

交银施罗德精选混合型证券投资基金 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 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：2023 年 3 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。本年度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 2023 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.4 过去三年基金的利润分配情况	8
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	13
4.10 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	13
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 审计报告	14
6.1 审计报告基本信息	14
6.2 审计报告的基本内容	14
§ 7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	17
7.3 净资产（基金净值）变动表	19
7.4 报表附注	22
§ 8 投资组合报告	58
8.1 期末基金资产组合情况	58

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	58
8.3 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	59
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	64
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	65
8.6 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	66
8.7 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	66
8.8 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	66
8.9 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	66
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	66
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	66
8.12 投资组合报告附注	66
§ 9 基金份额持有人信息	67
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	67
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	67
9.3 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	68
§ 10 开放式基金份额变动	68
§ 11 重大事件揭示	68
11.1 基金份额持有人大会决议	68
11.2 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	68
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	68
11.4 基金投资策略的改变	68
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	68
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	69
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	69
11.8 其他重大事件	71
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	73
12.1 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	73
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	73
§ 13 备查文件目录	73
13.1 备查文件目录	73
13.2 存放地点	73
13.3 查阅方式	73

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	交银施罗德精选混合型证券投资基金
基金简称	交银精选混合
基金主代码	519688
前端交易代码	519688
后端交易代码	519689
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005 年 9 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	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	7,472,727,726.41 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将坚持并不断深化价值投资的基本理念，充分发挥专业研究与管理能力，自上而下配置资产，自下而上精选证券，有效控制风险，分享中国经济与资本市场高速成长的成果，谋求实现基金财产的长期稳定增长。
投资策略	自上而下配置资产，自下而上精选证券，有效控制下行风险。
业绩比较基准	75%×沪深 300 指数+25%×中证综合债券指数
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。属于承担较高风险、预期收益较高的证券投资基金品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		交银施罗德基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王晚婷	秦一楠
	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	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fund001.com

基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2022 年	2021 年	2020 年
本期已实现收益	-594,637,389.28	1,440,890,965.19	2,050,992,168.49
本期利润	-1,370,717,423.64	121,514,581.88	3,384,609,634.30
加权平均基金份额本期利润	-0.1778	0.0128	0.4526
本期加权平均净值利润率	-18.80%	1.05%	45.34%
本期基金份额净值增长率	-15.58%	3.59%	55.07%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
期末可供分配利润	2,961,375,066.43	4,348,930,226.70	4,344,120,797.03
期末可供分配基金份额利润	0.3963	0.5661	0.5032
期末基金资产净值	6,943,532,907.86	9,206,455,986.27	10,541,386,185.73
期末基金份额净值	0.9292	1.1983	1.2211
3.1.3 累计期末指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末

基金份额 累计净值 增长率	1,142.62%	1,371.95%	1,320.91%
---------------------	-----------	-----------	-----------

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

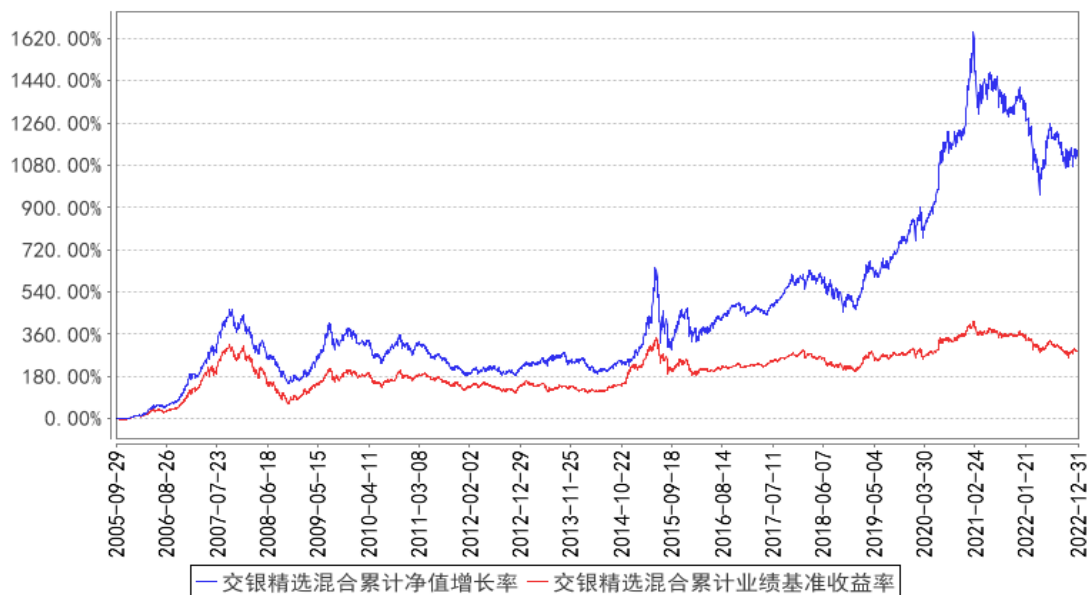
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.27%	1.25%	1.40%	0.97%	1.87%	0.28%
过去六个月	-7.59%	1.08%	-9.98%	0.83%	2.39%	0.25%
过去一年	-15.58%	1.36%	-15.70%	0.96%	0.12%	0.40%
过去三年	35.61%	1.32%	-0.22%	0.97%	35.83%	0.35%
过去五年	79.89%	1.32%	4.99%	0.97%	74.90%	0.35%
自基金合同生效起至今	1,142.62%	1.50%	289.04%	1.25%	853.58%	0.25%

注：1、本基金业绩比较基准自 2015 年 10 月 1 日起，由“75%×沪深 300 指数+25%×中信全债指数”变更为“75%×沪深 300 指数+25%×中证综合债券指数”，3.2.2、3.2.3 同。详情见本基金管理人于 2015 年 9 月 28 日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金业绩比较基准变更并修改基金合同相关内容的公告》；

2、本基金业绩比较基准每日进行再平衡过程。

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

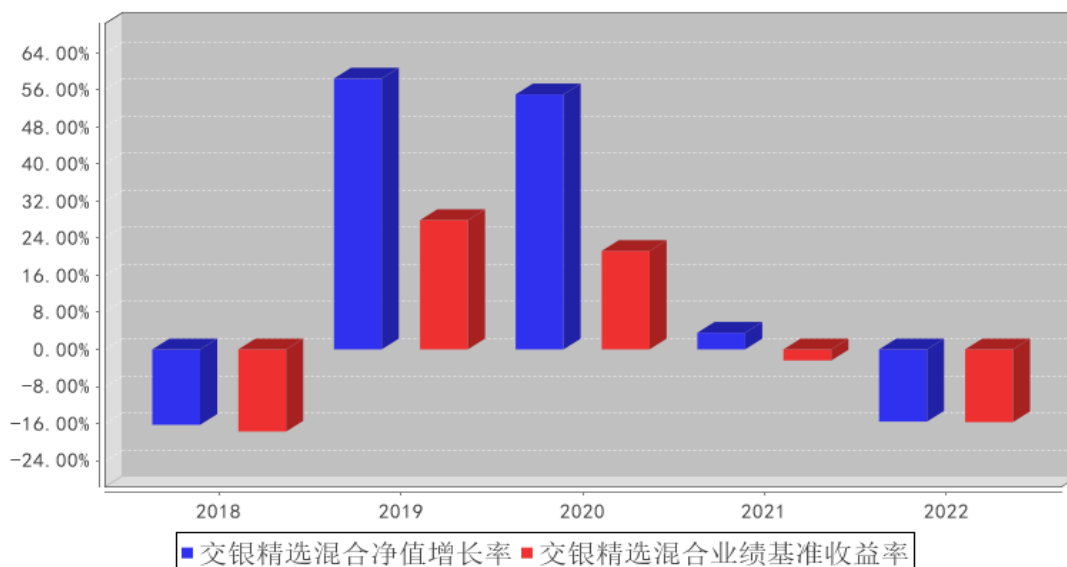
交银精选混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

交银精选混合基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2022 年	0.940	428,292,826.75	290,547,964.06	718,840,790.81	-
2021 年	0.740	354,454,402.29	271,210,180.55	625,664,582.84	-

2020 年	0.540	226,373,503.22	175,355,927.82	401,729,431.04
合计	2.220	1,009,120,732.26	737,114,072.43	1,746,234,804.69

§ 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 116 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		
王崇	交银精选混合、交银新成长混合、交银瑞丰混合的基金经理，公司权益投资副总监	2017 年 6 月 3 日	-	14 年	王崇先生，北京大学金融学博士。2008 年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任行业分析师、高级研究员。

