

交银施罗德荣鑫灵活配置混合型证券投资
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：中国民生银行股份有限公司

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。

基金托管人中国民生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

| | |
|---|-----------|
| § 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 | 5 |
| 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 |
| § 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 | 11 |
| 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 | 12 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 12 |
| 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 | 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 净资产（基金净值）变动表 | 15 |
| 6.4 报表附注 | 18 |
| § 7 投资组合报告 | 45 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 45 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 45 |
| 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 | 46 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 49 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 50 |
| 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 | 50 |
| 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 | 51 |
| 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 | 51 |

| | |
|--|-----------|
| 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 | 51 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 | 51 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 51 |
| 7.12 投资组合报告附注 | 51 |
| § 8 基金份额持有人信息 | 52 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 52 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 52 |
| 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 | 52 |
| § 9 开放式基金份额变动 | 52 |
| § 10 重大事件揭示 | 53 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 53 |
| 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 | 53 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 53 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 53 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 53 |
| 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 | 53 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 54 |
| 10.8 其他重大事件 | 54 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息 | 55 |
| 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 | 55 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 55 |
| § 12 备查文件目录 | 55 |
| 12.1 备查文件目录 | 55 |
| 12.2 存放地点 | 56 |
| 12.3 查阅方式 | 56 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|----------------------|
| 基金名称 | 交银施罗德荣鑫灵活配置混合型证券投资基金 |
| 基金简称 | 交银荣鑫灵活配置混合 |
| 基金主代码 | 519766 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2019年3月29日 |
| 基金管理人 | 交银施罗德基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国民生银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,080,757,225.43份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 在严格控制投资风险和保持资产流动性的基础上，力争实现基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金将结合宏观经济环境、政策形势、证券市场走势的综合分析，自上而下灵活配置大类资产，精选投资标的，合理确定基金在股票、债券等各类资产类别上的投资比例，同时进行高效的流动性管理，获得稳健投资收益。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×50%+中债综合全价指数收益率×50% |
| 风险收益特征 | 本基金是一只混合型基金，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 |

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 | 中国民生银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 王晚婷 |
| | 联系电话 | (021) 61055050 |
| | 电子邮箱 | xxpl@jysld.com, disclosure@jysld.com |
| 客户服务电话 | 400-700-5000, 021-61055000 | 95568 |
| 传真 | (021) 61055054 | 010-57093382 |
| 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） | 北京市西城区复兴门内大街2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2号 |
| 邮政编码 | 200120 | 100031 |
| 法定代表人 | 阮红 | 高迎欣 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|-----------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 《上海证券报》 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.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 | -7,216,025.53 |
| 本期利润 | -7,021,564.07 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0058 |
| 本期加权平均净值利润率 | -0.43% |
| 本期基金份额净值增长率 | 0.07% |
| 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 | 358,284,688.67 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.3315 |
| 期末基金资产净值 | 1,485,768,201.18 |
| 期末基金份额净值 | 1.375 |
| 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 | 28.03% |

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

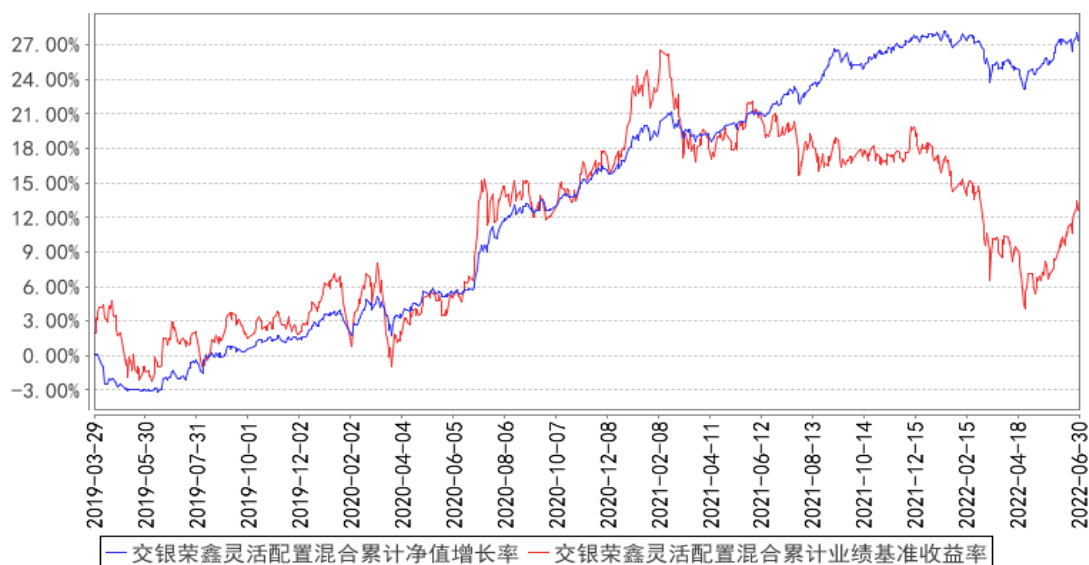
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月 | 1.33% | 0.32% | 4.61% | 0.53% | -3.28% | -0.21% |
| 过去三个月 | 2.23% | 0.29% | 3.37% | 0.71% | -1.14% | -0.42% |
| 过去六个月 | 0.07% | 0.29% | -4.24% | 0.73% | 4.31% | -0.44% |

| | | | | | | |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|
| 过去一年 | 4.88% | 0.25% | -6.06% | 0.62% | 10.94% | -0.37% |
| 过去三年 | 30.46% | 0.26% | 11.84% | 0.63% | 18.62% | -0.37% |
| 自基金合同生效起至今 | 28.03% | 0.26% | 13.39% | 0.64% | 14.64% | -0.38% |

注：交银施罗德荣鑫保本混合型证券投资基金从 2019 年 3 月 29 日起正式转型为交银施罗德荣鑫灵活配置混合型证券投资基金，本表列示的是本报告期基金转型后的基金净值表现，转型后基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率×50%+中债综合全价指数收益率×50%，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

