

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 2025 年中期报告

2025 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：兴业银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 08 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
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	55

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	55
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	55
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	55
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.11 投资组合报告附注	55
§ 8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
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	57
§ 9 开放式基金份额变动	57
§ 10 重大事件揭示	58
10.1 基金份额持有人大会决议	58
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	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4 基金投资策略的改变	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
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	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	59
10.8 其他重大事件	59
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	60
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	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	60
§ 12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录	60
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	申万宏源双季增享 6 个月持有期债券型集合资产管理计划		
基金简称	申万宏源双季增享 6 个月债券		
基金主代码	970188		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2022 年 10 月 13 日		
基金管理人	申万宏源证券资产管理有限公司		
基金托管人	兴业银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	267,902,331.29 份		
基金合同存续期	变更为本集合计划后，本集合计划存续期限自本集合计划合同生效之日起 3 年。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。		
下属分级基金的基金简称	申万宏源双季增享 6 个月债券 A	申万宏源双季增享 6 个月债券 B	申万宏源双季增享 6 个月债券 C
下属分级基金的交易代码	970188	970189	970190
报告期末下属分级基金的份额总额	67,974,098.65 份	116,902,316.88 份	83,025,915.76 份

注：本报告所述的“基金”系指按照《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》的要求完成合同变更后的证券公司大集合资产管理计划申万宏源双季增享 6 个月持有期债券型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）。管理人拟向中国证监会申请公募基金管理资格，在取得公募基金管理资格后，管理人将按照相关监管规定将本集合计划注册变更为公募基金。

2.2 基金产品说明

投资目标	本集合计划在追求本金安全、严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力求为持有人提供超越业绩比较基准的稳健回报，实现集合计划资产长期稳健增值。
投资策略	坚持稳健投资，在严格控制风险的基础上，追求长期持续稳定的合理回报。本集合计划的债券投资策略包括久期偏离策略、类别选择策略、相对价值策略、个券选择策略、信用债投资策略。本集合计划的投资策略还包括国债期货投资策略、股票投资策略等。
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*10%
风险收益特征	本集合计划为债券型集合资产管理计划，在通常情况下其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金、现金管理型集合计划，低于股票型基金、股票型集合计划、混合型基金和混合型集合计划。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		申万宏源证券资产管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	虞博	冯萌
	联系电话	021-33385861	021-52629999-213310

	电子邮箱	yubol@swyhsc.com	fengmeng@cib.com.cn
客户服务电话		95523	95561
传真		-	-
注册地址		上海市徐汇区长乐路 989 号 40 层	福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦
办公地址		上海市徐汇区长乐路 989 号 40 层	上海市浦东新区银城路 167 号 4 楼
邮政编码		200031	200120
法定代表人		袁锦	吕家进

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
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(2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日)		
	申万宏源双季增享 6 个月债 券 A	申万宏源双季增享 6 个月债 券 B	申万宏源双季增享 6 个月债 券 C
本期已实现 收益	803,186.59	1,961,818.90	1,031,254.95
本期利润	766,675.89	1,638,734.36	877,312.88
加权平均基 金份额本期 利润	0.0140	0.0137	0.0114
本期加权平 均净值利润 率	1.29%	1.26%	1.06%
本期基金份 额净值增长	1.14%	1.28%	1.02%

率			
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)		
期末可供分配利润	5,714,392.74	10,805,629.99	6,405,240.77
期末可供分配基金份额利润	0.0841	0.0924	0.0771
期末基金资产净值	74,537,704.43	129,172,446.65	90,470,853.37
期末基金份额净值	1.0966	1.1050	1.0897
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)		
基金份额累计净值增长率	9.28%	10.19%	8.59%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

申万宏源双季增享 6 个月债券 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	0.74%	0.08%	0.53%	0.05%	0.21%	0.03%
过去三个月	1.01%	0.14%	1.12%	0.08%	-0.11%	0.06%
过去六个月	1.14%	0.13%	-0.06%	0.10%	1.20%	0.03%
过去一年	4.25%	0.16%	3.67%	0.13%	0.58%	0.03%
自基金合同生效起至今	9.28%	0.12%	6.66%	0.11%	2.62%	0.01%

申万宏源双季增享 6 个月债券 B

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.77%	0.08%	0.53%	0.05%	0.24%	0.03%
过去三个月	1.08%	0.14%	1.12%	0.08%	-0.04%	0.06%
过去六个月	1.28%	0.13%	-0.06%	0.10%	1.34%	0.03%
过去一年	4.54%	0.16%	3.67%	0.13%	0.87%	0.03%
自基金合同生效起至今	10.19%	0.12%	6.38%	0.11%	3.81%	0.01%

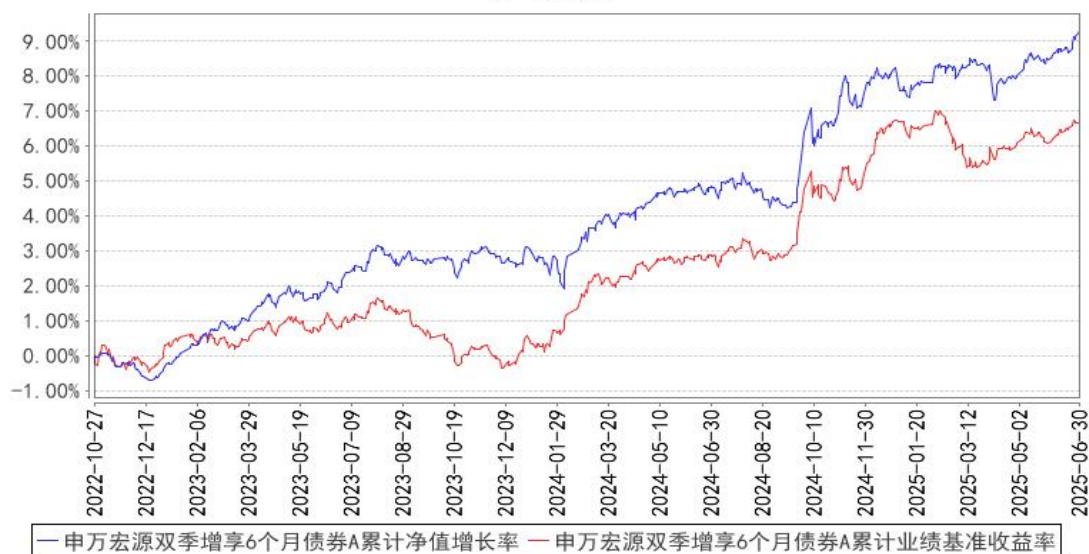
申万宏源双季增享 6 个月债券 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.73%	0.08%	0.53%	0.05%	0.20%	0.03%
过去三个月	0.96%	0.14%	1.12%	0.08%	-0.16%	0.06%
过去六个月	1.02%	0.13%	-0.06%	0.10%	1.08%	0.03%
过去一年	4.02%	0.16%	3.67%	0.13%	0.35%	0.03%
自基金合同生效起至今	8.59%	0.12%	6.66%	0.11%	1.93%	0.01%

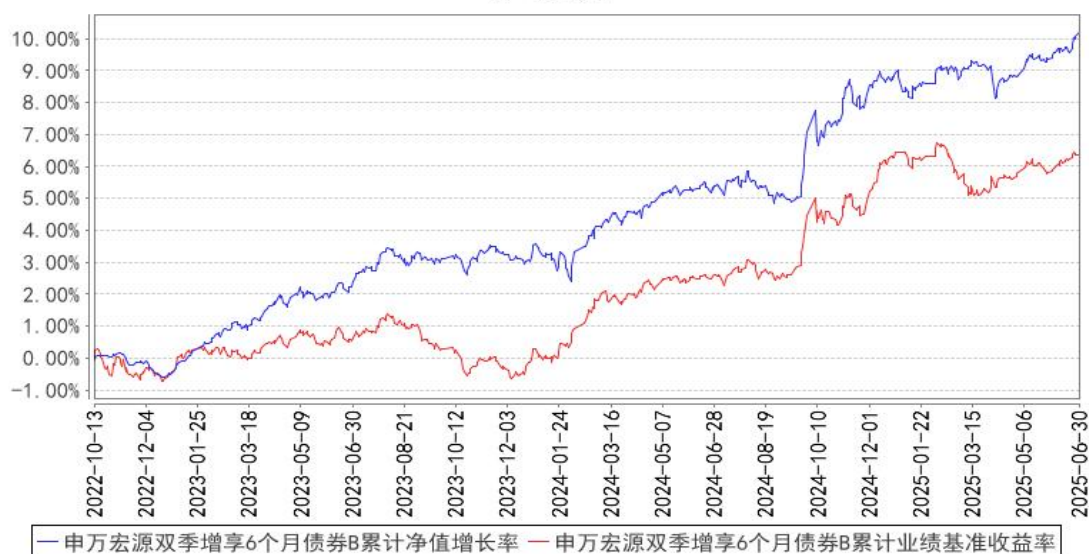
注：本集合计划合同变更生效日为 2022 年 10 月 13 日，申万宏源双季增享 6 个月债券 A 类份额和申万宏源双季增享 6 个月债券 C 类份额首次确认日是 2022 年 10 月 27 日。

