

申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资
产管理计划
2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 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 8 月 30 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 8 月 29 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 2024 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
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	11
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	34
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	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	42
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	43

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	43
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	43
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	43
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	43
7.12 投资组合报告附注	44
§ 8 基金份额持有人信息	45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	45
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	45
§ 9 开放式基金份额变动	46
§ 10 重大事件揭示	46
10.1 基金份额持有人大会决议	46
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	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	46
10.4 基金投资策略的改变	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	47
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	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	47
10.8 其他重大事件	48
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	48
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	48
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	48
§ 12 备查文件目录	49
12.1 备查文件目录	49
12.2 存放地点	49
12.3 查阅方式	49

§ 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	116,780,670.61 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	<p>本集合计划根据各项重要的经济指标分析宏观经济发展变动趋势，判断当前所处的经济周期，进而对未来做出科学预测。在此基础上，结合对流动性及资金流向的分析，综合股市和债市估值及风险分析进行资产配置。</p> <p>本集合计划主要投资于中国 A 股市场上高增长高分红能力的上市公司。在个股选择上，本集合计划将采用定量和定性分析相结合的系统方法精选受益于分红能力强、成长性较高且估值合理的股票构建股票组合。</p> <p>本集合计划的投资策略还包括债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、融资投资策略、现金类资产投资策略等。</p>
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		上海市徐汇区长乐路 989 号 40 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		上海市徐汇区长乐路 989 号 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	张金良

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.swhyzcg1.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(2024年1月1日-2024年6月30日)
本期已实现收益	1,313,763.68
本期利润	-1,453,876.36
加权平均基金份额本期利润	-0.0120
本期加权平均净值利润率	-1.37%
本期基金份额净值增长率	-1.36%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)
期末可供分配利润	-13,933,499.19
期末可供分配基金份额利润	-0.1193
期末基金资产净值	102,847,171.42
期末基金份额净值	0.8807
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-11.36%

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

(2) 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平

要低于所列数字。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-1.81%	0.77%	-1.72%	0.29%	-0.09%	0.48%
过去三个月	0.08%	0.94%	-0.49%	0.45%	0.57%	0.49%
过去六个月	-1.36%	1.15%	2.22%	0.53%	-3.58%	0.62%
过去一年	-5.09%	0.99%	-3.78%	0.52%	-1.31%	0.47%
过去三年	-10.23%	0.93%	-16.70%	0.63%	6.47%	0.30%
自基金合同生效起至今	-11.36%	0.93%	-18.76%	0.65%	7.40%	0.28%

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



§ 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 2024 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		
陈旻	本基金的基金经理	2019 年 4 月 15 日	-	20 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：Z0140824030007，并已取得基金从业资格，证书编号为：F4530000002658，且最近三年无被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚的经历。
秦庆	本基金的基金经理	2019 年 4 月 15 日	-	16 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：Z0140824030010，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《申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》、《申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划招募说明书》等有关本集合计划法律文件的规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 上半年，A 股市场小幅下跌，其中上证指数跌 0.25%，深圳成指跌 7.10%，沪深 300 涨 0.89%，中证 500 跌 8.96%，创业板指跌 10.99%。

2024 年上半年，国内经济基本面呈现弱复苏态势。在全球制造业景气修复和海外补库存的支撑下，出口保持较好增长；基建在财政发力稍显滞后的影响下，同比增速尚可；制造业持续回暖，投资提速明显；房地产链条仍显羸弱，需求端改善不及预期，期待政策进一步加码。货币政策方面，央行维持整体流动性相对合理充裕，同时也兼顾防风险防空转，上半年央行降准 1 次，未调降 OMO 及 MLF 利率，为后续政策操作留有空间。股票市场整体在小幅回调的背景下，大盘风格和高股息风格表现相对较好。行业层面上，银行、煤炭、公用事业、家用电器、石油石化等行业表现较好，而计算机、商贸零售、社会服务、传媒、医药生物等行业表现相对落后。

报告期内，本集合计划基本维持了权益类资产的仓位，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。权益仓位目前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、符合新质生产力方向的泛高端制造类优质个股以及部分低估的价值蓝筹股，24 年上半年主要把握了工业金属、电子、航运、银行等行业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，本基金份额净值为 0.8807 元；本报告期基金份额净值增长率为-1.36%，同期业绩比较基准收益率为 2.22%。

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 下半年，宏观经济高质量稳步复苏仍为重心。财政政策继续适度加力，提质增效，政府债发行预计提速，基建投资增速将有所提升。国内通胀总体可控，货币政策上延续稳健宽松，流动性整体无忧，对于监管导向需紧密关注。地产在供需政策加码下，恢复情况仍有待观察，预计地产基本面低位寻底概率较大。消费上政策持续支持，总体韧性较高，预计维持复苏格局。出口方面，在海外需求高韧性下，仍将保持一定支撑。总体而言，经济基本面预计保持弱修复态势，货币政策稳健宽松，流动性充裕合理。

