

交银施罗德瑞思三年封闭运作混合型证券投资基金
2020 年中期报告
2020 年 6 月 30 日

基金管理人：交银施罗德基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年八月二十九日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 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 2020 年 2 月 21 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
§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	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	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的真实、准确和完整发表意见	12
§6 中期财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	15
§7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	37
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
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	45
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	45
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	45
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	45
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45
7.12 投资组合报告附注	46

§8 基金份额持有人信息	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	47
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	48
8.4 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的情况.....	48
§9 开放式基金份额变动	48
§10 重大事件揭示	49
10.1 基金份额持有人大会决议.....	49
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.....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	49
10.4 基金投资策略的改变.....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	49
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.....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	49
10.8 其他重大事件.....	52
§11 备查文件目录	53
11.1 备查文件目录.....	53
11.2 存放地点.....	53
11.3 查阅方式.....	53

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	交银施罗德瑞思三年封闭运作混合型证券投资基金
基金简称	交银瑞思
基金主代码	501092
交易代码	501092
基金运作方式	契约型开放式 本基金合同生效后，前三年封闭运作，在封闭期内，本基金不办理申购、赎回业务，但投资人可在本基金上市交易后通过上海证券交易所转让基金份额。封闭期届满后，本基金转为上市开放式基金（LOF），可办理场外、场内申购赎回，并继续在上海证券交易所上市交易。
基金合同生效日	2020 年 2 月 21 日
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	4,945,845,223.18 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，坚持价值投资的基本理念，充分发挥专业研究与管理能力，力争为投资者提供长期稳健的投资回报。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势，以长期历史数据为基础，运用稳健的投资理念和严谨的分析方法对经济基本面进行深入的定量和定性分析，确定基金资产在沪深 A 股、港股、债券及货币市场工具等各类别资产的初步分配比例。同时，再辅以投资时钟模型以及周期轮动理论“自上而下”对各类资产配置进行灵活调整，及时应对市场变化，在有效规避或控制市场风险的基础上，为投资者获取稳定的投资收益。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×70%+恒生指数收益率×5%+中证综合债券指数收益率×25%
风险收益特征	本基金是一只混合型基金，其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。

	本基金可投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。
--	---

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		交银施罗德基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王晚婷	贺倩
	联系电话	(021) 61055050	010-66060069
	电子邮箱	xxpl@jysld.com, disclosure@jysld.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-700-5000, 021-61055000	95599
传真		(021) 61055054	010-68121816
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号交通银行大楼二层（裙）	北京市东城区建国门内大街69号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道8号国金中心二期21-22楼	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码		200120	100031
法定代表人		阮红	周慕冰

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.fund001.com
基金中期报告备置地点	基金管理人的办公场所

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

§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(2020年2月21日(基金合同生效日)至2020年6月30日)
本期已实现收益	1,603,073.71
本期利润	291,802,427.18
加权平均基金份额本期利润	0.0590
本期加权平均净值利润率	5.87%
本期基金份额净值增长率	5.90%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	1,603,073.71
期末可供分配基金份额利润	0.0003
期末基金资产净值	5,237,647,650.36
期末基金份额净值	1.0590
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)
基金份额累计净值增长率	5.90%

注：1、本基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、本基金合同生效日为 2020 年 2 月 21 日，自基金合同生效日至本报告期期末，本基金运作时间不足半年。

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	4.50%	0.54%	5.47%	0.68%	-0.97%	-0.14%
过去三个月	8.45%	0.55%	9.09%	0.69%	-0.64%	-0.14%
自基金合同生效起至今	5.90%	0.64%	0.11%	1.04%	5.79%	-0.40%

注：本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率×70%+恒生指数收益率×5%+中证综合债券指数收益率×25%，每日进行再平衡过程。

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

交银施罗德瑞思三年封闭运作混合型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2020 年 2 月 21 日至 2020 年 6 月 30 日)



注：本基金基金合同生效日为 2020 年 2 月 21 日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间未满一年。本基金建仓期为自基金合同生效日起的 6 个月。截至 2020 年 6 月 30 日，本基金尚处于建仓期。

§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

交银施罗德基金管理有限公司是经中国证监会证监基金字[2005]128 号文批准，由交通银行股份有限公司、施罗德投资管理有限公司、中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司共同发起设立。公司成立于 2005 年 8 月 4 日，注册地在中国上海，注册资本为 2 亿元人民币。其中，交通银行股份有限公司持有 65% 的股份，施罗德投资管理有限公司持有 30% 的股份，中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司持有 5% 的股份。

公司并下设交银施罗德资产管理（香港）有限公司和交银施罗德资产管理有限公司。

截至报告期末，公司管理了包括货币型、债券型、普通混合型和股票型在内的 89 只基金，其中股票型涵盖普通指数型、交易型开放式（ETF）、QDII 等不同类型基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
沈楠	交银主题优选混合、交银国企改革灵活配置混合、交银瑞思混合的基金经理	2020-02-21	-	11 年	沈楠先生，复旦大学硕士。历任长江证券高级分析师，2011 年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任行业分析师、基金经理助理。

