

# 交银施罗德全球精选价值证券投资基金 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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人.....	6
2.5 信息披露方式.....	6
2.6 其他相关资料.....	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>7</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介.....	9
4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	9
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.9 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
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>12</b>
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	17
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>36</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	37
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	37
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	38
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	45
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	47

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细 .....	47
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 .....	47
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细 .....	47
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 .....	47
7.11 投资组合报告附注.....	47
<b>§ 8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>48</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	48
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 .....	48
<b>§ 9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>48</b>
<b>§ 10 重大事件揭示.....</b>	<b>49</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	49
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 .....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	49
10.4 基金投资策略的改变.....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	49
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 .....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	49
10.8 其他重大事件.....	53
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>54</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	55
<b>§ 12 备查文件目录.....</b>	<b>55</b>
12.1 备查文件目录.....	55
12.2 存放地点.....	55
12.3 查阅方式.....	55

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	交银施罗德环球精选价值证券投资基金
基金简称	交银环球精选混合(QDII)
基金主代码	519696
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年8月22日
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	33,909,694.24份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过全球资产配置和灵活分散投资，在有效分散和控制风险的前提下，实现长期资本增值。
投资策略	自上而下配置资产，通过对全球宏观经济和各经济体的基本面分析，在不同区域间进行有效资产配置，自下而上精选证券，挖掘定价合理、具备持续竞争优势的上市公司股票进行投资，并有效控制下行风险。
业绩比较基准	70%×标准普尔全球大中盘指数(S&P Global LargeMidCap Index)+30%×恒生指数
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。此外，本基金在全球范围内进行投资，除了需要承担国际市场的市场波动风险之外，还面临汇率风险、国别风险、新兴市场风险等海外市场投资所面临的特别投资风险。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	交银施罗德基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王小飞
	联系电话	021-60637103
	电子邮箱	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话	400-700-5000, 021-61055000	021-60637228
传真	(021) 61055054	021-60635778
注册地址	中国(上海)自由贸易试验区银城中路188号交通银行大楼二层(裙)	北京市西城区金融大街25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	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码	200120	100033
法定代表人	阮红	田国立

## 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	Schroder Investment Management Limited	JPMorgan Chase Bank, National Association
	中文	施罗德投资管理有限公司	摩根大通银行
注册地址		英国伦敦	1111 Polaris Parkway, Columbus, OH 43240, U. S. A.
办公地址		31 Gresham Street London	383 Madison Avenue, New York, NY 10179-0001, U. S. A.
邮政编码		EC2V 7QA	10179-0001

## 2.5 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

## 2.6 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	1,752,878.40
本期利润	7,062,237.31
加权平均基金份额本期利润	0.2084
本期加权平均净值利润率	9.36%
本期基金份额净值增长率	9.74%
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	45,573,942.51
期末可供分配基金份额利润	1.3440
期末基金资产净值	79,483,636.75
期末基金份额净值	2.344
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	263.53%

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

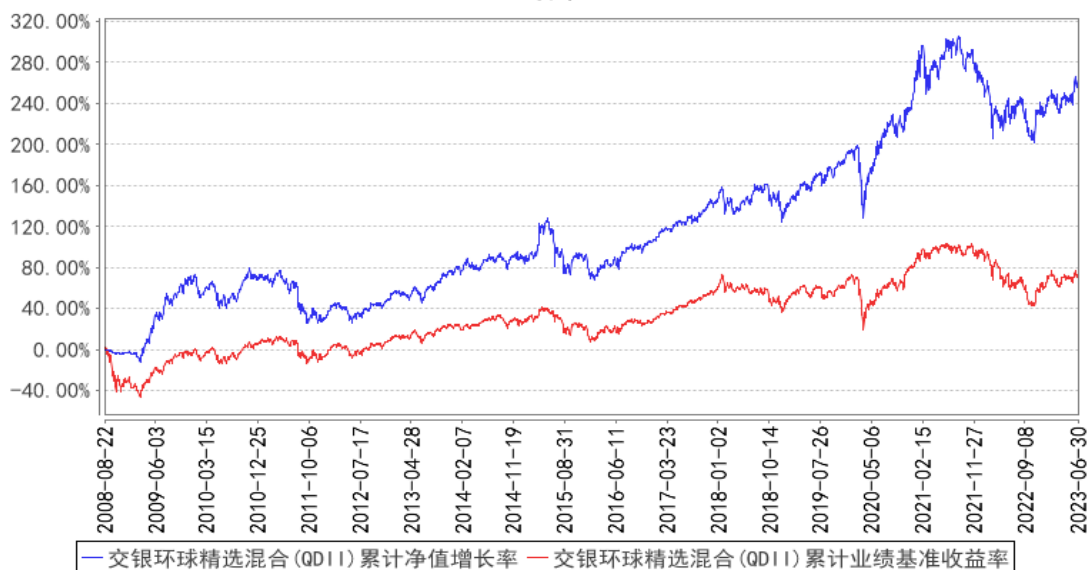
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	7.23%	0.79%	5.00%	0.83%	2.23%	-0.04%
过去三个月	5.35%	0.75%	1.73%	0.71%	3.62%	0.04%
过去六个月	9.74%	0.82%	7.45%	0.76%	2.29%	0.06%
过去一年	9.69%	0.91%	5.98%	0.89%	3.71%	0.02%
过去三年	21.48%	1.02%	12.37%	0.91%	9.11%	0.11%
自基金合同生效起至今	263.53%	0.98%	73.27%	1.07%	190.26%	-0.09%

注：本基金的业绩比较基准为 70%×标准普尔全球大中盘指数

(S&P Global LargeMidCap Index)+30%×恒生指数，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

