

交银施罗德全球精选价值证券投资基金 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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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 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
§ 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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介.....	10
4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	10
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.8 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.10 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.....	14
4.11 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.....	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	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.....	15
§ 7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表.....	17
7.2 利润表.....	18
7.3 净资产变动表.....	19
7.4 报表附注.....	21

§ 8 投资组合报告	47
8.1 期末基金资产组合情况.....	47
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	48
8.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	48
8.4 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.....	48
8.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	55
8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	58
8.7 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.....	58
8.8 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.....	58
8.9 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.....	58
8.10 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.....	58
8.11 投资组合报告附注.....	58
§ 9 基金份额持有人信息	59
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	59
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	59
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.....	59
§ 10 开放式基金份额变动	59
§ 11 重大事件揭示	60
11.1 基金份额持有人大会决议.....	60
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.....	60
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	60
11.4 基金投资策略的改变.....	60
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	60
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.....	60
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	60
11.8 其他重大事件.....	63
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	65
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.....	65
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	66
§ 13 备查文件目录	66
13.1 备查文件目录.....	66
13.2 存放地点.....	66
13.3 查阅方式.....	66

§ 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	33,841,052.06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	021-61055050
	电子邮箱	xxpl@jysld.com, disclosure@jysld.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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fund001.com
基金年度报告备置地点	基金管理人的办公场所

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 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	1,710,118.60	2,167,305.26	23,172,168.26
本期利润	4,968,339.25	-8,839,077.05	3,521,063.56
加权平均基金份额本期利润	0.1468	-0.2559	0.0748
本期加权平均净值利润率	6.52%	-11.91%	2.85%
本期基金份额净值增长率	6.84%	-10.47%	2.67%

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	43,380,355.21	38,423,423.02	54,104,822.39
期末可供分配基金份额利润	1.2819	1.1357	1.4704
期末基金资产净值	77,221,407.27	72,257,155.43	93,295,034.79
期末基金份额净值	2.282	2.136	2.535
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	253.91%	231.27%	270.01%

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

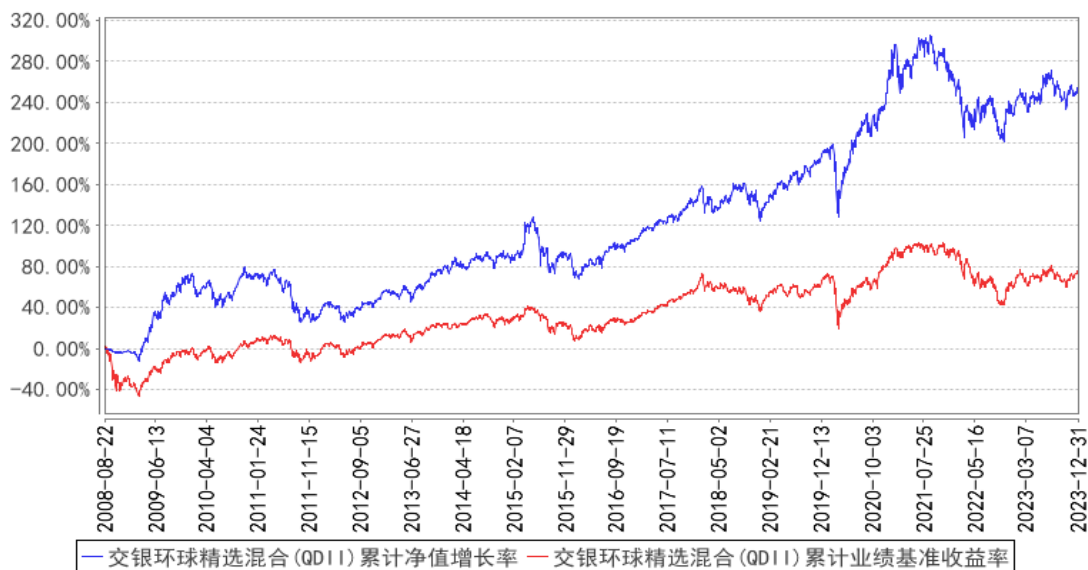
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.79%	0.61%	6.13%	0.68%	-3.34%	-0.07%
过去六个月	-2.65%	0.67%	1.65%	0.71%	-4.30%	-0.04%
过去一年	6.84%	0.75%	9.22%	0.73%	-2.38%	0.02%
过去三年	-1.80%	0.98%	-4.45%	0.89%	2.65%	0.09%
过去五年	51.85%	1.04%	25.14%	1.01%	26.71%	0.03%
自基金合同生效起至今	253.91%	0.97%	76.13%	1.06%	177.78%	-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