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、2023 年 1 月 7 日本基金管理人发布公告，经公司领导办公会审议通过，张雪蓉女士将担任本基金基金经理，本基金由王崇先生和张雪蓉女士共同管理。除此之外基金经理（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 公平交易制度和控制方法

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所管理的所有资产组合投资运作的公平。旗下所管理的所有资产组合，包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均严格遵循制度进行公平交易。制度中包含的主要控制方法如下：

(1) 公司建立资源共享的投资研究信息平台，所有研究成果对所有投资组合公平开放，确保各投资组合在获得研究支持和实施投资决策方面享有公平的机会。

(2) 公司将投资管理职能和交易执行职能相隔离，实行集中交易制度，建立了合理且可操作的公平交易分配机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于交易所公开竞价交易，遵循“时间优先、价格优先、比例分配”的原则，全部通过交易系统进行比例分配；对于非集中竞价交易、以公司名义进行的场外交易，遵循“价格优先、比例分配”的原则按事前独立确定的投资方案对交易结果进行分配。

(3) 公司建立了清晰的投资授权制度，明确各层级投资决策主体的职责和权限划分，组合投资经理充分发挥专业判断能力，不受他人干预，在授权范围内独立行使投资决策权，维护公平的投资管理环境，维护所管理投资组合的合法利益，保证各投资组合交易决策的客观性和独立性，防范不公平及异常交易的发生。

(4) 公司建立统一的投资对象备选库和交易对手备选库，制定明确的备选库建立、维护程序。在全公司适用股票、债券备选库的基础上，根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和关联交易限制等，按需要建立不同投资组合的投资对象风格库和交易对手备选库，组合经理在此基础上根据投资授权构建投资组合。

(5) 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投资组合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。

4.3.2 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。

4.3.3 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，受国内疫情反复、海外俄乌冲突、大宗商品价格暴涨、美联储超预期加息和担忧中美关系外资持续流出等不利因素影响，A 股和港股主要指数均出现较大幅度下行。行业层面，电子、新能源和医药等主流新兴成长行业跌幅较大，而受益于能源价格上涨的煤炭、石油和预期地产政策放松的银行、央企房地产等低估值行业表现较好。

本基金在 2022 年总体维持中性略高仓位，减持石油化工、电子、建材家居和软件互联网，加仓医疗服务、白酒、白色家电、物流和汽车零部件等行业内个股。

股票是典型的长久期资产，大型资金的权益资产投资者理应看的更远，淡化短期景气度。疫情冲击、俄乌冲突和美联储超预期加息等不利因素早晚都会过去，而地缘政治和大国关系对权益资产的影响也需要 A 股投资者逐渐适应和接受。

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 2023 年，随着美联储加息逐渐进入尾声，美元指数持续走强的趋势有望扭转。在国内经济领先，全球见底回升的大背景下，预计 A 股以及港股为首的新兴市场配置吸引力将不断增强，有望迎来新的投资机会。行业层面，考虑到国内外经济大概率表现为内需好于外需，中下游好于上游的中观环境。从未来两、三年的视角看，经过一年多股价的回调，大部分公司股票估值已具备价格优势，甚至存在部分竞争力突出的公司股价估值合理或偏低。拉长投资视角，目前“强预期、弱现实”并充满迷茫的经济和市场低迷阶段可能给中长期投资人提供比较好的布局机会，未来几年有望实现不错的年化收益率。

后续本基金将继续坚守能力圈，积极寻找消费、服务、软件和汽车零部件等行业内估值合理的优质公司股票做中期布局，努力为基金持有人创造较好回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2022 年度，根据《证券投资基金法》等法律法规及有关要求，本基金管理人诚实守信、勤勉尽责，依法履行基金管理人职责，落实风险控制，强化合规管理职能，确保基金管理业务运作的安全、规范，保护基金投资人的合法权益。

本报告期内，本基金管理人为了确保公司业务的规范运作，主要做了以下工作：

（一）继续深化全面风险管理，提高风险控制有效性。

公司风险管理部门持续加大信用风险事前防范力度，加强对信用风险的监控，信用风险提示进一步前移；继续加强流动性风险管理，坚持开展定期及不定期压力测试及应急演练工作；定期排查风险控制阈值，提高公司旗下组合风险控制精准度；不断优化业务操作流程，通过丰富管理工具加强操作风险管理；继续加强各项潜在风险排查，落实防范措施和跟踪机制，不断提升公司风险管理水平。

（二）全面开展内部监督检查，强化公司内部控制。

公司审计部门坚持以法律法规和公司各项制度为依据，按照监管机构的要求对基金运作和公司经营所涉及的各个环节实施严格的稽核监督。通过对投资研究、市场销售、运营、信息技术等业务条线内部控制关键点开展定期和不定期检查，有效促进公司内部控制制度规范、执行有效，内控管理水平不断提升。

（三）持续夯实公司合规管理体系，合规文化建设取得新实效。

公司法律合规部门持续夯实合规管理体系，体系内三道防线各司其职、形成合力，公司合规文化建设取得新实效；全年加强建立全面、系统、规范的规章制度体系，持续扎实推进新法规跟踪落

实工作，以持续抓好制度建设及执行助推公司合规管理常态长效发展。

（四）强化培训教育及重点领域合规提示，牢固树立全员风险合规防范意识。

公司牢固树立全员风险合规防范意识。公司围绕行业热点、重点、难点问题，组织开展了多场培训教育工作，加强重点领域合规提示，加深了员工对新法律法规的理解及强化其风险合规意识，抓牢抓实员工合规底线教育，加强案防管理，强化员工行为合规管控，提高了员工内部控制、风险管理的技能和水平，公司内部控制和风险管理体系得到进一步的夯实和优化。

4.7 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规和基金合同要求，本基金本报告期内对上一年度应分配的可分配利润进行了收益分配，具体情况参见 7.4.11 利润分配情况。

本基金未对本报告期内利润进行分配。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 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 12 月 31 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 托管人对本年度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年度报告中的财务指标、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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(23)第 P02125 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	交银施罗德精选混合型证券投资基金全体持有人
审计意见	我们审计了交银施罗德精选混合型证券投资基金的财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表、净资产(基金净值)变动表以及财务报表附注。我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了交银施罗德精选混合型证券投资基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况、2022 年度的经营

	成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于交银施罗德精选混合型证券投资基金,并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>交银施罗德基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括交银施罗德精选混合型证券投资基金 2022 年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估交银施罗德精选混合型证券投资基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算交银施罗德精选混合型证券投资基金、终止经营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督交银施罗德精选混合型证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险,设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊</p>

	<p>可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和做出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能对交银施罗德精选混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致交银施罗德精选混合型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容,并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p>
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	孙维琦 季潇然
会计师事务所的地址	上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼
审计报告日期	2023 年 3 月 27 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体: 交银施罗德精选混合型证券投资基金

报告截止日: 2022 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产:			
银行存款	7.4.7.1	590,082,224.57	340,342,891.25
结算备付金		2,361,431.09	10,559,151.70
存出保证金		2,346,171.73	2,471,824.41
交易性金融资产	7.4.7.2	5,899,815,815.15	8,831,325,949.93
其中: 股票投资		5,516,744,080.68	8,322,774,949.93
基金投资		-	-
债券投资		383,071,734.47	508,551,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-

买入返售金融资产	7.4.7.4	500,064,270.62	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		-	47,005,816.33
应收股利		-	-
应收申购款		2,020,379.53	2,914,335.52
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	7,084,784.32
资产总计		6,996,690,292.69	9,241,704,753.46
负债和净资产	附注号	本期末 2022年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		34,749,941.85	-
应付赎回款		3,070,915.61	13,763,956.67
应付管理人报酬		8,837,397.29	11,968,547.68
应付托管费		1,472,899.54	1,994,757.95
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		2,068.21	5.67
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	5,024,162.33	7,521,499.22
负债合计		53,157,384.83	35,248,767.19
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	3,312,879,077.49	3,406,011,854.45
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	3,630,653,830.37	5,800,444,131.82
净资产合计		6,943,532,907.86	9,206,455,986.27
负债和净资产总计		6,996,690,292.69	9,241,704,753.46

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9292 元，基金份额总额 7,472,727,726.41 份。