在上述宏观背景下，管理人判断 A 股市场的下行空间较为有限，预计下半年主要机会存在于泛科技类、军工类以及一些估值分位数偏低的传统蓝筹方向，管理人计划积极把握其中基本面趋势向好的优质个股投资机会，后续将继续紧盯宏观经济的恢复进度以及场内流动性的变化情况，适时对权益仓位进行进一步的优化配置以及持仓风格、行业的动态调整。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未实施利润分配，符合本基金基金合同的相关规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

- 1、本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

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

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	7,414,001.19	8,061,500.33
结算备付金		2,428,020.12	2,075,833.74
存出保证金		4,195.46	10,982.79
交易性金融资产	6.4.7.2	87,659,439.29	101,052,048.12
其中：股票投资		87,470,423.70	100,601,074.98
基金投资		-	-
债券投资		189,015.59	450,973.14
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	9,550,000.00	4,949,563.02
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		39,567.66	68,741.20
应收股利		-	-
应收申购款		64,935.06	76,523.46
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		107,160,158.78	116,295,192.66
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		148,447.07	48,252.11
应付赎回款		6,422.92	2,275.21

应付管理人报酬		102,730.76	113,582.54
应付托管费		12,841.35	14,197.82
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		3,835,949.84	3,828,405.26
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	206,595.42	212,205.45
负债合计		4,312,987.36	4,218,918.39
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	116,780,670.61	125,539,052.44
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-13,933,499.19	-13,462,778.17
净资产合计		102,847,171.42	112,076,274.27
负债和净资产总计		107,160,158.78	116,295,192.66

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.8807 元，基金份额总额 116,780,670.61 份。

6.2 利润表

会计主体：申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-673,187.94	10,528,388.65
1. 利息收入		105,654.88	95,551.28
其中：存款利息收入	6.4.7.9	41,436.12	38,901.53
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		64,218.76	56,649.75
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,984,199.46	1,267,004.04
其中：股票投资收益		911,998.96	223,325.24
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-41,809.56	5,832.07
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-

衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	1,114,010.06	1,037,846.73
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）	6.4.7.15	-2,767,640.04	9,066,038.83
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	4,597.76	99,794.50
减：二、营业总支出		780,688.42	710,960.42
1. 管理人报酬		633,591.16	552,220.67
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费		79,198.81	69,027.55
3. 销售服务费		-	-
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		3,752.59	7,242.31
8. 其他费用	6.4.7.17	64,145.86	82,469.89
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,453,876.36	9,817,428.23
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,453,876.36	9,817,428.23
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-1,453,876.36	9,817,428.23

6.3 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	125,539,052.44	-	-13,462,778.17	112,076,274.27
加：会计政策变	-	-	-	-

更				
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	125,539,052.44	-	-13,462,778.17	112,076,274.27
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-8,758,381.83	-	-470,721.02	-9,229,102.85
(一)、综合收益总额	-	-	-1,453,876.36	-1,453,876.36
(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)	-8,758,381.83	-	983,155.34	-7,775,226.49
其中：1. 基金申购款	1,952,519.90	-	-339,726.13	1,612,793.77
2. 基金赎回款	-10,710,901.73	-	1,322,881.47	-9,388,020.26
(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	116,780,670.61	-	-13,933,499.19	102,847,171.42
项目	上年度可比期间			
	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	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)	-4,517,802.36	-	9,928,099.79	5,410,297.43
(一)、综合收益总额	-	-	9,817,428.23	9,817,428.23
(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)	-4,517,802.36	-	110,671.56	-4,407,130.80
其中：1. 基金申购款	20,597,286.73	-	-1,519,972.94	19,077,313.79
2. 基金赎回款	-25,115,089.09	-	1,630,644.50	-23,484,444.59
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(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	98,392,646.77	-	-7,089,615.60	91,303,031.17

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：

袁锦

袁锦

王一蕊

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”或“集合计划”）于 2020 年 8 月 31 日经中国证监会《关于准予宏源证券宏源 3 号红利成长集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函【2020】2384 号）批准，《申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》于 2021 年 1 月 19 日起正式变更生效。本集合计划为契约型开放式，自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 $60\% \times \text{沪深 300 指数} + 40\% \times \text{上证国债指数}$ 。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

(1) 印花税

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

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

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

(2) 增值税

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

(3) 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

(4) 企业所得税

参照财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，对管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税。

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

(5) 个人所得税

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	7,414,001.19
等于：本金	7,412,523.79
加：应计利息	1,477.40
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	7,414,001.19

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	99,367,796.51	-	87,470,423.70	-11,897,372.81	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	178,989.75	3,095.67	189,015.59	6,930.17
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	178,989.75	3,095.67	189,015.59	6,930.17

资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	99,546,786.26	3,095.67	87,659,439.29	-11,890,442.64

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	9,550,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	9,550,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024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	97,744.56
其中：交易所市场	97,744.56
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	108,850.86
合计	206,595.42