交银环球精选混合(QDII) 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		
陈俊华	交银环球精选混合（QDII）、交银沪港深价值精选混合、交银核心资产混合、交银鸿光一年混合、交银鸿福六个月混合、交银鸿信一年持有期混合、交银鸿泰一年持有期混合的基金经理，公司跨境投资副总监	2015 年 11 月 21 日	-	18 年	陈俊华女士，中国国籍，上海交通大学金融学硕士。历任国泰君安证券研究部研究员、中国国际金融有限公司研究部公用事业组负责人。2015 年加入交银施罗德基金管理有限公司。2015 年 11 月 21 日至 2019 年 9 月 19 日担任交银施罗德全球自然资源证券投资基金的基金经理。
周中	交银环球精选混合（QDII）、交银创新成长混合、交银启欣混	2015 年 12 月 12 日	-	14 年	周中先生，中国国籍，复旦大学金融学硕士。历任野村证券亚太区股票研究部研究助理，中银国际证券研究部研究员、高级经理，瑞银证券研究部行业分析师、董事。2015 年加入交银施罗德基金管理有限公司。2015 年 12 月 12 日至 2019 年 9 月 19 日担任交银施罗德全球自然资源证券投



	合、交银启道混合、交银成长动力一年混合的基金经理				资基金的基金经理。
陈舒薇	交银环球精选混合(QDII)的基金经理	2020年1月8日	-	14年	陈舒薇女士，宾夕法尼亚大学 MBA、上海交通大学金融硕士、上海交通大学学士。历任东方证券分析师、中金公司分析师、光大证券分析师、香港瑞士信贷分析师。2019 年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任跨境投资部基金经理助理。

注：1、本表所列基金经理（助理）任职日期和离职日期均以基金合同生效日或公司作出决定并公告（如适用）之日为准。

2、本表所列基金经理（助理）证券从业年限中的“证券从业”的含义遵从中国证券业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、基金经理（或基金经理小组）期后变动（如有）敬请关注基金管理人发布的相关公告。

#### 4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

姓名	在境外投资顾问所任职务	证券从业年限	说明
Simon Webber	施罗德集团多区域（全球及国际）股票投资主管、全球和国际股票基金经理、全球气候变化股票基金经理	24 年	Simon Webber 先生，英国曼彻斯特大学物理学学士，CFA。1999 年加入施罗德投资管理有限公司，历任全球技术团队分析员。

#### 4.3 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。

#### 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.4.1 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。

#### 4.4.2 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。

### 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年一季度，海外市场呈震荡走势。开年，港股延续去年反弹态势，但随着春节复工后的经济数据走弱，叠加欧美银行危机，市场快速回调；欧美市场相对表现平稳，即使面临金融系统风险上升，但较有韧性的经济基本面以及去年一年的调整为市场提供支撑。转入二季度，境外中国资产和其他海外资产走势继续分化：港股持续回落，六月初随着中美关系缓和迎来一波小反弹，但很快再次回调；欧美市场则呈现单边上涨势头，受益于人工智能领域的需求拉动以及加息周期预期结束，美权重股科技龙头业绩、估值双升。

操作方面，本基金在上半年股票仓位维持高位运行：欧美股方面，各板块均衡配置；港股方面，增加了科技、中特估以及消费等个股的仓位，减少了医药板块的配置。

#### 4.5.2 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。

### 4.6 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，市场在反复寻底中等待更多实质性政策落地，但向下压制因素预计会越来越来减少。上半年，港股市场经历了几轮超跌反弹但很快又再度回落。然而，整体正面因素在不断

积累，前期制约美联储货币政策的就业和通胀两个锚均往利多方向演进；国内方面，近期中美关系有所缓和，同时国内稳增长政策预期积极，下半年经济有望持续复苏。当前困扰港股市场的流动性问题边际显著改善，后续预计港股将重拾升势。方向上，预计价值成长齐发力，我们将重点关注中特估+互联网：央企 AH 溢价已至历史高位，后续有望收敛。

投资策略方面，中特估+高端制造+消费互联网均衡配置，关注前期超调板块如可选消费、新能源等；中期重点关注品质/健康消费、科技互联、低碳环保三个方向，同时关注周期制造以及高股息个股机会。

我们会继续自下而上精选个股，努力为持有人赚取收益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序，经公司管理层批准后实行，并成立了估值委员会，估值委员会成员由研究部、基金运营部、风险管理部等人员和固定收益人员及基金经理组成。

公司严格按照新会计准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定进行估值，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。估值委员会的研究部成员按投资品种的不同性质，研究并参考市场普遍认同的做法，建议合理的估值模型，进行测算和认证，认可后交各估值委员会成员从基金会计、风险、合规等方面审批，一致同意后，报公司投资总监、总经理审批。

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

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内无需预警说明。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《中华人民共和

国证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支、等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

# § 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：交银施罗德环球精选价值证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	5,506,426.36	5,419,616.44
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	74,117,263.75	67,070,372.17
其中：股票投资		74,117,263.75	67,070,372.17
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-

其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		297,400.50	31,947.88
应收申购款		52,342.69	42,859.57
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		79,973,433.30	72,564,796.06
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
		<b>2023年6月30日</b>	<b>2022年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		272,298.99	55,069.67
应付管理人报酬		115,134.51	110,938.18
应付托管费		22,387.28	21,571.31
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	79,975.77	120,061.47
负债合计		489,796.55	307,640.63
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	33,909,694.24	33,833,732.41
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	45,573,942.51	38,423,423.02
净资产合计		79,483,636.75	72,257,155.43
负债和净资产总计		79,973,433.30	72,564,796.06

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.344 元，基金份额总额 33,909,694.24 份。

## 6.2 利润表

会计主体：交银施罗德环球精选价值证券投资基金

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	上年度可比期间
		2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		7,947,499.00	-7,970,218.46
1. 利息收入		14,578.06	9,460.15
其中：存款利息收入	6.4.7.13	14,578.06	9,460.15

