,888.00	0.23
101	600908	无锡银行	50,000	252,500.00	0.23
102	000893	亚钾国际	9,500	249,280.00	0.22

103	600019	宝钢股份	40,100	237,793.00	0.21
104	601200	上海环境	25,000	224,750.00	0.20
105	300073	当升科技	5,500	210,100.00	0.19
106	600801	华新水泥	16,500	205,095.00	0.18
107	601238	广汽集团	22,500	196,875.00	0.18
108	300243	瑞丰高材	20,000	195,400.00	0.17
109	002732	燕塘乳业	9,500	182,400.00	0.16
110	688589	力合微	4,438	177,120.58	0.16
111	300760	迈瑞医疗	600	174,360.00	0.16
112	600323	瀚蓝环境	10,000	173,300.00	0.15
113	603180	金牌厨柜	6,900	173,121.00	0.15
114	002371	北方华创	700	171,997.00	0.15
115	688608	恒玄科技	1,100	169,697.00	0.15
116	300221	银禧科技	28,000	168,000.00	0.15
117	600161	天坛生物	5,400	167,076.00	0.15
118	603650	彤程新材	5,000	166,500.00	0.15
119	605123	派克新材	1,800	164,160.00	0.15
120	000786	北新建材	6,700	156,512.00	0.14
121	688677	海泰新光	2,900	154,367.00	0.14
122	603722	阿科力	2,800	150,920.00	0.13
123	605589	圣泉集团	6,700	149,946.00	0.13
124	603355	莱克电气	6,400	142,720.00	0.13
125	000938	紫光股份	7,200	139,320.00	0.12
126	000895	双汇发展	5,000	133,550.00	0.12
127	000028	国药一致	4,570	132,484.30	0.12
128	603816	顾家家居	3,600	126,000.00	0.11
129	002730	电光科技	13,000	123,240.00	0.11
130	002572	索菲亚	7,400	118,030.00	0.11
131	688376	美埃科技	3,100	117,769.00	0.11
132	300674	宇信科技	7,200	117,216.00	0.10
133	002271	东方雨虹	6,000	115,200.00	0.10
134	000778	新兴铸管	30,000	114,600.00	0.10
135	601186	中国铁建	15,000	114,150.00	0.10
136	000858	五粮液	800	112,248.00	0.10
137	600639	浦东金桥	11,000	111,210.00	0.10
138	000709	河钢股份	52,000	110,760.00	0.10
139	000902	新洋丰	9,600	109,344.00	0.10
140	000783	长江证券	20,000	107,600.00	0.10
141	600028	中国石化	19,200	107,136.00	0.10
142	603259	药明康德	1,400	101,864.00	0.09
143	601390	中国中铁	17,600	99,968.00	0.09
144	688175	高凌信息	3,500	97,755.00	0.09
145	688168	安博通	2,700	97,632.00	0.09

146	002409	雅克科技	1,700	94,741.00	0.08
147	002081	金螳螂	25,000	94,000.00	0.08
148	688115	思林杰	2,600	90,142.00	0.08
149	300638	广和通	4,500	85,635.00	0.08
150	603309	维力医疗	5,800	82,534.00	0.07
151	600438	通威股份	3,200	80,096.00	0.07
152	001979	招商蛇口	8,000	76,240.00	0.07
153	600690	海尔智家	3,000	63,000.00	0.06
154	603663	三祥新材	5,320	58,466.80	0.05
155	600552	凯盛科技	4,100	54,653.00	0.05
156	688012	中微公司	320	49,152.00	0.04
157	300294	博雅生物	1,300	43,784.00	0.04
158	300593	新雷能	2,860	42,242.20	0.04
159	002327	富安娜	4,700	42,065.00	0.04
160	301219	腾远钴业	1,040	40,944.80	0.04
161	600011	华能国际	5,000	38,500.00	0.03
162	002568	百润股份	1,500	36,915.00	0.03
163	300393	中来股份	3,000	31,020.00	0.03
164	600879	航天电子	4,000	30,840.00	0.03
165	688295	中复神鹰	1,000	30,310.00	0.03
166	600803	新奥股份	1,700	28,594.00	0.03
167	688538	和辉光电	11,700	28,431.00	0.03
168	600284	浦东建设	4,500	28,350.00	0.03
169	300376	易事特	4,400	28,028.00	0.03
170	002078	太阳纸业	2,300	27,991.00	0.02
171	600655	豫园股份	4,500	27,945.00	0.02
172	688596	正帆科技	700	27,741.00	0.02
173	000878	云南铜业	2,500	27,225.00	0.02
174	600163	中闽能源	6,000	26,220.00	0.02
175	603215	比依股份	1,500	25,950.00	0.02
176	603610	麒盛科技	2,000	23,840.00	0.02
177	301221	光庭信息	400	23,320.00	0.02
178	603059	倍加洁	1,000	22,560.00	0.02
179	002340	格林美	4,000	21,840.00	0.02
180	603768	常青股份	1,000	18,540.00	0.02
181	600699	均胜电子	1,000	17,960.00	0.02
182	600782	新钢股份	4,400	15,356.00	0.01
183	688303	大全能源	498	14,725.86	0.01
184	002920	德赛西威	100	12,951.00	0.01
185	301087	可孚医疗	300	11,370.00	0.01
186	300308	中际旭创	100	11,291.00	0.01
187	300496	中科创达	100	8,006.00	0.01
188	688425	铁建重工	2,000	7,940.00	0.01