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	125,539,052.44	125,539,052.44
本期申购	1,952,519.90	1,952,519.90
本期赎回（以“-”号填列）	-10,710,901.73	-10,710,901.73
本期末	116,780,670.61	116,780,670.61

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	48,551,235.49	-62,014,013.66	-13,462,778.17
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	48,551,235.49	-62,014,013.66	-13,462,778.17
本期利润	1,313,763.68	-2,767,640.04	-1,453,876.36
本期基金份额交易产生的变动数	-3,370,004.53	4,353,159.87	983,155.34
其中：基金申购款	747,295.04	-1,087,021.17	-339,726.13
基金赎回款	-4,117,299.57	5,440,181.04	1,322,881.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	46,494,994.64	-60,428,493.83	-13,933,499.19

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	活期存款利息收入	28,525.76
定期存款利息收入	-	
其他存款利息收入	-	
结算备付金利息收入	12,847.92	
其他	62.44	
合计	41,436.12	

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 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	911,998.96
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	911,998.96

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 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	24,145,238.94
减：卖出股票成本总额	23,168,037.55
减：交易费用	65,202.43
买卖股票差价收入	911,998.96

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 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	3,174.10
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-44,983.66
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	-41,809.56

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 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	252,000.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	292,183.66
减：应计利息总额	4,800.00
减：交易费用	-

买卖债券差价收入	-44,983.66
----------	------------

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 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 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,114,010.06
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	1,114,010.06

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	-2,767,640.04
股票投资	-2,799,463.26
债券投资	31,823.22
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	-2,767,640.04

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	4,597.76
合计	4,597.76

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	3,978.52
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	135.00
账户维护费	360.00
合计	64,145.86

6.4.7.18 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。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本集合计划本报告期存在控制关系或其他重大影响关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
申万宏源证券资产管理有限公司	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：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		上年度可比期间	
	2024年1月1日至2024年6月30日		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 (%)	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	37,011,404.52	100.00	69,491,934.82	100.00
------------	---------------	--------	---------------	--------

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 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 (%)	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)
申万宏源证券有限公司	-	-	138,353.40	100.00

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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 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 (%)	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	821,373,000.00	100.00	589,976,000.00	100.00

6.4.10.1.4 权证交易

注：本报告期及上年度可比期间内，本基金均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024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	50,740.22	100.00	97,744.56	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
申万宏源证券有限公司	95,306.20	100.00	135,197.32	100.00

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	上年度可比期间
----	----	---------

	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	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	633,591.16	552,220.67
其中：应支付销售机构的客户维护费	245,063.79	101,869.07
应支付基金管理人的净管理费	388,527.37	450,351.60

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 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	79,198.81	69,027.55

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。

6.4.10.2.3 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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：本报告期及上年度可比期间内，本集合计划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。

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

注：本报告期及上年度可比期间内，本集合计划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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年6月30日	2023年1月1日至2023年6月30日
基金合同生效日（2021年1月19日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	16,539,966.14	-
报告期间申购/买入总份额	0.00	-
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	14.16%	-

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”。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2024年1月1日至2024年6月30日		2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	7,414,001.19	28,525.76	7,367,322.58	26,279.74

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

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

6.4.12 期末（2024 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

注：本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本集合计划是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。

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。

6.4.13.2.1 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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	-	150,736.41
AAA 以下	-	300,236.73
-	-	38,082.43
未评级	-	-
合计	-	450,973.14

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。

6.4.13.3 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 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。

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 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

资产					
银行存款	7,414,001.19	-	-	-	7,414,001.19
结算备付金	2,428,020.12	-	-	-	2,428,020.12
存出保证金	4,195.46	-	-	-	4,195.46
交易性金融资产	-	154,390.20	34,625.39	87,470,423.70	87,659,439.29
买入返售金融资产	9,550,000.00	-	-	-	9,550,000.00
应收申购款	-	-	-	64,935.06	64,935.06
应收清算款	-	-	-	39,567.66	39,567.66
资产总计	19,396,216.77	154,390.20	34,625.39	87,574,926.42	107,160,158.78
负债					
应付赎回款	-	-	-	6,422.92	6,422.92
应付管理人报酬	-	-	-	102,730.76	102,730.76
应付托管费	-	-	-	12,841.35	12,841.35
应付清算款	-	-	-	148,447.07	148,447.07
应付交易费用	-	-	-	97,744.56	97,744.56
应交税费	-	-	-	3,835,949.84	3,835,949.84
预提费用	-	-	-	108,850.86	108,850.86
负债总计	-	-	-	4,312,987.36	4,312,987.36
利率敏感度缺口	19,396,216.77	154,390.20	34,625.39	83,261,939.06	102,847,171.42
上年度末 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	-	-	-	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

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。

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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	1. 市场利率下降 25个基点	918.62	1,330.08
2. 市场利率上升 25个基点	-918.62	-1,330.08	

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。

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 2024年6月30日		上年度末 2023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	87,470,423.70	85.05	100,601,074.98	89.76
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	189,015.59	0.18	450,973.14	0.40
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	87,659,439.29	85.23	101,052,048.12	90.16
----	---------------	-------	----------------	-------

