

# 交银施罗德稳固收益债券型证券投资基金 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：交银施罗德基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2023 年 3 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	5
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
3.4 过去三年基金的利润分配情况 .....	10
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	12
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 .....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	15
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明 .....	16
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	16
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	16
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 .....	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	16
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>16</b>
6.1 审计报告基本信息 .....	16
6.2 审计报告的基本内容 .....	16
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>18</b>
7.1 资产负债表 .....	18
7.2 利润表 .....	20
7.3 净资产（基金净值）变动表 .....	21
7.4 报表附注 .....	24
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>58</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	58

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	59
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	60
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	61
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	81
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	82
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	82
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	82
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	82
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	82
8.11 投资组合报告附注 .....	83
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>84</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	84
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	84
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	85
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>85</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>85</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	85
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	85
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	85
11.4 基金投资策略的改变 .....	86
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	86
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	86
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	86
11.8 其他重大事件 .....	89
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>92</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	92
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	92
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>92</b>
13.1 备查文件目录 .....	92
13.2 存放地点 .....	93
13.3 查阅方式 .....	93

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	交银施罗德稳固收益债券型证券投资基金	
基金简称	交银稳固收益债券	
基金主代码	519726	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 5 月 31 日	
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,234,772,247.50 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	交银稳固收益债券 A	交银稳固收益债券 C
下属分级基金的交易代码	519726	016474
报告期末下属分级基金的份额总额	2,048,420,849.76 份	186,351,397.74 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在追求本金安全、有效控制风险的基础上，力争实现基金资产的持续稳定增值。
投资策略	<p>本基金在逐期追求投资本金安全的风险控制目标下追求基金收益的稳定递增。自转型完成之日起，本基金以 3 年为一个运作周期逐期运作，每一运作周期期满后且后一运作周期起始日前，安排不少于 5 个工作日的运作调整期，除对持续持有期少于 7 日的基金份额持有人收取不低于 1.5% 的赎回费以外，投资者在运作调整期内办理本基金的申购和赎回业务时不收取申购、赎回费用。</p> <p>本基金在每一运作周期的投资目标为力求期末基金份额净值加上该运作周期累计分红金额不低于该运作周期第 1 个工作日的基金份额净值。在每一运作周期中，本基金通过适当的投资策略和运作机制，优化基金组合的风险收益和流动性，增强对组合流动性的保护，力争实现设定的投资目标，满足投资人获取持续稳定收益的需求。</p> <p>本基金不设置担保人或保本义务人，不承诺基金份额持有人在本基金运作周期期满时可以获得保本金额的保证。</p>
业绩比较基准	三年期银行定期存款税后收益率
风险收益特征	本基金为债券型证券投资基金，其长期平均的预期收益和风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	交银施罗德基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	王晚婷	秦一楠
	联系电话	(021) 61055050	010-66060069
	电子邮箱	xxpl@jysld.com, disclosure@jysld.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-700-5000, 021-61055000	95599
传真		(021) 61055054	010-68121816
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区银城中路188号交通银行大楼二层(裙)	北京市东城区建国门内大街69号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道8号国金中心二期21-22楼	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码		200120	100031
法定代表人		阮红	谷澍

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	中国上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中心11楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2022年	2022年8月18日 (基金合同生效日)-2022年12月31日	2021年		2020年	
		交银稳固收益债券A	交银稳固收益债券C	交银稳固收益债券A	交银稳固收益债券C	交银稳固收益债券A
本期已实现收益	-42,185,046.60	-3,829,791.94	2,122,142.93	-	2,805,720.55	-
本期利润	-70,467,071.54	-5,065,702.81	2,290,876.03	-	2,261,236.27	-
加权平均基金份额本期利润	-0.1280	-0.0656	0.0565	-	0.0314	-

本期加权平均 净值利润率	-10.23%	-5.22%	4.83%	-	2.77%	-
本期基金份额 净值增长率	4.35%	-4.58%	4.93%	-	1.88%	-
3.1.2 期末数 据和指标	2022 年末		2021 年末		2020 年末	
期末可供分配 利润	115,302,546.65	42,563,470.08	3,852,742.61	-	2,193,705.65	-
期末可供分配 基金份额利润	0.0563	0.2284	0.1009	-	0.0495	-
期末基金资产 净值	2,329,452,751.71	230,828,886.93	45,367,821.80	-	50,198,883.24	-
期末基金份额 净值	1.1372	1.2387	1.1887	-	1.1329	-
3.1.3 累计期 末指标	2022 年末		2021 年末		2020 年末	
基金份额累计 净值增长率	15.38%	-4.58%	10.58%	-	5.39%	-

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

交银稳固收益债券 A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①—③	②—④
过去三个月	-1.86%	0.26%	0.70%	0.01%	-2.56%	0.25%
过去六个月	-1.96%	0.30%	1.41%	0.01%	-3.37%	0.29%
过去一年	4.35%	0.27%	2.79%	0.01%	1.56%	0.26%
过去三年	11.54%	0.26%	8.37%	0.01%	3.17%	0.25%
自基金合同生效 起至今	15.38%	0.24%	10.01%	0.01%	5.37%	0.23%

交银稳固收益债券 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
过去三个月	-1.94%	0.26%	0.70%	0.01%	-2.64%	0.25%
自基金合同生效 起至今	-4.58%	0.29%	1.04%	0.01%	-5.62%	0.28%

注：1、本基金的业绩比较基准为三年期银行定期存款税后收益率。

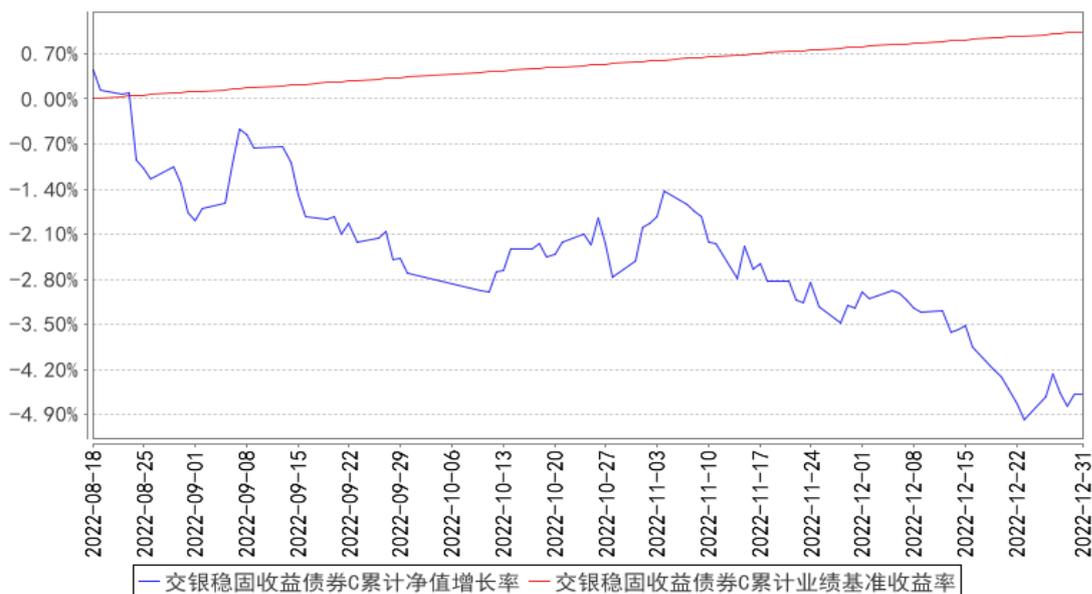
2、交银稳固收益债券 C 上述“自基金合同生效起至今”实际为“自基金份额类别首次确认起至今”，下同。

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

交银稳固收益债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



交银稳固收益债券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

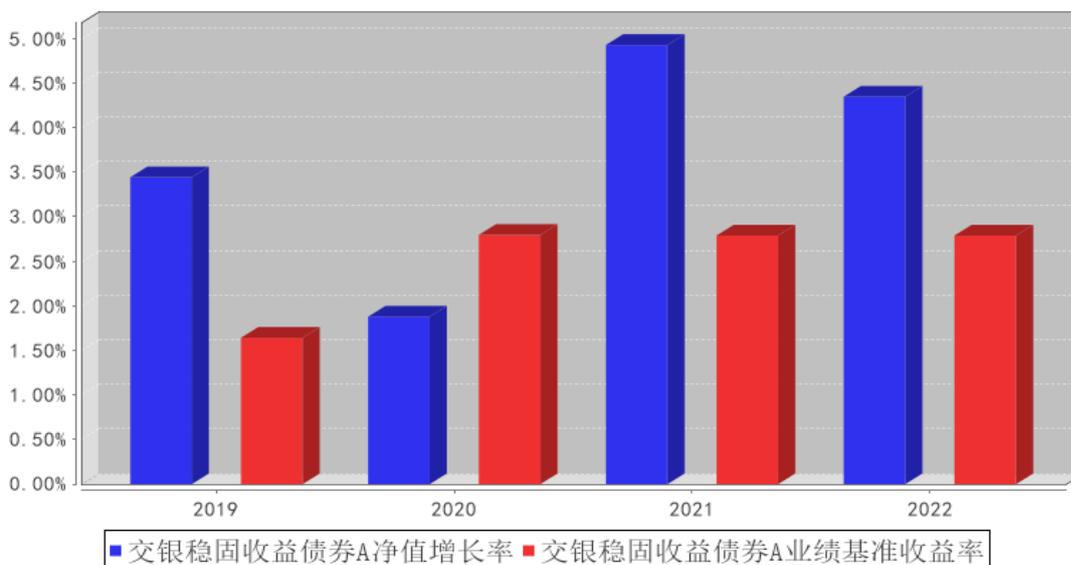


注：1、本基金由交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金转型而来。基金转型日为 2019 年 5 月 31 日。本基金的投资转型期为交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金保本周期到期选择期截止日次日（即 2019 年 5 月 31 日）起的 3 个月。截至投资转型期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

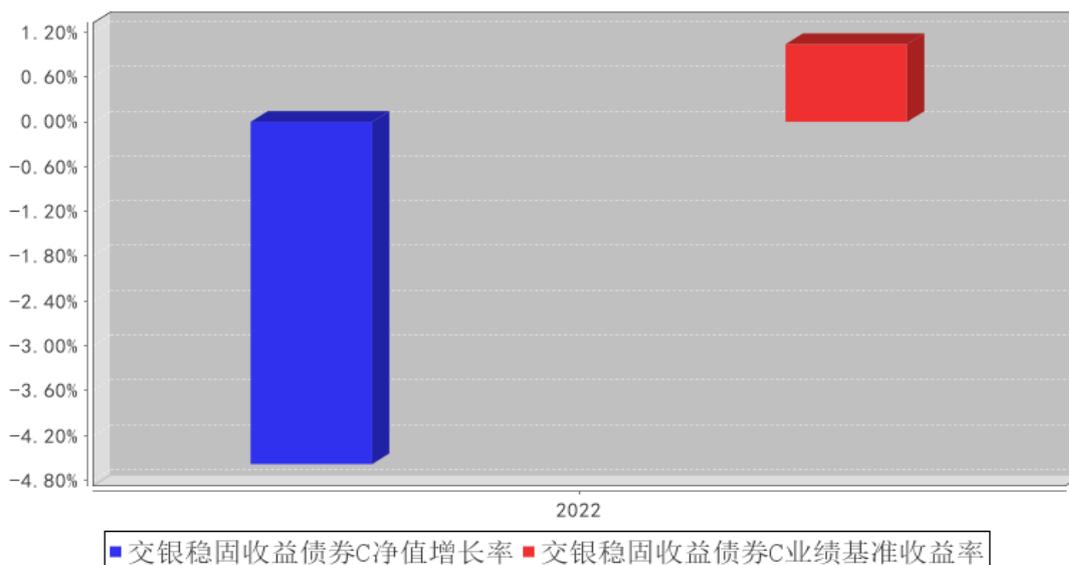
2、本基金自 2022 年 8 月 17 日起，开始销售 C 类份额，投资者提交的申购申请于 2022 年 8 月 18 日被确认并将有效份额登记在册。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

