

交银施罗德精选混合型证券投资基金 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：交银施罗德基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.4 过去三年基金的利润分配情况	8
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	15
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	16
§ 7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 净资产变动表	20
7.4 报表附注	22
§ 8 投资组合报告	57
8.1 期末基金资产组合情况	57

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	57
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	58
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	62
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	64
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	64
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	65
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	65
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	65
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	65
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	65
8.14 投资组合报告附注	65
§ 9 基金份额持有人信息	66
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	66
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	66
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	66
§ 10 开放式基金份额变动	66
§ 11 重大事件揭示	67
11.1 基金份额持有人大会决议	67
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	67
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	67
11.4 基金投资策略的改变	67
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	67
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	67
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	67
11.8 其他重大事件	70
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	72
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	72
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	72
§ 13 备查文件目录	72
13.1 备查文件目录	72
13.2 存放地点	72
13.3 查阅方式	72

§ 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	7,078,665,860.92 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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网	www.fund001.com

址	
基金年度报告备置地点	基金管理人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023 年	2022 年	2021 年
本期已实现收益	-863,957,519.02	-594,637,389.28	1,440,890,965.19
本期利润	-1,091,923,111.78	-1,370,717,423.64	121,514,581.88
加权平均基金份额本期利润	-0.1479	-0.1778	0.0128
本期加权平均净值利润率	-16.69%	-18.80%	1.05%
本期基金份额净值增长率	-15.90%	-15.58%	3.59%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
期末可供分配利润	1,963,538,849.37	2,961,375,066.43	4,348,930,226.70
期末可供分配基金份额利润	0.2774	0.3963	0.5661
期末基金资产净值	5,531,746,556.62	6,943,532,907.86	9,206,455,986.27
期末基金份额净值	0.7815	0.9292	1.1983
3.1.3 累计期末指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末

基金份额 累计净值 增长率	945.10%	1,142.62%	1,371.95%
---------------------	---------	-----------	-----------

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

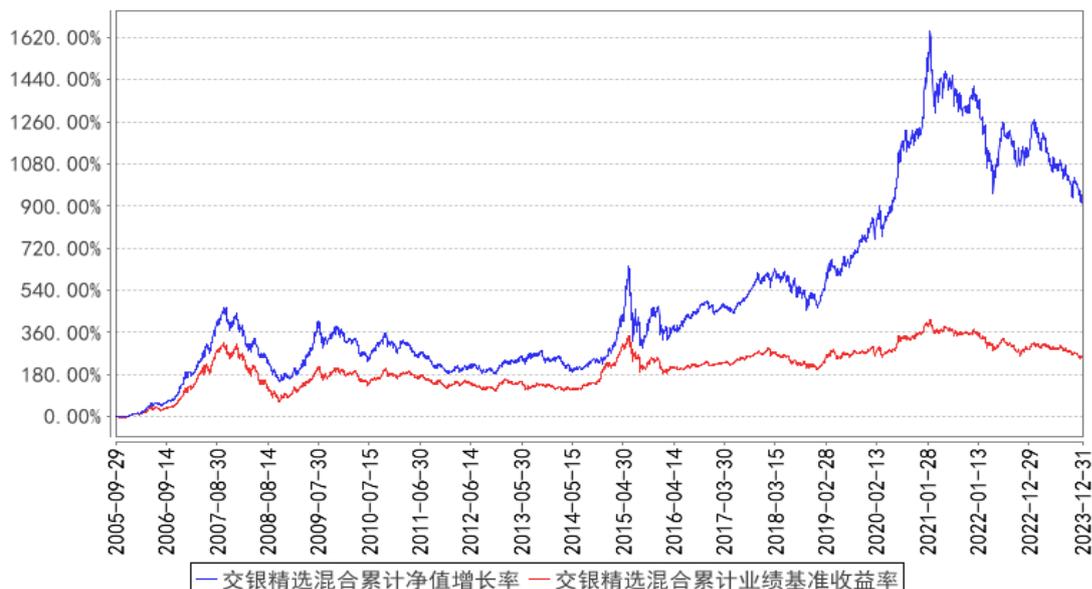
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-6.09%	0.87%	-4.95%	0.59%	-1.14%	0.28%
过去六个月	-10.23%	0.86%	-7.60%	0.64%	-2.63%	0.22%
过去一年	-15.90%	0.88%	-7.43%	0.63%	-8.47%	0.25%
过去三年	-26.45%	1.20%	-23.83%	0.83%	-2.62%	0.37%
过去五年	80.72%	1.20%	18.14%	0.91%	62.58%	0.29%
自基金合同生效起至今	945.10%	1.47%	260.15%	1.22%	684.95%	0.25%

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

2、本基金业绩比较基准每日进行再平衡过程。

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

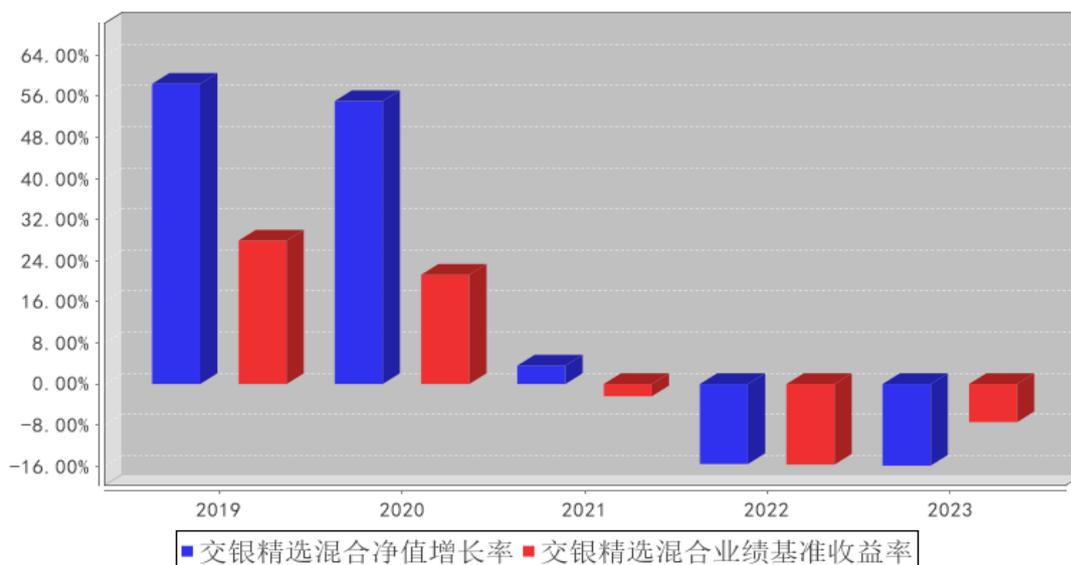
交银精选混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

交银精选混合基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2023 年	-	-	-	-	-
2022 年	0.940	428,292,826.75	290,547,964.06	718,840,790.81	-

2021 年	0.740	354,454,402.29	271,210,180.55	625,664,582.84	-
合计	1.680	782,747,229.04	561,758,144.61	1,344,505,373.65	-

§ 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 127 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（LOF）的基金经理，权益部一级专家、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。历任中金公司研究部研究员、华泰证券研究部研究员。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 公平交易制度和控制方法

本公司制定了严格的投资控制制度和公平交易监控制度来保证旗下所管理的所有资产组合投资运作的公平。旗下所管理的所有资产组合，包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均严格遵循制度进行公平交易。制度中包含的主要控制方法如下：

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

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

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

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

（5）公司中央交易室和风险管理部进行日常投资交易行为监控，风险管理部负责对各投资组合公平交易进行事后分析，于每季度和每年度分别对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析，通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本公司制定了严格的投资控制制度和公平交易监控制度来保证旗下基金运作的公平，旗下所管理的所有资产组合，包括证券投资基金和私募资产管理计划均严格遵循制度进行公平交易。