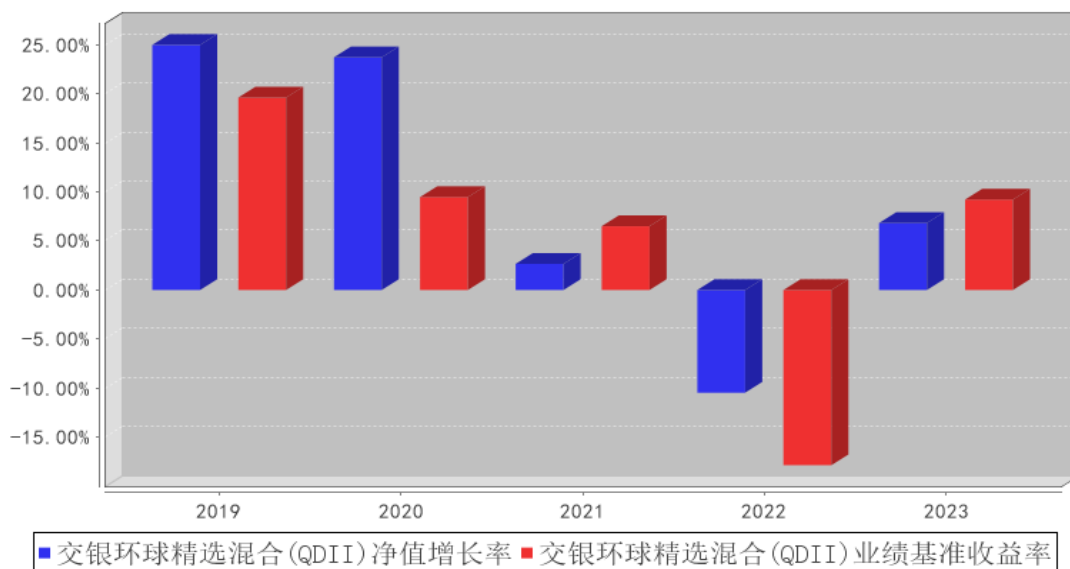
交银环球精选混合(QDII) 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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。

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

交银环球精选混合(QDII) 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	1.4800	1,899,955.95	3,152,293.70	5,052,249.65	-

2021 年	1.0300	1,681,303.82	3,139,248.12	4,820,551.94
合计	2.5100	3,581,259.77	6,291,541.82	9,872,801.59

§ 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		
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	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。

	资副总监				
周中	交银环球精选混合(QDII)、交银创新成长混合、交银启欣混合、交银启道混合、交银成长动力一年混合的基金经理	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。

4.4.2 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。

4.4.3 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。

4.5 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，欧美经济增长逐步走弱，体现在 PMI 数据长时间处于枯荣线以下，通胀持续下行、加息逐步停止，美国经济展现较强韧性，尽管美联储持续加息，部分银行破产倒闭，但居民和企业部门整体没有受到太多影响，经济活动继续扩张；国内方面，经济增长动能整体保持弱修复，A 股全年小幅下跌，港股表现弱于 A 股。

操作方面，本基金全年股票仓位维持高位运行，结构优化为主：欧美股方面，增加消费、AI 为主的科技板块仓位，降低医药板块等个股配置；港股方面，增加了科技互联网、能源板块仓位，降低消费、工业、地产板块等个股配置。

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

转入 2024 年，预计一季度成为业绩底，市场有望就此确立向上趋势，我们认为港股的表现或领先其他市场。随着考虑市值管理纳入中央企业负责人绩效考核，以及人民银行降存款准备金等政策推出，年初以来投资情绪有望得到有利扭转，市场进一步确认了央企价值重估。往后看，一季度业绩或将成为基本面底，市场风险偏好有望随之回升。我们认为现阶段守住筹码、逢低布局

将是最佳策略，港股弹性或大于 A 股，成长和利率敏感型行业或更受益，如医药、科技互联网与新能源等。

投资策略方面，保持顺周期+成长均衡配置，结构优化，同时关注高分红个股机会；中期继续关注科技互联、低碳环保、品质/健康消费等方向。

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。

4.8 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。

4.9 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。

4.10 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。

4.11 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 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	普华永道中天审字(2024)第 25346 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	交银施罗德环球精选价值证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了交银施罗德环球精选价值证券投资基金(以下简称“交银环球精选价值基金”)的财务报表,包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表,2023 年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</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在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了交银环球精选价值基金 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。</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。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> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于交银环球精选价值基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	交银环球精选价值基金的基金管理人交银施罗德基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会

	<p>计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，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环球精选价值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环球精选价值基金、终止运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环球精选价值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>（一）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>（二）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>（三）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（四）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，就可能导致对交银环球精选价值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环球精选价值基金不能持续经营。</p> <p>（五）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	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	沈兆杰	金诗涛
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼	
审计报告日期	2024 年 3 月 27 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：交银施罗德环球精选价值证券投资基金

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	6,419,830.18	5,419,616.44
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	70,231,733.87	67,070,372.17
其中：股票投资		70,231,733.87	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
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		888,992.11	-
应收股利		58,058.67	31,947.88
应收申购款		66,243.47	42,859.57
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		77,664,858.30	72,564,796.06
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		-	-
应付赎回款		183,288.85	55,069.67
应付管理人报酬		116,943.54	110,938.18
应付托管费		22,739.02	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	7.4.7.9	120,479.62	120,061.47
负债合计		443,451.03	307,640.63
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	33,841,052.06	33,833,732.41
未分配利润	7.4.7.12	43,380,355.21	38,423,423.02
净资产合计		77,221,407.27	72,257,155.43
负债和净资产总计		77,664,858.30	72,564,796.06

