

交银施罗德招享一年持有期混合型基金中
基金(FOF)
2023 年中期报告

2023 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：招商银行股份有限公司

送出日期：2023 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 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 2023 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	47
7.1 期末基金资产组合情况	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
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	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
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	58
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	58
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	58

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	58
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58
7.12 本报告期投资基金情况	58
7.13 投资组合报告附注	错误!未定义书签。
§ 8 基金份额持有人信息	66
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	66
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	66
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	66
§ 9 开放式基金份额变动	66
§ 10 重大事件揭示	67
10.1 基金份额持有人大会决议	67
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	67
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	67
10.4 基金投资策略的改变	67
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	67
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	67
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	68
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况	68
10.9 其他重大事件	70
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	71
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	71
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	71
§ 12 备查文件目录	71
12.1 备查文件目录	71
12.2 存放地点	71
12.3 查阅方式	71

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	交银施罗德招享一年持有期混合型基金中基金 (FOF)	
基金简称	交银招享一年混合	
基金主代码	011605	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 8 月 24 日	
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	4,431,000,759.44 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	交银招享一年混合 A	交银招享一年混合 C
下属分级基金的交易代码	011605	011606
报告期末下属分级基金的份额总额	3,067,945,898.27 份	1,363,054,861.17 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金的基金份额，在保持基金资产良好的流动性的前提下，力争实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金通过对宏观经济运行周期、货币与财政政策形势、资金面供求变化、证券市场走势与估值水平等综合分析，并融合量化投资方法，结合国内外先进资产配置理念，及时把握市场时机，调整资产配置比例，获取资产配置收益；基于本基金管理人绩效评估系统对备选基金的评估分析，在有效控制风险的前提下，通过定量和定性相结合的方法，精选具有不同风险收益特征及投资业绩比较优势的基金确定本基金配置组合。
业绩比较基准	85%×中债综合全价指数收益率+15%×沪深 300 指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金，由于本基金主要投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金的基金份额，持有基金的预期风险和预期收益间接成为本基金的预期风险和预期收益。本基金的预期风险与预期收益高于债券型基金、债券型基金中基金、货币市场基金和货币型基金中基金，低于股票型基金和股票型基金中基金。

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	招商银行股份有限公司
信息披露负责	姓名	王晚婷	张姗
	联系电话	(021) 61055050	0755-83077987

人	电子邮箱	xxpl@jysld.com, disclosure@jysld.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-700-5000, 021-61055000	95555
传真		(021) 61055054	0755-83195201
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)	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		200120	518040
法定代表人		阮红	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.fund001.com
基金中期报告备置地点	基金管理人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023年1月1日-2023年6月30日)	
	交银招享一年混合 A	交银招享一年混合 C
本期已实现收益	-30,156,855.11	-16,217,325.10
本期利润	61,603,944.15	24,214,032.28
加权平均基金份额本期利润	0.0180	0.0160
本期加权平均净值利润率	1.82%	1.63%
本期基金份额净值增长率	1.71%	1.52%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)	
	期末可供分配利润	-52,022,952.63

期末可供分配基金份额利润	-0.0170	-0.0242
期末基金资产净值	3,041,193,647.17	1,341,200,398.77
期末基金份额净值	0.9913	0.9840
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-0.87%	-1.60%

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

交银招享一年混合 A

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	0.60%	0.20%	0.33%	0.13%	0.27%	0.07%
过去三个月	-0.07%	0.18%	0.03%	0.12%	-0.10%	0.06%
过去六个月	1.71%	0.18%	0.98%	0.12%	0.73%	0.06%
过去一年	-1.08%	0.18%	-1.02%	0.14%	-0.06%	0.04%
自基金合同生效起至今	-0.87%	0.18%	-1.27%	0.17%	0.40%	0.01%

交银招享一年混合 C

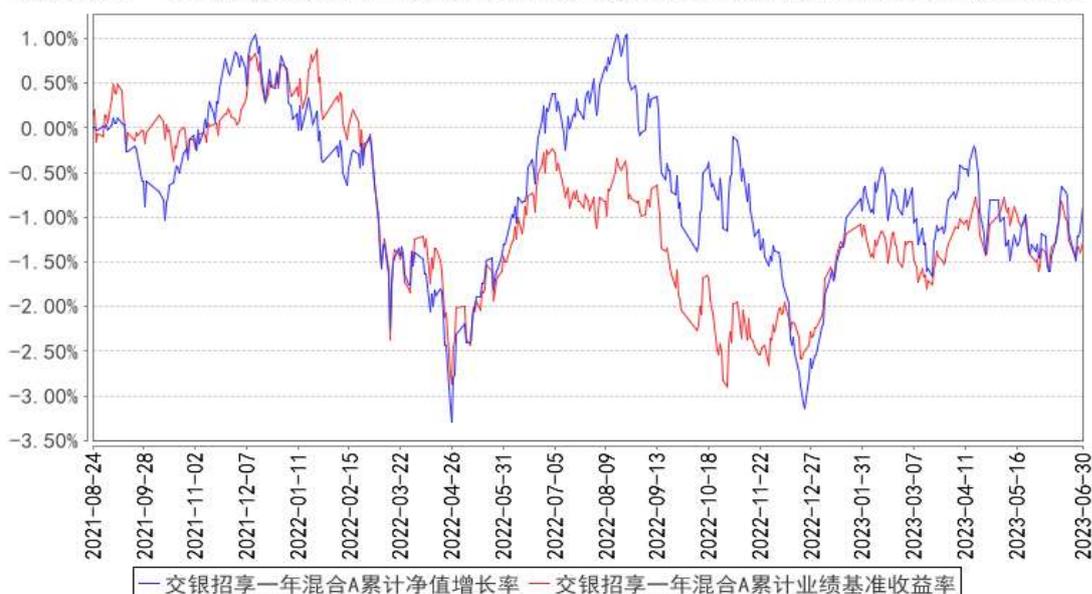
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.56%	0.20%	0.33%	0.13%	0.23%	0.07%
过去三个月	-0.16%	0.18%	0.03%	0.12%	-0.19%	0.06%
过去六个月	1.52%	0.18%	0.98%	0.12%	0.54%	0.06%
过去一年	-1.47%	0.18%	-1.02%	0.14%	-0.45%	0.04%
自基金合同生效	-1.60%	0.18%	-1.27%	0.17%	-0.33%	0.01%

起至今						
-----	--	--	--	--	--	--

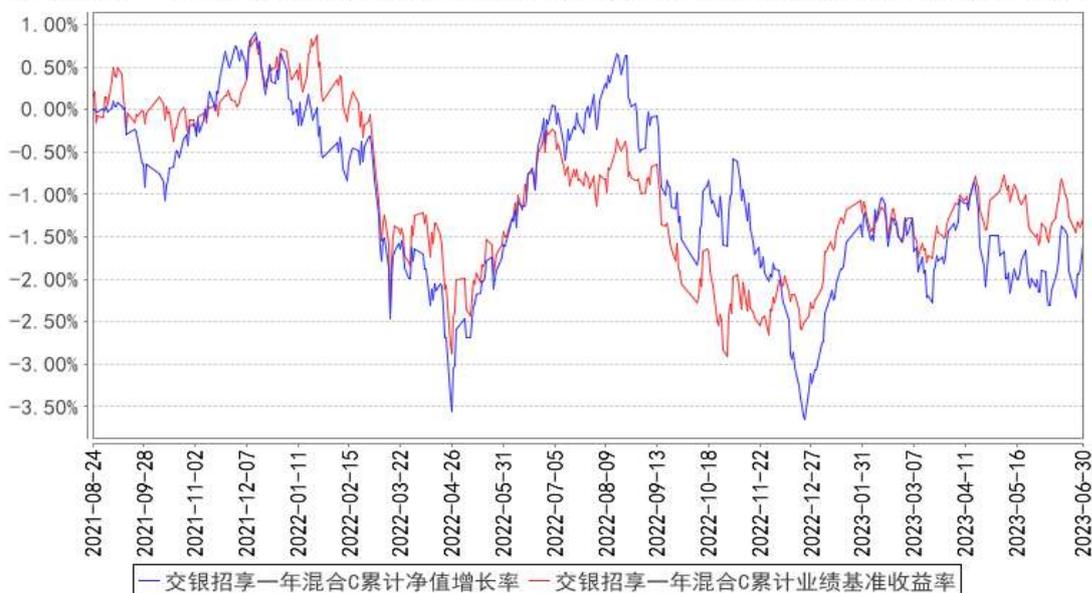
注：本基金的业绩比较基准为 $85\% \times$ 中债综合全价指数收益率 $+15\% \times$ 沪深 300 指数收益率，每日进行再平衡过程。

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

交银招享一年混合A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



交银招享一年混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至报告期末，公司管理了包括货币型、债券型、混合型和股票型在内的 122 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		
刘兵	交银招享一年混合、交银智选星光一年封闭运作混合（FOF-LOF）、交银兴享一年持有期混合（FOF）、交银优享一年持有期混合（FOF）、交银慧选睿信一年持有期混合（FOF）基金中基金、交银安享稳健	2021 年 8 月 24 日	-	7 年	刘兵先生，上海财经大学经济学博士。2016 年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任量化投资部研究员、多元资产管理部研究员、投资经理。