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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,572,028.18	1,635,791.91
其中：股票投资收益	6.4.7.14	1,729,214.07	402,817.04
基金投资收益	6.4.7.15	-	-
债券投资收益	6.4.7.16	-	-
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	264.05	-
股利收益	6.4.7.20	842,550.06	1,232,974.87
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	5,309,358.91	-9,776,355.21
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		47,847.46	156,367.88
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.22	3,686.39	4,516.81
<b>减：二、营业总支出</b>		885,261.69	905,928.84
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	674,271.81	686,653.94
2. 托管费	6.4.10.2.2	131,108.38	133,516.01
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	6.4.7.23	-	-
7. 税金及附加		1.08	-
8. 其他费用	6.4.7.24	79,880.42	85,758.89
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		7,062,237.31	-8,876,147.30
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,062,237.31	-8,876,147.30
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		7,062,237.31	-8,876,147.30

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：交银施罗德环球精选价值证券投资基金

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)	33,833,732.41	-	38,423,423.02	72,257,155.43
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)	33,833,732.41	-	38,423,423.02	72,257,155.43
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	75,961.83	-	7,150,519.49	7,226,481.32
(一)、综合收益总额	-	-	7,062,237.31	7,062,237.31
(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)	75,961.83	-	88,282.18	164,244.01
其中：1. 基金申购款	2,467,127.17	-	3,027,194.00	5,494,321.17
2. 基金赎回款	-2,391,165.34	-	-2,938,911.82	-5,330,077.16
(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)	33,909,694.24	-	45,573,942.51	79,483,636.75
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)	36,796,793.43	-	56,498,241.36	93,295,034.79
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)	36,796,793.43	-	56,498,241.36	93,295,034.79
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-1,969,169.18	-	-16,893,605.93	-18,862,775.11
(一)、综合收益总额	-	-	-8,876,147.30	-8,876,147.30
(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)	-1,969,169.18	-	-2,965,208.98	-4,934,378.16
其中: 1. 基金申购款	3,676,298.69	-	4,580,170.88	8,256,469.57
2. 基金赎回款	-5,645,467.87	-	-7,545,379.86	-13,190,847.73
(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)	-	-	-5,052,249.65	-5,052,249.65
(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)	34,827,624.25	-	39,604,635.43	74,432,259.68

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

交银施罗德环球精选价值证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2008]第 635 号《关于核准交银施罗德环球精选价值证券投资基金募集的批复》核准,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《交银施罗德环球精选价值证券投资基金基金合同》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 508,068,907.66 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2008)第 130 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《交银施罗德环球精选价值证券投资基金基金合同》于 2008 年 8 月 22 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 508,425,627.85 份基金份额,其中认购资金利息折合 356,720.19 份基金份额。本基金的基金管理人为交银施罗德基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司,境外资产托管人为摩根大通银行(JPMorgan&ChaseBank, N. A.),境外投资顾问为施罗德投资管理有限公司(SchroderInvestmentManagementLimited)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《交银施罗德环球精选价值证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的股票(包括股票存托凭证),在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金、债券、货币市场工具以及中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合为:股票资产(含存托凭证)占基金资产的 60%-100%,债券、货币市场工具以及中国证监会允许本基金投资的其他金融工具占基金资产的 0%-40%。本基金的业绩比较基准为:70%×标准普尔全球大中盘指数(S&PGlobalLargeMidCapIndex)+30%×恒生指数。

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 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[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[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》及其他相关境内外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) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地

区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

(4) 基金通过买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	5,506,426.36
等于：本金	5,506,133.80
加：应计利息	292.56
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	5,506,426.36

##### 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	58,601,039.96	-	74,117,263.75	15,516,223.79
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

合计	58,601,039.96	-	74,117,263.75	15,516,223.79
----	---------------	---	---------------	---------------

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	632.61
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	19,835.79
预提信息披露费	59,507.37
合计	79,975.77

#### 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	33,833,732.41	33,833,732.41
本期申购	2,467,127.17	2,467,127.17
本期赎回（以“-”号填列）	-2,391,165.34	-2,391,165.34
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	33,909,694.24	33,909,694.24

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	46,885,816.09	-8,462,393.07	38,423,423.02
本期利润	1,752,878.40	5,309,358.91	7,062,237.31
本期基金份额交易产生的变动数	111,905.73	-23,623.55	88,282.18

其中：基金申购款	3,497,964.58	-470,770.58	3,027,194.00
基金赎回款	-3,386,058.85	447,147.03	-2,938,911.82
本期已分配利润	-	-	-
本期末	48,750,600.22	-3,176,657.71	45,573,942.51

#### 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		14,546.61
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		-
其他		31.45
合计		14,578.06

#### 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		1,729,214.07
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		1,729,214.07

##### 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		28,018,465.09
减：卖出股票成本总额		26,189,099.49
减：交易费用		100,151.53
买卖股票差价收入		1,729,214.07

##### 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

无。

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

无。

6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

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

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出权证成交总额	9,937.40
减：卖出权证成本总额	9,664.31
减：交易费用	-
减：买卖权证差价收入应缴纳增值税额	9.04
买卖权证差价收入	264.05

#### 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	842,550.06
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	842,550.06

#### 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	5,309,683.97
股票投资	5,309,683.97
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-325.06
权证投资	-325.06
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	5,309,358.91

#### 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	3,623.89
其他	62.50



合计	3,686.39
----	----------

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 信用减值损失

无。

#### 6.4.7.24 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	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	160.00
存托保管费	377.26
合计	79,880.42

#### 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
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	基金托管人、基金销售机构
摩根大通银行	境外资产托管人
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、基金投资顾问
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	674,271.81	686,653.94
其中：支付销售机构的客户维护费	187,760.93	187,644.32

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.80%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 × 1.80% ÷ 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	131,108.38	133,516.01