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.282 元，基金份额总额 33,841,052.06 份。

7.2 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 12 月 31 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 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		6,726,842.50	-7,116,727.61
1. 利息收入		25,739.56	13,925.54
其中：存款利息收入	7.4.7.13	25,739.56	13,925.54
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		3,458,610.85	3,505,744.24
其中：股票投资收益	7.4.7.14	1,876,127.41	1,571,058.30
基金投资收益	7.4.7.15	-	-
债券投资收益	7.4.7.16	-	-

资产支持证券投资收益	7.4.7.17	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.18	-	-
衍生工具收益	7.4.7.19	1,057.02	-
股利收益	7.4.7.20	1,581,426.42	1,934,685.94
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）	7.4.7.21	3,258,220.65	-11,006,382.31
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-23,256.12	362,418.54
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.22	7,527.56	7,566.38
减：二、营业总支出		1,758,503.25	1,722,349.44
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,370,396.49	1,339,657.24
2. 托管费	7.4.10.2.2	266,465.98	260,488.82
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	7.4.7.23	-	-
7. 税金及附加		3.84	-
8. 其他费用	7.4.7.24	121,636.94	122,203.38
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,968,339.25	-8,839,077.05
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,968,339.25	-8,839,077.05
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		4,968,339.25	-8,839,077.05

7.3 净资产变动表

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 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	33,833,732.41	-	38,423,423.02	72,257,155.43
二、本期期初净资产	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)	7,319.65	-	4,956,932.19	4,964,251.84
(一)、综合收益总额	-	-	4,968,339.25	4,968,339.25
(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)	7,319.65	-	-11,407.06	-4,087.41
其中：1. 基金申购款	5,095,993.20	-	6,417,297.37	11,513,290.57
2. 基金赎回款	-5,088,673.55	-	-6,428,704.43	-11,517,377.98
(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	33,841,052.06	-	43,380,355.21	77,221,407.27
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	36,796,793.43	-	56,498,241.36	93,295,034.79
二、本期期初净资产	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)	-2,963,061.02	-	-18,074,818.34	-21,037,879.36
(一)、综合收益总额	-	-	-8,839,077.05	-8,839,077.05
(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)	-2,963,061.02	-	-4,183,491.64	-7,146,552.66
其中：1. 基金申	5,494,939.41	-	6,590,169.52	12,085,108.93

购款				
2. 基金赎回款	-8,458,000.43	-	-10,773,661.16	-19,231,661.59
(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)	-	-	-5,052,249.65	-5,052,249.65
四、本期期末净资产	33,833,732.41	-	38,423,423.02	72,257,155.43

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&P Global Large Mid Cap Index)+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 2024 年 3 月 27 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《交银施罗德环球精选价值证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于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。本基金现无金融资产分类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。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即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。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资、基金投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债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。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

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

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于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；对于

应收款项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。

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损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然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的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资、基金投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最

近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，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) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

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募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣

代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率计算的利息后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

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。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

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

无

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[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。

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	6,419,830.18	5,419,616.44
等于：本金	6,419,593.75	5,419,431.27
加：应计利息	236.43	185.17
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	6,419,830.18	5,419,616.44

注：于 2023 年 12 月 31 日，活期存款中包括的外币余额为美元活期存款 469,373.01 元（折合人民币 3,324,428.22 元），港币活期存款 1,152,772.08 元（折合人民币 1,045,576.46 元），欧元活期存款 8.26 元（折合人民币 64.64 元），加币活期存款 0.01 元（折合人民币 0.05 元）和韩元活期存款 27.00 元（折合人民币 0.15 元）。于 2022 年 12 月 31 日，活期存款中包括的外币余额为美元活期存款 233,756.92 元（折合人民币 1,628,023.44 元），港币活期存款 2,192,627.21 元（折合人民币 1,956,796.66 元），加币活期存款 0.01 元（折合人民币 0.05 元）和韩元活期存款 27.00 元（折合人民币 0.15 元）。

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	56,766,648.34	-	70,231,733.87	13,465,085.53
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	56,766,648.34	-	70,231,733.87	13,465,085.53
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	56,863,507.29	-	67,070,372.17	10,206,864.88
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	56,863,507.29	-	67,070,372.17	10,206,864.88

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

无。

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	上年度末
----	-----	------

	2023 年 12 月 31 日	2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	479.62	61.47
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	40,000.00	40,000.00
预提信息披露费	80,000.00	80,000.00
合计	120,479.62	120,061.47

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	33,833,732.41	33,833,732.41
本期申购	5,095,993.20	5,095,993.20
本期赎回（以“-”号填列）	-5,088,673.55	-5,088,673.55
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	33,841,052.06	33,841,052.06