交银荣鑫灵活配置混合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：本基金由交银施罗德荣鑫保本混合型证券投资基金转型而来。基金转型日为 2019 年 3 月 29 日。本基金的投资转型期为交银施罗德荣鑫保本混合型证券投资基金保本周期到期期间截止日的次日（即 2019 年 3 月 29 日）起的 3 个月。截至投资转型期结束，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 | | |
| 王艺伟 | 交银周期回报灵活配置混合、交银新回报灵活配置混合、交银多策略回报灵活配置混合、交银荣鑫灵活配置混合、交银优选回报灵活配置混合、交银优择回报灵活配置混合、交银瑞鑫定期开放灵活配置混 | 2019 年 11 月 28 日 | - | 10 年 | 王艺伟女士，北京大学经济学硕士，吉林大学经济学学士、理学学士。2012 年-2014 年任光大证券研究所宏观分析师。2014 年 9 月加入交银施罗德基金管理有限公司，历任研究员、研究部助理总经理、基金经理助理。2019 年 11 月 28 日至 2022 年 1 月 26 日担任交银施罗德安心收益债券型证券投资基金的基金经理。 |

| | | | | | |
|-----|----------------------------|------------------|---|------|--|
| | 合、交银恒益灵活配置混合、交银臻选回报混合的基金经理 | | | | |
| 余李平 | 交银荣鑫灵活配置混合的基金经理 | 2022 年 03 月 12 日 | - | 11 年 | 余李平先生，上海财经大学金融学硕士。2009 年于中诚信证券评估有限公司任信用分析师，2009 年至 2011 年于中央电视台财经频道任财经记者，2011 年至 2014 年任湘财证券研究所研究员，2014 年至 2015 年任光大证券研究所研究员。2015 年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任研究部行业分析师、固定收益部基金经理助理。 |

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

本报告期内，宏观基本面影响因素较为复杂，市场在稳增长宽信用政策加码与国内外多因素冲击和基本面“弱现实”之间来回徘徊，长债收益率整体呈现区间震荡走势。年初在央行避免“信贷塌方”表态下，市场宽松货币预期走强，债市收益率明显下行。春节后受海外流动性收紧、国内信贷总量数据较好，市场预期宽信用底部信号明确，债市收益率上行并回吐前期涨幅。二月下旬起，先后受俄乌冲突加剧和国内疫情扩散影响，市场对国内经济基本面预期的波动加大，长债收益率在疫情防控效果、复工复产进展、宽信用政策节奏和力度、经济基本面修复情况等多空因素影响下呈现区间震荡走势。

本报告期内权益市场呈现先抑后扬的深 V 走势。受包括海外流动性紧缩、地缘政治冲突和国内疫情蔓延等多种因素的相继影响，市场自年初开始呈现单边大幅下跌走势，仅稳增长相关板块和资源品较为抗跌，高估值成长板块跌幅较大。四月底随着悲观情绪充分释放，国内复工复产逐渐推进以及政策刺激的持续发力，市场开始显著反弹，其中汽车板块和前期跌幅较大新能源产业链涨幅明显，稳增长板块表现落后。报告期内，煤炭板块表现一枝独秀，消费服务及地产稳增长行业表现靠前，TMT 表现靠后。

在基金操作中，债券部分我们降低了组合久期，并择机增配收益相对较高的短久期高等级信用债。权益方面，组合一季度整体维持稳增长和价值股方向的投资布局，仓位整体保持稳定。二季度视疫情防控和宏观基本面的变化，组合仓位动态有所调整，配置方向上逐渐从稳增长价值往成长价值均衡配置调整，增持高景气度板块以及高性价比优质成长个股。

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 2022 年下半年，我们预计稳增长仍然是政策主基调，宽信用政策效果有望逐渐显现，但仍需观察国内基本面恢复的节奏和货币政策的边际变化趋势，外部因素则需考虑海外通胀与货币紧缩的节奏。

债券底仓方面，我们将维持中短久期高等级信用债的配置。权益方面，我们将保持对持仓个股的深度研究跟踪，同时密切关注宏观基本面和行业景气度变化，加大对高景气成长行业和中小市值优质高成长个股的研究和配置力度。此外，我们将会合理评估一级市场投资机会，努力为持有人增厚组合收益。

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

本报告期内，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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

本报告期内，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、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方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，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

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确和完整。

§ 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：交银施罗德荣鑫灵活配置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 |
|------------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 4,431,837.90 | 4,064,257.34 |
| 结算备付金 | | 31,800,814.93 | 8,306,872.76 |
| 存出保证金 | | 198,773.74 | 93,976.12 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 1,295,841,300.20 | 1,469,084,131.33 |
| 其中：股票投资 | | 303,728,964.67 | 266,748,048.93 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 992,112,335.53 | 1,202,336,082.40 |
| 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 | 159,000,000.00 | 43,000,000.00 |

| | | | |
|---------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 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 | | 152,067.62 | 1,927,451.41 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 217,947.03 | 144,023.59 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.8 | - | 19,953,482.12 |
| 资产总计 | | 1,491,642,741.42 | 1,546,574,194.67 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2022年6月30日 | 上年度末 2021年12月31日 |
| 负 债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付清算款 | | 1,806,068.45 | 1,680,810.61 |
| 应付赎回款 | | 2,224,697.63 | 119,653.35 |
| 应付管理人报酬 | | 752,304.17 | 716,072.20 |
| 应付托管费 | | 250,768.07 | 238,690.73 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 72,370.45 | 68,825.22 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.9 | 768,331.47 | 402,011.34 |
| 负债合计 | | 5,874,540.24 | 3,226,063.45 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.10 | 1,080,757,225.43 | 1,123,116,096.97 |
| 其他综合收益 | 6.4.7.11 | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.12 | 405,010,975.75 | 420,232,034.25 |
| 净资产合计 | | 1,485,768,201.18 | 1,543,348,131.22 |
| 负债和净资产总计 | | 1,491,642,741.42 | 1,546,574,194.67 |

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.375 元，基金份额总额 1,080,757,225.43 份。