7.2 利润表

会计主体：交银施罗德精选混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年1月1日至2022 年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 12月31日
一、营业总收入		-1,242,675,601.58	378,661,668.01
1. 利息收入		4,776,219.16	20,161,840.18
其中：存款利息收入	7.4.7.13	4,668,069.13	5,103,854.28
债券利息收入		-	15,029,376.07
资产支持证券 利息收入		-	-
买入返售金融 资产收入		108,150.03	28,609.83
证券出借利息 收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以 “-”填列）		-472,335,342.77	1,669,473,496.25
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-535,556,518.20	1,565,868,136.30
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	11,082,000.86	6,179,317.62
资产支持证券 投资收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收 益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	52,139,174.57	97,426,042.33
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）	7.4.7.20	-776,080,034.36	-1,319,376,383.31
4. 汇兑收益（损失以 “-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以 “-”号填列）	7.4.7.21	963,556.39	8,402,714.89
减：二、营业总支出		128,041,822.06	257,147,086.13
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	109,490,568.35	174,538,301.05
2. 托管费	7.4.10.2.2	18,248,428.10	29,089,716.96
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	149,967.41

其中：卖出回购金融资产支出		-	149,967.41
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		432.75	111.53
8. 其他费用	7.4.7.23	302,392.86	53,368,989.18
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,370,717,423.64	121,514,581.88
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,370,717,423.64	121,514,581.88
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-1,370,717,423.64	121,514,581.88

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：交银施罗德精选混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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）	3,406,011,854.45	-	5,800,444,131.82	9,206,455,986.27
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）	3,406,011,854.45	-	5,800,444,131.82	9,206,455,986.27
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-93,132,776.96	-	2,169,790,301.45	-2,262,923,078.41
（一）、综合收益总额	-	-	1,370,717,423.64	-1,370,717,423.64
（二）、本	-93,132,776.96	-	-80,232,087.00	-173,364,863.96

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	694,964,317.41	-	807,864,629.25	1,502,828,946.66
2. 基金赎回款	-788,097,094.37	-	-888,096,716.25	-1,676,193,810.62
(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)	-	-	-718,840,790.81	-718,840,790.81
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	3,312,879,077.49	-	3,630,653,830.37	6,943,532,907.86
项目	上年度可比期间			
	2021年1月1日至2021年12月31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)	3,827,177,720.22	-	6,714,208,465.51	10,541,386,185.73
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）	3,827,177,720.22	-	6,714,208,465.51	10,541,386,185.73
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-421,165,865.77	-	-913,764,333.69	-1,334,930,199.46
（一）、综合收益总额	-	-	121,514,581.88	121,514,581.88
（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）	-421,165,865.77	-	-409,614,332.73	-830,780,198.50
其中：1. 基金申购款	2,565,337,209.49	-	4,858,283,730.57	7,423,620,940.06
2. 基金赎回款	-	-	-	-8,254,401,138.56
	2,986,503,075.26		5,267,898,063.30	
（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）	-	-	-625,664,582.84	-625,664,582.84
（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）	3,406,011,854.45	-	5,800,444,131.82	9,206,455,986.27

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>谢卫</u>	<u>印皓</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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

交银施罗德精选混合型证券投资基金(原交银施罗德精选股票证券投资基金,以下简称“本基金”)系由基金管理人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》、《交银施罗德精选股票证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)以证监基金字[2005]140号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集基金份额为4,874,882,643.01份,经德勤华永会计师事务所有限公司验证,并出具了编号为德师报(验)字(05)第0038号验资报告。《交银施罗德精选股票证券投资基金基金合同》(以下简称“原基金合同”)于2005年9月29日正式生效。本基金的管理人为交银施罗德基金管理有限公司,托管人为中国农业银行股份有限公司(以下简称“中国农业银行”)。

根据2007年1月23日《交银施罗德基金管理有限公司关于对交银施罗德精选股票证券投资基金实施基金份额拆分和限量销售的公告》,根据拆分前基金份额净值和公告的基金份额拆分比例计算公式,基金份额拆分比例为1:2.255776094(保留到小数点后9位),拆分后的基金份额净值为1.0000元。本基金注册登记机构于2007年1月29日对基金份额持有人经重新计算的基金份额进行了变更登记。

2015年8月,本基金更名为交银施罗德精选混合型证券投资基金,公告了《交银施罗德精选混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“修改后的基金合同”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、修改后的基金合同和定期更新的本基金招募说明书的有关规定,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、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、存托凭证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。基金的投资组合为:股票资产占基金资产的60%-95%,债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的5%-40%,其中,基金保留的现金以及投资于一年期以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。

本基金的业绩比较基准自2015年10月1日起,由“75%×沪深300指数+25%×中信全债指

数”变更为“75%×沪深 300 指数+25%×中证综合债券指数”。

本财务报表由本基金的基金管理人交银施罗德基金管理有限公司于 2023 年 03 月 27 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)以及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度,即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

根据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,本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产,暂无金融资产划分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。

金融资产的合同条款规定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,且本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标,则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产计入“衍生金融资产”外,其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产计入“交易性金融资产”。

(2) 金融负债的分类

本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无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。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

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，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产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，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本基金对分类为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。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本基金在上一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然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

是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。若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风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价(包括转出的非现金资产或承担的新金融负债)之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，将其公允价值划分为三个层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是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；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值原则如下：

(1) 对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市价不能真实反映公允价值的，应对市价进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当投资品种不存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

(3) 经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整，确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认

金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

(2) 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本与相关交易费用的差额确认。

债券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖债券价差收入。除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖资产支持证券价差收入。资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额，确认资产支持证券利息收入。买卖资产支持证券价差收入为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本、相关交易费用与税费后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

(3) 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

(4) 信用减值损失

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信用损失准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

本基金的交易费用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如不影响估值日基金份额净值小数点后第四位，发生时直接计入基金损益；如果影响基金份额净值小数点后第四位的，应采用待摊或预提的方法，待摊或预提计入基金损益。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

- 1) 每年收益分配次数最多为 6 次，年度收益分配比例不低于基金年度已实现收益的 50%；
- 2) 收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。若基金份额持有人不选择，基金默认的收益分配方式是现金分红；分红方式最终以注册登记机构确认的分红方式为准；
- 3) 基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；
- 4) 基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；
- 5) 在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益每年至少分配一次，但若基金合同生效不满 3 个月则不进行收益分配；
- 6) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；
- 7) 每一基金份额享有同等分配权；
- 8) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 外币交易

本基金本报告期内无外币交易。

7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

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

(1) 对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》(中基协发[2017]6号)，在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

(2) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》(中国证监会公告[2017]13号)及《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》(中基协发[2013]13号)相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(3) 根据《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》(中基协发[2014]24号)，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认计量》、《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》和《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”)相关规定,以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《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。本基金在编制 2022 年度财务报表时已采用该准则,并采用准则允许的实务简便方法,调整期初基金净值,2021 年的比较数据将不作重述。

于首次执行日,本基金因执行新金融工具准则调减期初基金净值人民币 0.00 元,本基金执行新金融工具准则的影响如下:

(1) 金融工具的分类影响

以摊余成本计量的金融资产

于 2021 年 12 月 31 日,本基金按照原金融工具准则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、应收清算款、应收利息和应收申购款,对应的账面价值分别为人民币 340,342,891.25 元、10,559,151.70 元、2,471,824.41 元、47,005,816.33 元、7,084,784.32 元和 2,914,335.52 元。

于 2022 年 1 月 1 日,本基金按照新金融工具准则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、应收清算款和应收申购款,对应的账面价值分别为人民币 340,432,968.51 元、10,564,378.57 元、2,473,047.94 元、47,005,816.33 和 2,914,341.21 元。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

于 2021 年 12 月 31 日,本基金按照原金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为交易性金融资产,对应的账面价值分别为人民币 8,322,774,949.93 元。

于 2022 年 1 月 1 日,本基金按照新金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为交易性金融资产,对应的账面价值分别为人民币 8,329,763,200.90 元。

以摊余成本计量的金融负债

于 2021 年 12 月 31 日,本基金按照原金融工具准则以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用、应交税费和其他负债,对应的账面价值分别为人民币 13,763,956.67 元、11,968,547.68 元、1,994,757.95 元、7,243,191.57 元、5.67 元和 278,307.65 元。

于 2022 年 1 月 1 日,本基金按照新金融工具准则以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、

应付管理人报酬、应付托管费、应交税费和其他负债，对应的账面价值分别为 13,763,956.67 元、11,968,547.68 元、1,994,757.95 元、5.67 元和 7,521,499.22 元。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产和卖出回购金融资产款等对应的应计利息余额均列示在应收利息或应付利息科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则，将上述应计利息分别转入银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产和卖出回购金融资产款等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(2) 采用“预期信用损失”模型的影响

