

交银施罗德精选混合型证券投资基金 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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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	5
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	8
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	11
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
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	47
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	47
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	47

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	47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12 投资组合报告附注	48
§ 8 基金份额持有人信息	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49
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	49
§ 9 开放式基金份额变动	49
§ 10 重大事件揭示	50
10.1 基金份额持有人大会决议	50
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	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
10.4 基金投资策略的改变	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	50
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
10.8 其他重大事件	53
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	53
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	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	54
§ 12 备查文件目录	54
12.1 备查文件目录	54
12.2 存放地点	54
12.3 查阅方式	54

§ 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	7,400,108,797.73 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
	联系电话	(021) 61055050
	电子邮箱	xxpl@jysld.com, disclosure@jysld.com
客户服务电话	400-700-5000, 021-61055000	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)
本期已实现收益	-164,990,504.58
本期利润	-444,778,792.36
加权平均基金份额本期利润	-0.0594
本期加权平均净值利润率	-6.30%
本期基金份额净值增长率	-6.31%
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	2,767,685,281.30
期末可供分配基金份额利润	0.3740
期末基金资产净值	6,442,432,862.22
期末基金份额净值	0.8706
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	1,064.26%

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后的实际收益水平要低于所列数字；

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

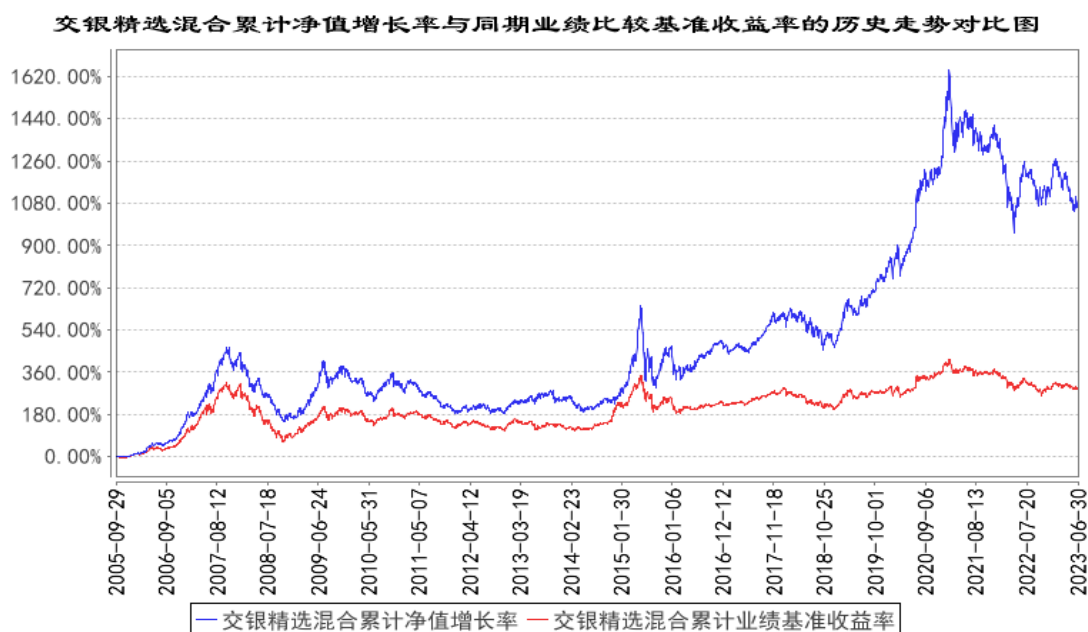
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.95%	0.94%	1.01%	0.65%	-0.06%	0.29%
过去三个月	-10.24%	0.82%	-3.42%	0.62%	-6.82%	0.20%
过去六个月	-6.31%	0.90%	0.19%	0.63%	-6.50%	0.27%
过去一年	-13.42%	1.00%	-9.81%	0.74%	-3.61%	0.26%
过去三年	6.66%	1.25%	-2.09%	0.90%	8.75%	0.35%
自基金合同生效起至今	1,064.26%	1.49%	289.77%	1.23%	774.49%	0.26%

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 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



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，注册资本金为 2 亿元人民币。其中，交通银行股份有限公司持有 65% 的股份，施罗德投资管理有限公司持有 30% 的股份，中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司持有 5% 的股份。公司并下设交银施罗德资产管理（香港）有限公司和交银施罗德资产管理有限公司。

