

# 交银施罗德安心收益债券型证券投资基金 2024 年年度报告

2024 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：中国民生银行股份有限公司

送出日期：2025 年 3 月 28 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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 3 月 26 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 2024 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	5
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况 .....	10
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	13
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 .....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	16
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 .....	17
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 .....	17
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	17
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 .....	17
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 .....	17
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>17</b>
6.1 审计报告基本信息 .....	17
6.2 审计报告的基本内容 .....	17
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>19</b>
7.1 资产负债表 .....	19
7.2 利润表 .....	21
7.3 净资产变动表 .....	22
7.4 报表附注 .....	24
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>53</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	53

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	53
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 .....	54
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	55
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	57
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 .....	57
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 .....	57
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 .....	57
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 .....	58
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	58
8.11 投资组合报告附注 .....	58
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>60</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	60
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	61
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 .....	61
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>61</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>62</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	62
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 .....	62
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	62
11.4 基金投资策略的改变 .....	62
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	62
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 .....	62
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	63
11.8 其他重大事件 .....	63
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>66</b>
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 .....	66
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	66
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>66</b>
13.1 备查文件目录 .....	66
13.2 存放地点 .....	67
13.3 查阅方式 .....	67

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	交银施罗德安心收益债券型证券投资基金	
基金简称	交银安心收益债券	
基金主代码	519753	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年6月2日	
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,346,323,940.69份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	交银安心收益债券 A	交银安心收益债券 E
下属分级基金的交易代码	519753	019268
报告期末下属分级基金的份额总额	1,321,835,051.05份	24,488,889.64份

注：本基金于 2018 年 6 月 2 日由交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金转型为交银施罗德安心收益债券型证券投资基金。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资风险和保持资产流动性的基础上，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势，将严谨、规范化的基本面研究分析与积极主动的投资风格相结合，在分析和判断宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上，动态调整债券、股票等大类资产比例。本基金以债券投资为核心，重点关注债券组合久期调整、期限结构配置及债券类属配置，并在严谨深入的信用分析基础上，综合考量信用债券的信用评级，以及各类债券的流动性、供求关系和收益率水平等，同时本基金也通过综合运用骑乘操作、套利操作等策略精选个券，提高投资组合收益。此外，在风险可控的前提下，本基金适度关注股票、权证市场的运行状况与相应风险收益特征，有效把握投资机会，适时增强组合收益。
业绩比较基准	中债综合全价指数
风险收益特征	本基金为债券型证券投资基金，其长期平均的预期收益和风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		交银施罗德基金管理有限公司	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责	姓名	王晚婷	林盛
	联系电话	(021) 61055050	010-58560666

人	电子邮箱	xxpl@jysld.com, disclosure@jysld.com	tgxxpl@cmbc.com.cn
客户服务电话		400-700-5000, 021-61055000	95568
传真		(021) 61055054	010-57093382
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）	北京市西城区复兴门内大街 2 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 2 号
邮政编码		200120	100031
法定代表人		张宏良	高迎欣

## 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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所 (特殊普通合伙)	中国上海南京西路 1266 号恒隆广场 2 期 25 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	2024 年		2023 年	2023 年 8 月 28 日 (基金合同生效日)- 2023 年 12 月 31 日	2022 年	
	交银安心 收益债券 A	交银安心 收益债券 E	交银安心 收益债券 A	交银安心 收益债券 E	交银安心 收益债券 A	交银安心 收益债券 E
本期已实现收益	60,079,730.29	152,811,400	12,828,843.84	0.74	2,043,818.73	-
本期利润	102,660,495.34	374,464,606	488,055.92	0.80	325,229.54	-
加权平均基金份额本期利润	0.0446	0.1378	-0.0003	0.0079	-0.0058	-

本期加权平均净值利润率	4.31%	10.89%	-0.03%	0.66%	-0.49%	-
本期基金份额净值增长率	5.55%	5.93%	1.35%	0.66%	0.05%	-
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
期末可供分配利润	20,037,333.01	6,024,418.82	53,742,034.98	20.97	10,372,638.87	-
期末可供分配基金份额利润	0.0152	0.2460	0.0131	0.2059	0.1858	-
期末基金资产净值	1,372,432,105.22	31,281,665.57	4,162,025,414.01	122.80	66,202,787.37	-
期末基金份额净值	1.0383	1.2774	1.0131	1.2059	1.1858	-
3.1.3 累计期末指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
基金份额累计净值增长率	24.72%	6.63%	18.17%	0.66%	16.60%	-

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

交银安心收益债券 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.61%	0.26%	2.23%	0.09%	0.38%	0.17%
过去六个月	2.21%	0.21%	2.50%	0.10%	-0.29%	0.11%
过去一年	5.55%	0.17%	4.98%	0.09%	0.57%	0.08%

过去三年	7.02%	0.20%	7.69%	0.06%	-0.67%	0.14%
过去五年	20.23%	0.22%	9.88%	0.07%	10.35%	0.15%
自基金合同生效起至今	24.72%	0.21%	14.61%	0.06%	10.11%	0.15%

交银安心收益债券 E

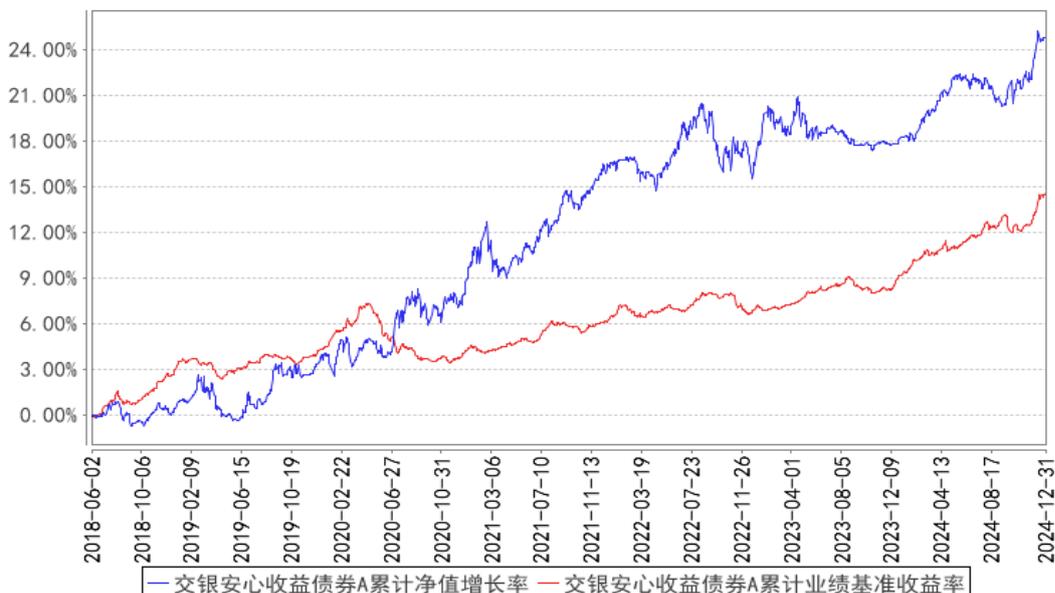
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.50%	0.26%	2.23%	0.09%	0.27%	0.17%
过去六个月	2.25%	0.21%	2.50%	0.10%	-0.25%	0.11%
过去一年	5.93%	0.17%	4.98%	0.09%	0.95%	0.08%
自基金合同生效起至今	6.63%	0.15%	5.15%	0.08%	1.48%	0.07%

