

# 交银施罗德启诚混合型证券投资基金 2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：交银施罗德基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 08 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

|   |           |
|---|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b> .....                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示 .....                                | 2         |
| 1.2 目录 .....                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b> .....                         | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况 .....                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明 .....                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人 .....                         | 5         |
| 2.4 信息披露方式 .....                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料 .....                              | 6         |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....                | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 .....                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现 .....                              | 7         |
| <b>§ 4 管理人报告</b> .....                        | <b>9</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 .....                        | 9         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....              | 9         |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....                 | 9         |
| 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 .....             | 10        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....             | 10        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....                | 11        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....                 | 11        |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....       | 11        |
| <b>§ 5 托管人报告</b> .....                        | <b>11</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....                  | 11        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 ..... | 12        |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....      | 12        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....              | <b>12</b> |
| 6.1 资产负债表 .....                               | 12        |
| 6.2 利润表 .....                                 | 13        |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表 .....                        | 14        |
| 6.4 报表附注 .....                                | 16        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b> .....                       | <b>50</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况 .....                          | 50        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....                    | 51        |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....       | 52        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....                     | 55        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                    | 57        |
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....      | 57        |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....   | 57        |
| 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....   | 57        |

|  |           |
|--|-----------|
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 ..... | 57        |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....                | 57        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....          | 57        |
| 7.12 投资组合报告附注 .....                      | 58        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>               | <b>59</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....              | 59        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....           | 59        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....   | 59        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>               | <b>60</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                 | <b>60</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                   | 60        |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....   | 60        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....        | 60        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                     | 60        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....              | 60        |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....      | 61        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....             | 61        |
| 10.8 其他重大事件 .....                        | 62        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>         | <b>63</b> |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 ..... | 63        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                | 63        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                 | <b>63</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                        | 63        |
| 12.2 存放地点 .....                          | 64        |
| 12.3 查阅方式 .....                          | 64        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                     |                    |                  |
|---------------------|--------------------|------------------|
| 基金名称                | 交银施罗德启诚混合型证券投资基金   |                  |
| 基金简称                | 交银启诚混合             |                  |
| 基金主代码               | 014038             |                  |
| 基金运作方式              | 契约型开放式             |                  |
| 基金合同生效日             | 2021 年 12 月 8 日    |                  |
| 基金管理人               | 交银施罗德基金管理有限公司      |                  |
| 基金托管人               | 招商银行股份有限公司         |                  |
| 报告期末基金份<br>额总额      | 3,444,399,014.92 份 |                  |
| 基金合同存续期             | 不定期                |                  |
| 下属分级基金的基<br>金简称     | 交银启诚混合 A           | 交银启诚混合 C         |
| 下属分级基金的交<br>易代码     | 014038             | 014039           |
| 报告期末下属分级<br>基金的份额总额 | 2,692,852,848.28 份 | 751,546,166.64 份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 本基金在严格控制风险的前提下，充分发挥专业研究与管理能力，追求超越业绩比较基准的投资收益，力争为投资者提供长期稳健的投资回报。   |
| 投资策略   | 本基金充分发挥基金管理人的研究优势，在分析和判断宏观经济周期和金融市场运行趋势的基础上，运用修正后的投资时钟分析框架，自上而下调整基金大类资产配置，确定债券组合久期和债券类别配置；在严谨深入的股票和债券研究分析基础上，自下而上精选个股和个券；在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力争获取投资组合的较高回报。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×65%+恒生指数收益率×5%+中证综合债券指数收益率×30%   |
| 风险收益特征 | 本基金是一只混合型基金，其预期风险和预期收益理论上高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。<br>本基金可投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。   |

### 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              | 招商银行股份有限公司                           |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名                         | 王晚婷                                  |
|             | 联系电话                       | (021) 61055050                       |
|             | 电子邮箱                       | xxpl@jysld.com, disclosure@jysld.com |
| 客户服务电话      | 400-700-5000, 021-61055000 | 95555                                |

|       |                                    |                      |
|-------|------------------------------------|----------------------|
| 传真    | (021) 61055054                     | 0755-83195201        |
| 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） | 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 |
| 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      | 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 |
| 邮政编码  | 200120                             | 518040               |
| 法定代表人 | 阮红                                 | 缪建民                  |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                 |
|---------------------|-----------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 《上海证券报》         |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.fund001.com |
| 基金中期报告备置地点          | 基金管理人的办公场所      |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称             | 办公地址             |
|--------|----------------|------------------|
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司 | 北京市西城区太平桥大街 17 号 |

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2022年01月01日-2022年06月30日) |                |               |
|---------------|------------------------------|----------------|---------------|
|               | 交银启诚混合 A                     | 交银启诚混合 C       |               |
| 本期已实现收益       | -10,217,148.06               | -1,385,210.31  |               |
| 本期利润          | 130,357,994.64               | 42,634,754.15  |               |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0506                       | 0.0807         |               |
| 本期加权平均净值利润率   | 5.07%                        | 8.09%          |               |
| 本期基金份额净值增长率   | 4.10%                        | 3.70%          |               |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2022年6月30日)             |                |               |
|               | 期末可供分配利润                     | -18,102,658.33 | -8,361,315.88 |
|               | 期末可供分配基金份额利润                 | -0.0067        | -0.0111       |

|              |                        |                |
|--------------|------------------------|----------------|
| 期末基金资产净值     | 2,829,983,695.20       | 786,350,927.27 |
| 期末基金份额净值     | 1.0509                 | 1.0463         |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末 (2022 年 6 月 30 日) |                |
| 基金份额累计净值增长率  | 5.09%                  | 4.63%          |

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

交银启诚混合 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    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月      | 4.49%    | 0.88%       | 6.30%      | 0.76%         | -1.81% | 0.12%  |
| 过去三个月      | 5.73%    | 1.20%       | 4.45%      | 0.99%         | 1.28%  | 0.21%  |
| 过去六个月      | 4.10%    | 1.02%       | -5.60%     | 1.02%         | 9.70%  | 0.00%  |
| 自基金合同生效起至今 | 5.09%    | 0.95%       | -5.34%     | 0.98%         | 10.43% | -0.03% |

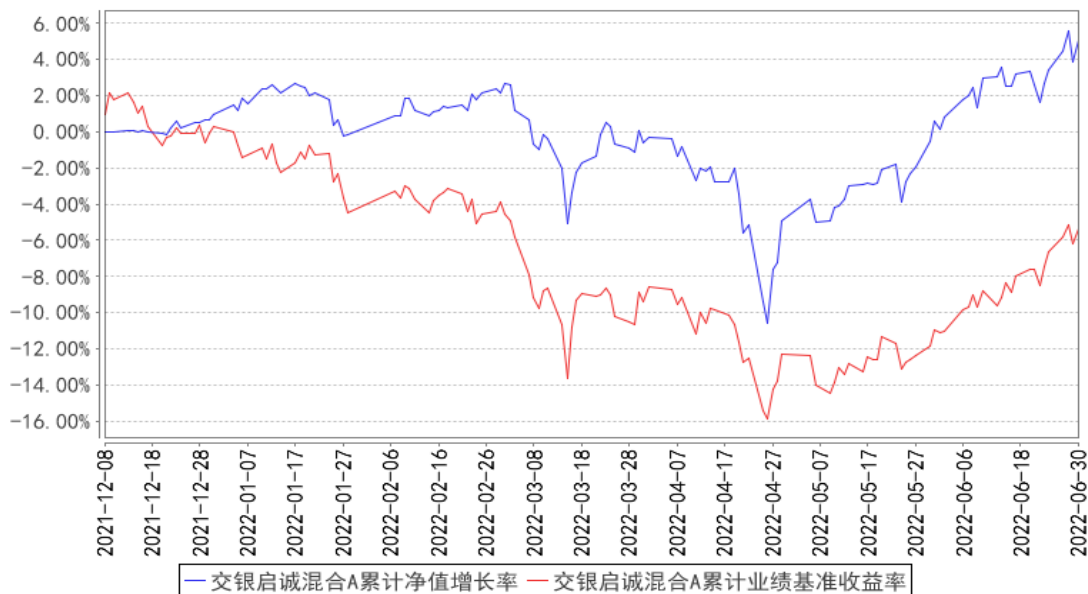
交银启诚混合 C

| 阶段    | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月 | 4.43%    | 0.88%       | 6.30%      | 0.76%         | -1.87% | 0.12% |
| 过去三个月 | 5.54%    | 1.20%       | 4.45%      | 0.99%         | 1.09%  | 0.21% |

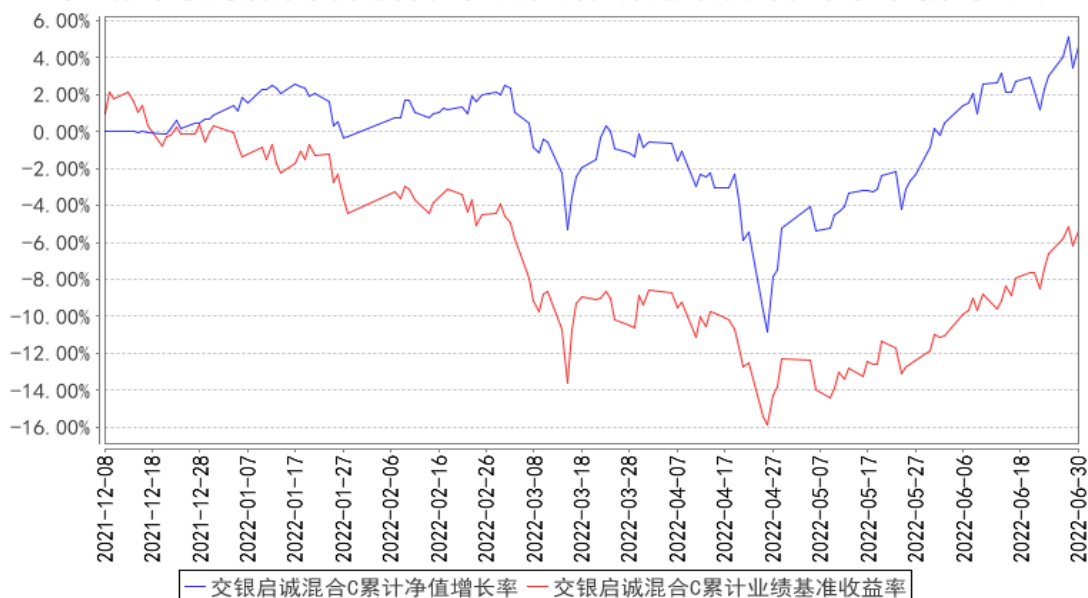
|            |       |       |        |       |       |        |
|------------|-------|-------|--------|-------|-------|--------|
| 过去六个月      | 3.70% | 1.02% | -5.60% | 1.02% | 9.30% | 0.00%  |
| 自基金合同生效起至今 | 4.63% | 0.95% | -5.34% | 0.98% | 9.97% | -0.03% |

