

交银施罗德瑞思三年封闭运作混合型证券  
投资基金  
2022 年中期报告

2022 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

送出日期：2022 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 08 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
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 .....	8
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 .....	9
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 .....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	10
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 .....	10
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 .....	11
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>11</b>
6.1 资产负债表 .....	11
6.2 利润表 .....	13
6.3 净资产（基金净值）变动表 .....	14
6.4 报表附注 .....	17
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>46</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	46
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 .....	47
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 .....	52
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 本基金投资股指期货的投资政策 .....	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	53
7.12 投资组合报告附注 .....	54
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>55</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	55
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	55
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	55
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情况 .....	56
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>56</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>56</b>
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
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>59</b>
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 .....	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	59
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>59</b>
12.1 备查文件目录 .....	59
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	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
场内简称	交银瑞思
基金主代码	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
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2020 年 8 月 5 日

### 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”对各类资产配比进行灵活调整，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 姓名	王晚婷	秦一楠

露负责人	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	谷澍

## 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(2022年1月1日-2022年6月30日)
本期已实现收益	-120,077,767.70
本期利润	-415,606,658.05
加权平均基金份额本期利润	-0.0840
本期加权平均净值利润率	-7.28%
本期基金份额净值增长率	-6.42%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)
期末可供分配利润	1,107,854,763.49
期末可供分配基金份额利润	0.2240
期末基金资产净值	6,053,699,986.67
期末基金份额净值	1.2240
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)
基金份额累计净值增长率	22.40%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

## 3.2 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	9.48%	1.30%	6.78%	0.82%	2.70%	0.48%
过去三个月	11.92%	1.69%	4.69%	1.07%	7.23%	0.62%
过去六个月	-6.42%	1.73%	-6.17%	1.10%	-0.25%	0.63%
过去一年	-3.42%	1.34%	-9.91%	0.94%	6.49%	0.40%
自基金合同生效起至今	22.40%	1.12%	7.82%	0.96%	14.58%	0.16%

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

交银瑞思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：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。

## § 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、混合型和股票型在内的 112 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		
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 年 2 月 21 日	-	13 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

2022 年上半年，国际局地战争局势紧张，美国面临高通胀下的紧缩预期，国内则遭遇新一轮疫情影响，在这样的背景下，全球及国内经济均面临较大下行压力，但国内较为温和的通胀环境使得出台宽松的稳增长政策更为坚定更为前瞻，且相比其他国家空间更大，我们仍预计在未来一段时间内政策将进一步保持宽松以发挥更为积极的促进和托底作用。市场方面，全球股市一度普遍回调，但经历估值大幅压缩下，市场在五月开始重新开启反弹，我们认为前期投资者已经过分反映悲观预期，未来虽可能有所反复，但再度大幅创新低的可能性较小。

报告期内，本基金整体维持中性偏高仓位，行业配置主要集中在电子化工等高端先进制造和材料、消费中的食品医药、互联网计算机以及少部分低估值金融等行业，同时继续增配了部分科

技及医疗港股。

#### 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 2022 年下半年，我们认为疫情扰动将逐渐过去，但联储加息及退出量化宽松的进程可能对全球资本市场仍会有一定干扰，总体市场将呈现结构性机会。在上市企业分化加大的背景下，拥有独特竞争优势以及商业壁垒的企业仍是我们重点关注的主要方向。中长期来看，组合仍将聚焦拥有核心技术壁垒的高端制造业，受益于技术升级的电子计算机等行业，以及受益内循环的食品饮料、医药等必须消费品，阶段性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其适用性的情况后，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 2022 年 1 月 1 日至 2022 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，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 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：交银施罗德瑞思三年封闭运作混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	949,791,454.47	1,082,055,208.58
结算备付金		18,144,391.90	21,599,674.92
存出保证金		14,127,747.01	18,989,440.42
交易性金融资产	6.4.7.2	5,092,556,777.74	5,355,579,208.48
其中：股票投资		5,049,341,582.31	5,310,880,967.48
基金投资		-	-

债券投资		43,215,195.43	44,698,241.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	19,684,524.15
应收股利		4,498,706.86	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	265,643.76
资产总计		6,079,119,077.98	6,498,173,700.31
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年6月30日</b>	<b>上年度末 2021年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
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		14,745,138.72	15,905,666.49
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		7,085,282.85	8,073,302.21
应付托管费		1,180,880.45	1,345,550.36
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		55.96	2,777.05
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	2,407,733.33	3,539,759.48
负债合计		25,419,091.31	28,867,055.59
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	4,945,845,223.18	4,945,845,223.18
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	1,107,854,763.49	1,523,461,421.54
净资产合计		6,053,699,986.67	6,469,306,644.72
负债和净资产总计		6,079,119,077.98	6,498,173,700.31

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.2240 元，基金份额总额 4,945,845,223.18

份。

## 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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-365,749,540.34	-70,374,952.14
1. 利息收入		2,821,416.27	4,230,882.71
其中：存款利息收入	6.4.7.13	2,809,660.18	4,063,358.05
债券利息收入		-	632.33
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		11,756.09	166,892.33
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-73,042,066.26	481,600,178.03
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-100,984,299.73	447,394,912.19
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	1,601,705.45	110,140.02
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-1,930,396.54	212,233.01
股利收益	6.4.7.19	28,270,924.56	33,882,892.81
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）	6.4.7.20	-295,528,890.35	-556,206,012.88
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		49,857,117.71	65,807,166.78
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	42,539,141.50	47,286,490.14
2. 托管费	6.4.10.2.2	7,089,856.95	7,881,081.66
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-