	养老一年、交银养老 2035 三年的基金经理以及基金投资顾问业务投资经理，公司多元资产管理助理总监				
--	---	--	--	--	--

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

2023 年上半年，国内经济开启复苏进程。一季度，伴随经济社会生活逐步恢复常态运行，经济呈现出弱复苏态势；进入二季度后，经济内生修复动力边际趋缓，除出口外多数经济指标走弱，反映当前经济内生需求仍不足。海外方面，欧美通胀自高位持续回落，但通胀读数仍高于欧美央行政策预期，市场对美国经济衰退预期经历曲折反复。国内权益市场在经济复苏预期摇摆中于一月快速上行，随后持续震荡调整，整体上价值风格相对占优。从行业上看，TMT 板块涨幅领先，主要是人工智能领域主题催化，同时家电亦涨幅居前，得益于基本面改善及较好的估值性价比。此外，受“中特估”概念催化下，建筑、机械等亦有较好的涨幅；相对的，受内需消费不振、地产销售较弱、猪肉价格持续低迷等因素影响，消费、地产和农林牧渔等相关行业跌幅居前。债市方面，利率在年初小幅调整后震荡下行，体现了市场对于复苏预期重新定价的过程，同时信用修复行情延续，信用利差整体收窄。

报告期内，本基金持续跟踪市场基本面、流动性、波动率以及股债配置性价比等指标，灵活调整股债仓位和资产内部结构。固定收益资产方面，信用债在前期大幅调整后，配置性价比提升，我们在期初适当增配了信用债基，后续债市走牛，持仓债基整体表现较好，未做过多调整，持续做好日常风险监测工作。权益资产方面，期初随着一系列积极政策推出，市场风险偏好提升，且波动率有所下降，因此我们适当提升了权益类资产仓位。后续权益市场震荡调整，但考虑到市场波动率已持续下行至历史较低水平，且存量资金博弈下结构性机会仍存，因此我们保持权益仓位基本不变，更加重视组合配置结构调整的节奏。我们的配置思路还是紧密跟踪市场主流配置方向，在不过度暴露行业和风格偏离风险的情况下，适当偏向景气趋势向好的板块，力争上涨时跟得上，下跌时守得住。

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 年下半年，经济基本面仍面临一定周期性压力，但伴随基数效应叠加稳增长政策效果逐步显现，国内经济或将企稳复苏，我们将关注总量及产业政策的推进。海外方面，美国经济仍有韧性，就业市场依然强劲，且通胀水平距离目标仍有较大距离，需跟踪美国经济数据和美联储加息动态。此外，海外金融风险暴露和地缘政治冲突演化等外围风险事件亦值得关注。股市方面，在政策和经济预期未出现进一步变化前，短期内权益市场走势仍有不确定性。但后续若伴随着国内经济温和复苏，A 股上市公司盈利修复延续，叠加投资者信心逐步回暖，股市微观流动性压力得到缓解。从中长期来看，A 股机会大于风险，其中政策支持对国内经济增长复苏的延续仍较为关键。债市方面，国内政策边际变化和经济修复节奏将成为影响债市的主要因素。在内生动能偏弱、政策温和发力、流动性保持平稳下，债市或呈现震荡的格局。未来的投资操作上，我们会继续严密跟踪市场走势和经济形势，做好组合的风险管理，力争给投资者带来更好的持有体验。

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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：交银施罗德招享一年持有期混合型基金中基金(FOF)

报告截止日：2023年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	28,769,482.77	104,639,438.91
结算备付金		1,031,426.31	3,440,305.89
存出保证金		44,377.99	66,022.83
交易性金融资产	6.4.7.2	4,383,896,137.62	5,052,009,862.22
其中：股票投资		241,460,255.55	184,814,885.48
基金投资		3,880,604,212.13	4,623,165,473.69
债券投资		261,831,669.94	244,029,503.05
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	10,000,000.00	135,052,897.30

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		13,100,362.25	5,193,405.00
应收股利		2,005.19	241,143.57
应收申购款		6,964.76	34,115.98
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	171,129.52	125,290.74
资产总计		4,437,021,886.41	5,300,802,482.44
负债和净资产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022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		10,000,000.00	-
应付赎回款		42,282,225.23	36,657,427.16
应付管理人报酬		783,149.16	1,026,219.65
应付托管费		454,134.17	629,298.83
应付销售服务费		448,117.05	564,363.58
应付投资顾问费		-	-
应交税费		690.06	9,197.29
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	659,524.80	789,924.72
负债合计		54,627,840.47	39,676,431.23
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	4,431,000,759.44	5,407,447,017.69
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-48,606,713.50	-146,320,966.48
净资产合计		4,382,394,045.94	5,261,126,051.21
负债和净资产总计		4,437,021,886.41	5,300,802,482.44

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 4,431,000,759.44 份，其中交银招享一年混合 A 基金份额总额 3,067,945,898.27 份，基金份额净值 0.9913 元；交银招享一年混合 C 基金份额总额 1,363,054,861.17 份，基金份额净值 0.9840 元。

6.2 利润表

会计主体：交银施罗德招享一年持有期混合型基金中基金 (FOF)

本报告期：2023年1月1日至2023年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年1月1日至2023 年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年6月30日
一、营业总收入		97,499,517.53	-34,608,870.15
1. 利息收入		198,139.33	549,536.76
其中：存款利息收入	6.4.7.13	102,520.89	164,498.27
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		95,618.44	385,038.49
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-35,670,547.56	-105,945,072.12
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-147,977.54	-54,214,095.00
基金投资收益	6.4.7.15	-49,409,611.44	-124,731,172.97
债券投资收益	6.4.7.16	4,705,070.97	4,671,823.29
资产支持证券投资	6.4.7.17	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.18	-	-
衍生工具收益	6.4.7.19	-	-
股利收益	6.4.7.20	9,181,970.45	68,328,372.56
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）	6.4.7.21	132,192,156.64	70,329,346.20
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.22	779,769.12	457,319.01
减：二、营业总支出		11,681,541.10	24,369,843.73
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,465,431.33	12,800,304.06
2. 托管费	6.4.10.2.2	3,100,050.33	5,707,197.58
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	2,959,149.94	5,738,364.75
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		15,052.55	628.33

其中：卖出回购金融资产支出		15,052.55	628.33
6. 信用减值损失	6.4.7.24	-	-
7. 税金及附加		762.93	1,386.34
8. 其他费用	6.4.7.25	141,094.02	121,962.67
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		85,817,976.43	-58,978,713.88
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		85,817,976.43	-58,978,713.88
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		85,817,976.43	-58,978,713.88

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：交银施罗德招享一年持有期混合型基金中基金(FOF)

本报告期：2023年1月1日至2023年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023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)	5,407,447,017.69	-	-	5,261,126,051.21
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)	5,407,447,017.69	-	-	5,261,126,051.21
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	97,714,252.98	-878,732,005.27
（一）、综合收益总额	-	-	85,817,976.43	85,817,976.43
（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）	976,446,258.25	-	11,896,276.55	-964,549,981.70
其中：1. 基金申	1,689,037.61	-	-21,529.46	1,667,508.15

购款				
2. 基金赎回款	- 978,135,295.86	-	11,917,806.01	-966,217,489.85
(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)	4,431,000,759. 44	-	-48,606,713.50	4,382,394,045.9 4
项目	上年度可比期间 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)	9,033,456,260. 93	-	67,925,592.27	9,101,381,853.2 0
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)	9,033,456,260. 93	-	67,925,592.27	9,101,381,853.2 0
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	4,673,492.67	-	-59,015,658.19	-54,342,165.52
(一)、综合收益总额	-	-	-58,978,713.88	-58,978,713.88
(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)	4,673,492.67	-	-36,944.31	4,636,548.36
其中：1. 基金申购款	4,673,492.67	-	-36,944.31	4,636,548.36
2. 基金赎回款	-	-	-	-

(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	9,038,129,753.60	-	8,909,934.08	9,047,039,687.68

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

谢卫

基金管理人负责人

印皓

主管会计工作负责人

单江

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

交银施罗德招享一年持有期混合型基金中基金(FOF)(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2021]334号《关于准予交银施罗德招享一年持有期混合型基金中基金(FOF)注册的批复》注册,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《交银施罗德招享一年持有期混合型基金中基金(FOF)基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币8,988,644,575.64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(2021)第0465号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《交银施罗德招享一年持有期混合型基金中基金(FOF)基金合同》于2021年8月24日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为8,989,864,235.49份基金份额,其中认购资金利息折合1,219,659.85份基金份额。本基金的基金管理人为交银施罗德基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《交银施罗德招享一年持有期混合型基金中基金(FOF)基金合同》和《交银施罗德招享一年持有期混合型基金中基金(FOF)招募说明书》,本基金根据认购/申购费用、赎回费用以及销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用、赎回时收取赎回费用的,且不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为A类基金份额;在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用、赎回时收取赎回费用,且从本类别基金资产中

计提销售服务费的，称为C类基金份额。本基金A类和C类两种收费模式并存，各类基金份额分别计算基金份额净值。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额，但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德招享一年持有期混合型基金中基金(FOF)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，包括经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金(含ETF和LOF、香港互认基金、不含QDII)、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或注册上市的股票、存托凭证)、债券(含国债、央行票据、金融债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、企业债券、公司债券、可转换债券(含可分离交易可转换债券的纯债部分)、可交换债券、公开发行的次级债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、货币市场工具、债券回购、同业存单、银行存款(含协议存款、定期存款及其他银行存款)以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为：本基金投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金的基金份额的资产不低于本基金资产的80%，投资于股票型基金(包括股票指数基金)的比例占基金资产的0%-30%；本基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：85%x中债综合全价指数收益率+15%x沪深300指数收益率。

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8月30日批准报出。

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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2023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2023年06月30日的财务状况以及2023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、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末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 2023年6月30日
活期存款	28,769,482.77
等于：本金	28,767,393.43
加：应计利息	2,089.34
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	28,769,482.77

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	242,155,901.31	-	241,460,255.55	-695,645.76
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	4,870,489.41	241,436,776.79	-565,562.58
	银行间市场	20,152,000.00	354,893.15	-112,000.00
	合计	257,283,849.96	5,225,382.56	261,831,669.94
资产支持证券	-	-	-	-
基金	3,816,359,196.21	-	3,880,604,212.13	64,245,015.92
其他	-	-	-	-
合计	4,315,798,947.48	5,225,382.56	4,383,896,137.62	62,871,807.58