### 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

交银启诚混合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



交银启诚混合C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：本基金基金合同生效日为 2021 年 12 月 8 日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间未满一年。本基金建仓期为自基金合同生效日起的 6 个月。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

交银施罗德基金管理有限公司是经中国证监会证监基金字[2005]128 号文批准，由交通银行股份有限公司、施罗德投资管理有限公司、中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司共同发起设立。公司成立于 2005 年 8 月 4 日，注册地在中国上海，注册资本为 2 亿元人民币。其中，交通银行股份有限公司持有 65% 的股份，施罗德投资管理有限公司持有 30% 的股份，中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司持有 5% 的股份。公司并下设交银施罗德资产管理（香港）有限公司和交银施罗德资产管理有限公司。

截至报告期末，公司管理了包括货币型、债券型、混合型和股票型在内的 112 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 |        |   |
| 杨金 | 交银趋势混合、交银启诚混合的基金经理 | 2021 年 12 月 08 日 | -    | 8 年    | 杨金先生。复旦大学金融学硕士、华东理工大学材料工程学士。历任长江证券研究部高级分析师，华泰柏瑞基金公司研究员。2017 年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任行业分析师。 |

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

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

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

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，基金整体运作符合有关法律法规和基金合同的规定，为基金持有人谋求最大利益。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本公司制定了严格的投资控制制度和公平交易监控制度来保证旗下基金运作的公平，旗下所

管理的所有资产组合，包括证券投资基金和私募资产管理计划均严格遵循制度进行公平交易。

公司建立资源共享的投资研究信息平台，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。公司在交易执行环节实行集中交易制度，建立公平的交易分配制度。对于交易所公开竞价交易，遵循“价格优先、时间优先”的原则，全部通过交易系统进行比例分配；对于非集中竞价交易、以公司名义进行的场外交易，遵循公平交易分配原则对交易结果进行分配。

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

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年上半年市场整体低开高走 V 型反弹，在经历年初以来的大幅回调后，市场以赛道股为首开始大幅反弹。

从基本面情况来看，宏观经济在经历了地产下行、疫情以及海外经济需求放缓带来的冲击下，整体筑底趋势较为明显，同时货币也较为宽松，市场集中在赛道及消费等相对景气度更高的板块展开行情演绎也在情理之中。

#### 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

从当前时点往后看，一方面，我们过去寻找到的一些优秀公司，在经历了时间的推移和上半年负向贝塔的冲击后，大部分公司基本面仍展现出了非常强的韧性及成长性，甚至其中一些在经

历行业普遍性困境后反而竞争力及行业地位得到进一步强化，目前估值相对成长性及未来空间来看仍较具性价比。

另一方面，过去一段时间的普涨反弹，主要体现在市场认知度较高的赛道及核心资产为主，而大部分低关注度个股仍处于偏底部及估值较低位置。同时过去一年中，很多有结构性成长逻辑的公司，受到原材料价格暴涨、海运费高企、汇率升值乃至今年的疫情、海外地缘政治冲突等诸多黑天鹅因素冲击明显，导致业绩最后低于预期。我们希望寻找那些长逻辑并没有得到破坏，同时股价因为短期业绩低于预期而处于底部，并随着诸多负向因素的缓解基本面有望呈现拐点向上的个股机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

本基金本报告期内无需预警说明。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职

责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

## 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

# § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：交银施罗德启诚混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号     | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b> |         |                        |                          |
| 银行存款       | 6.4.7.1 | 527,303,412.05         | 2,466,432,314.08         |
| 结算备付金      |         | 11,482,170.13          | -                        |
| 存出保证金      |         | 739,884.67             | -                        |
| 交易性金融资产    | 6.4.7.2 | 3,106,823,955.71       | 526,486,442.67           |
| 其中：股票投资    |         | 2,913,549,106.00       | 526,486,442.67           |
| 基金投资       |         | -                      | -                        |
| 债券投资       |         | 193,274,849.71         | -                        |
| 资产支持证券投资   |         | -                      | -                        |
| 贵金属投资      |         | -                      | -                        |
| 其他投资       |         | -                      | -                        |
| 衍生金融资产     | 6.4.7.3 | -                      | -                        |
| 买入返售金融资产   | 6.4.7.4 | -                      | -                        |
| 债权投资       | 6.4.7.5 | -                      | -                        |
| 其中：债券投资    |         | -                      | -                        |
| 资产支持证券投资   |         | -                      | -                        |
| 其他投资       |         | -                      | -                        |
| 其他债权投资     | 6.4.7.6 | -                      | -                        |

|               |            |                           |                             |
|---------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 其他权益工具投资      | 6.4.7.7    | -                         | -                           |
| 应收清算款         |            | -                         | 10,760,231.79               |
| 应收股利          |            | 8,239,853.78              | -                           |
| 应收申购款         |            | 1,842,459.97              | -                           |
| 递延所得税资产       |            | -                         | -                           |
| 其他资产          | 6.4.7.8    | -                         | 269,329.94                  |
| 资产总计          |            | 3,656,431,736.31          | 3,003,948,318.48            |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2022年6月30日</b> | <b>上年度末<br/>2021年12月31日</b> |
| <b>负债：</b>    |            |                           |                             |
| 短期借款          |            | -                         | -                           |
| 交易性金融负债       |            | -                         | -                           |
| 衍生金融负债        | 6.4.7.3    | -                         | -                           |
| 卖出回购金融资产款     |            | -                         | -                           |
| 应付清算款         |            | 10,400,796.71             | -                           |
| 应付赎回款         |            | 21,736,369.99             | -                           |
| 应付管理人报酬       |            | 4,498,249.51              | 2,813,381.97                |
| 应付托管费         |            | 749,708.24                | 468,897.01                  |
| 应付销售服务费       |            | 522,741.21                | 227,259.60                  |
| 应付投资顾问费       |            | -                         | -                           |
| 应交税费          |            | 2.87                      | -                           |
| 应付利润          |            | -                         | -                           |
| 递延所得税负债       |            | -                         | -                           |
| 其他负债          | 6.4.7.9    | 2,189,245.31              | 514,672.45                  |
| 负债合计          |            | 40,097,113.84             | 4,024,211.03                |
| <b>净资产：</b>   |            |                           |                             |
| 实收基金          | 6.4.7.10   | 3,444,399,014.92          | 2,971,846,835.39            |
| 其他综合收益        | 6.4.7.11   | -                         | -                           |
| 未分配利润         | 6.4.7.12   | 171,935,607.55            | 28,077,272.06               |
| 净资产合计         |            | 3,616,334,622.47          | 2,999,924,107.45            |
| 负债和净资产总计      |            | 3,656,431,736.31          | 3,003,948,318.48            |

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额总额 3,444,399,014.92 份，其中交银启诚混合 A 基金份额总额 2,692,852,848.28 份，基金份额净值 1.0509 元。交银启诚混合 C 基金份额总额 751,546,166.64 份，基金份额净值 1.0463 元。

## 6.2 利润表

会计主体：交银施罗德启诚混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6<br>月 30 日 |
|----|-----|--|
|----|-----|--|

|                            |              |                |
|----------------------------|--------------|----------------|
| <b>一、营业总收入</b>             |              | 201,966,533.97 |
| 1. 利息收入                    |              | 2,189,120.14   |
| 其中：存款利息收入                  | 6.4.7.13     | 2,109,384.70   |
| 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                 |              | 79,735.44      |
| 证券出借利息收入                   |              | -              |
| 其他利息收入                     |              | -              |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）          |              | 14,088,733.29  |
| 其中：股票投资收益                  | 6.4.7.14     | -17,372,934.73 |
| 基金投资收益                     |              | -              |
| 债券投资收益                     | 6.4.7.15     | 6,044,946.89   |
| 资产支持证券投资收益                 | 6.4.7.16     | -              |
| 贵金属投资收益                    | 6.4.7.17     | -              |
| 衍生工具收益                     | 6.4.7.18     | -              |
| 股利收益                       | 6.4.7.19     | 25,416,721.13  |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益      |              | -              |
| 其他投资收益                     |              | -              |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）     | 6.4.7.20     | 184,595,107.16 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         |              | -              |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         | 6.4.7.21     | 1,093,573.38   |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |              | 28,973,785.18  |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1   | 22,947,784.03  |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2   | 3,824,630.72   |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3   | 2,065,622.87   |
| 4. 投资顾问费                   | 6.4.10.2.1.1 | -              |
| 5. 利息支出                    |              | -              |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |              | -              |
| 6. 信用减值损失                  | 6.4.7.22     | -              |
| 7. 税金及附加                   |              | 291.17         |
| 8. 其他费用                    | 6.4.7.23     | 135,456.39     |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |              | 172,992,748.79 |
| 减：所得税费用                    |              | -              |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |              | 172,992,748.79 |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |              | -              |
| <b>六、综合收益总额</b>            |              | 172,992,748.79 |