6.2 利润表

会计主体：交银施罗德荣鑫灵活配置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 |
|------------------------|--------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 一、营业总收入 | | -327,549.65 | 38,452,922.32 |
| 1. 利息收入 | | 2,280,562.24 | 13,410,910.74 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.13 | 227,287.49 | 66,621.80 |
| 债券利息收入 | | - | 12,893,379.23 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 2,053,274.75 | 450,909.71 |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | -3,564,741.64 | 31,791,720.40 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.14 | -20,677,797.69 | 31,924,576.10 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.15 | 15,162,023.42 | -1,640,152.75 |
| 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 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.19 | 1,951,032.63 | 1,507,297.05 |
| 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 | 194,461.46 | -6,751,727.41 |
| 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 | 762,168.29 | 2,018.59 |
| 减：二、营业总支出 | | 6,694,014.42 | 4,366,856.32 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 4,893,581.05 | 2,783,974.44 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 1,631,193.68 | 927,991.46 |
| 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 | | 831.93 | 82,658.28 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 831.93 | 82,658.28 |
| 6. 信用减值损失 | 6.4.7.22 | - | - |
| 7. 税金及附加 | | 64,114.31 | 43,523.70 |

| | | | |
|---------------------|----------|---------------|---------------|
| 8. 其他费用 | 6.4.7.23 | 104,293.45 | 528,708.44 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -7,021,564.07 | 34,086,066.00 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -7,021,564.07 | 34,086,066.00 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | -7,021,564.07 | 34,086,066.00 |

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：交银施罗德荣鑫灵活配置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） | 1,123,116,096.97 | - | 420,232,034.25 | 1,543,348,131.22 |
| 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） | 1,123,116,096.97 | - | 420,232,034.25 | 1,543,348,131.22 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -42,358,871.54 | - | -15,221,058.50 | -57,579,930.04 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | -7,021,564.07 | -7,021,564.07 |
| （二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动 | -42,358,871.54 | - | -8,199,494.43 | -50,558,365.97 |

| | | | | |
|--|--|--------|-----------------|------------------|
| 数 (净值减少以“-”号填列) | | | | |
| 其中：1. 基金申购款 | 365,337,227.34 | - | 135,138,688.63 | 500,475,915.97 |
| 2. 基金赎回款 | -407,696,098.88 | - | -143,338,183.06 | -551,034,281.94 |
| (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、本期期末净资产(基金净值) | 1,080,757,225.43 | - | 405,010,975.75 | 1,485,768,201.18 |
| 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) | 764,173,135.28 | - | 202,082,438.70 | 966,255,573.98 |
| 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) | 764,173,135.28 | - | 202,082,438.70 | 966,255,573.98 |

| | | | | |
|--|-----------------|---|----------------|------------------|
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | 13,987,921.11 | - | 39,859,713.91 | 53,847,635.02 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | 34,086,066.00 | 34,086,066.00 |
| （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） | 13,987,921.11 | - | 5,773,647.91 | 19,761,569.02 |
| 其中：1. 基金申购款 | 342,509,104.88 | - | 98,878,717.19 | 441,387,822.07 |
| 2. 基金赎回款 | -328,521,183.77 | - | -93,105,069.28 | -421,626,253.05 |
| （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） | 778,161,056.39 | - | 241,942,152.61 | 1,020,103,209.00 |

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

交银施罗德荣鑫灵活配置混合型证券投资基金是由原交银施罗德荣鑫保本混合型证券投资基金(以下简称“原基金”)转型而来。原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[2016]449号《关于准予交银施罗德荣鑫保本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《交银施罗德荣鑫保本混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。原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 988,871,434.55 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(2016)第 325 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《交银施罗德荣鑫保本混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 3 月 25 日正式生效,原基金合同生效日的基金份额总额为 988,953,938.88 份基金份额,其中认购资金利息折合 82,504.33 份基金份额。

根据《交银施罗德荣鑫保本混合型证券投资基金基金合同》的有关约定,原基金的保本周期为三年。原基金第一个保本周期自本基金基金合同生效日起至三个公历年后对应日止(如该对应日为非工作日,保本周期到期日顺延至下一个工作日)。原基金保本周期届满时,在符合本基金存续条件下,原基金继续存续并转入下一保本周期。在不符合本基金存续条件下,原基金变更为非保本的混合型基金,基金名称相应变更为“交银施罗德荣鑫灵活配置混合型证券投资基金”。

根据《交银施罗德荣鑫保本混合型证券投资基金基金合同》及《交银施罗德荣鑫保本混合型证券投资基金保本周期到期安排及转型为交银施罗德荣鑫灵活配置混合型证券投资基金后运作相关业务规则的公告》,原基金保本周期到期因未能符合本基金存续条件,按照基金合同的约定自 2019 年 3 月 29 日起转型为“交银施罗德荣鑫灵活配置混合型证券投资基金”(以下简称“本基金”)。转型后基金的投资目标、投资范围、投资策略、投资比例、业绩比较基准、估值方法、申赎原则、收益分配及基金费率等按照《交银施罗德荣鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》相关规定进行运作。原《交银施罗德荣鑫保本混合型证券投资基金基金合同》自 2019 年 3 月 29 日起失效,《交银施罗德荣鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于同一日生效,并已报中国证监会备案。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为交银施罗德基金管理有限公司,基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德荣鑫灵活配置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、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(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 0%-95%，股票资产按照基金所持有的股票市值以及买入、卖出股指期货合约价值合计(轧差计算)；权证的投资比例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、存出保证金和应收申购款等；基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%。本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率×50%+中债综合全价指数收益率×50%。

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》、《交银施罗德荣鑫灵活配置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业务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业务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、买入返售金融资产、应收利息、应收证券清算款和应收申购款，金额分别为 4,064,257.34 元、8,306,872.76 元、93,976.12 元、43,000,000.00 元、19,953,482.12 元、1,927,451.41 元和