截至报告期末，公司管理了包括货币型、债券型、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		
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	-	15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。
张雪蓉	交银精选混合的基金经理	2023年1月7日	-	8年	张雪蓉女士，上海交通大学金融学硕士、复旦大学金融学学士。历任中金公司研究助理，华泰证券研究员。2020年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任行业分析师。

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，整体宏观预期波动较大。一月、二月，主要演绎国内经济复苏的逻辑，顺周期表现较好；三月，市场部分开始担忧国内经济复苏不及预期；四月至六月的月 PMI、PPI、CPI、地产数据以及周期品价格等宏观数据快速走弱，市场对国内经济预期转向悲观，系统性增配防御板块，如公用事业，而系统性减配总量经济相关的顺周期板块。上半年，整体 TMT 表现较活跃，国内数据要素政策不断完善，AI 在美国正在引领新一轮科技革命浪潮。五月，国内相关产业链标的股价创出新高。在二季度经济预期极其悲观阶段，0-1 阶段主题投资活跃，如：AIGC 应用、机器人以及智能驾驶等，但后期缺少基本面支撑的标的股价回落也较快。

本基金配置的食品饮料/医药等行业标的，阶段性影响了基金净值，市场对长期总需求的悲观叠加资金面的负反馈导致对企业长期竞争力、商业模式的优势、盈利持续性、ROE 等定价因子反应迟钝，对边际变化反应却非常敏感，很多优秀的公司又回落到了长期很有吸引力的价格，我们选择了坚守。对 0-1 阶段的投资，考虑到边缘标的胜率低，部分真正受益标的股价上涨太快失去中期投资吸引力，本基金参与较少。

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，宏观层面看，我们认为三季度经济筑底可能性较大。六月以来，我们看到了在促消费（汽车、家居家电以及电子产品等）不断有鼓励性政策出台。七月，发布了《关于促进民营经济发展壮大的意见》，帮助恢复民营企业投资意愿，居民侧通过降低存款利率、降低房贷利率等，鼓励居民消费意愿提升。同时，七月出台的《关于在超大特大城市积极稳步推进城中村改造的指导意见》有利于扭转地产投资持续向下的悲观预期，预计未来随着更多实质性政策出台，民间投资和居民消费的意愿将会逐步提升。预计在未来一年内，总量层面内需弱复苏是大概率事件。海外经济预计加息对总需求的抑制作用将逐步体现，总需求下半年可能逐步边际走弱，美国加息见顶利好人民币汇率稳定。整体对下半年 A 股持乐观态度。

从结构层面看，目前我国处于经济的重要转型期，有部分子行业/环节格局在出现优化，出口的地域结构正在快速发生变化，后期随着出生人口下降以及人口老龄化，劳动力的贡献下降，经济发展更需要科技的贡献。在经济转型期，我们会注重在以下几个方向寻找投资机会，寻找具备核心竞争力的公司在合适的位置布局：

1) 消费：目前位置继续配置供给侧格局优秀、商业模式优异、自由现金流充沛、估值低位的白酒、白电，同时也将重点关注平价消费、健康产品、文娱消费、本地零售、品牌出海等个股机会；

2) 医药：长期人口老龄化，需求的刚性和业绩增长的可持续性高，短期院端需求复苏强劲，目前板块估值或处于历史底部。我们在二季度寻找格局优异，创新药逐步步入收获期，估值历史低位的药品进行了配置；继续重点关注第三方医学检验龙头长坡厚雪；

3) 科技：重点关注半导体等关键领域“卡脖子”环节技术储备领先的公司以及完成 0-1 突破，国产化率提升空间较大的公司；重点关注国内数字中国、信创和数据要素的长周期持续推进，以及关注软件服务优质公司；持续关注人工智能带来的潜在科技革命机会，目前 A 股标的最确定受益的还是海外供应链的算力公司，国内未来算力建设提升空间可观，国内应用端寻找真正好产品公司，对行业变化保持紧密跟踪；

4) 制造业：关注新技术和新景气方向、关注具备全球成本竞争力、技术领先、利润率合理的制造业公司，对电池龙头，对机器人、自动驾驶等方向保持跟踪。

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应用性的情况后，及时召开临时会议进行研究，及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值委员会成员均具备相应的专业资格及工作经验。基金经理作为估值委员会成员，对本基金持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感，向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论。本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突，截止报告期末未有与任何外部估值定价服务机构签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内无需预警说明。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—交银施罗德基金管理有限公司 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，交银施罗德基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，交银施罗德基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中