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.35%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×0.35%÷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

份额单位：份

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
基金合同生效日（2008年8月22日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	8,212,422.53	10,434,882.00
报告期间申购/买入总份额	-	487,540.53
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	2,710,000.00
报告期末持有的基金份额	8,212,422.53	8,212,422.53
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	24.22%	23.57%

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。

3、基金管理人投资本基金适用的申购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

##### 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
摩根大通银行_活期存款	2,363,704.47	8,512.95	3,864,169.48	0.01
中国建设银行_活期存款	3,142,721.89	6,033.66	3,422,375.38	9,454.39

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

无。

##### 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

本基金以股票为主要投资对象，属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种，其预期风险和收益水平高于混合型基金和债券型基金。本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。此外，本基金在全球范围内进行投资，除了需要承担国际市场

的市场波动风险之外，还面临汇率风险、国别风险、新兴市场风险等海外市场投资所面临的特别投资风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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。

为了规避信用风险，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充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国建设银行以及境外次托管人摩根大通银行，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在在境内交易所进行的债券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，在境外交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性不重大。

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，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券（2022 年 12 月 31 日：无）。

#### 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随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 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时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 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。

本基金持有及承担的利率敏感性资产主要为银行存款，除银行存款外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。

##### 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	5,506,426.36	-	-	-	5,506,426.36
交易性金融资产	-	-	-	74,117,263.75	74,117,263.75

应收股利	-	-	-	297,400.50	297,400.50
应收申购款	953.30	-	-	51,389.39	52,342.69
资产总计	5,507,379.66	-	-	74,466,053.64	79,973,433.30
负债					
应付赎回款	-	-	-	272,298.99	272,298.99
应付管理人报酬	-	-	-	115,134.51	115,134.51
应付托管费	-	-	-	22,387.28	22,387.28
其他负债	-	-	-	79,975.77	79,975.77
负债总计	-	-	-	489,796.55	489,796.55
利率敏感度缺口	5,507,379.66	-	-	73,976,257.09	79,483,636.75
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	5,419,616.44	-	-	-	5,419,616.44
交易性金融资产	-	-	-	67,070,372.17	67,070,372.17
应收股利	-	-	-	31,947.88	31,947.88
应收申购款	649.76	-	-	42,209.81	42,859.57
资产总计	5,420,266.20	-	-	67,144,529.86	72,564,796.06
负债					
应付赎回款	-	-	-	55,069.67	55,069.67
应付管理人报酬	-	-	-	110,938.18	110,938.18
应付托管费	-	-	-	21,571.31	21,571.31
其他负债	-	-	-	120,061.47	120,061.47
负债总计	-	-	-	307,640.63	307,640.63
利率敏感度缺口	5,420,266.20	-	-	66,836,889.23	72,257,155.43

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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，本基金未持有交易性债券投资(2022 年 12 月 31 日：同)，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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	美元	港币	其他币种	合计



	折合人民币元	折合人民币元	折合人民币元	
以外币计价的资产				
银行存款	1,041,992.23	1,321,751.32	65.33	2,363,808.88
交易性金融资产	26,880,430.55	30,794,983.21	16,441,849.99	74,117,263.75
应收股利	7,128.97	236,208.16	54,063.37	297,400.50
资产合计	27,929,551.75	32,352,942.69	16,495,978.69	76,778,473.13
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	27,929,551.75	32,352,942.69	16,495,978.69	76,778,473.13
	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
项目	美元折合人民币元	港币折合人民币元	其他币种折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	1,628,023.44	1,956,797.15	0.20	3,584,820.79
交易性金融资产	23,118,681.73	31,987,364.39	11,964,326.05	67,070,372.17
应收股利	11,999.52	-	19,948.36	31,947.88
资产合计	24,758,704.69	33,944,161.54	11,984,274.61	70,687,140.84
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	24,758,704.69	33,944,161.54	11,984,274.61	70,687,140.84

## 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
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. 所有外币相对人民币升值 5%	3,838,923.66	3,534,357.04
2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-3,838,923.66	-3,534,357.04	

## 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，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市场价格风险。股票资产占基金资产的 60%-100%，债券、货币市场工具以及中国证监会允许本基金投资的其他金融工具占基金资产的 0%-40%。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	74,117,263.75	93.25	67,070,372.17	92.82
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-

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	74,117,263.75	93.25	67,070,372.17	92.82

#### 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%	3,528,075.95	3,190,867.39
	2. 业绩比较基准下降 5%	-3,528,075.95	-3,190,867.39

#### 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	74,117,263.75	67,070,372.17
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	74,117,263.75	67,070,372.17

#### 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	74,117,263.75	92.68
	其中：普通股	73,362,813.64	91.73
	存托凭证	754,450.11	0.94
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-

	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	5,506,426.36	6.89
8	其他各项资产	349,743.19	0.44
9	合计	79,973,433.30	100.00

## 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
中国香港	30,794,983.21	38.74
美国	26,880,430.55	33.82
日本	3,705,292.43	4.66
法国	3,068,808.37	3.86
英国	1,853,646.25	2.33
瑞士	1,712,970.00	2.16
德国	1,444,933.59	1.82
意大利	1,381,123.78	1.74
荷兰	1,008,883.99	1.27
韩国	893,870.07	1.12
西班牙	844,767.18	1.06
巴西	527,554.33	0.66
合计	74,117,263.75	93.25

注：1、国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定；

2、ADR、GDR 按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

## 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
通讯	8,601,038.32	10.82
非必需消费品	15,425,244.04	19.41
必需消费品	2,902,711.27	3.65
能源	3,164,761.60	3.98
金融	5,435,777.00	6.84
医疗保健	7,006,272.81	8.81
工业	13,298,266.22	16.73
材料	331,258.80	0.42
房地产	1,857,022.53	2.34
科技	13,789,839.02	17.35
公用事业	2,305,072.14	2.90
合计	74,117,263.75	93.25