144,023.59 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、买入返售金融资产、其他资产-应收利息、应收清算款和应收申购款，金额分别为 4,066,413.00 元、8,310,977.43 元、94,022.65 元、42,984,767.81 元、0.00 元、1,927,451.41 元和 144,823.69 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 1,469,084,131.33 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 1,489,045,738.68 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、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 1,680,810.61 元、119,653.35 元、716,072.20 元、238,690.73 元、222,425.33 元和 286.01 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、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 1,680,810.61 元、119,653.35 元、716,072.20 元、238,690.73 元、222,425.33 元和 286.01 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[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 2022 年 6 月 30 日 |
|--------|------------------------|
| 活期存款 | 4,431,837.90 |
| 等于：本金 | 4,431,039.57 |
| 加：应计利息 | 798.33 |
| 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 | 4,431,837.90 |

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 | 274,641,892.73 | - | 303,728,964.67 | 29,087,071.94 | |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - | - | |
| 债券 | 交易所市场 | 424,663,471.57 | 5,947,722.11 | 430,463,600.51 | -147,593.17 |
| | 银行间市场 | 555,770,383.67 | 6,900,735.02 | 561,648,735.02 | -1,022,383.67 |
| | 合计 | 980,433,855.24 | 12,848,457.13 | 992,112,335.53 | -1,169,976.84 |
| 资产支持证券 | - | - | - | - | |
| 基金 | - | - | - | - | |
| 其他 | - | - | - | - | |
| 合计 | 1,255,075,747.97 | 12,848,457.13 | 1,295,841,300.20 | 27,917,095.10 | |

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

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

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

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 | |
|-------|------------------------|-----------|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 159,000,000.00 | - |
| 银行间市场 | - | - |
| 合计 | 159,000,000.00 | - |

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 | 89.31 |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 674,639.60 |
| 其中：交易所市场 | 674,014.60 |
| 银行间市场 | 625.00 |
| 应付利息 | - |
| 预提审计费 | 24,795.19 |
| 预提信息披露费 | 59,507.37 |
| 预提账户维护费 | 9,300.00 |
| 合计 | 768,331.47 |

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 | 1,123,116,096.97 | 1,123,116,096.97 |
| 本期申购 | 365,337,227.34 | 365,337,227.34 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -407,696,098.88 | -407,696,098.88 |
| 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 | 1,080,757,225.43 | 1,080,757,225.43 |

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。

6.4.7.11 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 | 379,807,734.16 | 40,424,300.09 | 420,232,034.25 |
| 本期利润 | -7,216,025.53 | 194,461.46 | -7,021,564.07 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -14,307,019.96 | 6,107,525.53 | -8,199,494.43 |
| 其中：基金申购款 | 124,475,129.97 | 10,663,558.66 | 135,138,688.63 |
| 基金赎回款 | -138,782,149.93 | -4,556,033.13 | -143,338,183.06 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 358,284,688.67 | 46,726,287.08 | 405,010,975.75 |

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 | 50,139.01 |
| 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 | 174,846.34 |
| 其他 | 2,302.14 |
| 合计 | 227,287.49 |

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 | -20,677,797.69 |
| 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 | -20,677,797.69 |

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 | 559,560,246.23 |
| 减：卖出股票成本总额 | 578,458,267.37 |
| 减：交易费用 | 1,779,776.55 |
| 买卖股票差价收入 | -20,677,797.69 |

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 | 18,561,041.76 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | -3,399,018.34 |
| 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 | 15,162,023.42 |

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 | 424,042,296.77 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 415,344,408.93 |
| 减：应计利息总额 | 12,095,480.44 |
| 减：交易费用 | 1,425.74 |
| 买卖债券差价收入 | -3,399,018.34 |

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

无。

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 | 1,951,032.63 |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | - |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 1,951,032.63 |

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 | 194,461.46 |
| 股票投资 | -2,247,612.68 |
| 债券投资 | 2,442,074.14 |
| 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 | 194,461.46 |

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------|---------------------------------|
| | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
| 基金赎回费收入 | 762,168.29 |
| 合计 | 762,168.29 |

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。

6.4.7.22 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 | 24,795.19 |

| | |
|---------|------------|
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行费用 | 1,065.00 |
| 债券账户费用 | 18,600.00 |
| 存托服务费 | 325.89 |
| 合计 | 104,293.45 |

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 |
| 中国民生银行股份有限公司（“民生银行”） | 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 | 4,893,581.05 | 2,783,974.44 |
| 其中：支付销售机构的客户维护 费 | 738,855.37 | 200,035.40 |

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.6% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.6\% \div \text{当年天数}。$$

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 | 1,631,193.68 | 927,991.46 |

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.2% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.2\% \div \text{当年天数}。$$

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 |
| 民生银行_活期存款 | 4,431,837.90 | 50,139.01 | 3,336,242.61 | 23,830.78 |

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 | 兆讯传媒 | 2022 年 3 月 15 日 | 6 个月以上 | 限售股 | 39.88 | 31.09 | 642 | 25,602.96 | 19,959.78 | - |
| 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 | - |
| 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 | 135 | - | 11,172.60 | - |
| 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 | 6 个月以上 | 限售股 | 173.98 | 87.82 | 309 | 53,759.82 | 27,136.38 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|-----------------|------------|-------|-------|--------|--------|------------|--------------|---|
| | | 10 日 | | | | | | | | |
| 301219 | 腾远钴业 | 2022 年 5 月 24 日 | 1-6 个月 (含) | 限售股送股 | - | 87.82 | 247 | - | 21,691.54 | - |
| 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 | 6 个月以上 | 限售股 | 33.65 | 33.65 | 575 | 19,348.75 | 19,348.75 | - |
| 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 | - |
| 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 | - |
| 600938 | 中国海油 | 2022 年 4 月 14 日 | 6 个月以上 | 限售股 | 10.80 | 15.86 | 84,004 | 907,243.20 | 1,332,303.44 | - |
| 688072 | 拓荆科技 | 2022 年 4 月 12 日 | 6 个月以上 | 限售股 | 71.88 | 139.78 | 5,300 | 380,964.00 | 740,834.00 | - |
| 688237 | 超卓航科 | 2022 年 6 月 24 日 | 6 个月以上 | 限售股 | 41.27 | 41.27 | 2,891 | 119,311.57 | 119,311.57 | - |
| 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 | - |

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、上表所披露的受限期指自该证券实际取得之日起至可流通日之间的受限期限。