的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：交银施罗德精选混合型证券投资基金

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	443,087,635.51	590,082,224.57
结算备付金		14,711,356.39	2,361,431.09
存出保证金		2,409,115.54	2,346,171.73
交易性金融资产	6.4.7.2	6,099,726,916.91	5,899,815,815.15
其中：股票投资		5,745,539,745.42	5,516,744,080.68
基金投资		-	-
债券投资		354,187,171.49	383,071,734.47
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	-	500,064,270.62
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,567,384.61	2,020,379.53
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		6,561,502,408.96	6,996,690,292.69
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		90,029,762.87	34,749,941.85
应付赎回款		7,226,525.33	3,070,915.61
应付管理人报酬		8,035,208.85	8,837,397.29
应付托管费		1,339,201.47	1,472,899.54
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	2,068.21
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	12,438,848.22	5,024,162.33
负债合计		119,069,546.74	53,157,384.83
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	3,280,686,187.76	3,312,879,077.49
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	3,161,746,674.46	3,630,653,830.37
净资产合计		6,442,432,862.22	6,943,532,907.86
负债和净资产总计		6,561,502,408.96	6,996,690,292.69

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.8706 元，基金份额总额 7,400,108,797.73 份。

6.2 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：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		-383,281,574.48	-716,700,158.44
1. 利息收入		1,806,158.50	1,564,751.40
其中：存款利息收入	6.4.7.13	1,694,173.68	1,564,751.40
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		111,984.82	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-105,497,525.93	-536,373,347.62
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-164,786,303.17	-575,124,102.15

基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	3,004,291.02	6,169,396.55
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	56,284,486.22	32,581,357.98
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-279,788,287.78	-182,405,248.41
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	198,080.73	513,686.19
减：二、营业总支出		61,497,217.88	65,002,098.04
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	52,586,281.61	55,569,409.49
2. 托管费	6.4.10.2.2	8,764,380.27	9,261,568.18
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		403.15	34.87
8. 其他费用	6.4.7.23	146,152.85	171,085.50
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-444,778,792.36	-781,702,256.48
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-444,778,792.36	-781,702,256.48
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-444,778,792.36	-781,702,256.48

6.3 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：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)	3,312,879,077. 49	-	3,630,653,830. 37	6,943,532,907.8 6
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)	3,312,879,077. 49	-	3,630,653,830. 37	6,943,532,907.8 6
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-32,192,889.73	-	- 468,907,155.91	-501,100,045.64
(一)、综合收益总额	-	-	- 444,778,792.36	-444,778,792.36
(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)	-32,192,889.73	-	-24,128,363.55	-56,321,253.28
其中：1. 基金申购款	224,956,713.26	-	265,735,429.90	490,692,143.16
2. 基金赎回款	- 257,149,602.99	-	- 289,863,793.45	-547,013,396.44
(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)	3,280,686,187. 76	-	3,161,746,674. 46	6,442,432,862.2 2
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)	3,406,011,854. 45	-	5,800,444,131. 82	9,206,455,986.2 7
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	9,206,455,986.2 7
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	5,816,200.37	-	1,473,839,315. 50	1,468,023,115.1 3
(一)、综合收益总额	-	-	781,702,256.48	-781,702,256.48
(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)	5,816,200.37	-	26,703,731.79	32,519,932.16
其中：1. 基金申购款	422,746,322.49	-	505,941,652.10	928,687,974.59
2. 基金赎回款	- 416,930,122.12	-	- 479,237,920.31	-896,168,042.43
(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、本期期末净资产(基金净值)	3,411,828,054. 82	-	4,326,604,816. 32	7,738,432,871.1 4

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08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[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。

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	443,087,635.51
等于：本金	443,004,815.06
加：应计利息	82,820.45
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	443,087,635.51

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	6,023,480,167.49	-	5,745,539,745.42	- 277,940,422.07
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	2,000.00	2.60	2,228.80 226.20
	银行间市场	349,843,980.00	4,235,942.69	354,184,942.69 105,020.00
	合计	349,845,980.00	4,235,945.29	354,187,171.49 105,246.20
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	6,373,326,147.49	4,235,945.29	6,099,726,916.91	- 277,835,175.87