注：1、交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金从 2018 年 6 月 2 日起正式转型为交银施罗德安心收益债券型证券投资基金，本表列示的是本报告期基金转型后的基金净值表现，转型后基金的业绩比较基准为中债综合全价指数。

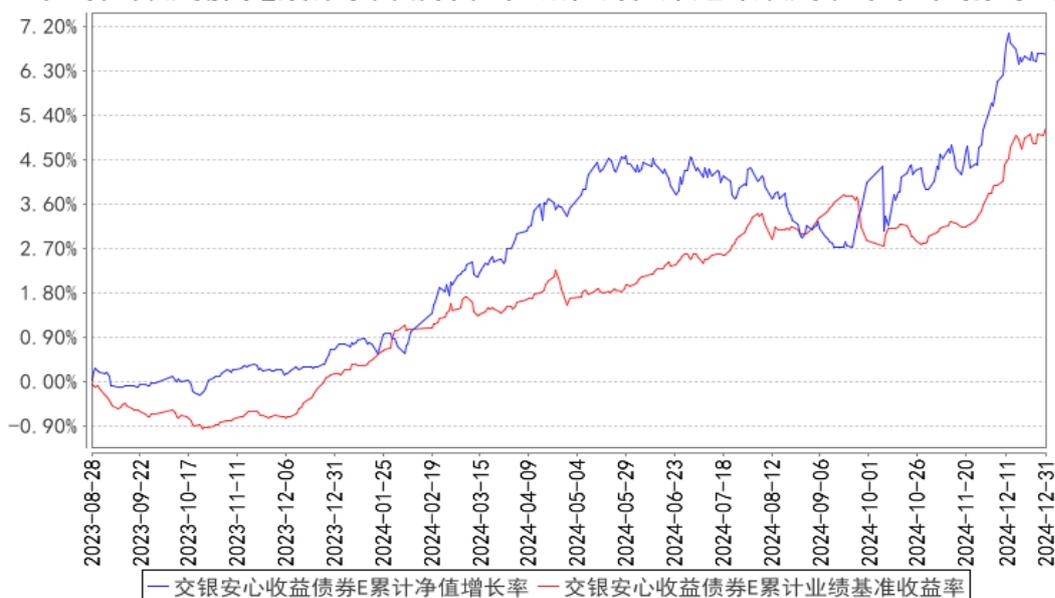
2、交银安心收益债券 E 上述“自基金合同生效起至今”实际为“自基金份额类别首次确认起至今”，下同。

### 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

交银安心收益债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



交银安心收益债券E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

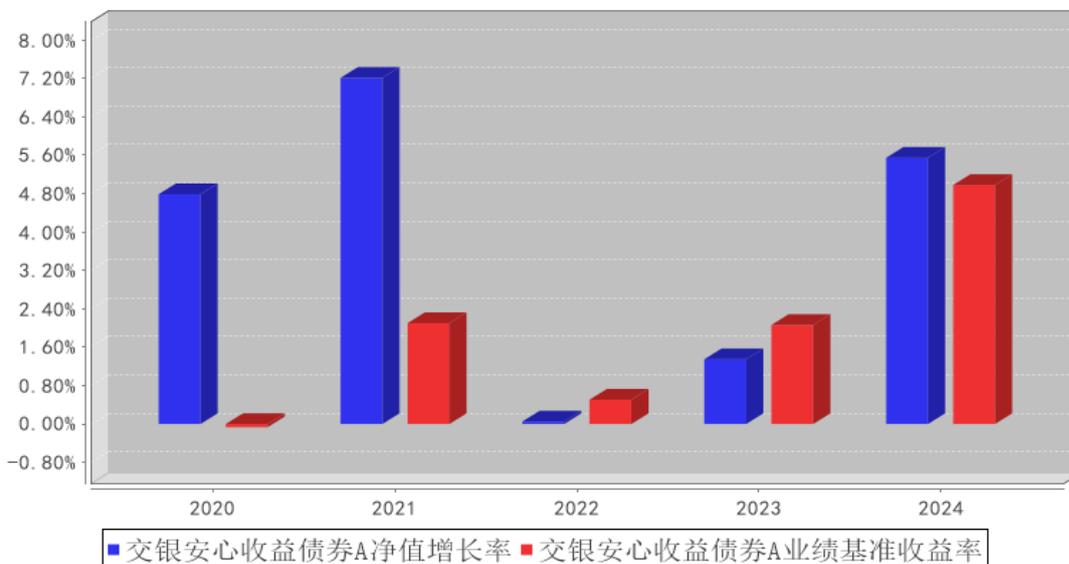


注：1、本基金由交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金转型而来。本基金转型日为 2018 年 6 月 2 日。本基金的投资转型期为交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金保本周期到期期间截止日的次日（即 2018 年 6 月 2 日）起的 3 个月。截至投资转型期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

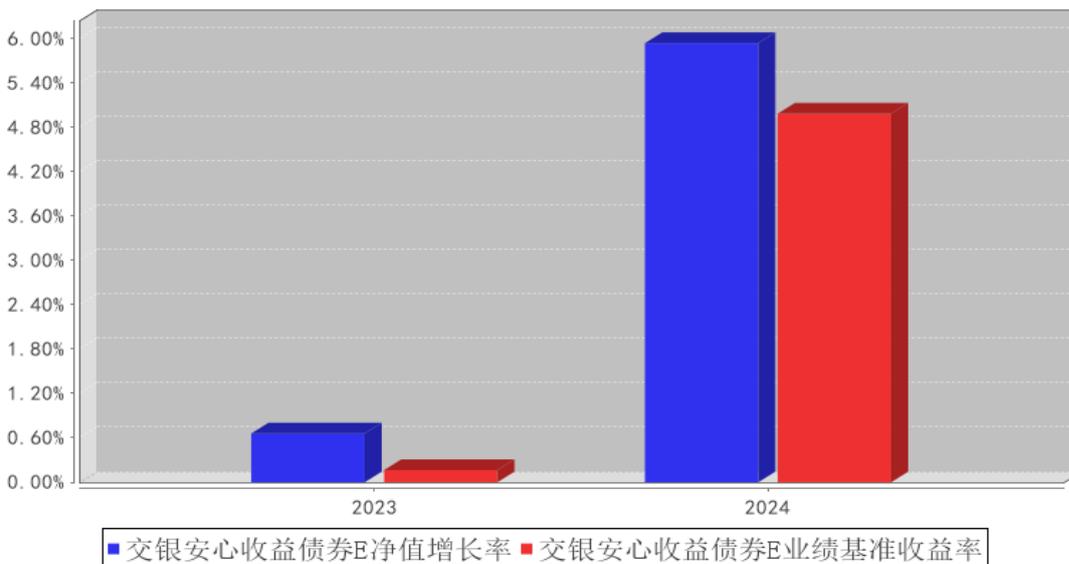
2、本基金自 2023 年 8 月 25 日起，开始销售 E 类份额，投资者提交的申购申请于 2023 年 8 月 28 日被确认并将有效份额登记在册。

### 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

交银安心收益债券A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



交银安心收益债券E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

交银安心收益债券 A

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
2024 年	0.3100	32,555,600.10	1,644,734.05	34,200,334.15	-
2023 年	1.8800	570,785,142.66	131,907,405.15	702,692,547.81	-
2022 年	-	-	-	-	-
合计	2.1900	603,340,742.76	133,552,130.20	736,892,872.96	-

		2.76	9.20	1.96	
交银安心收益债券 E					
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
2024 年	-	-	-	-	-
2023 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

