交银施罗德成长30混合型证券投资基金
2021年中期报告

2021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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2021年8月30日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年08月27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2021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 6
3.3 其他指标 8

§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遵规守信情况的说明 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遵规守信情况声明 11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 12
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 半年度财务会计报告（未经审计） 12

6.1 资产负债表 12
6.2 利润表 13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 14
6.4 报表附注 16

§7 投资组合报告 49

7.1 期末基金资产组合情况 49
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 50
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 51
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 53
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 53

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..... 53
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..... 53
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..... 53
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明..... 54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... 54
7.12 投资组合报告附注..... 54

§8 基金份额持有人信息..... 55

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... 55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... 55
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..... 55

§9 开放式基金份额变动..... 55

§10 重大事件揭示..... 56

10.1 基金份额持有人大会决议..... 56
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..... 56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... 56
10.4 基金投资策略的改变..... 56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... 56
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..... 57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... 57
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..... 61
12.3 查阅方式..... 61

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	交银施罗德成长30混合型证券投资基金
基金简称	交银成长30混合
基金主代码	519727
前端交易代码	519727
后端交易代码	519728
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年6月5日
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	670,193,944.04份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金属于成长型混合型基金，主要通过投资于不超过30只精选的成长型上市公司股票，在适度控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下，为基金份额持有人谋求长期、稳定的资本增值。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势，将严谨、规范化的选股方法与积极主动的投资风格相结合，在分析和判断宏观经济运行和行业景气变化以及上市公司成长潜力的基础上，精选业务聚焦型、在所属行业内数一数二的成长型上市公司股票，并通过持有不超过30只股票的集中持股策略，为基金资产谋求长期稳健增值。
业绩比较基准	75%×富时中国A600成长指数收益率+25%×中证综合债券指数收益率
风险收益特征	本基金是一只混合型基金，以成长型股票为主要投资对象，其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。属于承担较高风险、预期收益较高的证券投资基金品种。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王晚婷	李申
	联系电话	（021）61055050	021-60637102
	电子邮箱	xxpl@jysld.com,disclosure@jysld.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400-700-5000，021-61055000	021-60637111
传真		（021）61055054	021-60635778
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）	北京市西城区金融大街25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	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

邮政编码	200120	100033
法定代表人	阮红	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
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(2021年1月1日-2021年6月30日)
本期已实现收益	441,251,056.64
本期利润	45,220,371.35
加权平均基金份额本期利润	0.0592
本期加权平均净值利润率	2.29%
本期基金份额净值增长率	2.50%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	858,718,292.86
期末可供分配基金份额利润	1.2813
期末基金资产净值	1,782,673,460.76
期末基金份额净值	2.660
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	279.82%

注：1、上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，计入费用后的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。

3.2 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	份额净值增长率标	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①－③	②－④

	率①	准差②		④		
过去一个月	2.50%	0.81%	0.48%	0.80%	2.02%	0.01%
过去三个月	9.37%	1.08%	8.48%	0.92%	0.89%	0.16%
过去六个月	2.50%	1.83%	5.32%	1.24%	-2.82%	0.59%
过去一年	39.41%	1.76%	26.95%	1.16%	12.46%	0.60%
过去三年	206.10%	1.73%	59.69%	1.14%	146.41%	0.59%
自基金合同生效起至今	279.82%	1.68%	84.36%	1.19%	195.46%	0.49%

注：1、本基金业绩比较基准自2015年10月1日起，由“75%×富时中国A600成长指数收益率+25%×中信标普全债指数收益率”变更为“75%×富时中国A600成长指数收益率+25%×中证综合债券指数收益率”，3.2.2同。详情见本基金管理人于2015年9月28日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金业绩比较基准变更并修改基金合同相关内容的公告》。

2、本基金的业绩比较基准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

注：本基金建仓期为自基金合同生效日起的 6 个月。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

3.3 其他指标

无。

§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，注册资本金为 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 100 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		
郭斐	交银成长30混合、交银经济新动力混合、交银创新领航混合的基金经理	2017年9月26日	-	12年	郭斐先生，复旦大学经济学本科。2009年8月至2014年3月于高盛（亚洲）有限责任公司、高华证券公司任职。2014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。