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

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	6,039.12
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	12,314,413.16
其中：交易所市场	12,314,413.16
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	49,588.57
预提信息披露费	59,507.37
预提账户维护费	9,300.00
合计	12,438,848.22

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	7,472,727,726.41	3,312,879,077.49
本期申购	507,420,066.85	224,956,713.26
本期赎回（以“-”号填列）	-580,038,995.53	-257,149,602.99

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	7,400,108,797.73	3,280,686,187.76

注：1、如果本报告期间发生红利再投、转换入业务，则总申购份额中包含该业务；

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,961,375,066.43	669,278,763.94	3,630,653,830.37
本期利润	-164,990,504.58	-279,788,287.78	-444,778,792.36
本期基金份额交易产生的变动数	-28,699,280.55	4,570,917.00	-24,128,363.55
其中：基金申购款	204,362,958.88	61,372,471.02	265,735,429.90
基金赎回款	-233,062,239.43	-56,801,554.02	-289,863,793.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,767,685,281.30	394,061,393.16	3,161,746,674.46

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	1,573,724.51
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	100,644.02
其他	19,805.15
合计	1,694,173.68

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	-164,786,303.17
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	-164,786,303.17

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	11,108,007,236.70
减：卖出股票成本总额	11,239,423,171.01
减：交易费用	33,370,368.86
买卖股票差价收入	-164,786,303.17

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	3,157,121.02
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-152,830.00
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	3,004,291.02

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 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	232,400,000.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	229,684,680.00
减：应计利息总额	2,867,500.00
减：交易费用	650.00
买卖债券差价收入	-152,830.00

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	56,284,486.22
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	56,284,486.22

6.4.7.20 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	-279,788,287.78
股票投资	-280,693,203.98
债券投资	904,916.20
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	-279,788,287.78

6.4.7.21 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	198,080.73
合计	198,080.73

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

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

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	18,456.91
债券账户费用	18,600.00
合计	146,152.85

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
交银施罗德基金管理有限公司（“交银施罗德基金公司”）	基金管理人、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金销售机构
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金管理人的股东、基金销售机构
施罗德投资管理有限公司	基金管理人的股东
中国国际海运集装箱(集团)股份有限公司	基金管理人的股东
交银施罗德资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

本报告期实际与基金发生关联交易的关联方及关联交易具体情况请见下述内容。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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	52,586,281.61	55,569,409.49
其中：支付销售机构的客户维护费	15,283,405.03	15,876,179.65

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

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50%÷当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	8,764,380.27	9,261,568.18

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

6.4.10.3 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自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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	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。

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
中国农业银行_活 期存款	443,087,635.51	1,573,724.51	1,021,482,781.35	1,468,282.96

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，存款利率参考银行同业利率及银行存款利率确定。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（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	2023 年	6 个月	限售股	11.88	21.02	1,386	16,465.68	29,133.72	-

	港	3月30日	以上								
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		-
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	1个月内(含)	新股未上市	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50		-
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		-

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	97	-	2,434.70	-
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	威士顿	2023年6月13日	6个月以上	限售股	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
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	131	-	6,974.44	-
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	-

		日									
301345	C 涛涛	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	2023 年	6 个月	限售股	57.66	57.66	482	27,792.12	27,792.12		-

	科技	6月30日	以上								
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		-
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		-
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		-
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	-
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	索辰科技	2023年6月20日	1-6个月(含)	限售股送股	-	122.11	72	-	8,791.92	-
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	-
688539	高华科技	2023年4月11日	6个月以上	限售股	38.22	43.49	5,334	203,865.48	231,975.66	-
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	-

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，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。

6.4.13.2 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。

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

6.4.13.3.1 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。

6.4.13.4 市场风险

6.4.13.4.1 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。

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	443,087,635.51	-	-	-	443,087,635.51
结算备付金	14,711,356.39	-	-	-	14,711,356.39
存出保证金	2,409,115.54	-	-	-	2,409,115.54
交易性金融资产	354,184,942.69	-	2,228.80	5,745,539,745.42	6,099,726,916.91
应收申购款	115,991.54	-	-	1,451,393.07	1,567,384.61
资产总计	814,509,041.67	-	2,228.80	5,746,991,138.49	6,561,502,408.96
负债					
应付赎回款	-	-	-	7,226,525.33	7,226,525.33
应付管理人报酬	-	-	-	8,035,208.85	8,035,208.85
应付托管费	-	-	-	1,339,201.47	1,339,201.47
应付清算款	-	-	-	90,029,762.87	90,029,762.87
其他负债	-	-	-	12,438,848.22	12,438,848.22
负债总计	-	-	-	119,069,546.74	119,069,546.74
利率敏感度缺口	814,509,041.67	-	2,228.80	5,627,921,591.75	6,442,432,862.22
上年度末 2022 年 12 月 31 日					
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	-	2,000.22	5,516,744,080.68	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	-	2,000.22	5,518,744,082.81	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	-	2,000.22	5,465,586,697.98	6,943,532,907.86