4. 投资顾问费	6.4.10.2.1.1		-
5. 利息支出			-
其中：卖出回购金融资产支出			-
6. 信用减值损失	6.4.7.22		-
7. 税金及附加		45,671.37	1,367.17
8. 其他费用	6.4.7.23	182,447.89	10,638,227.81
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-415,606,658.05	-136,182,118.92
减：所得税费用			-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-415,606,658.05	-136,182,118.92
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>			-
<b>六、综合收益总额</b>		-415,606,658.05	-136,182,118.92

### 6.3 净资产（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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 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（基金净值）	4,945,845,223.18	-	1,523,461,421.54	6,469,306,644.72
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	4,945,845,223.18	-	1,523,461,421.54	6,469,306,644.72
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	-	-415,606,658.05	-415,606,658.05
（一）、综合收益总	-	-	-415,606,658.05	-415,606,658.05

额				
(二)、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	-	-	-	-
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	4,945,845,223.18	-	1,107,854,763.49	6,053,699,986.67
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021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(基金净值)	4,945,845,223.18	-	1,458,432,297.60	6,404,277,520.78
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本 期初 净资 产（基 金净 值）	4,945,845,223.18	-	1,458,432,297.60	6,404,277,520.78
三、本 期增 减变 动额 （减 少以 “-” 号填 列）	-	-	-136,182,118.92	-136,182,118.92
（一）、 综合收 益总 额	-	-	-136,182,118.92	-136,182,118.92
（二）、 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	-	-	-	-
（三）、 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）	-	-	-	-
（四）、 其他综 合收益 结转留 存收益	-	-	-	-
四、本 期末 净资	4,945,845,223.18	-	1,322,250,178.68	6,268,095,401.86



产(基金 净值)				
-------------	--	--	--	--

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：

<u>谢卫</u>	<u>谢卫</u>	<u>单江</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 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》，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、存托凭证)、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(含存托凭证)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(含存托凭证)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沪深 300 指数收益率 $\times$ 70%+恒生指数收益率 $\times$ 5%+中证综合债券指数收益率 $\times$ 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。

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 2022 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 2022 年 06 月 30 日的财务状况以及 2022 年上半年度的经营成果和净资产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变更,详见 6.4.5.1;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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”),财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外,中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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>》,本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表,对本基金财务报表的影响列示如下:

1. 会计政策变更的性质、内容和原因
  - (a) 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

#### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

#### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

#### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和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。本基金持有的以摊余成本计量的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。

### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示

为衍生金融资产/负债。

(b) 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在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，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，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，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。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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。

### (c) 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。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证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投资收益。

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扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息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扣除相关交易费用及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。

## 2. 当期报表中受影响的项目名称和调整金额

### (a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息和应收证券清算款，金额分别为 1,082,055,208.58 元、21,599,674.92 元、18,989,440.42 元、265,643.76 元和 19,684,524.15 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息和应收清算款，金额分别为 1,082,301,076.82 元、21,615,788.32 元、18,990,743.68 元、0.00 元和 19,684,524.15 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 5,355,579,208.48 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 5,355,581,567.34 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付管理人报酬、应付托管费和应付交易费用，金额分别为 15,905,666.49 元、8,073,302.21 元、1,345,550.36 元和 3,335,259.48 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付管理人报酬、应付托管费和其他负债-应付交易费用，金额分别为 15,905,666.49 元、8,073,302.21 元、1,345,550.36 元和 3,335,259.48 元。

(b) 修订后的《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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

#### 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 2022 年 6 月 30 日
活期存款	949,791,454.47
等于：本金	949,609,948.23
加：应计利息	181,506.24
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	949,791,454.47

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	5,384,075,708.31	-	5,049,341,582.31	- 334,734,126.00	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	37,833,000.00	33,630.03	43,215,195.43	5,348,565.40
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	37,833,000.00	33,630.03	43,215,195.43	5,348,565.40
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	5,421,908,708.31	33,630.03	5,092,556,777.74	- 329,385,560.60	

#### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	-100,762,100.00	-	-	
其中：股指	-100,762,100.00	-	-	



期货投资				
其他衍生工具		-		-
合计	-100,762,100.00		-	-

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2208	IC2208	-30.00	-38,377,200.00	-1,205,200.00
IF2208	IF2208	-50.00	-66,897,000.00	-3,306,900.00
合计				-4,512,100.00
减：可抵销期货暂收款				-4,512,100.00
净额				-

注：衍生金融资产项下的股指期货投资净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货投资产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵消后的净额为 0。

#### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

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。

##### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。
----

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

##### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

##### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

##### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

#### 6.4.7.7 其他权益工具投资

##### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

##### 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

#### 6.4.7.8 其他资产

无。

#### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022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	2,304,054.38
其中：交易所市场	2,304,054.38
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	39,671.58
预提信息披露费	59,507.37
预提账户维护费	4,500.00
合计	2,407,733.33