189	601000	唐山港	2,200	7,700.00	0.01
190	601127	赛力斯	100	7,620.00	0.01
191	000888	峨眉山 A	800	7,144.00	0.01
192	688041	海光信息	100	7,098.00	0.01
193	002230	科大讯飞	100	4,638.00	0.00
194	603019	中科曙光	100	3,949.00	0.00
195	000977	浪潮信息	100	3,320.00	0.00
196	600873	梅花生物	300	2,865.00	0.00
197	002777	久远银海	100	2,511.00	0.00
198	600060	海信视像	100	2,090.00	0.00
199	603108	润达医疗	100	2,035.00	0.00
200	300379	东方通	100	1,828.00	0.00
201	600373	中文传媒	100	1,318.00	0.00
202	002405	四维图新	100	890.00	0.00
203	000429	粤高速 A	100	846.00	0.00
204	601198	东兴证券	100	823.00	0.00
205	600757	长江传媒	100	745.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	中航机载	7,935,155.77	9.24
2	002475	立讯精密	3,731,659.00	4.34
3	601919	中远海控	2,732,195.00	3.18
4	600030	中信证券	2,579,083.00	3.00
5	000776	广发证券	2,538,608.00	2.96
6	601688	华泰证券	2,482,737.00	2.89
7	601108	财通证券	2,479,889.80	2.89
8	600038	中直股份	2,017,814.00	2.35
9	600362	江西铜业	1,646,745.00	1.92
10	000630	铜陵有色	1,500,763.00	1.75
11	002129	TCL 中环	1,498,847.00	1.75
12	600958	东方证券	1,333,397.00	1.55
13	603297	永新光学	1,191,466.00	1.39
14	600741	华域汽车	1,149,424.00	1.34
15	000625	长安汽车	1,140,252.00	1.33
16	600497	驰宏锌锗	1,113,162.00	1.30
17	000408	藏格矿业	1,069,245.00	1.24
18	002415	海康威视	1,056,109.00	1.23
19	002738	中矿资源	1,055,194.00	1.23
20	600183	生益科技	1,041,626.00	1.21

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	4,168,998.00	4.85
3	688300	联瑞新材	3,284,116.20	3.82
4	601688	华泰证券	3,046,523.00	3.55
5	002236	大华股份	2,623,446.00	3.05
6	002415	海康威视	2,398,361.00	2.79
7	002465	海格通信	2,174,957.00	2.53
8	600372	中航机载	1,671,928.00	1.95
9	688012	中微公司	1,670,276.54	1.94
10	601127	赛力斯	1,235,702.00	1.44
11	600030	中信证券	1,091,649.00	1.27
12	000625	长安汽车	1,065,480.00	1.24
13	603306	华懋科技	1,031,062.00	1.20
14	601108	财通证券	1,015,450.00	1.18
15	300308	中际旭创	1,014,015.00	1.18
16	601288	农业银行	1,007,080.00	1.17
17	002230	科大讯飞	980,271.00	1.14
18	300627	华测导航	946,869.00	1.10
19	000792	盐湖股份	851,574.00	0.99
20	002777	久远银海	824,669.00	0.96

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	85,493,942.23
卖出股票收入（成交）总额	63,758,015.10

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	450,973.14	0.40
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	450,973.14	0.40

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	127006	敖东转债	2,400	262,154.30	0.23
2	110059	浦发转债	1,400	150,736.41	0.13
3	113677	华懋转债	320	38,082.43	0.03