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 5.50% (2022 年 12 月 31 日：5.46%)，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：

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	5,745,539,745.42	89.18	5,516,744,080.68	79.45
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	2,228.80	0.00	2,000.22	-
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	5,745,541,974.22	89.18	5,516,746,080.90	79.45

6.4.13.4.3.2 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（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	1. 业绩比较基准下降 5%	-374,737,546.40	-437,436,828.20
2. 业绩比较基准上升 5%	374,737,546.40	437,436,828.20	

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	5,743,172,531.10	5,340,456,933.03
第二层次	354,795,325.83	383,457,597.87
第三层次	1,759,059.98	175,901,284.25
合计	6,099,726,916.91	5,899,815,815.15

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

无。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	5,745,539,745.42	87.56
	其中：股票	5,745,539,745.42	87.56
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	354,187,171.49	5.40
	其中：债券	354,187,171.49	5.40
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	457,798,991.90	6.98
8	其他各项资产	3,976,500.15	0.06
9	合计	6,561,502,408.96	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	131,712,100.00	2.04
C	制造业	4,273,288,282.23	66.33

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	84,028,772.47	1.30
E	建筑业	13,582,213.75	0.21
F	批发和零售业	173,190,322.32	2.69
G	交通运输、仓储和邮政业	183,720,506.72	2.85
H	住宿和餐饮业	48,611,544.35	0.75
I	信息传输、软件和信息技术服务业	255,413,932.56	3.96
J	金融业	-	-
K	房地产业	77,253,029.26	1.20
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	62,701,508.17	0.97
N	水利、环境和公共设施管理业	1,040,214.57	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	289,515,244.86	4.49
R	文化、体育和娱乐业	151,482,074.16	2.35
S	综合	-	-
	合计	5,745,539,745.42	89.18

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	002304	洋河股份	4,218,206	554,061,358.10	8.60
2	000568	泸州老窖	2,626,969	550,533,893.33	8.55
3	600519	贵州茅台	316,423	535,071,293.00	8.31
4	300750	宁德时代	2,018,782	461,877,133.78	7.17
5	603882	金域医学	3,834,324	289,491,462.00	4.49
6	000333	美的集团	4,048,189	238,519,295.88	3.70
7	600276	恒瑞医药	3,864,232	185,096,712.80	2.87
8	000963	华东医药	3,988,702	172,990,005.74	2.69
9	600079	人福医药	6,411,595	172,728,369.30	2.68
10	002352	顺丰控股	3,786,178	170,718,766.02	2.65
11	002368	太极股份	3,878,077	159,660,430.09	2.48
12	300413	芒果超媒	4,427,566	151,467,032.86	2.35
13	688981	中芯国际	2,642,048	133,476,264.96	2.07
14	300308	中际旭创	759,554	111,996,237.30	1.74
15	300146	汤臣倍健	4,100,200	98,322,796.00	1.53
16	600872	中炬高新	2,652,830	97,597,615.70	1.51