4.1.3 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

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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私募资产管理计划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“价格优先、时间优先”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，遵循公平交易分配原则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

2021年上半年，在经济数据维持高位、利率下行、海外波澜不惊的背景下，A股市场的情绪周期大起大落，行业涨跌演绎极致分化。在经济见顶回落的预期下，越来越多的总量敏感型公司的走势大有被踢出“茅指数”之势，市场的交易宽度越来越窄，少数仍有高成长预期的赛道大受追捧，中小盘从被抛弃到卷土重来。

报告期内，本基金重点配置了新能源汽车、基础材料器件、军工元件、消费建材、外需景气以及内需升级等领域的个股。

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2021年下半年，我们仍然认为，以PMI为代表的经济领先指标的走弱意味着2021年大概率不会继续成为大部分所谓“核心资产”的牛市。尽管我们无法精确预判流动性的方向，但我们相信强劲的盈利增长前景是能够抵抗估值向均值回归的地心引力的有力武器。中短期盈利的强劲、估值的合理可接受以及长期盈利模式的稳健，似乎是投资的不可能三角，我们在全力寻找沧海遗珠的同时，今年对前两者有着更高的要求。在4G/5G代际之交、新能源革命已然启动、数据经济/企业数字化转型加速到来的当下，我们预计科技成长仍将是未来相当长一段时间内市场的主

线。同时，跳出科技成长的狭隘边界，以更包容的视野，我们可以看到，在国民经济的各个产业，强者恒强的产业集中度提升、追求效率的工业化规模化转型、庞大内需支撑下的国产配套崛起共同催生了更多传统领域成长股的投资机遇。尽管我们没有全力去拥抱“不能被时代所改变”的资产，但我们相信那些致力于“改变时代”的优秀企业以及勤勉尽责不负这个时代的企业家终将创造更为丰厚的价值和回报。本基金将持续挖掘行业成长空间广阔、具备核心竞争力的公司，把握合适的配置窗口，力争为投资人获得持续稳定的超额回报。

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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行

为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

报告期内，未实施利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：交银施罗德成长30混合型证券投资基金

报告截止日：2021年6月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	473,348,624.83	130,055,097.83
结算备付金		903,154.18	1,782,220.78
存出保证金		375,206.72	542,879.23
交易性金融资产	6.4.7.2	1,326,731,283.53	2,119,894,239.75
其中：股票投资		1,320,148,676.37	2,119,894,239.75
基金投资		-	-
债券投资		6,582,607.16	-
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	-	-
应收证券清算款		3,554,860.58	12,165,396.19
应收利息	6.4.7.5	52,410.08	15,928.90
应收股利		-	-
应收申购款		1,946,924.64	3,618,264.45
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,806,912,464.56	2,268,074,027.13

负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		20,420,426.82	23,757,087.36
应付管理人报酬		2,235,207.82	2,755,797.97
应付托管费		372,534.63	459,299.64
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,036,307.88	1,282,452.90
应交税费		27.49	1.72
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	174,499.16	299,116.59
负债合计		24,239,003.80	28,553,756.18
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	670,193,944.04	863,041,715.70
未分配利润	6.4.7.10	1,112,479,516.72	1,376,478,555.25
所有者权益合计		1,782,673,460.76	2,239,520,270.95
负债和所有者权益总计		1,806,912,464.56	2,268,074,027.13

注： 报告截止日2021年06月30日，基金份额净值2.660元，基金份额总额670,193,944.04份。

6.2 利润表

会计主体：交银施罗德成长30混合型证券投资基金

本报告期：2021年1月1日至2021年6月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
一、收入		65,831,637.77	352,217,077.88
1.利息收入		602,150.17	2,154,754.55
其中：存款利息收入	6.4.7.11	600,593.87	2,127,467.94
债券利息收入		1,556.30	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	27,286.61