注：1、本表所列基金经理（助理）任职日期和离职日期均以基金合同生效日或公司作出决定并公告（如适用）之日为准。

2、本表所列基金经理（助理）证券从业年限中的“证券从业”的含义遵从中国证券业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、基金经理（或基金经理小组）期后变动（如有）敬请关注基金管理人发布的相关公告。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，基金整体运作符合有关法律法规和基金合同的规定，为基金持有人谋求最大利益。

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

本公司制定了严格的投资控制制度和公平交易监控制度来保证旗下基金运作的公平，旗下所管理的所有资产组合，包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均严格遵循制度进行公平交易。

公司建立资源共享的投资研究信息平台，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。公司在交易执行环节实行集中交易制度，建立公平的交易分配制度。对于交易所公开竞价交易，遵循“时间优先、价格优先、比例分配”的原则，全部通过交易系统进行比例分配；对于非集中竞价交易、以公司名义进行的场外交易，遵循“价格优先、比例分配”的原则按事前独立确定的投资方案对交易结果

进行分配。

公司中央交易室和风险管理部进行日常投资交易行为监控，风险管理部负责对各账户公平交易进行事后分析，于每季度和每年度分别对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析，通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

报告期内本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，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

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内，本公司管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量没有超过该证券当日总成交量 5% 的情形，本基金与本公司管理的其他投资组合在不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）同向交易的交易价差未出现异常。

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

2020 年上半年，受全球新冠疫情扩散和反复的影响，经济在供给和需求层面均受到了一定冲击。全球央行大幅货币宽松，并出台财政支持措施有效缓解了经济下行的程度，我们认为政策在未来一段时间将维持偏宽松格局。在流动性偏松的大环境下，市场有望继续呈现较强的结构性行情。

报告期内，本基金仍处于建仓期，在一季度市场大幅调整中快速增加仓位，但在后续市场强势反弹中保持谨慎乐观，仅继续缓慢建仓。目前在合理安全垫的基础上结合低估值和长期成长潜力两个维度进行配置，主要集中在先进制造、食品农业医药、计算机传媒电子以及部分低估值的金融地产家电等行业。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金（各类）份额净值及业绩表现请见“3.1 主要会计数据和财务指标”及“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”部分披露。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为如果新冠疫情在全球得到有效控制，同时通胀压力减缓，那么可以对市场继续保持乐观，基本面“深坑”后投资机会有望扩散。伴随科创板及创业板中更多优质资产登陆资本市场，上市企业的分化会加大，拥有较好现金流以及商业壁垒的企业仍是我们看好的主要方向。而伴随贸易战、新冠疫情等外部不利因素，我们认为仍需重点关注内需相关，受外需影响较小的领域和上市企业。未来我们将更多挖掘受益于进口替代的高端制造业，受益于技术升级的计算机、传媒、电子等行业，以及食品、

医药等必须消费品，同时关注低估值蓝筹的修复性机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序，经公司管理层批准后实行，并成立了估值委员会，估值委员会成员由研究部、基金运营部、风险管理部等人员和固定收益人员及基金经理组成。

公司严格按照新会计准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定进行估值，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。估值委员会的研究部成员按投资品种的不同性质，研究并参考市场普遍认同的做法，建议合理的估值模型，进行测算和认证，认可后交各估值委员会成员从基金会计、风险、合规等方面审批，一致同意后，报公司投资总监、总经理审批。

估值委员会会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后，及时召开临时会议进行研究，及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值委员会成员均具备相应的专业资格及工作经验。基金经理作为估值委员会成员，对本基金持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感，向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论。本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突，截止报告期末未有与任何外部估值定价服务机构签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

本基金本报告期内无需预警说明。

§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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—交银施罗德基金管理有限公司 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害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

本托管人认为，交银施罗德基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基

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

本托管人认为，交银施罗德基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金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、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§6 中期财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：交银施罗德瑞思三年封闭运作混合型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	347,001,317.70
结算备付金		82,908,751.37
存出保证金		903,006.56
交易性金融资产	6.4.7.2	3,370,918,179.13
其中：股票投资		3,370,918,179.13
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	1,400,000,000.00
应收证券清算款		74,348,718.99
应收利息	6.4.7.5	212,755.11
应收股利		1,890,524.00
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-

资产总计		5,278,183,252.86
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 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		-
应付证券清算款		31,030,695.44
应付赎回款		-
应付管理人报酬		6,311,960.81
应付托管费		1,051,993.47
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	1,954,669.94
应交税费		90,289.82
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	95,993.02
负债合计		40,535,602.50
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	4,945,845,223.18
未分配利润	6.4.7.10	291,802,427.18
所有者权益合计		5,237,647,650.36
负债和所有者权益总计		5,278,183,252.86