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：交银施罗德启诚混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                  | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |        |                |                  |
|-------------------------------------|---------------------------------------|--------|----------------|------------------|
|                                     | 实收基金                                  | 其他综合收益 | 未分配利润          | 净资产合计            |
| 一、上期期末净资产（基金净值）                     | 2,971,846,835.39                      | -      | 28,077,272.06  | 2,999,924,107.45 |
| 加：会计政策变更                            | -                                     | -      | -              | -                |
| 前期差错更正                              | -                                     | -      | -              | -                |
| 其他                                  | -                                     | -      | -              | -                |
| 二、本年期初净资产（基金净值）                     | 2,971,846,835.39                      | -      | 28,077,272.06  | 2,999,924,107.45 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                | 472,552,179.53                        | -      | 143,858,335.49 | 616,410,515.02   |
| （一）、综合收益总额                          | -                                     | -      | 172,992,748.79 | 172,992,748.79   |
| （二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | 472,552,179.53                        | -      | -29,134,413.30 | 443,417,766.23   |
| 其中：1. 基金申购款                         | 945,471,825.40                        | -      | -26,285,276.82 | 919,186,548.58   |
| 2. 基金赎回款                            | -472,919,645.87                       | -      | -2,849,136.48  | -475,768,782.35  |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利                   | -                                     | -      | -              | -                |

|                         |                  |   |                |                  |
|-------------------------|------------------|---|----------------|------------------|
| 润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） |                  |   |                |                  |
| （四）、其他综合收益结转留存收益        | -                | - | -              | -                |
| 四、本期末净资产（基金净值）          | 3,444,399,014.92 | - | 171,935,607.55 | 3,616,334,622.47 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

|           |           |           |
|-----------|-----------|-----------|
| <u>谢卫</u> | <u>谢卫</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   |

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

交银施罗德启诚混合型证券投资基金(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[2021]第 3027 号《关于准予交银施罗德启诚混合型证券投资基金注册的批复》，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《交银施罗德启诚混合型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 2,971,712,254.59 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第 1150 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《交银施罗德启诚混合型证券投资基金基金合同》于 2021 年 12 月 8 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,971,846,835.39 份基金份额，其中认购资金利息折合 134,580.80 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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《交银施罗德启诚混合型证券投资基金基金合同》和《交银施罗德启诚混合型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用、赎回时收取赎回费用的，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；在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用、赎回时收取赎回费用，并从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类分别设置基金代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值并单独公告。投资人可自由选择认购/申购的基金份额类别，本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德启诚混合型证券投资基金基金合同》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，包括国内依法发行上市的股票（含创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（含国债、央行票据、金融债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、企业债券、公司债券、可转换债券（含可分离交易可转换债券的纯债部分）、可交换公司债券、公开发行的次级债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、货币市场工具、债券回购、同业存单、银行存款（含协议存款、定期存款及其他银行存款）、股指期货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）。基金的投资组合比例为：股票投资（含存托凭证）占基金资产的比例为 60%–95%，其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0–50%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的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、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×65%+恒生指数收益率×5%+中证综合债券指数收益率×30%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 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》、《交银施罗德启诚混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 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。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 06 月 30 日的财务状况以及 2022 年上半年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

## 6.4.4 重要会计政策和会计估计

### 6.4.4.1 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。本期财务报表的实际编制期间为 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日。

### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### 新金融工具准则

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或金融负债。

#### (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。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。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。本基金持有的其他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。

## 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

### 新金融工具准则

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。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

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。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则,但选择不重述比较信息。因此,比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;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,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的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。

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。

#### 6.4.4.5 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。

#### 6.4.4.6 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。

#### 6.4.4.7 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。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。

#### 6.4.4.8 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基金净值比例计算的金额。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基金净值比例计算的金额。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)。

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

##### 新金融工具准则

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。

##### 原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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或者发行价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利息收入。

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。

#### 6.4.4.10 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。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的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所有者权益转出。

#### 6.4.4.12 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。

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。

#### 6.4.4.13 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。

#### 6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

无。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”),财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外,中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表,对本基金财务报表的影响列示如下:

##### 1. 会计政策变更的性质、内容和原因

###### (a) 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或金融负债。

###### (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商业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商业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。

(b) 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。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

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。

#### (c) 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。

#### 2. 当期报表中受影响的项目名称和调整金额

##### (a) 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>》

根据中国证监会于 2022 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。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关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，对国债、地方政府债以及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) 对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，股票的股息、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。

(3) 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。对基金从上市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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

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

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 527,303,412.05         |
| 等于：本金          | 527,246,412.38         |
| 加：应计利息         | 56,999.67              |
| 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          | 527,303,412.05 |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日 |              |                  |                |
|---------------|------------------------|--------------|------------------|----------------|
|               | 成本                     | 应计利息         | 公允价值             | 公允价值变动         |
| 股票            | 2,696,121,010.47       | -            | 2,913,549,106.00 | 217,428,095.53 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                      | -            | -                | -              |
| 债券            | 交易所市场                  | 88.06        | 1,674,088.06     | -              |
|               | 银行间市场                  | 1,529,761.65 | 191,600,761.65   | -193,120.00    |
|               | 合计                     | 1,529,849.71 | 193,274,849.71   | -193,120.00    |
| 资产支持证券        | -                      | -            | -                | -              |
| 基金            | -                      | -            | -                | -              |
| 其他            | -                      | -            | -                | -              |
| 合计            | 2,888,059,130.47       | 1,529,849.71 | 3,106,823,955.71 | 217,234,975.53 |

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

|    |
|----|
| 无。 |
|----|

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 |
|----|-----|
|----|-----|

|             | 2022 年 6 月 30 日 |
|-------------|-----------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -               |
| 应付赎回费       | 61,453.89       |
| 应付证券出借违约金   | -               |
| 应付交易费用      | 2,024,201.70    |
| 其中：交易所市场    | 2,023,526.70    |
| 银行间市场       | 675.00          |
| 应付利息        | -               |
| 预提审计费       | 34,782.35       |
| 预提信息披露费     | 59,507.37       |
| 预提账户维护费     | 9,300.00        |
| 合计          | 2,189,245.31    |

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 交银启诚混合 A

| 项目            | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |                  |
|---------------|---------------------------------------|------------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额             |
| 上年度末          | 2,521,641,970.95                      | 2,521,641,970.95 |
| 本期申购          | 522,415,795.19                        | 522,415,795.19   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -351,204,917.86                       | -351,204,917.86  |
| 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           | 2,692,852,848.28                      | 2,692,852,848.28 |

## 交银启诚混合 C

| 项目            | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |                 |
|---------------|---------------------------------------|-----------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额            |
| 上年度末          | 450,204,864.44                        | 450,204,864.44  |
| 本期申购          | 423,056,030.21                        | 423,056,030.21  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -121,714,728.01                       | -121,714,728.01 |
| 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           | 751,546,166.64                        | 751,546,166.64  |

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。

## 6.4.7.11 其他综合收益

无。

## 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

交银启诚混合 A

| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分          | 未分配利润合计        |
|----------------|----------------|----------------|----------------|
| 本期期初           | -3,678,740.49  | 27,696,867.76  | 24,018,127.27  |
| 本期利润           | -10,217,148.06 | 140,575,142.70 | 130,357,994.64 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -4,206,769.78  | -13,038,505.21 | -17,245,274.99 |
| 其中：基金申购款       | -7,778,768.67  | -6,911,656.96  | -14,690,425.63 |
| 基金赎回款          | 3,571,998.89   | -6,126,848.25  | -2,554,849.36  |
| 本期已分配利润        | -              | -              | -              |
| 本期末            | -18,102,658.33 | 155,233,505.25 | 137,130,846.92 |

交银启诚混合 C

| 项目             | 已实现部分         | 未实现部分         | 未分配利润合计        |
|----------------|---------------|---------------|----------------|
| 本期期初           | -883,855.82   | 4,943,000.61  | 4,059,144.79   |
| 本期利润           | -1,385,210.31 | 44,019,964.46 | 42,634,754.15  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -6,092,249.75 | -5,796,888.56 | -11,889,138.31 |
| 其中：基金申购款       | -7,776,074.63 | -3,818,776.56 | -11,594,851.19 |
| 基金赎回款          | 1,683,824.88  | -1,978,112.00 | -294,287.12    |
| 本期已分配利润        | -             | -             | -              |
| 本期末            | -8,361,315.88 | 43,166,076.51 | 34,804,760.63  |

## 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期                   |
|-----------|----------------------|
|           | 2022年1月1日至2022年6月30日 |
| 活期存款利息收入  | 2,037,396.37         |
| 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 | 64,283.23            |
| 其他        | 7,705.10             |
| 合计        | 2,109,384.70         |

## 6.4.7.14 股票投资收益

## 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目              | 本期                   |
|-----------------|----------------------|
|                 | 2022年1月1日至2022年6月30日 |
| 股票投资收益——买卖股票差价收 | -17,372,934.73       |



|                  |                |
|------------------|----------------|
| 入                |                |
| 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               | -17,372,934.73 |

#### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 1,266,666,831.04           |
| 减：卖出股票成本总额 | 1,277,481,768.41           |
| 减：交易费用     | 6,557,997.36               |
| 买卖股票差价收入   | -17,372,934.73             |

#### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                           | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 1,010,036.79               |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 5,034,910.10               |
| 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                           | 6,044,946.89               |

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 7,807,085.70               |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 2,770,000.00               |
| 减：应计利息总额               | 1,092.82                   |
| 减：交易费用                 | 1,082.78                   |

|          |              |
|----------|--------------|
| 买卖债券差价收入 | 5,034,910.10 |
|----------|--------------|

#### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

#### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

##### 6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

##### 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

##### 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.7.17 贵金属投资收益

##### 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

##### 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

##### 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.18 衍生工具收益

## 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期                              |
|---------------|---------------------------------|
|               | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
| 股票投资产生的股利收益   | 25,416,721.13                   |
| 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            | 25,416,721.13                   |

## 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期                              |
|------------------------|---------------------------------|
|                        | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
| 1. 交易性金融资产             | 184,595,107.16                  |
| 股票投资                   | 184,788,227.16                  |
| 债券投资                   | -193,120.00                     |
| 资产支持证券投资               | -                               |
| 基金投资                   | -                               |
| 贵金属投资                  | -                               |
| 其他                     | -                               |
| 2. 衍生工具                | -                               |
| 权证投资                   | -                               |
| 3. 其他                  | -                               |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | -                               |
| 合计                     | 184,595,107.16                  |

## 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|----|----|

|         | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 1,093,573.38                    |
| 合计      | 1,093,573.38                    |

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

#### 6.4.7.22 信用减值损失

无。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期                              |
|---------|---------------------------------|
|         | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
| 审计费用    | 30,710.27                       |
| 信息披露费   | 59,507.37                       |
| 证券出借违约金 | -                               |
| 银行费用    | 24,905.54                       |
| 债券账户费用  | 13,800.00                       |
| 其他      | 6,533.21                        |
| 合计      | 135,456.39                      |

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称                      | 与本基金的关系         |
|----------------------------|-----------------|
| 交银施罗德基金管理有限公司（“交银施罗德基金公司”） | 基金管理人、基金销售机构    |
| 招商银行股份有限公司（“招商银行”）         | 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         | 基金管理人的股东        |

|               |             |
|---------------|-------------|
| 司             |             |
| 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。

本报告期实际与基金发生关联交易的关联方及关联交易具体情况请见下述内容。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

无。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

无。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

###### 6.4.10.1.4 权证交易

无。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期                              |
|-----------------|---------------------------------|
|                 | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 22,947,784.03                   |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 10,685,102.97                   |

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.5% ÷ 当年天数。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

| 项目             | 本期                              |
|----------------|---------------------------------|
|                | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 3,824,630.72                    |

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

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% \div \text{当年天数}。$$

**6.4.10.2.3 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                              |              |              |
|----------------|---------------------------------|--------------|--------------|
|                | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |              |              |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                |              |              |
|                | 交银启诚混合 A                        | 交银启诚混合 C     | 合计           |
| 交通银行           |                                 | 145,376.33   | 145,376.33   |
| 交银施罗德基金公司      |                                 | 223,767.22   | 223,767.22   |
| 招商银行           |                                 | 699,620.36   | 699,620.36   |
| 合计             |                                 | 1,068,763.91 | 1,068,763.91 |

注：支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日 C 类基金份额对应的基金资产净值 0.8% 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：

$$\text{日基金销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额对应的资产净值} \times 0.8\% \div \text{当年天数}。$$

**6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

无。

**6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明****6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

无。

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

无。

## 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

## 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

## 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

## 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称     | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |              |
|-----------|---------------------------------------|--------------|
|           | 期末余额                                  | 当期利息收入       |
| 招商银行_活期存款 | 527,303,412.05                        | 2,037,396.37 |

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

## 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

## 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

## 6.4.11 利润分配情况

无。

## 6.4.12 期末(2022 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

## 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 |      |                 |        |        |       |        |              |           |           |    |
|----------------------|------|-----------------|--------|--------|-------|--------|--------------|-----------|-----------|----|
| 证券代码                 | 证券名称 | 成功认购日           | 受限期    | 流通受限类型 | 认购价格  | 期末估值单价 | 数量<br>(单位：股) | 期末成本总额    | 期末估值总额    | 备注 |
| 301097               | 天益医疗 | 2022 年 3 月 25 日 | 6 个月以上 | 限售股    | 52.37 | 47.83  | 249          | 13,040.13 | 11,909.67 | -  |
| 301102               | 兆讯传媒 | 2022 年 3 月 15 日 | 6 个月以上 | 限售股    | 39.88 | 31.09  | 642          | 25,602.96 | 19,959.78 | -  |

|        |      |            |          |       |        |       |       |            |            |   |
|--------|------|------------|----------|-------|--------|-------|-------|------------|------------|---|
| 301110 | 青木股份 | 2022年3月4日  | 6个月以上    | 限售股   | 63.10  | 39.85 | 202   | 12,746.20  | 8,049.70   | - |
| 301120 | 新特电气 | 2022年4月11日 | 6个月以上    | 限售股   | 13.73  | 15.49 | 1,032 | 14,169.36  | 15,985.68  | - |
| 301135 | 瑞德智能 | 2022年4月1日  | 6个月以上    | 限售股   | 31.98  | 26.26 | 338   | 10,809.24  | 8,875.88   | - |
| 301150 | 中一科技 | 2022年4月14日 | 6个月以上    | 限售股   | 163.56 | 82.76 | 269   | 43,997.64  | 22,262.44  | - |
| 301150 | 中一科技 | 2022年6月10日 | 1-6个月(含) | 限售股送股 | -      | 82.76 | 134   | -          | 11,089.84  | - |
| 301200 | 大族数控 | 2022年2月18日 | 6个月以上    | 限售股   | 76.56  | 51.92 | 857   | 65,611.92  | 44,495.44  | - |
| 301207 | 华兰疫苗 | 2022年2月10日 | 6个月以上    | 限售股   | 56.88  | 56.42 | 569   | 32,364.72  | 32,102.98  | - |
| 301216 | 万凯新材 | 2022年3月21日 | 6个月以上    | 限售股   | 35.68  | 29.84 | 1,120 | 39,961.60  | 33,420.80  | - |
| 301219 | 腾远钴业 | 2022年3月10日 | 6个月以上    | 限售股   | 173.98 | 87.82 | 321   | 55,847.58  | 28,190.22  | - |
| 301219 | 腾远钴业 | 2022年5月24日 | 1-6个月(含) | 限售股送股 | -      | 87.82 | 257   | 0          | 22,569.74  | - |
| 301228 | 实朴检测 | 2022年1月21日 | 6个月以上    | 限售股   | 20.08  | 20.34 | 373   | 7,489.84   | 7,586.82   | - |
| 301238 | 瑞泰新材 | 2022年6月10日 | 6个月以上    | 限售股   | 19.18  | 32.07 | 3,497 | 67,072.46  | 112,148.79 | - |
| 301239 | 普瑞眼科 | 2022年6月22日 | 6个月以上    | 限售股   | 33.65  | 33.65 | 575   | 19,348.75  | 19,348.75  | - |
| 301239 | 普瑞眼科 | 2022年6月22日 | 1个月内(含)  | 新股未上市 | 33.65  | 33.65 | 5,172 | 174,037.80 | 174,037.80 | - |
| 301256 | 华融化学 | 2022年3月    | 6个月以上    | 限售股   | 8.05   | 10.08 | 1,831 | 14,739.55  | 18,456.48  | - |



|                      |          | 14 日                  |                  |            |          |            |                      |              |              |    |
|----------------------|----------|-----------------------|------------------|------------|----------|------------|----------------------|--------------|--------------|----|
| 301259               | 艾布<br>鲁  | 2022<br>年 4 月<br>18 日 | 6 个月<br>以上       | 限售股        | 18.39    | 24.94      | 483                  | 8,882.37     | 12,046.02    | -  |
| 301266               | 宇邦<br>新材 | 2022<br>年 5 月<br>30 日 | 6 个月<br>以上       | 限售股        | 26.86    | 47.07      | 517                  | 13,886.62    | 24,335.19    | -  |
| 301286               | 侨源<br>股份 | 2022<br>年 6 月<br>6 日  | 6 个月<br>以上       | 限售股        | 16.91    | 19.79      | 784                  | 13,257.44    | 15,515.36    | -  |
| 301302               | 华如<br>科技 | 2022<br>年 6 月<br>16 日 | 6 个月<br>以上       | 限售股        | 52.03    | 56.42      | 466                  | 24,245.98    | 26,291.72    | -  |
| 600938               | 中国<br>海油 | 2022<br>年 4 月<br>14 日 | 6 个月<br>以上       | 限售股        | 10.80    | 15.86      | 84,004               | 907,243.20   | 1,332,303.44 | -  |
| 688052               | 纳芯<br>微  | 2022<br>年 4 月<br>14 日 | 6 个月<br>以上       | 限售股        | 230.00   | 350.81     | 6,090                | 1,400,700.00 | 2,136,432.90 | -  |
| 688237               | 超卓<br>航科 | 2022<br>年 6 月<br>24 日 | 1 个月<br>内<br>(含) | 新股未<br>上市  | 41.27    | 41.27      | 2,891                | 119,311.57   | 119,311.57   | -  |
| 688238               | 和元<br>生物 | 2022<br>年 3 月<br>15 日 | 6 个月<br>以上       | 限售股        | 13.23    | 25.32      | 12,836               | 169,820.28   | 325,007.52   | -  |
| 688251               | 井松<br>智能 | 2022<br>年 5 月<br>27 日 | 6 个月<br>以上       | 限售股        | 35.62    | 36.66      | 3,392                | 120,823.04   | 124,350.72   | -  |
| 688320               | 禾川<br>科技 | 2022<br>年 4 月<br>21 日 | 6 个月<br>以上       | 限售股        | 23.66    | 46.21      | 6,048                | 143,095.68   | 279,478.08   | -  |
| 688349               | 三一<br>重能 | 2022<br>年 6 月<br>15 日 | 6 个月<br>以上       | 限售股        | 29.80    | 36.94      | 32,650               | 972,970.00   | 1,206,091.00 | -  |
| 688400               | 凌云<br>光  | 2022<br>年 6 月<br>27 日 | 1 个月<br>内<br>(含) | 新股未<br>上市  | 21.93    | 21.93      | 13,111               | 287,524.23   | 287,524.23   | -  |
| 6.4.12.1.2 受限证券类别：债券 |          |                       |                  |            |          |            |                      |              |              |    |
| 证券<br>代码             | 证券<br>名称 | 成功<br>认购日             | 受限期              | 流通受<br>限类型 | 认购<br>价格 | 期末估<br>值单价 | 数量<br>(单<br>位：<br>张) | 期末<br>成本总额   | 期末估值总额       | 备注 |
| 111005               | 富春<br>转债 | 2022<br>年 6 月         | 1-6 个<br>月       | 老股东<br>配债  | 100.00   | 100.00     | 16,740               | 1,674,000.00 | 1,674,000.00 | -  |

|  |  |      |     |  |  |  |  |  |  |
|--|--|------|-----|--|--|--|--|--|--|
|  |  | 24 日 | (含) |  |  |  |  |  |  |
|--|--|------|-----|--|--|--|--|--|--|