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

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



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



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



注：申万宏源双季增享 6 个月债券 A 类份额和申万宏源双季增享 6 个月债券 C 类份额首次确认日是 2022 年 10 月 27 日。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

申万宏源证券资产管理有限公司（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 2025 年 6 月 30 日，集合资产管理计划管理人共管理 4 只公募集合资产管理计划，分别为申万宏源天添利货币型集合资产管理计划、申万宏源天天增货币型集合资产管理计划、申万宏源双季增享 6 个月持有期债券型集合资产管理计划、申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
季程	本基金的基金经理	2018 年 3 月 29 日	-	11 年	毕业于新加坡南洋理工大学，金融学硕士，曾任职于申银万国证券股份有限公司资产管理事业部、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，具有多年

					资产管理工作经验。已取得投资主办人执业证书，证书编号为：Z0140824030008，并已取得基金从业资格，证书编号为：F4530000002664，不存在其他兼职情况，且最近三年无被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚的经历。
丁杰科	本基金的基金经理	2020 年 1 月 3 日	-	17 年	经济学和法学双学士，产业经济学硕士，中级经济师。先后就职于交银施罗德基金、中国农业银行金融市场部、申万菱信基金、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负责人、投资经理，拥有多年债券交易和投资经验，担任过货币、债券，股债混合等多种类型基金产品的基金经理。不存在其他兼职情况。已取得投资主办人执业证书，证书编号为：Z0140824030009，并已取得基金从业资格，证书编号为：F4530000003495，且最近三年无被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚的经历。
秦庆	本基金的基金经理	2022 年 10 月 13 日	-	17 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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
秦庆	公募基金	1	294,181,004.45	2019 年 4 月 15 日
	私募资产管理计划	1	15,885,013.91	2025 年 6 月 30 日

	其他组合	-	-	-
	合计	2	310,066,018.36	-

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》等有关法律法规及《申万宏源双季增享 6 个月持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》、《申万宏源双季增享 6 个月持有期债券型集合资产管理计划招募说明书》等有关本集合计划法律文件的规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2025 年上半年，国内经济基本面总体呈弱复苏态势，依旧面临一定压力。在抢出口透支部分

需求、中美贸易摩擦影响下，净出口增速走弱，未来关注贸易谈判进展；中央财政发力明显，专项债发行提速，基建投资增长保持高韧性；在设备更新和转型升级政策效应有所弱化的影响下，制造业投资增速有所放缓；地产行业仍处于低位筑底阶段，关注后续政策加码。在以旧换新、消费补贴、平台促销等政策的持续推动下，居民消费持续改善。上半年，货币政策整体维持相对稳健，流动性保持合理宽裕，二季度央行下调公开市场操作利率 10bp 和存款准备金率 50bp。债券市场方面，十年国债收益率先上后下整体呈倒 V 型走势。具体来看，一季度受资金收敛及权益走强的压制，收益率从 1.61% 上行至 1.9%；二季度，受贸易战、降息降准、资金宽松影响下，收益率从 1.9% 下行至 1.65%。权益市场方面，上半年整体实现了小幅上涨，其中上证指数涨 2.76%，深圳成指涨 0.48%，沪深 300 涨 0.03%，中证 500 涨 3.31%，创业板指涨 0.53%，结构上，小盘风格表现相对更为突出。行业层面上，有色金属、银行、国防军工、传媒、通信等行业表现较好，而煤炭、食品饮料、房地产、石油石化、建筑装饰等行业表现相对落后。

上半年运作上，基于固收+产品的特性，管理人整体上对于债券与权益仓位分别进行了择时优化配置。固收部分，秉持着固收打底的操作思路，重点关注收益安全垫的稳健性，主投利率债、中高评级信用债，严控信用风险。根据对流动性及资金中枢的研究预判，优化持仓，动态调整合理杠杆和久期。通过对期限利差的研究，适当择机运用骑乘策略，配置了部分银行二永债、利率债增厚收益。权益部分，管理人继续采用宏观模型和多策略体系实现对权益仓位和结构的管理，将主要仓位基本覆盖在以军工、科技为代表的成长类板块以及以金融为代表的价值类板块，并通过多维度综合的行业轮动体系实现各结构内部的动态优化，力求在控制权益部分回撤的前提下为整体组合贡献更多的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，申万宏源双季增享 6 个月债券 A 单位净值为 1.0966 元，本报告期基金单位净值增长率为 1.14%，业绩比较基准收益率为-0.06%。申万宏源双季增享 6 个月债券 B 单位净值为 1.1050 元，本报告期基金单位净值增长率为 1.28%，业绩比较基准收益率为-0.06%。申万宏源双季增享 6 个月债券 C 单位净值为 1.0897 元，本报告期基金单位净值增长率为 1.02%，业绩比较基准收益率为-0.06%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2025 年下半年，国内经济基本面预计延续弱复苏态势，但仍面临一定程度扰动包括制造业设备更新放缓、地产需求转弱、抢出口回落等。货币政策方面，在适度宽松的定调下，流动性方面预计合理宽松，降准及结构性降息仍有所期待。基建投资在财政发力下预计仍有支撑；地产方面期待政策端的进一步加码，整体仍在低位筑底；消费方面，在多元化补贴政策支撑下延续改

善态势。总体而言，经济基本面预计弱修复，流动性合理充裕，资金价格中枢预计逐步下行。在上述宏观背景下，管理人判断债券市场中性乐观，权益市场也存有一定的投资机会，结构上相对更为看好成长板块中的科技、军工等方向以及传统价值板块中的非银、有色等方向。管理人将继续根据宏观模型以及固收+产品的特性对债券和权益仓位进行配置，并在产品运作过程中，动态监测实体经济恢复情况和资金面的变化，根据市场走势，动态调整组合久期和杠杆、优化权益内部结构，力争做到收益与回撤的均衡，为投资者获取相对稳健的收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及集合计划合同约定，本集合计划管理人为准确、及时进行基金估值和份额净值计价，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% 以上时对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未实施利润分配，符合本基金基金合同的相关规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

- 1、本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形；
- 2、本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：申万宏源双季增享 6 个月持有期债券型集合资产管理计划

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	1,482,819.03	3,304,336.87
结算备付金		556,395.70	509,836.27
存出保证金		4,083.68	3,215.76
交易性金融资产	6.4.7.2	289,955,019.75	250,538,616.19
其中：股票投资		29,451,347.71	25,908,895.90
基金投资		-	-
债券投资		250,291,767.93	214,535,706.59
资产支持证券投资		10,211,904.11	10,094,013.70
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	1,899,009.50	3,207,860.04
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		295,170.42	-
应收股利		-	-
应收申购款		549,960.10	310,000.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		294,742,458.18	257,873,865.13
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 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		346,149.82	906,878.22
应付赎回款		-	10,537.11
应付管理人报酬		87,614.91	71,599.19
应付托管费		11,935.35	10,601.38
应付销售服务费		18,679.12	15,016.74
应付投资顾问费		-	-
应交税费		12,902.74	20,178.69
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	84,171.79	150,394.92
负债合计		561,453.73	1,185,206.25
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	267,902,331.29	236,328,850.62
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	26,278,673.16	20,359,808.26
净资产合计		294,181,004.45	256,688,658.88
负债和净资产总计		294,742,458.18	257,873,865.13

注： 报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额总额 267,902,331.29 份，其中申万宏源双季增享 6 个月债券 A 基金份额总额 67,974,098.65 份，基金份额净值 1.0966 元。申万宏源双季增享 6 个月债券 B 基金份额总额 116,902,316.88 份，基金份额净值 1.1050 元。申万宏源双季增享 6 个月债券 C 基金份额总额 83,025,915.76 份，基金份额净值 1.0897 元。