“预期信用损失”模型适用于本基金持有的以摊余成本计量的金融资产。采用“预期信用损失”模型未对本基金 2022 年年初留存收益产生重大影响。

(3) 修订的《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>》

本基金根据修订的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》编制财务报表时，调整了部分财务报表科目的列报和披露，未对财务报表列报和披露产生重大影响。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、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》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、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]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》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、

债券免征增值税；2018年1月1日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

(2) 对证券投资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，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不计缴企业所得税。

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司代扣代缴个人所得税；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 对于基金从事A股买卖，出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税。

(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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
活期存款	590,082,224.57	340,342,891.25
等于：本金	589,855,743.08	340,342,891.25
加：应计利息	226,481.49	-
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	590,082,224.57	340,342,891.25

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		5,513,991,298.77	-	5,516,744,080.68	2,752,781.91
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	2,000.00	0.22	2,000.22	0.00
	银行间市场	380,090,670.00	3,778,734.25	383,069,734.25	-799,670.00
	合计	380,092,670.00	3,778,734.47	383,071,734.47	-799,670.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		5,894,083,968.77	3,778,734.47	5,899,815,815.15	1,953,111.91
项目		上年度末 2021 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		7,545,002,933.66	-	8,322,774,949.93	777,772,016.27
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	8,834,000.00	-	8,834,000.00	-
	银行间市场	499,455,870.00	-	499,717,000.00	261,130.00
	合计	508,289,870.00	-	508,551,000.00	261,130.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		8,053,292,803.66	-	8,831,325,949.93	778,033,146.27

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	500,064,270.62	-
合计	500,064,270.62	-
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

无。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应收利息	-	7,084,784.32
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	7,084,784.32

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	6,388.13	29,007.65
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	4,788,474.20	7,243,191.57
其中：交易所市场	4,786,784.20	7,242,149.07
银行间市场	1,690.00	1,042.50
应付利息	-	-
预提审计费	100,000.00	120,000.00
预提信息披露费	120,000.00	120,000.00
预提账户维护费	9,300.00	9,300.00
合计	5,024,162.33	7,521,499.22

7.4.7.10 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12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	7,682,815,406.10	3,406,011,854.45

本期申购	1,567,585,347.24	694,964,317.41
本期赎回（以“-”号填列）	-1,777,673,026.93	-788,097,094.37
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	7,472,727,726.41	3,312,879,077.49

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。

7.4.7.11 其他综合收益

无。

7.4.7.12 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	4,348,930,226.70	1,451,513,905.12	5,800,444,131.82
本期利润	-594,637,389.28	-776,080,034.36	-1,370,717,423.64
本期基金份额交易产生的变动数	-74,076,980.18	-6,155,106.82	-80,232,087.00
其中：基金申购款	657,047,436.34	150,817,192.91	807,864,629.25
基金赎回款	-731,124,416.52	-156,972,299.73	-888,096,716.25
本期已分配利润	-718,840,790.81	-	-718,840,790.81
本期末	2,961,375,066.43	669,278,763.94	3,630,653,830.37

7.4.7.13 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12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
活期存款利息收入	4,479,923.71	4,822,730.17
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	148,653.11	205,869.36
其他	39,492.31	75,254.75
合计	4,668,069.13	5,103,854.28

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 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12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日

股票投资收益——买卖 股票差价收入	-535,556,518.20	1,565,868,136.30
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	-535,556,518.20	1,565,868,136.30

7.4.7.14.2 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12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 12月31日
卖出股票成交总 额	13,923,393,403.99	17,971,177,036.13
减：卖出股票成本 总额	14,418,390,277.83	16,405,308,899.83
减：交易费用	40,559,644.36	-
买卖股票差价收 入	-535,556,518.20	1,565,868,136.30

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 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12月31 日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日
债券投资收益——利息 收入	7,840,749.46	-
债券投资收益——买卖 债券（债转股及债券到 期兑付）差价收入	3,241,251.40	6,179,317.62
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	11,082,000.86	6,179,317.62

7.4.7.15.2 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12月31 日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	526,543,603.75	649,004,380.25
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	511,628,870.00	629,196,606.07
减：应计利息总额	11,671,594.60	13,628,456.56
减：交易费用	1,887.75	-
买卖债券差价收入	3,241,251.40	6,179,317.62

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12 月31日
股票投资产生的股利收益	52,139,174.57	97,426,042.33
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	52,139,174.57	97,426,042.33

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
------	----	---------

	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-776,080,034.36	-1,319,376,383.31
股票投资	-775,019,234.36	-1,318,733,419.38
债券投资	-1,060,800.00	-642,963.93
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	-776,080,034.36	-1,319,376,383.31

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	963,556.39	8,402,714.89
合计	963,556.39	8,402,714.89

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。

7.4.7.22 信用减值损失

无。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
审计费用	100,000.00	120,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	33,872.46	43,444.76
债券账户费用	37,200.00	37,200.00
存托服务费	11,320.40	1,043.55
交易费用	-	53,047,300.87

合计	302,392.86	53,368,989.18
----	------------	---------------

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

无。

7.4.10.1.2 债券交易

无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

7.4.10.1.4 权证交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	109,490,568.35	174,538,301.05
其中：支付销售机构的客户维护费	31,623,937.32	39,292,863.44

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

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% \div \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	18,248,428.10	29,089,716.96

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：

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

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2022年12月31日		上年度末 2021年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例 (%)
交银施罗德 资产管理有 限公司	21,788,865.89	0.29	-	-

注：关联方投资本基金的费率按照基金合同和招募说明书规定的确定，符合公允性要求。

7.4.10.6 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12月 31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31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	590,082,224.57	4,479,923.71	340,342,891.25	4,822,730.17

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。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益 登记	除息日		每 10 份基	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配合 计	备 注
		场	场外					

	日	内		金份 额分 红数				
1	2022 年1 月14 日	-	2022 年1 月14 日	0.940	428,292,826.75	290,547,964.06	718,840,790.81	-
合计	-	-	-	0.940	428,292,826.75	290,547,964.06	718,840,790.81	-

7.4.12 期末（2022 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
301095	广 立 微	2022 年 7 月 28 日	6 个 月 以 上	限 售 股	58.00	86.49	740	42,920.00	64,002.60	-
301115	建 科 股 份	2022 年 8 月 23 日	6 个 月 以 上	限 售 股	42.05	24.04	685	28,804.25	16,467.40	-
301132	满 坤 科 技	2022 年 8 月 3 日	6 个 月 以 上	限 售 股	26.80	24.48	468	12,542.40	11,456.64	-
301152	天 力 锂 能	2022 年 8 月 19 日	6 个 月 以 上	限 售 股	57.00	46.64	433	24,681.00	20,195.12	-
301161	唯 万 密 封	2022 年 9 月 6 日	6 个 月 以 上	限 售 股	18.66	21.73	346	6,456.36	7,518.58	-
30116	锐	202	6 个 月	限	32.38	31.61	1,077	34,873.26	34,043.97	-

5	捷网络	2年 11月 14日	以上	售股						
30117 1	易点天下	2022年 8月 10日	6个月 以上	限售股	18.18	17.72	985	17,907.30	17,454.20	-
30117 6	逸豪新材	2022年 9月 21日	6个月 以上	限售股	23.88	16.89	544	12,990.72	9,188.16	-
30119 5	北路智控	2022年 7月 25日	6个月 以上	限售股	71.17	73.04	330	23,486.10	24,103.20	-
30119 7	工大科雅	2022年 7月 29日	6个月 以上	限售股	25.50	20.08	380	9,690.00	7,630.40	-
30122 3	中荣股份	2022年 10月 13日	6个月 以上	限售股	26.28	18.13	815	21,418.20	14,775.95	-
30122 7	森鹰窗业	2022年 9月 16日	6个月 以上	限售股	38.25	29.49	284	10,863.00	8,375.16	-
30123 0	泓博医药	2022年 10月 21日	6个月 以上	限售股	40.00	48.32	269	10,760.00	12,998.08	-
30123 1	荣信	2022年	6个月 以上	限售	25.49	20.38	275	7,009.75	5,604.50	-