证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		460,074,357.82	203,809,683.91
其中：股票投资收益	6.4.7.12	454,971,477.45	180,215,164.94
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	280,923.39	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	4,821,956.98	23,594,518.97
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-396,030,685.29	141,673,126.69
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	1,185,815.07	4,579,512.73
减：二、费用		20,611,266.42	27,278,273.37
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	14,744,695.01	18,337,246.20
2．托管费	6.4.10.2.2	2,457,449.18	3,056,207.71
3．销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4．交易费用	6.4.7.19	3,288,142.69	5,744,328.89
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．税金及附加		5.64	98.23
7．其他费用	6.4.7.20	120,973.90	140,392.34
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		45,220,371.35	324,938,804.51
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		45,220,371.35	324,938,804.51

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：交银施罗德成长30混合型证券投资基金

本报告期：2021年1月1日至2021年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021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	863,041,715.70	1,376,478,555.25	2,239,520,270.95

权益（基金净值）			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	45,220,371.35	45,220,371.35
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）	-192,847,771.66	-309,219,409.88	-502,067,181.54
其中：1.基金申购款	233,930,068.64	378,753,360.92	612,683,429.56
2.基金赎回款	-426,777,840.30	-687,972,770.80	-1,114,750,611.10
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）	670,193,944.04	1,112,479,516.72	1,782,673,460.76
项目	上年度可比期间 2020年1月1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）	1,626,881,734.22	991,140,588.79	2,618,022,323.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	324,938,804.51	324,938,804.51
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）	-536,005,907.23	-325,735,659.66	-861,741,566.89
其中：1.基金申购款	1,375,584,029.31	1,051,778,574.33	2,427,362,603.64
2.基金赎回款	-1,911,589,936.54	-1,377,514,233.99	-3,289,104,170.53
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）	1,090,875,826.99	990,343,733.64	2,081,219,560.63

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：

谢卫	夏华龙	单江
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

交银施罗德成长30混合型证券投资基金(原名为交银施罗德成长30股票型证券投资基金，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[2013]255号《关于核准交银施罗德成长30股票型证券投资基金募集的批复》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《交银施罗德成长30股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，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2,023,994,078.02元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2013)第299号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《交银施罗德成长30股票型证券投资基金基金合同》于2013年6月5日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为2,024,955,437.39份基金份额，其中认购资金利息折合961,359.37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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据2014年中国证监会令第104号《公开募集证券投资基金运作管理办法》及基金管理人于2015年8月5日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金变更基金类别及修改基金名称并相应修改基金合同和托管协议的公告》，交银施罗德成长30股票型证券投资基金自2015年8月8日起更名为交银施罗德成长30混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德成长30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、存托凭证)、债券、中期票据、货币市场工具、权证、资产支持证券、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(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例为：股票资产(含存托凭证)占基金资产的60%-95%，其中投资于经过严格品质筛选、成长质量优良的成长型股票的资产比例不低于

股票资产的80%；其余资产投资于债券、中期票据、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种；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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。自基金合同生效日至2015年9月30日，本基金的业绩比较基准为：75%×富时中国A600成长指数收益率+25%×中信标普全债指数收益率。根据本基金的基金管理人于2015年9月28日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金业绩比较基准变更并修改基金合同相关内容的公告》，自2015年10月1日起，本基金的业绩比较基准变更为：75%×富时中国A600成长指数收益率+25%×中证综合债券指数收益率。

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》、《交银施罗德成长30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。

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

本基金2021年上半年度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2021年06月30日的财务状况以及2021年上半年度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。

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[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]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。

(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。

(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 2021年6月30日
活期存款	473,348,624.83
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	473,348,624.83

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021年6月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		971,747,474.04	1,320,148,676.37	348,401,202.33
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	4,910,000.00	6,582,607.16	1,672,607.16
	银行间市场	-	-	-
	合计	4,910,000.00	6,582,607.16	1,672,607.16
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		976,657,474.04	1,326,731,283.53	350,073,809.49

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

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

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	50,899.16

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	406.40
应收债券利息	934.14
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	1.48
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	168.90
合计	52,410.08

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,036,307.88
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,036,307.88