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	46,885,816.09	-8,462,393.07	38,423,423.02
本期期初	46,885,816.09	-8,462,393.07	38,423,423.02
本期利润	1,710,118.60	3,258,220.65	4,968,339.25
本期基金份额交易产生的变动数	495.41	-11,902.47	-11,407.06
其中：基金申购款	7,300,962.95	-883,665.58	6,417,297.37
基金赎回款	-7,300,467.54	871,763.11	-6,428,704.43
本期已分配利润	-	-	-

本期末	48,596,430.10	-5,216,074.89	43,380,355.21
-----	---------------	---------------	---------------

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	25,700.44	13,916.93
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	39.12	8.61
合计	25,739.56	13,925.54

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	1,876,127.41	1,571,058.30
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	1,876,127.41	1,571,058.30

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 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	58,781,890.29	56,100,954.17
减：卖出股票成本总额	56,690,649.92	54,277,662.66
减：交易费用	215,112.96	252,233.21
买卖股票差价收入	1,876,127.41	1,571,058.30

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

7.4.7.15 基金投资收益

无。

7.4.7.16 债券投资收益

7.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

无。

7.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

7.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.17 资产支持证券投资收益

7.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

7.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

7.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.18 贵金属投资收益

7.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.19 衍生工具收益

7.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
卖出权证成交总额	31,862.49	-
减：卖出权证成本总额	30,760.22	-
减：交易费用	13.15	-
减：买卖权证差价收入 应缴纳增值税额	32.10	-
买卖权证差价收入	1,057.02	-

7.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,581,426.42	1,934,685.94
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	1,581,426.42	1,934,685.94

7.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
1. 交易性金融资产	3,258,545.71	-11,006,382.31
股票投资	3,258,545.71	-11,006,382.31
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	0.00	-
合计	3,258,220.65	-11,006,382.31

7.4.7.22 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	7,465.06	7,566.38
其他	62.50	-
合计	7,527.56	7,566.38

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。

7.4.7.23 信用减值损失

无。

7.4.7.24 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	40,000.00	40,000.00
信息披露费	80,000.00	80,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	310.00	290.00
存托保管费	1,326.94	1,913.38
合计	121,636.94	122,203.38

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	基金管理人、基金销售机构

罗德基金公司”)	
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	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
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 基金交易

无。

7.4.10.1.5 权证交易

无。

7.4.10.1.6 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	1,370,396.49	1,339,657.24
其中：应支付销售机构的客户维护费	381,540.95	368,340.88
应支付基金管理人的净管理费	750,970.74	752,463.83
应支付投资顾问的投资顾问费	237,884.80	218,852.53

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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.80\% \div \text{当年天数}。$$

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	266,465.98	260,488.82

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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.35\% \div \text{当年天数}。$$

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自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 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	24.27%	24.27%

- 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。

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

无。

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
摩根大通银行_活期存款	4,369,966.93	15,479.78	3,584,720.39	2,534.59
中国建设银行_活期存款	2,049,863.25	10,220.66	1,834,896.05	11,382.34

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

无。

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。

7.4.13.2 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 12 月 31 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）。

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

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 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约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。

7.4.13.3.1 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发行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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

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	6,419,830.18	-	-	-	6,419,830.18
交易性金融资产	-	-	-	70,231,733.87	70,231,733.87
应收股利	-	-	-	58,058.67	58,058.67
应收申购款	227.70	-	-	66,015.77	66,243.47
应收清算款	-	-	-	888,992.11	888,992.11
资产总计	6,420,057.88	-	-	71,244,800.42	77,664,858.30
负债					
应付赎回款	-	-	-	183,288.85	183,288.85
应付管理人报酬	-	-	-	116,943.54	116,943.54
应付托管费	-	-	-	22,739.02	22,739.02
其他负债	-	-	-	120,479.62	120,479.62
负债总计	-	-	-	443,451.03	443,451.03
利率敏感度缺口	6,420,057.88	-	-	70,801,349.39	77,221,407.27
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	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。

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)。

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。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日			
	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				
货币资金	3,324,428 .22	1,045,576.46	64.84	4,370,069.52
交易性金融资 产	27,642,34 8.99	26,856,906.56	15,732,478.32	70,231,733.87
应收股利	40,025.69	172.33	17,860.65	58,058.67
应收清算款	-	888,992.11	-	888,992.11
资产合计	31,006,80 2.90	28,791,647.46	15,750,403.81	75,548,854.17
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	31,006,80 2.90	28,791,647.46	15,750,403.81	75,548,854.17
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	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				
货币资金	1,628,023	1,956,797.15	0.20	3,584,820.79

	. 44			
交易性金融资产	23, 118, 68 1. 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, 70 4. 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, 70 4. 69	33, 944, 161. 54	11, 984, 274. 61	70, 687, 140. 84

7. 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 12 月 31 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, 777, 442. 71	3, 534, 357. 04
	2. 所有外币相对人 民币贬值 5%	-3, 777, 442. 71	-3, 534, 357. 04

7. 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。

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	70,231,733.87	90.95	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	70,231,733.87	90.95	67,070,372.17	92.82

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)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 12 月 31 日)	上年度末(2022 年 12 月 31 日)
	1. 业绩比较基准上涨 5%	3,505,324.22	3,190,867.39
2. 业绩比较基准下降 5%	-3,505,324.22	-3,190,867.39	