注：本报告采用彭博 BICS 一级分类标准编制。

## 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代 码	所在证 券市场	所属 国家 (地 区)	数量 (股)	公允价值	占基 金资 产净 值比 例 (%)
1	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股	700 HK	香港联合交易所	中国香港	8,700	2,660,139.55	3.35
2	Microsoft Corp	微软	MSFT US	美国证券交易所	美国	1,056	2,598,471.67	3.27
3	BYD Co Ltd	比亚迪	1211 HK	香港联合交易所	中国香港	11,000	2,535,731.93	3.19
4	Sinotruk Hong Kong Ltd	中国重汽	3808 HK	香港联合交易所	中国香港	164,000	2,301,596.27	2.90
5	Alphabet Inc	Alphabet 公司	GOOGL US	美国证券交易所	美国	2,325	2,010,958.20	2.53
6	Chow Tai Fook Jewellery Group Ltd	周大福	1929 HK	香港联合交易所	中国香港	135,600	1,760,487.68	2.21
7	Apple Inc	苹果公司	AAPL US	美国证券交易所	美国	1,233	1,728,158.53	2.17
8	PetroChina Co Ltd	中国石油	857 HK	香港联合交易所	中国香港	282,000	1,409,350.59	1.77
9	Visa Inc	维萨公司	V US	美国证券交易所	美国	812	1,393,378.18	1.75
10	COSCO SHIPPING Energy Transportation Co Ltd	中远海能	1138 HK	香港联合交易所	中国香港	190,000	1,377,040.75	1.73
11	CRRC Corp Ltd	中国中车	1766 HK	香港联合交易所	中国香港	336,000	1,329,129.25	1.67

12	China Resources Mixc Lifestyle Services Ltd	华润万象生活	1209 HK	香港联合交易所	中国香港	36,000	1,291,286.91	1.62
13	Amazon.com Inc	亚马逊公司	AMZN US	美国证券交易所	美国	1,352	1,273,523.55	1.60
14	China Mobile Ltd	中国移动	941 HK	香港联合交易所	中国香港	21,500	1,269,779.29	1.60
15	ZTE Corp	中兴通讯	763 HK	香港联合交易所	中国香港	43,600	1,262,370.34	1.59
16	ANTA Sports Products Ltd	安踏体育	2020 HK	香港联合交易所	中国香港	16,200	1,195,768.19	1.50
17	Eli Lilly and Co	礼来	LLY US	美国证券交易所	美国	337	1,142,010.67	1.44
18	Schneider Electric SE	施耐德电气股份公司	SU FP	法国证券交易所	法国	858	1,126,075.66	1.42
19	TotalEnergies SE	道达尔集团	TTE FP	法国证券交易所	法国	2,621	1,085,950.76	1.37
20	Netflix Inc	奈飞公司	NFLX US	美国证券交易所	美国	330	1,050,354.57	1.32
21	Parker-Hannifin Corp	派克汉尼汾	PH US	美国证券交易所	美国	358	1,008,969.67	1.27
22	ASML Holding NV	阿斯麦控股公司	ASML NA	荷兰证券交易所	荷兰	193	1,008,883.99	1.27
23	Yadea Group Holdings Ltd	雅迪控股	1585 HK	香港联合交易所	中国香港	60,000	985,892.57	1.24
24	JPMorgan Chase & Co	摩根大通	JPM US	美国证券交易所	美国	874	918,504.39	1.16

25	Intesa Sanpaolo SpA	意大利联合圣保罗银行股份有限公司	ISP IM	意大利证券交易所	意大利	47,780	904,123.55	1.14
26	Huaneng Power International Inc	华能国际	902 HK	香港联合交易所	中国香港	198,000	894,606.22	1.13
27	Samsung Electronics Co Ltd	三星电子有限公司	005930 KS	韩国证券交易所	韩国	2,258	893,870.07	1.12
28	Adobe Inc	奥多比	ADBE US	美国证券交易所	美国	249	879,802.64	1.11
29	NVIDIA Corp	英伟达	NVDA US	美国证券交易所	美国	287	877,260.82	1.10
30	Airbus SE	Airbus 公司	AIR FP	法国证券交易所	法国	821	856,781.95	1.08
31	Hua Hong Semiconductor Ltd	华虹半导体	1347 HK	香港联合交易所	中国香港	36,000	849,792.93	1.07
32	Iberdrola SA	伊维尔德罗拉有限公司	IBE SM	西班牙证券交易所	西班牙	8,966	844,767.18	1.06
33	Booking Holdings Inc	Booking 控股股份有限公司	BKNG US	美国证券交易所	美国	43	839,017.91	1.06
34	Bayerische Motoren Werke AG	宝马汽车股份公司	BMW GR	德国证券交易所	德国	933	827,863.91	1.04
35	Bridgestone Corp	普利司通株式会社	5108 JP	日本东京证券交易所	日本	2,800	824,802.63	1.04
36	Merck & Co Inc	默克	MRK US	美国证券交易所	美国	989	824,613.43	1.04
37	Roche Holding AG	罗氏	ROG SW	瑞士证券交易所	瑞士	369	815,142.88	1.03