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,945,845,223.18	4,945,845,223.18
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
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	4,945,845,223.18	4,945,845,223.18

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。

3、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。

4、截至 2022 年 6 月 30 日止，本基金于上交所上市的基金份额为 36,940,301.00 份（2021 年 6 月 30 日：29,829,533.00 份），托管在场外未上市交易的基金份额为 4,908,904,922.18 份（2021 年 6 月 30 日：4,916,015,690.18 份）。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

无。

#### 6.4.7.12 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
本期期初	1,561,830,191.79	-38,368,770.25	1,523,461,421.54
本期利润	-120,077,767.70	-295,528,890.35	-415,606,658.05
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	1,441,752,424.09	-333,897,660.60	1,107,854,763.49

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

活期存款利息收入	2,421,171.52
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	371,259.46
其他	17,229.20
合计	2,809,660.18

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-100,984,299.73
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	-100,984,299.73

##### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	2,795,902,239.48
减：卖出股票成本总额	2,886,768,283.11
减：交易费用	10,118,256.10
买卖股票差价收入	-100,984,299.73

##### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	39,811.55
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,561,893.90
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	1,601,705.45

#### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	10,714,528.53
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	9,143,300.00
减：应计利息总额	9,073.82
减：交易费用	260.81
买卖债券差价收入	1,561,893.90

#### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

#### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

##### 6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

##### 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

##### 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.17 贵金属投资收益

## 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

## 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

## 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.18 衍生工具收益

## 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2022年1月1日至2022年6月30日
股指期货投资收益	-1,930,396.54

## 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	28,270,924.56
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	28,270,924.56

## 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1. 交易性金融资产	-290,936,130.32

股票投资	-293,038,754.72
债券投资	2,102,624.40
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-4,595,480.00
权证投资	-
期货投资	-4,595,480.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-2,719.97
合计	-295,528,890.35

#### 6.4.7.21 其他收入

无。

#### 6.4.7.22 信用减值损失

无。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	24,955.86
债券账户费用	9,000.00
其他	49,313.08
合计	182,447.89

#### 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
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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	42,539,141.50	47,286,490.14
其中：支付销售机构的客户维护费	20,867,454.61	22,428,349.19

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.5\% \div \text{当年天数}。$$

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	7,089,856.95	7,881,081.66

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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% \div \text{当年天数}。$$

### 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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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
中国农业银行_活期存款	949,791,454.47	2,421,171.52	755,627,143.21	3,588,557.42

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(2022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	受限期	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
301097	天益医疗	2022年3月25日	6个月以上	限售股	52.37	47.83	249	13,040.13	11,909.67	-
301102	兆讯	2022	6个月	限售股	39.88	31.09	642	25,602.96	19,959.78	-

	传媒	年 3 月 15 日	以上								
301110	青木 股份	2022 年 3 月 4 日	6 个月 以上	限售股	63.10	39.85	202	12,746.20	8,049.70	-	
301120	新特 电气	2022 年 4 月 11 日	6 个月 以上	限售股	13.73	15.49	1,032	14,169.36	15,985.68	-	
301122	采纳 股份	2022 年 1 月 19 日	6 个月 以上	限售股	50.31	70.37	301	15,143.31	21,181.37	-	
301135	瑞德 智能	2022 年 4 月 1 日	6 个月 以上	限售股	31.98	26.26	338	10,809.24	8,875.88	-	
301150	中一 科技	2022 年 4 月 14 日	6 个月 以上	限售股	163.56	82.76	269	43,997.64	22,262.44	-	
301150	中一 科技	2022 年 6 月 10 日	1-6 个 月 (含)	限售股 送股	-	82.76	134	-	11,089.84	-	
301196	唯科 科技	2022 年 1 月 4 日	6 个月 以上	限售股	64.08	37.52	271	17,365.68	10,167.92	-	
301200	大族 数控	2022 年 2 月 18 日	6 个月 以上	限售股	76.56	51.92	857	65,611.92	44,495.44	-	
301207	华兰 疫苗	2022 年 2 月 10 日	6 个月 以上	限售股	56.88	56.42	569	32,364.72	32,102.98	-	
301216	万凯 新材	2022 年 3 月 21 日	6 个月 以上	限售股	35.68	29.84	1,120	39,961.60	33,420.80	-	
301219	腾远 钴业	2022 年 3 月 10 日	6 个月 以上	限售股	173.98	87.82	321	55,847.58	28,190.22	-	
301219	腾远 钴业	2022 年 5 月 24 日	1-6 个 月 (含)	限售股 送股	-	87.82	257	-	22,569.74	-	
301228	实朴 检测	2022 年 1 月 21 日	6 个月 以上	限售股	20.08	20.34	373	7,489.84	7,586.82	-	
301238	瑞泰 新材	2022 年 6 月 10 日	6 个月 以上	限售股	19.18	32.07	3,497	67,072.46	112,148.79	-	