注：1、报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0590 元，基金份额总额 4,945,845,223.18 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2020 年 2 月 21 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日。

6.2 利润表

会计主体：交银施罗德瑞思三年封闭运作混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 2 月 21 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2020 年 2 月 21 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		329,329,321.14
1.利息收入		14,791,367.03
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,934,910.00
债券利息收入		290.94
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		11,856,166.09
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		24,338,600.64
其中：股票投资收益	6.4.7.12	5,777,314.43
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	1,453,663.83
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.15	-6,271,590.00
股利收益	6.4.7.16	23,379,212.38
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	290,199,353.47
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-
减：二、费用		37,526,893.96
1. 管理人报酬		26,506,508.15
2. 托管费		4,417,751.35
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.19	6,440,257.24
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6.税金及附加		42,683.26
7. 其他费用	6.4.7.20	119,693.96
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		291,802,427.18
减：所得税费用		-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		291,802,427.18
-------------------	--	-----------------------

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：交银施罗德瑞思三年封闭运作混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 2 月 21 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 2 月 21 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	4,945,845,223.18	-	4,945,845,223.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	291,802,427.18	291,802,427.18
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	4,945,845,223.18	291,802,427.18	5,237,647,650.36

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：

基金管理人负责人：谢卫，主管会计工作负责人：夏华龙，会计机构负责人：单江

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

交银施罗德瑞思三年封闭运作混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券

监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]2666 号《关于准予交银施罗德瑞思三年封闭运作混合型证券投资基金注册的批复》核准,由交银施罗德基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德瑞思三年封闭运作混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 4,945,620,669.26 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)第 0122 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《交银施罗德瑞思三年封闭运作混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 2 月 21 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 4,945,845,223.18 份基金份额,其中认购资金利息折合 224,553.92 份基金份额。本基金的基金管理人为交银施罗德基金管理有限公司,基金托管人为中国农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《交银施罗德瑞思三年封闭运作混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金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(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、港股通标的股票、债券(含国债、央行票据、金融债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、企业债券、公司债券、可转换债券(含可分离交易可转换债券的纯债部分)、可交换公司债券、公开发行的次级债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、货币市场工具、债券回购、同业存单、银行存款(含协议存款、定期存款及其他银行存款)、股指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。本基金的投资组合比例为:本基金转为上市开放式基金(LOF)后,股票投资占基金资产的比例为 50%-95%(其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0%-50%);封闭期内,股票投资占基金资产的比例为 50%-100%(其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0%-50%);但本基金转为上市开放式基金(LOF)的前后各三个月内,基金投资不受前述下限比例限制。本基金转为上市开放式基金(LOF)后,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,本基金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基金资产净值的 5%;在封闭期内,本基金不受前述 5%的限制,但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,应当保持不低于交易保证金一倍的现金;其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率×70%+恒生指数收益率×5%+中证综合债券指数收益率×25%。

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于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、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》、《交银施罗德瑞思三年封闭运作混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年 2 月 21 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日止期间的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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 2 月 21 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2020 年 2 月 21 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债

表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

封闭期内实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为 1.00 元。

6.4.4.8 损益平准金

封闭期内不适用损益平准金。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

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

6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

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。

6.4.4.13其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《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[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计

入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	347,001,317.70
定期存款	-
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	-
合计	347,001,317.70

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	3,080,718,825.66	3,370,918,179.13	290,199,353.47
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-

	合计	-	-	-
	资产支持证券	-	-	-
	基金	-	-	-
	其他	-	-	-
	合计	3,080,718,825.66	3,370,918,179.13	290,199,353.47

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融工具。

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 2020 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	1,400,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	1,400,000,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	65,728.82
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	45,110.56
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	101,509.43

应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	406.30
合计	212,755.11

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	1,954,669.94
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,954,669.94

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提审计费	45,746.51
预提信息披露费	45,746.51
预提账户维护费	4,500.00
合计	95,993.02

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 2 月 21 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	4,945,845,223.18	4,945,845,223.18
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	4,945,845,223.18	4,945,845,223.18

注：1、本基金于 2020 年 2 月 17 日公开发售，共募集有效净认购资金人民币 4,945,620,669.26 元，折合为 4,945,620,669.26 份基金份额。根据《交银施罗德瑞思三年封闭运作混合型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 224,553.92 元在本基金成立后，折合为 224,553.92 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

2、根据《交银施罗德瑞思三年封闭运作混合型证券投资基金基金合同》、《交银施罗德瑞思三年封闭运作混合型证券投资基金招募说明书》的相关规定，本基金在基金合同生效之日起三年内(含三年)封闭式运作。于封闭期内，基金投资者不能申购、赎回本基金份额。

6.4.7.10 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
本期利润	1,603,073.71	290,199,353.47	291,802,427.18
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,603,073.71	290,199,353.47	291,802,427.18