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	6,126,709.97	7,051,094.71
业绩比较基准下降5%	-6,126,709.97	-7,051,094.71	

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	87,659,439.29	101,052,048.12
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	87,659,439.29	101,052,048.12

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。

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	87,470,423.70	81.63
	其中：股票	87,470,423.70	81.63
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	189,015.59	0.18
	其中：债券	189,015.59	0.18
	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	9,550,000.00	8.91
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	9,842,021.31	9.18
8	其他各项资产	108,698.18	0.10
9	合计	107,160,158.78	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合**7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合**

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	2,975,708.00	2.89

C	制造业	54,683,769.76	53.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,957,221.00	1.90
E	建筑业	2,087,756.00	2.03
F	批发和零售业	316,198.30	0.31
G	交通运输、仓储和邮政业	3,324,984.00	3.23
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,364,769.74	2.30
J	金融业	18,564,018.90	18.05
K	房地产业	704,656.00	0.69
L	租赁和商务服务业	26,358.00	0.03
M	科学研究和技术服务业	54,866.00	0.05
N	水利、环境和公共设施管理业	409,312.00	0.40
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	806.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	87,470,423.70	85.05

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600372	中航机载	384,828	4,606,391.16	4.48
2	002475	立讯精密	92,000	3,616,520.00	3.52
3	000725	京东方 A	727,200	2,974,248.00	2.89
4	601688	华泰证券	224,400	2,780,316.00	2.70
5	601211	国泰君安	158,200	2,143,610.00	2.08
6	600038	中直股份	50,600	2,080,166.00	2.02
7	601318	中国平安	48,500	2,005,960.00	1.95
8	000776	广发证券	161,900	1,970,323.00	1.92
9	600030	中信证券	107,700	1,963,371.00	1.91
10	601108	财通证券	264,360	1,747,419.60	1.70
11	002465	海格通信	167,000	1,730,120.00	1.68
12	000738	航发控制	83,600	1,677,852.00	1.63
13	601919	中远海控	106,700	1,652,783.00	1.61
14	000001	平安银行	145,800	1,479,870.00	1.44
15	601899	紫金矿业	82,500	1,449,525.00	1.41
16	002138	顺络电子	49,800	1,367,508.00	1.33

17	600183	生益科技	57,300	1,206,738.00	1.17
18	600741	华域汽车	71,600	1,172,808.00	1.14
19	601166	兴业银行	62,200	1,095,964.00	1.07
20	002415	海康威视	34,700	1,072,577.00	1.04
21	002025	航天电器	20,900	969,342.00	0.94
22	600362	江西铜业	40,900	968,512.00	0.94
23	600905	三峡能源	216,000	941,760.00	0.92
24	300627	华测导航	31,260	933,111.00	0.91
25	600585	海螺水泥	36,900	870,471.00	0.85
26	600958	东方证券	108,800	826,880.00	0.80
27	603078	江化微	60,610	811,567.90	0.79
28	601668	中国建筑	152,000	807,120.00	0.78
29	300373	扬杰科技	20,700	805,230.00	0.78
30	000333	美的集团	11,500	741,750.00	0.72
31	000630	铜陵有色	204,900	739,689.00	0.72
32	002236	大华股份	47,400	732,804.00	0.71
33	002273	水晶光电	42,000	713,160.00	0.69
34	603859	能科科技	32,264	678,189.28	0.66
35	601117	中国化学	80,900	666,616.00	0.65
36	300547	川环科技	40,700	665,445.00	0.65
37	600808	马钢股份	320,000	646,400.00	0.63
38	600862	中航高科	31,400	589,692.00	0.57
39	600887	伊利股份	22,100	571,064.00	0.56
40	600428	中远海特	93,200	570,384.00	0.55
41	002439	启明星辰	33,000	569,580.00	0.55
42	300481	濮阳惠成	41,200	568,560.00	0.55
43	600497	驰宏锌锗	105,200	561,768.00	0.55
44	601298	青岛港	58,000	554,480.00	0.54
45	000651	格力电器	14,000	549,080.00	0.53
46	300059	东方财富	48,600	513,216.00	0.50
47	600498	烽火通信	32,200	511,980.00	0.50
48	688300	联瑞新材	10,394	499,951.40	0.49
49	002738	中矿资源	18,480	495,264.00	0.48
50	688332	中科蓝讯	8,000	471,920.00	0.46
51	603920	世运电路	23,300	459,942.00	0.45
52	600027	华电国际	65,000	451,100.00	0.44
53	000768	中航西飞	18,700	449,361.00	0.44
54	000100	TCL 科技	103,400	446,688.00	0.43
55	300969	恒帅股份	6,400	442,432.00	0.43
56	603306	华懋科技	23,200	419,224.00	0.41
57	000898	鞍钢股份	194,000	411,280.00	0.40
58	000625	长安汽车	30,000	402,900.00	0.39
59	688518	联赢激光	23,400	390,780.00	0.38