	文化	8月31日		股							
301239	普瑞眼科	2022年6月22日	6个月以上	限售股	33.65	69.68	575	19,348.75	40,066.00	-	
301265	华新环保	2022年12月8日	6个月以上	限售股	13.28	11.40	819	10,876.32	9,336.60	-	
301267	华夏眼科	2022年10月26日	6个月以上	限售股	50.88	66.20	1,006	51,185.28	66,597.20	-	
301269	华大九天	2022年7月21日	6个月以上	限售股	32.69	87.94	1,168	38,181.92	102,713.92	-	
301276	嘉曼服饰	2022年9月1日	6个月以上	限售股	40.66	22.61	303	12,319.98	6,850.83	-	
301277	新天地	2022年11月9日	6个月以上	限售股	27.00	25.78	439	11,853.00	11,317.42	-	
301280	珠城科技	2022年12月19日	6个月以上	限售股	67.40	44.80	279	18,804.60	12,499.20	-	
301282	金禄电子	2022年8月18日	6个月以上	限售股	30.38	25.25	434	13,184.92	10,958.50	-	

301285	鸿日达	2022年9月21日	6个月以上	限售股	14.60	12.60	565	8,249.00	7,119.00	-
301290	东星医疗	2022年11月23日	6个月以上	限售股	44.09	35.13	330	14,549.70	11,592.90	-
301296	新巨丰	2022年8月26日	6个月以上	限售股	18.19	14.90	1,042	18,953.98	15,525.80	-
301301	川宁生物	2022年12月20日	6个月以上	限售股	5.00	7.53	3,574	17,870.00	26,912.22	-
301306	西测测试	2022年7月19日	6个月以上	限售股	43.23	42.29	255	11,023.65	10,783.95	-
301309	万得凯	2022年9月8日	6个月以上	限售股	39.00	24.46	228	8,892.00	5,576.88	-
301313	凡拓数创	2022年9月22日	6个月以上	限售股	25.25	29.14	247	6,236.75	7,197.58	-
301316	慧博云通	2022年9月29日	6个月以上	限售股	7.60	14.32	359	2,728.40	5,140.88	-
301318	维海德	2022年8月	6个月以上	限售股	64.68	41.74	206	13,324.08	8,598.44	-

		3 日								
301319	唯特偶	2022年9月22日	6个月以上	限售股	47.75	53.27	115	5,491.25	6,126.05	-
301327	华宝新能	2022年9月8日	6个月以上	限售股	237.50	176.97	242	57,475.00	42,826.74	-
301328	维峰电子	2022年8月30日	6个月以上	限售股	78.80	76.96	191	15,050.80	14,699.36	-
301330	熵基科技	2022年8月10日	6个月以上	限售股	43.32	31.31	694	30,064.08	21,729.14	-
301338	凯格精机	2022年8月8日	6个月以上	限售股	46.33	48.99	257	11,906.81	12,590.43	-
301349	信德新材	2022年8月30日	6个月以上	限售股	138.88	103.52	180	24,998.40	18,633.60	-
301356	天振股份	2022年11月3日	6个月以上	限售股	63.00	43.33	614	38,682.00	26,604.62	-
301363	美好医疗	2022年9月28日	6个月以上	限售股	30.66	37.85	445	13,643.70	16,843.25	-
301365	矩阵股份	2022年11月14日	6个月以上	限售股	34.72	23.87	516	17,915.52	12,316.92	-

		日								
301366	一博科技	2022年9月19日	6个月以上	限售股	65.35	45.09	268	17,513.80	12,084.12	-
301368	丰立智能	2022年12月7日	6个月以上	限售股	22.33	18.52	337	7,525.21	6,241.24	-
301377	鼎泰高科	2022年11月11日	6个月以上	限售股	22.88	17.63	770	17,617.60	13,575.10	-
301379	天山电子	2022年10月19日	6个月以上	限售股	31.51	24.63	449	14,147.99	11,058.87	-
301389	隆扬电子	2022年10月18日	6个月以上	限售股	22.50	17.16	1,269	28,552.50	21,776.04	-
301391	卡莱特	2022年11月24日	6个月以上	限售股	96.00	80.97	247	23,712.00	19,999.59	-
301396	宏景科技	2022年11月4日	6个月以上	限售股	40.13	31.90	396	15,891.48	12,632.40	-
301398	星源卓镁	2022年12月8日	6个月以上	限售股	34.40	28.94	255	8,772.00	7,379.70	-

		日								
600529	山东药玻	2022年11月28日	1-6个月(含)	限售股	27.19	26.66	2,206,694	60,000,009.86	58,830,462.04	-
603882	金域医学	2022年11月10日	6个月以上	限售股	69.66	74.27	35,400	2,465,964.00	2,629,158.00	-
603882	金域医学	2022年11月10日	6个月以上	限售股	69.66	74.27	403,800	28,128,708.00	29,990,226.00	-
688061	灿瑞科技	2022年10月11日	6个月以上	限售股	112.69	87.17	3,972	447,604.68	346,239.24	-
688372	伟测科技	2022年10月19日	6个月以上	限售股	61.49	81.20	2,383	146,530.67	193,499.60	-
688373	盟科药业	2022年7月29日	6个月以上	限售股	8.16	8.54	31,886	260,189.76	272,306.44	-
688419	耐科装备	2022年10月31日	6个月以上	限售股	37.85	29.44	3,039	115,026.15	89,468.16	-
688506	百利	2022年	1个月内	新股	24.70	24.70	15,622	385,863.40	385,863.40	-

	天恒	12月28日	(含)	未上市						
688690	纳微科技	2022年7月11日	6个月以上	限售股	70.00	51.24	460,000	32,200,000.00	23,570,400.00	-
688690	纳微科技	2022年7月13日	6个月以上	限售股	66.00	51.19	460,000	30,360,000.00	23,547,400.00	-
688690	纳微科技	2022年7月5日	6个月以上	限售股	71.25	51.41	691,352	49,258,830.00	35,542,406.32	-
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113665	汇通转债	2022年12月16日	1个月内(含)	老股东配债	100.00	100.01	20	2,000.00	2,000.22	-

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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，本基金的运作涉及的金融工具主要包括股票投资、债券投资、权证投资等。与这些金融工具有关的风险，以及本基金管理人管理此类风险所采取的风险管理政策如下所述。

本基金管理人从事风险管理的目标是使本基金在风险和收益之间取得适当的平衡，将风险对本基金经营业绩的负面影响降低到最低水平，使基金持有人的利益最大化。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人风险管理的基本策略是识别和分析本基金运作时本基金面临的各种类型的风险，确定适当的风险容忍度，并及时可靠地对各种风险进行监督，将风险控制在限定的范围之内。

本基金目前面临的主要风险包括：信用风险、流动性风险和市场风险。与本基金相关的市场风险主要包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

本基金的基金管理人建立了以全面、独立、相互制约以及定性和定量相结合为原则的，由董事会最终负责、业务部门进行风险评估和监控、风险管理部监察执行的，同时督察长行使独立监察权力的风险管理组织架构体系。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指金融工具的一方到期无法履行约定义务致使本基金遭受损失的风险。本基金的信用风险主要存在于银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资、买入返售金融资产、应收利息及其他。

本基金的银行存款存放于本基金的基金托管行-中国农业银行。本基金认为与中国农业银行相关的信用风险不重大。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，

因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

对于与债券投资等投资品种相关的信用风险，本基金管理人通过对投资品种的信用等级评估来选择适当的投资对象，并限制单个投资品种的持有比例来管理信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.3 流动性风险

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

流动性风险指因市场交易相对不活跃导致基金投资资产无法以适当价格及时变现，进而无法应对债务到期偿付或投资者赎回款按时支付的风险。

本基金坚持组合管理、分散投资的原则开展投资活动，所持证券均在证券交易所或银行间同业市场交易，并严格遵守基金管理人流动性相关交易限制；本期末本基金未持有具有重大流动性风险的投资品种。同时，本基金在需要时可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金，以缓解流动性风险。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人在基金合同中约定了巨额赎回条款，设计了

非常情况下赎回资金的处理模式,控制因开放模式带来的流动性风险,有效保障基金持有人利益。

本基金的基金管理人每日预测本基金的流动性需求,并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求,对流动性指标进行持续的监测和分析。