## § 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 131 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		
魏玉敏	交银增利债券、交银纯债债券发起、交银增利增强债券、交银可转债债券、交银裕泰两年定期开放债券、交银安心收益债券、交银双利债券、交银强化回	2022 年 1 月 27 日	-	12 年	魏玉敏女士，厦门大学金融学硕士、学士。2012 年至 2013 年任招商证券固定收益研究员，2013 年至 2016 年任国信证券固定收益高级分析师。2016 年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任固定收益部基金经理助理、基金经理。2018 年 8 月 29 日至 2020 年 10 月 16 日担任交银施罗德丰晟收益债券型证券投资基金的基金经理。2018 年 11 月 2 日至 2021 年 12 月 16 日担任交银施罗德丰润收益债券型证券投资基金的基金经理。2019 年 1 月 23 日至 2021 年 12 月 16 日担任交银施罗德中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金的基金经理。2018 年 8 月 29 日至 2023 年 9 月 10 日担任交银施罗德裕如纯债债券型证券投资基金的基金经理。2021 年 4 月 29 日至 2024 年 5 月 21 日担任交银施

	报债券、 交银定期 支付月月 丰债券的 基金经理				罗德鑫选回报混合型证券投资基金的基金经理。
王丽婧	交银双利债券、交银增利增强债券、交银安心收益债券、交银可转债债券、交银强化回报债券、交银鸿福六个月混合的基金经理助理	2022年 09月22 日	-	7年	王丽婧女士，上海财经大学数量经济学硕士、学士。2017年至2018年任华商基金管理有限公司研究员。2018年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任固定收益部研究员、基金经理助理。
高王峰	交银增利债券、交银纯债债券发起、交银增利增强债券、交银丰晟收益债券、交银安心收益债券、交银双利债券、交银强化回报债券、交银裕通纯债债券、交银裕道纯债一年定期开放债券发起的基金经理助理	2024年5 月6日	-	5年	高王峰先生，上海财经大学经济统计学博士。2019年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任固定收益部研究员、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 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

回顾 2024 年，债券市场走牛，利率下行。年初，央行降准，债券需求旺盛，收益率下行。三月，两会后政府设定增长目标并发行特别国债，收益率下行放缓。四月、五月，监管提示风险，资金面收紧，债市调整。六月，央行坚持宽松政策，市场情绪好转。七月，超预期降息，债市走强，但机构卖出长期国债后降温。九月，经济放缓，宽松预期升温，收益率下行，但政治局会议后受股债跷板效应影响，债市调整。年末，政策定调宽松，机构抢跑行情，收益率创新低，监管提示风险后债市震荡。2024 年，权益市场宽幅震荡且风格分化明显。上半年，红利风格明显占优；下半年，市场预期有所扭转，成长与价值板块呈现出较为明显的轮动效应。全年来看，权益市场

的表现较为亮眼，银行、非银、通信、家电、电子以及汽车涨幅靠前，医药、农牧、美容、食品以及建材靠后。转债方面，上半年转债跟随权益同样呈现出结构性行情，红利属性的银行转债表现较为亮眼。年中，转债市场开始演绎信用风险，低价转债调整扩散。而在临近年末的权益市场超强反弹中，转债则迎来了正股和估值的双轮驱动，表现同样亮眼。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金（各类）份额净值及业绩表现请见“3.1 主要会计数据和财务指标”及“3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较”部分披露。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2025 年，宏观经济较为依赖逆周期政策的发力，政策侧重点将从扩投资向促消费倾斜。促消费政策可能会有所加码，消费品以旧换新政策有望扩容，预计将稳步推升社零增速中枢上移，后续我们将关注政府债提前批的发行节奏。结合扩大内需和财政政策加力的基调，基本面预计将呈现信用环境边际扩张、货币政策适度宽松、通胀温和企稳的格局。在适度宽松的货币政策环境下，债券市场预计呈现震荡偏强的格局，信用利差也存在继续压缩的可能性。权益方面，股票市场情绪大幅回暖，当前估值仍然处于相对合理的水平，在经济弱复苏且债券收益率处于低位的环境下，整体观点仍然维持相对偏积极。未来将重点关注价值和成长板块的结构性机会。转债市场伴随股票市场明显反弹，目前转债估值大幅修复后性价比略有降低，但仍存在部分标的结合正股基本面具有较高的赔率。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2024 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。

公司内控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

根据相关法律法规和基金合同要求，本基金本报告期内对可供分配利润进行了收益分配，具体情况参见 7.4.11 利润分配情况。

#### 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

本报告期内，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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

本报告期内，按照相关法律法规规定和基金合同、托管协议的有关约定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、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方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的约定进行。

#### 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

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确和完整。

### § 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	毕马威华振审字第 2507504 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	交银施罗德安心收益债券型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了后附的交银施罗德安心收益债券型证券投资基金(以下简称“该基金”) 财务报表, 包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表, 2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为, 后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计

	<p>处理规定》（以下合称“企业会计准则”）及财务报表附注 7.4.2 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”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了该基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 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，我们独立于该基金，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>
其他信息	<p>该基金管理人交银施罗德基金管理有限公司（以下简称“该基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金 2024 年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。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>该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，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导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，该基金管理人管理层负责评估该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，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。</p> <p>该基金管理人治理层负责监督该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</p>

	<p>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)评价该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>(4)对该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，就可能导致对该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该基金不能持续经营。</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>我们与该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	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	王国蓓 侯雯
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场东2座办公楼8层
审计报告日期	2025年3月26日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：交银施罗德安心收益债券型证券投资基金

报告截止日：2024年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	10,871,530.85	171,025,640.03
结算备付金		8,230,652.09	6,281,342.71
存出保证金		199,574.86	245,783.84
交易性金融资产	7.4.7.2	1,486,697,715.15	4,251,232,169.02
其中：股票投资		166,584,074.22	211,282,653.76
基金投资		-	-
债券投资		1,320,113,640.93	4,039,949,515.26
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	20,002,899.32	20,018,098.64
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		232,671,870.35	10,323.01
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		1,758,674,242.62	4,448,813,357.25
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年12月31日</b>	<b>上年度末 2023年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		349,094,535.19	280,205,589.34
应付清算款		4,352,843.23	-
应付赎回款		250,578.44	2,772,591.40
应付管理人报酬		711,703.94	2,515,300.90
应付托管费		203,343.98	718,657.40
应付销售服务费		8,159.71	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		89,203.65	267,154.42
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	250,103.69	308,526.98
负债合计		354,960,471.83	286,787,820.44
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	1,346,323,940.69	4,108,283,480.86
未分配利润	7.4.7.12	57,389,830.10	53,742,055.95
净资产合计		1,403,713,770.79	4,162,025,536.81
负债和净资产总计		1,758,674,242.62	4,448,813,357.25

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额总额 1,346,323,940.69 份，其中交银安心收益债券 A 基金份额总额 1,321,835,051.05 份，基金份额净值 1.0383 元；交银安心收益债券 E 基金份额总额 24,488,889.64 份，基金份额净值 1.2774 元。

## 7.2 利润表

会计主体：交银施罗德安心收益债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		134,012,320.20	15,708,857.14
1. 利息收入		972,057.29	1,677,815.38
其中：存款利息收入	7.4.7.13	730,486.47	295,007.05
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		241,570.82	1,382,808.33
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以 “-”填列）		89,452,016.46	27,169,169.69
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-13,478,253.21	-18,598,063.76
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	93,757,990.13	44,918,509.92
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	9,172,279.54	848,723.53
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	42,802,418.31	-13,316,899.70
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	785,828.14	178,771.77
<b>减：二、营业总支出</b>		30,977,360.20	16,196,912.26
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	16,760,759.89	11,931,887.02
2. 托管费	7.4.10.2.2	4,788,788.55	3,409,110.63
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	13,059.14	-
4. 投资顾问费		-	-