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

2、受限期指自该证券实际取得之日起的流通受限期限。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只混合型基金，其预期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。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（含国债、央行票据、金融债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、企业债券、公司债券、可转换债券（含可分离交易可转换债券的纯债部分）、可交换公司债券、公开发行的次级债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、货币市场工具、债券回购、同业存单、银行存款（含协议存款、定期存款及其他银行存款）、股指期货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）。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。本基金可投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在严格控制风险的前提下，充分发挥专业研究与管理能力，追求超越业绩比较基准的投资收益，力争为投资者提供长期稳健的投资回报。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立合规审核及风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由风险管理部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。风险管理部对公司总经理负责。督察长独立行使督察权利，直接对董事会负责，就内部控制制度和执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能，定期和不定期地向董事会报告公司内部控制执行情况。

本基金的基金管理人建立了以合规审核及风险管理委员会为核心的，由督察长、风险控制委员会、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

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人招商银行股份有限公司，因而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。

于 2022 年 6 月 30 日，本基金持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.05%（2021 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）。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

于 2022 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

注：流动性受限资产、7 个工作日可变现资产的计算口径见《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》第四十条。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及

《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短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上市公司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票不得超过该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 6.4.12。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。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险,包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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。

本基金持有及承担的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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2022年6月30日   | 1年以内             | 1-5年 | 5年以上         | 不计息              | 合计               |
|---------------------|------------------|------|--------------|------------------|------------------|
| 资产                  |                  |      |              |                  |                  |
| 银行存款                | 527,303,412.05   | -    | -            | -                | 527,303,412.05   |
| 结算备付金               | 11,482,170.13    | -    | -            | -                | 11,482,170.13    |
| 存出保证金               | 739,884.67       | -    | -            | -                | 739,884.67       |
| 交易性金融资产             | 191,600,761.65   | -    | 1,674,088.06 | 2,913,549,106.00 | 3,106,823,955.71 |
| 应收股利                | -                | -    | -            | 8,239,853.78     | 8,239,853.78     |
| 应收申购款               | 84,160.99        | -    | -            | 1,758,298.98     | 1,842,459.97     |
| 资产总计                | 731,210,389.49   | -    | 1,674,088.06 | 2,923,547,258.76 | 3,656,431,736.31 |
| 负债                  |                  |      |              |                  |                  |
| 应付赎回款               | -                | -    | -            | 21,736,369.99    | 21,736,369.99    |
| 应付管理人报酬             | -                | -    | -            | 4,498,249.51     | 4,498,249.51     |
| 应付托管费               | -                | -    | -            | 749,708.24       | 749,708.24       |
| 应付清算款               | -                | -    | -            | 10,400,796.71    | 10,400,796.71    |
| 应付销售服务费             | -                | -    | -            | 522,741.21       | 522,741.21       |
| 应交税费                | -                | -    | -            | 2.87             | 2.87             |
| 其他负债                | -                | -    | -            | 2,189,245.31     | 2,189,245.31     |
| 负债总计                | -                | -    | -            | 40,097,113.84    | 40,097,113.84    |
| 利率敏感度缺口             | 731,210,389.49   | -    | 1,674,088.06 | 2,883,450,144.92 | 3,616,334,622.47 |
| 上年度末<br>2021年12月31日 | 1年以内             | 1-5年 | 5年以上         | 不计息              | 合计               |
| 资产                  |                  |      |              |                  |                  |
| 银行存款                | 2,466,432,314.08 | -    | -            | -                | 2,466,432,314.08 |
| 交易性金融资产             | -                | -    | -            | 526,486,442.67   | 526,486,442.67   |
| 应收证券清算款             | -                | -    | -            | 10,760,231.79    | 10,760,231.79    |
| 其他资产                | -                | -    | -            | 269,329.94       | 269,329.94       |
| 资产总计                | 2,466,432,314.08 | -    | -            | 537,516,004.40   | 3,003,948,318.48 |
| 负债                  |                  |      |              |                  |                  |
| 应付管理人报酬             | -                | -    | -            | 2,813,381.97     | 2,813,381.97     |
| 应付托管费               | -                | -    | -            | 468,897.01       | 468,897.01       |

|         |                  |   |   |                |                  |
|---------|------------------|---|---|----------------|------------------|
| 应付销售服务费 | -                | - | - | 227,259.60     | 227,259.60       |
| 其他负债    | -                | - | - | 514,672.45     | 514,672.45       |
| 负债总计    | -                | - | - | 4,024,211.03   | 4,024,211.03     |
| 利率敏感度缺口 | 2,466,432,314.08 | - | - | 533,491,793.37 | 2,999,924,107.45 |

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。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2022 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 5.34%(2021 年 12 月 31 日：无)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2021 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目                     | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日   |                |                |                |
|------------------------|--------------------------|----------------|----------------|----------------|
|                        | 美元<br>折合人民币<br>元         | 港币<br>折合人民币元   | 其他币种<br>折合人民币元 | 合计             |
| 以外币计价的<br>资产           |                          |                |                |                |
| 交易性金融资产                | -                        | 237,600,286.46 | -              | 237,600,286.46 |
| 资产合计                   | -                        | 237,600,286.46 | -              | 237,600,286.46 |
| 以外币计价的<br>负债           |                          |                |                |                |
| 负债合计                   | -                        | -              | -              | -              |
| 资产负债表外<br>外汇风险敞口净<br>额 | -                        | 237,600,286.46 | -              | 237,600,286.46 |
| 项目                     | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |                |                |                |
|                        | 美元<br>折合人民币<br>元         | 港币<br>折合人民币元   | 其他币种<br>折合人民币元 | 合计             |
| 以外币计价的<br>资产           |                          |                |                |                |

|                       |   |   |   |   |
|-----------------------|---|---|---|---|
| 资产合计                  | - | - | - | - |
| 以外币计价的<br>负债          |   |   |   |   |
| 负债合计                  | - | - | - | - |
| 资产负债表外<br>汇风险敞口净<br>额 | - | - | - | - |

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

| 假设 | 除汇率以外的其他市场变量保持不变  |                                 |                   |
|----|-------------------|---------------------------------|-------------------|
|    | 相关风险变量的变<br>动     | 对资产负债表日基金资产净值的<br>影响金额（单位：人民币元） |                   |
|    |                   | 本期末（2022年6月30日）                 | 上年度末（2021年12月31日） |
| 分析 | 1. 所有外币相对人民币升值 5% | 11,880,014.32                   | -                 |
|    | 2. 所有外币相对人民币贬值 5% | -11,880,014.32                  | -                 |

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市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其他价格风险。本基金股票投资（含存托凭证）占基金资产的比例为 60%-95%，其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0%-50%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的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、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种



定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2022年6月30日 |               | 上年度末<br>2021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  | 2,913,549,106.00  | 80.57         | 526,486,442.67      | 17.55         |
| 交易性金融资产—基金投资  | —                 | —             | —                   | —             |
| 交易性金融资产—债券投资  | 1,674,088.06      | 0.05          | —                   | —             |
| 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            | 2,915,223,194.06  | 80.61         | 526,486,442.67      | 17.55         |

注：债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：于 2022 年 6 月 30 日，由于本基金运行期间不足一年，尚不存在足够的经验数据，因此无法对本基金资产净值对于其他价格风险的敏感性作定量分析。

### 6.4.14 公允价值

#### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。”常见的各层次金融工具举例如下，第一层次：如以活跃市场报价估值的股票投资、股指期货投资、国债期货投资、每日开放申赎/买卖的基金投资等；第二层次：如因新发/增发尚未上市交易而按发行价格/增发价格估值的不限售的股票投资、债券投资等，使用第三方基准服务机构提供的报价估值的在交易所市场或银行间同业市场交易的债券投资、资产支持证券投资等；第三层次：如使用亚式期权模型计算流动性折扣进行估值的尚

处于限售期的股票投资，以及违约债、非指数收益法估值的长期停牌的股票等估值模型中使用不可观察输入值的投资等。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末<br>2022年6月30日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|---------------|-------------------|---------------------|
| 第一层次          | 2,907,069,927.44  | 526,486,442.67      |
| 第二层次          | 193,875,072.06    | -                   |
| 第三层次          | 5,878,956.21      | -                   |
| 合计            | 3,106,823,955.71  | 526,486,442.67      |

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

无。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目     | 金额               | 占基金总资产的比例<br>(%) |
|----|--------|------------------|------------------|
| 1  | 权益投资   | 2,913,549,106.00 | 79.68            |
|    | 其中：股票  | 2,913,549,106.00 | 79.68            |
| 2  | 基金投资   | -                | -                |
| 3  | 固定收益投资 | 193,274,849.71   | 5.29             |
|    | 其中：债券  | 193,274,849.71   | 5.29             |
|    | 资产支持证券 | -                | -                |
| 4  | 贵金属投资  | -                | -                |

|   |                   |                  |        |
|---|-------------------|------------------|--------|
| 5 | 金融衍生品投资           | -                | -      |
| 6 | 买入返售金融资产          | -                | -      |
|   | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -                | -      |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计      | 538,785,582.18   | 14.74  |
| 8 | 其他各项资产            | 10,822,198.42    | 0.30   |
| 9 | 合计                | 3,656,431,736.31 | 100.00 |