公司建立资源共享的投资研究信息平台，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。公司在交易执行环节实行集中交易制度，建立公平的交易分配制度。

对于交易所公开竞价交易，遵循“价格优先、时间优先”的原则，全部通过交易系统进行比例分配；对于非集中竞价交易、以公司名义进行的场外交易，遵循公平交易分配原则对交易结果进行分配。

公司中央交易室和风险管理部进行日常投资交易行为监控，风险管理部负责对各账户公平交易进行事后分析，于每季度和每年度分别对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析，通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

报告期内本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内，本公司管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量没有超过该证券当日总成交量 5% 的情形，本基金与本公司管理的其他投资组合在不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）同向交易的交易价差未出现异常。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年，本基金表现不佳，对此我们将持续优化投资和选股框架，配置角度加入一些宏观影响因子，选股角度更加深度价值，在具备足够安全边际的位置买入，并且在减量市场下考虑及时兑现收益。

复盘 2023 年：

主要有四波结构性行情：

(1) 春节前的核心资产行情，主要推动因素是放开后的经济预期升温以及外资持续流入，领涨的是白酒/CX0 医疗服务等核心资产；

(2) 春节后至六月底，以 AI 驱动的 TMT 行情为主，中特估行情为辅：春节后前期是 AI 驱动的软硬件上涨，计算机和通信领涨，后传媒因为机构持仓低而暴涨，四月发生回调，回调后资金

集中到业绩有支撑的海外算力链+游戏等方向，六月底再次创出新高；同时中特估等概念不断发酵，电信/银行/建筑等行业表现不错，而没有自由现金流支撑的建筑下跌；

(3) 七月至八月：七月，最初是顺周期行情，政治局会议被视为政策转向信号，表现较好主要是供给侧格局较好且机构持仓较低的周期类行业以及销量不断超预期的汽车行业，其他传统的白酒等可选消费表现尚可；而 TMT 则出现了大幅度回调；

(4) 九月至年底：九月，股票开始出现大反攻。四季度，电子在华为回归+消费电子第三季度业绩拐点出现的催化下开始明显反弹；生猪也出现了持续亏损产能去化行情；在地产等数据持续低于预期背景下，煤炭等高股息股票再次走强，而相应的传统可选消费则持续走弱。

本基金的操作及总结：

(1) 在春节前的核心资产行情中未能及时兑现收益，当时个股已经涨至阶段性高点，应该选择及时止盈；

(2) 在面对 AI 的行情中，主要观望为主，对算力等核心收益标的持仓较小而错过了一波较大的涨幅，未来在应对新的产业趋势可能出现的时候，会第一时间加大研究力度；

(3) 医药板块，情绪已经导致板块超调，但组合加仓力度不够，主要因为医药行业的积累不够，会持续加大优质个股研究储备；

(4) 顺周期配置太多，而逆周期的优质资产配置不足，如防御性高股息的公用事业/电信以及其他资源类运营类优质资产，未来主要通过优化宏观数据监测框架来提升；

(5) 对供需格局在恶化的部分制造业，由于坚信个股 alpha，对单位盈利见底的时间预计偏乐观，未来会更加谨慎。

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

对 2024 年的展望：

在中国从成长型经济体向成熟经济体的逐步转型中，需要逐步向科技提升效率以及内生消费拉动所转型，同时 2024 年是全球选举大年，地缘政治的不确定性在加码，我国经济转型升级中也存在一定不确定性，市场目前风险偏好较低，体现在成长股和价值股的估值在急剧收敛，债市/类债资产持续走牛，很多具备强竞争力和好的商业模式的公司的估值回到了历史低位，迎来赔率和胜率都比较好的机会。在这个阶段，我们需要底线思维，底线思维可能体现在外部极端假设下的分红收益率保护；也需要寻找向上期权，向上期权来自于对我国中长期经济前景预期的向上修正

/新的长期产业趋势下核心受益标的，聚焦资产本身创造自由现金流的能力，选择注重股东回报的公司布局。

2024 年将持续关注以下问题：

(1) 国内的房地产的价量何时企稳？财政政策力度？M1 何时企稳回升？

(2) 海外 AI 应用方面的创新进展，关注 AI 手机/AIPC 是否会有经验的功能催生潜在换机潮；MR 的应用和销量是否可能超预期效果；

(3) 中国企业走出去中的挑战与机遇。

2024 年目前的配置思路如下：

(1) 基础资产：格局稳定，自由现金流优异，可能存在阶段性结构性成长机会，分红率提供底层保护，DCF 角度看价值被低估的公司，这一类公司我们的配置目前主要集中在医药消费行业中自身竞争力较强的公司，比如医药、白酒、家电、家居等，目前这些子行业中很多公司的估值已经回调到比稳定类资产（如水电）更低的估值，我们认为如果未来对中国中长期经济增长的预期发生向上修正/业绩持续超预期验证自身 alpha，这类公司具备业绩和估值双升的机会，目前是兼具赔率和胜率的选择，是我们的主力仓位所在；

(2) 成长机会：1) 关注低渗透率的行业中竞争优势明确的公司，关注公司产品创新带来的增长弹性，未来 2 年的业绩将呈现高增长，但这类公司目前静态估值不算很低，我们在电子行业中进行了适当仓位配置；2) 出海带来的增长机会，我们的配置主要选择了具备产品/成本和渠道优势的低估值制造业个股进行了适当仓位配置；

(3) 周期机会：供需格局优化，年内具备涨价机会的子行业，如面板/化纤/生猪等，我们选择具备成本优势的个股在其 PB 底位进行了适当仓位配置。

2024 年，我们会积极做好研究和投资工作，及时对市场 and 个股的变化做出应对，争取给投资人带来更好的投资回报和持有体验。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2023 年度，根据《证券投资基金法》等法律法规及有关要求，本基金管理人诚实守信、勤勉尽责，依法履行基金管理人职责，落实风险控制，强化合规管理职能，确保基金管理业务运作的安全、规范，保护基金投资人的合法权益。

本报告期内，本基金管理人为了确保公司业务的规范运作，主要做了以下工作：

(一) 继续深化全面风险管理，提高风险控制有效性。

公司风险管理部门持续加大重点风险事前防范力度，加强对信用风险的监控，信用风险提示进一步前移；继续加强流动性风险管理，坚持开展定期及不定期压力测试及应急演练工作；定期排查

风险控制阈值，提高公司旗下组合风险控制精准度；不断优化业务操作流程，通过丰富管理工具加强操作风险管理；继续加强各项潜在风险排查，落实防范措施和跟踪机制，不断提升公司风险管理水平。

（二）全面开展内部监督检查，强化公司内部控制。

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

（三）持续夯实公司合规管理体系，合规文化建设取得新实效。

公司法律合规部门着力持续夯实合规管理体系，体系内三道防线各司其职、形成合力，公司合规文化建设取得新实效；全年加强建立全面、系统、规范的规章制度体系，持续扎实推进新法规跟踪落实工作，以持续抓好制度建设及执行助推公司合规管理常态长效发展。

（四）强化培训教育及重点领域合规提示，牢固树立全员风险合规防范意识。

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

估值委员会会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及应用性的情况后，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。

4.8 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 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内无需预警说明。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—交银施罗德基金管理有限公司 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，交银施罗德基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
------------	---

审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(24)第 P01110 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	交银施罗德精选混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了交银施罗德精选混合型证券投资基金的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表、净资产变动表以及财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了交银施罗德精选混合型证券投资基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况、2023 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于交银施罗德精选混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>交银施罗德基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括交银施罗德精选混合型证券投资基金 2023 年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估交银施罗德精选混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算交银施罗德精选混合型证券投资基</p>