交银稳固收益债券A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



交银稳固收益债券C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

交银稳固收益债券 A

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2022 年	1.030	144,344,458.86	70,765,240.93	215,109,699.79	-
2021 年	-	-	-	-	-
2020 年	-	-	-	-	-
合计	1.030	144,344,458.86	70,765,240.93	215,109,699.79	-

## § 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 116 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		
周 珊	交银稳固收益债券的基金经理	2022 年 4 月 21 日	-	14 年	周珊珊女士，北京大学工程硕士、厦门大学经济学学士。历任华安基金管理有限公司交易员、银河基金管理有限公司基金经理、国金基金管理有限公司投资经理。2016 年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任专户投资部投资经理。
唐 赉	交银信用添利债券（LOF）、交银双利债券、交银双轮动债券、交银定期支付月月丰债券、交银强化回报债券的基金经理	2020 年 07 月 14 日	2022 年 07 月 09 日	12 年	唐赉先生，香港城市大学电子工程硕士。历任渣打银行环球企业部助理客户经理、平安资产管理公司信用分析员。2012 年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任固定收益研究员、基金经理助理。2015 年 11 月 7 日至 2018 年 6 月 1 日担任转型前的交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月 31 日至 2019 年 10 月 23 日担任交银施罗德裕通纯债债券型证券投资基金的基金经理。2018 年 6 月 2 日至 2019 年 12 月 13 日担任交银施罗德安心收益债券型证券投资基金的基金经理。2020 年 7 月 14 日至 2022 年 1 月 18 日担任交银施罗德增强收益债券型证券投资基金的基金经理。2019 年 2 月 28 日至 2022 年 3 月 11 日担任交银施罗德荣鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 7 月 14 日至 2022 年 7 月 8 日担任交银施罗德稳固收益债券型证券投资基金的基金经理。

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

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

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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 公平交易制度和控制方法

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

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

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

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

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

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

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

对于交易所公开竞价交易，遵循“价格优先、时间优先”的原则，全部通过交易系统进行比例分

配；对于非集中竞价交易、以公司名义进行的场外交易，遵循公平交易分配原则对交易结果进行分配。

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

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

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年，疫情反复，国内经济数据乏善可陈。二季度和四季度扰动较为明显，叠加地产失速下滑，制约经济修复。分项看，广义财政与留抵退税、专项再贷款对全年基建和制造业投资形成有力支撑，出口上半年维持高景气、年底快速回落。消费和地产是主要拖累，居民信心不足抑制内需。上半年，债券市场在流动性宽松的背景下，收益率窄幅震荡。七月初，国内地产风险发酵。八月，央行超预期降息，十年国债收益率下行至年内低点 2.58%。十月下旬，资金面持续收敛，地产政策持续加码，叠加机构赎回负反馈，年底收益率快速上行后弱势震荡。权益市场大幅波动，受制于美联储加息以及疫情反复，市场在四月底之前单边下跌，随后国务院“稳住经济大盘”工作会议召开，经济预期有所修复，以新能源为代表的成长股快速反弹。七月，美联储加息 75BP，美联储极鹰派的加息策略对全球其它央行产生了明显的溢出效应，市场再度快速向下调整。报告期内，本基金的债券部分以短久期纯债和部分可转债为主。权益资产则坚持长期主义，整体偏成长风格，并根据市场风险适度调整。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

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

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2023 年，随着全球货币紧缩的效果显现，叠加欧洲能源危机和供应链瓶颈对增长的持续抑制，预计海外主要经济体增长可能在 2022 年四季度至 2023 年上半年间逐季减速，将对我国出口形成负面冲击。一方面，美国商品消费已经降速，而欧洲面临衰退风险，叠加能源价格推高预防性储蓄，进一步拖累海外商品消费需求。另一方面，由于本轮全球库存被动累积，尤其是企业和居民端的“隐性库存”高企，全球工业生产和贸易可能加速下行。虽然中国出口仍享有明显的供应链和成本优势，但可能难以摆脱全球工业周期走弱的影响，增长动能或从外需向内需切换。国内宏观方面，无论是消费还是工业生产都有望看到需求端的改善，同时预计地产仍有持续政策催化。预计 2023 年一季度经济基本面的修复仍然较为缓慢，经济中枢有望在二季度加速上行，我们将在三季度、四季度积极关注通胀风险及政策的可能变化。债券市场，在疫后复苏的背景下，我们将关注可能加码的宽信用政策以及经济内生的恢复增长的持续性，债市关注的机会是可能超调的配置机会。权益市场，经历了 2022 年市场的反复调整，部分板块的风险得到了实质性的释放，经济有望在一季度期间探底并开始稳步修复。我们对经济增长和权益市场较为乐观，结构上会增加大盘价值配置，把短期和长期更好结合起来。

组合策略方面，债券部分，我们计划维持组合的中短久期基本配置，寻找市场超调配置机会，适当增加中高等级信用债配置。权益部分，短期与长期主义相结合，从宏观、中观和微观出发，寻找三层逻辑共振的标的。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2022 年度，根据《证券投资基金法》等法律法规及有关要求，本基金管理人诚实守信、勤勉尽责，依法履行基金管理人职责，落实风险控制，强化合规管理职能，确保基金管理业务运作的安全、规范，保护基金投资人的合法权益。

本报告期内，本基金管理人为了确保公司业务的规范运作，主要做了以下工作：

（一）继续深化全面风险管理，提高风险控制有效性。

公司风险管理部门持续加大信用风险事前防范力度，加强对信用风险的监控，信用风险提示进一步前移；继续加强流动性风险管理，坚持开展定期及不定期压力测试及应急演练工作；定期排查风险控制阈值，提高公司旗下组合风险控制精准度；不断优化业务操作流程，通过丰富管理工具加强操作风险管理；继续加强各项潜在风险排查，落实防范措施和跟踪机制，不断提升公司风险管理水平。

（二）全面开展内部监督检查，强化公司内部控制。

公司审计部门坚持以法律法规和公司各项制度为依据，按照监管机构的要求对基金运作和公司经

营所涉及的各个环节实施严格的稽核监督。通过对投资研究、市场销售、运营、信息技术等业务条线内部控制关键点开展定期和不定期检查，有效促进公司内部控制制度规范、执行有效，内控管理水平不断提升。

（三）持续夯实公司合规管理体系，合规文化建设取得新实效。

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

（四）强化培训教育及重点领域合规提示，牢固树立全员风险合规防范意识。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

#### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

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

本基金本报告期内曾连续六十个工作日以上出现基金资产净值低于 5000 万元的情形，截至本报告期末，本基金基金资产净值已高于 5000 万元。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—交银施罗德基金管理有限公司 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

### § 6 审计报告

#### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2023)第 23745 号

#### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	交银施罗德稳固收益债券型证券投资基金全体基金份额持

	有人
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了交银施罗德稳固收益债券型证券投资基金(以下简称“交银稳固收益债券基金”)的财务报表,包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表,2022 年度的利润表和净资产(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了交银稳固收益债券基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于交银稳固收益债券基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>交银稳固收益债券基金的基金管理人交银施罗德基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估交银稳固收益债券基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算交银稳固收益债券基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督交银稳固收益债券基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常</p>

	<p>认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对交银稳固收益债券基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致交银稳固收益债券基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	沈兆杰   金诗涛
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2023 年 3 月 27 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：交银施罗德稳固收益债券型证券投资基金

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	51,869,548.20	1,236,677.29

结算备付金		18,227,407.25	237,322.40
存出保证金		431,773.83	13,826.68
交易性金融资产	7.4.7.2	2,507,924,505.47	40,190,988.48
其中：股票投资		421,240,493.42	2,824,435.08
基金投资		-	-
债券投资		2,086,684,012.05	37,366,553.40
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-12,178.62	3,600,000.00
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		78,314,587.41	209,008.18
应收股利		-	-
应收申购款		106,793.50	721.70
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	684,686.24
资产总计		2,656,862,437.04	46,173,230.97
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年12月31日</b>	<b>上年度末 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	698,326.25
应付赎回款		89,044,219.00	2,939.35
应付管理人报酬		1,634,348.16	27,043.24
应付托管费		466,956.62	7,726.64
应付销售服务费		71,698.36	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		38,597.80	74.42
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	5,324,978.46	69,299.27
负债合计		96,580,798.40	805,409.17
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	2,380,607,814.12	40,884,153.70
其他综合收益	7.4.7.11	-	-

未分配利润	7.4.7.12	179,673,824.52	4,483,668.10
净资产合计		2,560,281,638.64	45,367,821.80
负债和净资产总计		2,656,862,437.04	46,173,230.97

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额总额 2,234,772,247.50 份，其中交银稳固收益债券 A 基金份额总额 2,048,420,849.76 份，基金份额净值 1.1372 元。交银稳固收益债券 C 基金份额总额 186,351,397.74 份，基金份额净值 1.2387 元。

## 7.2 利润表

会计主体：交银施罗德稳固收益债券型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-68,487,985.12	3,049,127.26
1. 利息收入		555,517.85	1,401,425.75
其中：存款利息收入	7.4.7.13	187,130.53	14,151.91
债券利息收入		-	1,354,753.17
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		368,387.32	32,520.67
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-39,669,057.32	1,477,704.59
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-50,306,323.89	1,288,382.73
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	10,313,705.86	162,342.57
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	323,560.71	26,979.29
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	-29,517,935.81	168,733.10

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	143,490.16	1,263.82
<b>减：二、营业总支出</b>		7,044,789.23	758,251.23
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	4,874,582.03	332,033.91
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,392,737.77	94,866.81
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	138,349.59	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		421,515.27	48,072.40
其中：卖出回购金融资产支出		421,515.27	48,072.40
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		7,623.12	125.87
8. 其他费用	7.4.7.23	209,981.45	283,152.24
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-75,532,774.35	2,290,876.03
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-75,532,774.35	2,290,876.03
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-75,532,774.35	2,290,876.03

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：交银施罗德稳固收益债券型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	40,884,153.70	-	4,483,668.10	45,367,821.80
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	40,884,153.70	-	4,483,668.10	45,367,821.80

净值)				
三、本期 增减变动 额（减少 以“-”号 填列）	2,339,723,660.42	-	175,190,156.42	2,514,913,816.84
（一）、综 合收益总 额	-	-	-75,532,774.35	-75,532,774.35
（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）	2,339,723,660.42	-	465,832,630.56	2,805,556,290.98
其中：1. 基金申购 款	2,825,591,543.14	-	543,487,029.79	3,369,078,572.93
2. 基金赎回 款	-485,867,882.72	-	-77,654,399.23	-563,522,281.95
（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）	-	-	-215,109,699.79	-215,109,699.79
（四）、其 他综合收 益结转留 存收益	-	-	-	-
四、本期 期末净资 产（基金 净值）	2,380,607,814.12	-	179,673,824.52	2,560,281,638.64
项目	上年度可比期间			
	2021年1月1日至2021年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产（基金净值）	47,466,581.05	-	2,732,302.19	50,198,883.24
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	47,466,581.05	-	2,732,302.19	50,198,883.24
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-6,582,427.35	-	1,751,365.91	-4,831,061.44
（一）、综合收益总额	-	-	2,290,876.03	2,290,876.03
（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）	-6,582,427.35	-	-539,510.12	-7,121,937.47
其中：1. 基金申购款	4,729,132.32	-	466,027.78	5,195,160.10
2. 基金赎回款	-11,311,559.67	-	-1,005,537.90	-12,317,097.57
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以	-	-	-	-