6.2 利润表

会计主体：申万宏源双季增享 6 个月持有期债券型集合资产管理计划

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		4,028,508.87	5,942,739.93
1. 利息收入		52,474.72	59,559.85
其中：存款利息收入	6.4.7.9	5,028.98	10,719.45
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		47,445.74	48,840.40
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”		4,489,571.46	5,085,877.55

填列)			
其中：股票投资收益	6.4.7.10	1,109,975.92	-866,565.41
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	2,925,525.34	5,471,551.20
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	129,989.86	163,711.12
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	324,080.34	317,180.64
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	-513,537.31	797,302.53
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	-	-
减：二、营业总支出		745,785.74	1,218,522.37
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	480,574.09	538,584.38
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	67,476.15	76,389.32
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	102,398.02	42,388.76
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		1,596.17	456,674.44
其中：卖出回购金融资产 支出		1,596.17	456,674.44
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		8,712.25	9,841.61
8. 其他费用	6.4.7.17	85,029.06	94,643.86
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		3,282,723.13	4,724,217.56
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		3,282,723.13	4,724,217.56
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		3,282,723.13	4,724,217.56

6.3 净资产变动表

会计主体：申万宏源双季增享 6 个月持有期债券型集合资产管理计划

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	236,328,850.62	-	20,359,808.26	256,688,658.88
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	236,328,850.62	-	20,359,808.26	256,688,658.88
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	31,573,480.67	-	5,918,864.90	37,492,345.57
（一）、综合收益总额	-	-	3,282,723.13	3,282,723.13
（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）	31,573,480.67	-	2,636,141.77	34,209,622.44
其中：1. 基金申购款	49,797,097.74	-	4,227,521.80	54,024,619.54
2. 基金赎回款	-18,223,617.07	-	-1,591,380.03	-19,814,997.10
（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	267,902,331.29	-	26,278,673.16	294,181,004.45
项目	上年度可比期间 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	351,349,888.16	-	12,683,492.64	364,033,380.80
加：会计政策变更	-	-	-	-

前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	351,349,888.16	-	12,683,492.64	364,033,380.80
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-79,994,882.91	-	1,955,846.09	-78,039,036.82
(一)、综合收益总额	-	-	4,724,217.56	4,724,217.56
(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)	-79,994,882.91	-	-2,768,371.47	-82,763,254.38
其中：1. 基金申购款	32,104,597.35	-	1,243,751.56	33,348,348.91
2. 基金赎回款	-112,099,480.26	-	-4,012,123.03	-116,111,603.29
(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	271,355,005.25	-	14,639,338.73	285,994,343.98

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

王伟

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

申万宏源双季增享 6 个月持有期债券型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）于 2022

年 5 月 31 日经中国证监会《关于准予申银万国灵通快利 7 天集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函【2022】1040 号）批准，《申万宏源双季增享 6 个月持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》于 2022 年 10 月 13 日起正式变更生效。本集合计划为契约型开放式，自合同变更生效日起存续期不得超过 3 年。本集合计划的管理人为申万宏源证券资产管理有限公司，托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《申万宏源双季增享 6 个月持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》的有关规定，本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含主板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票）、债券（包括国内依法发行的国债、地方政府债、政府支持机构债、央行票据、金融债券（含次级债券）、政策性金融债券、企业债券、公司债券、可转换债券（含分离交易可转债、可交换债券）、证券公司发行的短期公司债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据）、债券回购、银行存款（包括协议存款、通知存款、定期存款）、货币市场工具、同业存单、资产支持证券、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本集合计划的投资组合比例为：投资于债券的比例不低于集合计划总资产的 80%；投资于股票、可转换债券（含分离交易可转债、可交换债券）等权益类资产的投资比例合计不超过集合计划总资产的 20%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的 5%，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、《资产管理产品相关会计处理规定》、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、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(2) 增值税

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

(3) 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《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、增值税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城

市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

(4) 企业所得税

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

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

(5) 个人所得税

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款	1,482,819.03
等于：本金	1,482,555.47
加：应计利息	263.56
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	1,482,819.03

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		28,554,845.88	-	29,451,347.71	896,501.83
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	28,926,407.36	802,947.94	30,039,447.94	310,092.64
	银行间市场	215,558,985.00	3,731,319.99	220,252,319.99	962,015.00
	合计	244,485,392.36	4,534,267.93	250,291,767.93	1,272,107.64
资产支持证券		10,000,000.00	204,904.11	10,211,904.11	7,000.00
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		283,040,238.24	4,739,172.04	289,955,019.75	2,175,609.47

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本报告期末本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本报告期末本基金未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本报告期末本基金未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	1,899,009.50	-
银行间市场	-	-
合计	1,899,009.50	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本报告期末本基金未持有买断式逆回购中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 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	3,396.90
其中：交易所市场	1,220.90
银行间市场	2,176.00
应付利息	-
预提费用	80,774.89
合计	84,171.79

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

申万宏源双季增享 6 个月债券 A

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	42,270,643.13	42,270,643.13
本期申购	31,309,018.87	31,309,018.87
本期赎回（以“-”号填列）	-5,605,563.35	-5,605,563.35
本期末	67,974,098.65	67,974,098.65

申万宏源双季增享 6 个月债券 B

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	123,867,357.20	123,867,357.20
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-6,965,040.32	-6,965,040.32
本期末	116,902,316.88	116,902,316.88

申万宏源双季增享 6 个月债券 C

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	70,190,850.29	70,190,850.29
本期申购	18,488,078.87	18,488,078.87
本期赎回（以“-”号填列）	-5,653,013.40	-5,653,013.40
本期末	83,025,915.76	83,025,915.76

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

申万宏源双季增享 6 个月债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,927,958.49	633,155.80	3,561,114.29

加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	2,927,958.49	633,155.80	3,561,114.29
本期利润	803,186.59	-36,510.70	766,675.89
本期基金份额交易产生的变动数	1,983,247.66	252,567.94	2,235,815.60
其中：基金申购款	2,423,478.54	300,158.05	2,723,636.59
基金赎回款	-440,230.88	-47,590.11	-487,820.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,714,392.74	849,213.04	6,563,605.78

申万宏源双季增享 6 个月债券 B

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	9,416,808.36	1,859,652.90	11,276,461.26
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	9,416,808.36	1,859,652.90	11,276,461.26
本期利润	1,961,818.90	-323,084.54	1,638,734.36
本期基金份额交易产生的变动数	-572,997.27	-72,068.58	-645,065.85
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-572,997.27	-72,068.58	-645,065.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,805,629.99	1,464,499.78	12,270,129.77

申万宏源双季增享 6 个月债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,468,792.84	1,053,439.87	5,522,232.71
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	4,468,792.84	1,053,439.87	5,522,232.71
本期利润	1,031,254.95	-153,942.07	877,312.88
本期基金份额交易产生的变动数	905,192.98	140,199.04	1,045,392.02
其中：基金申购款	1,317,091.70	186,793.51	1,503,885.21
基金赎回款	-411,898.72	-46,594.47	-458,493.19
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,405,240.77	1,039,696.84	7,444,937.61

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

活期存款利息收入	4,015.35
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	1,006.77
其他	6.86
合计	5,028.98

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 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,109,975.92
股票投资收益——赎回差价收入	—
股票投资收益——申购差价收入	—
股票投资收益——证券出借差价收入	—
合计	1,109,975.92

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出股票成交总额	5,916,484.23
减：卖出股票成本总额	4,799,368.64
减：交易费用	7,139.67
买卖股票差价收入	1,109,975.92

6.4.7.10.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期无证券出借差价收入。

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	3,356,189.72
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-430,664.38
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	2,925,525.34

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 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	71,809,273.08
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	70,338,842.50
减：应计利息总额	1,898,683.01
减：交易费用	2,411.95
买卖债券差价收入	-430,664.38

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
资产支持证券投资收益——利息收入	129,989.86
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	-
资产支持证券投资收益——赎回差价收入	-
资产支持证券投资收益——申购差价收入	-
合计	129,989.86

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 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资产生的股利收益	324,080.34
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	324,080.34

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
1. 交易性金融资产	-513,537.31
股票投资	194,430.19
债券投资	-691,967.50

资产支持证券投资	-16,000.00
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	-513,537.31

6.4.7.16 其他收入

注：本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	3,967.52
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	2,954.17
账户维护费	18,600.00
合计	85,029.06