60	601857	中国石油	37,500	387,000.00	0.38
61	601168	西部矿业	21,100	378,745.00	0.37
62	002352	顺丰控股	10,600	378,314.00	0.37
63	600036	招商银行	10,500	358,995.00	0.35
64	601998	中信银行	52,800	353,760.00	0.34
65	000408	藏格矿业	14,400	346,608.00	0.34
66	002859	洁美科技	16,600	333,328.00	0.32
67	605358	立昂微	14,300	330,902.00	0.32
68	600219	南山铝业	85,600	326,136.00	0.32
69	603297	永新光学	5,300	320,597.00	0.31
70	601390	中国中铁	49,100	320,132.00	0.31
71	300861	美畅股份	16,500	319,275.00	0.31
72	600760	中航沈飞	7,900	316,790.00	0.31
73	605589	圣泉集团	15,500	314,495.00	0.31
74	600048	保利发展	35,800	313,608.00	0.30
75	002466	天齐锂业	10,400	311,064.00	0.30
76	000063	中兴通讯	10,800	302,076.00	0.29
77	601619	嘉泽新能	99,100	300,273.00	0.29
78	688028	沃尔德	17,500	287,525.00	0.28
79	000060	中金岭南	67,000	284,080.00	0.28
80	002601	龙佰集团	15,000	278,550.00	0.27
81	002384	东山精密	13,400	277,380.00	0.27
82	000733	振华科技	6,600	274,098.00	0.27
83	000002	万 科 A	39,000	270,270.00	0.26
84	300447	全信股份	21,800	269,884.00	0.26
85	002129	TCL 中环	29,875	258,418.75	0.25
86	688008	澜起科技	4,500	257,220.00	0.25
87	600837	海通证券	29,600	253,376.00	0.25
88	002258	利尔化学	31,500	252,630.00	0.25
89	002212	天融信	50,700	246,909.00	0.24
90	600500	中化国际	70,000	244,300.00	0.24
91	002029	七 匹 狼	48,400	243,936.00	0.24
92	002008	大族激光	11,500	239,200.00	0.23
93	601288	农业银行	54,000	235,440.00	0.23
94	600196	复星医药	10,500	232,470.00	0.23
95	000932	华菱钢铁	52,000	230,360.00	0.22
96	600801	华新水泥	16,500	226,875.00	0.22
97	600019	宝钢股份	34,100	226,765.00	0.22
98	603678	火炬电子	9,000	222,210.00	0.22
99	600161	天坛生物	8,880	216,672.00	0.21
100	600908	无锡银行	40,000	212,800.00	0.21
101	601200	上海环境	25,000	212,500.00	0.21
102	603059	倍加洁	10,600	209,244.00	0.20

103	002324	普利特	24,100	206,055.00	0.20
104	601377	兴业证券	40,400	204,424.00	0.20
105	002985	北摩高科	8,900	196,067.00	0.19
106	002371	北方华创	600	191,934.00	0.19
107	300073	当升科技	5,500	188,705.00	0.18
108	600323	瀚蓝环境	9,000	188,100.00	0.18
109	000807	云铝股份	13,500	182,385.00	0.18
110	300398	飞凯材料	14,800	182,040.00	0.18
111	600970	中材国际	14,800	178,488.00	0.17
112	601233	桐昆股份	11,100	177,156.00	0.17
113	600879	航天电子	22,600	175,602.00	0.17
114	601238	广汽集团	22,500	174,150.00	0.17
115	600483	福能股份	14,800	172,568.00	0.17
116	002460	赣锋锂业	5,700	163,305.00	0.16
117	300782	卓胜微	2,100	163,254.00	0.16
118	002043	兔宝宝	15,000	155,550.00	0.15
119	300452	山河药辅	13,600	154,496.00	0.15
120	000893	亚钾国际	9,500	153,520.00	0.15
121	002517	恺英网络	15,800	150,890.00	0.15
122	603121	华培动力	21,100	150,232.00	0.15
123	603650	彤程新材	5,000	147,750.00	0.14
124	300760	迈瑞医疗	500	145,455.00	0.14
125	300674	宇信科技	13,000	144,040.00	0.14
126	603225	新风鸣	9,200	143,428.00	0.14
127	603355	莱克电气	6,400	138,240.00	0.13
128	300592	华凯易佰	12,040	137,617.20	0.13
129	002732	燕塘乳业	9,500	137,465.00	0.13
130	688589	力合微	5,326	134,268.46	0.13
131	600143	金发科技	20,000	132,200.00	0.13
132	603180	金牌家居	6,900	131,859.00	0.13
133	600699	均胜电子	8,700	128,934.00	0.13
134	603596	伯特利	3,220	125,258.00	0.12
135	300428	立中集团	6,400	118,976.00	0.12
136	000895	双汇发展	5,000	118,850.00	0.12
137	002315	焦点科技	4,400	118,624.00	0.12
138	603816	顾家家居	3,600	116,244.00	0.11
139	600999	招商证券	8,300	115,453.00	0.11
140	600584	长电科技	3,600	114,156.00	0.11
141	002532	天山铝业	14,000	113,540.00	0.11
142	002572	索菲亚	7,400	113,442.00	0.11
143	000938	紫光股份	5,000	111,750.00	0.11
144	000786	北新建材	3,700	109,742.00	0.11
145	688677	海泰新光	2,735	107,294.05	0.10