38	Mitsubishi UFJ Financial Group	三菱日联金融集团	8306 JP	日本东京证券交易所	日本	15,000	798,675.08	1.00
39	SMC Corp	日本 SMC 公司	6273 JP	日本东京证券交易所	日本	200	794,725.45	1.00
40	PepsiCo Inc	百事可乐	PEP US	美国证券交易所	美国	577	772,235.26	0.97
41	Liberty Media Corp-Liberty Formula One	Liberty 传媒公司-Liberty 一级方程式	FWONK US	美国证券交易所	美国	1,417	770,788.80	0.97
42	Advanced Micro Devices Inc	AMD 公司	AMD US	美国证券交易所	美国	931	766,297.61	0.96
43	HDFC Bank Ltd	HDFC 银行有限公司	HDB US	美国证券交易所	美国	1,498	754,450.11	0.95
44	Haier Smart Home Co Ltd	海尔智家	6690 HK	香港联合交易所	中国香港	32,800	745,523.63	0.94
45	Home Depot Inc/The	家得宝	HD US	美国证券交易所	美国	332	745,214.67	0.94
46	New Oriental Education & Technology Group Inc	新东方教育科技集团	9901 HK	香港联合交易所	中国香港	26,000	737,206.43	0.93
47	Wuxi Biologics Cayman Inc	药明生物	2269 HK	香港联合交易所	中国香港	21,000	727,109.60	0.91
48	AMETEK Inc	阿美特克股份有限公司	AME US	美国证券交易所	美国	619	724,052.04	0.91

49	Johnson Controls International	江森自控国际有限公司	JCI US	美国证券交易所	美国	1,399	688,820.05	0.87
50	Galaxy Entertainment Group Ltd	银河娱乐	27 HK	香港联合交易所	中国香港	15,000	687,413.87	0.86
51	UnitedHealth Group Inc	联合健康	UNH US	美国证券交易所	美国	197	684,182.68	0.86
52	American Express Co	美国运通	AXP US	美国证券交易所	美国	543	683,492.76	0.86
53	Keyence Corp	株式会社 KEYENCE	6861 JP	日本东京证券交易所	日本	200	678,436.36	0.85
54	Coterra Energy Inc	Coterra 能源股份有限公司	CTRA US	美国证券交易所	美国	3,662	669,460.25	0.84
55	Costco Wholesale Corp	好市多批发	COST US	美国证券交易所	美国	172	669,118.91	0.84
56	GSK PLC	葛兰素史克公共有限公司	GSK LN	英国伦敦证券交易所	英国	5,242	668,839.59	0.84
57	Cowell e Holdings Inc	高伟电子	1415 HK	香港联合交易所	中国香港	50,000	667,589.06	0.84
58	Las Vegas Sands Corp	拉斯维加斯金沙集团	LVS US	美国证券交易所	美国	1,566	656,304.96	0.83
59	Siemens AG	西门子	SIE GR	德国证券交易所	德国	512	617,069.68	0.78
60	Kubota Corp	久保田	6326 JP	日本东京证券交易所	日本	5,800	608,652.91	0.77
61	Bunzl PLC	本泽商贸有限公司	BNZL LN	英国伦敦证券交易所	英国	2,209	608,635.67	0.77

62	Keymed Biosciences Inc	康诺亚	2162 HK	香港联合交易所	中国香港	16,000	603,411.99	0.76
63	Diageo PLC	帝亚吉欧	DGE LN	英国伦敦证券交易所	英国	1,856	576,170.99	0.72
64	Huadian Power International Corp Ltd	华电国际	1071 HK	香港联合交易所	中国香港	150,000	565,698.74	0.71
65	Hang Lung Properties Ltd	恒隆地产	101 HK	香港联合交易所	中国香港	50,000	557,861.02	0.70
65	H World Group Ltd	华住集团	1179 HK	香港联合交易所	中国香港	20,000	557,861.02	0.70
66	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	B3 股份公司	B3SA3 BZ	巴西证券交易所	巴西	24,118	527,554.33	0.66
67	Gushengtang Holdings Ltd	固生堂	2273 HK	香港联合交易所	中国香港	11,000	504,103.51	0.63
68	Chervon Holdings Ltd	泉峰控股	2285 HK	香港联合交易所	中国香港	16,900	483,079.98	0.61
69	Ferrari NV	法拉利	RACE IM	意大利证券交易所	意大利	202	477,000.23	0.60
70	Alcon Inc	爱尔康公司	ALC SW	瑞士证券交易所	瑞士	761	455,462.79	0.57
71	Charles Schwab Corp/The	嘉信理财	SCHW US	美国证券交易所	美国	1,103	451,742.85	0.57
72	Texas Instruments Inc	德州仪器	TXN US	美国证券交易所	美国	344	447,471.25	0.56
73	Giant Biogene Holding Co ltd	巨子生物	2367 HK	香港联合交易所	中国香港	13,800	442,821.78	0.56

74	Nestle SA	雀巢	NESN SW	瑞士证 券交易 所	瑞士	509	442,364.33	0.56
75	Danaher Corp	丹纳赫	DHR US	美国证 券交易 所	美国	251	435,282.19	0.55
76	Oracle Corp	甲骨文	ORCL US	美国证 券交易 所	美国	484	416,491.93	0.52
77	Guangshen Railway Co Ltd	广深铁 路	525 HK	香港联 合交易 所	中国 香港	160,000	365,883.07	0.46
78	Morimatsu Internati onal Holdings Co Ltd	森松国 际	2155 HK	香港联 合交易 所	中国 香港	57,000	337,953.13	0.43
79	China Shenhua Energy Co Ltd	中国神 华	1088 HK	香港联 合交易 所	中国 香港	15,000	331,258.80	0.42
80	PRADA SpA	普拉达	1913 HK	香港联 合交易 所	中国 香港	6,800	329,184.11	0.41
81	Yum China Holdings Inc	百胜中 国	9987 HK	香港联 合交易 所	中国 香港	800	325,753.95	0.41
82	Orient Securitie s Co Ltd/China	东方证 券	3958 HK	香港联 合交易 所	中国 香港	80,000	316,459.34	0.40
83	EC Healthcar e	医思健 康	2138 HK	香港联 合交易 所	中国 香港	38,000	146,113.48	0.18
84	China Literatur e Ltd	阅文集 团	772 HK	香港联 合交易 所	中国 香港	4,000	121,530.72	0.15
85	Global New Material Internati onal Holdings Ltd	环球新 材国际	6616 HK	香港联 合交易 所	中国 香港	20,000	80,774.59	0.10