“-”号填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	40,884,153.70	-	4,483,668.10	45,367,821.80

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

交银施罗德稳固收益债券型证券投资基金是由原交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金(以下简称“原基金”)转型而来。原基金经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]151号《关于核准交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金募集的批复》核准,由交银施罗德基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。原基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 744,017,594.47 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2013)第 232 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金基金合同》于 2013 年 4 月 24 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 744,437,272.39 份基金份额,其中认购资金利息折合 419,677.92 份基金份额。

根据《交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金基金合同》的有关约定,原基金的保本周期为三年。原基金第一个保本周期自原基金基金合同生效日起至三个公历年后对应日止(如该对应日为非工作日,保本周期到期日顺延至下一个工作日)。原基金保本周期届满时,在符合保本基金存续条件下,原基金继续存续并转入下一保本周期。在不符合保本基金存续条件下,原基金变更为非保本的债券型基金,基金名称相应变更为“交银施罗德稳固收益债券型证券投资基金”。

根据《交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金基金合同》及《交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金保本周期到期安排及转型为交银施罗德稳固收益债券型证券投资基金后运作相关业

务规则的公告》，原基金第二个保本周期到期因未能符合保本基金存续条件，自 2019 年 5 月 31 日起转型为交银施罗德稳固收益债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)。转型后基金的投资目标、投资范围、投资策略、投资比例、业绩比较基准、估值方法、申赎原则、收益分配及基金费率等按照《交银施罗德稳固收益债券型证券投资基金基金合同》相关规定进行运作。原《交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金基金合同》自 2019 年 5 月 31 日起失效，《交银施罗德稳固收益债券型证券投资基金基金合同》于同日起生效，并已报中国证监会备案。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为交银施罗德基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德稳固收益债券型证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同和托管协议的公告》，本基金自 2022 年 8 月 17 日起增加收取销售服务费的 C 类份额，并对本基金的基金合同、托管协议作相应修改。在本基金增加收取销售服务费的 C 类份额后，原有的基金份额全部自动划归为本基金 A 类份额。对投资者申购时收取申购费用，赎回时收取赎回费用，且不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；对投资者申购时不收取申购费用，但在赎回时收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金增加 C 类基金份额后，将分别设置对应的基金代码并分别计算基金份额净值。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额，但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德稳固收益债券型证券投资基金基金合同》本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行交易的债券、股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、货币市场工具、权证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，但需符合中国证监会的相关规定。本基金的投资组合比例为：固定收益类资产占基金资产的比例不低于 80%，固定收益类资产包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、可转换债券（含分离交易的可转换公司债券）、资产支持证券、次级债、债券回购等金融工具；股票、权证等权益类资产占基金资产的比例不高于 20%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%。本基金的业绩比较基准为三年期银行定期存款税后收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人交银施罗德基金管理有限公司于 2023 年 3 月 27 日批准报出。

## 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《交银施罗德稳固收益债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

## 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 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 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

#### 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。

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。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价

格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。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。

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### 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扣除按票面利

率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息后的净额确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用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。资产支持证券在持有期间收到的款项,根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分,将本金部分冲减资产支持证券投资成本,并将投资收益部分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确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

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净资产转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

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

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确

定公允价值。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

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，财政部于 2022 年颁布了《关于印发《资产管理产品相关会计处理规定》的通知》（财会[2022]14 号），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：

#### (a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

(i) 于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收利息、应收证券清算款和应收申购款，金额分别为 1,236,677.29 元、237,322.40 元、13,826.68 元、3,600,000.00 元、684,686.24 元、209,008.18 元和 721.70 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、其他资产-应收利息、应收清算款和应收申购款，金额分别为 1,236,969.70 元、237,439.88 元、13,833.50 元、3,598,744.69 元、0.00 元、209,008.18 元和 721.76 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 40,190,988.48 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 40,876,513.26 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 698,326.25 元、2,939.35 元、27,043.24 元、7,726.64 元、29,996.88 元和 2.39 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和

其他负债-其他应付款，金额分别为 698,326.25 元、2,939.35 元、27,043.24 元、7,726.64 元、29,996.88 元和 2.39 元。

i)

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 《资产管理产品相关会计处理规定》

根据《资产管理产品相关会计处理规定》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[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[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]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。

(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。

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

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	51,869,548.20	1,236,677.29
等于：本金	51,864,727.66	1,236,677.29
加：应计利息	4,820.54	-
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	51,869,548.20	1,236,677.29

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		443,922,932.44	-	421,240,493.42	- 22,682,439.02
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	616,299,604.88	5,120,907.69	617,187,578.54	-4,232,934.03
	银行间市场	1,452,992,723.12	18,837,753.51	1,469,496,433.51	-2,334,043.12
	合计	2,069,292,328.00	23,958,661.20	2,086,684,012.05	-6,566,977.15
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		2,513,215,260.44	23,958,661.20	2,507,924,505.47	- 29,249,416.17
项目		上年度末 2021 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		2,610,305.09	-	2,824,435.08	214,129.99
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	24,998,698.53	-	24,928,253.40	-70,445.13
	银行间市场	12,313,465.22	-	12,438,300.00	124,834.78
	合计	37,312,163.75	-	37,366,553.40	54,389.65
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		39,922,468.84	-	40,190,988.48	268,519.64

## 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

## 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

## 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-12,178.62	-
银行间市场	-	-
合计	-12,178.62	-
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	3,600,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	3,600,000.00	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。
----

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

无。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

## 7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

## 7.4.7.7 其他权益工具投资

## 7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

## 7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

## 7.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	684,686.24
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	684,686.24

## 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	66,829.76	2.39
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	5,098,848.70	29,996.88
其中：交易所市场	5,091,673.70	29,839.38
银行间市场	7,175.00	157.50
应付利息	-	-
预提审计费	30,000.00	30,000.00
预提信息披露费	120,000.00	-
预提账户维护费	9,300.00	9,300.00
合计	5,324,978.46	69,299.27

## 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 交银稳固收益债券 A

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	38,166,353.01	40,884,153.70
本期申购	2,412,049,396.33	2,583,773,359.14
本期赎回（以“-”号填列）	-401,794,899.58	-430,401,096.46
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	2,048,420,849.76	2,194,256,416.38

## 交银稳固收益债券 C

项目	本期 2022年8月18日（基金合同生效日）至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	241,818,184.00	241,818,184.00
本期赎回（以“-”号填列）	-55,466,786.26	-55,466,786.26
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	186,351,397.74	186,351,397.74

注：1、如果本报告期间发生红利再投、转换入业务，则总申购份额中包含该业务；

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

## 7.4.7.11 其他综合收益

无。

## 7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

## 交银稳固收益债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	3,852,742.61	630,925.49	4,483,668.10
本期利润	-42,185,046.60	-28,282,024.94	-70,467,071.54
本期基金份额交易产生的变动数	368,744,550.43	47,544,888.13	416,289,438.56
其中：基金申购款	427,109,143.25	53,368,744.28	480,477,887.53
基金赎回款	-58,364,592.82	-5,823,856.15	-64,188,448.97
本期已分配利润	-215,109,699.79	-	-215,109,699.79
本期末	115,302,546.65	19,893,788.68	135,196,335.33

## 交银稳固收益债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-

本期利润	-3,829,791.94	-1,235,910.87	-5,065,702.81
本期基金份额交易产生的变动数	46,393,262.02	3,149,929.98	49,543,192.00
其中：基金申购款	59,313,032.95	3,696,109.31	63,009,142.26
基金赎回款	-12,919,770.93	-546,179.33	-13,465,950.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	42,563,470.08	1,914,019.11	44,477,489.19

#### 7.4.7.13 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12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
活期存款利息收入	67,925.09	8,722.82
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	64,655.52	5,085.15
其他	54,549.92	343.94
合计	187,130.53	14,151.91

#### 7.4.7.14 股票投资收益

##### 7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-50,306,323.89	1,288,382.73
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	-50,306,323.89	1,288,382.73

##### 7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
卖出股票成交总额	3,485,503,650.29	71,029,596.51

减：卖出股票成本总额	3,524,799,121.54	69,741,213.78
减：交易费用	11,010,852.64	-
买卖股票差价收入	-50,306,323.89	1,288,382.73

#### 7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 7.4.7.15 债券投资收益

##### 7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
债券投资收益——利息收入	12,022,130.18	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-1,708,424.32	162,342.57
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	10,313,705.86	162,342.57

##### 7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	453,189,032.02	100,067,108.08
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	449,962,426.00	98,482,140.55
减：应计利息总额	4,895,398.98	1,422,624.96
减：交易费用	39,631.36	-
买卖债券差价收入	-1,708,424.32	162,342.57

##### 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

## 7.4.7.18 衍生工具收益

## 7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12 月31日
股票投资产生的股利收益	323,560.71	26,979.29
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	323,560.71	26,979.29

## 7.4.7.20 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 12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日
1. 交易性金融资产	-29,517,935.81	168,733.10
股票投资	-22,896,569.01	-412,919.93
债券投资	-6,621,366.80	581,653.03
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	-29,517,935.81	168,733.10

## 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	143,490.16	1,263.82
合计	143,490.16	1,263.82

注：1、 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

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

#### 7.4.7.22 信用减值损失

无。

#### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
审计费用	30,000.00	30,000.00
信息披露费	120,000.00	-
证券出借违约金	-	-
银行费用	22,781.45	3,992.32
债券账户费用	37,200.00	37,200.00
交易费用	-	211,959.92
合计	209,981.45	283,152.24

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

无。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 7.4.9 关联方关系

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

上海直源投资管理有限公司

受基金管理人控制的公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

无。

###### 7.4.10.1.2 债券交易

无。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

###### 7.4.10.1.4 权证交易

无。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	4,874,582.03	332,033.91
其中：支付销售机构的客户维护费	584,496.06	87,036.89

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

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.70%÷当年天数。

###### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,392,737.77	94,866.81

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% \div \text{当年天数}。$$

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方 名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	交银稳固收益债券 A	交银稳固收益债券 C	合计
交通银行股份有限公司	-	-	-
交银施罗德基金管理有限 公司	-	53,635.71	53,635.71
中国农业银行股份有限公司	-	-	-
合计	-	53,635.71	53,635.71
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	交银稳固收益债券 A	交银稳固收益债券 C	合计
合计	-	-	-

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 0.4% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

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

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

## 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

## 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

## 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

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

无。

## 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行_活期存款	51,869,548.20	67,925.09	1,236,677.29	8,722.82

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

## 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

## 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

## 7.4.11 利润分配情况

交银稳固收益债券 A								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份 基金份额	现金形 式	再投资形 式	本期利 润分配	备注
		场内	场外					

				分红数	发放总 额	发放总额	合计	
1	2022 年 12 月 23 日	-	2022 年 12 月 23 日	1.030	144,344, 458.86	70,765,240 .93	215,109, 699.79	-
合计	-	-	-	1.030	144,344, 458.86	70,765,240 .93	215,109, 699.79	-

#### 7.4.12 期末（2022 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功 认购 日	受 限 期	流 通 受 限 类 型	认 购 价 格	期 末 估 值 单 价	数 量 （ 单 位： 股）	期 末 成 本 总 额	期 末 估 值 总 额	备 注
603885	吉祥航空	2022 年 8 月 16 日	6 个 月以 上	限 售 股	13.32	15.68	75,078	1,000,038.96	1,177,223.04	-

注：1、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2、本基金可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

3、本基金可作为特定投资者，参与上市公司公开或非公开发行股份认购。本基金可作为特定投资者所认购的非公开发行股份，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

4、本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期为自发行人股票上市之日起 6 个月。本基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