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，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本集合计划本报告期存在控制关系或其他重大影响关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
申万宏源证券资产管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
兴业银行股份有限公司	基金托管人
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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	14,097,387.92	100.00	68,192,091.94	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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	4,984,650.00	100.00	10,503.20	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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	658,885,000.00	100.00	690,924,000.00	100.00

6.4.10.1.4 权证交易

注：本报告期及上年度可比期间内，本集合计划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 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	7,054.53	100.00	1,220.90	100.00
关联方名称	上年度可比期间 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	19,226.97	100.00	754.45	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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	480,574.09	538,584.38
其中：应支付销售机构的客户维护 费	203,891.21	216,650.43
应支付基金管理人的净管理费	276,682.88	321,933.95

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

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

H 为每日该类计划份额应计提的集合计划固定管理费

E 为前一日该类计划份额的集合计划资产净值

集合计划固定管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

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

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

（1）计提起始日

业绩报酬计提起始日为集合计划合同生效日。

（2）计提基准日

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

(3) 计提基准及比例

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

(4) 计提方式

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

(5) 业绩报酬计算方式

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

其中：

Q：应计提业绩报酬的集合计划份额数量

P1：应计提业绩报酬的集合计划份额在计提基准日的集合计划份额累计净值

P0：应计提业绩报酬的集合计划份额在计提起始日的集合计划份额累计净值

P：应计提业绩报酬的集合计划份额在计提起始日的集合计划份额净值

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

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	67,476.15	76,389.32

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

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

H 为每日应计提的集合计划托管费

E 为前一日的集合计划资产净值

集合计划托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各 关联方名称	本期			
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	申万宏源双季增享 6 个月债券 A	申万宏源双季增享 6 个月债券 B	申万宏源双季增享 6 个月债券 C	合计
申万宏源证券有限 公司	-	-	99,382.19	99,382.19
合计	-	-	99,382.19	99,382.19
获得销售服务费的各 关联方名称	上年度可比期间			
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	申万宏源双季增享 6 个月债券 A	申万宏源双季增享 6 个月债券 B	申万宏源双季增享 6 个月债券 C	合计
申万宏源证券有限 公司	-	-	39,937.94	39,937.94
合计	-	-	39,937.94	39,937.94

注：销售服务费可用于本集合计划市场推广、销售以及份额持有人服务等各项费用。本集合计划 A、B 类计划份额不收取销售服务费，C 类计划份额的销售服务费年费率为 0.3%。C 类计划份额的销售服务费按前一日 C 类计划份额资产净值的 0.3%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E\times\text{年销售服务费率}\div365$$

H 为 C 类集合计划份额应计提的销售服务费

E 为 C 类集合计划份额前一日的集合计划资产净值

集合计划销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

销售服务费的优惠活动以管理人相关公告为准。

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
	申万宏源双季增享 6 个月债券 A	申万宏源双季增享 6 个月债券 B	申万宏源双季增享 6 个月债券 C
基金合同生效日 （ 2022 年 10 月 13 日）持有的基金份额	0.00	-	-
报告期初持有的基金份额	16,068,121.78	-	-
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	16,068,121.78	-	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	23.64%	-	-
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
	申万宏源双季增享 6 个月债券 A	申万宏源双季增享 6 个月债券 B	申万宏源双季增享 6 个月债券 C
基金合同生效日	-	-	-

（ 2022 年 10 月 13 日）持有的基金份额			
报告期初持有的基金份额	-	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	-

注：报告期期末持有的本基金份额占 A 类基金总份额比例为 23.64%，报告期期末持有的本基金份额占 A 类、B 类、C 类基金计总份额比例为 6.00%。

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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
兴业银行股份有限公司	1,482,819.03	4,015.35	2,193,851.89	6,179.79

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，本基金报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末（2025 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

本集合计划是一只债券型集合资产管理计划，主要面临的金融工具风险包括：信用风险、流动性风险和市场风险，其中市场风险部分主要是利率风险。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 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	10,070,438.36	-
合计	10,070,438.36	-

注：本表主要列示短期融资券和超短期融资券，债券评级取自第三方评级机构的债项评级，未评级债券列示其他短期融资券和超短期融资券。

6.4.13.2.2 按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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
AAA	113,558,109.56	82,253,826.02
AAA 以下	41,097,057.53	46,405,510.97
未评级	20,507,813.70	15,536,660.28
合计	175,162,980.79	144,195,997.27

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

6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
AAA	10,211,904.11	10,094,013.70
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	10,211,904.11	10,094,013.70

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末	上年度末
--------	-----	------

	2025 年 6 月 30 日	2024 年 12 月 31 日
AAA	39,783,898.09	49,653,854.53
AAA 以下	—	—
未评级	—	—
合计	39,783,898.09	49,653,854.53

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 2025 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	1,482,819.03	-	-	-	1,482,819.03
结算备付金	556,395.70	-	-	-	556,395.70
存出保证金	4,083.68	-	-	-	4,083.68
交易性金融资产	115,408,515.90	67,360,558.89	77,734,597.25	29,451,347.71	289,955,019.75
买入返售金融资产	1,899,009.50	-	-	-	1,899,009.50
应收申购款	-	-	-	549,960.10	549,960.10
应收清算款	-	-	-	295,170.42	295,170.42
资产总计	119,350,823.81	67,360,558.89	77,734,597.25	30,296,478.23	294,742,458.18
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	87,614.91	87,614.91
应付托管费	-	-	-	11,935.35	11,935.35
应付清算款	-	-	-	346,149.82	346,149.82
应付销售服务费	-	-	-	18,679.12	18,679.12
应交税费	-	-	-	12,902.74	12,902.74
其他负债	-	-	-	84,171.79	84,171.79
负债总计	-	-	-	561,453.73	561,453.73
利率敏感度缺口	119,350,823.81	67,360,558.89	77,734,597.25	29,735,024.50	294,181,004.45
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,304,336.87	-	-	-	3,304,336.87

结算备付金	509,836.27	-	-	-	509,836.27
存出保证金	3,215.76	-	-	-	3,215.76
交易性金融资产	100,218,487.41	77,876,409.60	46,534,823.28	25,908,895.90	250,538,616.19
买入返售金融资产	3,207,860.04	-	-	-	3,207,860.04
应收申购款	-	-	-	310,000.00	310,000.00
资产总计	107,243,736.35	77,876,409.60	46,534,823.28	26,218,895.90	257,873,865.13
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	10,537.11	10,537.11
应付管理人报酬	-	-	-	71,599.19	71,599.19
应付托管费	-	-	-	10,601.38	10,601.38
应付清算款	-	-	-	906,878.22	906,878.22
应付销售服务费	-	-	-	15,016.74	15,016.74
应交税费	-	-	-	20,178.69	20,178.69
其他负债	-	-	-	150,394.92	150,394.92
负债总计	-	-	-	1,185,206.25	1,185,206.25
利率敏感度缺口	107,243,736.35	77,876,409.60	46,534,823.28	25,033,689.65	256,688,658.88

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，市场利率风险变量通过久期和凸度影响基金资产净值。		
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（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	955,546.81	1,568,728.08
	市场利率上升 25 个基点	-926,488.54	-1,568,728.08

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 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024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	29,451,347.71	10.01	25,908,895.90	10.09
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	250,291,767.93	85.08	214,535,706.59	83.58
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	279,743,115.64	95.09	240,444,602.49	93.67

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（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	1. 业绩比较基准上升 5%	14,061,007.59	5,672,521.91
	2. 业绩比较基准下降 5%	-14,061,007.59	-5,672,521.91

6.4.13.4.4 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。

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	29,451,347.71	25,908,895.90
第二层次	260,503,672.04	224,629,720.29
第三层次	-	-
合计	289,955,019.75	250,538,616.19

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	29,451,347.71	9.99
	其中：股票	29,451,347.71	9.99
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	260,503,672.04	88.38
	其中：债券	250,291,767.93	84.92
	资产支持证券	10,211,904.11	3.46
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	1,899,009.50	0.64
	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	2,039,214.73	0.69
8	其他各项资产	849,214.20	0.29
9	合计	294,742,458.18	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	41,703.00	0.01
B	采矿业	545,243.00	0.19
C	制造业	19,838,340.99	6.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	509,001.00	0.17
E	建筑业	500,041.00	0.17
F	批发和零售业	294,766.00	0.10
G	交通运输、仓储和邮政业	456,721.00	0.16
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	779,545.06	0.26
J	金融业	5,901,821.66	2.01
K	房地产业	243,144.00	0.08
L	租赁和商务服务业	77,956.00	0.03
M	科学研究和技术服务业	172,772.00	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	12,628.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	16,448.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	25,164.00	0.01
S	综合	36,053.00	0.01
	合计	29,451,347.71	10.01