	<p>金、终止经营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督交银施罗德精选混合型证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和做出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对交银施罗德精选混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致交银施罗德精选混合型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	孙维琦 季潇然
会计师事务所的地址	上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼
审计报告日期	2024 年 03 月 25 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：交银施罗德精选混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	297,389,054.20	590,082,224.57
结算备付金		14,491,041.15	2,361,431.09
存出保证金		2,049,558.13	2,346,171.73
交易性金融资产	7.4.7.2	5,236,766,675.63	5,899,815,815.15
其中：股票投资		4,933,219,389.81	5,516,744,080.68
基金投资		-	-
债券投资		303,547,285.82	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	500,064,270.62
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		8,540,109.31	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,059,325.68	2,020,379.53
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		5,560,295,764.10	6,996,690,292.69
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		8,626,339.79	34,749,941.85
应付赎回款		5,662,049.04	3,070,915.61

应付管理人报酬		5,669,855.99	8,837,397.29
应付托管费		944,976.01	1,472,899.54
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.04	2,068.21
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	7,645,986.61	5,024,162.33
负债合计		28,549,207.48	53,157,384.83
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	3,138,180,448.70	3,312,879,077.49
未分配利润	7.4.7.12	2,393,566,107.92	3,630,653,830.37
净资产合计		5,531,746,556.62	6,943,532,907.86
负债和净资产总计		5,560,295,764.10	6,996,690,292.69

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.7815 元，基金份额总额 7,078,665,860.92 份。

7.2 利润表

会计主体：交银施罗德精选混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-986,900,654.94	-1,242,675,601.58
1. 利息收入		3,191,948.99	4,776,219.16
其中：存款利息收入	7.4.7.13	3,003,167.88	4,668,069.13
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		188,781.11	108,150.03
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以 “-”填列）		-762,435,119.88	-472,335,342.77
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-854,267,808.61	-535,556,518.20
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	5,947,924.44	11,082,000.86
资产支持证券 投资收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收 益	7.4.7.17	-	-

衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	85,884,764.29	52,139,174.57
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	-227,965,592.76	-776,080,034.36
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	308,108.71	963,556.39
减：二、营业总支出		105,022,456.84	128,041,822.06
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	89,768,923.10	109,490,568.35
2. 托管费	7.4.10.2.2	14,961,487.20	18,248,428.10
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
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	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		679.62	432.75
8. 其他费用	7.4.7.23	291,366.92	302,392.86
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,091,923,111.78	-1,370,717,423.64
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,091,923,111.78	-1,370,717,423.64
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-1,091,923,111.78	-1,370,717,423.64

7.3 净资产变动表

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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	3,312,879,077.49	-	3,630,653,830.37	6,943,532,907.86

二、本期期初净资产	3,312,879,077.49	-	3,630,653,830.37	6,943,532,907.86
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-174,698,628.79	-	-1,237,087,722.45	-1,411,786,351.24
(一)、综合收益总额	-	-	1,091,923,111.78	1,091,923,111.78
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-174,698,628.79	-	-145,164,610.67	-319,863,239.46
其中：1. 基金申购款	331,760,526.66	-	360,266,353.83	692,026,880.49
2. 基金赎回款	-506,459,155.45	-	-505,430,964.50	-1,011,890,119.95
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	3,138,180,448.70	-	2,393,566,107.92	5,531,746,556.62
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	3,406,011,854.45	-	5,800,444,131.82	9,206,455,986.27
二、本期期初净资产	3,406,011,854.45	-	5,800,444,131.82	9,206,455,986.27
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-93,132,776.96	-	-2,169,790,301.	-2,262,923,078.4

			45	1
(一)、综合收益总额	-	-	1,370,717,423.64	1,370,717,423.64
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-93,132,776.96	-	-80,232,087.00	-173,364,863.96
其中：1. 基金申购款	694,964,317.41	-	807,864,629.25	1,502,828,946.66
2. 基金赎回款	-788,097,094.37	-	-888,096,716.25	-1,676,193,810.62
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-718,840,790.81	-718,840,790.81
四、本期期末净资产	3,312,879,077.49	-	3,630,653,830.37	6,943,532,907.86

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>谢卫</u>	<u>印皓</u>	<u>单江</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

交银施罗德精选混合型证券投资基金(原交银施罗德精选股票证券投资基金,以下简称“本基金”)系由基金管理人交银施罗德基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《交银施罗德精选股票证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)以证监基金字[2005]140号文批准公开募集。本基金为契约型开放

式基金，存续期限不定，首次设立募集基金份额 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 2024 年 3 月 25 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 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 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

根据本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产，暂无金融资产划分为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

金融资产的合同条款规定在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付，且本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标，则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

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

(2) 金融负债的分类

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

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

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

本基金在前一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

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

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。若本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价(包括转出的非现金资产或承担的新金融负债)之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

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

(2) 投资收益

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

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

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

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

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

(3) 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值

变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

(4) 信用减值损失

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认信用损失准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 每年收益分配次数最多为 6 次，年度收益分配比例不低于基金年度已实现收益的 50%；

(2) 收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。若基金份额持有人不选择，基金默认的收益分配方式是现金分红；分红方式最终以注册登记机构确认的分红方式为准；

(3) 基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；

(4) 基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；

(5) 在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益每年至少分配一次，但若基金合同生效不

满 3 个月则不进行收益分配；

(6) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；

(7) 每一基金份额享有同等分配权；

(8) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 外币交易

本基金本报告期内无外币交易。

7.4.4.13 分部报告

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

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

(2) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（中国证监会公告[2017]13号）及《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》（中基协发

[2013]13 号)相关规定, 本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(3) 对于中国证券投资基金业协会《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》(中基协字[2022]566 号)所规定的固定收益品种, 本基金按照相关规定, 对以公允价值计量的固定收益品种选取第三方估值基准服务机构提供估值全价进行估值; 对以摊余成本计量的固定收益品种用第三方估值基准服务机构提供的预期信用损失减值计量结果。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

根据中国证监会于 2024 年颁布的修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》, 本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露, 这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》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；自 2023 年 8 月 28 日起，出让方减按 0.05% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税。

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	297,389,054.20	590,082,224.57
等于：本金	297,321,533.08	589,855,743.08
加：应计利息	67,521.12	226,481.49
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	297,389,054.20	590,082,224.57

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		5,159,000,628.93	-	4,933,219,389.81	- 225,781,239.12
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	3,900.00	0.45	4,050.85	150.40
	银行间市场	300,107,392.13	3,667,234.97	303,543,234.97	-231,392.13
	合计	300,111,292.13	3,667,235.42	303,547,285.82	-231,241.73
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		5,459,111,921.06	3,667,235.42	5,236,766,675.63	- 226,012,480.85
项目		上年度末 2022 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		5,513,991,298.77	-	5,516,744,080.68	2,752,781.91
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	2,000.00	0.22	2,000.22	-
	银行间市场	380,090,670.00	3,778,734.25	383,069,734.25	-799,670.00
	合计	380,092,670.00	3,778,734.47	383,071,734.47	-799,670.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		5,894,083,968.77	3,778,734.47	5,899,815,815.15	1,953,111.91

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	500,064,270.62	-
合计	500,064,270.62	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

无。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.8 其他资产

无。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	4,298.41	6,388.13
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	7,412,388.20	4,788,474.20
其中：交易所市场	7,411,183.28	4,786,784.20
银行间市场	1,204.92	1,690.00
应付利息	-	-
预提审计费	100,000.00	100,000.00
预提信息披露费	120,000.00	120,000.00
预提账户维护费	9,300.00	9,300.00
合计	7,645,986.61	5,024,162.33