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

根据证监会公告，本基金投资中信证券（600030）发行主体中信证券股份有限公司收到深圳证监局出具的警示函。深圳证监局发现中信证券在 2023 年 6 月 19 日的网络安全事件中，存在机房基础设施建设安全性不足，信息系统设备可靠性管理疏漏等问题。7 月 13 日，深圳证监局对中信证券采取出具警示函的行政监管措施。目前中信证券股份有限公司财务方面一切正常，上述行政监管措施对该公司生产经营、财务状况及偿债能力无重大不利影响。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。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未出现超出基金合同规定的备选股票库的情形。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	10,982.79
2	应收清算款	68,741.20
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	76,523.46
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	156,247.45

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	127006	敖东转债	262,154.30	0.23
2	110059	浦发转债	150,736.41	0.13

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
1,265	99,240.36	27,744,256.28	22.10	97,794,796.16	77.90

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

基金管理人所有从业人员持有本基金	10,197,916.32	8.1233
------------------	---------------	--------

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021年1月19日）基金份额总额	66,700,266.22
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	92,958,120.48
减：本报告期基金总赎回份额	70,329,517.17
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	125,539,052.44

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本集合计划未召开份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，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根据工作需要，任命牛环起、施伟为资产管理业务部副总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本集合计划本报告期投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，未改聘会计师事务所。该审计机构已经连续3年为本基金提供审计服务。报告期内本基金应支付给会计师事务所的报酬为8,000.00元人民币。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 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监管部门稽查或处罚。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：根据托管人审计报告，托管人不存在涉嫌犯罪被依法立案调查的情况，托管人的控股股东、实际控制人、董事、监事、高级管理人员不存在涉嫌犯罪被依法采取强制措施、涉嫌严重违纪违法或者职务犯罪被纪检监察机关采取留置措施且影响其履行职责的情况；托管人或者托管人的控股股东、实际控制人、董事、监事、高级管理人员不存在受到刑事处罚，涉嫌违法违规被中国证监会立案调查或者受到中国证监会行政处罚，或者受到其他有权机关重大行政处罚，或者被中国证监会采取行政监管措施和被证券交易所采取纪律处分的情况；托管人董事、监事、高级管理人员不存在因涉嫌违法违规被其他有权机关采取强制措施且影响其履行职责的情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
申万宏源证券有限公司	2	138,284,746.60	100.00	189,785.73	100.00	-

注：交易单元选择的标准：1、经营行为规范，在近一年内无重大违规行为；2、公司财务状况良好；3、有良好的内控制度，在业内有良好的声誉；4、有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；5、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
申万宏源证券有限公司	178,314.36	100.00	1,078,995.00 0.00	100.00	-	-

司						
---	--	--	--	--	--	--

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划新增销售机构的公告	中国证监会规定披露媒介	2023 年 2 月 20 日
2	申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划新增销售机构公告	中国证监会规定披露媒介	2023 年 4 月 3 日
3	申万宏源证券有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会规定披露媒介	2023 年 8 月 31 日
4	关于申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划管理人及自有资金跟投主体变更的公告	中国证监会规定披露媒介	2023 年 10 月 9 日
5	申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划更新的招募说明书	中国证监会规定披露媒介	2023 年 10 月 9 日
6	申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划基金产品资料概要更新	中国证监会规定披露媒介	2023 年 10 月 9 日
7	申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划自有资金置换公告	中国证监会规定披露媒介	2023 年 12 月 20 日
8	申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划新增销售机构的公告	中国证监会规定披露媒介	2023 年 12 月 25 日
9	申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划自有资金参与结果公告	中国证监会规定披露媒介	2023 年 12 月 26 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

1. 申万宏源证券资产管理有限公司已于 2023 年 9 月 28 日实际取得中国证券监督管理委员会颁发的《经营证券期货业务许可证》。自 2023 年 10 月 9 日起，本集合计划管理人由“申万宏源证券有限公司”变更为“申万宏源证券资产管理有限公司”。本集合计划项下管理人的权利和义务由申万宏源证券资产管理有限公司承继，并由其履行管理人职责。具体请见管理人发布的《关于申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划管理人及自有资金跟投主体变更的公告》。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

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

13.2 存放地点

上海市徐汇区长乐路 989 号 40 层

13.3 查阅方式

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

咨询电话：95523

公司网址：www.swhyzcgl.com

申万宏源证券资产管理有限公司

2024 年 3 月 29 日