注：本基金本报告期末通过港股通机制投资香港股票的公允价值为 237,600,286.46 元，占基金资产净值比例为 6.57%。

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|------------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -                | -            |
| B  | 采矿业              | 278,275,173.09   | 7.69         |
| C  | 制造业              | 1,860,691,548.68 | 51.45        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 204,224,107.21   | 5.65         |
| E  | 建筑业              | -                | -            |
| F  | 批发和零售业           | -                | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 176,347,608.42   | 4.88         |
| H  | 住宿和餐饮业           | 3,505,137.00     | 0.10         |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 3,104,951.62     | 0.09         |
| J  | 金融业              | 19,808,156.40    | 0.55         |
| K  | 房地产业             | 62,388,006.00    | 1.73         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 13,424,689.51    | 0.37         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 53,846,266.04    | 1.49         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 139,789.02       | 0.00         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -                | -            |
| P  | 教育               | -                | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | 193,386.55       | 0.01         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -                | -            |
| S  | 综合               | -                | -            |
|    | 合计               | 2,675,948,819.54 | 74.00        |

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别 | 公允价值（人民币）     | 占基金资产净值比例（%） |
|------|---------------|--------------|
| 能源   | 91,367,147.31 | 2.53         |
| 原材料  | 38,074,256.07 | 1.05         |
| 工业   | 423.32        | 0.00         |

|      |                |      |
|------|----------------|------|
| 可选消费 | 26,608,723.74  | 0.74 |
| 公用事业 | 62,025,684.60  | 1.72 |
| 房地产  | 19,524,051.42  | 0.54 |
| 合计   | 237,600,286.46 | 6.57 |

注：本报告采用中证 CICS 一级分类标准编制。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码     | 股票名称     | 数量（股）      | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|----------|----------|------------|----------------|--------------|
| 1  | 301035   | 润丰股份     | 2,089,020  | 172,239,699.00 | 4.76         |
| 2  | 601677   | 明泰铝业     | 5,314,568  | 126,486,718.40 | 3.50         |
| 3  | 688377   | 迪威尔      | 4,047,388  | 125,266,658.60 | 3.46         |
| 4  | 002046   | 国机精工     | 8,706,100  | 119,099,448.00 | 3.29         |
| 5  | 600529   | 山东药玻     | 4,158,765  | 116,237,481.75 | 3.21         |
| 6  | 603380   | 易德龙      | 2,938,431  | 114,304,965.90 | 3.16         |
| 7  | 601717   | 郑煤机      | 4,977,776  | 71,729,752.16  | 1.98         |
| 7  | 00564 HK | 郑煤机      | 3,382,000  | 26,608,723.74  | 0.74         |
| 8  | 300873   | 海晨股份     | 3,463,868  | 97,923,548.36  | 2.71         |
| 9  | 300590   | 移为通信     | 6,991,450  | 94,873,976.50  | 2.62         |
| 10 | 600938   | 中国海油     | 1,152,305  | 19,974,155.89  | 0.55         |
| 10 | 00883 HK | 中国海洋石油   | 8,333,552  | 73,833,340.67  | 2.04         |
| 11 | 600027   | 华电国际     | 14,397,600 | 56,582,568.00  | 1.56         |
| 11 | 01071 HK | 华电国际电力股份 | 10,166,000 | 24,864,444.00  | 0.69         |
| 12 | 600547   | 山东黄金     | 4,205,180  | 78,048,140.80  | 2.16         |
| 13 | 000975   | 银泰黄金     | 7,663,975  | 74,647,116.50  | 2.06         |
| 14 | 300911   | 亿田智能     | 860,661    | 66,141,797.85  | 1.83         |
| 15 | 002318   | 久立特材     | 3,659,600  | 58,517,004.00  | 1.62         |
| 16 | 600023   | 浙能电力     | 16,687,443 | 57,905,427.21  | 1.60         |
| 17 | 600497   | 驰宏锌锗     | 10,959,600 | 56,880,324.00  | 1.57         |
| 18 | 003038   | 鑫铂股份     | 1,115,100  | 56,201,040.00  | 1.55         |
| 19 | 603337   | 杰克股份     | 2,532,288  | 54,393,546.24  | 1.50         |
| 20 | 002353   | 杰瑞股份     | 1,203,907  | 48,517,452.10  | 1.34         |
| 21 | 605166   | 聚合顺      | 3,692,777  | 47,119,834.52  | 1.30         |
| 22 | 601137   | 博威合金     | 2,656,300  | 47,016,510.00  | 1.30         |
| 23 | 300938   | 信测标准     | 1,565,550  | 43,350,079.50  | 1.20         |
| 24 | 836077   | 吉林碳谷     | 659,881    | 41,110,586.30  | 1.14         |
| 25 | 605033   | 美邦股份     | 1,697,061  | 39,354,844.59  | 1.09         |
| 26 | 01818 HK | 招金矿业     | 6,490,000  | 38,074,256.07  | 1.05         |
| 27 | 600048   | 保利发展     | 1,865,100  | 32,564,646.00  | 0.90         |
| 28 | 02380 HK | 中国电力     | 7,529,105  | 32,065,300.22  | 0.89         |
| 29 | 600011   | 华能国际     | 3,721,300  | 26,197,952.00  | 0.72         |

|    |          |          |           |               |      |
|----|----------|----------|-----------|---------------|------|
| 29 | 00902 HK | 华能国际电力股份 | 1,524,000 | 5,095,940.38  | 0.14 |
| 30 | 600383   | 金地集团     | 2,219,000 | 29,823,360.00 | 0.82 |
| 31 | 601857   | 中国石油     | 4,180,863 | 22,158,573.90 | 0.61 |
| 31 | 00857 HK | 中国石油股份   | 1,892,000 | 6,051,392.86  | 0.17 |
| 32 | 000060   | 中金岭南     | 6,081,600 | 27,123,936.00 | 0.75 |
| 33 | 601952   | 苏垦农发     | 1,923,839 | 26,914,507.61 | 0.74 |
| 34 | 002971   | 和远气体     | 1,154,900 | 26,597,347.00 | 0.74 |
| 35 | 000543   | 皖能电力     | 6,292,900 | 25,108,671.00 | 0.69 |
| 36 | 000600   | 建投能源     | 5,670,700 | 23,930,354.00 | 0.66 |
| 37 | 600519   | 贵州茅台     | 11,500    | 23,517,500.00 | 0.65 |
| 38 | 600026   | 中远海能     | 2,182,465 | 22,544,863.45 | 0.62 |
| 38 | 01138 HK | 中远海能     | 99        | 423.32        | 0.00 |
| 39 | 603109   | 神驰机电     | 1,277,540 | 22,254,746.80 | 0.62 |
| 40 | 000519   | 中兵红箭     | 737,500   | 21,498,125.00 | 0.59 |
| 41 | 603112   | 华翔股份     | 1,423,700 | 21,227,367.00 | 0.59 |
| 42 | 00688 HK | 中国海外发展   | 920,500   | 19,522,619.40 | 0.54 |
| 43 | 300268   | 佳沃食品     | 641,500   | 19,084,625.00 | 0.53 |
| 44 | 605222   | 起帆电缆     | 821,920   | 18,715,118.40 | 0.52 |
| 45 | 601111   | 中国国航     | 1,589,041 | 18,448,766.01 | 0.51 |
| 46 | 002049   | 紫光国微     | 93,078    | 17,658,758.16 | 0.49 |
| 47 | 002493   | 荣盛石化     | 1,144,050 | 17,606,929.50 | 0.49 |
| 48 | 001205   | 盛航股份     | 884,989   | 17,522,782.20 | 0.48 |
| 49 | 300726   | 宏达电子     | 269,600   | 16,491,432.00 | 0.46 |
| 50 | 000568   | 泸州老窖     | 66,300    | 16,345,602.00 | 0.45 |
| 51 | 601233   | 桐昆股份     | 1,027,500 | 16,316,700.00 | 0.45 |
| 52 | 603662   | 柯力传感     | 798,684   | 15,670,180.08 | 0.43 |
| 53 | 601968   | 宝钢包装     | 2,005,800 | 15,585,066.00 | 0.43 |
| 54 | 600499   | 科达制造     | 734,100   | 15,151,824.00 | 0.42 |
| 55 | 600483   | 福能股份     | 1,030,500 | 14,499,135.00 | 0.40 |
| 56 | 003025   | 思进智能     | 692,958   | 14,337,301.02 | 0.40 |
| 57 | 002468   | 申通快递     | 1,146,600 | 13,667,472.00 | 0.38 |
| 58 | 600989   | 宝丰能源     | 909,300   | 13,321,245.00 | 0.37 |
| 59 | 300795   | 米奥会展     | 559,700   | 13,192,129.00 | 0.36 |
| 60 | 002801   | 微光股份     | 425,525   | 12,701,921.25 | 0.35 |
| 61 | 600089   | 特变电工     | 442,900   | 12,131,031.00 | 0.34 |
| 62 | 02883 HK | 中海油田服务   | 1,746,000 | 11,482,413.78 | 0.32 |
| 63 | 600489   | 中金黄金     | 1,513,600 | 11,185,504.00 | 0.31 |
| 64 | 688676   | 金盘科技     | 411,062   | 10,687,612.00 | 0.30 |
| 65 | 300059   | 东方财富     | 402,441   | 10,222,001.40 | 0.28 |
| 66 | 603799   | 华友钴业     | 104,940   | 10,034,362.80 | 0.28 |
| 67 | 300797   | 钢研纳克     | 720,260   | 9,809,941.20  | 0.27 |