5. 利息支出		8,996,382.69	516,465.69
其中：卖出回购金融资产支出		8,996,382.69	516,465.69
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		188,460.01	116,286.02
8. 其他费用	7.4.7.23	229,909.92	223,162.90
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		103,034,960.00	-488,055.12
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		103,034,960.00	-488,055.12
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		103,034,960.00	-488,055.12

### 7.3 净资产变动表

会计主体：交银施罗德安心收益债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	4,108,283,480.86	-	53,742,055.95	4,162,025,536.81
二、本期期初净资产	4,108,283,480.86	-	53,742,055.95	4,162,025,536.81
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	2,761,959,540.17	-	3,647,774.15	2,758,311,766.02
（一）、综合收益总额	-	-	103,034,960.00	103,034,960.00
（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）	2,761,959,540.17	-	-65,186,851.70	2,827,146,391.87
其中：1. 基金申购款	979,577,352.54	-	54,271,411.99	1,033,848,764.53
2. 基金赎回	-	-	-	-

回款	3,741,536,892. 71		119,458,263.69	3,860,995,156.4 0
(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)	-	-	-34,200,334.15	-34,200,334.15
四、本期期末净资产	1,346,323,940. 69	-	57,389,830.10	1,403,713,770.7 9
项目	上年度可比期间 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	55,830,148.50	-	10,372,638.87	66,202,787.37
二、本期期初净资产	55,830,148.50	-	10,372,638.87	66,202,787.37
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	4,052,453,332. 36	-	43,369,417.08	4,095,822,749.4 4
(一)、综合收益总额	-	-	-488,055.12	-488,055.12
(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)	4,052,453,332. 36	-	746,550,020.01	4,799,003,352.3 7
其中：1. 基金申购款	4,715,431,458. 04	-	818,912,207.43	5,534,343,665.4 7
2. 基金赎回款	- 662,978,125.68	-	-72,362,187.42	-735,340,313.10
(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)	-	-	- 702,692,547.81	-702,692,547.81
四、本期期末净资产	4,108,283,480. 86	-	53,742,055.95	4,162,025,536.8 1

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>周云康</u>	<u>许颖</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

交银施罗德安心收益债券型证券投资基金是由原交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金(以下简称“交银施罗德荣和保本基金”)转型而来。交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金(以下简称“原基金”)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[2015]879 号文《关于准予交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金注册的批复》注册,由交银施罗德基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。原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 1,971,015,696.61 元。经向中国证监会备案,《交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 5 月 29 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,971,186,670.30 份基金份额,其中认购资金利息折合 170,973.69 份基金份额。

根据《交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金基金合同》的有关约定,本基金的保本周期为三年。交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金于 2019 年 5 月 29 日第一个保本周期到期,由于不符合保本基金存续条件,按照《交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金基金合同》的约定,该基金保本周期到期后转型为非保本的债券型基金,名称相应变更为“交银施罗德安心收益债券型证券投资基金”。交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金的第一个保本周期到期期间为保本周期到期日及之后 3 个工作日(含第 3 个工作日),即 2019 年 5 月 29 日至 2019 年 6 月 1 日。

根据《交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金保本周期到期安排及转型为交银施罗德安心收益债券型证券投资基金后运作相关业务规则的公告》,交银施罗德荣和保本基金保本周期到期因未能符合保本基金存续条件,自 2019 年 6 月 2 日起转型为交银施罗德安心收益债券型证券投资基金(以下简称“本基金”),并相应修改基金的投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等。原《交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金基金合同》失效,《交银施罗德安心收益债券型证券投资基金基金合同》于同日起生效,并已报中国证监会备案。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为交银施罗德基金管理有限公司(以下简称“交银施罗德基金公司”),基金托管人为中国民生银行股份有限公司(以下简称“民生银行”)。

根据《交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德安心收益债券型证券投资基金增加 E 类基金份额并修改基金合同和托管协议的公告》，本基金自 2023 年 8 月 15 日起增加收取销售服务费的 E 类份额，并对本基金的基金合同、托管协议作相应修改。在本基金增加收取销售服务费的 E 类份额后，原有的基金份额全部自动划归为本基金 A 类份额。对投资者申购时收取申购费用，赎回时收取赎回费用，且不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；对投资者申购时不收取申购费用，但在赎回时收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 E 类基金份额。本基金增加 E 类基金份额后，将分别设置对应的基金代码并分别计算基金份额净值。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额，但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德安心收益债券型投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行交易的国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、中期票据、可转换债券及可分离转债、次级债、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具等固定收益类品种，和股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证等权益类品种以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金的投资组合比例为：本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%；对股票、权证等权益类资产的投资比例不高于基金资产净值的 20%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为中债综合全价指数。

本财务报表由本基金的基金管理人交银施罗德基金公司于 2025 年 3 月 26 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〉》以及参考本基金的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”）发布的有关规定及其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于 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。

## 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) 金融资产的分类

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

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和金融负债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。由于基

金份额拆分/折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分/折算日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分/折算比例计算确认。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确认。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。

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(若有)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

在符合有关基金分红条件的前提下，基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%；基金收益分配方式分为

现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除权日的单位净值自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金份额持有人可对其持有的 A 类基金份额和 E 类基金份额分别选择不同的收益分配方式；基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的任一类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，E 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同；本基金同一基金份额类别的每一基金份额享有同等收益分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。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 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。

#### 7.4.4.13 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证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) 对于证券交易所上市的证券，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，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、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流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《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》之附件《证券投资基金投资流

通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”),按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 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。

##### 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[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、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》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《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[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《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号文《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号文《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》、财政部 税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延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》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 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，以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。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。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。

b) 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，暂不征收企业所得税。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

d) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

e) 对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

## 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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	10,871,530.85	20,950,640.03

等于：本金	10,868,387.17	20,943,022.85
加：应计利息	3,143.68	7,617.18
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	-	150,075,000.00
等于：本金	-	150,000,000.00
加：应计利息	-	75,000.00
减：坏账准备	-	-
合计	10,871,530.85	171,025,640.03

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	155,479,039.20	-	166,584,074.22	11,105,035.02	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	386,647,004.48	3,424,131.85	399,994,615.19	9,923,478.86
	银行间市场	899,356,011.63	13,125,025.74	920,119,025.74	7,637,988.37
	合计	1,286,003,016.11	16,549,157.59	1,320,113,640.93	17,561,467.23
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	1,441,482,055.31	16,549,157.59	1,486,697,715.15	28,666,502.25	
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	224,856,861.91	-	211,282,653.76	- 13,574,208.15	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	1,047,823,884.27	12,102,407.41	1,056,480,310.98	-3,445,980.70
	银行间	2,944,571,427.21	36,013,504.28	2,983,469,204.28	2,884,272.79

	市场				
	合计	3,992,395,311.48	48,115,911.69	4,039,949,515.26	-561,707.91
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		4,217,252,173.39	48,115,911.69	4,251,232,169.02	-
					14,135,916.06

#### 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 2024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	20,002,899.32	-
合计	20,002,899.32	-
项目	上年度末 2023年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	20,018,098.64	-
银行间市场	-	-
合计	20,018,098.64	-

##### 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 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	310.95	2,077.25
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	80,492.74	137,149.73
其中：交易所市场	53,266.23	119,349.77
银行间市场	27,226.51	17,799.96
应付利息	-	-
预提审计费	40,000.00	40,000.00
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	250,103.69	308,526.98