截止本报告期末及上年度末,本基金无重大流动性风险。

7.4.13.4 市场风险

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的利率敏感性资产主要是银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资。基于本基金产品性质,生息资产占基金资产绝对比重较小,因此本基金并不存在重大的利率风险。本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,通过对短期利率水平的预测、收益率曲线分析、利率重定价日组合及类别品种配置、调整投资组合的久期、凸性等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2022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	590,082,224.57	-	-	-	590,082,224.57
结算备付金	2,361,431.09	-	-	-	2,361,431.09
存出保证金	2,346,171.73	-	-	-	2,346,171.73
交易性金融资产	383,069,734.25	-	2,000,225,516,744,080.68	-	5,899,815,815.15
买入返售金融资产	500,064,270.62	-	-	-	500,064,270.62
应收申购款	20,377.40	-	-	2,000,002.13	2,020,379.53
资产总计	1,477,944,209.66	-	2,000,225,518,744,082.81	-	6,996,690,292.69
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,070,915.61	3,070,915.61
应付管理人报酬	-	-	-	8,837,397.29	8,837,397.29
应付托管费	-	-	-	1,472,899.54	1,472,899.54
应付清算款	-	-	-	34,749,941.85	34,749,941.85
应交税费	-	-	-	2,068.21	2,068.21
其他负债	-	-	-	5,024,162.33	5,024,162.33
负债总计	-	-	-	53,157,384.83	53,157,384.83
利率敏感度缺口	1,477,944,209.66	-	2,000,225,465,586,697.98	-	6,943,532,907.86
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	340,342,891.25	-	-	-	340,342,891.25
结算备付金	10,559,151.70	-	-	-	10,559,151.70

存出保证金	2,471,824.41	-	-	-	2,471,824.41
交易性金融资产	499,717,000.00	-	8,834,000.00	8,322,774,949.93	8,831,325,949.93
应收申购款	13,287.04	-	-	2,901,048.48	2,914,335.52
应收证券清算款	-	-	-	47,005,816.33	47,005,816.33
其他资产	-	-	-	7,084,784.32	7,084,784.32
资产总计	853,104,154.40	-	8,834,000.00	8,379,766,599.06	9,241,704,753.46
负债					
应付赎回款	-	-	-	13,763,956.67	13,763,956.67
应付管理人报酬	-	-	-	11,968,547.68	11,968,547.68
应付托管费	-	-	-	1,994,757.95	1,994,757.95
应交税费	-	-	-	5.67	5.67
其他负债	-	-	-	7,521,499.22	7,521,499.22
负债总计	-	-	-	35,248,767.19	35,248,767.19
利率敏感度缺口	853,104,154.40	-	8,834,000.00	8,344,517,831.87	9,206,455,986.27

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2022 年 12 月 31 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 5.52% (2021 年 12 月 31 日：5.52%)，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)。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指金融工具的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。该风险可能与特定投资品种相关，也有可能与整体投资品种相关。本基金的金融资产以公允价值计量，所有其他价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。

本基金在购建资产配置和基金资产投资组合的基础上，通过建立事前和事后跟踪误差的方式，对基金资产的市场价格风险进行管理。

本基金投资组合中股票资产占基金资产的 60%-95%，债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 5%-40%，其中，基金保留的现金以及投资于一年期以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。于资产负债表日，本基金面临的其他价格风险列示如下：

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 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	5,516,744,080.68	79.45	8,322,774,949.93	90.40
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	2,000.22	0.00	8,834,000.00	0.10
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	5,516,746,080.90	79.45	8,331,608,949.93	90.50

注：债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 除本基金业绩比较标准外的其他市场变量保持不变。		
	2. 观察有效期设定为一年期间。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022 年 12 月 31 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
分析	1. 业绩比较基准下降 5%	-437,436,828.20	-587,699,685.38
	2. 业绩比较基准上升 5%	437,436,828.20	587,699,685.38

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	5,340,456,933.03	7,607,859,327.85
第二层次	383,457,597.87	1,223,466,622.08
第三层次	175,901,284.25	-
合计	5,899,815,815.15	8,831,325,949.93

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,225,006,208.70	1,225,006,208.70
转出第三层次	-	566,560,697.70	566,560,697.70
当期利得或损失总额	-	-482,544,226.75	-482,544,226.75
其中：计入损益的利得或损失	-	-482,544,226.75	-482,544,226.75
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	175,901,284.25	175,901,284.25
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未	-	-28,372,523.68	-28,372,523.68

实现利得或损失的变动— —公允价值变动损益			
项目	上年度可比同期 2021年1月1日至2021年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或 损失	-	-	-
计入其他综合收益 的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金 融资产计入本期损益的未 实现利得或损失的变动— —公允价值变动损益	-	-	-

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估 值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均 值	与公允价值 之间的关系
限售股票	175,901,284.25	平均价格 亚式期权 模型	股票在剩余限 售期内的股价 的预期年化波 动率	21.27%~247.56%	负相关
项目	上年度末公允价 值	采用的估 值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均 值	与公允价值 之间的关系
-	-	-	-	-	-

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

7.4.14.4 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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	5,516,744,080.68	78.85
	其中：股票	5,516,744,080.68	78.85
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	383,071,734.47	5.48
	其中：债券	383,071,734.47	5.48
	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	500,064,270.62	7.15
	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	592,443,655.66	8.47
8	其他各项资产	4,366,551.26	0.06
9	合计	6,996,690,292.69	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	72,830,715.62	1.05
B	采矿业	16,063.74	0.00
C	制造业	3,172,700,567.19	45.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	22,965.75	0.00
E	建筑业	27,103.02	0.00
F	批发和零售业	65,321.50	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	263,231,838.18	3.79
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	480,880,252.38	6.93
J	金融业	101,509.83	0.00
K	房地产业	206,619,841.48	2.98
L	租赁和商务服务业	42,555.83	0.00
M	科学研究和技术服务业	801,054,746.43	11.54
N	水利、环境和公共设施管理业	18,848.25	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	519,018,685.81	7.47
R	文化、体育和娱乐业	113,065.67	0.00
S	综合	-	-
	合计	5,516,744,080.68	79.45

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

8.3 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	600519	贵州茅台	389,854	673,277,858.00	9.70
2	002304	洋河股份	4,030,259	646,856,569.50	9.32
3	300750	宁德时代	1,639,314	644,938,913.88	9.29
4	603882	金域医学	5,867,524	457,114,320.80	6.58
5	603259	药明康德	5,020,384	406,651,104.00	5.86
6	300347	泰格医药	3,611,636	378,499,452.80	5.45
7	600570	恒生电子	8,631,687	349,238,056.02	5.03
8	002352	顺丰控股	4,556,278	263,170,617.28	3.79
9	600309	万华化学	1,930,387	178,850,355.55	2.58
10	002410	广联达	2,174,652	130,370,387.40	1.88
11	002968	新大正	4,864,622	106,000,113.38	1.53
12	002463	沪电股份	8,569,976	101,982,714.40	1.47
13	001914	招商积余	6,542,245	100,619,728.10	1.45
14	002049	紫光国微	665,557	87,733,723.74	1.26
15	688690	纳微科技	1,611,352	82,660,206.32	1.19
16	000708	中信特钢	4,659,282	79,953,279.12	1.15
17	603799	华友钴业	1,336,171	74,331,192.73	1.07
18	300498	温氏股份	3,710,174	72,830,715.62	1.05
19	688269	凯立新材	798,000	68,468,400.00	0.99
20	300969	恒帅股份	1,033,540	68,265,317.00	0.98
21	601799	星宇股份	519,776	66,203,869.12	0.95

22	603055	台华新材	6,443,250	65,076,825.00	0.94
23	601012	隆基绿能	1,529,187	64,623,442.62	0.93
24	603197	保隆科技	1,356,260	64,151,098.00	0.92
25	300015	爱尔眼科	1,988,983	61,797,701.81	0.89
26	600529	山东药玻	2,206,694	58,830,462.04	0.85
27	603806	福斯特	564,738	37,521,192.72	0.54
28	002851	麦格米特	1,358,500	35,266,660.00	0.51
29	300146	汤臣倍健	1,522,481	34,743,016.42	0.50
30	688560	明冠新材	688,982	31,899,866.60	0.46
31	300012	华测检测	696,000	15,520,800.00	0.22
32	688337	普源精电	6,563	641,139.47	0.01
33	688475	萤石网络	20,526	532,239.18	0.01
34	688279	峰昭科技	5,505	473,980.50	0.01
35	688141	杰华特	9,946	472,435.00	0.01
36	688506	百利天恒	15,622	385,863.40	0.01
37	688061	灿瑞科技	3,972	346,239.24	0.00
38	301301	川宁生物	35,740	314,797.92	0.00
39	688046	药康生物	12,070	290,283.50	0.00
40	688373	盟科药业	31,886	272,306.44	0.00
41	688372	伟测科技	2,383	193,499.60	0.00
42	688498	源杰科技	1,582	189,096.46	0.00
43	688325	赛微微电	4,039	164,548.86	0.00
44	688147	微导纳米	6,293	157,828.44	0.00
45	301328	维峰电子	1,910	153,250.76	0.00
46	301280	珠城科技	2,783	132,065.20	0.00
47	301366	一博科技	2,672	124,831.72	0.00
48	688410	山外山	4,853	122,635.31	0.00
49	688132	邦彦技术	4,844	118,193.60	0.00
50	688496	清越科技	12,000	108,960.00	0.00
51	688291	金橙子	3,961	103,619.76	0.00
52	301269	华大九天	1,168	102,713.92	0.00
53	301265	华新环保	8,181	99,226.62	0.00
54	688420	N美腾	2,408	98,294.56	0.00
55	301176	逸豪新材	5,431	94,661.79	0.00
56	688143	长盈通	1,938	90,349.56	0.00
57	688419	耐科装备	3,039	89,468.16	0.00
58	688252	天德钰	5,201	87,220.77	0.00
59	301227	森鹰窗业	2,840	86,972.16	0.00
60	601136	首创证券	4,739	82,553.38	0.00
61	301161	唯万密封	3,460	80,697.58	0.00
62	301313	凡拓数创	2,464	79,626.97	0.00
63	301398	星源卓镁	2,549	78,837.80	0.00
64	301238	瑞泰新材	3,497	78,647.53	0.00