|     |        |      |         |              |      |
|-----|--------|------|---------|--------------|------|
| 68  | 300033 | 同花顺  | 99,700  | 9,586,155.00 | 0.27 |
| 69  | 603916 | 苏博特  | 356,700 | 9,092,283.00 | 0.25 |
| 70  | 002155 | 湖南黄金 | 683,300 | 8,295,262.00 | 0.23 |
| 71  | 300750 | 宁德时代 | 14,200  | 7,582,800.00 | 0.21 |
| 72  | 605189 | 富春染织 | 366,631 | 7,361,950.48 | 0.20 |
| 73  | 605123 | 派克新材 | 50,500  | 7,106,360.00 | 0.20 |
| 74  | 000603 | 盛达资源 | 628,200 | 7,086,096.00 | 0.20 |
| 75  | 600362 | 江西铜业 | 377,000 | 6,721,910.00 | 0.19 |
| 76  | 600029 | 南方航空 | 851,800 | 6,226,658.00 | 0.17 |
| 77  | 301073 | 君亭酒店 | 50,550  | 3,505,137.00 | 0.10 |
| 78  | 002879 | 长缆科技 | 222,600 | 3,468,108.00 | 0.10 |
| 79  | 688052 | 纳芯微  | 6,090   | 2,136,432.90 | 0.06 |
| 80  | 301238 | 瑞泰新材 | 34,966  | 1,296,327.26 | 0.04 |
| 81  | 688349 | 三一重能 | 32,650  | 1,206,091.00 | 0.03 |
| 82  | 688120 | 华海清科 | 4,822   | 1,197,784.80 | 0.03 |
| 83  | 688072 | 拓荆科技 | 5,300   | 822,030.00   | 0.02 |
| 84  | 688302 | 海创药业 | 13,082  | 582,018.18   | 0.02 |
| 85  | 301219 | 腾远钴业 | 5,762   | 530,176.28   | 0.01 |
| 86  | 688279 | 峰昭科技 | 5,505   | 406,929.60   | 0.01 |
| 87  | 688153 | 唯捷创芯 | 7,674   | 391,374.00   | 0.01 |
| 88  | 688337 | 普源精电 | 6,563   | 381,179.04   | 0.01 |
| 89  | 301150 | 中一科技 | 4,025   | 365,815.66   | 0.01 |
| 90  | 688046 | 药康生物 | 12,070  | 353,651.00   | 0.01 |
| 91  | 301216 | 万凯新材 | 11,195  | 351,287.05   | 0.01 |
| 92  | 688238 | 和元生物 | 12,836  | 325,007.52   | 0.01 |
| 93  | 688119 | 中钢洛耐 | 33,327  | 293,944.14   | 0.01 |
| 94  | 688400 | 凌云光  | 13,111  | 287,524.23   | 0.01 |
| 95  | 301302 | 华如科技 | 4,651   | 282,999.62   | 0.01 |
| 96  | 301266 | 宇邦新材 | 5,161   | 279,894.51   | 0.01 |
| 97  | 688320 | 禾川科技 | 6,048   | 279,478.08   | 0.01 |
| 98  | 688325 | 赛微微电 | 4,039   | 247,186.80   | 0.01 |
| 99  | 301102 | 兆讯传媒 | 6,414   | 211,821.06   | 0.01 |
| 100 | 301256 | 华融化学 | 18,308  | 196,408.08   | 0.01 |
| 101 | 301239 | 普瑞眼科 | 5,747   | 193,386.55   | 0.01 |
| 102 | 301120 | 新特电气 | 10,311  | 182,450.94   | 0.01 |
| 103 | 301286 | 侨源股份 | 7,839   | 176,722.11   | 0.00 |
| 104 | 301259 | 艾布鲁  | 4,828   | 139,789.02   | 0.00 |
| 105 | 301097 | 天益医疗 | 2,486   | 130,023.27   | 0.00 |
| 106 | 688251 | 井松智能 | 3,392   | 124,350.72   | 0.00 |
| 107 | 688237 | 超卓航科 | 2,891   | 119,311.57   | 0.00 |
| 108 | 301135 | 瑞德智能 | 3,376   | 96,066.48    | 0.00 |
| 109 | 688193 | 仁度生物 | 1,635   | 88,453.50    | 0.00 |

|     |          |        |       |           |      |
|-----|----------|--------|-------|-----------|------|
| 110 | 688102   | 斯瑞新材   | 6,030 | 77,847.30 | 0.00 |
| 111 | 001270   | 铖昌科技   | 568   | 57,481.60 | 0.00 |
| 112 | 301200   | 大族数控   | 857   | 44,495.44 | 0.00 |
| 113 | 601089   | 福元医药   | 1,749 | 36,816.45 | 0.00 |
| 114 | 301207   | 华兰疫苗   | 569   | 32,102.98 | 0.00 |
| 115 | 001323   | 慕思股份   | 573   | 28,111.38 | 0.00 |
| 116 | 603191   | 望变电气   | 1,149 | 26,197.20 | 0.00 |
| 117 | 603206   | 嘉环科技   | 1,210 | 23,353.00 | 0.00 |
| 118 | 603051   | 鹿山新材   | 272   | 21,488.00 | 0.00 |
| 119 | 001228   | 永泰运    | 383   | 20,739.45 | 0.00 |
| 120 | 001308   | 康冠科技   | 667   | 19,456.39 | 0.00 |
| 121 | 603070   | 万控智造   | 775   | 16,197.50 | 0.00 |
| 122 | 603097   | 江苏华辰   | 577   | 13,617.20 | 0.00 |
| 123 | 603209   | 兴通股份   | 595   | 13,518.40 | 0.00 |
| 124 | 001268   | 联合精密   | 409   | 11,337.48 | 0.00 |
| 125 | 603272   | 联翔股份   | 443   | 9,723.85  | 0.00 |
| 126 | 301110   | 青木股份   | 202   | 8,049.70  | 0.00 |
| 127 | 301228   | 实朴检测   | 373   | 7,586.82  | 0.00 |
| 128 | 00884 HK | 旭辉控股集团 | 425   | 1,432.02  | 0.00 |

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码     | 股票名称     | 本期累计买入金额       | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|----------|----------|----------------|----------------|
| 1  | 601677   | 明泰铝业     | 160,002,065.57 | 5.33           |
| 2  | 003038   | 鑫铂股份     | 114,517,840.14 | 3.82           |
| 3  | 600938   | 中国海油     | 17,839,647.00  | 0.59           |
| 3  | 00883 HK | 中国海洋石油   | 84,679,245.16  | 2.82           |
| 4  | 601717   | 郑煤机      | 72,883,681.70  | 2.43           |
| 4  | 00564 HK | 郑煤机      | 29,242,540.58  | 0.97           |
| 5  | 002046   | 国机精工     | 101,759,551.41 | 3.39           |
| 6  | 600529   | 山东药玻     | 95,841,797.54  | 3.19           |
| 7  | 603380   | 易德龙      | 92,450,153.09  | 3.08           |
| 8  | 300873   | 海晨股份     | 90,772,028.07  | 3.03           |
| 9  | 600547   | 山东黄金     | 88,172,123.31  | 2.94           |
| 10 | 600027   | 华电国际     | 56,555,652.14  | 1.89           |
| 10 | 01071 HK | 华电国际电力股份 | 27,340,744.32  | 0.91           |
| 11 | 603337   | 杰克股份     | 83,058,842.65  | 2.77           |
| 12 | 000975   | 银泰黄金     | 79,578,458.11  | 2.65           |
| 13 | 300797   | 钢研纳克     | 75,394,497.40  | 2.51           |
| 14 | 600497   | 驰宏锌锗     | 74,616,800.18  | 2.49           |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 15 | 301035 | 润丰股份 | 68,985,365.98 | 2.30 |
| 16 | 300568 | 星源材质 | 66,827,278.01 | 2.23 |
| 17 | 001205 | 盛航股份 | 63,074,463.09 | 2.10 |
| 18 | 002318 | 久立特材 | 58,770,753.85 | 1.96 |
| 19 | 300398 | 飞凯材料 | 55,298,434.30 | 1.84 |
| 20 | 300911 | 亿田智能 | 53,954,848.08 | 1.80 |

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

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码     | 股票名称 | 本期累计卖出金额       | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|----------|------|----------------|-----------------|
| 1  | 300398   | 飞凯材料 | 126,205,548.59 | 4.21            |
| 2  | 003038   | 鑫铂股份 | 65,004,751.80  | 2.17            |
| 3  | 000933   | 神火股份 | 64,284,012.91  | 2.14            |
| 4  | 300568   | 星源材质 | 58,310,648.15  | 1.94            |
| 5  | 001205   | 盛航股份 | 57,982,581.94  | 1.93            |
| 6  | 000807   | 云铝股份 | 48,993,422.17  | 1.63            |
| 7  | 002971   | 和远气体 | 48,264,050.00  | 1.61            |
| 8  | 300787   | 海能实业 | 45,589,929.51  | 1.52            |
| 9  | 000519   | 中兵红箭 | 45,439,791.00  | 1.51            |
| 10 | 300797   | 钢研纳克 | 42,910,054.00  | 1.43            |
| 11 | 601899   | 紫金矿业 | 35,734,969.00  | 1.19            |
| 12 | 000630   | 铜陵有色 | 31,336,373.00  | 1.04            |
| 13 | 002922   | 伊戈尔  | 28,575,305.00  | 0.95            |
| 14 | 600026   | 中远海能 | 12,249,663.00  | 0.41            |
| 14 | 01138 HK | 中远海能 | 14,152,342.45  | 0.47            |
| 15 | 300268   | 佳沃食品 | 26,280,031.00  | 0.88            |
| 16 | 002801   | 微光股份 | 23,695,171.00  | 0.79            |
| 17 | 002361   | 神剑股份 | 23,001,192.00  | 0.77            |
| 18 | 600399   | 抚顺特钢 | 21,589,258.00  | 0.72            |
| 19 | 300590   | 移为通信 | 21,412,814.00  | 0.71            |
| 20 | 601677   | 明泰铝业 | 19,224,791.00  | 0.64            |