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	70,979.61

应付证券出借违约金	-
预提审计费	34,712.18
预提信息披露费	59,507.37
预提账户维护费	9,300.00
合计	174,499.16

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	863,041,715.70	863,041,715.70
本期申购	233,930,068.64	233,930,068.64
本期赎回（以“-”号填列）	-426,777,840.30	-426,777,840.30
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	670,193,944.04	670,193,944.04

注：1、如果本报告期间发生红利再投、转换入业务，则总申购份额中包含该业务；

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

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
上年度末	598,227,930.85	778,250,624.40	1,376,478,555.25
本期利润	441,251,056.64	-396,030,685.29	45,220,371.35
本期基金份额交易产生的变动数	-180,760,694.63	-128,458,715.25	-309,219,409.88
其中：基金申购款	197,848,961.02	180,904,399.90	378,753,360.92
基金赎回款	-378,609,655.65	-309,363,115.15	-687,972,770.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	858,718,292.86	253,761,223.86	1,112,479,516.72

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	590,685.91
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	6,414.67
其他	3,493.29
合计	600,593.87

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	454,971,477.45
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	454,971,477.45

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	1,369,169,539.43

减：卖出股票成本总额	914,198,061.98
买卖股票差价收入	454,971,477.45

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	280,923.39
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	280,923.39

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,871,592.50
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,590,000.00
减：应收利息总额	669.11
买卖债券差价收入	280,923.39

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	4,821,956.98
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	4,821,956.98

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日

1.交易性金融资产	-396,030,685.29
股票投资	-397,703,292.45
债券投资	1,672,607.16
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2.衍生工具	-
权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-396,030,685.29

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	1,119,882.18
基金转换费收入	65,932.89
合计	1,185,815.07

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的25%归入基金资产。

2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的不低于赎回费的25%归入转出基金的基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	3,288,142.69
银行间市场交易费用	-
合计	3,288,142.69

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	34,712.18
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	8,154.35
债券账户费用	18,600.00
合计	120,973.90

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
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金销售机构
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	基金管理人的股东、基金销售机构
施罗德投资管理有限公司	基金管理人的股东
中国国际海运集装箱(集团)股份有限公司	基金管理人的股东
交银施罗德资产管理有限公司	基金管理人的子公司
上海直源投资管理有限公司	受基金管理人控制的公司

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。

本报告期实际与基金发生关联交易的关联方及关联交易具体情况请见下述内容。

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

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

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 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	14,744,695.01	18,337,246.20
其中：支付销售机构的客户维护费	5,426,110.61	6,345,783.45

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 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,457,449.18	3,056,207.71

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行_活期存款	473,348,624.83	590,685.91	151,782,178.74	2,094,669.59

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。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

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

无。

6.4.12 期末(2021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

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

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：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
127038	国微转债	2021年6月10日	2021年7月14日	老股东配债	100.00	100.00	1,155	115,500.00	115,500.00	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

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，以成长型股票为主要投资对象，其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。属于承担较高风险、预期收益较高的证券投资基金品种。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（含存托凭证）、

债券、货币市场工具、权证、资产支持证券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种。本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，并保持基金资产良好的流动性的前提下，为基金份额持有人谋求长期、稳定的资本增值。

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人中国建设银行，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2021年6月30日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为0.37%（2020年12月31日：无）。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

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一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于2021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，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，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》及《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公司发行的证券不得超过该证券的10%。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%。

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、存出保证金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021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	473,348,624.83	-	-	-	473,348,624.83
结算备付金	903,154.18	-	-	-	903,154.18