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

交银安心收益债券 A

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,108,283,379.03	4,108,283,379.03
本期申购	942,616,242.33	942,616,242.33

本期赎回(以“-”号填列)	-3,729,064,570.31	-3,729,064,570.31
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	1,321,835,051.05	1,321,835,051.05

交银安心收益债券 E

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	101.83	101.83
本期申购	36,961,110.21	36,961,110.21
本期赎回(以“-”号填列)	-12,472,322.40	-12,472,322.40
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	24,488,889.64	24,488,889.64

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

交银安心收益债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	64,506,832.45	-10,764,797.47	53,742,034.98
本期期初	64,506,832.45	-10,764,797.47	53,742,034.98
本期利润	60,079,730.29	42,580,765.05	102,660,495.34
本期基金份额交易产生的变动数	-70,348,895.58	-1,256,246.42	-71,605,142.00
其中：基金申购款	29,283,413.18	15,207,421.19	44,490,834.37
基金赎回款	-99,632,308.76	-16,463,667.61	-116,095,976.37
本期已分配利润	-34,200,334.15	-	-34,200,334.15
本期末	20,037,333.01	30,559,721.16	50,597,054.17

交银安心收益债券 E

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	21.19	-0.22	20.97
本期期初	21.19	-0.22	20.97
本期利润	152,811.40	221,653.26	374,464.66
本期基金份额交易产	5,871,586.23	546,704.07	6,418,290.30

生的变动数			
其中：基金申购款	8,898,264.14	882,313.48	9,780,577.62
基金赎回款	-3,026,677.91	-335,609.41	-3,362,287.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,024,418.82	768,357.11	6,792,775.93

#### 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
活期存款利息收入	125,182.65	155,731.56
定期存款利息收入	300,000.00	-
其他存款利息收入	-	75,000.00
结算备付金利息收入	295,981.98	52,370.74
其他	9,321.84	11,904.75
合计	730,486.47	295,007.05

#### 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 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-13,478,253.21	-18,598,063.76
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	-13,478,253.21	-18,598,063.76

##### 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 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
卖出股票成交总额	484,679,630.42	232,220,807.53
减：卖出股票成本总额	497,307,440.05	250,078,068.30

减：交易费用	850,443.58	740,802.99
买卖股票差价收入	-13,478,253.21	-18,598,063.76

#### 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 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月 31日
债券投资收益——利息收入	66,079,554.33	49,904,210.64
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	27,678,435.80	-4,985,700.72
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	93,757,990.13	44,918,509.92

##### 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 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月 31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	7,949,620,954.11	2,031,712,682.95
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	7,825,945,549.65	2,009,179,622.71
减：应计利息总额	95,864,200.79	27,455,748.46
减：交易费用	132,767.87	63,012.50
买卖债券差价收入	27,678,435.80	-4,985,700.72

##### 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 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12 月31日
股票投资产生的股利 收益	9,172,279.54	848,723.53
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	9,172,279.54	848,723.53

#### 7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年12月31日
1. 交易性金融资产	42,802,418.31	-13,316,899.70
股票投资	24,679,243.17	-13,175,774.55
债券投资	18,123,175.14	-141,125.15
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	42,802,418.31	-13,316,899.70

#### 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12 月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年12月31日
基金赎回费收入	785,828.14	178,771.77
合计	785,828.14	178,771.77

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 2024年1月1日至2024年12 月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31 日
审计费用	40,000.00	40,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-

银行费用	32,709.92	25,962.90
债券账户费用	37,200.00	37,200.00
合计	229,909.92	223,162.90

#### 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
中国民生银行股份有限公司（“民生银行”）	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	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	16,760,759.89	11,931,887.02
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,471,476.99	568,885.37
应支付基金管理人的净管理费	15,289,282.90	11,363,001.65

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.70%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.70%÷当年天数。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	4,788,788.55	3,409,110.63

注：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：

日托管费=前一日基金资产净值×0.20%÷当年天数。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2024年1月1日至2024年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	交银安心收益债券 A	交银安心收益债券 E	合计
交通银行股份有限公司	-	12,612.64	12,612.64
交银施罗德基金管理有 限公司	-	131.63	131.63
合计	-	12,744.27	12,744.27
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2023年1月1日至2023年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	交银安心收益债券 A	交银安心收益债券 E	合计

交银施罗德基金管理有 限公司	-	0.17	0.17
合计	-	0.17	0.17

注：支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日 E 类基金份额对应的基金资产净值 0.4% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

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

#### 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

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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
民生银行_活期 存款	10,871,530.85	125,182.65	20,950,640.03	155,731.56

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

单位：人民币元

交银安心收益债券 A								
序号	权益登记日	除息日		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	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2024 年 12 月 25 日	-	2024 年 12 月 25 日	0.310	32,555,600.10	1,644,734.05	34,200,334.15	-
合计	-	-	-	0.310	32,555,600.10	1,644,734.05	34,200,334.15	-

7.4.12 期末（2024 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

截至本报告期末 2024 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 200,085,179.44 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
102383412	23 甘国投 MTN003	2025 年 1 月 7 日	103.18	200,000	20,635,117.81
102480088	24 津城建 MTN003	2025 年 1 月 7 日	105.58	200,000	21,115,350.82
102480591	24 津城建 MTN010	2025 年 1 月 7 日	103.93	200,000	20,786,587.98
102481258	24 天津轨交 MTN003	2025 年 1 月 7 日	104.11	100,000	10,411,394.52
102482376	24 豫航空港 MTN011	2025 年 1 月 7 日	101.39	100,000	10,138,534.25
102483339	24 云能投 MTN017	2025 年 1 月 7 日	98.80	348,000	34,381,513.31
102483868	24 甘国投 MTN006	2025 年 1 月 7 日	101.94	300,000	30,580,980.82

232400013	24 渤海银行二级资本债 01	2025 年 1 月 7 日	103.11	319,000	32,892,757.71
242480005	24 杭州银行永续债 01	2025 年 1 月 7 日	103.17	380,000	39,204,610.41
合计				2,147,000	220,146,847.63

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 12 月 31 日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 149,009,355.75 元,于 2025 年 01 月 03 日(先后)到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

#### 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

本基金为债券型证券投资基金,其长期平均的预期收益和风险高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行交易的国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、中期票据、可转换债券及可分离转债、次级债、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具等固定收益类品种,和股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证等权益类品种以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是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“风险和收益高于货币市场基金而低于平衡型基金,谋求稳定和可持续的绝对收益”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，将风险控制可在可承受的范围内。

#### 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。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行或其他国内大中型商业银行，按银行同业利率计息，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	10,230,984.70
A-1 以下	-	-
未评级	53,620,877.26	620,350,738.76
合计	53,620,877.26	630,581,723.46

注：未评级部分包含国债、政策性金融债或短期融资券。

##### 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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末	上年度末
--------	-----	------

	2024 年 12 月 31 日	2023 年 12 月 31 日
AAA	329,749,295.21	1,648,441,108.01
AAA 以下	226,596,217.25	485,814,445.83
未评级	710,147,251.21	1,275,112,237.96
合计	1,266,492,763.67	3,409,367,791.80

注：未评级部分包含中期票据、公司债、国债或政策性金融债。

#### 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。

于报告期末，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

##### 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期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金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%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股股票不得超过该上

上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。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。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 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。