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601688	华泰证券	52,000	926,120.00	0.31
2	600372	中航机载	74,061	893,175.66	0.30
3	000738	航发控制	36,600	759,450.00	0.26
4	000776	广发证券	43,200	726,192.00	0.25
5	601318	XD 中国平	12,300	682,404.00	0.23
6	000725	京东方 A	163,100	650,769.00	0.22
7	601108	财通证券	79,200	626,472.00	0.21
8	688112	鼎阳科技	14,000	517,580.00	0.18
9	600362	江西铜业	18,800	440,484.00	0.15
10	002138	顺络电子	15,600	438,672.00	0.15
11	688628	XD 优利德	13,000	436,150.00	0.15
12	601211	国泰海通	22,100	423,436.00	0.14
13	600030	中信证券	15,300	422,586.00	0.14
14	688239	航宇科技	11,570	404,718.60	0.14
15	000001	平安银行	32,900	397,103.00	0.13
16	688375	国博电子	6,500	390,065.00	0.13
17	600862	中航高科	14,800	385,984.00	0.13
18	002149	西部材料	17,500	347,375.00	0.12
19	000898	鞍钢股份	146,000	338,720.00	0.12
20	600038	中直股份	8,400	326,004.00	0.11
21	601128	常熟银行	43,318	319,253.66	0.11
22	002475	立讯精密	8,300	287,927.00	0.10
23	600958	东方证券	29,500	285,560.00	0.10
24	688539	高华科技	10,600	281,960.00	0.10
25	000100	TCL 科技	61,300	265,429.00	0.09
26	002600	领益智造	30,300	260,277.00	0.09
27	688300	联瑞新材	5,574	259,469.70	0.09
28	300481	濮阳惠成	18,000	257,580.00	0.09
29	600183	生益科技	8,300	250,245.00	0.09
30	002025	航天电器	4,700	241,627.00	0.08
31	000157	中联重科	33,300	240,759.00	0.08
32	600765	中航重机	14,200	239,696.00	0.08
33	300373	扬杰科技	4,500	233,550.00	0.08
34	600887	伊利股份	8,300	231,404.00	0.08
35	002139	拓邦股份	16,700	230,627.00	0.08
36	000768	中航西飞	8,400	229,656.00	0.08
37	688596	正帆科技	6,600	223,872.00	0.08
38	002415	海康威视	7,900	219,067.00	0.07
39	002517	恺英网络	11,000	212,410.00	0.07
40	000630	铜陵有色	60,700	202,738.00	0.07

41	000060	中金岭南	43,000	196,940.00	0.07
42	603678	火炬电子	5,000	190,150.00	0.06
43	600497	驰宏锌锗	34,400	181,976.00	0.06
44	600741	华域汽车	10,300	181,795.00	0.06
45	300855	图南股份	7,500	178,350.00	0.06
46	603267	鸿远电子	3,400	170,918.00	0.06
47	600048	保利发展	20,500	166,050.00	0.06
48	002429	兆驰股份	36,000	157,680.00	0.05
49	002352	顺丰控股	3,200	156,032.00	0.05
50	603920	世运电路	5,100	155,601.00	0.05
51	300750	宁德时代	600	151,332.00	0.05
52	601117	中国化学	19,400	148,798.00	0.05
53	600585	海螺水泥	6,900	148,143.00	0.05
54	603078	江化微	7,700	143,528.00	0.05
55	000783	长江证券	20,500	142,065.00	0.05
56	688636	智明达	4,183	141,343.57	0.05
57	600519	贵州茅台	100	140,952.00	0.05
58	300969	恒帅股份	2,080	139,318.40	0.05
59	301050	雷电微力	2,600	138,580.00	0.05
60	600760	中航沈飞	2,200	128,964.00	0.04
61	601377	兴业证券	20,600	127,514.00	0.04
62	000425	徐工机械	15,600	121,212.00	0.04
63	601899	紫金矿业	6,100	118,950.00	0.04
64	688676	金盘科技	3,500	117,075.00	0.04
65	002595	豪迈科技	1,900	112,518.00	0.04
66	688080	映翰通	2,200	111,958.00	0.04
67	603059	倍加洁	4,400	108,504.00	0.04
68	600079	人福医药	4,900	102,802.00	0.03
69	000878	云南铜业	8,000	101,760.00	0.03
70	600036	招商银行	2,200	101,090.00	0.03
71	688210	统联精密	4,300	98,040.00	0.03
72	605369	拱东医疗	4,900	93,051.00	0.03
73	688389	普门科技	7,200	93,024.00	0.03
74	300682	朗新集团	3,900	91,650.00	0.03
75	600114	东睦股份	4,500	91,530.00	0.03
76	300450	先导智能	3,600	89,460.00	0.03
77	603786	科博达	1,600	88,656.00	0.03
78	002371	北方华创	200	88,442.00	0.03
79	301235	华康洁净	3,700	87,468.00	0.03
80	600900	长江电力	2,900	87,406.00	0.03
81	688697	纽威数控	6,300	84,042.00	0.03
82	601619	嘉泽新能	23,000	82,340.00	0.03
83	000733	振华科技	1,600	80,080.00	0.03

84	688025	杰普特	1,100	78,650.00	0.03
85	301301	川宁生物	6,500	78,260.00	0.03
86	603225	新凤鸣	7,300	77,745.00	0.03
87	601233	桐昆股份	7,200	76,320.00	0.03
88	002466	天齐锂业	2,300	73,692.00	0.03
89	001309	德明利	600	71,004.00	0.02
90	601009	南京银行	6,100	70,882.00	0.02
91	603297	永新光学	800	69,880.00	0.02
92	601919	中远海控	4,600	69,184.00	0.02
93	300592	华凯易佰	6,000	67,500.00	0.02
94	300447	全信股份	4,300	67,381.00	0.02
95	688589	力合微	3,096	66,223.44	0.02
96	601390	中国中铁	11,700	65,637.00	0.02
97	002179	中航光电	1,600	64,576.00	0.02
98	601668	中国建筑	11,100	64,047.00	0.02
99	000932	华菱钢铁	14,400	63,360.00	0.02
100	605499	东鹏饮料	200	62,810.00	0.02
101	603309	维力医疗	4,800	61,056.00	0.02
102	600584	长电科技	1,800	60,642.00	0.02
103	002241	歌尔股份	2,500	58,300.00	0.02
104	605358	立昂微	2,500	58,250.00	0.02
105	600483	福能股份	6,000	57,840.00	0.02
106	601288	农业银行	9,500	55,860.00	0.02
107	300502	新易盛	420	53,348.40	0.02
108	601398	工商银行	6,900	52,371.00	0.02
109	688028	沃尔德	2,400	52,080.00	0.02
110	002738	中矿资源	1,600	51,456.00	0.02
111	601001	晋控煤业	4,200	51,324.00	0.02
112	600188	兖矿能源	4,200	51,114.00	0.02
113	300059	东方财富	2,200	50,886.00	0.02
114	600699	均胜电子	2,900	50,576.00	0.02
115	601965	中国汽研	2,800	49,700.00	0.02
116	300308	中际旭创	340	49,592.40	0.02
117	600019	宝钢股份	7,500	49,425.00	0.02
118	603019	中科曙光	700	49,280.00	0.02
119	601618	中国中冶	16,300	48,574.00	0.02
120	603180	金牌家居	2,400	46,728.00	0.02
121	002373	千方科技	5,000	46,500.00	0.02
122	603027	千禾味业	4,000	46,440.00	0.02
123	002236	大华股份	2,900	46,052.00	0.02
124	002384	东山精密	1,200	45,324.00	0.02
125	300760	迈瑞医疗	200	44,950.00	0.02
126	600828	茂业商业	11,600	44,776.00	0.02