146	002409	雅克科技	1,700	106,947.00	0.10
147	000778	新兴铸管	30,000	104,400.00	0.10
148	688608	恒玄科技	700	102,466.00	0.10
149	000902	新洋丰	8,600	102,082.00	0.10
150	300396	迪瑞医疗	5,000	101,550.00	0.10
151	000709	河钢股份	52,000	100,880.00	0.10
152	688376	美埃科技	3,100	97,216.00	0.09
153	300221	银禧科技	18,000	94,680.00	0.09
154	002064	华峰化学	13,000	93,210.00	0.09
155	002730	电光科技	13,000	91,520.00	0.09
156	600803	新奥股份	4,400	91,520.00	0.09
157	600256	广汇能源	13,400	89,780.00	0.09
158	002373	千方科技	9,500	86,165.00	0.08
159	603267	鸿远电子	2,500	85,250.00	0.08
160	600690	海尔智家	3,000	85,140.00	0.08
161	000028	国药一致	2,570	82,831.10	0.08
162	002508	老板电器	3,600	79,560.00	0.08
163	600918	中泰证券	14,000	79,380.00	0.08
164	300682	朗新集团	9,200	78,292.00	0.08
165	300638	广和通	4,500	76,950.00	0.07
166	300450	先导智能	4,600	76,498.00	0.07
167	001979	招商蛇口	8,600	75,594.00	0.07
168	603688	石英股份	2,550	75,505.50	0.07
169	002966	苏州银行	10,000	75,000.00	0.07
170	000039	中集集团	8,000	74,080.00	0.07
171	688168	安博通	2,700	72,630.00	0.07
172	000983	山西焦煤	6,600	68,046.00	0.07
173	688123	聚辰股份	1,100	66,913.00	0.07
174	002459	晶澳科技	5,840	65,408.00	0.06
175	601816	京沪高铁	11,800	63,366.00	0.06
176	603722	阿科力	1,400	63,350.00	0.06
177	605123	派克新材	1,100	61,798.00	0.06
178	688115	思林杰	2,600	61,308.00	0.06
179	688175	高凌信息	4,060	60,006.80	0.06
180	601186	中国铁建	7,000	59,990.00	0.06
181	601006	大秦铁路	8,100	57,996.00	0.06
182	601128	常熟银行	7,590	57,456.30	0.06
183	603259	药明康德	1,400	54,866.00	0.05
184	000723	美锦能源	11,400	54,264.00	0.05
185	003028	振邦智能	1,500	54,090.00	0.05
186	600352	浙江龙盛	5,900	50,681.00	0.05
187	300699	光威复材	2,000	49,660.00	0.05
188	600377	宁沪高速	3,700	46,620.00	0.05

189	688033	天宜上佳	7,765	46,590.00	0.05
190	601398	工商银行	8,100	46,170.00	0.04
191	600438	通威股份	2,200	42,042.00	0.04
192	002271	东方雨虹	3,400	41,956.00	0.04
193	600765	中航重机	2,000	40,800.00	0.04
194	000783	长江证券	8,200	39,606.00	0.04
195	002081	金螳螂	13,000	39,390.00	0.04
196	002139	拓邦股份	3,700	39,294.00	0.04
197	601012	隆基绿能	2,700	37,854.00	0.04
198	300253	卫宁健康	6,400	37,760.00	0.04
199	600325	华发股份	5,600	36,400.00	0.04
200	600028	中国石化	5,700	36,024.00	0.04
201	002126	银轮股份	1,900	33,079.00	0.03
202	002906	华阳集团	1,200	32,112.00	0.03
203	603309	维力医疗	2,800	30,828.00	0.03
204	300687	赛意信息	2,200	30,624.00	0.03
205	300115	长盈精密	2,500	29,975.00	0.03
206	601607	上海医药	1,500	28,665.00	0.03
207	300593	新雷能	2,860	28,428.40	0.03
208	301219	腾远钴业	740	28,312.40	0.03
209	002327	富安娜	2,700	27,135.00	0.03
210	300294	博雅生物	800	26,400.00	0.03
211	002302	西部建设	5,000	26,000.00	0.03
212	000858	五粮液	200	25,608.00	0.02
213	002340	格林美	4,000	25,480.00	0.02
214	002568	百润股份	1,500	25,245.00	0.02
215	002984	森麒麟	1,000	24,090.00	0.02
216	603883	老百姓	1,300	23,868.00	0.02
217	600655	豫园股份	4,500	23,175.00	0.02
218	688538	和辉光电	11,700	23,166.00	0.02
219	688596	正帆科技	700	23,100.00	0.02
220	688295	中复神鹰	1,000	20,300.00	0.02
221	603610	麒盛科技	2,000	19,760.00	0.02
222	300308	中际旭创	140	19,303.20	0.02
223	002003	伟星股份	1,500	18,825.00	0.02
224	603118	共进股份	2,700	18,090.00	0.02
225	300376	易事特	4,400	17,644.00	0.02
226	600284	浦东建设	3,000	16,020.00	0.02
227	002803	吉宏股份	1,400	15,582.00	0.02
228	603296	华勤技术	280	15,464.40	0.02
229	601137	博威合金	1,000	15,240.00	0.01
230	600552	凯盛科技	1,600	15,088.00	0.01
231	600782	新钢股份	4,400	14,608.00	0.01