86	JD.com Inc	京东集团	9618 HK	香港联合交易所	中国香港	242	29,544.32	0.04
87	China Overseas Land & Investme	中国海外发展	688 HK	香港联合交易所	中国香港	500	7,874.60	0.01

## 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

### 7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	Hua Hong Semiconductor Ltd	1347 HK	1,521,049.75	2.11
2	CRRC Corp Ltd	1766 HK	1,460,861.79	2.02
3	PetroChina Co Ltd	857 HK	1,280,418.83	1.77
4	ZTE Corp	763 HK	1,152,694.31	1.60
5	NVIDIA Corp	NVDA US	883,360.76	1.22
6	Huaneng Power International Inc	902 HK	793,976.27	1.10
7	Keymed Biosciences Inc	2162 HK	787,347.74	1.09
8	Las Vegas Sands Corp	LVS US	779,141.69	1.08
9	GSK PLC	GSK LN	767,246.43	1.06
10	Mitsubishi UFJ Financial Group	8306 JP	746,765.37	1.03
11	Otis Worldwide Corp	OTIS US	736,784.41	1.02
12	Cowell e Holdings Inc	1415 HK	706,326.95	0.98
13	New Oriental Education & Technology Group Inc	9901 HK	705,191.89	0.98
14	SSY Group Ltd	2005 HK	702,262.23	0.97
15	Sinotruk Hong Kong Ltd	3808 HK	702,166.13	0.97
16	Haier Smart Home Co Ltd	6690 HK	701,507.82	0.97
17	Liberty Media Corp-Liberty Formula One	FWONK US	676,825.11	0.94

18	Chervon Holdings Ltd	2285 HK	601,004.88	0.83
19	Hang Lung Properties Ltd	101 HK	598,408.14	0.83
20	Siemens AG	SIE GR	594,656.90	0.82

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。

### 7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	Tsingtao Brewery Co Ltd	168 HK	2,589,088.07	3.58
2	China Overseas Land & Investme	688 HK	2,266,509.63	3.14
3	Chow Tai Fook Jewellery Group Ltd	1929 HK	1,936,778.00	2.68
4	Wuxi Biologics Cayman Inc	2269 HK	1,750,283.85	2.42
5	BYD Co Ltd	1211 HK	1,404,621.45	1.94
6	Zhuzhou CRRC Times Electric Co Ltd	3898 HK	1,361,707.77	1.88
7	Dongfang Electric Corp Ltd	1072 HK	1,139,452.96	1.58
8	Johnson & Johnson	JNJ US	887,316.53	1.23
9	Sinotruk Hong Kong Ltd	3808 HK	850,852.70	1.18
10	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	MC FP	843,451.40	1.17
11	Elevance Health Inc	ELV US	824,938.02	1.14
12	Otis Worldwide Corp	OTIS US	814,905.76	1.13
13	SSY Group Ltd	2005 HK	742,570.01	1.03
14	Keymed Biosciences Inc	2162 HK	692,642.66	0.96
15	Meituan	3690 HK	686,826.11	0.95
16	Texas Instruments Inc	TXN US	590,617.12	0.82
17	AT&T Inc	T US	577,306.99	0.80

18	Union Pacific Corp	UNP US	565,150.40	0.78
19	Nestle SA	NESN SW	561,887.62	0.78
20	Prudential PLC	PRU LN	526,633.65	0.73

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。

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	27,787,027.08
卖出收入（成交）总额	28,018,465.09

注：“买入成本”或“卖出收入”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。

### 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

无。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

无。

### 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

无。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

无。

### 7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

无。

### 7.11 投资组合报告附注

#### 7.11.1 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。

#### 7.11.2 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。

#### 7.11.3 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	应收清算款	-

3	应收股利	297,400.50
4	应收利息	-
5	应收申购款	52,342.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	349,743.19

#### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

#### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

#### 7.11.6 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 (%)
6,319	5,366.31	8,391,360.76	24.75	25,518,333.48	75.25

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	7,460.34	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

基金合同生效日 (2008 年 8 月 22 日) 基金份额总额	508,425,627.85
本报告期期初基金份额总额	33,833,732.41
本报告期基金总申购份额	2,467,127.17
减：本报告期基金总赎回份额	2,391,165.34
本报告期基金拆分变动份额	-



本报告期末基金份额总额	33,909,694.24
-------------	---------------

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人的重大人事变动：本报告期内，本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

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

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

无。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 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 (%)	
UOB Kay	-	34,295,824.	61.46	41,154.98	94.03	-

Hian Limited		36				
Cowen and Company LLC	-	3181114.15	5.70	315.02	0.72	-
BMO Capital Markets Corp.	-	2697516.58	4.83	369.58	0.84	-
Virtu Americas LLC	-	2296948.6	4.12	176.23	0.40	-
Goldman Sachs & Co. LLC New York	-	2282921.84	4.09	95.34	0.22	-
Exane SA	-	1957482.13	3.51	244.75	0.56	-
Jefferies LLC New York	-	1869828.48	3.35	97.3	0.22	-
Jefferies International Limited	-	1672493.61	3.00	209.05	0.48	-
UBS Securities LLC Stamford	-	887056.48	1.59	165.6	0.38	-
UBS AG	-	852566.08	1.53	106.56	0.24	-
Morgan Stanley & Co. International PLC	-	798290.19	1.43	159.53	0.36	-
Instinet Europe Limited London	-	767246.43	1.37	95.87	0.22	-