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	70,231,733.87	67,070,372.17
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	70,231,733.87	67,070,372.17

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

无。

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
证券交易所上市但尚在限售期内的股票投资	-	-	-	-	-

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
证券交易所上市但尚在限售期内的股票投资	-	-	-	-	-

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	70,231,733.87	90.43
	其中：普通股	69,757,364.51	89.82
	存托凭证	474,369.36	0.61
	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	6,419,830.18	8.27
8	其他各项资产	1,013,294.25	1.30
9	合计	77,664,858.30	100.00

8.2 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（%）
美国	27,642,348.99	35.80
中国香港	26,856,906.56	34.78
日本	3,433,334.05	4.45
法国	3,070,194.61	3.98
瑞士	1,812,359.59	2.35
意大利	1,514,364.98	1.96
德国	1,337,353.16	1.73
英国	1,130,021.47	1.46
西班牙	1,043,369.86	1.35
韩国	1,009,793.97	1.31
荷兰	928,206.72	1.20
巴西	453,479.91	0.59
合计	70,231,733.87	90.95

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。

8.3 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	9,946,487.28	12.88
非必需消费品	13,391,509.48	17.34
必需消费品	3,002,477.61	3.89
能源	3,174,585.82	4.11
金融	5,026,260.97	6.51
医疗保健	7,998,864.15	10.36
工业	11,470,621.22	14.85
材料	1,287,029.84	1.67
房地产	1,402,782.54	1.82
科技	12,901,715.62	16.71
公用事业	629,399.34	0.82
合计	70,231,733.87	90.95

注：本报告采用彭博 BICS 一级分类标准编制。

8.4 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	公司名称	公司名	证券代	所在证	所属	数量	公允价值	占基
---	------	-----	-----	-----	----	----	------	----

号	(英文)	称(中文)	码	券市场	国家(地区)	(股)		金资产净值比例(%)
1	Sinotruk Hong Kong Ltd	中国重汽	3808 HK	香港联合交易所	中国香港	232,000	3,223,733.22	4.17
2	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股	700 HK	香港联合交易所	中国香港	10,600	2,822,761.99	3.66
3	Microsoft Corp	微软公司	MSFT US	美国证券交易所	美国	938	2,498,249.04	3.24
4	ANTA Sports Products Ltd	安踏体育	2020 HK	香港联合交易所	中国香港	35,200	2,418,452.96	3.13
5	Alphabet Inc	Alphabet 公司	GOOGL US	美国证券交易所	美国	2,207	2,183,566.88	2.83
6	China East Education Holdings Ltd	中国东方教育	667 HK	香港联合交易所	中国香港	797,000	1,937,338.28	2.51
7	AK Medical Holdings Ltd	爱康医疗	1789 HK	香港联合交易所	中国香港	294,000	1,669,298.52	2.16
8	COSCO SHIPPING Energy Transportation Co Ltd	中远海能	1138 HK	香港联合交易所	中国香港	242,000	1,617,689.62	2.09
9	Eli Lilly and Co	礼来	LLY US	美国证券交易所	美国	332	1,370,710.96	1.78
10	Cowell e Holdings Inc	高伟电子	1415 HK	香港联合交易所	中国香港	64,000	1,338,021.98	1.73
11	CNOOC Ltd	中国海洋石油	883 HK	香港联合交易所	中国香港	113,000	1,332,398.52	1.73

12	Apple Inc	苹果公司	AAPL US	美国证 券交易 所	美国	950	1,295,450.62	1.68
13	Visa Inc	维萨公 司	V US	美国证 券交易 所	美国	702	1,294,474.62	1.68
14	China Mobile Ltd	中国移 动	941 HK	香港联 合交易 所	中国 香港	21,500	1,263,647.11	1.64
15	TotalEne rgies SE	道达尔 集团	TTE FP	法国证 券交易 所	法国	2,567	1,237,396.11	1.60
16	Zhaojin Mining Industry Co Ltd	招金矿 业	1818 HK	香港联 合交易 所	中国 香港	138,000	1,215,376.01	1.57
17	Schneider Electric SE	施耐德 电气股 份公司	SU FP	法国证 券交易 所	法国	824	1,172,129.18	1.52
18	Amazon.co m Inc	亚马逊 公司	AMZN US	美国证 券交易 所	美国	1,078	1,160,084.78	1.50
19	Samsung Electroni cs Co Ltd	三星电 子有限 公司	005930 KS	韩国证 券交易 所	韩国	2,345	1,009,793.97	1.31
20	Adobe Inc	奥多比	ADBE US	美国证 券交易 所	美国	233	984,550.55	1.27
21	JPMorgan Chase & Co	摩根大 通	JPM US	美国证 券交易 所	美国	817	984,294.86	1.27
22	Keymed Bioscienc es Inc	康诺亚	2162 HK	香港联 合交易 所	中国 香港	22,000	979,752.81	1.27
23	Netflix Inc	奈飞公 司	NFLX US	美国证 券交易 所	美国	284	979,352.69	1.27
24	ASML Holding NV	阿斯麦 控股公 司	ASML NA	荷兰证 券交易 所	荷兰	174	928,206.72	1.20
25	NVIDIA Corp	英伟达	NVDA US	美国证 券交易 所	美国	260	911,948.62	1.18
26	China	华润万	1209	香港联	中国	36,000	909,368.79	1.18