232	600251	冠农股份	2,000	14,480.00	0.01
233	000568	泸州老窖	100	14,349.00	0.01
234	600415	小商品城	1,900	14,098.00	0.01
235	688630	芯碁微装	200	12,514.00	0.01
236	002818	富森美	1,000	12,260.00	0.01
237	603768	常青股份	1,000	11,340.00	0.01
238	603605	珀莱雅	100	11,099.00	0.01
239	301087	可孚医疗	300	10,170.00	0.01
240	601127	赛力斯	100	9,112.00	0.01
241	600007	中国国贸	400	8,784.00	0.01
242	000888	峨眉山 A	800	8,712.00	0.01
243	301221	光庭信息	200	7,136.00	0.01
244	000528	柳 工	600	6,714.00	0.01
245	603215	比依股份	500	6,395.00	0.01
246	601328	交通银行	700	5,229.00	0.01
247	603663	三祥新材	320	4,604.80	0.00
248	300496	中科创达	100	4,559.00	0.00
249	002230	科大讯飞	100	4,295.00	0.00
250	000977	浪潮信息	100	3,637.00	0.00
251	601699	潞安环能	200	3,626.00	0.00
252	000157	中联重科	400	3,072.00	0.00
253	600873	梅花生物	300	3,006.00	0.00
254	603939	益丰药房	120	2,946.00	0.00
255	603108	润达医疗	100	1,514.00	0.00
256	002078	太阳纸业	100	1,395.00	0.00
257	600971	恒源煤电	100	1,194.00	0.00
258	000429	粤高速 A	100	1,041.00	0.00
259	300379	东方通	100	808.00	0.00
260	600757	长江传媒	100	806.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002025	航天电器	911,200.00	0.81
2	688332	中科蓝讯	531,378.00	0.47
3	603859	能科科技	493,818.00	0.44
4	300373	扬杰科技	444,606.00	0.40
5	000733	振华科技	368,563.00	0.33
6	603059	倍加洁	367,685.00	0.33
7	002138	顺络电子	351,612.00	0.31
8	603688	石英股份	340,882.00	0.30
9	688028	沃尔德	315,204.20	0.28

10	601390	中国中铁	264,468.33	0.24
11	601108	财通证券	238,620.00	0.21
12	688008	澜起科技	230,323.00	0.21
13	601128	常熟银行	218,355.00	0.19
14	002384	东山精密	214,586.00	0.19
15	603678	火炬电子	212,045.00	0.19
16	002517	恺英网络	195,899.00	0.17
17	605589	圣泉集团	192,633.00	0.17
18	603121	华培动力	183,657.00	0.16
19	601233	桐昆股份	177,583.00	0.16
20	300592	华凯易佰	175,359.00	0.16

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	601919	中远海控	1,603,583.00	1.43
2	600362	江西铜业	1,309,857.00	1.17
3	600372	中航机载	1,158,296.43	1.03
4	601899	紫金矿业	1,130,883.00	1.01
5	002475	立讯精密	1,083,191.00	0.97
6	000630	铜陵有色	873,760.00	0.78
7	600497	驰宏锌锗	872,070.00	0.78
8	000408	藏格矿业	772,442.00	0.69
9	600038	中直股份	768,080.00	0.69
10	601166	兴业银行	631,420.00	0.56
11	601288	农业银行	584,500.00	0.52
12	600027	华电国际	553,590.00	0.49
13	601168	西部矿业	552,776.00	0.49
14	000651	格力电器	506,450.00	0.45
15	600837	海通证券	401,900.00	0.36
16	600918	中泰证券	378,060.00	0.34
17	600030	中信证券	347,236.00	0.31
18	300547	川环科技	321,859.00	0.29
19	605358	立昂微	310,810.00	0.28
20	002273	水晶光电	300,200.00	0.27

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	12,836,849.53
卖出股票收入（成交）总额	24,145,238.94

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	--------------

1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	189,015.59	0.18
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	189,015.59	0.18

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110059	浦发转债	1,400	154,390.20	0.15
2	113677	华懋转债	320	34,625.39	0.03