65	688525	佰维存储	4,614	74,100.84	0.00
66	301285	鸿日达	5,643	73,945.48	0.00
67	688455	科捷智能	5,277	71,819.97	0.00
68	301276	嘉曼服饰	3,026	70,269.50	0.00
69	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.00
70	301316	慧博云通	3,584	67,028.63	0.00
71	301267	华夏眼科	1,006	66,597.20	0.00
72	301368	丰立智能	3,368	66,558.14	0.00
73	301319	唯特偶	1,149	66,253.15	0.00
74	301095	广立微	740	64,002.60	0.00
75	301231	荣信文化	2,744	57,404.12	0.00
76	301309	万得凯	2,271	56,692.74	0.00
77	001269	欧晶科技	546	54,185.04	0.00
78	688448	磁谷科技	1,985	46,667.35	0.00
79	301327	华宝新能	242	42,826.74	0.00
80	001330	博纳影业	3,564	42,696.72	0.00
81	301239	普瑞眼科	575	40,066.00	0.00
82	301219	腾远钴业	578	39,841.54	0.00
83	301266	宇邦新材	517	39,085.20	0.00
84	001338	永顺泰	1,649	34,826.88	0.00
85	301165	锐捷网络	1,077	34,043.97	0.00
86	301200	大族数控	857	33,594.40	0.00
87	300893	松原股份	1,200	32,280.00	0.00
88	301216	万凯新材	1,120	32,121.60	0.00
89	301302	华如科技	466	29,837.98	0.00
90	601022	宁波远洋	1,983	26,770.50	0.00
91	301356	天振股份	614	26,604.62	0.00
92	603071	物产环能	1,627	26,324.86	0.00
93	301150	中一科技	404	26,062.04	0.00
94	603191	望变电气	1,149	25,530.78	0.00
95	301207	华兰疫苗	569	25,366.02	0.00
96	603122	合富中国	2,198	24,617.60	0.00
97	001322	箭牌家居	1,595	24,244.00	0.00
98	301195	北路智控	330	24,103.20	0.00
99	301168	通灵股份	329	23,809.73	0.00
100	301102	兆讯传媒	642	23,593.50	0.00
101	603255	鼎际得	489	21,956.10	0.00
102	301389	隆扬电子	1,269	21,776.04	0.00
103	301330	熵基科技	694	21,729.14	0.00
104	603209	兴通股份	595	21,610.40	0.00
105	001308	康冠科技	667	20,703.68	0.00
106	301152	天力锂能	433	20,195.12	0.00
107	301391	卡莱特	247	19,999.59	0.00

108	301286	侨源股份	784	19,372.64	0.00
109	301120	新特电气	1,032	19,205.52	0.00
110	001323	慕思股份	573	18,977.76	0.00
111	001228	永泰运	383	18,962.33	0.00
112	001236	弘业期货	1,399	18,956.45	0.00
113	301349	信德新材	180	18,633.60	0.00
114	301096	百诚医药	272	18,580.32	0.00
115	603206	嘉环科技	1,210	18,500.90	0.00
116	301171	易点天下	985	17,454.20	0.00
117	603057	紫燕食品	549	17,277.03	0.00
118	301363	美好医疗	445	16,843.25	0.00
119	603235	天新药业	572	16,656.64	0.00
120	001339	智微智能	812	16,516.08	0.00
121	301115	建科股份	685	16,467.40	0.00
122	301256	华融化学	1,831	16,332.52	0.00
123	603051	鹿山新材	272	16,295.52	0.00
124	301091	深城交	681	16,207.80	0.00
125	603211	晋拓股份	1,287	16,164.72	0.00
126	603132	金徽股份	1,342	16,063.74	0.00
127	301089	拓新药业	220	15,840.00	0.00
128	301122	采纳股份	301	15,555.68	0.00
129	301296	新巨丰	1,042	15,525.80	0.00
130	603170	宝立食品	542	15,354.86	0.00
131	603237	五芳斋	325	15,323.75	0.00
132	301069	凯盛新材	539	14,865.62	0.00
133	301223	中荣股份	815	14,775.95	0.00
134	001298	好上好	403	14,379.04	0.00
135	301097	天益医疗	249	14,063.52	0.00
136	605598	上海港湾	553	13,769.70	0.00
137	603070	万控智造	775	13,640.00	0.00
138	301377	鼎泰高科	770	13,575.10	0.00
139	603176	汇通集团	1,924	13,333.32	0.00
140	301100	风光股份	599	13,273.84	0.00
141	301149	隆华新材	1,214	13,232.60	0.00
142	603130	云中马	480	13,176.00	0.00
143	301230	泓博医药	269	12,998.08	0.00
144	001317	三羊马	300	12,840.00	0.00
145	301396	宏景科技	396	12,632.40	0.00
146	301338	凯格精机	257	12,590.43	0.00
147	603230	内蒙新华	1,141	12,585.23	0.00
148	301189	奥尼电子	435	12,432.30	0.00
149	001256	炜冈科技	474	12,390.36	0.00
150	001333	光华股份	426	12,332.70	0.00

151	301365	矩阵股份	516	12,316.92	0.00
152	001300	三柏硕	763	11,826.50	0.00
153	001299	美能能源	576	11,635.20	0.00
154	301290	东星医疗	330	11,592.90	0.00
155	001313	粤海饲料	1,232	11,580.80	0.00
156	301132	满坤科技	468	11,456.64	0.00
157	001331	胜通能源	385	11,330.55	0.00
158	301277	新天地	439	11,317.42	0.00
159	301179	泽宇智能	295	11,260.15	0.00
160	603151	邦基科技	535	11,256.40	0.00
161	301379	天山电子	449	11,058.87	0.00
162	301282	金禄电子	434	10,958.50	0.00
163	001238	浙江正特	374	10,797.38	0.00
164	301306	西测测试	255	10,783.95	0.00
165	001222	源飞宠物	434	10,758.86	0.00
166	603216	梦天家居	772	10,599.56	0.00
167	603213	镇洋发展	799	10,562.78	0.00
168	603097	江苏华辰	577	9,860.93	0.00
169	301193	家联科技	297	9,833.67	0.00
170	603182	嘉华股份	546	9,778.86	0.00
171	001268	联合精密	409	9,697.39	0.00
172	001230	劲旅环境	375	9,671.25	0.00
173	301118	恒光股份	315	9,516.15	0.00
174	001229	魅视科技	347	9,313.48	0.00
175	301259	艾布鲁	483	9,177.00	0.00
176	001266	宏英智能	346	9,155.16	0.00
177	001219	青岛食品	354	9,126.12	0.00
178	301196	唯科科技	271	9,100.18	0.00
179	603280	南方路机	363	8,893.50	0.00
180	301188	力诺特玻	647	8,812.14	0.00
181	301318	维海德	206	8,598.44	0.00
182	603215	比依股份	575	8,423.75	0.00
183	001231	农心科技	355	8,037.20	0.00
184	001296	长江材料	403	7,745.66	0.00
185	301135	瑞德智能	338	7,740.20	0.00
186	001234	泰慕士	333	7,675.65	0.00
187	301110	青木股份	202	7,647.72	0.00
188	603272	联翔股份	443	7,646.18	0.00
189	301197	工大科雅	380	7,630.40	0.00
190	301021	英诺激光	290	7,479.10	0.00
191	301111	粤万年青	379	7,435.98	0.00
192	605033	美邦股份	423	7,241.76	0.00
193	603048	浙江黎明	464	6,927.52	0.00