301239	普瑞眼科	2022年6月22日	1个月内(含)	新股未上市	33.65	33.65	5,172	174,037.80	174,037.80	-
301239	普瑞眼科	2022年6月22日	6个月以上	限售股	33.65	33.65	575	19,348.75	19,348.75	-
301256	华融化学	2022年3月14日	6个月以上	限售股	8.05	10.08	1,831	14,739.55	18,456.48	-
301259	艾布鲁	2022年4月18日	6个月以上	限售股	18.39	24.94	483	8,882.37	12,046.02	-
301266	宇邦新材	2022年5月30日	6个月以上	限售股	26.86	47.07	517	13,886.62	24,335.19	-
301286	侨源股份	2022年6月6日	6个月以上	限售股	16.91	19.79	784	13,257.44	15,515.36	-
301302	华如科技	2022年6月16日	6个月以上	限售股	52.03	56.42	466	24,245.98	26,291.72	-
688120	华海清科	2022年5月30日	6个月以上	限售股	136.66	217.12	4,822	658,974.52	1,046,952.64	-
688237	超卓航科	2022年6月24日	1个月内(含)	新股未上市	41.27	41.27	2,891	119,311.57	119,311.57	-
688279	峰昭科技	2022年4月13日	6个月以上	限售股	82.00	67.34	5,505	451,410.00	370,706.70	-
688283	坤恒顺维	2022年2月8日	6个月以上	限售股	33.80	45.41	1,595	53,911.00	72,428.95	-
688302	海创药业	2022年4月1日	6个月以上	限售股	42.92	38.35	13,082	561,479.44	501,694.70	-
688325	赛微微电	2022年4月15日	6个月以上	限售股	74.55	53.89	4,039	301,107.45	217,661.71	-
688400	凌云光	2022年6月27日	1个月内(含)	新股未上市	21.93	21.93	13,111	287,524.23	287,524.23	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券	证券	成功	受限期	流通受	认购	期末估	数量	期末	期末估值总额	备注
----	----	----	-----	-----	----	-----	----	----	--------	----

代码	名称	认购日		限类型	价格	值单价	(单 位: 张)	成本总额		
118009	华锐 转债	2022 年 6 月 27 日	1 个月 内 (含)	老股东 配债	100.00	100.00	16,760	1,676,000.00	1,676,000.00	-

注：1、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。

2、受限期指自该证券实际取得之日起的流通受限期限。

#### 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，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、存托凭证）、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人中国农业银行股份有限公司，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 2022 年 6 月 30 日，本基金持有除国债、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 0.71%（2021 年 12 月 31 日：0.69%）。

#### 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 2022 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同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》且于封闭期结束后按照《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%。于封闭期结束后，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股票不得超过该上市公司可流通股股票的 15%（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股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 30%。

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。于封闭期结束后，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%。

于封闭期结束后，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 2022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	949,791,454.47	-	-	-	949,791,454.47
结算备付金	18,144,391.90	-	-	-	18,144,391.90
存出保证金	14,127,747.01	-	-	-	14,127,747.01
交易性金融资产	-	-	43,215,195.43	5,049,341,582.31	5,092,556,777.74
应收股利	-	-	-	4,498,706.86	4,498,706.86
资产总计	982,063,593.38	-	43,215,195.43	5,053,840,289.17	6,079,119,077.98
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	7,085,282.85	7,085,282.85
应付托管费	-	-	-	1,180,880.45	1,180,880.45
应付清算款	-	-	-	14,745,138.72	14,745,138.72
应交税费	-	-	-	55.96	55.96
其他负债	-	-	-	2,407,733.33	2,407,733.33
负债总计	-	-	-	25,419,091.31	25,419,091.31
利率敏感度缺口	982,063,593.38	-	43,215,195.43	5,028,421,197.86	6,053,699,986.67
上年度末 2021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	1,082,055,208.58	-	-	-	1,082,055,208.58
结算备付金	21,599,674.92	-	-	-	21,599,674.92
存出保证金	18,989,440.42	-	-	-	18,989,440.42
交易性金融资产	-	-	44,698,241.00	5,310,880,967.48	5,355,579,208.48
应收证券清算款	-	-	-	19,684,524.15	19,684,524.15
其他资产	-	-	-	265,643.76	265,643.76
资产总计	1,122,644,323.92	-	44,698,241.00	5,330,831,135.39	6,498,173,700.31
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	8,073,302.21	8,073,302.21
应付托管费	-	-	-	1,345,550.36	1,345,550.36
应付证券清算款	-	-	-	15,905,666.49	15,905,666.49
应交税费	-	-	-	2,777.05	2,777.05

其他负债	-	-	-	3,539,759.48	3,539,759.48
负债总计	-	-	-	28,867,055.59	28,867,055.59
利率敏感度缺口	1,122,644,323.92	-	44,698,241.00	5,301,964,079.80	6,469,306,644.72

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 2022 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 0.71%(2021 年 12 月 31 日：0.69%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2021 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 2022 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
交易性金融资产	-	1,873,954,055. 39	-	1,873,954,055.39
资产合计	-	1,873,954,055. 39	-	1,873,954,055.39
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	-	1,873,954,055. 39	-	1,873,954,055.39
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计

以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	785,803,867.08	-	785,803,867.08
资产合计	-	785,803,867.08	-	785,803,867.08
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	-	785,803,867.08	-	785,803,867.08

#### 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		
	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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	1. 所有外币相对人民币升值 5%	93,697,702.77	39,290,193.35
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-93,697,702.77	-39,290,193.35