5、本基金可以通过网下发行获配的创业板股票。发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代 码	股 票 名	停 牌 日 期	停 牌 原	期 末 估	复 牌 日	复 牌 开 盘 单 价	数 量 （ 股）	期 末 成 本 总 额	期 末 估 值 总 额	备 注
----------	-------------	------------------	-------------	-------------	-------------	----------------------------	-------------------	----------------------------	----------------------------	--------

	称		因	值 单 价	期					
600038	中直 股份	2022 年 12 月 26 日	重大 事项 停牌	46.41	2023 年 1 月 10 日	51.05	307,600	14,857,044.00	14,275,716.00	-

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只债券型基金，其长期平均的预期收益和风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行交易的债券、股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、货币市场工具、权证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，但需符合中国证监会的相关规定。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，在追求本金安全、有效控制风险的基础上，力争实现基金资产的持续稳定增值。

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

部控制执行情况。

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

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

#### 7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国农业银行股份有限公司，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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	1,385,599,058.47	11,539,664.50
合计	1,385,599,058.47	11,539,664.50

注：未评级部分为国债、政策性金融债、企业短期融资券和企业超短期融资券。

##### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

**7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

无。

**7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	137,494,628.69	3,095,938.50
AAA 以下	81,547,341.56	528,222.00
未评级	482,042,983.33	22,202,728.40
合计	701,084,953.58	25,826,888.90

注：未评级部分为国债、政策性金融债和中期票据。

**7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

无。

**7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

无。

**7.4.13.3 流动性风险**

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

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

于 2022 年 12 月 31 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。

### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限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 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

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

### 7.4.13.4 市场风险

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

#### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率

敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

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

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	51,869,548.20	-	-	-	51,869,548.20
结算备付金	18,227,407.25	-	-	-	18,227,407.25
存出保证金	431,773.83	-	-	-	431,773.83
交易性金融资产	1,920,732,816.81	160,815,892.83	5,135,302.41	421,240,493.42	2,507,924,505.47
买入返售金融资产	-12,178.62	-	-	-	-12,178.62
应收申购款	-	-	-	106,793.50	106,793.50
应收清算款	-	-	-	78,314,587.41	78,314,587.41
资产总计	1,991,249,367.47	160,815,892.83	5,135,302.41	499,661,874.33	2,656,862,437.04
负债					
应付赎回款	-	-	-	89,044,219.00	89,044,219.00
应付管理人报酬	-	-	-	1,634,348.16	1,634,348.16
应付托管费	-	-	-	466,956.62	466,956.62
应付销售服务费	-	-	-	71,698.36	71,698.36
应交税费	-	-	-	38,597.80	38,597.80
其他负债	-	-	-	5,324,978.46	5,324,978.46
负债总计	-	-	-	96,580,798.40	96,580,798.40
利率敏感度缺口	1,991,249,367.47	160,815,892.83	5,135,302.41	403,081,075.93	2,560,281,638.64
上年度末 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	1,236,677.29	-	-	-	1,236,677.29
结算备付金	237,322.40	-	-	-	237,322.40
存出保证金	13,826.68	-	-	-	13,826.68
交易性金融资产	19,713,662.20	9,904,832.40	7,748,058.80	2,824,435.08	40,190,988.48
买入返售金融资产	3,600,000.00	-	-	-	3,600,000.00
应收申购款	-	-	-	721.70	721.70
应收证券清算款	-	-	-	209,008.18	209,008.18
其他资产	-	-	-	684,686.24	684,686.24
资产总计	24,801,488.57	9,904,832.40	7,748,058.80	3,718,851.20	46,173,230.97
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,939.35	2,939.35

应付管理人报酬	-	-	-	27,043.24	27,043.24
应付托管费	-	-	-	7,726.64	7,726.64
应付证券清算款	-	-	-	698,326.25	698,326.25
应交税费	-	-	-	74.42	74.42
其他负债	-	-	-	69,299.27	69,299.27
负债总计	-	-	-	805,409.17	805,409.17
利率敏感度缺口	24,801,488.57	9,904,832.40	7,748,058.80	2,913,442.03	45,367,821.80

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022年12月31日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	市场利率上升 25 个基点	-2,208,339.52	-289,837.05
	市场利率下降 25 个基点	2,222,751.86	301,101.99

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金基于恒定比例组合保险（CPPI, Constant Proportion Portfolio Insurance）原理对包括债券、货币市场工具在内的固定收益类资产和包括股票、权证在内的权益类资产进行配置，动态调整固定收益类资产与权益类资产投资的比例，通过对固定收益类资产的投资实现每一运作周期到期时投资本金的保护，并通过对权益类资产的投资寻求每一运作周期内基金资产的稳定增值。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中固定收益类资产占基金

资产的比例不低于 80%，固定收益类资产包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、可转换债券（含分离交易的可转换公司债券）、资产支持证券、次级债、债券回购等金融工具；股票、权证等权益类资产占基金资产的比例不高于 20%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日		上年度末 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	421,240,493.42	16.45	2,824,435.08	6.23
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	156,308,690.25	6.11	569,560.50	1.26
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	577,549,183.67	22.56	3,393,995.58	7.48

注：债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元)		
	本期末(2022 年 12 月 31 日)	上年度末(2021 年 12 月 31 日)	
分析	1. 业绩比较基准上 涨 5%	51,005,948.34	-
	2. 业绩比较基准下	-51,005,948.34	-

	降 5%		
--	------	--	--

注：于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性权益类投资、可转换债券及可交换债券公允价值占基金资产净值的比例为 7.48%，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	562,096,244.63	3,353,995.58
第二层次	1,944,651,037.80	36,836,992.90
第三层次	1,177,223.04	-
合计	2,507,924,505.47	40,190,988.48

###### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

###### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

###### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,000,789.74	1,000,789.74
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	176,433.30	176,433.30
其中：计入损益的利得或损失	-	176,433.30	176,433.30
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,177,223.04	1,177,223.04
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	177,184.08	177,184.08
项目	上年度可比同期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

注：于 2022 年 12 月 31 日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但

尚在限售期内的股票投资。于 2022 年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
证券交易所上市但尚在限售期内的股票投资	1,177,223.04	平均价格亚式期权模型	该流通受限股票在剩余限售期内的股价预期年化波动率	39.45%~39.45%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
证券交易所上市但尚在限售期内的股票投资	-	0	0	0	0

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2021 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	421,240,493.42	15.85
	其中：股票	421,240,493.42	15.85

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,086,684,012.05	78.54
	其中：债券	2,086,684,012.05	78.54
	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	-12,178.62	-0.00
	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	70,096,955.45	2.64
8	其他各项资产	78,853,154.74	2.97
9	合计	2,656,862,437.04	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	9,316,398.00	0.36
B	采矿业	-	-
C	制造业	286,334,825.34	11.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	18,291,878.04	0.71
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	66,147,165.04	2.58
J	金融业	20,223,644.00	0.79
K	房地产业	6,356,025.00	0.25
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,533,688.00	0.10
S	综合	12,036,870.00	0.47
	合计	421,240,493.42	16.45

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	300687	赛意信息	759,684	22,410,678.00	0.88
2	688498	源杰科技	178,740	21,364,792.20	0.83
3	600456	宝钛股份	517,600	21,149,136.00	0.83
4	300672	国科微	235,200	20,003,760.00	0.78
5	600298	安琪酵母	383,500	17,341,870.00	0.68
6	688033	天宜上佳	788,633	17,168,540.41	0.67
7	002371	北方华创	66,000	14,869,800.00	0.58
8	600038	中直股份	307,600	14,275,716.00	0.56
9	688262	国芯科技	326,408	13,647,118.48	0.53
10	600602	云赛智联	1,553,700	13,532,727.00	0.53
11	002152	广电运通	1,352,300	13,441,862.00	0.53
12	603345	安井食品	82,000	13,274,160.00	0.52
13	300033	同花顺	130,400	12,858,744.00	0.50
14	600060	海信视像	946,300	12,812,902.00	0.50
15	600050	中国联通	2,771,172	12,414,850.56	0.48
16	600096	云天化	581,800	12,241,072.00	0.48
17	002304	洋河股份	75,800	12,165,900.00	0.48
18	000568	泸州老窖	53,800	12,066,264.00	0.47
19	600603	广汇物流	1,471,500	12,036,870.00	0.47
20	600330	天通股份	988,322	10,416,913.88	0.41
21	300498	温氏股份	474,600	9,316,398.00	0.36
22	000922	佳电股份	1,005,300	9,017,541.00	0.35
23	002928	华夏航空	565,100	7,815,333.00	0.31
24	601318	中国平安	156,700	7,364,900.00	0.29
25	600519	贵州茅台	4,000	6,908,000.00	0.27
26	301391	卡莱特	76,658	6,554,259.00	0.26
27	002840	华统股份	380,037	6,418,824.93	0.25
28	000069	华侨城 A	1,192,500	6,356,025.00	0.25
29	603885	吉祥航空	380,978	6,126,685.04	0.24
30	600586	金晶科技	683,700	5,955,027.00	0.23
31	688448	磁谷科技	238,909	5,616,750.59	0.22
32	688102	斯瑞新材	317,350	5,233,101.50	0.20
33	300575	中旗股份	234,895	5,137,153.65	0.20
34	688066	航天宏图	48,442	4,141,791.00	0.16
35	688281	华秦科技	12,980	3,699,300.00	0.14

36	300911	亿田智能	70,100	3,234,414.00	0.13
37	600233	圆通速递	139,600	2,804,564.00	0.11
38	002959	小熊电器	43,700	2,635,984.00	0.10
39	603008	喜临门	92,100	2,629,455.00	0.10
40	603801	志邦家居	95,500	2,567,040.00	0.10
41	300413	芒果超媒	84,400	2,533,688.00	0.10
42	002669	康达新材	184,100	2,369,367.00	0.09
43	002511	中顺洁柔	155,200	2,132,448.00	0.08
44	688080	映翰通	51,846	2,129,833.68	0.08
45	688378	奥来德	29,775	1,503,637.50	0.06
46	002352	顺丰控股	22,100	1,276,496.00	0.05
47	002930	宏川智慧	14,000	268,800.00	0.01

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	102,378,589.14	225.66
2	300014	亿纬锂能	62,431,707.72	137.61
3	600330	天通股份	52,273,108.92	115.22
4	000069	华侨城 A	49,020,252.79	108.05
5	000568	泸州老窖	47,971,917.90	105.74
6	688033	天宜上佳	47,125,218.30	103.87
7	600298	安琪酵母	47,050,322.87	103.71
8	600603	广汇物流	45,919,530.84	101.22
9	300750	宁德时代	45,289,192.00	99.83
10	300498	温氏股份	38,337,226.21	84.50
11	601899	紫金矿业	37,772,010.40	83.26
12	688560	明冠新材	36,335,269.74	80.09
13	601601	中国太保	34,395,583.00	75.81
14	002903	宇环数控	33,226,728.50	73.24
15	002436	兴森科技	32,413,923.35	71.45
16	300672	国科微	30,205,553.05	66.58
17	601668	中国建筑	30,118,099.40	66.39
18	002371	北方华创	28,363,405.00	62.52
19	002595	豪迈科技	28,333,371.00	62.45
20	603308	应流股份	28,219,439.81	62.20
21	688037	芯源微	27,465,703.80	60.54
22	603260	合盛硅业	27,450,322.20	60.51
23	601669	中国电建	27,347,063.00	60.28
24	600131	国网信通	26,922,390.61	59.34
25	000333	美的集团	26,768,398.25	59.00
26	000630	铜陵有色	25,045,535.00	55.21