	Resources Mixc Lifestyle Services Ltd	象生活	HK	合交易所	香港			
27	Booking Holdings Inc	Booking 控股股份有限公司	BKNG US	美国证券交易所	美国	36	904,460.22	1.17
28	Home Depot Inc/The	家得宝	HD US	美国证券交易所	美国	368	903,259.56	1.17
29	Parker-Hannifin Corp	派克汉尼汾	PH US	美国证券交易所	美国	275	897,324.97	1.16
30	Merck & Co Inc	默克	MRK US	美国证券交易所	美国	1,162	897,245.22	1.16
31	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	42,265	874,303.80	1.13
32	Topsports International Holdings Ltd	滔搏	6110 HK	香港联合交易所	中国香港	150,000	827,193.63	1.07
33	Zhejiang Leapmotor Technology Ltd	零跑汽车	9863 HK	香港联合交易所	中国香港	24,000	777,126.65	1.01
34	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	12,700	772,631.16	1.00
35	SMC Corp	日本 SMC 公司	6273 JP	日本东京证券交易所	日本	200	760,878.03	0.99
36	Arista Networks Inc	Arista 网络股份有限公司	ANET US	美国证券交易所	美国	455	758,961.24	0.98
37	Roche Holding	罗氏	ROG SW	瑞士证券交易所	瑞士	367	755,277.28	0.98

	AG			所				
38	Meta Platforms Inc	Meta 平台股份有限公司	META US	美国证券交易所	美国	301	754,604.74	0.98
39	Costco Wholesale Corp	开市客	COST US	美国证券交易所	美国	161	752,698.93	0.97
40	Siemens AG	西门子	SIE GR	德国证券交易所	德国	539	716,696.74	0.93
41	Chow Tai Fook Jewellery Group Ltd	周大福	1929 HK	香港联合交易所	中国香港	67,600	712,467.68	0.92
42	Bunzl PLC	本泽商贸有限公司	BNZL LN	英国伦敦证券交易所	英国	2,443	703,398.96	0.91
43	UnitedHealth Group Inc	联合健康	UNH US	美国证券交易所	美国	184	686,104.55	0.89
44	Cie Financiere Richemont SA	瑞士历峰集团	CFR SW	瑞士证券交易所	瑞士	684	666,405.53	0.86
45	Airbus SE	空中客车有限公司	AIR FP	法国证券交易所	法国	604	660,669.32	0.86
46	AMETEK Inc	阿美特克股份有限公司	AME US	美国证券交易所	美国	557	650,501.59	0.84
47	Bridgestone Corp	普利司通株式会社	5108 JP	日本东京证券交易所	日本	2,200	645,179.57	0.84
48	Ferrari NV	法拉利	RACE IM	意大利证券交易所	意大利	268	640,061.18	0.83
49	WuXi XDC Cayman Inc	药明合联股份有限公司	2268 HK	香港联合交易所	中国香港	22,000	638,535.44	0.83
50	KDDI Corp	KDDI	9433	日本东	日本	2,800	630,757.44	0.82

		有限公司	JP	京证券交易所				
51	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	6,776	629,399.34	0.82
52	Keyence Corp	株式会社 KEYENCE	6861 JP	日本东京证券交易所	日本	200	623,887.85	0.81
53	Bayerische Motoren Werke AG	宝马汽车股份公司	BMW GR	德国证券交易所	德国	787	620,656.42	0.80
54	Coterra Energy Inc	Coterra 能源股份有限公司	CTRA US	美国证券交易所	美国	3,346	604,791.19	0.78
55	PepsiCo Inc	百事可乐	PEP US	美国证券交易所	美国	471	566,578.04	0.73
56	Fair Isaac Corp	费埃哲公司	FICO US	美国证券交易所	美国	65	535,881.69	0.69
57	Las Vegas Sands Corp	拉斯维加斯金沙集团	LVS US	美国证券交易所	美国	1,528	532,568.61	0.69
58	Gushengtang Holdings Ltd	固生堂	2273 HK	香港联合交易所	中国香港	11,000	502,846.66	0.65
59	Charles Schwab Corp/The	嘉信理财	SCHW US	美国证券交易所	美国	1,031	502,395.74	0.65
60	Advanced Micro Devices Inc	AMD 公司	AMD US	美国证券交易所	美国	481	502,193.25	0.65
61	Hang Lung Properties Ltd	恒隆地产	101 HK	香港联合交易所	中国香港	50,000	493,413.75	0.64
62	American Express Co	美国运通	AXP US	美国证券交易所	美国	360	477,674.29	0.62
63	H World	华住集	1179	香港联	中国	20,000	476,180.55	0.62