#### 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（含存托凭证）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 (含存托凭证) 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 2022年6月30日		上年度末 2021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	5,049,341,582.31	83.41	5,310,880,967.48	82.09
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	43,215,195.43	0.71	44,698,241.00	0.69
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	5,092,556,777.74	84.12	5,355,579,208.48	82.78

注: 1、债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

2、其他包含在期货交易所交易的期货投资。在当日无负债结算制度下, 期货投资与相关的期货暂收款 (结算所得的持仓损益) 之间按抵销后的净额为 0。

#### 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 (2022年6月30日)	上年度末 (2021年12月)	

			31 日 )
分析	1. 业绩比较基准上 涨 5%	394,607,856.46	291,830,254.26
	2. 业绩比较基准下 降 5%	-394,607,856.46	-291,830,254.26

#### 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的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：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。”常见的各层次金融工具举例如下，第一层次：如以活跃市场报价估值的股票投资、股指期货投资、国债期货投资、每日开放申赎/买卖的基金投资等；第二层次：如因新发/增发尚未上市交易而按发行价格/增发价格估值的不限售的股票投资、债券投资等，使用第三方基准服务机构提供的报价估值的在交易所市场或银行间同业市场交易的债券投资、资产支持证券投资等；第三层次：如使用亚式期权模型计算流动性折扣进行估值的尚处于限售期的股票投资，以及违约债、非指数收益法估值的长期停牌的股票等估值模型中使用不可观察输入值的投资等。

##### 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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	5,087,564,391.71	5,120,211,702.37
第二层次	2,276,299.49	34,160,814.69
第三层次	2,716,086.54	201,206,691.42
合计	5,092,556,777.74	5,355,579,208.48

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

无。

**6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明**

无。

**6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明**

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

**6.4.15 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	5,049,341,582.31	83.06
	其中：股票	5,049,341,582.31	83.06
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	43,215,195.43	0.71
	其中：债券	43,215,195.43	0.71
	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	967,935,846.37	15.92
8	其他各项资产	18,626,453.87	0.31
9	合计	6,079,119,077.98	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通机制投资香港股票的公允价值为 1,873,954,055.39 元，占基金资产净值比例为 30.96%。

**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	44,421,386.50	0.73
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,423,260,132.48	23.51
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	58,766.40	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	506,471,751.30	8.37
H	住宿和餐饮业	96,142,430.10	1.59
I	信息传输、软件和信息技术服务业	452,003,463.08	7.47
J	金融业	480,035,566.68	7.93
K	房地产业	44,225,006.00	0.73
L	租赁和商务服务业	19,959.78	0.00
M	科学研究和技术服务业	46,824,574.82	0.77
N	水利、环境和公共设施管理业	6,316,442.86	0.10
O	居民服务、修理和其他服务业		-
P	教育		-
Q	卫生和社会工作	28,258,653.00	0.47
R	文化、体育和娱乐业	47,349,393.92	0.78
S	综合		-
	合计	3,175,387,526.92	52.45

### 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（%）
可选消费	290,766,960.32	4.80
主要消费	148,809,131.85	2.46
医药卫生	700,437,770.56	11.57
金融	75,783,517.04	1.25
信息技术	158,788,258.45	2.62
通信服务	418,595,972.46	6.91
公用事业	51,297,842.45	0.85
房地产	29,474,602.26	0.49
合计	1,873,954,055.39	30.96

注：本报告采用中证 CICS 一级分类标准编制。

### 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	002352	顺丰控股	8,862,233	494,601,223.73	8.17
2	01024 HK	快手-W	3,146,200	235,158,333.20	3.88
3	01548 HK	金斯瑞生物科技	8,024,000	195,225,167.73	3.22
4	00853 HK	微创医疗	8,775,200	170,726,539.80	2.82
5	600276	恒瑞医药	4,495,754	166,747,515.86	2.75
6	002493	荣盛石化	10,435,938	160,609,085.82	2.65
7	000001	平安银行	8,791,100	131,690,678.00	2.18