注：“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|              |                  |
|--------------|------------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 3,479,756,204.58 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 1,266,666,831.04 |

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，



不考虑相关交易费用。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值           | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-----------|----------------|---------------|
| 1  | 国家债券      | -              | -             |
| 2  | 央行票据      | -              | -             |
| 3  | 金融债券      | 191,600,761.65 | 5.30          |
|    | 其中：政策性金融债 | 191,600,761.65 | 5.30          |
| 4  | 企业债券      | -              | -             |
| 5  | 企业短期融资券   | -              | -             |
| 6  | 中期票据      | -              | -             |
| 7  | 可转债（可交换债） | 1,674,088.06   | 0.05          |
| 8  | 同业存单      | -              | -             |
| 9  | 其他        | -              | -             |
| 10 | 合计        | 193,274,849.71 | 5.34          |

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 数量（张）     | 公允价值           | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|----------|-----------|----------------|---------------|
| 1  | 220201 | 22 国开 01 | 1,500,000 | 151,586,547.95 | 4.19          |
| 2  | 220206 | 22 国开 06 | 400,000   | 40,014,213.70  | 1.11          |
| 3  | 111005 | 富春转债     | 16,740    | 1,674,088.06   | 0.05          |

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

无。

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

无。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

### 7.12 投资组合报告附注

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

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

2022 年 3 月 25 日，中国银行保险监督管理委员会公示银保监罚决字（2022）8 号行政处罚决定书，给予国家开发银行罚款 440 万元。

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

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

#### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

#### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称    | 金额            |
|----|-------|---------------|
| 1  | 存出保证金 | 739,884.67    |
| 2  | 应收清算款 | -             |
| 3  | 应收股利  | 8,239,853.78  |
| 4  | 应收利息  | -             |
| 5  | 应收申购款 | 1,842,459.97  |
| 6  | 其他应收款 | -             |
| 7  | 待摊费用  | -             |
| 8  | 其他    | -             |
| 9  | 合计    | 10,822,198.42 |

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例（%） | 流通受限情况说明 |
|----|------|------|-------------|--------------|----------|
|----|------|------|-------------|--------------|----------|

|   |        |      |              |      |     |
|---|--------|------|--------------|------|-----|
| 1 | 600938 | 中国海油 | 1,332,303.44 | 0.04 | 限售股 |
|---|--------|------|--------------|------|-----|

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 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 (%) |
| 交银启诚混合 A | 52,313    | 51,475.79 | 73,408,315.06  | 2.73       | 2,619,444,533.22 | 97.27      |
| 交银启诚混合 C | 15,800    | 47,566.21 | 222,773,972.73 | 29.64      | 528,772,193.91   | 70.36      |
| 合计       | 68,113    | 50,568.89 | 296,182,287.79 | 8.60       | 3,148,216,727.13 | 91.40      |

### 8.2 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 | 交银启诚混合 A | 9,361,385.56  | 0.35         |
|                  | 交银启诚混合 C | 4,111,205.79  | 0.55         |
|                  | 合计       | 13,472,591.35 | 0.39         |

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目                             | 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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 交银启诚混合 A | >100               |
|                                | 交银启诚混合 C | >100               |
|                                | 合计       | >100               |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 交银启诚混合 A | >100               |
|                                | 交银启诚混合 C | >100               |
|                                | 合计       | >100               |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                                     | 交银启诚混合 A         | 交银启诚混合 C       |
|--|------------------|----------------|
| 基金合同生效日<br>(2021 年 12 月 8<br>日) 基金份额总额 | 2,521,641,970.95 | 450,204,864.44 |
| 本报告期初基金<br>份额总额                        | 2,521,641,970.95 | 450,204,864.44 |
| 本报告期基金总申<br>购份额                        | 522,415,795.19   | 423,056,030.21 |
| 减: 本报告期基金<br>总赎回份额                     | 351,204,917.86   | 121,714,728.01 |
| 本报告期基金拆分<br>变动份额                       | -                | -              |
| 本报告期期末基金<br>份额总额                       | 2,692,852,848.28 | 751,546,166.64 |

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

无。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 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。

### 2、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金托管人及其高级管理人员本报告期内未受监管部门稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称  | 交易单元数量 | 股票交易             |                  | 应支付该券商的佣金  |                | 备注 |
|-------|--------|------------------|------------------|------------|----------------|----|
|       |        | 成交金额             | 占当期股票成交总额的比例 (%) | 佣金         | 占当期佣金总量的比例 (%) |    |
| 中信证券  | 1      | 1,060,969,185.41 | 22.42            | 949,524.38 | 21.96          | -  |
| 海通证券  | 1      | 1,018,809,166.84 | 21.53            | 928,314.69 | 21.47          | -  |
| 长江证券  | 1      | 851,280,883.75   | 17.99            | 792,800.78 | 18.34          | -  |
| 东北证券  | 2      | 781,956,218.39   | 16.52            | 728,234.04 | 16.85          | -  |
| 华西证券  | 2      | 409,853,012.50   | 8.66             | 381,695.12 | 8.83           | -  |
| 浙商证券  | 2      | 345,847,837.22   | 7.31             | 322,089.47 | 7.45           | -  |
| 中泰证券  | 1      | 187,073,723.64   | 3.95             | 174,220.40 | 4.03           | -  |
| 广发证券  | 1      | 39,735,759.09    | 0.84             | 11,920.75  | 0.28           | -  |
| 方正证券  | 2      | 27,734,646.18    | 0.59             | 25,828.69  | 0.60           | -  |
| 国盛证券  | 1      | 9,019,346.00     | 0.19             | 8,399.68   | 0.19           | -  |
| 东吴证券  | 1      | -                | -                | -          | -              | -  |
| 国元证券  | 1      | -                | -                | -          | -              | -  |
| 太平洋证券 | 1      | -                | -                | -          | -              | -  |

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | 债券回购交易 | 权证交易 |
|------|------|--------|------|
|------|------|--------|------|

|       | 成交金额          | 占当期债券成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 (%) |
|-------|---------------|------------------|------|--------------------|------|------------------|
| 中信证券  | 12,251,085.70 | 100.00           | -    | -                  | -    | -                |
| 海通证券  | -             | -                | -    | -                  | -    | -                |
| 长江证券  | -             | -                | -    | -                  | -    | -                |
| 东北证券  | -             | -                | -    | -                  | -    | -                |
| 华西证券  | -             | -                | -    | -                  | -    | -                |
| 浙商证券  | -             | -                | -    | -                  | -    | -                |
| 中泰证券  | -             | -                | -    | -                  | -    | -                |
| 广发证券  | -             | -                | -    | -                  | -    | -                |
| 方正证券  | -             | -                | -    | -                  | -    | -                |
| 国盛证券  | -             | -                | -    | -                  | -    | -                |
| 东吴证券  | -             | -                | -    | -                  | -    | -                |
| 国元证券  | -             | -                | -    | -                  | -    | -                |
| 太平洋证券 | -             | -                | -    | -                  | -    | -                |

注：1、报告期内，本基金以上交易单元均为新增交易单元；

2、租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：券商基本面评价（财务状况、经营状况）、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）、券商每日信息评价（及时性和有效性）和券商协作表现评价等四个方面；

3、租用证券公司交易单元的程序：首先根据租用证券公司交易单元的选择标准进行综合评价，然后根据评价选择基金交易单元。研究部提交方案，并上报公司批准。

## 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项  | 法定披露方式                | 法定披露日期      |
|----|---|-----------------------|-------------|
| 1  | 交银施罗德基金管理有限公司关于自有资金拟购买旗下偏股型基金的公告                | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站 | 2022年01月29日 |
| 2  | 交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德启诚混合型证券投资基金开放日常赎回业务的公告      | 上海证券报、公司网站            | 2022年03月03日 |
| 3  | 交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金可投资北交所上市股票的风险提示性公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站 | 2022年03月15日 |
| 4  | 交银施罗德基金管理有限公司关于增加上海钜派钰茂基金销售有限公司为旗下基金销售机构的公告     | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站 | 2022年03月18日 |

|    |   |                       |                  |
|----|---|-----------------------|------------------|
| 5  | 交银施罗德基金管理有限公司关于自有资金拟购买旗下偏股型基金的公告                            | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站 | 2022 年 03 月 18 日 |
| 6  | 交银施罗德基金管理有限公司关于增加东兴证券股份有限公司为旗下基金销售机构的公告                     | 上海证券报、公司网站            | 2022 年 04 月 13 日 |
| 7  | 交银施罗德启诚混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告                             | 公司网站                  | 2022 年 04 月 21 日 |
| 8  | 交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德启诚混合型证券投资基金开放日常申购、定期定额投资业务并设大额申购业务限额的公告 | 上海证券报、公司网站            | 2022 年 04 月 28 日 |
| 9  | 交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德启诚混合型证券投资基金调整大额申购（定期定额投资）业务限额的公告        | 上海证券报、公司网站            | 2022 年 06 月 03 日 |
| 10 | 交银施罗德基金管理有限公司关于增加国都证券股份有限公司为旗下基金的销售机构的公告                    | 上海证券报、公司网站            | 2022 年 06 月 14 日 |

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予交银施罗德启诚混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《交银施罗德启诚混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《交银施罗德启诚混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《交银施罗德启诚混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、关于申请募集注册交银施罗德启诚混合型证券投资基金的法律意见书；
- 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启诚混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

## 12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

## 12.3 查阅方式

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

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