Goldman Sachs International	-	736172.69	1.32	97.81	0.22	-
Citigroup Global Markets Limited	-	339555.19	0.61	42.47	0.10	-
BTIG LLC	-	299867.95	0.54	299.86	0.69	-
Liquidnet Inc.	-	229398.6	0.41	24.62	0.06	-
UBS Securities Asia Limited	-	187114.79	0.34	37.41	0.09	-
Luminex Trading & Analytics LLC	-	121348.34	0.22	9.16	0.02	-
RBC Capital Markets LLC NY	-	116692.51	0.21	3.78	0.01	-
Credit Suisse Securities (USA) LLC New York	-	83122.76	0.15	32.39	0.07	-
Joh. Berenberg Gossler & Co. KG	-	73205.89	0.13	9.11	0.02	-
J.P. Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	-	39849.72	0.07	19.92	0.05	-

d						
虚拟券商	-	19874.8	0.04	0	0.00	-

注：1、本公司从事境外投资业务时，将需要委托境外券商代理或协助进行交易操作。公司作为基金管理人将勤勉尽责地承担受信责任，挑选、委托合适的境外券商以取得有益于基金持有人利益的最佳执行；

2、本公司投资海外市场，遵循公平分配、最佳执行的原则。公司挑选券商并开户均主要遵循以下原则：券商基本面评价，包括财务状况和经营状况； 券商研究及服务质量，包括其研究报告质量、数量和及时性，包括券商在股票配售等公司行为发生时所提供的服务；券商的交易执行能力，即是否对投资指令进行了有效的执行以及能否取得较高质量的成交结果。衡量券商交易执行能力的指标主要有：是否完成交易、成交的及时性、成交价格、对市场价格及流动性的影响等。能够及时准确高效地提供结算等后台业务支持。

### 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		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的比例 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
UOB Kay Hian Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Cowen and Company LLC	-	-	-	-	-	-	-	-
BMO Capital Markets Corp.	-	-	-	-	-	-	-	-
Virtu Americas LLC	-	-	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs & Co. LLC New York	-	-	-	-	-	-	-	-
Exane SA	-	-	-	-	-	-	-	-
Jefferies LLC New York	-	-	-	-	-	-	-	-

Jefferies International Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
UBS Securities LLC Stamford	-	-	-	-	-	-	-	-
UBS AG	-	-	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley & Co. International PLC	-	-	-	-	-	-	-	-
Instinet Europe Limited London	-	-	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs International	-	-	-	-	-	-	-	-
Citigroup Global Markets Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
BTIG LLC	-	-	-	-	-	-	-	-
Liquidnet Inc.	-	-	-	-	-	-	-	-
UBS Securities Asia Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Luminex Trading & Analytics LLC	-	-	-	-	-	-	-	-
RBC Capital Markets LLC NY	-	-	-	-	-	-	-	-
Credit Suisse Securities (USA) LLC New York	-	-	-	-	-	-	-	-
Joh. Berenberg Gossler & Co. KG	-	-	-	-	-	-	-	-
J.P. Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
虚拟券商	-	-	-	-	9,937.40	100.00	-	-

注：1、本公司从事境外投资业务时，将需要委托境外券商代理或协助进行交易操作。公司作为基金管理人将勤勉尽责地承担受信责任，挑选、委托合适的境外券商以取得有益于基金持有人利益的最佳执行；

2、本公司投资海外市场，遵循公平分配、最佳执行的原则。公司挑选券商并开户均主要遵循以下原则：券商基本面评价，包括财务状况和经营状况；券商研究及服务质量，包括其研究报告质量、数量和及时性，包括券商在股票配售等公司行为发生时所提供的服务；券商的交易执行能力，即是否对投资指令进行了有效的执行以及能否取得较高质量的成交结果。衡量券商交易执行能力的指标主要有：是否完成交易、成交的及时性、成交价格、对市场价格及流动性的影响等。能够及时准确高效地提供结算等后台业务支持。

## 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环球精选价值证券投资基金暂停及恢复大额申购（定期定额投资）业务的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2023年1月6日
2	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德环球精选价值证券投资基金于境外主要市场节假日暂停及	中国证监会规定媒体及公司网站	2023年1月12日

	节后恢复基金申购、赎回和定期定额投资业务的公告		
3	交银施罗德环球精选价值证券投资基金 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
4	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德环球精选价值证券投资基金于境外主要市场节假日暂停及节后恢复基金申购、赎回和定期定额投资业务的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2023 年 2 月 15 日
5	交银施罗德环球精选价值证券投资基金 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
6	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德环球精选价值证券投资基金于境外主要市场节假日暂停及节后恢复基金申购、赎回和定期定额投资业务的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2023 年 4 月 4 日
7	交银施罗德环球精选价值证券投资基金 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
8	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德环球精选价值证券投资基金于境外主要市场节假日暂停及节后恢复基金申购、赎回和定期定额投资业务的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2023 年 5 月 24 日
9	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德环球精选价值证券投资基金于境外主要市场节假日暂停及节后恢复基金申购、赎回和定期定额投资业务的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2023 年 6 月 14 日
10	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德环球精选价值证券投资基金于境外主要市场节假日暂停及节后恢复基金申购、赎回和定期定额投资业务的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2023 年 6 月 30 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	2023/1/1-2023/6/30	8,212,422.53	0.00	0.00	8,212,422.53	24.22

产品特有风险

本基金本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例超过基金总份额 20%的情况。如该类投资者集中赎回，可能会对本基金带来流动性冲击，从而影响基金的投资运作和收益水平。基金管理人将加强流动性管理，防范相关风险，保护持有人利益。

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环球精选价值证券投资基金募集的文件；
- 2、《交银施罗德环球精选价值证券投资基金基金合同》；
- 3、《交银施罗德环球精选价值证券投资基金招募说明书》；
- 4、《交银施罗德环球精选价值证券投资基金托管协议》；
- 5、关于申请募集交银施罗德环球精选价值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环球精选价值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。