27	002245	蔚蓝锂芯	24,996,451.87	55.10
28	603936	博敏电子	24,856,150.32	54.79
29	600456	宝钛股份	24,284,079.33	53.53
30	600050	中国联通	23,652,501.00	52.13
31	300687	赛意信息	23,426,850.68	51.64
32	600418	江淮汽车	22,426,770.22	49.43
33	688301	奕瑞科技	22,399,063.51	49.37
34	688498	源杰科技	21,897,069.69	48.27
35	002304	洋河股份	20,998,709.63	46.29
36	300803	指南针	20,529,461.00	45.25
37	000537	广宇发展	19,378,361.24	42.71
38	002027	分众传媒	19,333,033.00	42.61
39	600745	闻泰科技	19,179,575.00	42.28
40	001330	博纳影业	19,158,597.94	42.23
41	688262	国芯科技	19,039,263.65	41.97
42	300033	同花顺	18,956,133.00	41.78
43	300347	泰格医药	18,549,024.09	40.89
44	601208	东材科技	18,152,594.01	40.01
45	688186	广大特材	17,784,088.61	39.20
46	002475	立讯精密	17,422,680.85	38.40
47	300724	捷佳伟创	17,208,128.00	37.93
48	601868	中国能建	17,106,944.00	37.71
49	600549	厦门钨业	16,923,737.46	37.30
50	300996	普联软件	16,587,651.75	36.56
51	600487	亨通光电	16,537,663.94	36.45
52	600057	厦门象屿	16,166,926.25	35.64
53	603885	吉祥航空	15,858,523.36	34.96
54	600096	云天化	15,649,318.90	34.49
55	300661	圣邦股份	15,431,047.46	34.01
56	000933	神火股份	15,420,916.00	33.99
57	002001	新和成	15,307,766.40	33.74
58	300360	炬华科技	15,056,372.00	33.19
59	600038	中直股份	14,857,044.00	32.75
60	300331	苏大维格	14,792,590.00	32.61
61	002158	汉钟精机	14,769,713.00	32.56
62	002511	中顺洁柔	14,606,245.00	32.20
63	001979	招商蛇口	14,557,916.90	32.09
64	300451	创业慧康	14,514,680.96	31.99
65	002335	科华数据	14,469,756.00	31.89
66	603799	华友钴业	14,415,032.80	31.77
67	600376	首开股份	14,302,501.00	31.53
68	002152	广电运通	14,143,809.00	31.18
69	600690	海尔智家	14,048,859.84	30.97

70	688066	航天宏图	14,048,830.83	30.97
71	002068	黑猫股份	13,805,619.00	30.43
72	000657	中钨高新	13,743,507.85	30.29
73	002216	三全食品	13,689,128.40	30.17
74	603806	福斯特	13,688,886.00	30.17
75	603345	安井食品	13,675,965.00	30.14
76	600060	海信视像	13,624,996.79	30.03
77	002384	东山精密	13,507,538.00	29.77
78	600602	云赛智联	13,500,263.00	29.76
79	603063	禾望电气	13,478,501.00	29.71
80	300083	创世纪	13,457,220.48	29.66
81	300019	硅宝科技	13,409,072.76	29.56
82	603496	恒为科技	13,248,831.12	29.20
83	002840	华统股份	13,197,642.40	29.09
84	600702	舍得酒业	13,133,890.00	28.95
85	300274	阳光电源	13,115,499.48	28.91
86	600522	中天科技	13,060,310.00	28.79
87	300586	美联新材	12,911,385.19	28.46
88	002846	英联股份	12,893,113.60	28.42
89	688372	伟测科技	12,666,853.18	27.92
90	603595	东尼电子	12,560,690.00	27.69
91	300820	英杰电气	12,548,155.72	27.66
92	601882	海天精工	12,404,439.00	27.34
93	688170	德龙激光	12,344,595.06	27.21
94	002063	远光软件	12,312,216.62	27.14
95	002860	星帅尔	12,096,658.00	26.66
96	603100	川仪股份	12,050,384.62	26.56
97	688595	芯海科技	12,000,243.74	26.45
98	605589	圣泉集团	11,939,200.40	26.32
99	301026	浩通科技	11,930,046.36	26.30
100	603916	苏博特	11,873,499.77	26.17
101	600009	上海机场	11,842,494.00	26.10
102	000625	长安汽车	11,709,844.90	25.81
103	000975	银泰黄金	11,706,477.00	25.80
104	300024	机器人	11,702,689.75	25.80
105	300373	扬杰科技	11,692,928.06	25.77
106	601628	中国人寿	11,633,499.76	25.64
107	300575	中旗股份	11,574,329.40	25.51
108	300693	盛弘股份	11,560,306.00	25.48
109	600519	贵州茅台	11,311,168.00	24.93
110	300203	聚光科技	11,273,958.00	24.85
111	603505	金石资源	11,227,372.72	24.75
112	300366	创意信息	11,198,506.39	24.68

113	000799	酒鬼酒	11,178,983.00	24.64
114	300463	迈克生物	11,059,279.00	24.38
115	002532	天山铝业	10,905,345.00	24.04
116	601111	中国国航	10,890,488.00	24.00
117	688518	联赢激光	10,868,142.29	23.96
118	601155	新城控股	10,662,564.00	23.50
119	301021	英诺激光	10,647,434.98	23.47
120	002987	京北方	10,617,879.70	23.40
121	300058	蓝色光标	10,567,898.31	23.29
122	688508	芯朋微	10,521,678.56	23.19
123	300316	晶盛机电	10,488,640.00	23.12
124	000922	佳电股份	10,382,626.00	22.89
125	600325	华发股份	10,378,807.84	22.88
126	603927	中科软	10,314,986.60	22.74
127	002539	云图控股	10,254,987.00	22.60
128	002897	意华股份	10,150,297.00	22.37
129	688599	天合光能	10,140,096.24	22.35
130	600580	卧龙电驱	9,961,191.78	21.96
131	300760	迈瑞医疗	9,947,952.00	21.93
132	002851	麦格米特	9,757,705.53	21.51
133	600436	片仔癀	9,736,932.00	21.46
134	600011	华能国际	9,680,992.00	21.34
135	688012	中微公司	9,641,992.88	21.25
136	301102	兆讯传媒	9,613,587.49	21.19
137	300219	鸿利智汇	9,558,577.00	21.07
138	603508	思维列控	9,456,922.52	20.85
139	600509	天富能源	9,423,819.00	20.77
140	600566	济川药业	9,353,548.00	20.62
141	002020	京新药业	9,256,788.20	20.40
142	000301	东方盛虹	9,249,244.00	20.39
143	000034	神州数码	9,227,647.00	20.34
144	603816	顾家家居	9,186,800.00	20.25
145	688596	正帆科技	9,119,658.21	20.10
146	300253	卫宁健康	9,119,276.00	20.10
147	002460	赣锋锂业	9,036,164.24	19.92
148	300481	濮阳惠成	9,021,697.00	19.89
149	301195	北路智控	9,014,810.19	19.87
150	002444	巨星科技	8,943,998.00	19.71
151	002270	华明装备	8,885,983.00	19.59
152	300433	蓝思科技	8,840,569.00	19.49
153	600588	用友网络	8,816,464.31	19.43
154	002765	蓝黛科技	8,785,049.16	19.36
155	002028	思源电气	8,772,636.00	19.34

156	600633	浙数文化	8,765,030.00	19.32
157	300353	东土科技	8,656,690.00	19.08
158	688099	晶晨股份	8,558,248.09	18.86
159	003029	吉大正元	8,468,474.60	18.67
160	688556	高测股份	8,396,089.03	18.51
161	688579	山大地纬	8,336,534.38	18.38
162	603297	永新光学	8,187,325.00	18.05
163	002352	顺丰控股	8,135,208.00	17.93
164	688519	南亚新材	8,127,763.77	17.92
165	688015	交控科技	8,100,211.76	17.85
166	000002	万科 A	8,054,274.00	17.75
167	002928	华夏航空	7,941,386.00	17.50
168	688362	甬矽电子	7,921,640.38	17.46
169	002237	恒邦股份	7,855,487.08	17.32
170	300525	博思软件	7,797,060.50	17.19
171	300634	彩讯股份	7,767,921.14	17.12
172	002493	荣盛石化	7,757,665.00	17.10
173	688628	优利德	7,696,664.53	16.97
174	603396	金辰股份	7,669,390.00	16.90
175	603138	海量数据	7,534,362.00	16.61
176	002938	鹏鼎控股	7,487,711.00	16.50
177	603077	和邦生物	7,481,349.40	16.49
178	002120	韵达股份	7,439,796.70	16.40
179	000049	德赛电池	7,427,804.00	16.37
180	600875	东方电气	7,414,460.00	16.34
181	000661	长春高新	7,413,642.00	16.34
182	002078	太阳纸业	7,328,235.40	16.15
183	002508	老板电器	7,317,517.00	16.13
184	301369	联动科技	7,280,942.00	16.05
185	601390	中国中铁	7,164,537.00	15.79
186	688023	安恒信息	7,101,710.78	15.65
187	002049	紫光国微	7,067,715.20	15.58
188	300567	精测电子	7,033,776.00	15.50
189	002648	卫星化学	6,943,662.60	15.31
190	000001	平安银行	6,849,676.00	15.10
191	603209	兴通股份	6,847,056.00	15.09
192	000681	视觉中国	6,827,417.00	15.05
193	002567	唐人神	6,750,849.00	14.88
194	600426	华鲁恒升	6,701,018.00	14.77
195	000983	山西焦煤	6,656,218.00	14.67
196	600821	金开新能	6,649,186.00	14.66
197	002171	楚江新材	6,646,663.00	14.65
198	301391	卡莱特	6,633,683.24	14.62

199	688699	明微电子	6,630,754.32	14.62
200	300327	中颖电子	6,628,540.00	14.61
201	601021	春秋航空	6,574,929.00	14.49
202	603893	瑞芯微	6,490,482.00	14.31
203	603456	九洲药业	6,480,656.00	14.28
204	002438	江苏神通	6,456,249.00	14.23
205	600489	中金黄金	6,426,100.20	14.16
206	688448	磁谷科技	6,376,387.26	14.05
207	300174	元力股份	6,366,757.22	14.03
208	002155	湖南黄金	6,341,408.00	13.98
209	688060	云涌科技	6,328,247.39	13.95
210	002410	广联达	6,287,504.16	13.86
211	300217	东方电热	6,267,388.00	13.81
212	600079	人福医药	6,259,507.00	13.80
213	002230	科大讯飞	6,233,208.00	13.74
214	688665	四方光电	6,194,764.87	13.65
215	002045	国光电器	6,188,371.00	13.64
216	600586	金晶科技	6,183,031.00	13.63
217	300752	隆利科技	6,158,450.99	13.57
218	688008	澜起科技	6,156,046.98	13.57
219	300876	蒙泰高新	6,151,829.80	13.56
220	688256	寒武纪	6,116,831.46	13.48
221	000682	东方电子	6,115,787.00	13.48
222	002943	宇晶股份	6,062,974.00	13.36
223	600872	中炬高新	6,051,244.00	13.34
224	002271	东方雨虹	5,997,466.00	13.22
225	300339	润和软件	5,983,811.93	13.19
226	002992	宝明科技	5,943,558.40	13.10
227	603628	清源股份	5,940,850.00	13.09
228	603738	泰晶科技	5,927,282.02	13.06
229	003022	联泓新科	5,918,380.28	13.05
230	002223	鱼跃医疗	5,917,707.00	13.04
231	300458	全志科技	5,903,384.60	13.01
232	600138	中青旅	5,856,312.00	12.91
233	300482	万孚生物	5,835,767.00	12.86
234	002603	以岭药业	5,822,742.00	12.83
235	600406	国电南瑞	5,816,607.80	12.82
236	601838	成都银行	5,816,277.00	12.82
237	601728	中国电信	5,808,875.00	12.80
238	000887	中鼎股份	5,717,797.00	12.60
239	300207	欣旺达	5,683,202.00	12.53
240	002368	太极股份	5,670,426.07	12.50
241	000690	宝新能源	5,662,341.91	12.48