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 2023年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	10,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	10,000,000.00	-

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

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应收利息	-
其他应收款	171,129.52
待摊费用	-
合计	171,129.52

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	555,845.85
其中：交易所市场	555,845.85
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	39,671.58
预提信息披露费	59,507.37
预提账户维护费	4,500.00
合计	659,524.80

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

交银招享一年混合 A

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,744,960,260.95	3,744,960,260.95
本期申购	751,482.35	751,482.35
本期赎回（以“-”号填列）	-677,765,845.03	-677,765,845.03
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	3,067,945,898.27	3,067,945,898.27

交银招享一年混合 C

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	1,662,486,756.74	1,662,486,756.74
本期申购	937,555.26	937,555.26
本期赎回(以“-”号填列)	-300,369,450.83	-300,369,450.83
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	1,363,054,861.17	1,363,054,861.17

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

交银招享一年混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-29,523,387.53	-65,747,908.08	-95,271,295.61
本期利润	-30,156,855.11	91,760,799.26	61,603,944.15
本期基金份额交易产生的变动数	7,657,290.01	-742,189.65	6,915,100.36
其中：基金申购款	-7,924.18	986.91	-6,937.27
基金赎回款	7,665,214.19	-743,176.56	6,922,037.63
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-52,022,952.63	25,270,701.53	-26,752,251.10

交银招享一年混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-22,002,444.51	-29,047,226.36	-51,049,670.87
本期利润	-16,217,325.10	40,431,357.38	24,214,032.28
本期基金份额交易产生的变动数	5,233,881.83	-252,705.64	4,981,176.19
其中：基金申购款	-15,611.05	1,018.86	-14,592.19
基金赎回款	5,249,492.88	-253,724.50	4,995,768.38
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-32,985,887.78	11,131,425.38	-21,854,462.40

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	75,140.31
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	26,843.18
其他	537.40
合计	102,520.89

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 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-147,977.54
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	-147,977.54

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 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	536,965,121.88
减：卖出股票成本总额	535,458,917.18
减：交易费用	1,654,182.24
买卖股票差价收入	-147,977.54

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	2,609,126,333.99
减：卖出/赎回基金成本总额	2,657,856,428.18
减：买卖基金差价收入应缴纳增	-

值税额	
减：交易费用	679,517.25
基金投资收益	-49,409,611.44

6.4.7.16 债券投资收益

6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	3,322,297.42
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付)差价收入	1,382,773.55
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	4,705,070.97

6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	214,841,376.17
减：卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	211,604,121.09
减：应计利息总额	1,842,408.75
减：交易费用	12,072.78
买卖债券差价收入	1,382,773.55

6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 资产支持证券投资收益

6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 贵金属投资收益

6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.19 衍生工具收益

6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	3,921,576.60
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	5,260,393.85
合计	9,181,970.45

6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	132,192,156.64
股票投资	8,991,105.15
债券投资	713,597.48
资产支持证券投资	-
基金投资	122,487,454.01
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	132,192,156.64

6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	-
销售服务费返还	779,769.12
合计	779,769.12

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。

6.4.7.23 持有基金产生的费用

项目	本期费用 2023年1月1日至2023年6月30日
当期持有基金产生的应支付销售服务费(元)	2,135,180.28
当期持有基金产生的应支付管理费(元)	12,448,177.56
当期持有基金产生的应支付托管费(元)	2,984,153.42

注：上述费用为根据所投资基金的招募说明书列明的计算方法对销售服务费、管理费和托管费进行的估算；上述费用已在本基金所持有基金的净值中体现，不构成本基金的费用项目。

6.4.7.24 信用减值损失

无。

6.4.7.25 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	32,915.07
债券账户费用	9,000.00
合计	141,094.02

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
招商银行股份有限公司(“招商银行”)	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

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 基金交易

无。

6.4.10.1.5 权证交易

无。

6.4.10.1.6 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 2023年1月1日至2023年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,465,431.33	12,800,304.06
其中：支付销售机构的客户维护费	4,589,904.84	9,125,323.84

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金管理人管理的其他基金部分后的余额的0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：
日管理人报酬=前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金管理人管理的其他基金部分后的余额×0.50%÷当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,100,050.33	5,707,197.58

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金托管人托管的其他基金部分后的余额的0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：
日托管费=前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金托管人托管的其他基金部分后的余额×0.15%÷当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	交银招享一年混合A	交银招享一年混合C	合计
交通银行股份有限公司	-	463,536.56	463,536.56
交银施罗德基金管理有限公司	-	261.03	261.03
招商银行股份有限公司	-	2,482,254.73	2,482,254.73

合计	-	2,946,052.32	2,946,052.32
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	交银招享一年混合A	交银招享一年混合C	合计
交通银行股份有限公司	-	840,831.99	840,831.99
交银施罗德基金管理有限 公司	-	1,323.31	1,323.31
招商银行股份有限公司	-	4,875,991.68	4,875,991.68
合计	-	5,718,146.98	5,718,146.98

注：支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日C类基金份额对应的基金资产净值0.4%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给交银施罗德基金公司，再由交银施罗德基金公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日基金销售服务费} = \text{前一日C类基金份额对应的资产净值} \times 0.4\% \div \text{当年天数}。$$

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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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

招商银行_活期存款	28,769,482.77	75,140.31	33,011,394.46	125,120.40
-----------	---------------	-----------	---------------	------------

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

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

于2023年06月30日，本基金持有基金管理人所管理的公开募集证券投资基金合计2,499,095,165.10元，占本基金资产净值的比例为57.03%。

6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

项目	本期费用 2023年1月1日至2023年 6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期交易基金产生的申购费（元）	-	-
当期交易基金产生的赎回费（元）	62,462.55	-
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	783,257.80	466,026.92
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	5,984,450.63	8,929,170.49
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	1,636,001.47	2,491,914.37
当期交易基金产生的交易费（元）	-	-
当期交易基金产生的转换费（元）	223,343.52	350,611.12

注：本基金申购、赎回本基金的基金管理人管理的其他基金(ETF除外)，应当通过基金管理人的直销渠道且不得收取申购费、赎回费(按规定应当收取并记入被投资基金其他收入部分的赎回费除外)、销售服务等销售费用。相关申购费、赎回费由基金管理人直接减免，故当期交易基金产生的申购费为零，当期交易基金产生的赎回费仅为按规定应当收取并记入被投资基金其他收入部分的赎回费。相关销售服务费已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，由基金管理人从被投资基金收取后向本基金返还，当期持有基金产生的应支付销售服务费为管理人当期应向本基金返还的销售服务费，相关披露金额根据本基金对被投资基金的实际持仓、被投资基金的基金合同约定的费率和方法估算。当期持有基金产生的应支付管理费、当期持有基金产生的应支付托管费已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，相关披露金额根据本基金对被投资基金的实际持仓、被投资基金的基金合同约定的费率和方法估算。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2023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
001282	三联锻造	2023年5月15日	6个月以上	限售股	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
001286	陕西能源	2023年3月31日	6个月以上	限售股	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023年3月30日	6个月以上	限售股	11.88	21.02	1,386	16,465.68	29,133.72	-
001328	登康口腔	2023年3月29日	6个月以上	限售股	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001360	南矿集团	2023年3月31日	6个月以上	限售股	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
001367	海森药业	2023年3月30日	6个月以上	限售股	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
300804	广康生化	2023年6月15日	6个月以上	限售股	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22	-
301157	华塑科技	2023年3月1日	6个月以上	限售股	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301170	锡南科技	2023年6月16日	6个月以上	限售股	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	1个月内（含）	新股未上市	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	6个月以上	限售股	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-

		日									
301203	国泰环保	2023年3月28日	6个月以上	限售股	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-	
301225	恒勃股份	2023年6月8日	6个月以上	限售股	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58	-	
301232	飞沃科技	2023年6月8日	6个月以上	限售股	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-	
301260	格力博	2023年1月20日	6个月以上	限售股	30.85	23.63	3,121	96,282.85	73,749.23	-	
301261	恒工精密	2023年6月29日	6个月以上	限售股	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	-	
301261	恒工精密	2023年6月29日	1个月内(含)	新股未上市	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	-	
301281	科源制药	2023年3月28日	6个月以上	限售股	44.18	25.10	241	10,647.38	6,049.10	-	
301281	科源制药	2023年5月26日	1-6个月(含)	限售股送股	-	25.10	96	-	2,409.60	-	
301291	明阳电气	2023年6月21日	6个月以上	限售股	38.13	31.03	1,206	45,984.78	37,422.18	-	
301293	三博脑科	2023年4月25日	6个月以上	限售股	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-	
301303	真兰仪表	2023年2月13日	6个月以上	限售股	26.80	22.32	1,058	28,354.40	23,614.56	-	
301305	朗坤环境	2023年5月15日	6个月以上	限售股	25.25	19.69	753	19,013.25	14,826.57	-	
301307	美利信	2023年4月14日	6个月以上	限售股	32.34	31.86	687	22,217.58	21,887.82	-	
301310	鑫宏业	2023年5月26日	6个月以上	限售股	67.28	65.43	409	27,517.52	26,760.87	-	
301315	威士	2023年	6个月	限售股	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-	