7.4.7.10 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 12 月 31 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	748,332,396.74	331,760,526.66
本期赎回（以“-”号填列）	-1,142,394,262.23	-506,459,155.45
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	7,078,665,860.92	3,138,180,448.70

注：1、如果本报告期间发生红利再投、转换入业务，则总申购份额中包含该业务；

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

7.4.7.11 其他综合收益

无。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,961,375,066.43	669,278,763.94	3,630,653,830.37
本期期初	2,961,375,066.43	669,278,763.94	3,630,653,830.37
本期利润	-863,957,519.02	-227,965,592.76	-
本期基金份额交易产生的变动数	-133,878,698.04	-11,285,912.63	-145,164,610.67
其中：基金申购款	286,682,456.16	73,583,897.67	360,266,353.83
基金赎回款	-420,561,154.20	-84,869,810.30	-505,430,964.50
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,963,538,849.37	430,027,258.55	2,393,566,107.92

7.4.7.13 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12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
活期存款利息收入	2,748,881.81	4,479,923.71
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	213,829.92	148,653.11
其他	40,456.15	39,492.31
合计	3,003,167.88	4,668,069.13

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资收益——买卖 股票差价收入	-854,267,808.61	-535,556,518.20
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	-854,267,808.61	-535,556,518.20

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日
卖出股票成交总额	20,648,027,863.39	13,923,393,403.99
减：卖出股票成本总额	21,447,549,344.10	14,418,390,277.83
减：交易费用	54,746,327.90	40,559,644.36
买卖股票差价收入	-854,267,808.61	-535,556,518.20

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
债券投资收益——利息收入	5,944,690.54	7,840,749.46
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	3,233.90	3,241,251.40
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	5,947,924.44	11,082,000.86

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	527,419,694.18	526,543,603.75

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	519,530,060.00	511,628,870.00
减：应计利息总额	7,885,500.21	11,671,594.60
减：交易费用	900.07	1,887.75
买卖债券差价收入	3,233.90	3,241,251.40

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	85,884,764.29	52,139,174.57
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	85,884,764.29	52,139,174.57

7.4.7.20 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-227,965,592.76	-776,080,034.36
股票投资	-228,534,021.03	-775,019,234.36
债券投资	568,428.27	-1,060,800.00
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	-227,965,592.76	-776,080,034.36

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	308,108.71	963,556.39
合计	308,108.71	963,556.39

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、本基金的赎回费收入包括转换费收入，其中转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部

分构成，其中转出基金的不低于赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

7.4.7.22 信用减值损失

无。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	100,000.00	100,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	34,166.92	33,872.46
债券账户费用	37,200.00	37,200.00
存托服务费	-	11,320.40
合计	291,366.92	302,392.86

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

无。

7.4.10.1.2 债券交易

无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

7.4.10.1.4 权证交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

7.4.10.2 关联方报酬**7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	89,768,923.10	109,490,568.35
其中：应支付销售机构的客户维护费	26,762,377.52	31,623,937.32
应支付基金管理人的净管理费	63,006,545.58	77,866,631.03

注：自 2022 年 1 月 1 日至 2023 年 7 月 9 日，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。根据《交银施罗德基金管理有限公司关于调整旗下部分基金管理费率和/或托管费率并修改基金合同等法律文件的公告》，自 2023 年 7 月 10 日起，支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times \text{约定年费率} \div \text{当年天数}。$$
7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	14,961,487.20	18,248,428.10

注：自 2022 年 1 月 1 日至 2023 年 7 月 9 日，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。根据《交银施罗德基金管理有限公司关于调整旗下部分基金管理费率和/或托管费率并修改基金合同等法律文件的公告》，自 2023 年 7 月 10 日起，支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月

月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times \text{约定年费率} \div \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.3 销售服务费

无。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023年12月31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	0.31	21,788,865.89	0.29

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

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行- 活期存款	297,389,054.20	2,748,881.81	590,082,224.57	4,479,923.71

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

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001239	永达股份	2023年12月4日	6个月以上	限售股	12.05	19.92	189	2,277.45	3,764.88	-
001306	夏厦精密	2023年11月9日	6个月以上	限售股	53.63	75.36	64	3,432.32	4,823.04	-
001326	联域股份	2023年11月1日	6个月以上	限售股	41.18	48.64	99	4,076.82	4,815.36	-
001358	兴欣新材	2023年12月14日	6个月以上	限售股	41.00	44.16	87	3,567.00	3,841.92	-
001378	德冠新材	2023年10月23日	6个月以上	限售股	31.68	31.27	205	6,494.40	6,410.35	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	6个月以上	限售股	25.82	31.80	306	7,900.92	9,730.80	-
301251	威	2023	6个月	限售	28.88	34.59	321	9,270.48	11,103.39	-

	尔高	年8月30日	以上	股						
301261	恒工精密	2023年6月29日	6个月以上	限售股	36.90	50.85	198	7,306.20	10,068.30	-
301272	英华特	2023年7月6日	6个月以上	限售股	51.39	53.38	173	8,890.47	9,234.74	-
301291	明阳电气	2023年6月21日	6个月以上	限售股	38.13	28.36	1,206	45,984.78	34,202.16	-
301329	信音电子	2023年7月5日	6个月以上	限售股	21.00	22.23	458	9,618.00	10,181.34	-
301362	民爆光电	2023年7月27日	6个月以上	限售股	51.05	38.52	420	21,441.00	16,178.40	-
301371	敷尔佳	2023年7月24日	6个月以上	限售股	55.68	37.58	564	31,403.52	21,195.12	-
301372	科净源	2023年8月3日	6个月以上	限售股	45.00	43.59	231	10,395.00	10,069.29	-
301381	赛维时代	2023年7月5日	6个月以上	限售股	20.45	29.69	571	11,676.95	16,952.99	-
301393	昊帆生物	2023年7月5日	6个月以上	限售股	67.68	59.37	260	17,596.80	15,436.20	-
301413	安培龙	2023年12月11日	6个月以上	限售股	33.25	58.19	164	5,453.00	9,543.16	-
301418	协	2023	6个月	限售	51.88	50.20	189	9,805.32	9,487.80	-

	昌科技	年8月10日	以上	股						
301456	盘古智能	2023年7月6日	6个月以上	限售股	37.96	30.39	407	15,449.72	12,368.73	-
301459	丰茂股份	2023年12月6日	6个月以上	限售股	31.90	39.84	208	6,635.20	8,286.72	-
301468	博盈特焊	2023年7月12日	6个月以上	限售股	47.58	30.22	598	28,452.84	18,071.56	-
301469	恒达新材	2023年8月10日	6个月以上	限售股	36.58	33.09	275	10,059.50	9,099.75	-
301486	致尚科技	2023年6月30日	6个月以上	限售股	57.66	47.25	482	27,792.12	22,774.50	-
301488	豪恩汽电	2023年6月26日	6个月以上	限售股	39.78	69.09	262	10,422.36	18,101.58	-
301489	思泉新材	2023年10月16日	6个月以上	限售股	41.66	64.11	128	5,332.48	8,206.08	-
301498	乖宝宠物	2023年8月9日	6个月以上	限售股	39.99	38.81	554	22,154.46	21,500.74	-
301505	苏州规划	2023年7月12日	6个月以上	限售股	26.35	35.81	194	5,111.90	6,947.14	-
301507	民生健康	2023年8月24日	6个月以上	限售股	10.00	15.85	851	8,510.00	13,488.35	-
301508	中	2023	6个月	限售	16.82	26.68	419	7,047.58	11,178.92	-