194	001336	楚环科技	274	6,770.54	0.00
195	603150	万朗磁塑	251	6,518.47	0.00
196	002493	荣盛石化	500	6,150.00	0.00
197	301133	金钟股份	286	5,988.84	0.00
198	301228	实朴检测	373	5,751.66	0.00
199	301063	海锅股份	153	5,205.06	0.00
200	301083	百胜智能	416	4,592.64	0.00
201	300144	宋城演艺	26	379.60	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	300750	宁德时代	1,138,020,727.83	12.36
2	603259	药明康德	743,791,868.18	8.08
3	603799	华友钴业	730,879,399.27	7.94
4	002304	洋河股份	582,655,733.10	6.33
5	002271	东方雨虹	521,101,955.79	5.66
6	603882	金城医学	455,595,283.54	4.95
7	601117	中国化学	437,708,240.55	4.75
8	600519	贵州茅台	400,127,456.55	4.35
9	600570	恒生电子	367,720,863.84	3.99
10	300347	泰格医药	365,231,287.57	3.97
11	600309	万华化学	325,480,857.65	3.54
12	688111	金山办公	298,564,512.62	3.24
13	002049	紫光国微	295,905,031.47	3.21
14	002493	荣盛石化	293,803,910.21	3.19
15	300661	圣邦股份	285,634,483.44	3.10
16	600765	中航重机	278,328,571.10	3.02
17	600346	恒力石化	271,776,749.49	2.95
18	002352	顺丰控股	235,281,522.42	2.56
19	002410	广联达	227,226,068.26	2.47
20	300274	阳光电源	216,502,008.65	2.35
21	601799	星宇股份	211,276,230.80	2.29
22	002444	巨星科技	198,719,235.08	2.16
23	000568	泸州老窖	189,133,482.42	2.05

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。

8.4.2 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 (%)
----	------	------	----------	-----------------

	码			
1	002493	荣盛石化	964,576,294.07	10.48
2	002271	东方雨虹	932,165,587.71	10.13
3	603799	华友钴业	716,249,198.45	7.78
4	603613	国联股份	646,841,550.99	7.03
5	600570	恒生电子	551,334,652.37	5.99
6	002444	巨星科技	521,932,235.32	5.67
7	002049	紫光国微	480,337,709.50	5.22
8	603816	顾家家居	470,484,507.26	5.11
9	300750	宁德时代	464,432,132.63	5.04
10	603259	药明康德	461,431,988.89	5.01
11	688032	禾迈股份	401,484,481.00	4.36
12	601117	中国化学	377,353,193.52	4.10
13	300661	圣邦股份	304,177,219.48	3.30
14	600765	中航重机	284,356,167.84	3.09
15	601233	桐昆股份	280,903,786.53	3.05
16	300782	卓胜微	273,264,239.07	2.97
17	688111	金山办公	268,901,199.40	2.92
18	300408	三环集团	256,122,305.68	2.78
19	600346	恒力石化	246,463,704.73	2.68
20	300274	阳光电源	220,597,102.26	2.40
21	002028	思源电气	188,452,165.25	2.05

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。

8.4.3 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	12,387,378,642.94
卖出股票收入（成交）总额	13,923,393,403.99

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。

8.5 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	383,069,734.25	5.52
	其中：政策性金融债	383,069,734.25	5.52
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）	2,000.22	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	383,071,734.47	5.52

8.6 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	220211	22 国开 11	1,200,000	120,646,126.03	1.74
2	220201	22 国开 01	900,000	91,819,158.90	1.32
3	220408	22 农发 08	900,000	90,165,082.19	1.30
4	220308	22 进出 08	500,000	49,979,931.51	0.72
5	220401	22 农发 01	300,000	30,459,435.62	0.44

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

8.11.2 本期国债期货投资评价

无。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	2,346,171.73
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,020,379.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,366,551.26

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	603882	金域医学	32,619,384.00	0.47	限售股

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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 (%)
410,161	18,219.01	401,044,597.50	5.37	7,071,683,128.91	94.63

9.2 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	3,024,600.25	0.04

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	-

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2005 年 9 月 29 日） 基金份额总额	4,874,882,643.01
本报告期期初基金份额总额	7,682,815,406.10
本报告期基金总申购份额	1,567,585,347.24
减：本报告期基金总赎回份额	1,777,673,026.93
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	7,472,727,726.41

§ 11 重大事件揭示**11.1 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。

11.2 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：2022 年 7 月 30 日本基金管理人发布公告，经公司第五届董事会第三十五次会议审议通过，夏华龙先生离任公司副总经理和首席信息官职位。

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。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

无。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所为德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙），本期审计费为 100,000.00 元。自本基金基金合同生效以来，本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 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。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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 (%)	
兴业证券	1	4,440,653,481.47	16.98	4,136,043.74	16.98	-
天风证券	1	4,272,192,343.50	16.33	3,978,698.16	16.33	-
国海证券	1	3,312,369,047.53	12.66	3,084,813.29	12.66	-
申万宏源证券	3	2,367,503,031.01	9.05	2,205,778.60	9.05	-
中金公司	2	1,970,452,090.85	7.53	1,838,856.03	7.55	-
国泰君安证券	1	1,748,967,841.86	6.69	1,628,813.53	6.69	-
华创证券	1	1,645,392,995.09	6.29	1,532,356.97	6.29	-
招商证券	1	1,555,760,952.37	5.95	1,449,254.90	5.95	-
华泰证券	1	1,461,577,594.09	5.59	1,361,169.16	5.59	-
东北证券	2	1,341,852,010.53	5.13	1,249,804.77	5.13	-
光大证券	2	611,225,141.14	2.34	569,234.25	2.34	-
中泰证券	1	483,195,231.17	1.85	450,007.52	1.85	-
国金证券	2	420,766,417.45	1.61	391,851.96	1.61	-
海通证券	1	329,534,114.23	1.26	306,887.06	1.26	-
安信证券	2	192,531,332	0.74	179,301.13	0.74	-

		.56				
长江证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	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	-	-	-	-	-

11.7.2 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(%)
兴业证券	7,606,732.45	41.74	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	10,616,871.30	58.25	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	2,000.00	0.01	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

国金证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
安信证 券	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 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，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。

11.8 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	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德精选混合型证券投资基金暂停直销机构大额申购（转换转入、定期定额投资）业务的公告	上海证券报、公司网站	2022 年 1 月 4 日
2	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德精选混合型证券投资基金分红公告	上海证券报、公司网站	2022 年 1 月 12 日
3	交银施罗德精选混合型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	公司网站	2022 年 1 月 21 日

4	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 1 月 29 日
5	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 3 月 15 日
6	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 3 月 18 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 3 月 18 日
8	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德精选混合型证券投资基金恢复大额申购（转换转入、定期定额投资）业务的公告	上海证券报、公司网站	2022 年 3 月 18 日
9	交银施罗德精选混合型证券投资基金 2021 年年度报告	公司网站	2022 年 3 月 30 日
10	交银施罗德精选混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	公司网站	2022 年 4 月 21 日
11	交银施罗德精选混合型证券投资基金 2022 年第 2 季度报告	公司网站	2022 年 7 月 20 日
12	交银施罗德基金管理有限公司关于增加中邮证券有限责任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 7 月 28 日
13	交银施罗德基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2022 年 7 月 30 日
14	交银施罗德基金管理有限公司关于增加开源证券股份有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2022 年 8 月 12 日
15	交银施罗德精选混合型证券投资基金 2022 年中期报告	公司网站	2022 年 8 月 30 日
16	交银施罗德基金管理有限公司关于调整直销中心柜台投资者最低认申购金额限制的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2022 年 9 月 3 日
17	交银施罗德精选混合型证券投资基金基金产品资料概要更新(2022 年第 1 号)	公司网站	2022 年 10 月 14 日
18	交银施罗德精选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 10 月 14 日
19	交银施罗德基金管理有限公司关于	中国证券报、上海证券	2022 年 10 月 19 日

	自有资金拟购买旗下偏股型基金的公告	报、证券时报、公司网站	
20	交银施罗德精选混合型证券投资基金 2022 年第 3 季度报告	公司网站	2022 年 10 月 25 日
21	交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金投资非公开发行股票的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2022 年 11 月 30 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准交银施罗德精选股票证券投资基金募集的文件；
- 2、《交银施罗德精选混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《交银施罗德精选混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《交银施罗德精选混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、关于募集交银施罗德精选股票证券投资基金之法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、报告期内交银施罗德精选混合型证券投资基金在规定报刊上各项公告的原稿。

13.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

13.3 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。