存出保证金	375,206.72	-	-	-	375,206.72
交易性金融资产	-	-	6,582,607.16	1,320,148,676.37	1,326,731,283.53
应收利息	-	-	-	52,410.08	52,410.08
应收申购款	2,047.53	-	-	1,944,877.11	1,946,924.64
应收证券清算款	-	-	-	3,554,860.58	3,554,860.58
资产总计	474,629,033.26	-	6,582,607.16	1,325,700,824.14	1,806,912,464.56
负债					
应付赎回款	-	-	-	20,420,426.82	20,420,426.82
应付管理人报酬	-	-	-	2,235,207.82	2,235,207.82
应付托管费	-	-	-	372,534.63	372,534.63
应付交易费用	-	-	-	1,036,307.88	1,036,307.88
应交税费	-	-	-	27.49	27.49
其他负债	-	-	-	174,499.16	174,499.16
负债总计	-	-	-	24,239,003.80	24,239,003.80
利率敏感度缺口	474,629,033.26	-	6,582,607.16	1,301,461,820.34	1,782,673,460.76
上年度末 2020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	130,055,097.83	-	-	-	130,055,097.83
结算备付金	1,782,220.78	-	-	-	1,782,220.78
存出保证金	542,879.23	-	-	-	542,879.23
交易性金融资产	-	-	-	2,119,894,239.75	2,119,894,239.75
应收证券清算款	-	-	-	12,165,396.19	12,165,396.19
应收利息	-	-	-	15,928.90	15,928.90
应收申购款	15,342.10	-	-	3,602,922.35	3,618,264.45
资产总计	132,395,539.94	-	-	2,135,678,487.19	2,268,074,027.13
负债					
应付赎回款	-	-	-	23,757,087.36	23,757,087.36
应付管理人报酬	-	-	-	2,755,797.97	2,755,797.97
应付托管费	-	-	-	459,299.64	459,299.64
应付交易费用	-	-	-	1,282,452.90	1,282,452.90
应交税费	-	-	-	1.72	1.72
其他负债	-	-	-	299,116.59	299,116.59
负债总计	-	-	-	28,553,756.18	28,553,756.18
利率敏感度缺口	132,395,539.94	-	-	2,107,124,731.01	2,239,520,270.95

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

注：于2021年6月30日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为0.37%(2020年12月31日：无)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2020年12月31日：同)。

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。本基金投资组合中股票资产（含存托凭证）占基金资产的60%-95%，其中投资于经过严格品质筛选、成长质量优良的成长型股票的资产比例不低于股票资产的80%；债券、中期票据、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的5%-40%；其中基金持有的权证不超过基金资产净值的3%，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%，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 2021年6月30日		上年度末 2020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	1,320,148,676.37	74.05	2,119,894,239.75	94.66
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-

交易性金融资产－债券投资	6,582,607.16	0.37	-	-
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	1,326,731,283.53	74.42	2,119,894,239.75	94.66

注：债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准（附注6.4.1）以外的其他市场变量保持不变		
	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（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
分析	1.业绩比较基准（附注6.4.1）上涨5%	118,723,946.34	154,569,065.82
	2.业绩比较基准（附注6.4.1）下降5%	-118,723,946.34	-154,569,065.82

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§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	1,320,148,676.37	73.06
	其中：股票	1,320,148,676.37	73.06
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	6,582,607.16	0.36
	其中：债券	6,582,607.16	0.36
	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	-	-
	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	474,251,779.01	26.25
8	其他各项资产	5,929,402.02	0.33
9	合计	1,806,912,464.56	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,148,492,862.54	64.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	50,382,085.27	2.83
J	金融业	26,068,836.96	1.46
K	房地产业	65,519,625.60	3.68
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	29,685,266.00	1.67
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,320,148,676.37	74.05