	机 认 检	年 11 月 23 日	以上	股						
301509	金 凯 生 科	2023 年 7 月 26 日	6 个月 以上	限售 股	56.56	62.23	266	15,044.96	16,553.18	-
301515	港 通 医 疗	2023 年 7 月 13 日	6 个月 以上	限售 股	31.16	28.27	230	7,166.80	6,502.10	-
301516	中 远 通	2023 年 12 月 1 日	6 个月 以上	限售 股	6.87	15.51	604	4,149.48	9,368.04	-
301517	陕 西 华 达	2023 年 10 月 9 日	6 个月 以上	限售 股	26.87	43.69	185	4,970.95	8,082.65	-
301518	长 华 化 学	2023 年 7 月 26 日	6 个月 以上	限售 股	25.75	23.01	385	9,913.75	8,858.85	-
301520	万 邦 医 药	2023 年 9 月 18 日	6 个月 以上	限售 股	67.88	52.74	160	10,860.80	8,438.40	-
301525	儒 竞 科 技	2023 年 8 月 23 日	6 个月 以上	限售 股	99.57	81.46	266	26,485.62	21,668.36	-
301526	国 际 复 材	2023 年 12 月 19 日	6 个月 以上	限售 股	2.66	4.45	9,723	25,863.18	43,267.35	-
301529	福 赛 科 技	2023 年 8 月 31 日	6 个月 以上	限售 股	36.60	37.88	182	6,661.20	6,894.16	-
301533	威 马 农 机	2023 年 8 月 7 日	6 个月 以上	限售 股	29.50	33.16	225	6,637.50	7,461.00	-
301548	崇	2023	6 个月	限售	66.80	58.99	136	9,084.80	8,022.64	-

	德科技	年9月11日	以上	股						
301550	斯菱股份	2023年9月6日	6个月以上	限售股	37.56	43.57	260	9,765.60	11,328.20	-
301555	惠柏新材	2023年10月24日	6个月以上	限售股	22.88	32.44	224	5,125.12	7,266.56	-
301558	三态股份	2023年9月21日	6个月以上	限售股	7.33	13.40	1,458	10,687.14	19,537.20	-
301566	达利凯普	2023年12月22日	6个月以上	限售股	8.90	22.14	576	5,126.40	12,752.64	-
301578	辰奕智能	2023年12月21日	6个月以上	限售股	48.94	68.32	118	5,774.92	8,061.76	-
601083	锦江航运	2023年11月28日	6个月以上	限售股	11.25	11.07	1,263	14,208.75	13,981.41	-
601096	宏盛华源	2023年12月15日	6个月以上	限售股	1.70	4.06	3,918	6,660.60	15,907.08	-
603004	鼎龙科技	2023年12月20日	6个月以上	限售股	16.80	31.19	195	3,276.00	6,082.05	-
603075	热威股份	2023年9月1日	6个月以上	限售股	23.10	23.31	182	4,204.20	4,242.42	-
603119	浙江荣泰	2023年7月21日	6个月以上	限售股	15.32	23.87	226	3,462.32	5,394.62	-
603193	润	2023	6个月	限售	17.38	16.66	303	5,266.14	5,047.98	-

	本股份	年10月9日	以上	股						
603231	索宝蛋白	2023年12月6日	6个月以上	限售股	21.29	21.53	161	3,427.69	3,466.33	-
603270	金帝股份	2023年8月25日	6个月以上	限售股	21.77	29.58	195	4,245.15	5,768.10	-
603273	天元智能	2023年10月16日	6个月以上	限售股	9.50	18.97	178	1,691.00	3,376.66	-
603275	众辰科技	2023年8月16日	6个月以上	限售股	49.97	39.70	193	9,644.21	7,662.10	-
603276	恒兴新材	2023年9月18日	6个月以上	限售股	25.73	24.88	134	3,447.82	3,333.92	-
603296	华勤技术	2023年8月1日	6个月以上	限售股	80.80	77.75	593	47,914.40	46,105.75	-
603373	安邦护卫	2023年12月13日	6个月以上	限售股	19.10	34.75	88	1,680.80	3,058.00	-
688548	广钢气体	2023年8月8日	6个月以上	限售股	9.87	12.75	4,048	39,953.76	51,612.00	-
688549	中巨芯	2023年8月30日	6个月以上	限售股	5.18	8.09	4,294	22,242.92	34,738.46	-
688563	航材股份	2023年7月12日	6个月以上	限售股	78.99	60.49	1,501	118,563.99	90,795.49	-
688573	信	2023	6个月	限售	23.68	28.80	285	6,748.80	8,208.00	-

	宇人	年8月9日	以上	股						
688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月以上	限售股	26.74	38.67	648	17,327.52	25,058.16	-
688591	泰凌微	2023年8月18日	6个月以上	限售股	24.98	28.02	681	17,011.38	19,081.62	-
688602	康鹏科技	2023年7月13日	6个月以上	限售股	8.66	11.06	1,066	9,231.56	11,789.96	-
688603	天承科技	2023年6月30日	6个月以上	限售股	55.00	74.14	140	7,700.00	10,379.60	-
688612	威迈斯	2023年7月19日	6个月以上	限售股	47.29	37.97	422	19,956.38	16,023.34	-
688638	誉辰智能	2023年7月4日	6个月以上	限售股	83.90	59.68	141	11,829.90	8,414.88	-
688646	逸飞激光	2023年7月21日	6个月以上	限售股	46.80	36.07	219	10,249.20	7,899.33	-
688648	中邮科技	2023年11月6日	6个月以上	限售股	15.18	21.43	303	4,599.54	6,493.29	-
688651	盛邦安全	2023年7月19日	6个月以上	限售股	39.90	46.05	178	7,102.20	8,196.90	-
688652	京仪装备	2023年11月22日	6个月以上	限售股	31.95	52.25	416	13,291.20	21,736.00	-
688653	康	2023	6个月	限售	10.50	15.99	648	6,804.00	10,361.52	-

	希通信	年 11 月 10 日	以上	股						
688657	浩辰软件	2023 年 9 月 25 日	6 个月以上	限售股	103.40	78.23	101	10,443.40	7,901.23	-
688693	锆威特	2023 年 8 月 10 日	6 个月以上	限售股	40.83	43.41	178	7,267.74	7,726.98	-
688702	盛科通信	2023 年 9 月 6 日	6 个月以上	限售股	42.66	48.18	549	23,420.34	26,450.82	-
688716	中研股份	2023 年 9 月 13 日	6 个月以上	限售股	29.66	36.39	267	7,919.22	9,716.13	-
688719	爱科赛博	2023 年 9 月 20 日	6 个月以上	限售股	69.98	60.10	194	13,576.12	11,659.40	-
688720	艾森股份	2023 年 11 月 29 日	6 个月以上	限售股	28.03	49.84	165	4,624.95	8,223.60	-
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
123236	家联转债	2023 年 12 月 22 日	1 个月内（含）	老股东配债	100.00	100.00	19	1,900.00	1,900.08	-

注：1、基金可作为特定投资者，参与上市公司非公开发行股份认购，交易所主板、创业板、科创板新股申购，通过大宗交易或其他符合法律法规的交易方式取得带限售期的股票等业务，并根据各项法律法规的要求进行锁定。

2、受限期指自该证券实际取得之日起的流通受限期限。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

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

7.4.13.2 信用风险

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

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

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.3 流动性风险

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人在基金合同中约定了巨额赎回条款，设计了非常情况下赎回资金的处理模式，控制因开放模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