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）、债券、中期票据、货币市场工具、权证、资产支持证券、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（但须符合中国证监会相关规定）。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相对风险控制在限定的范围之内，在严格控制投资风险和保持资产流动性的基础上，力争实现基金资产的长期稳定增值。

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內。

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民生银行股份有限公司，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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2022年6月30日 | 上年度末 2021年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1 | - | - |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | 155,994,626.41 | 119,842,898.40 |
| 合计 | 155,994,626.41 | 119,842,898.40 |

注：未评级部分为国债、政策性金融债、企业短期融资券和企业超短期融资券。

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

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2022年6月30日 | 上年度末 2021年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1 | - | - |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | 19,576,252.82 | 87,501,000.00 |
| 合计 | 19,576,252.82 | 87,501,000.00 |

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2022年6月30日 | 上年度末 2021年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA | 763,166,480.62 | 922,778,734.00 |
| AAA 以下 | - | - |
| 未评级 | 53,374,975.68 | 72,213,450.00 |
| 合计 | 816,541,456.30 | 994,992,184.00 |

注：未评级部分为国债、政策性金融债和中期票据。

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 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》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。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及买入返售金融资产等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 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 | 4,431,837.90 | - | - | - | 4,431,837.90 |
| 结算备付金 | 31,800,814.93 | - | - | - | 31,800,814.93 |
| 存出保证金 | 198,773.74 | - | - | - | 198,773.74 |
| 交易性金融资产 | 645,295,802.33 | 344,021,394.70 | 2,795,138.50 | 303,728,964.67 | 1,295,841,300.20 |
| 买入返售金融资产 | 159,000,000.00 | - | - | - | 159,000,000.00 |
| 应收申购款 | - | - | - | 217,947.03 | 217,947.03 |
| 应收清算款 | - | - | - | 152,067.62 | 152,067.62 |
| 资产总计 | 840,727,228.90 | 344,021,394.70 | 2,795,138.50 | 304,098,979.32 | 1,491,642,741.42 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 2,224,697.63 | 2,224,697.63 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 752,304.17 | 752,304.17 |
| 应付托管费 | - | - | - | 250,768.07 | 250,768.07 |
| 应付清算款 | - | - | - | 1,806,068.45 | 1,806,068.45 |
| 应交税费 | - | - | - | 72,370.45 | 72,370.45 |
| 其他负债 | - | - | - | 768,331.47 | 768,331.47 |
| 负债总计 | - | - | - | 5,874,540.24 | 5,874,540.24 |
| 利率敏感度缺口 | 840,727,228.90 | 344,021,394.70 | 2,795,138.50 | 298,224,439.08 | 1,485,768,201.18 |
| 上年度末 2021年12月31日 | | | | | |
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 4,064,257.34 | - | - | - | 4,064,257.34 |

| | | | | | |
|----------|----------------|----------------|--------------|----------------|------------------|
| 结算备付金 | 8,306,872.76 | - | - | - | 8,306,872.76 |
| 存出保证金 | 93,976.12 | - | - | - | 93,976.12 |
| 交易性金融资产 | 521,607,348.40 | 677,169,054.00 | 3,559,680.00 | 266,748,048.93 | 1,469,084,131.33 |
| 买入返售金融资产 | 43,000,000.00 | - | - | - | 43,000,000.00 |
| 应收申购款 | - | - | - | 144,023.59 | 144,023.59 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 1,927,451.41 | 1,927,451.41 |
| 其他资产 | - | - | - | 19,953,482.12 | 19,953,482.12 |
| 资产总计 | 577,072,454.62 | 677,169,054.00 | 3,559,680.00 | 288,773,006.05 | 1,546,574,194.67 |
| 负债 | - | - | - | - | - |
| 应付赎回款 | - | - | - | 119,653.35 | 119,653.35 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 716,072.20 | 716,072.20 |
| 应付托管费 | - | - | - | 238,690.73 | 238,690.73 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 1,680,810.61 | 1,680,810.61 |
| 应交税费 | - | - | - | 68,825.22 | 68,825.22 |
| 其他负债 | - | - | - | 402,011.34 | 402,011.34 |
| 负债总计 | - | - | - | 3,226,063.45 | 3,226,063.45 |
| 利率敏感度缺口 | 577,072,454.62 | 677,169,054.00 | 3,559,680.00 | 285,546,942.60 | 1,543,348,131.22 |

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

| 假设 | 除市场利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 | 市场利率上升 25 个基点 | -2,154,131.20 | -3,023,770.11 |
| | 市场利率下降 25 个基点 | 2,165,325.87 | 3,042,292.66 |

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。本基金股票资产（含存托凭证）占基金资产的 0%-95%，股票资产按照基金所持有的股票市值以及买入、卖出股指期货合约价值合计（轧差计算）；权证的投资比例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、存出保证金和应收申购款等；基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%。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 | 303,728,964.67 | 20.44 | 266,748,048.93 | 17.28 |
| 交易性金融资产—基金投资 | — | — | — | — |
| 交易性金融资产—债券投资 | 6,365,314.57 | 0.43 | 4,738,734.00 | 0.31 |
| 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 | 310,094,279.24 | 20.87 | 271,486,782.93 | 17.59 |

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(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% | 23,526,577.32 | - |
| | 2. 业绩比较基准下降 5% | -23,526,577.32 | - |

注:于 2021 年 12 月 31 日,本基金持有的交易性权益类投资、可转换债券及可交换债券公允价值占基金资产净值的比例为 17.59%,因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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 | 305,261,498.13 | 265,680,934.32 |

| | | |
|------|------------------|------------------|
| 第二层次 | 988,017,857.75 | 1,200,978,863.09 |
| 第三层次 | 2,561,944.32 | 2,424,333.92 |
| 合计 | 1,295,841,300.20 | 1,469,084,131.33 |