17	600489	中金黄金	9,073,200	93,726,156.00	1.45
18	600522	中天科技	5,832,315	92,792,131.65	1.44
19	600690	海尔智家	3,691,362	86,673,179.76	1.35
20	003816	中国广核	27,007,500	83,993,325.00	1.30
21	002475	立讯精密	2,376,200	77,107,690.00	1.20
22	002371	北方华创	227,992	72,421,658.80	1.12
23	601138	工业富联	2,776,099	69,957,694.80	1.09
24	601126	四方股份	4,279,400	65,004,086.00	1.01
25	603259	药明康德	1,002,673	62,476,554.63	0.97
26	600993	马应龙	2,190,472	60,917,026.32	0.95
27	600529	山东药玻	2,206,694	60,066,210.68	0.93
28	300996	普联软件	1,732,482	53,187,197.40	0.83
29	000708	中信特钢	3,167,682	50,176,082.88	0.78
30	300760	迈瑞医疗	162,293	48,655,441.40	0.76
31	600258	首旅酒店	2,565,253	48,611,544.35	0.75
32	002049	紫光国微	489,600	45,655,200.00	0.71
33	000977	浪潮信息	929,522	45,081,817.00	0.70
34	688609	九联科技	3,675,347	43,736,629.30	0.68
35	688188	柏楚电子	222,002	41,860,697.12	0.65
36	001914	招商积余	2,752,846	41,430,332.30	0.64
37	600547	山东黄金	1,617,800	37,985,944.00	0.59
38	603520	司太立	2,255,990	37,629,913.20	0.58
39	603867	新化股份	926,426	37,520,253.00	0.58
40	688269	凯立新材	588,133	37,517,004.07	0.58
41	600266	城建发展	7,051,712	35,822,696.96	0.56
42	688120	华海清科	136,794	34,478,927.70	0.54
43	688059	华锐精密	382,871	32,065,446.25	0.50
44	688200	华峰测控	194,154	29,705,562.00	0.46
45	301035	润丰股份	315,900	24,820,263.00	0.39
46	603063	禾望电气	667,100	20,513,325.00	0.32
47	002559	亚威股份	1,941,400	17,239,632.00	0.27
48	601089	福元医药	1,048,500	17,090,550.00	0.27
49	688012	中微公司	99,447	15,558,483.15	0.24
50	300982	苏文电能	223,900	13,559,384.00	0.21
51	600026	中远海能	1,027,700	12,990,128.00	0.20
52	601100	恒立液压	64,800	4,168,584.00	0.06
53	000860	顺鑫农业	40,400	1,361,076.00	0.02
54	601882	海天精工	37,500	1,248,750.00	0.02
55	000888	峨眉山 A	88,800	1,017,648.00	0.02
56	688443	智翔金泰	30,329	933,162.53	0.01
57	002555	三七互娱	13,800	481,344.00	0.01
58	301291	明阳电气	12,054	391,066.98	0.01
59	688582	芯动联科	6,476	299,402.44	0.00

60	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.00
61	688539	高华科技	5,334	231,975.66	0.00
62	688543	国科军工	4,094	228,607.10	0.00
63	688629	华丰科技	7,073	160,957.02	0.00
64	688334	西高院	8,879	157,912.84	0.00
65	301397	溯联股份	3,618	152,606.80	0.00
66	688620	安凯微	10,157	135,209.66	0.00
67	301315	威士顿	2,253	132,828.53	0.00
68	301225	恒勃股份	3,324	118,422.57	0.00
69	688472	阿特斯	6,261	106,687.44	0.00
70	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.00
71	301376	致欧科技	4,192	98,850.60	0.00
72	688429	时创能源	3,452	98,752.08	0.00
73	301170	锡南科技	2,496	92,283.70	0.00
74	301358	湖南裕能	2,023	86,766.47	0.00
75	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.00
76	300804	广康生化	2,257	77,134.83	0.00
77	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.00
78	688469	中芯集成	13,800	74,658.00	0.00
79	301260	格力博	3,121	73,749.23	0.00
80	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.00
81	688361	中科飞测	831	53,740.77	0.00
82	688531	日联科技	346	47,045.62	0.00
83	300896	爱美客	100	44,495.00	0.00
84	301325	曼恩斯特	364	39,293.80	0.00
85	688146	中船特气	1,011	38,549.43	0.00
86	688484	南芯科技	1,008	37,003.68	0.00
87	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
88	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.00
89	601061	中信金属	4,016	30,441.28	0.00
90	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00
91	688576	西山科技	240	28,898.40	0.00
92	688507	索辰科技	222	27,108.42	0.00
93	603071	物产环能	1,627	26,991.93	0.00
94	301310	鑫宏业	409	26,760.87	0.00
95	300347	泰格医药	400	25,816.00	0.00
96	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
97	301303	真兰仪表	1,058	23,614.56	0.00
98	688570	天玛智控	884	22,391.72	0.00
99	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
100	301322	绿通科技	392	20,870.08	0.00
101	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
102	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00