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

截止本报告期末及上年度末，本基金无重大流动性风险。

7.4.13.4 市场风险

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风

险。本基金持有的利率敏感性资产主要是银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资。基于本基金产品性质，生息资产占基金资产绝对比重较小，因此本基金并不存在重大的利率风险。本基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，通过对短期利率水平的预测、收益率曲线分析、利率重定价日组合及类别品种配置、调整投资组合的久期、凸性等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	297,389,054.20	-	-	-	297,389,054.20
结算备付金	14,491,041.15	-	-	-	14,491,041.15
存出保证金	2,049,558.13	-	-	-	2,049,558.13
交易性金融资产	303,543,234.97	2,150.77	1,900.08	4,933,219,389.81	5,236,766,675.63
应收申购款	17,295.22	-	-	1,042,030.46	1,059,325.68
应收清算款	-	-	-	8,540,109.31	8,540,109.31
资产总计	617,490,183.67	2,150.77	1,900.08	4,942,801,529.58	5,560,295,764.10
负债					
应付赎回款	-	-	-	5,662,049.04	5,662,049.04
应付管理人报酬	-	-	-	5,669,855.99	5,669,855.99
应付托管费	-	-	-	944,976.01	944,976.01
应付清算款	-	-	-	8,626,339.79	8,626,339.79
应交税费	-	-	-	0.04	0.04
其他负债	-	-	-	7,645,986.61	7,645,986.61
负债总计	-	-	-	28,549,207.48	28,549,207.48
利率敏感度缺口	617,490,183.67	2,150.77	1,900.08	4,914,252,322.10	5,531,746,556.62
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					
货币资金	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

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 5.49% (2022 年 12 月 31 日：5.52%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2022 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 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	4,933,219,389.81	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	4,050.85	0.00	2,000.22	0.00

交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	4,933,223,440.66	89.18	5,516,746,080.90	79.45

注：债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 除本基金业绩比较标准外的其他市场变量保持不变。		
	2. 观察有效期设定为一年期间。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年12月31日）	上年度末（2022年12月31日）
	1. 业绩比较基准上升5%	337,440,206.10	437,436,828.20
	2. 业绩比较基准下降5%	-337,440,206.10	-437,436,828.20

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	4,932,134,521.05	5,340,456,933.03

第二层次	303,604,395.37	383,457,597.87
第三层次	1,027,759.21	175,901,284.25
合计	5,236,766,675.63	5,899,815,815.15

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	175,901,284.25	175,901,284.25
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	3,163,886.96	3,163,886.96
转出第三层次	-	181,049,410.91	181,049,410.91
当期利得或损失总额	-	3,011,998.91	3,011,998.91
其中：计入损益的利得或损失	-	3,011,998.91	3,011,998.91
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,027,759.21	1,027,759.21
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	75,201.50	75,201.50
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计

	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,225,006,208.70	1,225,006,208.70
转出第三层次	-	566,560,697.70	566,560,697.70
当期利得或损失总额	-	-482,544,226.75	-482,544,226.75
其中：计入损益的利得或损失	-	-482,544,226.75	-482,544,226.75
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	175,901,284.25	175,901,284.25
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-28,372,523.68	-28,372,523.68

注：于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于 2023 年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	1,027,759.21	平均价格亚式期权模型	股票在剩余限售期内的股价的预期年化波动率	14.62%~219.88%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	175,901,284.25	平均价格亚式期权模型	股票在剩余限售期内的股价的预期年化波动率	21.27%~247.56%	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2022 年 12 月 31 日：同)。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括货币资金、买入返售金融资产、应收款项、卖出回购金融资产款和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告**8.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	4,933,219,389.81	88.72
	其中：股票	4,933,219,389.81	88.72
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	303,547,285.82	5.46
	其中：债券	303,547,285.82	5.46
	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	311,880,095.35	5.61
8	其他各项资产	11,648,993.12	0.21
9	合计	5,560,295,764.10	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合**8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合**

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	222,759,092.00	4.03
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,897,276,579.14	70.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-

E	建筑业	11,890.32	0.00
F	批发和零售业	36,490.19	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	14,499.81	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	193,857,695.76	3.50
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	20,093,846.00	0.36
M	科学研究和技术服务业	282,035,593.00	5.10
N	水利、环境和公共设施管理业	803,053.29	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	316,330,393.68	5.72
R	文化、体育和娱乐业	256.62	0.00
S	综合	-	-
	合计	4,933,219,389.81	89.18

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	203,223	350,762,898.00	6.34
2	300760	迈瑞医疗	1,096,400	318,613,840.00	5.76
3	603882	金域医学	5,055,624	316,330,393.68	5.72
4	600809	山西汾酒	1,278,940	295,089,826.20	5.33
5	000568	泸州老窖	1,631,125	292,656,447.50	5.29
6	603259	药明康德	3,875,795	282,002,844.20	5.10
7	002475	立讯精密	7,225,041	248,902,662.45	4.50
8	002714	牧原股份	5,409,400	222,759,092.00	4.03
9	600522	中天科技	13,301,800	166,139,482.00	3.00
10	600079	人福医药	6,591,637	163,868,095.82	2.96
11	600276	恒瑞医药	3,575,766	161,731,896.18	2.92
12	603501	韦尔股份	1,466,782	156,520,307.22	2.83
13	002353	杰瑞股份	5,105,600	143,518,416.00	2.59
14	603816	顾家家居	3,907,690	136,769,150.00	2.47
15	002517	恺英网络	11,097,901	123,963,554.17	2.24
16	601233	桐昆股份	7,759,657	117,403,610.41	2.12
17	300782	卓胜微	811,774	114,460,134.00	2.07
18	002422	科伦药业	3,878,401	112,667,549.05	2.04

19	002463	沪电股份	4,023,150	88,992,078.00	1.61
20	601126	四方股份	6,191,900	87,677,304.00	1.58
21	300750	宁德时代	508,830	83,071,585.80	1.50
22	300679	电连技术	1,919,955	79,678,132.50	1.44
23	000596	古井贡酒	321,100	74,752,080.00	1.35
24	688518	联赢激光	3,225,111	66,050,273.28	1.19
25	603345	安井食品	593,073	62,041,366.53	1.12
26	600993	马应龙	2,540,772	61,435,866.96	1.11
27	002304	洋河股份	552,298	60,697,550.20	1.10
28	002446	盛路通信	6,898,027	57,253,624.10	1.04
29	600298	安琪酵母	1,566,600	55,112,988.00	1.00
30	000768	中航西飞	2,459,100	55,010,067.00	0.99
31	600309	万华化学	532,400	40,898,968.00	0.74
32	002241	歌尔股份	1,888,957	39,686,986.57	0.72
33	002555	三七互娱	1,974,040	37,131,692.40	0.67
34	300604	长川科技	941,200	35,756,188.00	0.65
35	300115	长盈精密	2,691,100	35,657,075.00	0.64
36	002987	京北方	1,761,028	32,719,900.24	0.59
37	000938	紫光股份	1,609,100	31,136,085.00	0.56
38	300979	华利集团	434,100	22,851,024.00	0.41
39	301035	润丰股份	324,300	22,701,000.00	0.41
40	000521	长虹美菱	3,746,700	21,093,921.00	0.38
41	002465	海格通信	1,639,100	21,062,435.00	0.38
42	300662	科锐国际	727,400	20,090,788.00	0.36
43	601208	东材科技	1,165,600	14,430,128.00	0.26
44	000888	峨眉山 A	88,800	792,984.00	0.01
45	688563	航材股份	1,501	90,795.49	0.00
46	688548	广钢气体	4,048	51,612.00	0.00
47	603296	华勤技术	593	46,105.75	0.00
48	301526	国际复材	9,723	43,267.35	0.00
49	688549	中巨芯	4,294	34,738.46	0.00
50	301291	明阳电气	1,206	34,202.16	0.00
51	301383	天键股份	493	32,045.00	0.00
52	688702	盛科通信	549	26,450.82	0.00
53	688582	芯动联科	648	25,058.16	0.00
54	301486	致尚科技	482	22,774.50	0.00
55	688652	京仪装备	416	21,736.00	0.00
56	301525	儒竞科技	266	21,668.36	0.00
57	301498	乖宝宠物	554	21,500.74	0.00
58	301371	敷尔佳	564	21,195.12	0.00
59	301558	三态股份	1,458	19,537.20	0.00
60	688591	泰凌微	681	19,081.62	0.00
61	301488	豪恩汽电	262	18,101.58	0.00