242	688630	芯碁微装	5,632,807.80	12.42
243	688378	奥来德	5,564,268.17	12.26
244	300092	科新机电	5,555,531.00	12.25
245	605108	同庆楼	5,518,592.00	12.16
246	000534	万泽股份	5,506,817.07	12.14
247	002396	星网锐捷	5,378,388.00	11.86
248	603078	江化微	5,370,123.50	11.84
249	600212	绿能慧充	5,362,672.00	11.82
250	688102	斯瑞新材	5,303,139.22	11.69
251	002318	久立特材	5,285,289.00	11.65
252	688032	禾迈股份	5,283,885.66	11.65
253	002865	钧达股份	5,223,840.00	11.51
254	002594	比亚迪	5,179,747.00	11.42
255	688300	联瑞新材	5,142,338.87	11.33
256	688123	聚辰股份	5,093,957.67	11.23
257	002192	融捷股份	5,091,676.00	11.22
258	300068	南都电源	5,079,567.52	11.20
259	603187	海容冷链	4,955,434.00	10.92
260	000513	丽珠集团	4,933,036.00	10.87
261	002276	万马股份	4,930,349.00	10.87
262	000811	冰轮环境	4,928,286.00	10.86
263	600732	爱旭股份	4,814,176.00	10.61
264	301004	嘉益股份	4,741,733.00	10.45
265	600027	华电国际	4,716,854.37	10.40
266	688125	安达智能	4,691,884.72	10.34
267	300832	新产业	4,633,495.00	10.21
268	601888	中国中免	4,578,001.00	10.09
269	688003	天准科技	4,548,811.43	10.03
270	688271	联影医疗	4,544,087.73	10.02
271	300652	雷迪克	4,519,149.00	9.96
272	688680	海优新材	4,512,167.67	9.95
273	000708	中信特钢	4,490,526.20	9.90
274	000498	山东路桥	4,463,744.00	9.84
275	600547	山东黄金	4,403,775.00	9.71
276	688120	华海清科	4,401,015.07	9.70
277	600988	赤峰黄金	4,252,203.00	9.37
278	002046	国机精工	4,208,461.00	9.28
279	688281	华秦科技	4,109,027.34	9.06
280	603259	药明康德	4,099,702.00	9.04
281	000591	太阳能	3,996,173.00	8.81
282	688401	路维光电	3,965,711.03	8.74
283	600754	锦江酒店	3,931,333.00	8.67
284	603019	中科曙光	3,930,250.60	8.66

285	300911	亿田智能	3,924,543.00	8.65
286	688233	神工股份	3,916,860.85	8.63
287	688408	中信博	3,856,777.74	8.50
288	600795	国电电力	3,796,126.00	8.37
289	000768	中航西飞	3,781,608.00	8.34
290	300260	新莱应材	3,773,230.00	8.32
291	300088	长信科技	3,767,449.00	8.30
292	688031	星环科技	3,759,818.13	8.29
293	301122	采纳股份	3,727,828.00	8.22
294	603565	中谷物流	3,699,772.52	8.16
295	603639	海利尔	3,692,354.72	8.14
296	688559	海目星	3,679,709.89	8.11
297	601225	陕西煤业	3,637,865.00	8.02
298	002559	亚威股份	3,617,051.00	7.97
299	002053	云南能投	3,604,312.00	7.94
300	600075	新疆天业	3,595,778.00	7.93
301	688155	先惠技术	3,562,118.04	7.85
302	603185	上机数控	3,560,126.00	7.85
303	002273	水晶光电	3,537,412.00	7.80
304	688183	生益电子	3,529,190.79	7.78
305	605507	国邦医药	3,497,843.00	7.71
306	600299	安迪苏	3,494,040.00	7.70
307	300850	新强联	3,493,528.00	7.70
308	002959	小熊电器	3,407,156.00	7.51
309	688025	杰普特	3,365,350.62	7.42
310	603667	五洲新春	3,344,280.00	7.37
311	003038	鑫铂股份	3,255,006.80	7.17
312	002727	一心堂	3,251,717.00	7.17
313	600383	金地集团	3,250,567.00	7.16
314	001270	铖昌科技	3,236,348.00	7.13
315	600309	万华化学	3,226,290.00	7.11
316	600277	亿利洁能	3,207,209.00	7.07
317	603636	南威软件	3,198,268.00	7.05
318	688390	固德威	3,176,487.37	7.00
319	603115	海星股份	3,141,742.00	6.93
320	002389	航天彩虹	3,136,763.00	6.91
321	600536	中国软件	3,131,237.50	6.90
322	600475	华光环能	3,131,190.46	6.90
323	688392	骄成超声	3,126,393.89	6.89
324	000733	振华科技	3,116,707.00	6.87
325	600048	保利发展	3,105,593.00	6.85
326	002334	英威腾	3,105,087.00	6.84
327	601717	郑煤机	3,102,944.00	6.84

328	688697	纽威数控	3,102,438.01	6.84
329	603338	浙江鼎力	3,102,175.00	6.84
330	603882	金域医学	3,098,211.08	6.83
331	605060	联德股份	3,091,327.00	6.81
332	600036	招商银行	3,089,244.00	6.81
333	603613	国联股份	3,085,617.23	6.80
334	600256	广汇能源	3,081,731.00	6.79
335	600188	兖矿能源	3,080,328.00	6.79
336	301326	捷邦科技	3,061,349.64	6.75
337	603191	望变电气	3,048,559.88	6.72
338	002876	三利谱	2,939,967.00	6.48
339	600233	圆通速递	2,898,548.00	6.39
340	603085	天成自控	2,879,317.00	6.35
341	601231	环旭电子	2,781,785.00	6.13
342	600438	通威股份	2,767,483.00	6.10
343	603878	武进不锈	2,753,985.24	6.07
344	605399	晨光新材	2,753,180.40	6.07
345	002669	康达新材	2,739,259.00	6.04
346	002738	中矿资源	2,718,387.00	5.99
347	688700	东威科技	2,659,322.02	5.86
348	300413	芒果超媒	2,652,750.00	5.85
349	603801	志邦家居	2,652,102.00	5.85
350	301278	快可电子	2,647,575.00	5.84
351	603008	喜临门	2,647,184.00	5.83
352	688105	诺唯赞	2,644,093.19	5.83
353	688047	龙芯中科	2,640,738.09	5.82
354	688108	赛诺医疗	2,627,986.65	5.79
355	001203	大中矿业	2,586,063.00	5.70
356	002129	TCL 中环	2,537,378.00	5.59
357	688080	映翰通	2,518,958.57	5.55
358	000683	远兴能源	2,511,272.00	5.54
359	603444	吉比特	2,480,202.00	5.47
360	000066	中国长城	2,460,689.00	5.42
361	603599	广信股份	2,460,652.00	5.42
362	688659	元琛科技	2,424,299.03	5.34
363	603896	寿仙谷	2,411,096.90	5.31
364	600958	东方证券	2,403,196.00	5.30
365	603198	迎驾贡酒	2,397,894.00	5.29
366	300131	英唐智控	2,373,953.00	5.23
367	603225	新风鸣	2,365,346.00	5.21
368	688114	华大智造	2,362,863.87	5.21
369	002241	歌尔股份	2,329,067.00	5.13
370	688778	厦钨新能	2,320,496.48	5.11

371	300786	国林科技	2,307,981.20	5.09
372	301208	中亦科技	2,277,535.00	5.02
373	600926	杭州银行	2,271,795.00	5.01
374	603337	杰克股份	2,244,880.97	4.95
375	002623	亚玛顿	2,202,088.00	4.85
376	688299	长阳科技	2,171,036.06	4.79
377	301099	雅创电子	2,157,988.00	4.76
378	603011	合锻智能	2,078,542.00	4.58
379	000547	航天发展	2,051,762.00	4.52
380	688291	金橙子	2,020,404.95	4.45
381	002385	大北农	1,972,799.00	4.35
382	002205	国统股份	1,951,639.00	4.30
383	300161	华中数控	1,948,304.00	4.29
384	688369	致远互联	1,881,124.22	4.15
385	603501	韦尔股份	1,794,466.80	3.96
386	300177	中海达	1,791,554.00	3.95
387	002206	海利得	1,766,269.00	3.89
388	600258	首旅酒店	1,765,011.00	3.89
389	002549	凯美特气	1,759,134.00	3.88
390	300212	易华录	1,758,050.00	3.88
391	002891	中宠股份	1,755,585.00	3.87
392	688045	必易微	1,754,359.60	3.87
393	605222	起帆电缆	1,750,344.00	3.86
394	002430	杭氧股份	1,698,520.00	3.74
395	300037	新宙邦	1,695,027.00	3.74
396	300926	博俊科技	1,615,542.00	3.56
397	301318	维海德	1,592,795.84	3.51
398	000519	中兵红箭	1,565,925.00	3.45
399	002965	祥鑫科技	1,544,826.80	3.41
400	688499	利元亨	1,525,234.88	3.36
401	601800	中国交建	1,503,229.00	3.31
402	002555	三七互娱	1,477,718.00	3.26
403	000786	北新建材	1,471,238.00	3.24
404	605111	新洁能	1,449,554.00	3.20
405	301168	通灵股份	1,445,600.00	3.19
406	300382	斯莱克	1,409,400.00	3.11
407	300629	新劲刚	1,388,225.00	3.06
408	000999	华润三九	1,375,901.00	3.03
409	300285	国瓷材料	1,370,319.00	3.02
410	688777	中控技术	1,365,079.50	3.01
411	688162	巨一科技	1,361,904.98	3.00
412	688187	时代电气	1,358,144.82	2.99
413	600941	中国移动	1,324,373.00	2.92

414	300766	每日互动	1,323,467.00	2.92
415	688385	复旦微电	1,320,894.31	2.91
416	688020	方邦股份	1,315,119.66	2.90
417	601222	林洋能源	1,309,531.00	2.89
418	002675	东诚药业	1,250,054.00	2.76
419	002262	恩华药业	1,248,827.00	2.75
420	688320	禾川科技	1,242,505.97	2.74
421	301077	星华新材	1,237,607.60	2.73
422	002837	英维克	1,237,562.70	2.73
423	300124	汇川技术	1,236,664.00	2.73
424	600761	安徽合力	1,235,435.00	2.72
425	002952	亚世光电	1,232,919.00	2.72
426	601007	金陵饭店	1,211,764.00	2.67
427	600863	内蒙华电	1,199,388.00	2.64
428	002006	精工科技	1,159,159.00	2.56
429	300073	当升科技	1,140,275.00	2.51
430	000762	西藏矿业	1,118,529.00	2.47
431	603605	珀莱雅	1,102,333.00	2.43
432	301163	宏德股份	1,053,992.00	2.32
433	301046	能辉科技	1,045,954.00	2.31
434	301096	百诚医药	1,022,934.32	2.25
435	002080	中材科技	1,015,445.00	2.24
436	688819	天能股份	1,001,000.18	2.21
437	605358	立昂微	999,727.56	2.20
438	300666	江丰电子	975,154.00	2.15
439	603612	索通发展	942,016.00	2.08
440	300421	力星股份	935,819.00	2.06
441	688550	瑞联新材	922,305.67	2.03

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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	95,053,612.75	209.52
2	300014	亿纬锂能	60,934,295.35	134.31
3	300750	宁德时代	43,830,111.65	96.61
4	000069	华侨城 A	42,513,098.97	93.71
5	600330	天通股份	39,333,035.74	86.70
6	000568	泸州老窖	37,604,425.00	82.89
7	601899	紫金矿业	36,929,429.36	81.40
8	601601	中国太保	35,151,027.50	77.48