	顿	6月13日	以上								
301322	绿通科技	2023年2月27日	6个月以上	限售股	131.11	53.24	261	34,219.71	13,895.64	-	
301322	绿通科技	2023年5月25日	1-6个月(含)	限售股送股	-	53.24	130	-	6,921.20	-	
301323	新莱福	2023年5月29日	6个月以上	限售股	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-	
301325	曼恩斯特	2023年5月4日	6个月以上	限售股	76.80	107.95	364	27,955.20	39,293.80	-	
301332	德尔玛	2023年5月9日	6个月以上	限售股	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	-	
301337	亚华电子	2023年5月16日	6个月以上	限售股	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-	
301345	涛涛车业	2023年3月10日	6个月以上	限售股	73.45	46.64	266	19,537.70	12,406.24	-	
301358	湖南裕能	2023年2月1日	6个月以上	限售股	23.77	42.89	2,023	48,086.71	86,766.47	-	
301360	荣旗科技	2023年4月17日	6个月以上	限售股	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-	
301373	凌玮科技	2023年1月20日	6个月以上	限售股	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-	
301376	致欧科技	2023年6月14日	6个月以上	限售股	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-	
301382	蜂助手	2023年5月9日	6个月以上	限售股	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-	
301383	天键股份	2023年5月31日	6个月以上	限售股	46.16	35.72	493	22,756.88	17,609.96	-	
301387	光大同创	2023年4月10日	6个月以上	限售股	58.32	45.36	307	17,904.24	13,925.52	-	

301397	溯联股份	2023年6月15日	6个月以上	限售股	53.27	40.20	362	19,283.74	14,552.40	-
301399	英特科技	2023年5月16日	6个月以上	限售股	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01	-
301408	华人健康	2023年2月22日	6个月以上	限售股	16.24	16.95	879	14,274.96	14,899.05	-
301429	森泰股份	2023年4月10日	6个月以上	限售股	28.75	21.02	499	14,346.25	10,488.98	-
301439	泓淋电力	2023年3月10日	6个月以上	限售股	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10	-
301486	致尚科技	2023年6月30日	1个月内(含)	新股未上市	57.66	57.66	4,338	250,129.08	250,129.08	-
301486	致尚科技	2023年6月30日	6个月以上	限售股	57.66	57.66	482	27,792.12	27,792.12	-
301488	豪恩汽电	2023年6月26日	6个月以上	限售股	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	-
301488	豪恩汽电	2023年6月26日	1个月内(含)	新股未上市	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68	-
601061	中信金属	2023年3月30日	6个月以上	限售股	6.58	7.58	4,016	26,425.28	30,441.28	-
601065	江盐集团	2023年3月31日	6个月以上	限售股	10.36	11.84	875	9,065.00	10,360.00	-
601133	柏诚股份	2023年3月31日	6个月以上	限售股	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	-
603125	常青科技	2023年3月30日	6个月以上	限售股	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	-
603135	中重科技	2023年3月29日	6个月以上	限售股	17.80	17.89	628	11,178.40	11,234.92	-
603137	恒尚节能	2023年4月10日	6个月以上	限售股	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-

		日								
603172	万丰股份	2023年4月28日	6个月以上	限售股	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-
688146	中船特气	2023年4月13日	6个月以上	限售股	36.15	38.13	1,011	36,547.65	38,549.43	-
688334	西高院	2023年6月9日	6个月以上	限售股	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48	-
688361	中科飞测	2023年5月12日	6个月以上	限售股	23.60	64.67	831	19,611.60	53,740.77	-
688429	时创能源	2023年6月20日	6个月以上	限售股	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
688433	华曙高科	2023年4月7日	6个月以上	限售股	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	-
688443	智翔金泰	2023年6月13日	6个月以上	限售股	37.88	29.49	3,033	114,890.04	89,443.17	-
688458	美芯晟	2023年5月15日	6个月以上	限售股	75.00	90.76	221	16,575.00	20,057.96	-
688469	中芯集成	2023年4月28日	6个月以上	限售股	5.69	5.41	13,800	78,522.00	74,658.00	-
688472	阿特斯	2023年6月2日	6个月以上	限售股	11.10	17.04	6,261	69,497.10	106,687.44	-
688479	友车科技	2023年5月4日	6个月以上	限售股	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-
688484	南芯科技	2023年3月28日	6个月以上	限售股	39.99	36.71	1,008	40,309.92	37,003.68	-
688506	百利天恒	2022年12月28日	6个月以上	限售股	24.70	71.38	15,622	385,863.40	1,115,098.36	-
688507	索辰科技	2023年4月10日	6个月以上	限售股	245.56	122.11	150	36,834.00	18,316.50	-
688507	索辰	2023年	1-6个	限售股	-	122.11	72	-	8,791.92	-

	科技	6月20日	月(含)	送股							
688523	航天环宇	2023年5月26日	6个月以上	限售股	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-	
688531	日联科技	2023年3月24日	6个月以上	限售股	152.38	135.97	346	52,723.48	47,045.62	-	
688535	华海诚科	2023年3月28日	6个月以上	限售股	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-	
688543	国科军工	2023年6月14日	6个月以上	限售股	43.67	53.05	410	17,904.70	21,750.50	-	
688562	航天软件	2023年5月15日	6个月以上	限售股	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-	
688570	天玛智控	2023年5月29日	6个月以上	限售股	30.26	25.33	884	26,749.84	22,391.72	-	
688576	西山科技	2023年5月30日	6个月以上	限售股	135.80	120.41	240	32,592.00	28,898.40	-	
688581	安杰思	2023年5月12日	6个月以上	限售股	125.80	118.03	163	20,505.40	19,238.89	-	
688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月以上	限售股	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	-	
688593	新相微	2023年5月25日	6个月以上	限售股	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	-	
688603	天承科技	2023年6月30日	1个月内(含)	新股未上市	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00	-	
688603	天承科技	2023年6月30日	6个月以上	限售股	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	-	
688620	安凯微	2023年6月15日	6个月以上	限售股	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-	
688623	双元科技	2023年5月31日	6个月以上	限售股	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62	-	

688629	华丰科技	2023年6月16日	6个月以上	限售股	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	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
127087	星帅转2	2023年6月14日	1-6个月（含）	老股东配债	100.00	100.01	1,025	102,500.00	102,511.46	-

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

本基金为混合型基金中基金，由于本基金主要投资于公开募集证券投资基金的基金份额，持有基金的预期风险和预期收益间接成为本基金的预期风险和预期收益。本基金的预期风险与预期收益高于债券型基金、债券型基金中基金、货币市场基金和货币型基金中基金，低于股票型基金和股票型基金中基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金（含ETF和LOF、香港互认基金、不含QDII）、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或注册上市的股票、存托凭证）、债券（含国债、央行票据、金融债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、企业债券、公

司债券、可转换债券(含可分离交易可转换债券的纯债部分)、可交换债券、公开发行的次级债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、货币市场工具、债券回购、同业存单、银行存款(含协议存款、定期存款及其他银行存款)以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金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投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金的基金份额,在保持基金资产良好的流动性的前提下,力争实现基金资产的长期增值。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设,在董事会下设立合规审核及风险管理委员会,负责制定风险管理的宏观政策,审议通过风险控制的总体措施等;在管理层层面设立风险控制委员会,讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施;在业务操作层面风险管理职责主要由风险管理部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。风险管理部对公司总经理负责。督察长独立行使督察权利,直接对董事会负责,就内部控制制度和执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能,定期和不定期地向董事会报告公司内部控制执行情况。

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人招商银行股份有限公司,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,在场外申赎基金份额均通过该基金的基金管理人的直销柜台办理,违约风险可能性很小;在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2023 年 6 月 30 日，本基金持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.91%（2022 年 12 月 31 日：0.55%）。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可在基金最短持有期限到期日起（含当日）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 2023 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、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期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。

本基金持有单只基金的市值,不高于本基金资产净值的20%,且不持有其他基金中基金。本基金的基金管理人管理的全部基金中基金持有单只基金(ETF联接基金除外)不超过被投资基金净资产的20%,被投资基金净资产规模以最近定期报告披露的规模为准。本基金投资于一家公司发行的证券(不含本基金所投资的基金份额)市值不超过基金资产净值的10%,且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券(不含本基金所投资的基金份额)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,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,其余亦可在基金销售机构申购、赎回,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。在本基金开放日,本基金投资于流通受限基金不高于本基金资产净值的10%;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。

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023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	28,769,482.77	-	-	-	28,769,482.77
结算备付金	1,031,426.31	-	-	-	1,031,426.31
存出保证金	44,377.99	-	-	-	44,377.99
交易性金融资产	222,758,878.66	35,744,798.00	3,327,993.28	4,122,064,467.68	4,383,896,137.62
买入返售金融资产	10,000,000.00	-	-	-	10,000,000.00
应收股利	-	-	-	2,005.19	2,005.19
应收申购款	-	-	-	6,964.76	6,964.76
应收清算款	-	-	-	13,100,362.25	13,100,362.25
其他资产	-	-	-	171,129.52	171,129.52
资产总计	262,604,165.73	35,744,798.00	3,327,993.28	4,135,344,929.40	4,437,021,886.41
负债					
应付赎回款	-	-	-	42,282,225.23	42,282,225.23
应付管理人报酬	-	-	-	783,149.16	783,149.16
应付托管费	-	-	-	454,134.17	454,134.17
应付清算款	-	-	-	10,000,000.00	10,000,000.00
应付销售服务费	-	-	-	448,117.05	448,117.05
应交税费	-	-	-	690.06	690.06
其他负债	-	-	-	659,524.80	659,524.80
负债总计	-	-	-	54,627,840.47	54,627,840.47
利率敏感度缺口	262,604,165.73	35,744,798.00	3,327,993.28	4,080,717,088.93	4,382,394,045.94
上年度末	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