62	301468	博盈特焊	598	18,071.56	0.00
63	301381	赛维时代	571	16,952.99	0.00
64	301509	金凯生科	266	16,553.18	0.00
65	301362	民爆光电	420	16,178.40	0.00
66	688612	威迈斯	422	16,023.34	0.00
67	601096	宏盛华源	3,918	15,907.08	0.00
68	301393	昊帆生物	260	15,436.20	0.00
69	601083	锦江航运	1,263	13,981.41	0.00
70	301507	民生健康	851	13,488.35	0.00
71	301566	达利凯普	576	12,752.64	0.00
72	301456	盘古智能	407	12,368.73	0.00
73	603176	汇通集团	1,924	11,890.32	0.00
74	688602	康鹏科技	1,066	11,789.96	0.00
75	688719	爱科赛博	194	11,659.40	0.00
76	301550	斯菱股份	260	11,328.20	0.00
77	301508	中机认检	419	11,178.92	0.00
78	301251	威尔高	321	11,103.39	0.00
79	300395	菲利华	300	10,968.00	0.00
80	001219	青岛食品	460	10,603.00	0.00
81	688603	天承科技	140	10,379.60	0.00
82	688653	康希通信	648	10,361.52	0.00
83	301329	信音电子	458	10,181.34	0.00
84	603216	梦天家居	772	10,128.64	0.00
85	301372	科净源	231	10,069.29	0.00
86	301261	恒工精密	198	10,068.30	0.00
87	301202	朗威股份	306	9,730.80	0.00
88	688716	中研股份	267	9,716.13	0.00
89	301413	安培龙	164	9,543.16	0.00
90	301418	协昌科技	189	9,487.80	0.00
91	001296	长江材料	403	9,482.59	0.00
92	301516	中远通	604	9,368.04	0.00
93	301196	唯科科技	271	9,316.98	0.00
94	301111	粤万年青	379	9,308.24	0.00
95	301272	英华特	173	9,234.74	0.00
96	301469	恒达新材	275	9,099.75	0.00
97	301518	长华化学	385	8,858.85	0.00
98	603213	镇洋发展	799	8,621.21	0.00
99	603048	浙江黎明	464	8,616.48	0.00
100	301520	万邦医药	160	8,438.40	0.00
101	688638	誉辰智能	141	8,414.88	0.00
102	301459	丰茂股份	208	8,286.72	0.00
103	688720	艾森股份	165	8,223.60	0.00
104	688573	信宇人	285	8,208.00	0.00

105	301489	思泉新材	128	8,206.08	0.00
106	688651	盛邦安全	178	8,196.90	0.00
107	001234	泰慕士	333	8,145.18	0.00
108	301517	陕西华达	185	8,082.65	0.00
109	301193	家联科技	475	8,065.50	0.00
110	301578	辰奕智能	118	8,061.76	0.00
111	301548	崇德科技	136	8,022.64	0.00
112	688657	浩辰软件	101	7,901.23	0.00
113	688646	逸飞激光	219	7,899.33	0.00
114	688693	锆威特	178	7,726.98	0.00
115	301118	恒光股份	315	7,695.45	0.00
116	603275	众辰科技	193	7,662.10	0.00
117	301021	英诺激光	290	7,629.90	0.00
118	605033	美邦股份	423	7,592.85	0.00
119	301533	威马农机	225	7,461.00	0.00
120	301083	百胜智能	416	7,429.76	0.00
121	603150	万朗磁塑	251	7,291.55	0.00
122	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
123	301505	苏州规划	194	6,947.14	0.00
124	301529	福赛科技	182	6,894.16	0.00
125	301515	港通医疗	230	6,502.10	0.00
126	688648	中邮科技	303	6,493.29	0.00
127	001378	德冠新材	205	6,410.35	0.00
128	301228	实朴检测	373	6,184.34	0.00
129	603004	鼎龙科技	195	6,082.05	0.00
130	603270	金帝股份	195	5,768.10	0.00
131	603119	浙江荣泰	226	5,394.62	0.00
132	002493	荣盛石化	500	5,175.00	0.00
133	603193	润本股份	303	5,047.98	0.00
134	001306	夏厦精密	64	4,823.04	0.00
135	001326	联域股份	99	4,815.36	0.00
136	603075	热威股份	182	4,242.42	0.00
137	001358	兴欣新材	87	3,841.92	0.00
138	001239	永达股份	189	3,764.88	0.00
139	603231	索宝蛋白	161	3,466.33	0.00
140	603273	天元智能	178	3,376.66	0.00
141	603276	恒兴新材	134	3,333.92	0.00
142	600779	水井坊	53	3,114.81	0.00
143	603373	安邦护卫	88	3,058.00	0.00
144	600029	南方航空	90	518.40	0.00
145	300144	宋城演艺	26	256.62	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000568	泸州老窖	848,478,852.32	12.22
2	002475	立讯精密	543,186,083.03	7.82
3	600809	山西汾酒	518,843,680.98	7.47
4	002555	三七互娱	463,098,525.74	6.67
5	600522	中天科技	382,051,091.30	5.50
6	300760	迈瑞医疗	364,387,259.44	5.25
7	600276	恒瑞医药	359,874,823.93	5.18
8	300750	宁德时代	358,659,634.94	5.17
9	002049	紫光国微	328,213,929.79	4.73
10	002371	北方华创	298,333,570.68	4.30
11	000063	中兴通讯	283,998,224.78	4.09
12	688111	金山办公	282,646,753.23	4.07
13	300782	卓胜微	278,922,297.96	4.02
14	603259	药明康德	276,948,832.96	3.99
15	000858	五粮液	258,468,753.22	3.72
16	000333	美的集团	257,877,428.56	3.71
17	002368	太极股份	253,505,458.66	3.65
18	002304	洋河股份	246,535,861.71	3.55
19	000596	古井贡酒	242,244,899.86	3.49
20	300413	芒果超媒	230,249,646.40	3.32
21	688981	中芯国际	229,585,416.73	3.31
22	002714	牧原股份	215,981,644.21	3.11
23	600079	人福医药	208,080,155.50	3.00
24	603444	吉比特	190,571,232.50	2.74
25	601138	工业富联	190,303,974.14	2.74
26	000963	华东医药	188,798,259.49	2.72
27	300274	阳光电源	183,648,995.74	2.64
28	002230	科大讯飞	176,966,829.70	2.55
29	600690	海尔智家	171,320,201.01	2.47
30	601233	桐昆股份	171,206,888.67	2.47
31	600941	中国移动	170,516,688.35	2.46
32	000938	紫光股份	167,365,035.26	2.41
33	603501	韦尔股份	165,234,547.24	2.38
34	002353	杰瑞股份	164,446,800.89	2.37
35	300059	东方财富	161,687,843.35	2.33
36	603816	顾家家居	161,154,812.68	2.32
37	600489	中金黄金	156,152,469.57	2.25
38	300308	中际旭创	154,663,963.16	2.23

39	600970	中材国际	149,928,124.23	2.16
40	002517	恺英网络	146,957,254.85	2.12
41	002422	科伦药业	143,238,161.26	2.06
42	300347	泰格医药	139,968,218.44	2.02