103	301091	深城交	1,022	18,927.44	0.00
104	301179	泽宇智能	531	17,894.70	0.00
105	301383	天键股份	493	17,609.96	0.00
106	301096	百诚医药	272	16,485.92	0.00
107	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
108	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
109	688623	双元科技	178	15,448.62	0.00
110	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
111	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
112	301280	珠城科技	419	14,983.44	0.00
113	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
114	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
115	603230	内蒙新华	1,141	14,718.90	0.00
116	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
117	301122	采纳股份	391	13,927.42	0.00
118	301387	光大同创	307	13,925.52	0.00
119	301069	凯盛新材	539	13,712.16	0.00
120	301089	拓新药业	220	13,626.80	0.00
121	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
122	301189	奥尼电子	435	13,306.65	0.00
123	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
124	301149	隆华新材	1,214	12,674.16	0.00
125	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
126	301345	C 涛涛	266	12,406.24	0.00
127	301100	风光股份	599	12,375.34	0.00
128	603176	汇通集团	1,924	12,313.60	0.00
129	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
130	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
131	001317	三羊马	300	11,070.00	0.00
132	301188	力诺特玻	647	11,050.76	0.00
133	603216	梦天家居	772	10,522.36	0.00
134	301429	森泰股份	499	10,488.98	0.00
135	601065	江盐集团	875	10,360.00	0.00
136	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
137	301083	百胜智能	416	9,734.40	0.00
138	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
139	603213	镇洋发展	799	9,532.07	0.00
140	301265	华新环保	819	9,516.78	0.00
141	301196	唯科科技	271	9,200.45	0.00
142	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
143	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
144	301281	科源制药	338	8,483.80	0.00
145	001296	长江材料	403	8,467.03	0.00

146	301118	恒光股份	315	8,419.95	0.00
147	001219	青岛食品	460	8,390.40	0.00
148	301193	家联科技	475	8,326.75	0.00
149	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
150	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
151	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
152	605033	美邦股份	423	7,910.10	0.00
153	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
154	001234	泰慕士	333	7,592.40	0.00
155	301021	英诺激光	290	7,580.60	0.00
156	603048	浙江黎明	464	7,470.40	0.00
157	301111	粤万年青	379	7,420.82	0.00
158	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
159	603150	万朗磁塑	251	6,616.36	0.00
160	002493	荣盛石化	500	5,820.00	0.00
161	301228	实朴检测	373	5,811.34	0.00
162	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
163	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
164	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
165	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
166	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
167	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
168	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00
169	600029	南方航空	90	542.70	0.00
170	300144	宋城演艺	26	322.40	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	000568	泸州老窖	669,306,076.70	9.64
2	002555	三七互娱	230,530,439.62	3.32
3	000333	美的集团	227,453,780.56	3.28
4	300413	芒果超媒	213,489,166.40	3.07
5	300750	宁德时代	210,079,432.85	3.03
6	600809	山西汾酒	200,008,421.80	2.88
7	002049	紫光国微	199,219,899.70	2.87
8	688981	中芯国际	199,164,127.74	2.87
9	600276	恒瑞医药	194,243,847.55	2.80
10	000063	中兴通讯	193,773,933.26	2.79
11	603444	吉比特	190,485,232.50	2.74
12	688111	金山办公	178,990,127.66	2.58
13	002368	太极股份	177,607,576.58	2.56

14	002230	科大讯飞	176,966,829.70	2.55
15	002304	洋河股份	174,538,622.61	2.51
16	600690	海尔智家	169,943,161.01	2.45
17	000963	华东医药	168,120,168.43	2.42
18	600079	人福医药	167,029,363.02	2.41
19	300274	阳光电源	163,629,813.74	2.36
20	300059	东方财富	161,687,843.35	2.33
21	600941	中国移动	159,011,236.80	2.29
22	600970	中材国际	149,928,124.23	2.16
23	300308	中际旭创	142,357,732.16	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。

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	600570	恒生电子	478,635,398.86	6.89
2	300750	宁德时代	426,133,600.98	6.14
3	300347	泰格医药	390,291,757.95	5.62
4	603259	药明康德	295,708,071.30	4.26
5	002555	三七互娱	262,178,757.56	3.78
6	600519	贵州茅台	219,767,554.21	3.17
7	000063	中兴通讯	203,458,489.46	2.93
8	603882	金域医学	201,442,776.84	2.90
9	002049	紫光国微	191,185,650.64	2.75
10	603444	吉比特	190,577,833.52	2.74
11	688111	金山办公	184,895,902.54	2.66
12	002230	科大讯飞	182,334,596.85	2.63
13	600309	万华化学	178,495,258.73	2.57
14	600970	中材国际	175,984,303.38	2.53
15	600809	山西汾酒	167,568,340.88	2.41
16	300274	阳光电源	162,692,845.00	2.34
17	600941	中国移动	162,463,908.12	2.34
18	002304	洋河股份	147,048,957.80	2.12
19	688066	航天宏图	143,049,133.31	2.06
20	300059	东方财富	139,857,521.04	2.01