2022 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	104,639,438.91	-	-	-	104,639,438.91
结算备付金	3,440,305.89	-	-	-	3,440,305.89
存出保证金	66,022.83	-	-	-	66,022.83
交易性金融资产	215,727,325.52	22,570,549.75	5,731,627.78	4,807,980,359.17	5,052,009,862.22
买入返售金融资产	135,052,897.30	-	-	-	135,052,897.30
应收股利	-	-	-	241,143.57	241,143.57
应收申购款	-	-	-	34,115.98	34,115.98
应收清算款	-	-	-	5,193,405.00	5,193,405.00
其他资产	-	-	-	125,290.74	125,290.74
资产总计	458,925,990.45	22,570,549.75	5,731,627.78	4,813,574,314.46	5,300,802,482.44
负债					
应付赎回款	-	-	-	36,657,427.16	36,657,427.16
应付管理人报酬	-	-	-	1,026,219.65	1,026,219.65
应付托管费	-	-	-	629,298.83	629,298.83
应付销售服务费	-	-	-	564,363.58	564,363.58
应交税费	-	-	-	9,197.29	9,197.29
其他负债	-	-	-	789,924.72	789,924.72
负债总计	-	-	-	39,676,431.23	39,676,431.23
利率敏感度缺口	458,925,990.45	22,570,549.75	5,731,627.78	4,773,897,883.23	5,261,126,051.21

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2023 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 5.97% (2022 年 12 月 31 日：4.59%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2022 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中：本基金投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金的基金份额的资产不低于本基金资产的80%；投资于股票型基金（包括股票指数基金）的比例占基金资产的0%-30%；本基金持有的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022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	241,460,255.55	5.51	184,814,885.48	3.51
交易性金融资产—基金投资	3,880,604,212.13	88.55	4,623,165,473.69	87.87
交易性金融资产—债券投资	40,013,697.26	0.91	28,998,509.74	0.55
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	4,162,078,164.94	94.97	4,836,978,868.91	91.94

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		
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(2023年6月30日)	上年度末(2022年12月)

			31日)
1. 业绩比较基准上 涨 5%		223,397,212.64	235,827,072.92
2. 业绩比较基准下 降 5%		-223,397,212.64	-235,827,072.92

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 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	4,158,723,166.00	4,833,559,915.17
第二层次	222,530,867.28	215,416,856.71
第三层次	2,642,104.34	3,033,090.34
合计	4,383,896,137.62	5,052,009,862.22

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	241,460,255.55	5.44
	其中：股票	241,460,255.55	5.44
2	基金投资	3,880,604,212.13	87.46
3	固定收益投资	261,831,669.94	5.90
	其中：债券	261,831,669.94	5.90
	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	10,000,000.00	0.23
	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	29,800,909.08	0.67
8	其他各项资产	13,324,839.71	0.30
9	合计	4,437,021,886.41	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	5,460,826.00	0.12
B	采矿业	18,792,989.70	0.43
C	制造业	151,321,024.19	3.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,867,641.47	0.25
E	建筑业	5,762,629.15	0.13

F	批发和零售业	3,103,793.25	0.07
G	交通运输、仓储和邮政业	8,179,131.77	0.19
H	住宿和餐饮业	1,189,754.00	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,313,893.84	0.03
J	金融业	23,782,966.20	0.54
K	房地产业	3,884,052.00	0.09
L	租赁和商务服务业	2,073,823.00	0.05
M	科学研究和技术服务业	1,607,694.96	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	1,577,308.01	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,591,008.01	0.04
R	文化、体育和娱乐业	951,720.00	0.02
S	综合	-	-
	合计	241,460,255.55	5.51

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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	300750	宁德时代	31,240	7,147,399.60	0.16
2	600519	贵州茅台	4,200	7,102,200.00	0.16
3	601600	中国铝业	986,400	5,415,336.00	0.12
4	601318	中国平安	114,900	5,331,360.00	0.12
5	600900	长江电力	223,500	4,930,410.00	0.11
6	601699	潞安环能	249,100	4,065,312.00	0.09
7	600028	中国石化	632,100	4,020,156.00	0.09
8	002142	宁波银行	112,000	2,833,600.00	0.06
9	000589	贵州轮胎	501,400	2,807,840.00	0.06
10	601958	金钼股份	224,600	2,504,290.00	0.06
11	300680	隆盛科技	97,100	2,414,877.00	0.06
12	002478	常宝股份	323,700	2,411,565.00	0.06
13	002129	TCL 中环	72,375	2,402,850.00	0.05
14	002536	飞龙股份	160,000	2,400,000.00	0.05
15	603518	锦泓集团	210,500	2,389,175.00	0.05
16	000568	泸州老窖	11,100	2,326,227.00	0.05
17	600748	上实发展	582,900	2,302,455.00	0.05
18	300511	雪榕生物	302,000	2,295,200.00	0.05
19	603507	振江股份	61,300	2,222,738.00	0.05

20	600717	天津港	497,795	2,205,231.85	0.05
21	600125	铁龙物流	363,448	2,195,225.92	0.05
22	002997	瑞鹤模具	72,900	2,167,317.00	0.05
23	688517	金冠电气	97,000	2,130,120.00	0.05
24	600461	洪城环境	255,800	2,089,886.00	0.05
25	601668	中国建筑	349,300	2,004,982.00	0.05
26	000552	靖远煤电	573,600	1,910,088.00	0.04
27	300970	华绿生物	81,200	1,896,832.00	0.04
28	002952	亚世光电	103,800	1,840,374.00	0.04
29	600362	江西铜业	93,900	1,782,222.00	0.04
30	003011	海象新材	54,500	1,757,625.00	0.04
31	601966	玲珑轮胎	78,600	1,746,492.00	0.04
32	600583	海油工程	282,900	1,654,965.00	0.04
33	601601	中国太保	63,600	1,652,328.00	0.04
34	600438	通威股份	45,000	1,543,950.00	0.04
35	002641	公元股份	266,100	1,500,804.00	0.03
36	600858	银座股份	244,100	1,474,364.00	0.03
37	600150	中国船舶	44,500	1,464,495.00	0.03
38	300015	爱尔眼科	77,613	1,439,721.15	0.03
39	600089	特变电工	64,500	1,437,705.00	0.03
40	000768	中航西飞	52,000	1,391,000.00	0.03
41	601188	龙江交通	409,300	1,375,248.00	0.03
42	002215	诺普信	182,600	1,371,326.00	0.03
43	002080	中材科技	65,800	1,350,216.00	0.03
44	600862	中航高科	53,100	1,343,961.00	0.03
45	000738	航发控制	54,100	1,320,040.00	0.03
46	300073	当升科技	26,100	1,313,613.00	0.03
47	002304	洋河股份	10,000	1,313,500.00	0.03
48	600765	中航重机	49,140	1,302,701.40	0.03
49	603109	神驰机电	72,700	1,297,695.00	0.03
50	002049	紫光国微	13,900	1,296,175.00	0.03
51	688122	西部超导	23,240	1,295,165.20	0.03
52	601688	华泰证券	93,600	1,288,872.00	0.03
53	600111	北方稀土	53,700	1,287,726.00	0.03
54	300092	科新机电	78,200	1,282,480.00	0.03
55	600905	三峡能源	237,600	1,275,912.00	0.03
56	000776	广发证券	86,200	1,268,002.00	0.03
57	600030	中信证券	64,000	1,265,920.00	0.03
58	301006	迈拓股份	48,100	1,257,815.00	0.03
59	600050	中国联通	256,000	1,228,800.00	0.03
60	601117	中国化学	147,900	1,224,612.00	0.03
61	601211	国泰君安	86,900	1,215,731.00	0.03
62	600754	锦江酒店	28,100	1,189,754.00	0.03

63	601888	中国中免	10,700	1,182,671.00	0.03
64	002483	润邦股份	199,100	1,154,780.00	0.03
65	301011	华立科技	48,900	1,145,727.00	0.03
66	600809	山西汾酒	6,100	1,128,927.00	0.03
67	000338	潍柴动力	90,400	1,126,384.00	0.03
68	688506	百利天恒	15,622	1,115,098.36	0.03
69	002458	益生股份	90,000	1,111,500.00	0.03
70	002108	沧州明珠	244,600	1,108,038.00	0.03
71	000661	长春高新	8,100	1,104,030.00	0.03
72	300547	川环科技	65,700	1,095,219.00	0.02
73	002284	亚太股份	119,500	1,071,915.00	0.02
74	002327	富安娜	127,300	1,071,866.00	0.02
75	605128	上海沿浦	25,800	1,045,158.00	0.02
76	688599	天合光能	24,500	1,043,945.00	0.02
77	601908	京运通	171,900	1,039,995.00	0.02
78	603979	金诚信	33,300	1,035,630.00	0.02
79	002170	芭田股份	149,300	1,025,691.00	0.02
80	603324	盛剑环境	26,800	1,010,360.00	0.02
81	601985	中国核电	142,100	1,001,805.00	0.02
82	000417	合肥百货	206,800	967,824.00	0.02
83	300855	图南股份	27,300	964,236.00	0.02
84	300274	阳光电源	8,200	956,366.00	0.02
85	600985	淮北矿业	82,300	948,096.00	0.02
86	688443	智翔金泰	30,329	933,162.53	0.02
87	002971	和远气体	36,000	923,400.00	0.02
88	002459	晶澳科技	22,000	917,400.00	0.02
89	301181	标榜股份	30,440	915,939.60	0.02
90	002860	星帅尔	67,900	915,292.00	0.02
91	601163	三角轮胎	57,400	910,938.00	0.02
92	600997	开滦股份	145,100	866,247.00	0.02
93	688156	路德环境	29,900	857,233.00	0.02
94	000002	万科A	60,800	852,416.00	0.02
95	000090	天健集团	168,900	851,256.00	0.02
96	600919	江苏银行	114,900	844,515.00	0.02
97	600820	隧道股份	140,500	844,405.00	0.02
98	300838	浙江力诺	46,200	844,074.00	0.02
99	601838	成都银行	68,700	838,827.00	0.02
100	601169	北京银行	181,100	838,493.00	0.02
101	600999	招商证券	61,700	837,269.00	0.02
102	601577	长沙银行	107,500	834,200.00	0.02
103	601666	平煤股份	108,800	820,352.00	0.02
104	600348	华阳股份	103,350	817,498.50	0.02
105	300796	贝斯美	67,760	815,152.80	0.02