8	600570	恒生电子	3,004,563	130,818,673.02	2.16
9	03690 HK	美团-W	728,900	121,054,179.85	2.00
10	002304	洋河股份	610,000	111,721,500.00	1.85
11	00700 HK	腾讯控股	333,300	101,016,342.69	1.67
12	002436	兴森科技	8,499,966	95,794,616.82	1.58
13	002475	立讯精密	2,780,000	93,936,200.00	1.55
14	601166	兴业银行	4,274,459	85,061,734.10	1.41
15	03888 HK	金山软件	3,149,600	82,421,296.57	1.36
16	002555	三七互娱	3,882,136	82,417,747.28	1.36
17	603259	药明康德	450,000	46,795,500.00	0.77
17	02359 HK	药明康德	395,613	35,354,887.41	0.58
18	601318	中国平安	1,727,638	80,663,418.22	1.33
19	01066 HK	威高股份	10,113,680	78,879,956.15	1.30
20	03908 HK	中金公司	5,300,000	75,783,517.04	1.25
21	06969 HK	思摩尔国际	3,531,000	73,076,156.54	1.21
22	600754	锦江酒店	1,134,225	71,342,752.50	1.18
23	300782	卓胜微	506,755	68,411,925.00	1.13
24	02238 HK	广汽集团	10,348,000	67,167,751.45	1.11
25	00175 HK	吉利汽车	4,362,000	66,549,243.84	1.10
26	002841	视源股份	854,992	64,397,997.44	1.06
27	01093 HK	石药集团	9,422,000	62,768,705.40	1.04
28	688111	金山办公	316,731	62,434,014.72	1.03
29	300454	深信服	536,000	55,626,080.00	0.92
30	600150	中国船舶	2,925,860	55,532,822.80	0.92
31	600519	贵州茅台	27,100	55,419,500.00	0.92
32	601628	中国人寿	1,675,792	52,083,615.36	0.86
33	02382 HK	舜宇光学科技	475,000	51,954,930.48	0.86
34	00268 HK	金蝶国际	3,290,000	51,769,781.84	0.86
35	00902 HK	华能国际电力股份	15,341,214	51,297,842.45	0.85
36	02269 HK	药明生物	832,000	51,086,998.14	0.84
37	300408	三环集团	1,693,868	50,985,426.80	0.84
38	600030	中信证券	2,319,550	50,241,453.00	0.83
39	601601	中国太保	2,117,200	49,817,716.00	0.82
40	002371	北方华创	175,817	48,722,407.04	0.80
41	300251	光线传媒	4,999,936	47,349,393.92	0.78
42	01951 HK	锦欣生殖	7,649,230	47,295,370.38	0.78
43	301117	佳缘科技	839,968	46,979,410.24	0.78
44	000661	长春高新	200,000	46,684,000.00	0.77
45	01347 HK	华虹半导体	1,875,000	45,538,867.50	0.75
46	300760	迈瑞医疗	144,000	45,100,800.00	0.75
47	600600	青岛啤酒	150,000	15,588,000.00	0.26



47	00168 HK	青岛啤酒股份	350,000	24,424,226.40	0.40
48	688039	当虹科技	1,003,604	39,592,177.80	0.65
49	688112	鼎阳科技	622,357	38,050,906.98	0.63
50	06185 HK	康希诺生物	540,400	37,133,324.72	0.61
51	603799	华友钴业	381,099	36,440,686.38	0.60
52	06862 HK	海底捞	2,299,000	35,979,297.12	0.59
53	002299	圣农发展	1,600,000	30,688,000.00	0.51
54	300059	东方财富	1,199,880	30,476,952.00	0.50
55	603882	金域医学	339,979	28,065,266.45	0.46
56	00291 HK	华润啤酒	528,000	26,415,108.72	0.44
57	688059	华锐精密	184,446	25,449,859.08	0.42
58	600258	首旅酒店	999,987	24,799,677.60	0.41
59	600690	海尔智家	881,846	24,215,491.16	0.40
60	301033	迈普医学	545,058	22,952,392.38	0.38
61	000002	万 科 A	1,087,100	22,285,550.00	0.37
62	06699 HK	时代天使	163,400	21,966,820.83	0.36
63	600383	金地集团	1,632,400	21,939,456.00	0.36
64	300973	立高食品	199,929	20,782,619.55	0.34
65	688536	思瑞浦	36,000	20,217,240.00	0.33
66	688008	澜起科技	319,902	19,379,663.16	0.32
67	603501	韦尔股份	110,200	19,067,906.00	0.31
68	688308	欧科亿	276,270	18,388,531.20	0.30
69	01209 HK	华润万象生活	500,400	16,646,752.26	0.27
70	002318	久立特材	999,951	15,989,216.49	0.26
71	600887	伊利股份	383,566	14,939,895.70	0.25
72	603816	顾家家居	260,000	14,723,800.00	0.24
73	06186 HK	中国飞鹤	1,900,000	14,656,246.22	0.24
74	600872	中炬高新	400,000	13,844,000.00	0.23
75	300761	立华股份	345,494	13,733,386.50	0.23
76	600131	国网信通	967,467	13,012,431.15	0.21
77	06049 HK	保利物业	300,000	12,827,850.00	0.21
78	600399	抚顺特钢	700,000	12,530,000.00	0.21
79	002928	华夏航空	1,008,541	11,870,527.57	0.20
80	300871	回盛生物	519,200	11,484,704.00	0.19
81	300381	溢多利	1,016,615	10,582,962.15	0.17
82	01579 HK	颐海国际	423,000	10,237,393.97	0.17
83	00285 HK	比亚迪电子	450,000	9,524,678.63	0.16
84	601968	宝钢包装	1,177,247	9,147,209.19	0.15
85	600195	中牧股份	600,096	7,357,176.96	0.12
86	300816	艾可蓝	207,518	6,304,396.84	0.10
87	688032	禾迈股份	2,534	2,207,114.00	0.04
88	688349	三一重能	32,650	1,330,487.50	0.02