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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	002444	巨星科技	4,884,275	166,456,092.00	9.34
2	002271	东方雨虹	2,449,025	135,480,063.00	7.60
3	300408	三环集团	3,087,404	130,967,677.68	7.35
4	002050	三花智控	4,273,715	102,483,685.70	5.75
5	000733	振华科技	1,435,570	87,670,259.90	4.92
6	603799	华友钴业	747,591	85,374,892.20	4.79
7	002179	中航光电	944,260	74,615,425.20	4.19
8	002493	荣盛石化	4,189,800	72,357,846.00	4.06
9	601155	新城控股	1,574,991	65,519,625.60	3.68
10	300124	汇川技术	668,050	49,609,393.00	2.78
11	603816	顾家家居	638,327	49,329,910.56	2.77
12	603613	国联股份	431,911	43,178,142.67	2.42
13	002475	立讯精密	883,983	40,663,218.00	2.28
14	300171	东富龙	928,800	37,755,720.00	2.12
15	603882	金域医学	185,800	29,685,266.00	1.67
16	300059	东方财富	795,024	26,068,836.96	1.46
17	603298	杭叉集团	1,198,500	21,740,790.00	1.22
18	300115	长盈精密	975,300	20,091,180.00	1.13
19	002709	天赐材料	169,300	18,043,994.00	1.01
20	601058	赛轮轮胎	1,169,500	11,683,305.00	0.66
21	603267	鸿远电子	89,500	11,448,840.00	0.64
22	300582	英飞特	459,900	10,734,066.00	0.60
23	003031	中瓷电子	195,811	10,710,861.70	0.60
24	002049	紫光国微	46,740	7,206,840.60	0.40
25	688682	霍莱沃	56,193	7,203,942.60	0.40
26	600399	抚顺特钢	224,300	4,068,802.00	0.23

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	002444	巨星科技	81,299,780.62	3.63
2	603799	华友钴业	56,793,041.42	2.54
3	603816	顾家家居	54,824,210.09	2.45
4	300171	东富龙	35,000,037.36	1.56
5	300014	亿纬锂能	28,592,578.00	1.28
6	002138	顺络电子	27,820,662.60	1.24

7	601058	赛轮轮胎	26,316,011.25	1.18
8	603882	金域医学	26,292,174.32	1.17
9	300059	东方财富	24,276,538.93	1.08
10	002709	天赐材料	17,985,969.50	0.80
11	300115	长盈精密	17,554,745.70	0.78
12	300124	汇川技术	16,908,973.00	0.76
13	300408	三环集团	13,793,350.00	0.62
14	002271	东方雨虹	11,014,872.00	0.49
15	300910	瑞丰新材	10,283,133.60	0.46
16	603267	鸿远电子	9,604,798.00	0.43
17	300582	英飞特	9,122,129.00	0.41
18	003031	中瓷电子	9,113,713.70	0.41
19	688682	霍莱沃	7,308,720.01	0.33
20	603063	禾望电气	6,775,056.51	0.30

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	300014	亿纬锂能	279,677,546.78	12.49
2	002049	紫光国微	157,340,334.01	7.03
3	603799	华友钴业	112,309,871.09	5.01
4	300408	三环集团	102,965,396.14	4.60
5	002271	东方雨虹	102,232,208.16	4.56
6	002475	立讯精密	87,487,737.27	3.91
7	002179	中航光电	83,122,940.88	3.71
8	000725	京东方A	63,902,434.00	2.85
9	002444	巨星科技	46,434,778.36	2.07
10	601038	一拖股份	43,316,115.34	1.93
11	300207	欣旺达	42,729,518.50	1.91
12	600048	保利地产	32,910,194.19	1.47
13	002025	航天电器	26,125,726.37	1.17
14	002138	顺络电子	26,108,200.00	1.17
15	600223	鲁商发展	25,815,528.82	1.15
16	600183	生益科技	25,411,900.27	1.13
17	601155	新城控股	17,473,360.00	0.78
18	002507	涪陵榨菜	16,994,910.00	0.76
19	603063	禾望电气	16,010,957.00	0.71
20	300587	天铁股份	14,278,343.54	0.64

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

买入股票成本（成交）总额	512,155,791.05
卖出股票收入（成交）总额	1,369,169,539.43

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	6,582,607.16	0.37
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	6,582,607.16	0.37

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	127036	三花转债	35,792	4,688,394.08	0.26
2	123111	东财转3	12,153	1,778,713.08	0.10
3	127038	国微转债	1,155	115,500.00	0.01

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

无。

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

无。

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

无。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

7.11.3 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

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 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 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	375,206.72
2	应收证券清算款	3,554,860.58
3	应收股利	-
4	应收利息	52,410.08
5	应收申购款	1,946,924.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	5,929,402.02