106	000778	新兴铸管	198,000	807,840.00	0.02
107	601009	南京银行	100,700	805,600.00	0.02
108	301063	海锅股份	28,900	805,154.00	0.02
109	600794	保税科技	228,700	805,024.00	0.02
110	300839	博汇股份	60,500	804,045.00	0.02
111	603112	华翔股份	67,800	797,328.00	0.02
112	605167	利柏特	82,336	797,012.48	0.02
113	601229	上海银行	138,200	794,650.00	0.02
114	002179	中航光电	17,390	788,636.50	0.02
115	600502	安徽建工	148,600	784,608.00	0.02
116	600901	江苏租赁	187,740	775,366.20	0.02
117	300316	晶盛机电	10,900	772,810.00	0.02
118	600123	兰花科创	93,990	768,838.20	0.02
119	600057	厦门象屿	88,000	765,600.00	0.02
120	603856	东宏股份	57,500	758,425.00	0.02
121	300881	盛德鑫泰	22,570	743,681.50	0.02
122	300690	双一科技	46,300	739,411.00	0.02
123	601006	大秦铁路	99,300	737,799.00	0.02
124	002674	兴业科技	59,300	732,355.00	0.02
125	000055	方大集团	147,800	731,610.00	0.02
126	300019	硅宝科技	42,904	731,513.20	0.02
127	002160	常铝股份	180,700	730,028.00	0.02
128	688357	建龙微纳	11,060	715,471.40	0.02
129	300938	信测标准	16,300	713,940.00	0.02
130	601098	中南传媒	61,200	709,920.00	0.02
131	601377	兴业证券	115,200	705,024.00	0.02
132	605218	伟时电子	45,200	700,600.00	0.02
133	605088	冠盛股份	40,500	694,575.00	0.02
134	300791	仙乐健康	23,300	676,632.00	0.02
135	688558	国盛智科	18,800	672,288.00	0.02
136	300893	松原股份	26,000	668,980.00	0.02
137	000596	古井贡酒	2,700	667,926.00	0.02
138	603983	丸美股份	20,000	647,000.00	0.01
139	603111	康尼机电	128,200	639,718.00	0.01
140	688338	赛科希德	11,500	637,675.00	0.01
141	603180	金牌厨柜	18,800	630,176.00	0.01
142	605388	均瑶健康	49,500	629,145.00	0.01
143	600886	国投电力	49,700	628,705.00	0.01
144	000538	云南白药	11,920	625,561.60	0.01
145	605060	联德股份	22,500	617,850.00	0.01
146	300652	雷迪克	27,000	614,790.00	0.01
147	600600	青岛啤酒	5,900	611,417.00	0.01
148	002724	海洋王	68,400	593,712.00	0.01

149	600926	杭州银行	49,300	579,275.00	0.01
150	600628	新世界	79,900	577,677.00	0.01
151	300632	光莆股份	44,100	563,598.00	0.01
152	300308	中际旭创	3,800	560,310.00	0.01
153	300871	回盛生物	33,600	553,728.00	0.01
154	000608	阳光股份	201,700	546,607.00	0.01
155	000541	佛山照明	95,700	546,447.00	0.01
156	003033	征和工业	15,500	544,050.00	0.01
157	002398	垒知集团	95,100	542,070.00	0.01
158	300371	汇中股份	40,800	534,480.00	0.01
159	605068	明新旭腾	21,000	513,660.00	0.01
160	601336	新华保险	13,900	511,103.00	0.01
161	605166	聚合顺	54,400	507,008.00	0.01
162	002056	横店东磁	27,800	506,238.00	0.01
163	002271	东方雨虹	18,400	501,584.00	0.01
164	601877	正泰电器	17,900	494,935.00	0.01
165	688021	奥福环保	18,600	482,112.00	0.01
166	002028	思源电气	10,200	476,544.00	0.01
167	688503	N聚和	4,850	472,875.00	0.01
168	603657	春光科技	26,600	466,830.00	0.01
169	300305	裕兴股份	43,000	464,400.00	0.01
170	603816	顾家家居	12,100	461,615.00	0.01
171	600674	川投能源	29,800	448,490.00	0.01
172	603303	得邦照明	32,400	447,444.00	0.01
173	601500	通用股份	109,300	447,037.00	0.01
174	300817	双飞股份	29,880	446,706.00	0.01
175	002381	双箭股份	55,900	431,548.00	0.01
176	688155	先惠技术	7,900	428,654.00	0.01
177	301189	奥尼电子	14,000	428,260.00	0.01
178	688093	世华科技	21,123	423,727.38	0.01
179	300837	浙矿股份	11,000	422,400.00	0.01
180	301092	争光股份	15,983	418,434.94	0.01
181	605189	富春染织	24,800	406,968.00	0.01
182	688312	燕麦科技	20,502	397,943.82	0.01
183	688015	交控科技	22,500	393,075.00	0.01
184	300927	江天化学	23,900	391,243.00	0.01
185	301291	明阳电气	12,054	391,066.98	0.01
186	300107	建新股份	78,400	383,376.00	0.01
187	301100	风光股份	17,900	369,814.00	0.01
188	301108	洁雅股份	10,100	365,620.00	0.01
189	605099	共创草坪	16,200	361,746.00	0.01
190	301000	肇民科技	19,080	349,927.20	0.01
191	600109	国金证券	37,300	323,391.00	0.01

192	600060	海信视像	13,000	321,750.00	0.01
193	688456	有研粉材	9,600	321,312.00	0.01
194	300915	海融科技	8,600	319,318.00	0.01
195	605050	福然德	25,700	317,395.00	0.01
196	300955	嘉亨家化	14,600	310,980.00	0.01
197	688120	华海清科	1,192	300,443.60	0.01
198	688582	芯动联科	6,476	299,402.44	0.01
199	301196	唯科科技	8,800	298,760.00	0.01
200	688466	金科环境	14,814	295,687.44	0.01
201	600026	中远海能	23,300	294,512.00	0.01
202	600803	新奥股份	15,400	292,292.00	0.01
203	002025	航天电器	4,500	287,100.00	0.01
204	300920	润阳科技	16,300	280,523.00	0.01
205	301310	鑫宏业	4,089	280,239.27	0.01
206	301003	江苏博云	12,100	279,631.00	0.01
207	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.01
208	603688	石英股份	2,400	273,216.00	0.01
209	688006	杭可科技	8,680	264,479.60	0.01
210	688002	睿创微纳	5,900	264,320.00	0.01
211	002444	巨星科技	12,000	262,560.00	0.01
212	600516	方大炭素	40,000	248,000.00	0.01
213	000623	吉林敖东	15,400	247,016.00	0.01
214	300144	宋城演艺	19,500	241,800.00	0.01
215	601319	中国人保	41,000	239,440.00	0.01
216	688496	清越科技	12,000	238,560.00	0.01
217	600183	生益科技	16,500	234,300.00	0.01
218	002595	豪迈科技	6,600	231,858.00	0.01
219	688516	奥特维	1,200	226,080.00	0.01
220	002372	伟星新材	10,500	215,670.00	0.00
221	600612	老凤祥	3,000	209,640.00	0.00
222	300856	科思股份	2,600	204,802.00	0.00
223	600398	海澜之家	28,900	198,832.00	0.00
224	002154	报喜鸟	35,100	193,752.00	0.00
225	605499	东鹏饮料	1,100	190,190.00	0.00
226	600285	羚锐制药	11,600	186,296.00	0.00
227	688050	爱博医疗	900	184,797.00	0.00
228	301383	天键股份	4,925	183,366.76	0.00
229	002244	滨江集团	20,700	182,574.00	0.00
230	603338	浙江鼎力	3,200	179,232.00	0.00
231	601000	唐山港	49,700	175,441.00	0.00
232	000739	普洛药业	9,800	173,852.00	0.00
233	002270	华明装备	14,905	163,209.75	0.00
234	688623	二元科技	1,776	162,256.88	0.00

235	600582	天地科技	27,400	159,742.00	0.00
236	688630	芯碁微装	1,900	159,638.00	0.00
237	600598	北大荒	11,800	157,294.00	0.00
238	301397	溯联股份	3,618	152,606.80	0.00
239	688518	联赢激光	5,400	150,444.00	0.00
240	603568	伟明环保	8,500	148,835.00	0.00
241	301367	怡和嘉业	1,000	148,340.00	0.00
242	002266	浙富控股	35,700	147,441.00	0.00
243	600315	上海家化	4,700	136,347.00	0.00
244	600871	石化油服	68,100	134,838.00	0.00
245	002867	周大生	7,400	131,572.00	0.00
246	301239	普瑞眼科	1,300	127,504.00	0.00
247	002010	传化智联	23,600	125,552.00	0.00
248	688029	南微医学	1,500	122,340.00	0.00
249	301225	恒勃股份	3,324	118,422.57	0.00
250	002158	汉钟精机	4,600	114,816.00	0.00
251	000937	冀中能源	17,700	112,926.00	0.00
252	002048	宁波华翔	8,200	109,880.00	0.00
253	688472	阿特斯	6,261	106,687.44	0.00
254	002937	兴瑞科技	4,300	105,780.00	0.00
255	000967	盈峰环境	20,900	105,545.00	0.00
256	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.00
257	688281	华秦科技	500	101,250.00	0.00
258	301232	飞沃科技	1,643	99,339.12	0.00
259	603757	大元泵业	3,300	98,472.00	0.00
260	605090	九丰能源	4,200	93,786.00	0.00
261	301358	湖南裕能	2,023	86,766.47	0.00
262	301029	怡合达	1,900	84,892.00	0.00
263	600161	天坛生物	3,100	84,165.00	0.00
264	688621	阳光诺和	1,400	82,348.00	0.00
265	688819	天能股份	2,200	81,048.00	0.00
266	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.00
267	300804	广康生化	2,257	77,134.83	0.00
268	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.00
269	603317	天味食品	5,200	75,972.00	0.00
270	688469	中芯集成	13,800	74,658.00	0.00
271	301260	格力博	3,121	73,749.23	0.00
272	600350	山东高速	11,500	73,255.00	0.00
273	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.00
274	003816	中国广核	22,800	70,908.00	0.00
275	688361	中科飞测	831	53,740.77	0.00
276	603868	飞科电器	800	50,472.00	0.00
277	688531	日联科技	346	47,045.62	0.00