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

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 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	10,871,530.85	-	-	-	10,871,530.85
结算备付金	8,230,652.09	-	-	-	8,230,652.09
存出保证金	199,574.86	-	-	-	199,574.86
交易性金融资产	81,894,007.32	1,076,784,529.33	161,435,104.28	166,584,074.22	1,486,697,715.15
买入返售金融资产	20,002,899.32	-	-	-	20,002,899.32
应收申购款	-	-	-	232,671,870.35	232,671,870.35
资产总计	121,198,664.44	1,076,784,529.33	161,435,104.28	399,255,944.57	1,758,674,242.62
负债					
应付赎回款	-	-	-	250,578.44	250,578.44
应付管理人报酬	-	-	-	711,703.94	711,703.94
应付托管费	-	-	-	203,343.98	203,343.98
应付清算款	-	-	-	4,352,843.23	4,352,843.23
卖出回购金融资产款	349,094,535.19	-	-	-	349,094,535.19
应付销售服务费	-	-	-	8,159.71	8,159.71
应交税费	-	-	-	89,203.65	89,203.65
其他负债	-	-	-	250,103.69	250,103.69
负债总计	349,094,535.19	-	-	5,865,936.64	354,960,471.83
利率敏感度缺口	-227,895,870.75	-1,076,784,529.33	161,435,104.28	393,390,007.93	1,403,713,770.79
上年度末 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	171,025,640.03	-	-	-	171,025,640.03
结算备付金	6,281,342.71	-	-	-	6,281,342.71
存出保证金	245,783.84	-	-	-	245,783.84
交易性金融资产	1,648,544,302.84	1,895,163,280.75	496,241,931.67	211,282,653.76	4,251,232,169.02
买入返售金融资产	20,018,098.64	-	-	-	20,018,098.64
应收申购款	-	-	-	10,323.01	10,323.01
资产总计	1,846,115,168.06	1,895,163,280.75	496,241,931.67	211,292,976.77	4,448,813,357.25
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,772,591.40	2,772,591.40
应付管理人报酬	-	-	-	2,515,300.90	2,515,300.90
应付托管费	-	-	-	718,657.40	718,657.40
卖出回购金融资产款	280,205,589.34	-	-	-	280,205,589.34
应交税费	-	-	-	267,154.42	267,154.42
其他负债	-	-	-	308,526.98	308,526.98
负债总计	280,205,589.34	-	-	6,582,231.10	286,787,820.44

利率敏感度缺口	1,565,909,578.72	1,895,163,280.75	496,241,931.67	204,710,745.67	4,162,025,536.81
---------	------------------	------------------	----------------	----------------	------------------

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

假设	除市场利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（2024年12月31日）	上年度末（2023年12月31日）
	市场利率上升 25 个基点	-9,835,239.43	-12,698,509.02
市场利率下降 25 个基点	10,007,405.47	12,784,567.46	

#### 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或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中债券的比例不低于基金资产的 80%；对股票、权证等权益类资产的投资比例不高于基金资产净值的 20%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。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 2024年12月31日	上年度末 2023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	166,584,074.22	11.87	211,282,653.76	5.08
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	166,353,511.08	11.85	72,302,100.55	1.74
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	332,937,585.30	23.72	283,584,754.31	6.81

注：债券投资为可转换债券或可交换债券投资。

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	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(2024年12月31日)	上年度末(2023年12月31日)
	1. 业绩比较基准上涨 5%	10,572,033.62	-
2. 业绩比较基准下降 5%	-10,572,033.62	-	

注：本基金上年度末持有的交易性权益类、可转换债券及可交换债券投资比例较低，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	332,937,585.30	283,584,754.31
第二层次	1,153,760,129.85	3,967,647,414.71
第三层次	-	-
合计	1,486,697,715.15	4,251,232,169.02

### 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。对于公开市场交易的证券投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，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投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

### 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

无。

### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

### 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应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

## 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	166,584,074.22	9.47
	其中：股票	166,584,074.22	9.47
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,320,113,640.93	75.06
	其中：债券	1,320,113,640.93	75.06
	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	20,002,899.32	1.14
	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	19,102,182.94	1.09
8	其他各项资产	232,871,445.21	13.24
9	合计	1,758,674,242.62	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	-	-
B	采矿业	18,553,990.00	1.32
C	制造业	76,301,343.76	5.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	32,143,289.00	2.29
E	建筑业	7,044,842.00	0.50
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	9,787,709.20	0.70
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,149,019.00	0.15
J	金融业	10,289,465.40	0.73
K	房地产业	1,251,918.00	0.09
L	租赁和商务服务业	7,824,390.00	0.56
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,238,107.86	0.09

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	166,584,074.22	11.87

### 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	002027	分众传媒	1,113,000	7,824,390.00	0.56
2	601117	中国化学	849,800	7,044,842.00	0.50
3	600483	福能股份	705,300	7,031,841.00	0.50
4	603871	嘉友国际	349,192	6,756,865.20	0.48
5	600900	长江电力	217,600	6,430,080.00	0.46
6	300750	宁德时代	24,000	6,384,000.00	0.45
7	600938	中国海油	213,400	6,297,434.00	0.45
8	000543	皖能电力	736,100	5,822,551.00	0.41
9	600027	华电国际	999,700	5,608,317.00	0.40
10	001328	登康口腔	167,800	5,329,328.00	0.38
11	000400	许继电气	175,700	4,837,021.00	0.34
12	601838	成都银行	279,740	4,786,351.40	0.34
13	603707	健友股份	323,570	4,293,773.90	0.31
14	603529	爱玛科技	104,400	4,282,488.00	0.31
15	605166	聚合顺	355,900	4,260,123.00	0.30
16	600522	中天科技	284,000	4,066,880.00	0.29
17	601088	中国神华	87,700	3,813,196.00	0.27
18	300577	开润股份	135,000	3,354,750.00	0.24
19	601702	华峰铝业	175,200	3,209,664.00	0.23
20	600919	江苏银行	305,200	2,997,064.00	0.21
21	300207	欣旺达	126,900	2,831,139.00	0.20
22	000528	柳工	229,800	2,771,388.00	0.20
23	600011	华能国际	398,500	2,697,845.00	0.19
24	601899	紫金矿业	168,900	2,553,768.00	0.18
25	601615	明阳智能	201,800	2,544,698.00	0.18
26	600461	洪城环境	236,800	2,356,160.00	0.17
27	300433	蓝思科技	103,600	2,268,840.00	0.16
28	600529	山东药玻	87,500	2,254,875.00	0.16
29	002984	森麒麟	90,600	2,234,196.00	0.16

30	601225	陕西煤业	95,900	2,230,634.00	0.16
31	601991	大唐发电	770,700	2,196,495.00	0.16
32	002517	恺英网络	157,900	2,149,019.00	0.15
33	603993	洛阳钼业	301,000	2,001,650.00	0.14
34	002928	华夏航空	214,400	1,663,744.00	0.12
35	600028	中国石化	248,100	1,657,308.00	0.12
36	601058	赛轮轮胎	112,900	1,617,857.00	0.12
37	001323	慕思股份	41,200	1,557,772.00	0.11
38	300772	运达股份	108,700	1,439,188.00	0.10
39	300760	迈瑞医疗	5,400	1,377,000.00	0.10
40	001965	招商公路	98,000	1,367,100.00	0.10
41	603119	浙江荣泰	60,100	1,345,639.00	0.10
42	601288	农业银行	250,700	1,338,738.00	0.10
43	002241	歌尔股份	48,600	1,254,366.00	0.09
44	600048	保利发展	141,300	1,251,918.00	0.09
45	601033	永兴股份	84,891	1,227,523.86	0.09
46	000333	美的集团	16,300	1,226,086.00	0.09
47	605305	中际联合	43,100	1,221,023.00	0.09
48	600482	中国动力	49,700	1,216,159.00	0.09
49	603173	福斯达	51,900	1,196,295.00	0.09
50	601939	建设银行	132,800	1,167,312.00	0.08
51	688503	聚和材料	25,388	1,124,434.52	0.08
52	300904	威力传动	18,600	1,119,162.00	0.08
53	688498	源杰科技	7,965	1,068,903.00	0.08
54	002335	科华数据	27,800	803,976.00	0.06
55	002475	立讯精密	18,900	770,364.00	0.05
56	300866	安克创新	7,100	693,244.00	0.05
57	301004	嘉益股份	5,900	682,335.00	0.05
58	688041	海光信息	4,546	680,945.34	0.05
59	300121	阳谷华泰	41,600	502,944.00	0.04
60	001283	豪鹏科技	8,300	480,487.00	0.03
61	000888	峨眉山 A	800	10,584.00	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	603167	渤海轮渡	16,007,993.44	0.38
2	601033	永兴股份	12,877,341.50	0.31
3	600938	中国海油	10,661,444.00	0.26
4	601117	中国化学	9,676,098.00	0.23
5	688501	青达环保	9,430,159.08	0.23
6	601939	建设银行	9,376,198.00	0.23