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 | 303,728,964.67 | 20.36 |
| | 其中：股票 | 303,728,964.67 | 20.36 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 992,112,335.53 | 66.51 |
| | 其中：债券 | 992,112,335.53 | 66.51 |
| | 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 | 159,000,000.00 | 10.66 |
| | 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 | 36,232,652.83 | 2.43 |
| 8 | 其他各项资产 | 568,788.39 | 0.04 |
| 9 | 合计 | 1,491,642,741.42 | 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 | 18,189,308.89 | 1.22 |
| C | 制造业 | 214,407,712.64 | 14.43 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 5,733,210.00 | 0.39 |
| F | 批发和零售业 | 35,764.40 | 0.00 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 15,759,940.00 | 1.06 |
| H | 住宿和餐饮业 | 6,495,819.30 | 0.44 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 21,295,447.94 | 1.43 |
| J | 金融业 | 10,300,208.00 | 0.69 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 40,699.23 | 0.00 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 5,042,806.70 | 0.34 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 139,789.02 | 0.01 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 193,386.55 | 0.01 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 6,094,872.00 | 0.41 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 303,728,964.67 | 20.44 |

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 | 002594 | 比亚迪 | 44,400 | 14,806,956.00 | 1.00 |
| 2 | 300896 | 爱美客 | 24,100 | 14,460,241.00 | 0.97 |
| 3 | 603613 | 国联股份 | 160,072 | 14,182,379.20 | 0.95 |
| 4 | 603799 | 华友钴业 | 137,290 | 13,127,669.80 | 0.88 |
| 5 | 601012 | 隆基绿能 | 192,496 | 12,826,008.48 | 0.86 |
| 6 | 002049 | 紫光国微 | 63,100 | 11,971,332.00 | 0.81 |
| 7 | 300059 | 东方财富 | 405,520 | 10,300,208.00 | 0.69 |
| 8 | 002352 | 顺丰控股 | 175,000 | 9,766,750.00 | 0.66 |
| 9 | 603816 | 顾家家居 | 170,300 | 9,644,089.00 | 0.65 |
| 10 | 002371 | 北方华创 | 34,400 | 9,532,928.00 | 0.64 |
| 11 | 600418 | 江淮汽车 | 551,400 | 9,462,024.00 | 0.64 |