278	603786	科博达	700	45,990.00	0.00
279	601611	中国核建	5,000	42,250.00	0.00
280	301325	曼恩斯特	364	39,293.80	0.00
281	688146	中船特气	1,011	38,549.43	0.00
282	688484	南芯科技	1,008	37,003.68	0.00
283	300354	东华测试	800	35,760.00	0.00
284	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
285	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.00
286	601061	中信金属	4,016	30,441.28	0.00
287	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00
288	688576	西山科技	240	28,898.40	0.00
289	688507	索辰科技	222	27,108.42	0.00
290	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
291	301303	真兰仪表	1,058	23,614.56	0.00
292	688570	天玛智控	884	22,391.72	0.00
293	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
294	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
295	301322	绿通科技	391	20,816.84	0.00
296	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
297	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
298	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
299	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
300	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
301	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
302	301280	珠城科技	418	14,947.68	0.00
303	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
304	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
305	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
306	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
307	301387	光大同创	307	13,925.52	0.00
308	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
309	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
310	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
311	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
312	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
313	301345	C 涛涛	266	12,406.24	0.00
314	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
315	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
316	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
317	301290	东星医疗	330	10,576.50	0.00
318	301429	森泰股份	499	10,488.98	0.00
319	601065	江盐集团	875	10,360.00	0.00
320	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00

321	301265	华新环保	819	9,516.78	0.00
322	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
323	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
324	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
325	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
326	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
327	301281	科源制药	337	8,458.70	0.00
328	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
329	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
330	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
331	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
332	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
333	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
334	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
335	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
336	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
337	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
338	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
339	603172	万丰股份	122	1,967.86	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	600519	贵州茅台	6,877,647.00	0.13
2	601699	潞安环能	5,639,778.00	0.11
3	601318	中国平安	5,466,628.00	0.10
4	601600	中国铝业	5,389,359.00	0.10
5	600900	长江电力	4,991,031.00	0.09
6	000878	云南铜业	4,868,535.00	0.09
7	601069	西部黄金	4,833,422.00	0.09
8	600583	海油工程	4,832,728.00	0.09
9	601166	兴业银行	4,467,801.00	0.08
10	300748	金力永磁	4,415,669.00	0.08
11	002466	天齐锂业	4,248,042.00	0.08
12	600028	中国石化	4,113,920.00	0.08
13	601012	隆基绿能	3,951,194.00	0.08
14	002179	中航光电	3,634,966.00	0.07
15	002460	赣锋锂业	3,608,681.00	0.07
16	601668	中国建筑	3,593,406.00	0.07
17	000568	泸州老窖	3,591,804.00	0.07
18	600871	石化油服	3,591,504.00	0.07
19	600330	天通股份	3,578,583.00	0.07

20	002352	顺丰控股	3,573,704.00	0.07
----	--------	------	--------------	------

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	601012	隆基绿能	11,215,924.00	0.21
2	300750	宁德时代	5,932,361.00	0.11
3	002466	天齐锂业	5,928,487.00	0.11
4	002594	比亚迪	5,247,491.00	0.10
5	002475	立讯精密	5,166,513.00	0.10
6	601166	兴业银行	5,156,688.00	0.10
7	603259	药明康德	4,942,983.60	0.09
8	000878	云南铜业	4,752,865.00	0.09
9	000568	泸州老窖	4,730,147.00	0.09
10	600919	江苏银行	4,450,706.00	0.08
11	601069	西部黄金	4,146,612.00	0.08
12	300673	佩蒂股份	4,096,920.00	0.08
13	002352	顺丰控股	4,021,226.00	0.08
14	300748	金力永磁	3,945,396.00	0.07
15	600660	福耀玻璃	3,929,761.00	0.07
16	003020	立方制药	3,819,206.10	0.07
17	300787	海能实业	3,770,713.00	0.07
18	000001	平安银行	3,759,519.00	0.07
19	600089	特变电工	3,633,344.00	0.07
20	002917	金奥博	3,614,186.00	0.07

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	583,113,182.10
卖出股票收入（成交）总额	536,965,121.88

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	99,257,814.49	2.26

2	央行票据	-	-
3	金融债券	122,560,158.19	2.80
	其中：政策性金融债	122,560,158.19	2.80
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）	40,013,697.26	0.91
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	261,831,669.94	5.97

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	018008	国开 1802	722,000	74,879,569.48	1.71
2	019638	20 国债 09	405,000	41,449,131.37	0.95
3	108615	国开 2105	376,000	38,365,762.63	0.88
4	210015	21 付息国债 15	200,000	20,394,893.15	0.47
5	019703	23 国债 10	115,000	11,560,524.66	0.26

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 本报告期投资基金情况

7.12.1 投资政策及风险说明

基于本基金管理人绩效评估系统对备选基金的评估分析，在有效控制风险的前提下，通过定

量和定性相结合的方法，精选具有不同风险收益特征及投资业绩比较优势的基金确定本基金配置组合。本基金的绩效评估系统分析主要包括业绩指标分析、业绩归因分析以及基金管理人综合评估等。

运用量化方法分析所有适选基金在不同市场下的历史业绩表现，包括收益指标、风险指标和风险调整后收益指标等，具体如下：收益指标：包括绝对收益、相对收益等指标；风险指标：包括波动率、最大回撤等指标；风险调整后收益指标：包括夏普比率、信息比率等指标。

深入分析基金的业绩表现，再次精选基金确定备选基金，包括对基金的择时能力、资产配置能力、个股选择能力等进行归因分析，解释基金收益来源，评估未来收益的持续性与稳定性。基于市场环境、政策变动、风险事件等多重因素对基金配置组合进行持续跟踪，动态调整基金投资组合及配置比例。

结合对基金管理人的定性评估，包括基金管理人基本情况、投研团队实力以及投研团队稳定性、基金经理投资优势及业绩稳定性方面，被投资基金运作合规，风格清晰，中长期收益良好，业绩波动性较低，根据定性评估分析结果，最终确定本基金的投资组合及配置比例。

本基金通过定量和定性相结合的方法，长期持续跟踪本基金的组合业绩，并定期对基金组合进行维护，力争实现基金资产的长期稳健增值。

报告期内，本基金主要投资于开放式基金，符合基金合同约定的投资政策、投资限制等要求

7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	519782	交银裕隆纯债债券A	契约型开放式	655,000,000.00	858,574,000.00	19.59	是
2	008204	交银稳利中短债债券A	契约型开放式	668,336,848.52	744,393,581.88	16.99	是
3	005578	交银丰晟收益债券C	契约型开放式	245,690,973.26	281,119,611.60	6.41	是

4	003864	招商招祥纯债 C	契约型开放式	207,142,735.15	224,542,724.90	5.12	否
5	519718	交银纯债债券发起 A/B	契约型开放式	169,000,000.00	185,545,100.00	4.23	是
6	161716	招商双债增强 (LOF) C	契约型开放式 (LOF)	118,000,000.00	175,702,000.00	4.01	否
7	005577	交银丰晟收益债券 A	契约型开放式	125,817,455.73	147,068,024.00	3.36	是
8	015779	景顺长城价值边际灵活配置混合 C	契约型开放式	63,692,724.07	85,303,665.35	1.95	否
9	015736	长盛盛裕纯债债券 D	契约型开放式	76,483,184.70	79,190,689.44	1.81	否
10	008340	华富中债-安徽省公司信用类债券指数 A	契约型开放式	58,473,820.87	61,029,126.84	1.39	否
11	519772	交银新生活力灵活配置混合	契约型开放式	24,811,852.82	55,181,560.67	1.26	是
12	519756	交银国企改革灵活配置混合	契约型开放式	30,000,000.00	53,985,000.00	1.23	是

13	000914	中加纯 债债券	契约 型开 放式	49,288,106.06	53,290,300.27	1.22	否
14	004388	鹏华丰 享债券	契约 型开 放式	45,000,000.00	52,758,000.00	1.20	否
15	012429	华夏核 心制造 混合 C	契约 型开 放式	59,229,783.25	52,187,362.02	1.19	否
16	009402	交银启 明混合	契约 型开 放式	40,000,000.00	51,784,000.00	1.18	是
17	009804	国泰研 究优势 混合	契约 型开 放式	43,626,070.61	49,960,576.06	1.14	否
18	007574	宝盈新 价值混 合 C	契约 型开 放式	16,881,370.66	45,900,446.82	1.05	否
19	519732	交银定 期支付 双息平 衡混合	契约 型开 放式	9,063,177.69	45,243,383.03	1.03	是
20	006626	山西证 券超短 债债券 A	契约 型开 放式	40,000,000.00	44,608,000.00	1.02	否
21	014549	交银数 据产业 灵活配 置混合 C	契约 型开 放式	20,702,942.13	42,906,847.56	0.98	是
22	011404	融通鑫 新成长 混合 C	契约 型开 放式	34,045,628.12	42,665,981.16	0.97	否
23	006234	万家汽 车新趋	契约 型开	11,109,652.82	33,572,259.86	0.77	否