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	11,748,912,039.73
--------------	-------------------

卖出股票收入（成交）总额	11,108,007,236.70
--------------	-------------------

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	354,184,942.69	5.50
	其中：政策性金融债	354,184,942.69	5.50
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）	2,228.80	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	354,187,171.49	5.50

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	121,921,545.21	1.89
2	220408	22 农发 08	900,000	91,180,479.45	1.42
3	230206	23 国开 06	600,000	60,154,918.03	0.93
4	220308	22 进出 08	500,000	50,611,027.40	0.79
5	220216	22 国开 16	300,000	30,316,972.60	0.47

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形披露如下：

2023 年 2 月 7 日，上海证券交易所公示上海证券交易所纪律处分决定书 202310 号，给予人福医药集团股份有限公司公开谴责。

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

除上述主体外，本基金投资的前十名证券的其他发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,409,115.54
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,567,384.61
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,976,500.15

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113665	汇通转债	2,228.80	0.00

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
381,893	19,377.44	516,610,590.24	6.98	6,883,498,207.49	93.02

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	3,200,623.36	0.04

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和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	10~50

§ 9 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	7,472,727,726.41
本报告期基金总申购份额	507,420,066.85
减：本报告期基金总赎回份额	580,038,995.53
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	7,400,108,797.73

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

- 1、基金管理人的重大人事变动：本报告期内，本基金的基金管理人未发生重大人事变动。
- 2、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动：本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

无。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 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。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金托管人及其高级管理人员本报告期内未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国海证券	1	3,821,493,139.32	16.73	3,417,013.43	16.70	-
华泰证券	1	3,497,527,264.76	15.31	3,139,419.11	15.34	-
招商证券	1	2,442,566,184.57	10.69	2,274,775.57	11.12	-

天风证券	1	1,699,134,022.93	7.44	1,396,013.86	6.82	-
光大证券	2	1,571,590,852.81	6.88	1,451,427.59	7.09	-
申万宏源证券	3	1,517,315,661.49	6.64	1,335,045.44	6.52	-
安信证券	2	1,316,464,335.12	5.76	1,226,023.15	5.99	-
国金证券	2	1,125,078,380.23	4.93	1,047,790.33	5.12	-
国信证券	1	1,115,094,166.49	4.88	1,038,499.10	5.08	-
兴业证券	1	1,110,520,729.18	4.86	982,517.15	4.80	-
国泰君安证券	1	1,022,965,142.53	4.48	885,286.01	4.33	-
华创证券	1	739,413,937.17	3.24	688,615.66	3.37	-
海通证券	1	733,984,376.52	3.21	529,428.92	2.59	-
中金公司	2	649,819,474.27	2.85	605,178.04	2.96	-
瑞银证券	1	276,337,562.15	1.21	257,355.19	1.26	-
东北证券	2	199,877,591.57	0.88	186,146.51	0.91	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中银国际证券	1	-	-	-	-	-

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)

国海证 券	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源证券	-	-	-	-	-	-
安信证 券	-	-	-	-	-	-
国金证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
国泰君 安证券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
瑞银证 券	-	-	-	-	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
英大证 券	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-

中信证 券	-	-	-	-	-	-
中银国 际证券	-	-	-	-	-	-

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。

10.8 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基金经理变更的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2023年1月7日
2	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(2023年第1号)	中国证监会规定媒体及公司网站	2023年1月11日
3	交银施罗德精选混合型证券投资基金(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1月11日
4	交银施罗德精选混合型证券投资基金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
5	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
6	交银施罗德基金管理有限公司关于增加南京银行股份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3月3日
7	交银施罗德精选混合型证券投资基金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
8	交银施罗德精选混合型证券投资基金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

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准交银施罗德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指定报刊上各项公告的原稿。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅备查文件，或者登录基金管理人的网站(www.fund001.com)查阅。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人交银施罗德基金管理有限公司。本公司客户服务中心电话：400-700-5000（免长途话费），021-61055000，电子邮件：services@jysld.com。