	Group Ltd	团	HK	合交易所	香港			
64	Intel Corp	英特尔	INTC US	美国证券交易所	美国	1,337	475,845.89	0.62
65	HDFC Bank Ltd	HDFC 银行有限公司	HDB US	美国证券交易所	美国	998	474,369.36	0.61
66	Deere & Co	迪尔	DE US	美国证券交易所	美国	165	467,306.28	0.61
67	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	B3 股份公司	B3SA3 BZ	巴西证券交易所	巴西	21,351	453,479.91	0.59
68	Giant Biogene Holding Co ltd	巨子生物	2367 HK	香港联合交易所	中国香港	13,800	445,596.15	0.58
69	Danaher Corp	丹纳赫	DHR US	美国证券交易所	美国	268	439,121.17	0.57
70	Diageo PLC	帝亚吉欧	DGE LN	英国伦敦证券交易所	英国	1,655	426,622.51	0.55
71	Coca-Cola Co/The	可口可乐	KO US	美国证券交易所	美国	1,007	420,305.20	0.54
72	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	西班牙对外银行	BBVA SM	西班牙证券交易所	西班牙	6,431	413,970.52	0.54
73	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	911	407,336.21	0.53
74	Orient Overseas International Ltd	东方海外国际	316 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	395,456.61	0.51
75	Nestle SA	雀巢	NESN	瑞士证	瑞士	476	390,676.78	0.51

			SW	券交易所				
76	Oracle Corp	甲骨文	ORCL US	美国证券交易所	美国	493	368,137.43	0.48
77	Morimatsu International Holdings Co Ltd	森松国际	2155 HK	香港联合交易所	中国香港	57,000	284,347.81	0.37
78	Yum China Holdings Inc	百胜中国	9987 HK	香港联合交易所	中国香港	800	241,047.13	0.31
79	China Literature Ltd	阅文集团	772 HK	香港联合交易所	中国香港	4,000	105,394.63	0.14
80	China Taiping Insurance Holdings Co Ltd	中国太平	966 HK	香港联合交易所	中国香港	12,000	73,141.33	0.09
81	Global New Material International Holdings Ltd	环球新材国际	6616 HK	香港联合交易所	中国香港	20,000	71,653.83	0.09
82	EC Healthcare	医思健康	2138 HK	香港联合交易所	中国香港	38,000	59,971.54	0.08
83	JD.com Inc	京东集团	9618 HK	香港联合交易所	中国香港	242	24,693.36	0.03

8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

8.5.1 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	Tencent Holdings Ltd	700 HK	3,080,419.00	4.26
2	Sinotruk Hong Kong Ltd	3808 HK	2,442,281.20	3.38

3	China East Education Holdings Ltd	667 HK	2,357,593.56	3.26
4	CNOOC Ltd	883 HK	2,034,638.49	2.82
5	Keymed Biosciences Inc	2162 HK	1,949,459.63	2.70
6	ANTA Sports Products Ltd	2020 HK	1,858,833.18	2.57
7	AK Medical Holdings Ltd	1789 HK	1,818,853.17	2.52
8	Meituan	3690 HK	1,741,801.82	2.41
9	Hua Hong Semiconductor Ltd	1347 HK	1,521,049.75	2.11
10	CRRC Corp Ltd	1766 HK	1,460,861.79	2.02
11	Zhaojin Mining Industry Co Ltd	1818 HK	1,432,397.51	1.98
12	PetroChina Co Ltd	857 HK	1,280,418.83	1.77
13	ZTE Corp	763 HK	1,152,694.31	1.60
14	Beijing Tong Ren Tang Chinese Medicine Co Ltd	3613 HK	982,114.77	1.36
15	Cowell e Holdings Inc	1415 HK	976,024.24	1.35
16	Topsports International Holdings Ltd	6110 HK	895,763.03	1.24
17	NVIDIA Corp	NVDA US	883,360.76	1.22
18	Zhejiang Leapmotor Technology Ltd	9863 HK	866,969.84	1.20
19	Las Vegas Sands Corp	LVS US	806,102.75	1.12
20	Huaneng Power International Inc	902 HK	793,976.27	1.10

注：1、“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；

2、此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

8.5.2 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	BYD Co Ltd	1211 HK	3,798,532.18	5.26

2	Chow Tai Fook Jewellery Group Ltd	1929 HK	2,663,106.15	3.69
3	Tsingtao Brewery Co Ltd	168 HK	2,589,088.07	3.58
4	Wuxi Biologics Cayman Inc	2269 HK	2,524,228.08	3.49
5	Tencent Holdings Ltd	700 HK	2,313,032.37	3.20
6	China Overseas Land & Investme	688 HK	2,273,927.10	3.15
7	Meituan	3690 HK	2,060,329.62	2.85
8	Sinotruk Hong Kong Ltd	3808 HK	1,758,061.22	2.43
9	Keymed Biosciences Inc	2162 HK	1,392,384.04	1.93
10	Zhuzhou CRRC Times Electric Co Ltd	3898 HK	1,361,707.77	1.88
11	PetroChina Co Ltd	857 HK	1,333,260.83	1.85
12	New Oriental Education & Technology Group Inc	9901 HK	1,289,200.42	1.78
13	Hua Hong Semiconductor Ltd	1347 HK	1,200,416.81	1.66
14	Dongfang Electric Corp Ltd	1072 HK	1,139,452.96	1.58
15	CRRC Corp Ltd	1766 HK	1,037,908.50	1.44
16	Texas Instruments Inc	TXN US	1,005,623.31	1.39
17	Galaxy Entertainment Group Ltd	27 HK	960,383.17	1.33
18	ZTE Corp	763 HK	959,009.38	1.33
19	Beijing Tong Ren Tang Chinese Medicine Co Ltd	3613 HK	892,321.10	1.23
20	Yadea Group Holdings Ltd	1585 HK	891,061.70	1.23