		势混合 C	放式				
24	006332	招商金 鸿债券 A	契约 型开 放式	28,362,484.63	32,021,245.15	0.73	否
25	007014	嘉合磐 泰短债 债券 A	契约 型开 放式	28,000,000.00	30,338,000.00	0.69	否
26	015309	国投瑞 银境煊 混合 E	契约 型开 放式	10,098,975.68	29,587,978.95	0.68	否
27	012160	财通资 管健康 产业混 合 C	契约 型开 放式	24,268,047.25	27,104,981.97	0.62	否
28	008187	淳厚信 睿混合 C	契约 型开 放式	13,990,476.58	26,642,064.55	0.61	否
29	003166	鹏华弘 嘉混合 C	契约 型开 放式	11,000,000.00	26,482,500.00	0.60	否
30	017511	鹏华稳 健回报 混合 C	契约 型开 放式	25,000,000.00	25,840,000.00	0.59	否
31	013882	交银品 质升级 混合 C	契约 型开 放式	13,598,615.57	24,790,276.18	0.57	是
32	002291	诺安安 鑫混合	契约 型开 放式	10,000,000.00	24,309,000.00	0.55	否
33	015208	信达澳 银健康 中国混 合 C	契约 型开 放式	9,420,827.79	23,976,006.73	0.55	否
34	011321	国泰大 健康股	契约 型开	8,000,000.00	22,888,000.00	0.52	否

		票 C	放式				
35	007469	中信建投精选混合 C	契约型开放式	10,370,229.40	19,829,952.66	0.45	否
36	014864	建信食品饮料行业股票 C	契约型开放式	15,000,000.00	15,997,500.00	0.37	否
37	288201	华夏货币 B	契约型开放式	15,010,086.31	15,010,086.31	0.34	否
38	005776	中加转型动力混合 C	契约型开放式	6,012,837.90	14,965,953.53	0.34	否
39	011711	中欧睿泽混合 C	契约型开放式	14,146,306.80	13,257,918.73	0.30	否
40	010962	中银鑫新消费成长混合 C	契约型开放式	11,402,286.26	12,134,313.04	0.28	否
41	005151	红土创新优淳货币 B	契约型开放式	10,014,789.55	10,014,789.55	0.23	否
42	007465	交银创业板 50 指数 C	契约型开放式	5,895,985.70	8,503,780.18	0.19	是
43	011412	易方达远见成长混合 C	契约型开放式	5,000,000.00	5,393,500.00	0.12	否
44	008647	天弘增利短债债券 C	契约型开放式	4,581,271.76	5,004,123.14	0.11	否

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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。

7.13.2 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。

7.13.3 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	44,377.99
2	应收清算款	13,100,362.25
3	应收股利	2,005.19
4	应收利息	-
5	应收申购款	6,964.76
6	其他应收款	171,129.52
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,324,839.71

7.13.4 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	110060	天路转债	2,990,581.26	0.07
2	110077	洪城转债	2,865,568.01	0.07
3	127058	科伦转债	2,747,653.68	0.06
4	110084	贵燃转债	2,627,309.63	0.06
5	113044	大秦转债	2,478,976.89	0.06
6	123048	应急转债	2,261,052.62	0.05
7	118003	华兴转债	2,212,631.97	0.05
8	110053	苏银转债	1,981,286.75	0.05
9	113021	中信转债	1,927,018.91	0.04
10	123098	一品转债	1,438,452.53	0.03
11	110061	川投转债	1,266,295.84	0.03
12	110088	淮22转债	892,017.88	0.02
13	127028	英特转债	887,981.15	0.02
14	113056	重银转债	788,174.06	0.02
15	123112	万讯转债	769,031.85	0.02
16	127071	天箭转债	722,188.81	0.02
17	123158	宙邦转债	644,184.17	0.01
18	128083	新北转债	609,080.31	0.01

19	127027	能化转债	578,951.67	0.01
20	127069	小熊转债	576,391.38	0.01
21	127012	招路转债	558,528.64	0.01
22	113648	巨星转债	530,285.18	0.01
23	110045	海澜转债	514,504.86	0.01
24	128075	远东转债	457,717.46	0.01
25	127020	中金转债	433,399.55	0.01
26	128081	海亮转债	428,567.54	0.01
27	113549	白电转债	413,903.04	0.01
28	113631	皖天转债	390,553.20	0.01
29	127005	长证转债	359,029.20	0.01
30	128121	宏川转债	355,333.32	0.01
31	127018	本钢转债	352,714.72	0.01
32	128128	齐翔转2	256,778.33	0.01
33	113651	松霖转债	253,258.04	0.01
34	113058	友发转债	246,565.35	0.01
35	127006	敖东转债	230,134.92	0.01
36	127033	中装转2	215,822.26	0.00
37	128026	众兴转债	197,794.35	0.00
38	128042	凯中转债	196,533.16	0.00
39	113609	永安转债	188,509.90	0.00
40	127047	帝欧转债	183,293.68	0.00
41	113033	利群转债	163,096.72	0.00
42	128023	亚太转债	153,947.51	0.00
43	128142	新乳转债	135,371.06	0.00
44	123100	朗科转债	129,988.58	0.00
45	110072	广汇转债	129,953.96	0.00
46	127054	双箭转债	110,968.75	0.00
47	127055	精装转债	99,976.18	0.00
48	113649	丰山转债	93,753.95	0.00
49	128076	金轮转债	89,049.26	0.00
50	113601	塞力转债	86,191.40	0.00
51	113524	奇精转债	78,400.41	0.00
52	123159	崧盛转债	78,211.41	0.00
53	128066	亚泰转债	77,638.77	0.00
54	128119	龙大转债	72,962.37	0.00
55	127053	豪美转债	67,566.28	0.00
56	123076	强力转债	61,189.47	0.00
57	118028	会通转债	59,230.13	0.00
58	128123	国光转债	56,495.42	0.00
59	127042	嘉美转债	51,441.31	0.00
60	123106	正丹转债	32,644.43	0.00
61	128118	瀛通转债	31,107.26	0.00

62	123129	锦鸡转债	23,945.10	0.00
----	--------	------	-----------	------

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.13.6 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

份额级别	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(%)
交银招享一年混合A	19,263	159,266.26	1,981,893.05	0.06	3,065,964,005.22	99.94
交银招享一年混合C	888,938	1,533.35	-	-	1,363,054,861.17	100.00
合计	908,201	4,878.88	1,981,893.05	0.04	4,429,018,866.39	99.96

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	交银招享一年混合A	754,164.27	0.02
	交银招享一年混合C	9,726.40	0.00
	合计	763,890.67	0.02

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

无。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	交银招享一年混合A	交银招享一年混合C
基金合同生效日(2021年8月24)	6,065,205,184.78	2,924,659,050.71

日) 基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	3,744,960,260.95	1,662,486,756.74
本报告期基金总申购份额	751,482.35	937,555.26
减: 本报告期基金总赎回份额	677,765,845.03	300,369,450.83
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	3,067,945,898.27	1,363,054,861.17

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 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

报告期内, 本基金持有的交银施罗德持续成长主题混合型证券投资基金召开基金份额持有人大会审议调整投资范围及修改基金合同有关事项的议案。本基金管理人代表本基金出席上述持有人大会, 表决意见为同意。

除上述基金外, 本基金持有的其他基金未发生重大影响事件

10.6 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。

10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.7.1 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。

10.7.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金托管人及其高级管理人员本报告期内未受监管部门稽查或处罚。

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 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 (%)	
国盛证券	3	1,102,341,848.66	100.00	1,036,554.80	100.00	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

10.8.2 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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)

						的 比 例 (%)		
国盛证券	373,405,476.93	99.89	652,800,000.00	100.00	-	-	41,219,896.90	100.00
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	406,000.00	0.11	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-

浙商 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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。

10.9 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	交银施罗德招享一年持有期混合型基金中基金(FOF)2022年第4季度报告	中国证监会规定媒体及公司网站	2023年1月19日
2	交银施罗德基金管理有限公司关于增加济安财富（北京）基金销售有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2023年2月10日
3	交银施罗德招享一年持有期混合型基金中基金(FOF)2022年年度报告	中国证监会规定媒体及公司网站	2023年3月30日
4	交银施罗德招享一年持有期混合型基金中基金(FOF)2023年第1季度报告	中国证监会规定媒体及公司网站	2023年4月21日
5	交银施罗德基金管理有限公司关于增加宁波银行股份有限公司为旗下基金的销售机构的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2023年5月24日
6	交银施罗德招享一年持有期混合型基金中基金(FOF)(更新)招募说明书(2023年第1号)	中国证监会规定媒体及公司网站	2023年6月21日
7	交银施罗德招享一年持有期混合型基金中基金(FOF)(A类份额)基金产品资料概要更新(2023年第1号)	中国证监会规定媒体及公司网站	2023年6月21日
8	交银施罗德招享一年持有期混合型	中国证监会规定媒体及	2023年6月21日

	基金中基金 (FOF) (C 类份额) 基金 产品资料概要更新 (2023 年第 1 号)	公司网站	
--	--	------	--

§ 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招享一年持有期混合型基金中基金 (FOF) 募集注册的文件；
- 2、《交银施罗德招享一年持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金合同》；
- 3、《交银施罗德招享一年持有期混合型基金中基金 (FOF) 招募说明书》；
- 4、《交银施罗德招享一年持有期混合型基金中基金 (FOF) 托管协议》；
- 5、关于申请募集注册交银施罗德招享一年持有期混合型基金中基金 (FOF) 的法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、报告期内交银施罗德招享一年持有期混合型基金中基金 (FOF) 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印件或复印件。

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。