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 2 月 21 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	2,542,324.26
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	387,796.04
其他	4,789.70
合计	2,934,910.00

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期

	2020 年 2 月 21 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,008,945,012.85
减：卖出股票成本总额	1,003,167,698.42
买卖股票差价收入	5,777,314.43

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2020年2月21日（基金合同生效日）至2020年6月30日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	18,681,063.56
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	17,194,332.88
减：应收利息总额	33,066.85
买卖债券(债转股及债券到期兑付)差价收入	1,453,663.83

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期
	2020年2月21日（基金合同生效日）至2020年6月30日
股指期货投资收益	-6,271,590.00

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2020年2月21日（基金合同生效日）至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	23,379,212.38
基金投资产生的股利收益	-

合计	23,379,212.38
----	---------------

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年2月21日（基金合同生效日）至2020年6月 30日
1.交易性金融资产	290,199,353.47
——股票投资	290,199,353.47
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
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	290,199,353.47

6.4.7.18 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年2月21日（基金合同生效日）至2020年6月30日
交易所市场交易费用	6,432,929.01
银行间市场交易费用	-
期货交易费用	7,328.23
合计	6,440,257.24

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2020年2月21日（基金合同生效日）至2020年6月30日
审计费用	45,746.51
信息披露费	45,746.51
银行费用	23,300.94
债券账户费用	4,500.00
其他	400.00
合计	119,693.96

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

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

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

本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害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
交银施罗德基金管理有限公司(“交银施罗德基金公司”)	基金管理人、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的交易。

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
	2020年2月21日（基金合同生效日）至2020年6月

	30日
当期发生的基金应支付的管理费	26,506,508.15
其中：支付销售机构的客户维护费	4,512.51

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50%÷当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2020年2月21日（基金合同生效日）至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	4,417,751.35

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内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 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内未发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.4.2 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

本报告期内除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金。

6.4.10.5 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	
	2020年2月21日（基金合同生效日）至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入

中国农业银行股份有限公司	347,001,317.70	2,542,324.26
--------------	----------------	--------------

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，存款利率参考银行同业利率及银行存款利率确定。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2020 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002841	视源股份	2020-06-05	2020-12-07	限售股	82.98	93.12	300,000	24,894,000.00	27,936,000.00	-
300840	酷特智能	2020-06-30	2020-07-08	新股未上市	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300843	胜蓝股份	2020-06-23	2020-07-02	新股未上市	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300845	捷安高科	2020-06-24	2020-07-03	新股未上市	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300846	首都在线	2020-06-22	2020-07-01	新股未上市	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-
300847	中船汉光	2020-06-29	2020-07-09	新股未上市	6.94	6.94	1,420	9,854.80	9,854.80	-
688222	成都先导	2020-04-03	2020-10-16	限售股	20.52	43.70	9,201	188,804.52	402,083.70	-
688277	天智航	2020-06-24	2020-07-07	新股未上市	12.04	12.04	8,810	106,072.40	106,072.40	-
68836	光云	2020-	2020-	限售股	10.8	43.22	8,249	89,089.	356,521	-

5	科技	04-22	10-29		0			20	.78	
688377	迪威尔	2020-06-29	2020-07-08	新股未上市	16.42	16.42	7,894	129,619.48	129,619.48	-
688520	神州细胞	2020-06-11	2020-12-22	限售股	25.64	58.82	12,351	316,679.64	726,485.82	-
688528	秦川物联	2020-06-19	2020-07-01	新股未上市	11.33	11.33	8,337	94,458.21	94,458.21	-
688600	皖仪科技	2020-06-23	2020-07-03	新股未上市	15.50	15.50	5,468	84,754.00	84,754.00	-

注：基金可作为特定投资者，参与上市公司非公开发行股份认购，交易所主板、创业板、科创板新股申购，通过大宗交易或其他符合法律法规的交易方式取得带限售期的股票等业务，并根据各项法律法规的要求进行锁定。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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

本基金是一只混合型基金，其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。本基金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（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、港股通标的股票、债券（含国债、央行票据、金融债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、企业债券、公司债券、可转换债券（含可分离交易可转换债券的纯债部分）、可交换公司债券、公开发行的次级债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、货币市场工具、债券回购、同业存单、银行存款（含协议存款、定期存款及其他银行存款）、股指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。基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金可投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，在严格控制风险的前提下，坚持价值投资的基本理念，充分发挥专业研究与管理能力，力争为投资者提供长期稳健的投资回报。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立合规审核及风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；

在业务操作层面风险管理职责主要由风险管理部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。风险管理部对公司总经理负责。督察长独立行使督察权利，直接对董事会负责，就内部控制制度和执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能，定期和不定期地向董事会报告公司内部控制执行情况。

本基金的基金管理人建立了以合规审核及风险管理委员会为核心的，由督察长、风险控制委员会、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国农业银行，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险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。