127	601818	光大银行	10,700	44,405.00	0.02
128	600970	中材国际	5,000	42,900.00	0.01
129	300782	卓胜微	600	42,822.00	0.01
130	002029	七匹狼	6,300	42,462.00	0.01
131	002906	华阳集团	1,300	42,263.00	0.01
132	600325	华发股份	8,600	41,882.00	0.01
133	002960	青鸟消防	4,200	41,034.00	0.01
134	601231	环旭电子	2,800	40,964.00	0.01
135	601939	建设银行	4,300	40,592.00	0.01
136	600196	复星医药	1,600	40,144.00	0.01
137	002064	华峰化学	6,000	39,660.00	0.01
138	600428	中远海特	6,200	38,750.00	0.01
139	002027	分众传媒	5,300	38,690.00	0.01
140	601225	陕西煤业	2,000	38,480.00	0.01
141	000762	西藏矿业	2,000	38,360.00	0.01
142	603766	隆鑫通用	3,000	38,280.00	0.01
143	000933	神火股份	2,300	38,272.00	0.01
144	300428	立中集团	2,100	38,262.00	0.01
145	600648	外高桥	3,500	38,255.00	0.01
146	601601	中国太保	1,000	37,510.00	0.01
147	601319	中国人保	4,300	37,453.00	0.01
148	605117	德业股份	700	36,862.00	0.01
149	002126	银轮股份	1,500	36,420.00	0.01
150	600673	东阳光	3,100	36,053.00	0.01
151	002273	水晶光电	1,800	35,946.00	0.01
152	600803	新奥股份	1,900	35,910.00	0.01
153	600031	三一重工	2,000	35,900.00	0.01
154	300726	宏达电子	1,000	35,750.00	0.01
155	300181	佐力药业	2,000	34,660.00	0.01
156	603699	纽威股份	1,100	34,287.00	0.01
157	600216	浙江医药	2,300	34,017.00	0.01
158	688582	芯动联科	500	33,600.00	0.01
159	688005	容百科技	1,490	33,256.80	0.01
160	601988	中国银行	5,900	33,158.00	0.01
161	300629	新劲刚	1,500	32,535.00	0.01
162	601088	中国神华	800	32,432.00	0.01
163	002532	天山铝业	3,900	32,409.00	0.01
164	000963	华东医药	800	32,288.00	0.01
165	603900	莱绅通灵	2,800	31,920.00	0.01
166	002001	新和成	1,500	31,905.00	0.01
167	601877	正泰电器	1,400	31,738.00	0.01
168	600549	厦门钨业	1,500	31,380.00	0.01
169	002648	卫星化学	1,800	31,194.00	0.01

170	600459	贵研铂业	2,000	31,020.00	0.01
171	601868	中国能建	13,700	30,551.00	0.01
172	002508	老板电器	1,600	30,416.00	0.01
173	603444	吉比特	100	30,195.00	0.01
174	601816	京沪高铁	5,200	29,900.00	0.01
175	600219	南山铝业	7,800	29,874.00	0.01
176	002714	牧原股份	700	29,407.00	0.01
177	002311	海大集团	500	29,295.00	0.01
178	601336	新华保险	500	29,250.00	0.01
179	002984	森麒麟	1,540	28,875.00	0.01
180	002439	启明星辰	1,800	28,782.00	0.01
181	600808	马钢股份	8,300	28,635.00	0.01
182	000723	美锦能源	6,600	28,512.00	0.01
183	600660	福耀玻璃	500	28,505.00	0.01
184	002223	鱼跃医疗	800	28,480.00	0.01
185	300913	兆龙互连	600	28,092.00	0.01
186	600521	华海药业	1,500	27,945.00	0.01
187	603259	药明康德	400	27,820.00	0.01
188	605589	圣泉集团	1,000	27,750.00	0.01
189	601018	宁波港	7,500	27,450.00	0.01
190	002315	焦点科技	600	27,414.00	0.01
191	300033	同花顺	100	27,301.00	0.01
192	000823	超声电子	2,300	27,255.00	0.01
193	300759	康龙化成	1,100	26,994.00	0.01
194	002378	章源钨业	3,400	26,894.00	0.01
195	600406	国电南瑞	1,200	26,892.00	0.01
196	601127	赛力斯	200	26,864.00	0.01
197	300684	中石科技	1,100	26,268.00	0.01
198	600750	江中药业	1,200	26,196.00	0.01
199	600063	皖维高新	5,700	26,106.00	0.01
200	600812	华北制药	4,200	25,956.00	0.01
201	002755	奥赛康	1,600	25,568.00	0.01
202	000625	长安汽车	2,000	25,520.00	0.01
203	000156	华数传媒	3,200	25,408.00	0.01
204	300232	洲明科技	3,500	25,340.00	0.01
205	000875	吉电股份	5,000	25,300.00	0.01
206	601985	中国核电	2,700	25,164.00	0.01
207	601999	出版传媒	3,600	25,164.00	0.01
208	601658	邮储银行	4,600	25,162.00	0.01
209	600268	国电南自	3,200	25,024.00	0.01
210	002249	大洋电机	3,800	25,004.00	0.01
211	002020	京新药业	1,900	24,795.00	0.01
212	601628	中国人寿	600	24,714.00	0.01

213	601998	中信银行	2,900	24,650.00	0.01
214	600496	精工钢构	7,700	24,640.00	0.01
215	688008	澜起科技	300	24,600.00	0.01
216	600377	宁沪高速	1,600	24,544.00	0.01
217	600621	华鑫股份	1,600	24,496.00	0.01
218	600959	江苏有线	7,100	24,424.00	0.01
219	600155	华创云信	3,500	24,360.00	0.01
220	601368	绿城水务	5,000	24,250.00	0.01
221	600301	华锡有色	1,200	23,964.00	0.01
222	000672	上峰水泥	3,000	23,700.00	0.01
223	002294	信立泰	500	23,665.00	0.01
224	000988	华工科技	500	23,505.00	0.01
225	600938	中国海油	900	23,499.00	0.01
226	600256	广汇能源	3,900	23,478.00	0.01
227	600871	石化油服	12,000	23,400.00	0.01
228	601089	福元医药	1,400	23,352.00	0.01
229	603288	海天味业	600	23,346.00	0.01
230	002881	美格智能	500	23,200.00	0.01
231	600361	创新新材	5,800	23,142.00	0.01
232	600017	日照港	7,400	22,940.00	0.01
233	601555	东吴证券	2,600	22,750.00	0.01
234	002850	科达利	200	22,634.00	0.01
235	300762	上海瀚讯	1,000	22,630.00	0.01
236	600863	内蒙华电	5,500	22,605.00	0.01
237	600995	南网储能	2,300	22,494.00	0.01
238	600075	新疆天业	5,300	22,419.00	0.01
239	600795	国电电力	4,600	22,264.00	0.01
240	300073	当升科技	500	21,935.00	0.01
241	002409	雅克科技	400	21,876.00	0.01
242	600882	妙可蓝多	700	21,371.00	0.01
243	600420	国药现代	2,000	21,300.00	0.01
244	002324	普利特	2,000	21,260.00	0.01
245	600098	广州发展	3,400	21,250.00	0.01
246	600639	浦东金桥	2,000	21,180.00	0.01
247	600664	哈药股份	5,700	20,976.00	0.01
248	600742	富维股份	2,200	20,922.00	0.01
249	600872	中炬高新	1,100	20,900.00	0.01
250	600398	海澜之家	3,000	20,880.00	0.01
251	601898	中煤能源	1,900	20,786.00	0.01
252	603031	安孚科技	700	20,713.00	0.01
253	301297	富乐德	500	20,665.00	0.01
254	600171	上海贝岭	600	20,550.00	0.01
255	002920	德赛西威	200	20,426.00	0.01