89	301238	瑞泰新材	34,966	1,296,327.26	0.02
90	688120	华海清科	4,822	1,046,952.64	0.02
91	688302	海创药业	13,082	501,694.70	0.01
92	688279	峰昭科技	5,505	370,706.70	0.01
93	688119	中钢洛耐	33,327	293,944.14	0.00
94	688400	凌云光	13,111	287,524.23	0.00
95	301302	华如科技	4,651	282,999.62	0.00
96	301266	宇邦新材	5,161	279,894.51	0.00
97	688325	赛微微电	4,039	217,661.71	0.00
98	301239	普瑞眼科	5,747	193,386.55	0.00
99	301286	侨源股份	7,839	176,722.11	0.00
100	688251	井松智能	3,392	141,853.44	0.00
101	688237	超卓航科	2,891	119,311.57	0.00
102	688283	坤恒顺维	1,595	72,428.95	0.00
103	301177	迪阿股份	792	58,766.40	0.00
104	001270	铖昌科技	568	57,481.60	0.00
105	301219	腾远钴业	578	50,759.96	0.00
106	301200	大族数控	857	44,495.44	0.00
107	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.00
108	301216	万凯新材	1,120	33,420.80	0.00
109	301150	中一科技	403	33,352.28	0.00
110	301207	华兰疫苗	569	32,102.98	0.00
111	001323	慕思股份	573	28,111.38	0.00
112	301096	百诚医药	272	21,488.00	0.00
113	301122	采纳股份	301	21,181.37	0.00
114	301102	兆讯传媒	642	19,959.78	0.00
115	301256	华融化学	1,831	18,456.48	0.00
116	02020 HK	安踏体育	200	16,488.06	0.00
117	301120	新特电气	1,032	15,985.68	0.00
118	301168	通灵股份	329	14,831.32	0.00
119	301189	奥尼电子	435	14,489.85	0.00
120	603097	江苏华辰	577	13,617.20	0.00
121	301118	恒光股份	315	13,554.45	0.00
122	301100	风光股份	599	12,926.42	0.00
123	301259	艾布鲁	483	12,046.02	0.00
124	301179	泽宇智能	295	12,038.95	0.00
125	301097	天益医疗	249	11,909.67	0.00
126	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
127	002439	启明星辰	567	11,300.31	0.00
128	301111	粤万年青	379	10,392.18	0.00
129	301196	唯科科技	271	10,167.92	0.00
130	603272	联翔股份	443	9,723.85	0.00

131	301135	瑞德智能	338	8,875.88	0.00
132	301193	家联科技	297	8,063.55	0.00
133	301110	青木股份	202	8,049.70	0.00
134	301133	金钟股份	286	7,942.22	0.00
135	301228	实朴检测	373	7,586.82	0.00
136	300950	德固特	328	5,346.40	0.00
137	688083	中望软件	14	2,931.88	0.00
138	603995	甬金股份	51	1,716.66	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	01548 HK	金斯瑞生物科技	155,903,875.59	2.41
2	00853 HK	微创医疗	139,836,188.71	2.16
3	603259	药明康德	40,903,316.00	0.63
3	02359 HK	药明康德	68,450,207.47	1.06
4	002475	立讯精密	97,990,420.62	1.51
5	03690 HK	美团-W	83,168,547.75	1.29
6	03908 HK	中金公司	80,835,478.29	1.25
7	600276	恒瑞医药	74,143,031.39	1.15
8	300759	康龙化成	63,775,992.02	0.99
8	03759 HK	康龙化成	5,095,186.55	0.08
9	01024 HK	快手-W	68,542,997.80	1.06
10	603501	韦尔股份	68,002,495.53	1.05
11	06969 HK	思摩尔国际	64,946,291.19	1.00
12	300251	光线传媒	60,519,290.78	0.94
13	002304	洋河股份	57,207,328.60	0.88
14	000001	平安银行	57,078,608.98	0.88
15	688083	中望软件	52,098,326.66	0.81
16	301117	佳缘科技	51,741,721.54	0.80
17	02382 HK	舜宇光学科技	51,141,616.60	0.79
18	300454	深信服	51,069,819.00	0.79
19	002371	北方华创	50,843,054.03	0.79
20	600399	抚顺特钢	48,112,262.00	0.74

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	601166	兴业银行	174,043,793.98	2.69
2	600383	金地集团	134,227,656.35	2.07
3	600019	宝钢股份	118,271,486.98	1.83
4	603995	甬金股份	105,384,761.84	1.63
5	600048	保利发展	84,029,142.16	1.30
6	603799	华友钴业	72,348,327.04	1.12
7	600195	中牧股份	72,107,094.00	1.11
8	300759	康龙化成	63,522,679.06	0.98
8	03759 HK	康龙化成	5,650,281.55	0.09
9	688536	思瑞浦	65,566,509.88	1.01
10	601601	中国太保	59,692,627.00	0.92
11	000002	万科 A	58,186,469.00	0.90
12	688083	中望软件	57,879,702.77	0.89
13	600399	抚顺特钢	57,537,623.00	0.89
14	600038	中直股份	55,788,574.04	0.86
15	300911	亿田智能	53,566,632.10	0.83
16	600026	中远海能	41,063,414.75	0.63
16	01138 HK	中远海能	11,218,697.51	0.17
17	000009	中国宝安	52,080,999.68	0.81
18	603501	韦尔股份	46,957,049.55	0.73
19	300408	三环集团	46,247,176.00	0.71
20	300253	卫宁健康	44,618,303.76	0.69

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	2,918,267,652.66
卖出股票收入（成交）总额	2,795,902,239.48