于 2020 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

注：流动性受限资产、7 个工作日可变现资产的计算口径见《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》第四十条。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》且于基金开放期内按照《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%,且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。于开放期内,本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%,本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

于开放期内,本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算,确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时,本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度;按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理,以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外,本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度:根据质押品的资质确定质押率水平;持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额;并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时,可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施,本基金在本报告期内流动性情况良好。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金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

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及买入返售金融资产等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020年6月30日	1年以内	1至5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	347,001,317.70	-	-	-	347,001,317.70
结算备付金	82,908,751.37	-	-	-	82,908,751.37
存出保证金	903,006.56	-	-	-	903,006.56
交易性金融资产	-	-	-	3,370,918,179.13	3,370,918,179.13
买入返售金融资产	1,400,000,000.00	-	-	-	1,400,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	74,348,718.99	74,348,718.99
应收利息	-	-	-	212,755.11	212,755.11
应收股利	-	-	-	1,890,524.00	1,890,524.00
资产总计	1,830,813,075.63	-	-	3,447,370,177.23	5,278,183,252.86
负债					
应付证券清算款	-	-	-	31,030,695.44	31,030,695.44
应付管理人报酬	-	-	-	6,311,960.81	6,311,960.81
应付托管费	-	-	-	1,051,993.47	1,051,993.47
应付交易费用	-	-	-	1,954,669.94	1,954,669.94
应交税费	-	-	-	90,289.82	90,289.82

其他负债	-	-	-	95,993.02	95,993.02
负债总计	-	-	-	40,535,602.50	40,535,602.50
利率敏感度缺口	1,830,813,075.63	-	-	3,406,834,574.73	5,237,647,650.36

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	201,607,799.55	-	201,607,799.55
资产合计	-	201,607,799.55	-	201,607,799.55
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	201,607,799.55	-	201,607,799.55

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇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：人民币万元）
		本期末 2020 年 6 月 30 日
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	增加约 1,008
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	减少约 1,008

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的其他价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。基金的投资组合比例为：本基金封闭期结束，转为开放式运作后，股票投资占基金资产的比例为 50%-95%（其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0%-50%）；封闭期内，股票投资占基金资产的比例为 50%-100%（其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0%-50%）；但本基金封闭期结束前三个月至转开放式运作后三个月内，基金投资不受前述下限比例限制。本基金封闭期结束，转为开放式运作后，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，本基金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基金资产净值的 5%；在封闭期内，本基金不受前述 5% 的限制，但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，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日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对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地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 2020 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)

交易性金融资产—股票投资	3,370,918,179.13	64.36
交易性金融资产—基金投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
合计	3,370,918,179.13	64.36

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2020 年 6 月 30 日，由于本基金运行期间不足一年，尚不存在足够的经验数据，因此无法对本基金资产净值对于其他价格风险的敏感性作定量分析。

§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	3,370,918,179.13	63.87
	其中：股票	3,370,918,179.13	63.87
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	1,400,000,000.00	26.52
	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	429,910,069.07	8.15
8	其他各项资产	77,355,004.66	1.47
9	合计	5,278,183,252.86	100.00

7.2 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	占基金资产净值
----	------	------	---------

			比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	90,266,689.82	1.72
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,473,138,946.91	28.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	72,165,015.09	1.38
E	建筑业	11,387,568.00	0.22
F	批发和零售业	88,993,610.66	1.70
G	交通运输、仓储和邮政业	225,264,868.71	4.30
H	住宿和餐饮业	40,799,187.75	0.78
I	信息传输、软件和信息技术服务业	357,799,854.98	6.83
J	金融业	264,124,014.64	5.04
K	房地产业	323,993,962.84	6.19
L	租赁和商务服务业	112,164,222.46	2.14
M	科学研究和技术服务业	13,282,083.70	0.25
N	水利、环境和公共设施管理业	12,830,136.62	0.24
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	30,196,155.00	0.58
R	文化、体育和娱乐业	52,904,062.40	1.01
S	综合	-	-
	合计	3,169,310,379.58	60.51

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
金融	102,001,844.36	1.95
医疗保健	33,431,904.00	0.64
非日常生活消费品	30,289,560.79	0.58
公用事业	29,239,214.40	0.56
工业	6,645,276.00	0.13