256	001965	招商公路	1,700	20,400.00	0.01
257	002773	康弘药业	700	20,279.00	0.01
258	601567	三星医疗	900	20,178.00	0.01
259	603687	大胜达	2,700	20,061.00	0.01
260	300408	三环集团	600	20,040.00	0.01
261	600488	津药药业	4,800	20,016.00	0.01
262	301282	金禄电子	800	19,832.00	0.01
263	601958	金钼股份	1,800	19,692.00	0.01
264	600018	上港集团	3,400	19,414.00	0.01
265	300570	太辰光	200	19,276.00	0.01
266	301205	联特科技	200	19,172.00	0.01
267	002230	科大讯飞	400	19,152.00	0.01
268	605338	巴比食品	1,000	18,750.00	0.01
269	603859	能科科技	576	18,616.32	0.01
270	688083	中望软件	280	18,034.80	0.01
271	002396	星网锐捷	800	17,960.00	0.01
272	688337	普源精电	499	17,799.33	0.01
273	688016	心脉医疗	200	17,684.00	0.01
274	601600	中国铝业	2,500	17,600.00	0.01
275	002649	博彦科技	1,200	17,436.00	0.01
276	002688	金河生物	2,800	17,388.00	0.01
277	300628	亿联网络	500	17,380.00	0.01
278	300054	鼎龙股份	600	17,208.00	0.01
279	300638	广和通	600	17,178.00	0.01
280	301517	陕西华达	420	17,089.80	0.01
281	600908	无锡银行	2,700	17,037.00	0.01
282	002980	华盛昌	840	16,951.20	0.01
283	002706	良信股份	1,900	16,929.00	0.01
284	002130	沃尔核材	700	16,674.00	0.01
285	601168	西部矿业	1,000	16,630.00	0.01
286	600415	小商品城	800	16,544.00	0.01
287	601012	隆基绿能	1,100	16,522.00	0.01
288	002044	美年健康	3,200	16,448.00	0.01
289	002626	金达威	800	16,368.00	0.01
290	600645	中源协和	700	16,240.00	0.01
291	603688	石英股份	450	15,849.00	0.01
292	603663	三祥新材	600	15,804.00	0.01
293	300979	华利集团	300	15,771.00	0.01
294	300458	全志科技	390	15,479.10	0.01
295	000559	万向钱潮	2,000	15,300.00	0.01
296	600583	海油工程	2,800	15,288.00	0.01
297	601991	大唐发电	4,800	15,216.00	0.01
298	002926	华西证券	1,700	15,198.00	0.01

299	300623	捷捷微电	500	14,900.00	0.01
300	002281	光迅科技	300	14,796.00	0.01
301	603939	益丰药房	600	14,682.00	0.00
302	300613	富瀚微	300	14,664.00	0.00
303	600008	首创环保	4,800	14,496.00	0.00
304	301339	通行宝	840	14,389.20	0.00
305	301327	华宝新能	280	14,380.80	0.00
306	600141	兴发集团	700	14,371.00	0.00
307	002299	圣农发展	1,000	14,290.00	0.00
308	600282	南钢股份	3,400	14,280.00	0.00
309	600668	尖峰集团	1,000	14,150.00	0.00
310	688315	诺禾致源	1,000	14,120.00	0.00
311	300037	新宙邦	400	14,080.00	0.00
312	002967	广电计量	800	14,072.00	0.00
313	001979	招商蛇口	1,600	14,032.00	0.00
314	002500	山西证券	2,400	14,016.00	0.00
315	300811	铂科新材	300	13,923.00	0.00
316	603013	亚普股份	800	13,824.00	0.00
317	002546	新联电子	2,500	13,725.00	0.00
318	300727	润禾材料	520	13,670.80	0.00
319	600718	东软集团	1,400	13,650.00	0.00
320	601866	中远海发	5,500	13,585.00	0.00
321	600552	凯盛科技	1,200	13,560.00	0.00
322	603132	金徽股份	1,000	13,270.00	0.00
323	601006	大秦铁路	2,000	13,200.00	0.00
324	002733	雄韬股份	800	13,176.00	0.00
325	600489	中金黄金	900	13,167.00	0.00
326	003037	三和管桩	1,800	12,924.00	0.00
327	600707	彩虹股份	2,000	12,920.00	0.00
328	601179	中国西电	2,100	12,894.00	0.00
329	601916	浙商银行	3,800	12,882.00	0.00
330	000807	云铝股份	800	12,784.00	0.00
331	603501	豪威集团	100	12,765.00	0.00
332	002266	浙富控股	4,100	12,628.00	0.00
333	688772	珠海冠宇	883	12,618.07	0.00
334	300925	法本信息	500	12,590.00	0.00
335	002262	恩华药业	600	12,468.00	0.00
336	603100	川仪股份	600	12,378.00	0.00
337	600058	五矿发展	1,600	12,368.00	0.00
338	605296	神农集团	400	12,296.00	0.00
339	002206	海利得	2,400	12,264.00	0.00
340	603566	普莱柯	900	12,249.00	0.00
341	002440	闰土股份	1,600	12,192.00	0.00

342	002160	常铝股份	2,800	12,096.00	0.00
343	600850	电科数字	500	12,095.00	0.00
344	002410	广联达	900	12,069.00	0.00
345	300768	迪普科技	700	12,005.00	0.00
346	300018	中元股份	1,500	11,925.00	0.00
347	000858	五 粮 液	100	11,890.00	0.00
348	688380	中微半导	437	11,842.70	0.00
349	688419	耐科装备	317	11,817.76	0.00
350	603876	鼎胜新材	1,300	11,817.00	0.00
351	603648	畅联股份	1,100	11,814.00	0.00
352	688371	菲沃泰	712	11,790.72	0.00
353	002376	新北洋	1,500	11,655.00	0.00
354	600335	国机汽车	1,800	11,610.00	0.00
355	600758	辽宁能源	3,100	11,594.00	0.00
356	300772	运达股份	900	11,592.00	0.00
357	601678	滨化股份	2,800	11,592.00	0.00
358	601016	节能风电	4,000	11,560.00	0.00
359	300763	锦浪科技	200	11,478.00	0.00
360	000539	粤电力 A	2,500	11,350.00	0.00
361	000568	泸州老窖	100	11,340.00	0.00
362	002419	天虹股份	2,100	11,256.00	0.00
363	000755	山西高速	2,300	11,201.00	0.00
364	688432	有研硅	1,013	11,183.52	0.00
365	002632	道明光学	1,200	11,160.00	0.00
366	688147	微导纳米	366	11,045.88	0.00
367	600380	健康元	1,000	11,030.00	0.00
368	300360	炬华科技	700	11,025.00	0.00
369	002332	仙琚制药	1,200	11,004.00	0.00
370	605333	沪光股份	400	10,980.00	0.00
371	603087	甘李药业	200	10,956.00	0.00
372	600027	华电国际	2,000	10,940.00	0.00
373	600563	法拉电子	100	10,909.00	0.00
374	601116	三江购物	1,000	10,890.00	0.00
375	000709	河钢股份	5,000	10,800.00	0.00
376	002421	达实智能	3,200	10,752.00	0.00
377	300463	迈克生物	900	10,710.00	0.00
378	002606	大连电瓷	1,200	10,704.00	0.00
379	601113	华鼎股份	2,700	10,665.00	0.00
380	600299	安迪苏	1,100	10,615.00	0.00
381	300856	科思股份	700	10,605.00	0.00
382	600987	航民股份	1,500	10,605.00	0.00
383	603156	养元饮品	500	10,580.00	0.00
384	002966	苏州银行	1,200	10,536.00	0.00

385	688232	新点软件	350	10,514.00	0.00
386	002746	仙坛股份	1,800	10,476.00	0.00
387	300453	三鑫医疗	1,300	10,465.00	0.00
388	601226	华电科工	1,700	10,370.00	0.00
389	002655	共达电声	800	10,368.00	0.00
390	601169	北京银行	1,500	10,245.00	0.00
391	000726	鲁 泰 A	1,600	10,144.00	0.00
392	600575	淮河能源	2,900	10,121.00	0.00
393	600961	株冶集团	900	10,062.00	0.00
394	300207	欣旺达	500	10,030.00	0.00
395	600724	宁波富达	2,200	10,010.00	0.00
396	300320	海达股份	1,000	9,940.00	0.00
397	002641	公元股份	2,400	9,912.00	0.00
398	002797	第一创业	1,400	9,912.00	0.00
399	603998	方盛制药	1,000	9,820.00	0.00
400	300973	立高食品	200	9,754.00	0.00
401	003816	中国广核	2,600	9,464.00	0.00
402	300194	福安药业	2,200	9,306.00	0.00
403	002129	TCL 中环	1,200	9,216.00	0.00
404	300014	亿纬锂能	200	9,162.00	0.00
405	600917	重庆燃气	1,600	9,152.00	0.00
406	600248	陕建股份	2,400	9,144.00	0.00
407	603055	台华新材	1,000	9,130.00	0.00
408	603018	华设集团	1,100	9,031.00	0.00
409	000415	渤海租赁	2,700	8,991.00	0.00
410	300604	长川科技	200	8,982.00	0.00
411	000983	山西焦煤	1,400	8,960.00	0.00
412	300978	东箭科技	800	8,928.00	0.00
413	603038	华立股份	600	8,772.00	0.00
414	603170	宝立食品	700	8,729.00	0.00
415	688588	凌志软件	590	8,596.30	0.00
416	002803	吉宏股份	600	8,556.00	0.00
417	601138	工业富联	400	8,552.00	0.00
418	600418	江淮汽车	200	8,018.00	0.00
419	603197	保隆科技	200	7,814.00	0.00
420	600609	金杯汽车	1,400	7,406.00	0.00
421	002465	海格通信	500	6,970.00	0.00
422	688223	晶科能源	1,262	6,549.78	0.00
423	688709	成都华微	200	6,548.00	0.00
424	002003	伟星股份	600	6,546.00	0.00
425	002245	蔚蓝锂芯	500	6,415.00	0.00
426	601328	交通银行	800	6,400.00	0.00
427	600062	华润双鹤	300	5,598.00	0.00