9	600603	广汇物流	34,714,377.25	76.52
10	002903	宇环数控	33,500,971.00	73.84
11	688560	明冠新材	31,902,988.67	70.32
12	002436	兴森科技	31,522,297.00	69.48
13	600298	安琪酵母	31,029,899.26	68.40
14	688033	天宜上佳	30,578,219.72	67.40
15	601668	中国建筑	30,013,686.10	66.16
16	300498	温氏股份	29,543,902.88	65.12
17	002595	豪迈科技	29,179,291.15	64.32
18	603308	应流股份	28,705,696.92	63.27
19	601669	中国电建	28,151,574.00	62.05
20	600131	国网信通	27,436,783.00	60.48
21	000333	美的集团	27,280,013.00	60.13
22	603260	合盛硅业	26,591,118.60	58.61
23	688037	芯源微	24,947,655.11	54.99
24	000630	铜陵有色	24,760,784.00	54.58
25	002245	蔚蓝锂芯	23,865,862.00	52.61
26	603936	博敏电子	22,416,631.00	49.41
27	600418	江淮汽车	21,274,106.00	46.89
28	688301	奕瑞科技	21,269,093.13	46.88
29	000537	广宇发展	20,014,830.67	44.12
30	300803	指南针	19,530,515.44	43.05
31	002027	分众传媒	19,318,404.75	42.58
32	600745	闻泰科技	19,036,618.00	41.96
33	300347	泰格医药	18,893,644.00	41.65
34	001330	博纳影业	18,884,246.23	41.62
35	300996	普联软件	18,725,501.00	41.27
36	601208	东材科技	18,699,300.01	41.22
37	688186	广大特材	18,438,602.70	40.64
38	300724	捷佳伟创	17,283,356.75	38.10
39	600487	亨通光电	16,865,858.40	37.18
40	600549	厦门钨业	16,834,184.50	37.11
41	002475	立讯精密	16,722,027.00	36.86
42	601868	中国能建	16,466,025.00	36.29
43	600057	厦门象屿	16,460,361.40	36.28
44	300661	圣邦股份	15,787,060.00	34.80
45	300360	炬华科技	15,710,506.80	34.63
46	002335	科华数据	14,999,009.00	33.06
47	300451	创业慧康	14,971,657.09	33.00
48	002158	汉钟精机	14,747,182.21	32.51
49	002001	新和成	14,724,977.88	32.46
50	001979	招商蛇口	14,526,515.75	32.02
51	000657	中钨高新	14,210,685.25	31.32

52	002846	英联股份	14,150,925.84	31.19
53	000933	神火股份	14,124,994.00	31.13
54	600690	海尔智家	14,122,512.00	31.13
55	002384	东山精密	14,051,557.00	30.97
56	002216	三全食品	13,907,012.50	30.65
57	300331	苏大维格	13,705,281.00	30.21
58	603595	东尼电子	13,570,704.00	29.91
59	300274	阳光电源	13,517,953.00	29.80
60	600376	首开股份	13,412,383.56	29.56
61	603799	华友钴业	13,376,337.00	29.48
62	601882	海天精工	13,202,745.00	29.10
63	002063	远光软件	13,050,473.00	28.77
64	300586	美联新材	12,954,889.00	28.56
65	603063	禾望电气	12,949,614.00	28.54
66	600702	舍得酒业	12,936,455.00	28.51
67	300083	创世纪	12,631,997.88	27.84
68	603806	福斯特	12,597,508.81	27.77
69	002068	黑猫股份	12,416,352.00	27.37
70	600522	中天科技	12,403,469.00	27.34
71	688372	伟测科技	12,239,550.53	26.98
72	002511	中顺洁柔	12,225,673.00	26.95
73	688595	芯海科技	12,119,680.82	26.71
74	603496	恒为科技	12,010,700.80	26.47
75	688170	德龙激光	11,968,281.44	26.38
76	603916	苏博特	11,874,413.00	26.17
77	300019	硅宝科技	11,873,300.08	26.17
78	002371	北方华创	11,760,258.37	25.92
79	688518	联赢激光	11,633,595.50	25.64
80	600009	上海机场	11,618,824.70	25.61
81	300693	盛弘股份	11,612,975.00	25.60
82	000625	长安汽车	11,580,278.00	25.53
83	300373	扬杰科技	11,542,258.45	25.44
84	603100	川仪股份	11,418,021.00	25.17
85	600050	中国联通	11,256,755.00	24.81
86	300366	创意信息	11,244,107.25	24.78
87	601628	中国人寿	11,103,222.16	24.47
88	300820	英杰电气	11,086,059.75	24.44
89	002987	京北方	11,008,946.86	24.27
90	000799	酒鬼酒	11,006,596.00	24.26
91	300463	迈克生物	10,976,020.43	24.19
92	300024	机器人	10,920,074.23	24.07
93	605589	圣泉集团	10,912,605.16	24.05
94	002897	意华股份	10,839,987.00	23.89

95	300760	迈瑞医疗	10,836,331.35	23.89
96	002860	星帅尔	10,801,707.00	23.81
97	300672	国科微	10,781,895.00	23.77
98	688508	芯朋微	10,759,195.94	23.72
99	300058	蓝色光标	10,634,099.00	23.44
100	002532	天山铝业	10,624,524.66	23.42
101	301021	英诺激光	10,608,619.59	23.38
102	600509	天富能源	10,548,086.00	23.25
103	301026	浩通科技	10,496,143.11	23.14
104	000975	银泰黄金	10,474,643.00	23.09
105	688066	航天宏图	10,457,732.30	23.05
106	601111	中国国航	10,407,397.32	22.94
107	688599	天合光能	10,157,567.21	22.39
108	600580	卧龙电驱	10,074,795.31	22.21
109	300316	晶盛机电	10,017,036.00	22.08
110	603505	金石资源	9,951,883.00	21.94
111	601155	新城控股	9,885,677.00	21.79
112	600325	华发股份	9,849,228.80	21.71
113	300203	聚光科技	9,844,577.00	21.70
114	688012	中微公司	9,832,623.19	21.67
115	002539	云图控股	9,772,700.52	21.54
116	603508	思维列控	9,683,982.00	21.35
117	603927	中科软	9,681,395.00	21.34
118	300219	鸿利智汇	9,642,076.00	21.25
119	600436	片仔癀	9,635,292.00	21.24
120	600566	济川药业	9,626,086.00	21.22
121	603816	顾家家居	9,585,143.00	21.13
122	301195	北路智控	9,570,031.60	21.09
123	003029	吉大正元	9,471,520.00	20.88
124	600011	华能国际	9,425,685.00	20.78
125	688596	正帆科技	9,415,410.08	20.75
126	002851	麦格米特	9,407,567.09	20.74
127	002020	京新药业	9,330,611.48	20.57
128	688579	山大地纬	9,288,662.98	20.47
129	300253	卫宁健康	9,183,662.00	20.24
130	000301	东方盛虹	8,942,847.00	19.71
131	600633	浙数文化	8,940,770.44	19.71
132	600588	用友网络	8,886,972.00	19.59
133	603885	吉祥航空	8,847,097.00	19.50
134	002028	思源电气	8,777,743.00	19.35
135	688556	高测股份	8,728,354.10	19.24
136	301102	兆讯传媒	8,684,296.00	19.14
137	002460	赣锋锂业	8,640,507.00	19.05

138	688099	晶晨股份	8,533,923.41	18.81
139	300433	蓝思科技	8,504,058.00	18.74
140	000034	神州数码	8,499,938.00	18.74
141	002270	华明装备	8,498,780.00	18.73
142	603297	永新光学	8,456,251.66	18.64
143	300634	彩讯股份	8,440,529.65	18.60
144	300481	濮阳惠成	8,434,605.00	18.59
145	688519	南亚新材	8,405,473.28	18.53
146	002444	巨星科技	8,298,184.00	18.29
147	000002	万科A	8,163,568.00	17.99
148	300353	东土科技	8,062,771.00	17.77
149	603138	海量数据	7,988,302.56	17.61
150	002765	蓝黛科技	7,986,359.00	17.60
151	002493	荣盛石化	7,929,074.00	17.48
152	300525	博思软件	7,907,342.50	17.43
153	002237	恒邦股份	7,800,323.00	17.19
154	688015	交控科技	7,725,063.23	17.03
155	000049	德赛电池	7,627,763.87	16.81
156	600875	东方电气	7,626,440.00	16.81
157	300567	精测电子	7,618,282.00	16.79
158	688628	优利德	7,462,085.68	16.45
159	002304	洋河股份	7,428,220.10	16.37
160	002938	鹏鼎控股	7,344,971.80	16.19
161	603209	兴通股份	7,312,209.00	16.12
162	603396	金辰股份	7,291,464.00	16.07
163	002120	韵达股份	7,199,635.00	15.87
164	601390	中国中铁	7,198,762.00	15.87
165	300174	元力股份	7,192,071.06	15.85
166	688008	澜起科技	7,176,267.72	15.82
167	002078	太阳纸业	6,963,506.80	15.35
168	002171	楚江新材	6,925,919.00	15.27
169	002508	老板电器	6,913,939.17	15.24
170	002352	顺丰控股	6,903,665.00	15.22
171	002648	卫星化学	6,867,489.46	15.14
172	000661	长春高新	6,847,638.00	15.09
173	603077	和邦生物	6,847,039.96	15.09
174	688023	安恒信息	6,835,168.72	15.07
175	301369	联动科技	6,816,873.96	15.03
176	688362	甬矽电子	6,798,071.93	14.98
177	002567	唐人神	6,777,212.00	14.94
178	600426	华鲁恒升	6,769,696.00	14.92
179	300575	中旗股份	6,720,993.75	14.81
180	600821	金开新能	6,704,766.00	14.78

181	688060	云涌科技	6,677,808.86	14.72
182	002840	华统股份	6,632,931.52	14.62
183	300217	东方电热	6,625,628.00	14.60
184	300327	中颖电子	6,612,494.80	14.58
185	003022	联泓新科	6,517,322.83	14.37
186	000001	平安银行	6,422,698.00	14.16
187	603893	瑞芯微	6,416,379.00	14.14
188	600489	中金黄金	6,393,369.12	14.09
189	603456	九洲药业	6,391,787.00	14.09
190	002992	宝明科技	6,386,818.00	14.08
191	002230	科大讯飞	6,353,699.00	14.00
192	002410	广联达	6,334,359.24	13.96
193	688630	芯碁微装	6,324,499.79	13.94
194	601021	春秋航空	6,309,342.08	13.91
195	000681	视觉中国	6,298,582.00	13.88
196	002223	鱼跃医疗	6,207,190.00	13.68
197	002438	江苏神通	6,192,232.00	13.65
198	000682	东方电子	6,116,651.00	13.48
199	603628	清源股份	6,063,854.00	13.37
200	002049	紫光国微	6,046,243.00	13.33
201	002603	以岭药业	5,999,180.00	13.22
202	600406	国电南瑞	5,952,270.52	13.12
203	000983	山西焦煤	5,946,817.00	13.11
204	002368	太极股份	5,937,280.48	13.09
205	002155	湖南黄金	5,923,262.54	13.06
206	002943	宇晶股份	5,861,262.00	12.92
207	000887	中鼎股份	5,855,616.32	12.91
208	002192	融捷股份	5,851,775.00	12.90
209	601838	成都银行	5,835,729.00	12.86
210	600079	人福医药	5,826,376.00	12.84
211	300092	科新机电	5,810,975.00	12.81
212	300033	同花顺	5,661,366.09	12.48
213	300482	万孚生物	5,655,426.00	12.47
214	300207	欣旺达	5,636,961.81	12.43
215	300752	隆利科技	5,621,457.20	12.39
216	603738	泰晶科技	5,615,443.36	12.38
217	002271	东方雨虹	5,608,950.50	12.36
218	601728	中国电信	5,547,906.00	12.23
219	300876	蒙泰高新	5,534,066.20	12.20
220	002396	星网锐捷	5,473,642.00	12.07
221	600872	中炬高新	5,457,150.00	12.03
222	300458	全志科技	5,438,521.40	11.99
223	688256	寒武纪	5,438,362.49	11.99