| | | | | | |
|----|--------|-------|-----------|--------------|------|
| 12 | 603501 | 韦尔股份 | 49,900 | 8,634,197.00 | 0.58 |
| 13 | 301035 | 润丰股份 | 100,033 | 8,247,720.85 | 0.56 |
| 14 | 603986 | 兆易创新 | 55,760 | 7,929,629.60 | 0.53 |
| 15 | 688036 | 传音控股 | 87,460 | 7,804,055.80 | 0.53 |
| 16 | 600399 | 抚顺特钢 | 410,900 | 7,355,110.00 | 0.50 |
| 17 | 600702 | 舍得酒业 | 35,800 | 7,302,842.00 | 0.49 |
| 18 | 000983 | 山西焦煤 | 506,600 | 6,783,374.00 | 0.46 |
| 19 | 689009 | 九号公司 | 151,678 | 6,749,671.00 | 0.45 |
| 20 | 600089 | 特变电工 | 241,000 | 6,600,990.00 | 0.44 |
| 21 | 688232 | 新点软件 | 173,601 | 6,530,869.62 | 0.44 |
| 22 | 605108 | 同庆楼 | 275,130 | 6,495,819.30 | 0.44 |
| 23 | 300432 | 富临精工 | 294,115 | 6,470,530.00 | 0.44 |
| 24 | 300413 | 芒果超媒 | 182,700 | 6,094,872.00 | 0.41 |
| 25 | 000725 | 京东方 A | 1,545,600 | 6,089,664.00 | 0.41 |
| 26 | 000568 | 泸州老窖 | 24,700 | 6,089,538.00 | 0.41 |
| 27 | 603517 | 绝味食品 | 105,200 | 6,082,664.00 | 0.41 |
| 28 | 300274 | 阳光电源 | 61,900 | 6,081,675.00 | 0.41 |
| 29 | 600009 | 上海机场 | 105,700 | 5,993,190.00 | 0.40 |
| 30 | 000498 | 山东路桥 | 593,500 | 5,733,210.00 | 0.39 |
| 31 | 000913 | 钱江摩托 | 292,500 | 5,136,300.00 | 0.35 |
| 32 | 600188 | 兖矿能源 | 128,400 | 5,069,232.00 | 0.34 |
| 33 | 002046 | 国机精工 | 341,900 | 4,677,192.00 | 0.31 |
| 34 | 688122 | 西部超导 | 49,807 | 4,592,205.40 | 0.31 |
| 35 | 300416 | 苏试试验 | 182,800 | 4,493,224.00 | 0.30 |
| 36 | 300707 | 威唐工业 | 260,900 | 4,411,819.00 | 0.30 |
| 37 | 000975 | 银泰黄金 | 449,300 | 4,376,182.00 | 0.29 |
| 38 | 002669 | 康达新材 | 321,200 | 4,291,232.00 | 0.29 |
| 39 | 600938 | 中国海油 | 120,005 | 1,960,520.89 | 0.13 |
| 40 | 688072 | 拓荆科技 | 5,300 | 740,834.00 | 0.05 |
| 41 | 688238 | 和元生物 | 12,836 | 349,909.36 | 0.02 |
| 42 | 688320 | 禾川科技 | 6,048 | 312,076.80 | 0.02 |
| 43 | 688112 | 鼎阳科技 | 4,901 | 299,647.14 | 0.02 |
| 44 | 688167 | 炬光科技 | 2,014 | 299,582.50 | 0.02 |
| 45 | 688119 | 中钢洛耐 | 33,327 | 293,944.14 | 0.02 |
| 46 | 688400 | 凌云光 | 13,111 | 287,524.23 | 0.02 |
| 47 | 301302 | 华如科技 | 4,651 | 282,999.62 | 0.02 |
| 48 | 688325 | 赛微微电 | 4,039 | 247,186.80 | 0.02 |
| 49 | 688789 | 宏华数科 | 1,400 | 230,482.00 | 0.02 |
| 50 | 301239 | 普瑞眼科 | 5,747 | 193,386.55 | 0.01 |
| 51 | 688768 | 容知日新 | 2,072 | 156,601.76 | 0.01 |
| 52 | 688265 | 南模生物 | 2,374 | 152,007.22 | 0.01 |
| 53 | 688251 | 井松智能 | 3,392 | 141,853.44 | 0.01 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-------|------------|------|
| 54 | 301259 | 艾布鲁 | 4,828 | 139,789.02 | 0.01 |
| 55 | 301190 | 善水科技 | 5,741 | 136,233.93 | 0.01 |
| 56 | 688237 | 超卓航科 | 2,891 | 119,311.57 | 0.01 |
| 57 | 688267 | 中触媒 | 3,390 | 113,327.70 | 0.01 |
| 58 | 301238 | 瑞泰新材 | 3,497 | 112,148.79 | 0.01 |
| 59 | 688121 | 卓然股份 | 3,681 | 89,485.11 | 0.01 |
| 60 | 688786 | 悦安新材 | 1,513 | 68,992.80 | 0.00 |
| 61 | 001270 | 铖昌科技 | 568 | 57,481.60 | 0.00 |
| 62 | 301219 | 腾远钴业 | 556 | 48,827.92 | 0.00 |
| 63 | 301200 | 大族数控 | 857 | 44,495.44 | 0.00 |
| 64 | 601089 | 福元医药 | 1,749 | 36,816.45 | 0.00 |
| 65 | 301177 | 迪阿股份 | 482 | 35,764.40 | 0.00 |
| 66 | 301150 | 中一科技 | 404 | 33,435.04 | 0.00 |
| 67 | 301216 | 万凯新材 | 1,120 | 33,420.80 | 0.00 |
| 68 | 301207 | 华兰疫苗 | 569 | 32,102.98 | 0.00 |
| 69 | 001323 | 慕思股份 | 573 | 28,111.38 | 0.00 |
| 70 | 301089 | 拓新药业 | 220 | 27,636.40 | 0.00 |
| 71 | 603191 | 望变电气 | 1,149 | 26,197.20 | 0.00 |
| 72 | 301069 | 凯盛新材 | 539 | 24,853.29 | 0.00 |
| 73 | 301266 | 宇邦新材 | 517 | 24,335.19 | 0.00 |
| 74 | 603206 | 嘉环科技 | 1,210 | 23,353.00 | 0.00 |
| 75 | 301096 | 百诚医药 | 272 | 21,488.00 | 0.00 |
| 76 | 301122 | 采纳股份 | 301 | 21,181.37 | 0.00 |
| 77 | 001228 | 永泰运 | 383 | 20,739.45 | 0.00 |
| 78 | 002230 | 科大讯飞 | 500 | 20,610.00 | 0.00 |
| 79 | 301102 | 兆讯传媒 | 642 | 19,959.78 | 0.00 |
| 80 | 301091 | 深城交 | 681 | 18,591.30 | 0.00 |
| 81 | 301149 | 隆华新材 | 1,214 | 18,586.34 | 0.00 |
| 82 | 301256 | 华融化学 | 1,831 | 18,456.48 | 0.00 |
| 83 | 301286 | 侨源股份 | 784 | 15,515.36 | 0.00 |
| 84 | 301168 | 通灵股份 | 329 | 14,831.32 | 0.00 |
| 85 | 301189 | 奥尼电子 | 435 | 14,489.85 | 0.00 |
| 86 | 603097 | 江苏华辰 | 577 | 13,617.20 | 0.00 |
| 87 | 301118 | 恒光股份 | 315 | 13,554.45 | 0.00 |
| 88 | 301100 | 风光股份 | 599 | 12,926.42 | 0.00 |
| 89 | 301097 | 天益医疗 | 249 | 11,909.67 | 0.00 |
| 90 | 001268 | 联合精密 | 409 | 11,337.48 | 0.00 |
| 91 | 301196 | 唯科科技 | 271 | 10,167.92 | 0.00 |
| 92 | 603272 | 联翔股份 | 443 | 9,723.85 | 0.00 |
| 93 | 301135 | 瑞德智能 | 338 | 8,875.88 | 0.00 |
| 94 | 301110 | 青木股份 | 202 | 8,049.70 | 0.00 |
| 95 | 301133 | 金钟股份 | 286 | 7,942.22 | 0.00 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-----|----------|------|
| 96 | 301228 | 实朴检测 | 373 | 7,586.82 | 0.00 |
| 97 | 301083 | 百胜智能 | 416 | 5,807.36 | 0.00 |
| 98 | 600559 | 老白干酒 | 26 | 745.94 | 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 | 601012 | 隆基绿能 | 17,801,651.60 | 1.15 |
| 2 | 000002 | 万科 A | 15,783,664.60 | 1.02 |
| 3 | 300059 | 东方财富 | 15,631,569.60 | 1.01 |
| 4 | 603613 | 国联股份 | 12,492,835.05 | 0.81 |
| 5 | 603501 | 韦尔股份 | 12,226,590.00 | 0.79 |
| 6 | 002049 | 紫光国微 | 12,220,005.00 | 0.79 |
| 7 | 002594 | 比亚迪 | 12,208,989.00 | 0.79 |
| 8 | 300896 | 爱美客 | 12,178,190.00 | 0.79 |
| 9 | 601988 | 中国银行 | 11,515,254.00 | 0.75 |
| 10 | 603986 | 兆易创新 | 10,958,964.00 | 0.71 |
| 11 | 600399 | 抚顺特钢 | 10,704,299.91 | 0.69 |
| 12 | 601668 | 中国建筑 | 10,375,693.00 | 0.67 |
| 13 | 300413 | 芒果超媒 | 9,840,779.45 | 0.64 |
| 14 | 002371 | 北方华创 | 9,413,724.00 | 0.61 |
| 15 | 603599 | 广信股份 | 9,363,275.00 | 0.61 |
| 16 | 000776 | 广发证券 | 9,229,879.00 | 0.60 |
| 17 | 002352 | 顺丰控股 | 9,223,626.00 | 0.60 |
| 18 | 002555 | 三七互娱 | 9,165,626.00 | 0.59 |
| 19 | 000792 | 盐湖股份 | 9,143,965.00 | 0.59 |
| 20 | 300138 | 晨光生物 | 8,567,511.00 | 0.56 |