注：1、“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；

2、此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

8.5.3 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	56,375,702.70
卖出收入（成交）总额	58,781,890.29

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。

8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

无。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 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出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形披露如下：

2023年7月7日，中国人民银行公示银罚决字（2023）34号行政处罚决定书，给予腾讯集团旗下的第三方支付平台财付通支付科技有限公司没收违法所得56612.38万元，罚款242677.82万元的行政处罚。

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

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

8.11.2 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。

8.11.3 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	888,992.11
3	应收股利	58,058.67
4	应收利息	-
5	应收申购款	66,243.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,013,294.25

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

8.11.6 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。

§ 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 (%)
6,091	5,555.91	8,383,511.51	24.77	25,457,540.55	75.23

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	7,464.96	0.02

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

无。

§ 10 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	5,095,993.20
减：本报告期基金总赎回份额	5,088,673.55
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	33,841,052.06

§ 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：本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门根据工作需要，任命牛环起、施伟为资产托管业务部副总经理。

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普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)，本期审计费为 40,000.00 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	

			(%)		(%)	
UOB Kay Hian Limited	-	78,607,378.82	68.26	94,328.90	95.80	-
Cowen and Company LLC	-	4,286,947.32	3.72	465.43	0.47	-
Goldman Sachs & Co. LLC New York	-	4,052,052.11	3.52	169.32	0.17	-
Virtu Americas LLC	-	3,939,353.67	3.42	246.99	0.25	-
BMO Capital Markets Corp.	-	3,447,953.29	2.99	446.78	0.45	-
RBC Capital Markets LLC NY	-	2,807,978.09	2.44	173.88	0.18	-
UBS AG	-	2,691,182.68	2.34	336.27	0.34	-
Jefferies LLC New York	-	2,599,164.21	2.26	118.59	0.12	-
Jefferies International Limited	-	2,379,762.90	2.07	297.49	0.30	-
Goldman Sachs International	-	1,985,580.17	1.72	269.72	0.27	-
Exane SA	-	1,957,482.13	1.7	244.75	0.25	-
Morgan	-	1,443,142.3	1.25	298.74	0.30	-

Stanley & Co. International PLC		7				
UBS Securities LLC Stamford	-	901,979.18	0.78	168.84	0.17	-
Instinet Europe Limited London	-	840,054.88	0.73	104.98	0.11	-
Citigroup Global Markets Limited	-	729,591.15	0.63	91.29	0.09	-
J.P. Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	-	521,617.04	0.45	116.24	0.12	-
BofA Securities Inc	-	419,284.52	0.36	53.72	0.05	-
BTIG LLC	-	299,867.95	0.26	299.86	0.30	-
Joh. Berenberg Gossler & Co. KG	-	298,867.16	0.26	37.26	0.04	-
UBS Securities Asia Limited	-	244,416.65	0.21	48.83	0.05	-
Liquidnet Inc	-	229,398.60	0.2	24.62	0.03	-
Merrill Lynch	-	197,533.51	0.17	39.45	0.04	-

International						
Luminex Trading & Analytics LLC	-	121,348.34	0.11	9.16	0.01	-
Credit Suisse Securities (USA) LLC New York	-	83,122.76	0.07	32.39	0.03	-
XP Investments US LLC	-	56,303.97	0.05	39.41	0.04	-
BNP Paribas	-	16,229.50	0.01	1.99	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。

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

无。

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	中国证监会规定媒体及公司网站	2023年1月12日

	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		
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
11	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
12	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公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2023 年 7 月 7 日
13	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	中国证监会规定媒体及公司网站	2023 年 7 月 8 日

	示性公告		
14	交银施罗德环球精选价值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 7 月 14 日
15	交银施罗德环球精选价值证券投资基金(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 7 月 14 日
16	交银施罗德环球精选价值证券投资基金 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
17	交银施罗德环球精选价值证券投资基金 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
18	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 8 月 31 日
19	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 10 月 23 日
20	交银施罗德环球精选价值证券投资基金 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
21	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 11 月 21 日
22	交银施罗德基金管理有限公司关于增加上海中欧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 11 月 23 日
23	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 12 月 21 日
24	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

投资者	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
-----	----------------	------------

类别	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	2023/1/1-2023/12/31	8,212,422.53	-	-	8,212,422.53	24.27
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。							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准交银施罗德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。