合计	201,607,799.55	3.85
----	----------------	------

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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	占基金资产净值比例（%）
1	600383	金地集团	11,678,934	160,001,395.80	3.05
2	600690	海尔智家	7,289,647	129,026,751.90	2.46
3	002439	启明星辰	3,015,832	126,876,052.24	2.42
4	601166	兴业银行	6,366,600	100,464,948.00	1.92
5	603195	公牛集团	616,659	99,066,268.35	1.89
6	600048	保利地产	6,673,400	98,632,852.00	1.88
7	600967	内蒙一机	8,020,731	83,335,395.09	1.59
8	300034	钢研高纳	4,380,705	82,182,025.80	1.57
9	002841	视源股份	835,955	81,274,241.60	1.55
10	002050	三花智控	3,693,297	80,883,204.30	1.54
11	603517	绝味食品	1,132,100	80,084,754.00	1.53
12	300259	新天科技	13,603,381	78,627,542.18	1.50
13	002027	分众传媒	14,114,400	78,617,208.00	1.50
14	002352	顺丰控股	1,418,000	77,564,600.00	1.48
15	300014	亿纬锂能	1,597,943	76,461,572.55	1.46
16	300036	超图软件	2,994,820	75,409,567.60	1.44
17	002928	华夏航空	4,827,557	72,654,732.85	1.39
18	000860	顺鑫农业	1,209,724	68,930,073.52	1.32

19	600038	中直股份	1,636,861	67,225,881.27	1.28
20	000656	金科股份	8,009,769	65,359,715.04	1.25
21	300188	美亚柏科	2,823,262	55,985,285.46	1.07
22	600862	中航高科	3,307,800	55,967,976.00	1.07
23	600036	招商银行	1,597,252	53,859,337.44	1.03
24	300413	芒果超媒	811,412	52,904,062.40	1.01
25	02601.HK	中国太保	2,761,800	52,220,688.85	1.00
26	688188	柏楚电子	319,568	52,121,540.80	1.00
27	603368	柳药股份	2,258,857	51,840,768.15	0.99
28	300059	东方财富	2,545,000	51,409,000.00	0.98
29	002648	卫星石化	3,149,697	51,245,570.19	0.98
30	600131	国网信通	2,699,850	51,216,154.50	0.98
31	000998	隆平高科	2,999,686	49,944,771.90	0.95
32	06030.HK	中信证券	3,717,500	49,781,155.51	0.95
33	002475	立讯精密	968,698	49,742,642.30	0.95
34	002120	韵达股份	1,690,212	41,325,683.40	0.79
35	603308	应流股份	2,019,900	41,205,960.00	0.79
36	600754	锦江酒店	1,470,241	40,799,187.75	0.78
37	300087	荃银高科	3,036,289	40,321,917.92	0.77
38	600803	新奥股份	3,699,963	38,257,617.42	0.73
39	002230	科大讯飞	999,971	37,428,914.53	0.71
40	601116	三江购物	2,599,919	37,152,842.51	0.71
41	601688	华泰证券	1,936,209	36,400,729.20	0.69
42	002930	宏川智慧	2,396,578	33,719,852.46	0.64
43	01093.HK	石药集团	2,500,000	33,431,904.00	0.64
44	002311	海大集团	690,854	32,877,741.86	0.63

45	300724	捷佳伟创	343,400	30,401,202.00	0.58
46	02238.HK	广汽集团	5,932,000	30,289,560.79	0.58
47	002044	美年健康	2,095,500	30,196,155.00	0.58
48	300463	迈克生物	509,998	29,697,183.54	0.57
49	00902.HK	华能国际电力股份	11,000,000	29,239,214.40	0.56
50	600104	上汽集团	1,686,834	28,659,309.66	0.55
51	600887	伊利股份	919,066	28,610,524.58	0.55
52	300662	科锐国际	573,900	25,538,550.00	0.49
53	603700	宁水集团	749,860	22,285,839.20	0.43
54	601009	南京银行	3,000,000	21,990,000.00	0.42
55	688169	石头科技	57,000	21,483,300.00	0.41
56	600461	洪城水业	3,286,671	20,936,094.27	0.40
57	600176	中国巨石	2,207,400	20,197,710.00	0.39
58	600885	宏发股份	499,886	20,055,426.32	0.38
59	300450	先导智能	329,795	15,239,826.95	0.29
60	002216	三全食品	599,986	14,339,665.40	0.27
61	000651	格力电器	250,000	14,142,500.00	0.27
62	002949	华阳国际	800,000	12,880,000.00	0.25
63	603359	东珠生态	766,894	12,830,136.62	0.24
64	002081	金螳螂	1,448,800	11,387,568.00	0.22
65	000100	TCL 科技	1,797,100	11,142,020.00	0.21
66	002507	涪陵榨菜	300,000	10,803,000.00	0.21
67	002555	三七互娱	200,000	9,360,000.00	0.18
68	002878	元隆雅图	364,956	7,985,237.28	0.15
69	600273	嘉化能源	910,000	7,953,400.00	0.15