注：“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	795,641,253.04	11.46
2	002304	洋河股份	656,407,923.59	9.45
3	600570	恒生电子	535,689,457.23	7.71
4	002555	三七互娱	434,448,565.50	6.26
5	000568	泸州老窖	427,247,403.21	6.15
6	600519	贵州茅台	423,711,157.58	6.10
7	300347	泰格医药	402,528,214.95	5.80
8	603259	药明康德	365,541,010.56	5.26
9	002049	紫光国微	353,534,829.17	5.09
10	002475	立讯精密	314,445,406.88	4.53
11	688111	金山办公	284,374,859.93	4.10
12	002371	北方华创	280,733,439.27	4.04
13	000063	中兴通讯	276,344,472.31	3.98
14	000858	五粮液	253,909,666.09	3.66
15	000333	美的集团	250,704,867.62	3.61
16	002352	顺丰控股	225,367,850.18	3.25
17	002368	太极股份	211,371,936.46	3.04
18	688981	中芯国际	210,648,134.77	3.03
19	603882	金域医学	207,401,754.84	2.99
20	300413	芒果超媒	206,771,748.77	2.98
21	600522	中天科技	204,093,320.65	2.94
22	601138	工业富联	197,370,874.49	2.84
23	300782	卓胜微	194,231,325.48	2.80
24	300498	温氏股份	192,560,009.50	2.77
25	603444	吉比特	190,638,233.52	2.75
26	600276	恒瑞医药	187,777,946.85	2.70
27	600809	山西汾酒	186,481,997.88	2.69
28	300274	阳光电源	183,404,162.00	2.64
29	000963	华东医药	182,522,898.96	2.63
30	002230	科大讯飞	182,334,596.85	2.63
31	600309	万华化学	178,495,258.73	2.57
32	600970	中材国际	175,984,303.38	2.53

33	600941	中国移动	173,840,929.62	2.50
34	300308	中际旭创	165,516,489.55	2.38
35	000596	古井贡酒	164,428,976.77	2.37
36	600489	中金黄金	162,862,601.56	2.35
37	600690	海尔智家	151,302,882.19	2.18
38	300146	汤臣倍健	148,777,316.54	2.14
39	688066	航天宏图	143,049,133.31	2.06
40	002463	沪电股份	142,518,979.02	2.05
41	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。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	21,092,558,674.26
卖出股票收入（成交）总额	20,648,027,863.39

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	303,543,234.97	5.49
	其中：政策性金融债	303,543,234.97	5.49
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）	4,050.85	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	303,547,285.82	5.49

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	230206	23 国开 06	2,600,000	263,364,229.51	4.76
2	230306	23 进出 06	400,000	40,179,005.46	0.73
3	113665	汇通转债	20	2,150.77	0.00
4	123236	家联转债	19	1,900.08	0.00

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细
无。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
无。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
无。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策
无。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策
无。

8.11.2 本期国债期货投资评价
无。

8.12 投资组合报告附注

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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,049,558.13
2	应收清算款	8,540,109.31
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,059,325.68
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,648,993.12

8.12.4 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	2,150.77	0.00

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
352,687	20,070.67	415,688,079.59	5.87	6,662,977,781.33	94.13

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	3,312,003.87	0.05

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和相关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	50~100

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2005 年 9 月 29 日) 基金份额总额	4,874,882,643.01
本报告期期初基金份额总额	7,472,727,726.41
本报告期基金总申购份额	748,332,396.74
减：本报告期基金总赎回份额	1,142,394,262.23
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	7,078,665,860.92

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

- 1、基金管理人的重大人事变动：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。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

无。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金管理人及其高级管理人员本报告期内未受监管部门稽查或处罚。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国海证券	1	8,695,143,999.12	20.84	6,982,955.54	20.38	-
华泰证券	1	8,260,281,085.15	19.80	6,621,127.42	19.32	-

国信证券	1	3,525,953,423.25	8.45	2,799,555.36	8.17	-
招商证券	1	3,208,127,274.95	7.69	2,826,972.39	8.25	-
国金证券	2	3,155,361,672.68	7.56	2,536,091.61	7.40	-
兴业证券	1	2,784,978,424.96	6.68	2,214,775.25	6.46	-
申万宏源证券	3	2,394,401,992.65	5.74	1,967,680.54	5.74	-
天风证券	1	1,699,134,022.93	4.07	1,396,013.86	4.07	-
光大证券	2	1,571,590,852.81	3.77	1,451,427.59	4.24	-
安信证券	2	1,373,167,740.31	3.29	1,267,745.68	3.70	-
华创证券	1	1,299,696,009.28	3.12	1,099,398.51	3.21	-
国泰君安证券	1	1,022,965,142.53	2.45	885,286.01	2.58	-
中信证券	1	760,868,993.33	1.82	559,923.83	1.63	-
海通证券	1	733,984,376.52	1.76	529,428.92	1.55	-
中金公司	2	649,819,474.27	1.56	605,178.04	1.77	-
瑞银证券	1	378,590,067.12	0.91	332,604.05	0.97	-
东北证券	2	199,877,591.57	0.48	186,146.51	0.54	-
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	-	-	-	-	-
中银国际证券	1	-	-	-	-	-

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券	成交金额	占当期债券回购成交总	成交金额	占当期权证
		券				

		成交总额 的比例 (%)		额的比例 (%)		成交总额 的比例 (%)
国海证 券	1,694.18	33.92	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
国金证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源证券	3,300.00	66.08	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-
安信证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
国泰君 安证券	-	-	-	-	-	-
中信证 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。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德精选混合型证券投资基金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
9	交银施罗德基金管理有限公司关于增加博时财富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6月21日
10	交银施罗德基金管理有限公司关于直销平台基金投资顾问业务中交易	中国证监会规定媒体及公司网站	2023年7月7日

	本公司旗下基金免收相关费用的公告		
11	交银施罗德基金管理有限公司关于直销平台基金投资顾问业务中交易本公司旗下基金免收相关费用的提示性公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2023 年 7 月 8 日
12	交银施罗德基金管理有限公司关于调整旗下部分基金管理费率和或托管费率并修改基金合同等法律文件的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2023 年 7 月 8 日
13	交银施罗德精选混合型证券投资基金基金合同	中国证监会规定媒体及公司网站	2023 年 7 月 8 日
14	交银施罗德精选混合型证券投资基金托管协议	中国证监会规定媒体及公司网站	2023 年 7 月 8 日
15	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 2 号)	中国证监会规定媒体及公司网站	2023 年 7 月 11 日
16	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 2 号)	中国证监会规定媒体及公司网站	2023 年 7 月 11 日
17	交银施罗德精选混合型证券投资基金 2023 年第 2 季度报告	中国证监会规定媒体及公司网站	2023 年 7 月 20 日
18	交银施罗德基金管理有限公司关于增加南京证券股份有限公司为旗下基金的销售机构的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2023 年 8 月 14 日
19	交银施罗德精选混合型证券投资基金 2023 年中期报告	中国证监会规定媒体及公司网站	2023 年 8 月 30 日
20	交银施罗德基金管理有限公司关于终止凤凰金信(海口)基金销售有限公司办理相关销售业务的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2023 年 8 月 30 日
21	交银施罗德基金管理有限公司关于增加深圳前海微众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 9 月 8 日
22	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 3 号)	中国证监会规定媒体及公司网站	2023 年 10 月 13 日
23	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 3 号)	中国证监会规定媒体及公司网站	2023 年 10 月 13 日
24	交银施罗德精选混合型证券投资基金 2023 年第 3 季度报告	中国证监会规定媒体及公司网站	2023 年 10 月 24 日
25	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德资产管理(香港)有限公司解散的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2023 年 12 月 29 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

为更好地满足广大投资者的投资需求，降低投资者的投资成本，经与基金托管人协商一致，本基金管理人于 2023 年 7 月 10 日起调整部分基金的管理费率和/或托管费率，并对基金合同和其他法律文件作相应修改，欲知详情请查阅本基金管理人发布的最新法律文件。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

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

13.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

13.3 查阅方式

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

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