7	600153	建发股份	8,107,656.00	0.19
8	601998	中信银行	7,788,305.00	0.19
9	001965	招商公路	6,814,295.00	0.16
10	603707	健友股份	6,768,099.78	0.16
11	601899	紫金矿业	6,716,447.00	0.16
12	603667	五洲新春	6,702,328.00	0.16
13	605166	聚合顺	6,654,720.00	0.16
14	002463	沪电股份	6,137,277.00	0.15
15	600575	淮河能源	6,086,801.00	0.15
16	300760	迈瑞医疗	5,945,699.00	0.14
17	000400	许继电气	5,231,384.00	0.13
18	002039	黔源电力	5,072,662.20	0.12
19	600584	长电科技	4,955,674.00	0.12
20	600600	青岛啤酒	4,904,527.00	0.12

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	603167	渤海轮渡	14,630,812.20	0.35
2	688501	青达环保	13,528,772.81	0.33
3	300791	仙乐健康	12,632,987.70	0.30
4	601225	陕西煤业	11,943,606.74	0.29
5	601033	永兴股份	11,427,034.00	0.27
6	600642	申能股份	11,071,227.00	0.27
7	603871	嘉友国际	11,068,970.40	0.27
8	002311	海大集团	9,565,429.00	0.23
9	601939	建设银行	8,940,191.00	0.21
10	002027	分众传媒	8,355,616.00	0.20
11	601998	中信银行	7,949,563.00	0.19
12	300218	安利股份	7,948,834.00	0.19
13	003006	百亚股份	7,863,834.38	0.19
14	600153	建发股份	7,404,607.00	0.18
15	603667	五洲新春	7,351,072.00	0.18
16	002463	沪电股份	6,791,093.00	0.16
17	001965	招商公路	6,697,371.00	0.16
18	600575	淮河能源	6,302,429.00	0.15
19	601088	中国神华	6,215,596.00	0.15
20	600489	中金黄金	6,208,052.00	0.15

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	427,929,617.34
卖出股票收入（成交）总额	484,679,630.42

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	64,308,164.55	4.58
2	央行票据	-	-
3	金融债券	207,199,086.99	14.76
	其中：政策性金融债	20,351,473.97	1.45
4	企业债券	190,885,946.85	13.60
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	691,366,931.46	49.25
7	可转债（可交换债）	166,353,511.08	11.85
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,320,113,640.93	94.04

## 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	242480005	24 杭州银行 永续债 01	700,000	72,219,019.18	5.14
2	102481810	24 京城建 MTN002B	500,000	52,203,424.66	3.72
3	019740	24 国债 09	430,000	43,543,260.82	3.10
4	232480001	24 中行二级 资本债 01A	400,000	42,514,251.37	3.03
5	102480566	24 威海城投 MTN001A	400,000	41,804,983.61	2.98

## 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 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.10.1 本期国债期货投资政策

无。

#### 8.10.2 本期国债期货投资评价

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：

2024 年 01 月 15 日，国家金融监督管理总局浙江监管局公示浙金罚决字[2024]1 号行政处罚决定书，给予杭州银行股份有限公司 210 万元人民币的行政处罚。

2024 年 08 月 15 日，国家金融监督管理总局浙江监管局公示浙金罚决字[2024]24 号行政处罚决定书，给予杭州银行股份有限公司 110 万元人民币的行政处罚。

2024 年 11 月 25 日，国家外汇管理局浙江省分局公示浙外管罚[2024]6 号行政处罚决定书，给予杭州银行股份有限公司罚没共计 645.5 万元人民币的行政处罚。

2024 年 01 月 05 日，国家金融监督管理总局公示金罚决字[2023]68 号行政处罚决定书，给予中国银行股份有限公司 430 万元人民币的行政处罚。

2024 年 04 月 03 日，国家外汇管理局北京市分局公示京汇罚[2024]9 号行政处罚决定书，给予中国银行股份有限公司罚没共计 40.22 万元人民币的行政处罚。

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	199,574.86
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	232,671,870.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	232,871,445.21

## 8.11.4 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	127061	美锦转债	11,063,695.89	0.79
2	118000	嘉元转债	10,724,027.17	0.76
3	128127	文科转债	9,355,687.85	0.67
4	110081	闻泰转债	9,225,282.76	0.66
5	128108	蓝帆转债	8,216,933.23	0.59
6	118031	天 23 转债	6,697,915.79	0.48
7	118023	广大转债	5,917,488.08	0.42
8	127089	晶澳转债	5,849,067.65	0.42
9	113048	晶科转债	5,303,089.04	0.38
10	110063	鹰 19 转债	5,201,013.14	0.37
11	123113	仙乐转债	5,130,775.02	0.37
12	128119	龙大转债	4,734,238.74	0.34
13	123124	晶瑞转 2	4,683,667.94	0.33
14	113641	华友转债	4,625,922.84	0.33
15	118027	宏图转债	3,626,478.90	0.26
16	123186	志特转债	3,586,185.36	0.26
17	127026	超声转债	3,486,140.55	0.25
18	113636	甬金转债	3,348,983.73	0.24
19	123171	共同转债	3,311,894.15	0.24
20	118008	海优转债	2,963,899.73	0.21
21	113640	苏利转债	2,707,479.45	0.19
22	118020	芳源转债	2,687,190.41	0.19
23	113046	金田转债	2,681,424.66	0.19
24	123128	首华转债	2,554,934.89	0.18
25	118043	福立转债	2,401,357.55	0.17
26	127091	科数转债	2,377,687.31	0.17
27	123132	回盛转债	2,276,891.30	0.16
28	110085	通 22 转债	2,211,579.73	0.16
29	118035	国力转债	2,011,874.46	0.14
30	128081	海亮转债	1,780,345.89	0.13
31	113608	威派转债	1,725,881.92	0.12

32	118029	富淼转债	1,720,009.96	0.12
33	123216	科顺转债	1,576,415.75	0.11
34	127101	豪鹏转债	1,344,148.64	0.10
35	113666	爱玛转债	1,264,419.18	0.09
36	118028	会通转债	1,260,569.86	0.09
37	110090	爱迪转债	1,233,991.78	0.09
38	118030	睿创转债	1,201,193.43	0.09
39	113625	江山转债	1,179,806.85	0.08
40	111003	聚合转债	1,174,805.94	0.08
41	127016	鲁泰转债	1,124,833.70	0.08
42	123211	阳谷转债	1,116,345.25	0.08
43	128122	兴森转债	940,297.06	0.07
44	110095	双良转债	914,648.70	0.07
45	123223	九典转 02	891,253.59	0.06
46	113677	华懋转债	612,547.26	0.04
47	113674	华设转债	608,248.63	0.04
48	123151	康医转债	532,815.85	0.04