70	00694.HK	北京首都机场股份	1,500,000	6,645,276.00	0.13
71	688520	神州细胞	12,351	726,485.82	0.01
72	688222	成都先导	9,201	402,083.70	0.01
73	688558	国盛智科	8,488	376,018.40	0.01
74	688365	光云科技	8,249	356,521.78	0.01
75	688004	博汇科技	2,500	249,875.00	0.00
76	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.00
77	603087	甘李药业	1,076	107,922.80	0.00
78	688277	天智航	8,810	106,072.40	0.00
79	688528	秦川物联	8,337	94,458.21	0.00
80	688600	皖仪科技	5,468	84,754.00	0.00
81	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.00
82	605166	聚合顺	1,641	26,009.85	0.00
83	603682	锦和商业	2,018	23,227.18	0.00
84	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
85	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
86	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
87	300847	中船汉光	1,420	9,854.80	0.00
88	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
89	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
90	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
91	300846	首都在线	1,131	3,811.47	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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600383	金地集团	157,963,173.32	3.02
2	002439	启明星辰	119,276,874.76	2.28
3	600690	海尔智家	112,005,710.25	2.14
4	601166	兴业银行	105,278,283.52	2.01
5	600048	保利地产	105,024,339.20	2.01
6	603195	公牛集团	95,424,112.11	1.82
7	002648	卫星石化	87,837,338.76	1.68
8	600967	内蒙一机	84,961,645.85	1.62
9	000998	隆平高科	84,304,716.87	1.61
10	600036	招商银行	80,754,875.52	1.54
11	600038	中直股份	78,623,597.85	1.50
12	300259	新天科技	76,019,671.20	1.45
13	300724	捷佳伟创	73,768,638.00	1.41
14	300034	钢研高纳	73,230,632.99	1.40
15	000860	顺鑫农业	72,374,071.84	1.38
16	300036	超图软件	71,086,170.36	1.36
17	002841	视源股份	70,854,029.75	1.35
18	002352	顺丰控股	69,884,553.93	1.33
19	002027	分众传媒	69,167,961.70	1.32
20	02601.HK	中国太保	65,448,738.94	1.25

注：“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	300724	捷佳伟创	64,324,495.16	1.23
2	603882	金城医学	63,794,339.97	1.22
3	603338	浙江鼎力	61,224,976.70	1.17
4	601058	赛轮轮胎	41,724,017.30	0.80
5	600009	上海机场	41,658,228.13	0.80
6	603259	药明康德	34,556,755.00	0.66
7	601238	广汽集团	34,097,837.01	0.65
8	600529	山东药玻	32,806,157.40	0.63
9	300118	东方日升	30,562,528.00	0.58
10	600598	北大荒	30,195,202.44	0.58
11	000998	隆平高科	29,365,340.14	0.56
12	002648	卫星石化	27,809,105.04	0.53
13	600036	招商银行	26,676,524.37	0.51
14	000725	京东方 A	24,897,674.00	0.48
15	002083	孚日股份	24,486,658.05	0.47
16	002081	金螳螂	23,711,457.28	0.45
17	002600	领益智造	23,344,396.00	0.45
18	300271	华宇软件	23,054,314.07	0.44
19	002756	永兴材料	21,898,777.32	0.42
20	002475	立讯精密	21,248,693.19	0.41

注：“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	4,066,907,447.44
卖出股票的收入（成交）总额	1,008,945,012.85

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

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

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

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股指期货交易情况说明

代码	名称	持仓量	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计(元)					-
股指期货投资本期收益(元)					-6,271,590.00
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

7.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

7.12.3 其他资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	903,006.56
2	应收证券清算款	74,348,718.99
3	应收股利	1,890,524.00
4	应收利息	212,755.11
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	77,355,004.66

7.12.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002841	视源股份	27,936,000.00	0.53	限售股

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，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
53,800	91,930.21	3,467,430.93	0.07%	4,942,377,792.25	99.93%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例(%)
1	深圳市大众工程管理有限公司	789,622.00	11.79%
2	赵浦	311,407.00	4.65%
3	冯星	296,108.00	4.42%
4	张丽军	296,108.00	4.42%
5	鲍卫东	256,626.00	3.83%
6	张娥妹	246,756.00	3.69%
7	袁亚男	227,016.00	3.39%
8	龙玉琪	197,404.00	2.95%
9	何邵聪	197,404.00	2.95%
10	苏昕光	197,404.00	2.95%
11	曹桂花	197,404.00	2.95%
12	梁敏洁	197,403.00	2.95%

注：持有人为场内持有人。

8.3 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	549,637.74	0.01%

8.4 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的情况

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020 年 2 月 21 日）基金份额总额	4,945,845,223.18
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	4,945,845,223.18

注：本基金合同生效后，前三年封闭运作，在封闭期内，本基金不办理申购、赎回业务，但投资人可在本基金上市交易后通过上海证券交易所转让基金份额，也可以办理将已持有基金份额的转托管业务。本报告期内基金总赎回份额含跨系统转托管导致强制赎回的份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

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

1、基金管理人的重大人事变动：本报告期内，本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

2、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动：本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及本基金管理人、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

本基金本报告期内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

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)为本基金提供审计服务。

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

1、管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金管理人及其高级管理人员本报告期内未受监管部门稽查或处罚。