428	002662	峰璟股份	1,600	5,472.00	0.00
429	600276	恒瑞医药	100	5,190.00	0.00
430	300339	润和软件	100	5,083.00	0.00
431	300758	七彩化学	300	4,482.00	0.00
432	688552	航天南湖	100	3,991.00	0.00
433	002043	兔宝宝	400	3,920.00	0.00
434	601208	东材科技	400	3,792.00	0.00
435	002456	欧菲光	300	3,555.00	0.00
436	603987	康德莱	400	3,080.00	0.00
437	601669	中国电建	600	2,922.00	0.00
438	000061	农产品	300	1,917.00	0.00
439	688658	悦康药业	100	1,904.00	0.00
440	601058	赛轮轮胎	100	1,312.00	0.00
441	601857	中国石油	100	855.00	0.00
442	002394	联发股份	100	823.00	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	688375	国博电子	554,267.90	0.22
2	000738	航发控制	427,601.00	0.17
3	002149	西部材料	392,929.00	0.15
4	688636	智明达	313,216.97	0.12
5	688539	高华科技	279,503.53	0.11
6	002600	领益智造	259,568.00	0.10
7	688596	正帆科技	252,036.50	0.10
8	002429	兆驰股份	201,340.00	0.08
9	600862	中航高科	198,050.00	0.08
10	002139	拓邦股份	186,190.00	0.07
11	688239	航宇科技	185,020.98	0.07
12	300855	图南股份	170,198.00	0.07
13	600362	江西铜业	153,530.00	0.06
14	603267	鸿远电子	150,841.00	0.06
15	002025	航天电器	146,051.00	0.06
16	601117	中国化学	145,061.00	0.06
17	301050	雷电微力	137,253.00	0.05
18	688552	航天南湖	133,987.00	0.05
19	603786	科博达	132,429.00	0.05
20	688676	金盘科技	130,490.64	0.05

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	688636	智明达	344,041.60	0.13
2	000738	航发控制	304,017.00	0.12
3	002465	海格通信	271,669.00	0.11
4	688375	国博电子	271,488.20	0.11
5	300674	宇信科技	262,938.00	0.10
6	300547	川环科技	261,480.00	0.10
7	603338	浙江鼎力	203,821.00	0.08
8	688552	航天南湖	198,621.00	0.08
9	688658	悦康药业	161,574.00	0.06
10	300458	全志科技	145,038.00	0.06
11	300682	朗新集团	127,975.00	0.05
12	688589	力合微	127,821.31	0.05
13	300638	广和通	118,476.00	0.05
14	002149	西部材料	109,690.00	0.04
15	000157	中联重科	106,300.00	0.04
16	002594	比亚迪	76,750.00	0.03
17	002352	顺丰控股	69,830.00	0.03
18	600879	航天电子	68,820.00	0.03
19	605369	拱东医疗	63,496.00	0.02
20	605589	圣泉集团	62,283.00	0.02

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	8,147,390.26
卖出股票收入（成交）总额	5,916,484.23

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	5,022,036.99	1.71
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,252,413.70	6.88
	其中：政策性金融债	20,252,413.70	6.88
4	企业债券	35,255,027.39	11.98
5	企业短期融资券	20,118,032.88	6.84
6	中期票据	31,152,230.13	10.59
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	39,783,898.09	13.52
9	其他	98,708,128.75	33.55
10	合计	250,291,767.93	85.08

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	242400005	24 农行永续债 01	200,000	20,737,556.16	7.05
2	112414188	24 江苏银行 CD188	200,000	19,948,688.88	6.78
3	092280108	22 中行二级资本债 02A	150,000	15,715,791.78	5.34
4	115654	23 首城 02	100,000	10,540,463.01	3.58
5	092280069	22 华夏银行二级资本债 01	100,000	10,530,287.67	3.58

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	263355	24 华发 5A	100,000	10,211,904.11	3.47

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

本集合计划对国债期货的投资根据风险管理原则，以套期保值为目的。结合国债交易市场和期货市场的收益性、流动性等情况，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作，获取超额收益。

7.10.2 本期国债期货投资评价

本报告期本基金无国债期货交易。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国农业银行股份有限公司、江苏银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、华夏银行股份有限公司、中国工商银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局、中国人民银行的处罚。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

除此之外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，且在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚的情形。

7.11.2 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。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	4,083.68
2	应收清算款	295,170.42
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	549,960.10
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	849,214.20

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本报告期末本基金未持有可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本报告期末本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人 户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
申万宏源 双季增享 6 个月债 券 A	172	395,198.25	18,822,114.39	27.69	49,151,984.26	72.31

申万宏源双季增享 6 个月债券 B	337	346,891.15	11,272,317.79	9.64	105,629,999.09	90.36
申万宏源双季增享 6 个月债券 C	87	954,320.87	28,881,559.06	34.79	54,144,356.70	65.21
合计	596	449,500.56	58,975,991.24	22.01	208,926,340.05	77.99

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	申万宏源双季增享 6 个月债券 A	2,759.78	0.0041
	申万宏源双季增享 6 个月债券 B	—	—
	申万宏源双季增享 6 个月债券 C	—	—
	合计	2,759.78	0.0010

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	申万宏源双季增享 6 个月债券 A	0
	申万宏源双季增享 6 个月债券 B	0
	申万宏源双季增享 6 个月债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	申万宏源双季增享 6 个月债券 A	0
	申万宏源双季增享 6 个月债券 B	0
	申万宏源双季增享 6 个月债券 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	申万宏源双季增享 6 个月债券 A	申万宏源双季增享 6 个月债券 B	申万宏源双季增享 6 个月债券 C
基金合同生效日（2022 年 10 月 13 日）基金份额总额	—	380,979,531.67	—

本报告期期初 基金份额总额	42,270,643.13	123,867,357.20	70,190,850.29
本报告期基金 总申购份额	31,309,018.87	—	18,488,078.87
减：本报告期 基金总赎回份 额	5,605,563.35	6,965,040.32	5,653,013.40
本报告期基金 拆分变动份额	—	—	—
本报告期期末 基金份额总额	67,974,098.65	116,902,316.88	83,025,915.76

§ 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：

自 2025 年 1 月 24 日起，顾伟担任副总经理；

自 2025 年 2 月 27 日起，虞博担任合规总监、首席风险官，袁锦不再代任合规总监、首席风险官。

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

本报告期内本基金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在开展基金托管业务过程中无受稽查或处罚等情况。

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	14,097,387.92	100.00	7,054.53	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。

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	4,984,650.00	100.00	658,885,000.00	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	2025 年 1 月 25 日
2	申万宏源双季增享 6 个月持有期债券型集合资产管理计划新增销售机构的公告	中国证监会规定披露媒介	2025 年 2 月 19 日
3	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	2025 年 2 月 28 日
4	申万宏源双季增享 6 个月持有期债券型集合资产管理计划关于份额持有期不足 6 个月的提示性公告	中国证监会规定披露媒介	2025 年 4 月 11 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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，未发现影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、《申万宏源双季增享 6 个月持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》；
- 2、《申万宏源双季增享 6 个月持有期债券型集合资产管理计划托管协议》；
- 3、《申万宏源双季增享 6 个月持有期债券型集合资产管理计划招募说明书》；
- 4、《申万宏源双季增享 6 个月持有期债券型集合资产管理计划基金产品资料概要》；
- 5、管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内披露的各项公告。

12.2 存放地点

上海市徐汇区长乐路 989 号 40 层

12.3 查阅方式

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

咨询电话：95523

公司网址：www.swhyzcgl.com

申万宏源证券资产管理有限公司

2025 年 8 月 29 日