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

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（%）
95,086	7,048.29	41,814,870.38	6.24	628,379,073.66	93.76

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	162,198.60	0.02

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
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（2013年6月5日）基金份额总额	2,024,955,437.39
本报告期期初基金份额总额	863,041,715.70
本报告期基金总申购份额	233,930,068.64

减：本报告期基金总赎回份额	426,777,840.30
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	670,193,944.04

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

§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：2021年1月23日本基金管理人发布公告，经公司第五届董事会第二十三次会议审议通过，许珊燕女士离任公司副总经理职位。2021年4月24日本基金管理人发布公告，经公司第五届董事会第二十七次会议审议通过，聘任马俊先生担任公司副总经理职位。

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

无。

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	
长江证券	2	919,295,509.91	48.86%	856,141.47	48.86%	-
华泰证券	2	196,575,402.56	10.45%	183,065.21	10.45%	-
中信建投证券	2	187,493,525.22	9.97%	174,612.30	9.97%	-
国盛证券	1	178,253,558.75	9.47%	166,004.38	9.47%	-
中泰证券	2	145,333,187.36	7.73%	135,349.09	7.73%	-
中金公司	1	77,610,884.73	4.13%	72,278.96	4.13%	-
东方证券	1	50,093,646.09	2.66%	46,653.55	2.66%	-
东方财富证券	1	45,907,779.40	2.44%	42,754.23	2.44%	-
天风证券	2	23,072,318.32	1.23%	21,486.85	1.23%	-
信达证券	1	17,574,204.14	0.93%	16,366.86	0.93%	-
中信证券	1	13,982,319.00	0.74%	13,021.37	0.74%	-
安信证券	2	12,705,621.00	0.68%	11,832.86	0.68%	-
海通证券	1	8,115,452.00	0.43%	7,558.37	0.43%	-
西部证券	1	5,311,922.00	0.28%	4,947.18	0.28%	-
北京高华证	1	-	-	-	-	-

券						
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中金财富证券	1	-	-	-	-	-
中银国际证券	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		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
长江证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	1,871,592.50	22.36%	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-

海通证券	1,590,000.00	18.99%	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
北京高华证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	4,910,000.00	58.65%	-	-	-	-

注：1、报告期内，本基金交易单元未发生变化；

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	交银施罗德成长30混合型证券投资基金2020年第4季度报告	公司网站	2021年1月21日
2	交银施罗德基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2021年1月23日
3	交银施罗德基金管理有限公司关于增加和耕传承基金销售有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2021年2月5日
4	交银施罗德基金管理有限公司关于增加上海中欧财富基金销售有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2021年3月5日
5	交银施罗德基金管理有限公司关于增加腾安基金销售（深圳）有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2021年3月23日
6	交银施罗德成长30混合型证券投资	公司网站	2021年3月30日

	基金2020年年度报告		
7	交银施罗德基金管理有限公司关于增加万联证券股份有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2021年4月6日
8	交银施罗德基金管理有限公司关于增加华龙证券股份有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2021年4月12日
9	交银施罗德成长30混合型证券投资基金2021年第1季度报告	公司网站	2021年4月21日
10	交银施罗德基金管理有限公司关于副总经理任职的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2021年4月24日
11	交银施罗德基金管理有限公司关于增加北京植信基金销售有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2021年5月26日
12	交银施罗德成长30混合型证券投资基金基金产品资料概要更新(2021年第1号)	公司网站	2021年6月24日
13	交银施罗德成长30混合型证券投资基金(更新)招募说明书(2021年第1号)	公司网站	2021年6月24日
14	交银施罗德基金管理有限公司关于增加国联证券股份有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2021年6月29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

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中国证监会批准交银施罗德成长30股票型证券投资基金募集的文件；

2、《交银施罗德成长30混合型证券投资基金基金合同》；

3、《交银施罗德成长30混合型证券投资基金招募说明书》；

4、《交银施罗德成长30混合型证券投资基金托管协议》；

5、关于募集交银施罗德成长30股票型证券投资基金之法律意见书；

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成长30混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

12.3 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。