2、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金托管人及其高级管理人员本报告期内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	3	801,341,187.68	15.81%	746,657.12	15.95%	-

交银施罗德瑞思三年封闭运作混合型证券投资基金 2020 年中期报告

券有限公司						
东北证券股份有限公司	2	771,100,344.53	15.21%	718,127.46	15.34%	-
中国国际金融股份有限公司	2	603,218,928.40	11.90%	521,335.88	11.14%	-
兴业证券股份有限公司	1	602,001,856.95	11.87%	560,640.66	11.97%	-
安信证券股份有限公司	2	54,165,416.48	1.07%	50,445.28	1.08%	-
天风证券股份有限公司	1	539,916,522.30	10.65%	502,825.28	10.74%	-
国金证券股份有限公司	2	537,549,833.99	10.60%	500,618.33	10.69%	-
中信证券股份有限公司	1	452,287,529.50	8.92%	421,217.14	9.00%	-
国泰君安证券股份有限公司	1	325,003,760.50	6.41%	302,673.76	6.46%	-
中泰证券股份有限公司	1	198,459,530.30	3.91%	184,825.85	3.95%	-
光大证券股份有限公司	2	185,126,480.63	3.65%	172,407.40	3.68%	-
海通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中银国际证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国海证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限	1	-	-	-	-	-

公司						
英大证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证 券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-

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		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	17,691,977 .52	100.00%	1,900,00 0,000.00	6.93%	-	-
东北证券股 份有限公司	-	-	1,500,00 0,000.00	5.47%	-	-
中国国际金 融股份有限 公司	-	-	3,000,00 0,000.00	10.95%	-	-
兴业证券股 份有限公司	-	-	5,000,00 0,000.00	18.25%	-	-
安信证券股 份有限公司	-	-	400,000, 000.00	1.46%	-	-
国金证券股 份有限公司	-	-	2,000,00 0,000.00	7.30%	-	-
国泰君安证 券股份有限 公司	-	-	6,100,00 0,000.00	22.26%	-	-
中泰证券股 份有限公司	-	-	7,500,00 0,000.00	27.37%	-	-

注：1、报告期内，本基金以上交易单元均为新增交易单元；

2、租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：券商基本面评价（财务状况、经营状况）、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）、券商每日信息评价（及时性和有效性）和券商协作表现评价等四个方面；

3、租用证券公司交易单元的程序：首先根据租用证券公司交易单元的选择标准进

行综合评价，然后根据评价选择基金交易单元。研究部提交方案，并上报公司批准。

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	交银施罗德瑞思三年封闭运作混合型证券投资基金招募说明书	公司网站	2020-01-14
2	交银施罗德瑞思三年封闭运作混合型证券投资基金托管协议	公司网站	2020-01-14
3	交银施罗德瑞思三年封闭运作混合型证券投资基金基金合同摘要	公司网站	2020-01-14
4	交银施罗德瑞思三年封闭运作混合型证券投资基金基金合同	公司网站	2020-01-14
5	交银施罗德瑞思三年封闭运作混合型证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	中国证券报、公司网站	2020-01-14
6	交银施罗德瑞思三年封闭运作混合型证券投资基金基金份额发售公告	中国证券报、公司网站	2020-01-14
7	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德瑞思三年封闭运作混合型证券投资基金调整募集期限的公告	中国证券报、公司网站	2020-02-05
8	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德瑞思三年封闭运作混合型证券投资基金提前结束募集的公告	中国证券报、公司网站	2020-02-17
9	交银施罗德基金管理有限公司关于增加交银施罗德瑞思三年封闭运作混合型证券投资基金场外销售机构的公告	中国证券报、公司网站	2020-02-17
10	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德瑞思三年封闭运作混合型证券投资基金进行比例配售暨公布认购申请确认比例结果的公告	中国证券报、公司网站	2020-02-18
11	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德瑞思三年封闭运作混合型证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报、公司网站	2020-02-22
12	交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2020-02-29
13	交银施罗德基金管理有限公司关于终止泰诚财富基金销售（大连）有限公司办理相关销售业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2020-03-21
14	交银施罗德基金管理有限公司关于暂停部分销售机构办理相关销售业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2020-04-13

§11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予交银施罗德瑞思三年封闭运作混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《交银施罗德瑞思三年封闭运作混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《交银施罗德瑞思三年封闭运作混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《交银施罗德瑞思三年封闭运作混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、关于申请募集注册交银施罗德瑞思三年封闭运作混合型证券投资基金的法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、报告期内交银施罗德瑞思三年封闭运作混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

11.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

11.3 查阅方式

投资者可在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅备查文件，或者登录基金管理人的网站(www.fund001.com)查阅。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人交银施罗德基金管理有限公司。本公司客户服务中心电话：400-700-5000（免长途话费），021-61055000，电子邮件：services@jysld.com。