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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,本基金投资的中信证券(600030.SH)的发行主体中信证券股份有限公司(以下简称中信证券)2023年7月13日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。2024年1月12日中信证券因保荐的恒逸石化股份有限公司(发行人)可转债项目,发行人证券发行上市当年即亏损、营业利润比上年下滑50%以上,证监会采取出具警示函的行政监督管理措施。2024年4月30日中信证券收到证监会的行政处罚决定书,涉及中核钛白实际控制人违反限制性规定转让股票。目前中信证券财务方面一切正常,上述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。

根据证监会公告,本基金投资的广发证券(000776.SZ)的发行主体广发证券股份有限公司(以下简称广发证券)于2023年4月17日和7月17日收到中国证监会《立案告知书》和《行政处罚事先告知书》。中国证监会认为,广发证券在为美尚生态2018年非公开发行股票提供保荐服务过程中,未遵守业务规则和行业规范,未勤勉尽责地对美尚生态的发行申请文件进行审慎核查,出具的保荐书等文件存在虚假记载。对广发证券责令改正,给予警告,没收保荐业务收入和承销股票违法所得,并处以50万元罚款。目前广发证券财务方面一切正常,上述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。

根据证监会公告,本基金投资的国泰君安(601211.SH)的发行主体国泰君安证券股份有限公司(以下简称国泰君安证券)2024年1月8日收到证监会出具的警示函。国泰君安证券作为泰禾集团股份有限公司公司债券受托管理人,在受托管理期间未严格遵守执业行为准则,存在未及时召集持有人会议、未对发行人未披露相关重大债务逾期及诉讼事项保持必要关注等情形,对此证监会采取出具警示函的行政监督管理措施。目前国泰君安证券财务方面一切正常,上述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。

7.12.2 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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	4,195.46
2	应收清算款	39,567.66
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	64,935.06
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	108,698.18

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110059	浦发转债	154,390.20	0.15
2	113677	华懋转债	34,625.39	0.03

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本报告期末本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
1,129	103,437.26	27,744,256.28	23.76	89,036,414.33	76.24

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,238,584.10	1.0606

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门	50~100

负责人持有本开放式基金	
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021 年 1 月 19 日） 基金份额总额	66,700,266.22
本报告期期初基金份额总额	125,539,052.44
本报告期基金总申购份额	1,952,519.90
减：本报告期基金总赎回份额	10,710,901.73
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	116,780,670.61

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本集合计划未召开份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，管理人高级管理人员变动情况如下：

- (1) 2024 年 1 月 2 日起，王伟同志担任总经理助理；
- (2) 2024 年 2 月 2 日，免去李琦同志总经理职务；
- (3) 2024 年 2 月 2 日起，袁锦同志担任总经理，免去副总经理职务；
- (4) 2024 年 2 月 2 日，免去唐卫江同志董事会秘书职务
- (5) 2024 年 2 月 2 日起，财务总监叶枫同志兼任董事会秘书；
- (6) 2024 年 4 月 12 日，免去姜山同志副经理职务；
- (7) 2024 年 5 月 23 日，免去吴惧同志总经理助理职务。

本报告期内，管理人董事变动情况如下：

- (1) 2024 年 01 月 19 日起，袁锦同志担任董事；
- (2) 2024 年 2 月 2 日起，李琦同志担任董事长；
- (3) 2024 年 04 月 19 日起，王胜同志担任董事，周海晨同志不再担任董事职务。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、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监管部门稽查或处罚。

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监管部门稽查或处罚。

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	37,011,404.52	100.00	50,740.22	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。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	-	-	821,373,000.00	100.00	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	申万宏源证券资产管理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	2024 年 1 月 3 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暂停申购、定期定额投资公告	中国证监会规定披露媒介	2024 年 1 月 12 日
3	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(更新)	中国证监会规定披露媒介	2024 年 1 月 18 日
4	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	中国证监会规定披露媒介	2024 年 1 月 18 日
5	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延长存续期限并修改资产管理合同、招募说明书的公告	中国证监会规定披露媒介	2024 年 1 月 18 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更新的招募说明书	中国证监会规定披露媒介	2024 年 1 月 18 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基金产品资料概要更新	中国证监会规定披露媒介	2024 年 1 月 18 日
8	申万宏源证券资产管理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	2024 年 2 月 2 日
9	申万宏源证券资产管理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	2024 年 4 月 12 日
10	申万宏源证券资产管理有限公司关于董事变更的公告	中国证监会规定披露媒介	2024 年 4 月 23 日
11	申万宏源证券资产管理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	2024 年 5 月 23 日
12	申万宏源证券资产管理有限公司住所变更公告	中国证监会规定披露媒介	2024 年 5 月 23 日
13	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	2024 年 5 月 31 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：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，管理人于 2024 年 1 月 18 日发布《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延长存续期限并修改资产管理合同、招募说明书的公告》。本集合计划自本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。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

上海市徐汇区长乐路 989 号 40 层

12.3 查阅方式

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

咨询电话：95523

公司网址：www.swhyzcgl.com

申万宏源证券资产管理有限公司

2024 年 8 月 30 日