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 | 601117 | 中国化学 | 20,715,775.00 | 1.34 |
| 2 | 000002 | 万科 A | 18,013,307.33 | 1.17 |
| 3 | 002555 | 三七互娱 | 16,588,239.00 | 1.07 |
| 4 | 000786 | 北新建材 | 15,222,252.35 | 0.99 |
| 5 | 601800 | 中国交建 | 14,027,140.00 | 0.91 |
| 6 | 600323 | 瀚蓝环境 | 11,528,912.90 | 0.75 |
| 7 | 601166 | 兴业银行 | 11,363,868.40 | 0.74 |
| 8 | 601988 | 中国银行 | 11,336,028.00 | 0.73 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 9 | 601668 | 中国建筑 | 11,252,783.00 | 0.73 |
| 10 | 600905 | 三峡能源 | 10,532,093.62 | 0.68 |
| 11 | 603599 | 广信股份 | 10,320,918.20 | 0.67 |
| 12 | 601658 | 邮储银行 | 10,006,378.02 | 0.65 |
| 13 | 600570 | 恒生电子 | 9,543,788.88 | 0.62 |
| 14 | 600585 | 海螺水泥 | 9,476,629.20 | 0.61 |
| 15 | 000776 | 广发证券 | 9,323,395.00 | 0.60 |
| 16 | 000792 | 盐湖股份 | 9,009,454.00 | 0.58 |
| 17 | 002841 | 视源股份 | 8,848,115.00 | 0.57 |
| 18 | 300138 | 晨光生物 | 8,595,305.84 | 0.56 |
| 19 | 601857 | 中国石油 | 7,864,624.00 | 0.51 |
| 20 | 002493 | 荣盛石化 | 7,738,405.00 | 0.50 |

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 | 617,686,795.79 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 559,560,246.23 |

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 | 78,606,092.62 | 5.29 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 29,354,968.10 | 1.98 |
| | 其中：政策性金融债 | 29,354,968.10 | 1.98 |
| 4 | 企业债券 | 336,740,874.53 | 22.66 |
| 5 | 企业短期融资券 | 70,460,450.96 | 4.74 |
| 6 | 中期票据 | 451,008,381.93 | 30.36 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 6,365,314.57 | 0.43 |
| 8 | 同业存单 | 19,576,252.82 | 1.32 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 992,112,335.53 | 66.77 |

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 | 019664 | 21 国债 16 | 674,930 | 68,604,082.71 | 4.62 |
| 2 | 136557 | 16 国寿投 | 400,000 | 41,489,832.33 | 2.79 |

| | | | | | |
|---|-----------|-------------------|---------|---------------|------|
| 3 | 188590 | 国电投 09 | 400,000 | 41,032,867.94 | 2.76 |
| 4 | 102001052 | 20 宝武集团 MTN001 | 400,000 | 40,095,112.33 | 2.70 |
| 5 | 042280239 | 22 电网 CP005 | 400,000 | 39,969,231.78 | 2.69 |

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

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 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 | 198,773.74 |
| 2 | 应收清算款 | 152,067.62 |
| 3 | 应收股利 | - |

| | | |
|---|-------|------------|
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 217,947.03 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 568,788.39 |

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 | 2,795,138.50 | 0.19 |
| 2 | 110059 | 浦发转债 | 1,182,946.24 | 0.08 |
| 3 | 110079 | 杭银转债 | 716,615.39 | 0.05 |

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 (%) |
| 13,503 | 80,038.30 | 1,034,826,828.59 | 95.75 | 45,930,396.84 | 4.25 |

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 | 7,473.21 | 0.00 |

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

无。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|------------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2019 年 3 月 29 日） 基金份额总额 | 117,888,498.13 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 1,123,116,096.97 |
| 本报告期基金总申购份额 | 365,337,227.34 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 407,696,098.88 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 1,080,757,225.43 |

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：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

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
本报告期内，托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中未受到相关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 | 1,162,733,352.34 | 100.00 | 1,082,979.94 | 100.00 | - |

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 | 69,617,201.30 | 100.00 | 25,491,200,000.00 | 100.00 | - | - |

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 | 交银施罗德荣鑫灵活配置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 | 交银施罗德基金管理有限公司关于自有资金拟购买旗下偏股型基金的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站 | 2022 年 01 月 29 日 |
| 3 | 交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德荣鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更的公告 | 上海证券报、公司网站 | 2022 年 03 月 12 日 |
| 4 | 交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金可投资北交所上市股票的风险提示性公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站 | 2022 年 03 月 15 日 |
| 5 | 交银施罗德荣鑫灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新 | 公司网站 | 2022 年 03 月 16 日 |

| | | | |
|----|---|-----------------------|------------------|
| | (2022 年第 1 号) | | |
| 6 | 交银施罗德荣鑫灵活配置混合型证券投资基金(更新)招募说明书(2022 年第 1 号) | 公司网站 | 2022 年 03 月 16 日 |
| 7 | 交银施罗德基金管理有限公司关于增加上海钜派钰茂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 | 2022 年 03 月 18 日 |
| 8 | 交银施罗德基金管理有限公司关于固有资金拟购买旗下偏股型基金的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站 | 2022 年 03 月 18 日 |
| 9 | 交银施罗德荣鑫灵活配置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 |
| 10 | 交银施罗德荣鑫灵活配置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 |

§ 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荣鑫保本混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《交银施罗德荣鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《交银施罗德荣鑫灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《交银施罗德荣鑫灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、《交银施罗德荣鑫保本混合型证券投资基金基金合同》；
- 6、《交银施罗德荣鑫保本混合型证券投资基金招募说明书》；
- 7、《交银施罗德荣鑫保本混合型证券投资基金托管协议》；
- 8、《交银施罗德荣鑫保本混合型证券投资基金保证合同》；
- 9、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 10、基金托管人业务资格批件、营业执照；

- 11、关于申请募集注册交银施罗德荣鑫保本混合型证券投资基金的法律意见书；
- 12、关于修改《交银施罗德荣鑫保本混合型证券投资基金基金合同》的法律意见书
- 13、报告期内交银施罗德荣鑫保本混合型证券投资基金、交银施罗德荣鑫灵活配置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。