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

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
交银安心收益债券 A	950	1,391,405.32	1,307,273,156.38	98.90	14,561,894.67	1.10
交银安心收益债券 E	1,929	12,695.12	0.00	0.00	24,488,889.64	100.00
合计	2,879	467,635.96	1,307,273,156.38	97.10	39,050,784.31	2.90

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	交银安心收益债券 A	98,091.37	0.01
	交银安心收益债券 E	4,090.47	0.02
	合计	102,181.84	0.01

## 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	份额级别	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	交银安心收益债券 A	-
	交银安心收益债券 E	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	交银安心收益债券 A	0~10
	交银安心收益债券 E	-
	合计	0~10

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	交银安心收益债券 A	交银安心收益债券 E
基金合同生效日（2018年6月2日）基金份额总额	189,784,733.61	-
本报告期期初基金份额总额	4,108,283,379.03	101.83
本报告期基金总申购份额	942,616,242.33	36,961,110.21
减：本报告期基金总赎回份额	3,729,064,570.31	12,472,322.40
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,321,835,051.05	24,488,889.64

注：1、如果本报告期间发生转换入、份额类别调整、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、份额类别调整业务，则总赎回份额中包含该业务。

## § 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，公司董事长（法定代表人）由张宏良先生担任，阮红女士不再担任公司董事长（法定代表人）；公司首席信息官由周云康先生担任，谢卫先生继续担任公司总经理。报告期末至本报告报送日前，印皓女士不再担任公司副总经理。

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，经履行适当程序，为本基金提供审计服务的机构由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)变更为毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)。本期审计费为 40,000.00 元。目前该事务所已为本基金提供审计服务 1 年。

### 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

措施	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	交银施罗德基金管理有限公司
受到稽查或处罚等措施的时间	2024 年 7 月 1 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会上海监管局
受到的具体措施类型	责令改正
受到稽查或处罚等措施的原因	个别制度未严格执行，个别业务内控管理不完善。
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司已完成整改。
其他	-

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中未受到相关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 (%)	
长江证券	2	912,609,247.76	100.00	549,587.26	100.00	-
中信证券	1	-	-	-	-	本报告期新增1个

### 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	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
长江证券	3,179,366,745.83	100.00	41,551,396,000.00	100.00	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

注：1、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；

2、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。

3、本基金管理人严格落实《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》的要求，在规定时间内完成股票交易佣金费率的调整，自 2024 年 7 月 1 日起按照调整后的费率执行。

4、本部分的数据统计时间区间与本报告的报告期一致，本公司网站披露的《交银施罗德基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）》的报告期为 2024 年 7 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日。敬请投资者关注上述报告统计时间区间的口径差异。

## 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	交银施罗德安心收益债券型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒体及公司网站	2024 年 1 月 20 日
2	交银施罗德基金管理有限公司关于增加国金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	2024 年 3 月 22 日
3	交银施罗德安心收益债券型证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会规定媒体及公司网站	2024 年 3 月 29 日
4	交银施罗德基金管理有限公司高级管理人员任职公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2024 年 3 月 30 日
5	交银施罗德安心收益债券型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒体及公司网站	2024 年 4 月 20 日
6	交银施罗德基金管理有限公司关于增加华西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	2024 年 5 月 6 日
7	交银施罗德安心收益债券型证券投资基金（E 类份额）基金产品资料概要更新（2024 年第 1 号）	中国证监会规定媒体及公司网站	2024 年 5 月 10 日
8	交银施罗德安心收益债券型证券投资基金（更新）招募说明书（2024 年第 1 号）	中国证监会规定媒体及公司网站	2024 年 5 月 10 日
9	交银施罗德安心收益债券型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新（2024 年第 1 号）	中国证监会规定媒体及公司网站	2024 年 5 月 10 日
10	交银施罗德基金管理有限公司关于终止上海钜派钰茂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	2024 年 5 月 23 日
11	交银施罗德安心收益债券型证券投资基金（E 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒体及公司网站	2024 年 6 月 27 日
12	交银施罗德安心收益债券型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒体及公司网站	2024 年 6 月 27 日
13	交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金在交通银行股份有限公司恢复原前端申购（含定期定额投资）费率率的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2024 年 7 月 5 日
14	交银施罗德基金管理有限公司关于增加交通银行股份有限公司为旗下基金的销售机构的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2024 年 7 月 17 日
15	交银施罗德基金管理有限公司旗下全部基金 2024 年第二季度报告提示性公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2024 年 7 月 18 日
16	交银施罗德安心收益债券型证券投资基金 2024 年第 2 季度报告	中国证监会规定媒体及公司网站	2024 年 7 月 18 日

17	交银施罗德基金管理有限公司关于董事长离任及代任董事长（法定代表人）的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2024 年 8 月 17 日
18	交银施罗德基金管理有限公司旗下全部基金 2024 年中期报告提示性公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2024 年 8 月 30 日
19	交银施罗德安心收益债券型证券投资基金 2024 年中期报告	中国证监会规定媒体及公司网站	2024 年 8 月 30 日
20	交银施罗德基金管理有限公司关于增加招商银行股份有限公司为旗下基金的销售机构的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2024 年 10 月 9 日
21	交银施罗德基金管理有限公司高级管理人员任职公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2024 年 10 月 25 日
22	交银施罗德基金管理有限公司关于董事长（法定代表人）任职的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2024 年 10 月 25 日
23	交银施罗德安心收益债券型证券投资基金 2024 年第 3 季度报告	中国证监会规定媒体及公司网站	2024 年 10 月 25 日
24	交银施罗德基金管理有限公司关于旗下基金改聘会计师事务所的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2024 年 12 月 3 日
25	交银施罗德基金管理有限公司关于增加蚂蚁（杭州）基金销售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	2024 年 12 月 16 日
26	交银施罗德基金管理有限公司关于增加上海天天基金销售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	2024 年 12 月 18 日
27	交银施罗德基金管理有限公司关于增加北京雪球基金销售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	2024 年 12 月 18 日
28	交银施罗德基金管理有限公司关于增加京东肯特瑞基金销售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	2024 年 12 月 18 日
29	交银施罗德基金管理有限公司关于增加宁波银行股份有限公司为旗下基金的销售机构的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2024 年 12 月 20 日
30	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德安心收益债券型证券投资基金暂停及恢复大额申购（转换转入、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	2024 年 12 月 20 日
31	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德安心收益债券型证券投资基金分红公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2024 年 12 月 24 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	2024/1/1-2024/12/31	960,567,025.44	-	960,567,025.44	-	-
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、中国证监会准予交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金募集注册的文件;
- 2、《交银施罗德安心收益债券型证券投资基金基金合同》;
- 3、《交银施罗德安心收益债券型证券投资基金招募说明书》;
- 4、《交银施罗德安心收益债券型证券投资基金托管协议》;
- 5、《交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金基金合同》;
- 6、《交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金招募说明书》;
- 7、《交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金托管协议》;
- 8、《交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金保证合同》;
- 9、基金管理人业务资格批件、营业执照;
- 10、基金托管人业务资格批件、营业执照;
- 11、关于申请募集注册交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金的法律意见书;
- 12、关于修改《交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金基金合同》的法律意见书
- 13、报告期内交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金、交银施罗德安心收益债券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](http://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](mailto:services@jysld.com)。