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）	43,215,195.43	0.71
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	43,215,195.43	0.71

#### 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	113052	兴业转债	277,280	30,964,283.02	0.51
2	113636	甬金转债	81,700	10,217,525.11	0.17
3	118009	华锐转债	16,760	1,676,077.14	0.03
4	113053	隆 22 转债	2,590	357,310.16	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 本基金投资股指期货的投资政策

本基金参与股指期货投资根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的。本基金在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

本基金的股指期货交易对基金总体风险影响不大，符合本基金的投资政策和投资目标。

#### 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 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、处罚的情形披露如下：

2021 年 10 月 8 日，国家市场监督管理总局公示国市监处〔2021〕74 号行政处罚决定书，责令美团停止违法行为，全额退还独家合作保证金 12.89 亿元，并处以其 2020 年中国境内销售额 1147.48 亿元 3%的罚款，计人民币 34.42 亿元。

2021 年 9 月 29 日，国家外汇管理局深圳市分局公示深外管检[2021]40 号行政处罚决定书，给予平安银行处罚款人民币 187 万元人民币罚款的行政处罚，没收违法所得 1.58 万元。

2022 年 3 月 25 日，中国银行保险监督管理委员会公示银保监罚决字〔2022〕24 号行政处罚决定书，给予平安银行处罚款人民币 400 万元人民币罚款的行政处罚。

本基金管理人对证券投资决策程序的说明如下：本基金管理人对证券投资特别是重仓证券的投资有严格的投资决策流程控制，对上述主体发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述主体外，本基金投资的前十名证券的其他发行主体本期没有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。

### 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	14,127,747.01
2	应收清算款	-
3	应收股利	4,498,706.86
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,626,453.87

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113052	兴业转债	30,964,283.02	0.51
2	113636	甬金转债	10,217,525.11	0.17

### 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（%）
54,290	91,100.48	14,358,899.35	0.29	4,931,486,323.83	99.71

### 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	上海宁泉资产管理有限公司—宁泉致远 20 号私募证券投资基金	3,085,840.00	8.35
2	上海宁泉资产管理有限公司—宁泉致远 56 号私募证券投资基金	2,217,850.00	6.00
3	上海宁泉资产管理有限公司—宁泉致远 58 号私募证券投资基金	1,273,028.00	3.45
4	狄洪涛	1,226,206.00	3.32
5	上海宁泉资产管理有限公司—宁泉致远 39 号私募证券投资基金	1,086,477.00	2.94
6	上海宁泉资产管理有限公司—宁泉致远 45 号私募证券投资基金	1,055,167.00	2.86
7	郑文颖	915,619.00	2.48
8	黎勇波	775,728.00	2.10
9	郑月娟	758,852.00	2.05
10	贾瑞起	718,176.00	1.94

### 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	824,031.75	0.02
------------------	------------	------

#### 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情况

无。

### § 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
本报告期期初基金份额总额	4,945,845,223.18
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额	-
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：2022年3月，中国农业银行总行决定王霄勇任托管业务部总裁。2022年3月，中国农业银行总行决定王洪滨任托管业务部高级专家。

#### 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 (%)	
中金公司	2	1,991,581,934.11	34.97	1,673,591.10	32.69	-
华创证券	1	619,268,182.72	10.87	576,726.61	11.26	-
天风证券	1	562,772,380.11	9.88	524,112.81	10.24	-
东北证券	2	361,332,574.24	6.34	336,511.12	6.57	-
招商证券	1	325,542,806.22	5.72	303,176.46	5.92	-
华泰证券	1	319,422,699.79	5.61	297,476.82	5.81	-
申万宏源证券	3	318,011,722.00	5.58	293,059.91	5.72	-
国金证券	2	288,405,371.99	5.06	268,591.38	5.25	-
兴业证券	1	274,970,682.41	4.83	256,078.48	5.00	-
国泰君安证券	1	252,947,949.90	4.44	235,574.29	4.60	-
光大证券	2	184,459,370.07	3.24	171,784.52	3.36	-
国海证券	1	103,272,811.77	1.81	96,179.02	1.88	-
中泰证券	1	68,891,368.84	1.21	64,161.55	1.25	-
安信证券	2	24,641,691.16	0.43	22,947.58	0.45	-
长江证券	1	-	-	-	-	-

国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	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 (%)
中金公司	1,676,000.00	10.32	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源 证券	259,000.00	1.59	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	3,589,000.00	22.10	-	-	-	-
国泰君安 证券	4,293,158.90	26.44	-	-	-	-
光大证券	6,421,369.63	39.54	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

英大证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际 证券	-	-	-	-	-	-

注：1、报告期内，本基金新增交易单元为长江证券，减少交易单元为中信建投证券，其他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	交银施罗德瑞思三年封闭运作混合型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	公司网站	2022 年 01 月 21 日
2	交银施罗德瑞思三年封闭运作混合型证券投资基金 2021 年年度报告	公司网站	2022 年 03 月 30 日
3	交银施罗德瑞思三年封闭运作混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	公司网站	2022 年 04 月 21 日
4	交银施罗德基金管理有限公司关于增加申万宏源西部证券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	2022 年 06 月 02 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。

## 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](http://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](mailto:services@jysld.com)。