224	002045	国光电器	5,413,845.00	11.93
225	300832	新产业	5,341,294.00	11.77
226	002865	钧达股份	5,337,619.00	11.77
227	600138	中青旅	5,335,285.00	11.76
228	688699	明微电子	5,316,188.42	11.72
229	603187	海容冷链	5,239,630.00	11.55
230	300339	润和软件	5,173,910.79	11.40
231	000811	冰轮环境	5,165,811.00	11.39
232	603078	江化微	5,164,622.11	11.38
233	688665	四方光电	5,160,361.92	11.37
234	300068	南都电源	5,102,698.04	11.25
235	301004	嘉益股份	5,034,254.00	11.10
236	000690	宝新能源	5,026,015.97	11.08
237	600732	爱旭股份	5,023,144.00	11.07
238	002276	万马股份	4,959,142.00	10.93
239	600027	华电国际	4,903,300.00	10.81
240	605108	同庆楼	4,873,879.00	10.74
241	688125	安达智能	4,853,332.45	10.70
242	000534	万泽股份	4,853,222.00	10.70
243	688300	联瑞新材	4,847,206.48	10.68
244	002594	比亚迪	4,803,456.00	10.59
245	002318	久立特材	4,771,875.67	10.52
246	688378	奥来德	4,726,620.62	10.42
247	600212	绿能慧充	4,717,235.00	10.40
248	688032	禾迈股份	4,698,916.43	10.36
249	688271	联影医疗	4,663,561.50	10.28
250	688123	聚辰股份	4,630,723.04	10.21
251	300652	雷迪克	4,616,548.00	10.18
252	688680	海优新材	4,591,742.48	10.12
253	600988	赤峰黄金	4,581,057.00	10.10
254	000708	中信特钢	4,522,480.90	9.97
255	600547	山东黄金	4,491,800.00	9.90
256	688120	华海清科	4,438,553.63	9.78
257	601888	中国中免	4,405,997.50	9.71
258	000513	丽珠集团	4,397,132.00	9.69
259	688003	天准科技	4,333,364.24	9.55
260	600519	贵州茅台	4,317,351.00	9.52
261	002046	国机精工	4,287,855.00	9.45
262	000498	山东路桥	4,270,345.00	9.41
263	600754	锦江酒店	4,029,834.00	8.88
264	300260	新莱应材	4,027,245.00	8.88
265	688401	路维光电	4,007,753.30	8.83
266	000591	太阳能	3,956,304.00	8.72

267	688408	中信博	3,911,892.15	8.62
268	688031	星环科技	3,892,175.33	8.58
269	600795	国电电力	3,891,683.00	8.58
270	688155	先惠技术	3,868,380.94	8.53
271	688697	纽威数控	3,861,312.94	8.51
272	688559	海目星	3,827,778.35	8.44
273	000768	中航西飞	3,822,087.00	8.42
274	603259	药明康德	3,798,000.00	8.37
275	688233	神工股份	3,717,151.34	8.19
276	600299	安迪苏	3,665,157.00	8.08
277	300850	新强联	3,649,642.00	8.04
278	603019	中科曙光	3,630,106.00	8.00
279	002559	亚威股份	3,625,492.50	7.99
280	300088	长信科技	3,620,514.96	7.98
281	603639	海利尔	3,609,673.40	7.96
282	603565	中谷物流	3,566,666.52	7.86
283	002273	水晶光电	3,538,316.00	7.80
284	601225	陕西煤业	3,409,838.00	7.52
285	600075	新疆天业	3,408,470.00	7.51
286	002053	云南能投	3,398,520.00	7.49
287	003038	鑫铂股份	3,389,800.00	7.47
288	000733	振华科技	3,371,583.00	7.43
289	603338	浙江鼎力	3,334,135.00	7.35
290	001270	铖昌科技	3,332,988.00	7.35
291	301122	采纳股份	3,322,664.00	7.32
292	603667	五洲新春	3,321,645.00	7.32
293	603882	金域医学	3,302,097.00	7.28
294	688183	生益电子	3,290,080.11	7.25
295	603185	上机数控	3,279,181.36	7.23
296	605060	联德股份	3,269,451.00	7.21
297	002727	一心堂	3,261,202.00	7.19
298	600536	中国软件	3,214,824.00	7.09
299	603115	海星股份	3,180,458.00	7.01
300	600277	亿利洁能	3,147,797.00	6.94
301	002334	英威腾	3,122,581.00	6.88
302	605507	国邦医药	3,100,474.00	6.83
303	600309	万华化学	3,099,165.00	6.83
304	600383	金地集团	3,050,196.00	6.72
305	002876	三利谱	3,024,729.00	6.67
306	603636	南威软件	3,015,402.00	6.65
307	688390	固德威	2,956,350.06	6.52
308	603085	天成自控	2,938,561.00	6.48
309	600036	招商银行	2,935,240.00	6.47

310	600048	保利发展	2,932,884.00	6.46
311	601717	郑煤机	2,931,360.00	6.46
312	688392	骄成超声	2,928,961.57	6.46
313	688025	杰普特	2,890,628.55	6.37
314	002389	航天彩虹	2,889,890.00	6.37
315	002623	亚玛顿	2,853,612.00	6.29
316	600256	广汇能源	2,846,772.00	6.27
317	688700	东威科技	2,836,248.67	6.25
318	603613	国联股份	2,833,567.88	6.25
319	600188	兖矿能源	2,831,614.00	6.24
320	603191	望变电气	2,799,544.56	6.17
321	603878	武进不锈	2,789,215.00	6.15
322	301326	捷邦科技	2,770,859.84	6.11
323	600475	华光环能	2,736,991.40	6.03
324	688659	元琛科技	2,720,182.09	6.00
325	600438	通威股份	2,684,368.00	5.92
326	002129	TCL 中环	2,684,350.00	5.92
327	688105	诺唯赞	2,661,325.01	5.87
328	601231	环旭电子	2,645,189.00	5.83
329	001203	大中矿业	2,620,498.00	5.78
330	605399	晨光新材	2,535,531.10	5.59
331	688108	赛诺医疗	2,491,367.46	5.49
332	603198	迎驾贡酒	2,458,350.00	5.42
333	603896	寿仙谷	2,449,526.90	5.40
334	002738	中矿资源	2,420,407.00	5.34
335	000683	远兴能源	2,411,829.00	5.32
336	301278	快可电子	2,394,707.57	5.28
337	688114	华大智造	2,367,188.53	5.22
338	603599	广信股份	2,351,935.00	5.18
339	002241	歌尔股份	2,333,619.00	5.14
340	603225	新凤鸣	2,309,781.00	5.09
341	688047	龙芯中科	2,295,472.51	5.06
342	600926	杭州银行	2,280,735.00	5.03
343	688778	厦钨新能	2,274,128.08	5.01
344	603444	吉比特	2,269,068.37	5.00
345	688299	长阳科技	2,256,990.89	4.97
346	603337	杰克股份	2,252,614.00	4.97
347	300786	国林科技	2,240,496.00	4.94
348	300131	英唐智控	2,197,552.00	4.84
349	000066	中国长城	2,183,866.00	4.81
350	600958	东方证券	2,177,712.00	4.80
351	002205	国统股份	2,175,781.00	4.80
352	301099	雅创电子	2,106,550.39	4.64

353	301208	中亦科技	2,088,318.00	4.60
354	603011	合锻智能	2,079,772.00	4.58
355	600096	云天化	2,066,248.88	4.55
356	002385	大北农	2,026,568.00	4.47
357	300161	华中数控	2,018,748.00	4.45
358	300212	易华录	1,988,667.00	4.38
359	688291	金橙子	1,948,361.76	4.29
360	688369	致远互联	1,907,014.84	4.20
361	000547	航天发展	1,883,900.93	4.15
362	605222	起帆电缆	1,850,187.00	4.08
363	002549	凯美特气	1,820,544.00	4.01
364	002430	杭氧股份	1,787,420.00	3.94
365	002891	中宠股份	1,774,136.00	3.91
366	002206	海利得	1,763,996.00	3.89
367	603501	韦尔股份	1,736,486.00	3.83
368	600258	首旅酒店	1,684,056.00	3.71
369	300037	新宙邦	1,618,819.40	3.57
370	000519	中兵红箭	1,608,012.00	3.54
371	002965	祥鑫科技	1,597,563.00	3.52
372	688499	利元亨	1,596,589.33	3.52
373	301318	维海德	1,590,548.08	3.51
374	688045	必易微	1,584,517.84	3.49
375	688262	国芯科技	1,573,878.43	3.47
376	601800	中国交建	1,529,612.00	3.37
377	600456	宝钛股份	1,528,930.00	3.37
378	688777	中控技术	1,515,404.70	3.34
379	300177	中海达	1,499,153.00	3.30
380	300926	博俊科技	1,492,537.00	3.29
381	605111	新洁能	1,482,656.00	3.27
382	301168	通灵股份	1,464,974.00	3.23
383	002555	三七互娱	1,460,625.00	3.22
384	300382	斯莱克	1,441,351.00	3.18
385	000786	北新建材	1,427,447.48	3.15
386	300285	国瓷材料	1,415,680.00	3.12
387	600761	安徽合力	1,394,086.00	3.07
388	601222	林洋能源	1,368,791.00	3.02
389	688162	巨一科技	1,364,926.08	3.01
390	600941	中国移动	1,342,338.00	2.96
391	688385	复旦微电	1,323,476.85	2.92
392	688020	方邦股份	1,313,560.08	2.90
393	688187	时代电气	1,312,524.85	2.89
394	002262	恩华药业	1,311,535.00	2.89
395	000999	华润三九	1,284,381.00	2.83

396	002675	东诚药业	1,270,546.00	2.80
397	300124	汇川技术	1,258,098.00	2.77
398	688320	禾川科技	1,254,564.05	2.77
399	300766	每日互动	1,243,963.00	2.74
400	002952	亚世光电	1,243,788.00	2.74
401	002837	英维克	1,237,415.00	2.73
402	600863	内蒙华电	1,186,796.00	2.62
403	301046	能辉科技	1,185,779.00	2.61
404	601007	金陵饭店	1,171,967.00	2.58
405	300629	新劲刚	1,160,512.10	2.56
406	002006	精功科技	1,120,806.00	2.47
407	603605	珀莱雅	1,110,931.00	2.45
408	301077	星华新材	1,097,641.00	2.42
409	000762	西藏矿业	1,090,755.00	2.40
410	300666	江丰电子	1,040,057.00	2.29
411	301096	百诚医药	1,029,866.00	2.27
412	301163	宏德股份	1,026,792.00	2.26
413	300421	力星股份	1,018,102.00	2.24
414	300125	聆达股份	1,014,992.00	2.24
415	688819	天能股份	1,013,807.57	2.23
416	605358	立昂微	994,354.45	2.19
417	688200	华峰测控	990,512.15	2.18
418	002080	中材科技	968,632.00	2.14
419	603612	索通发展	967,729.00	2.13
420	300073	当升科技	954,600.00	2.10
421	688550	瑞联新材	937,099.27	2.07
422	601058	赛轮轮胎	913,110.00	2.01

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

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,966,111,748.89
卖出股票收入（成交）总额	3,485,503,650.29

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	460,878,888.29	18.00
2	央行票据	-	-

3	金融债券	742,745,801.73	29.01
	其中：政策性金融债	742,745,801.73	29.01
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	633,292,640.55	24.74
6	中期票据	93,457,991.23	3.65
7	可转债（可交换债）	156,308,690.25	6.11
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,086,684,012.05	81.50

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	012283722	22 中交建 SCP008	1,700,000	170,368,876.71	6.65
2	210312	21 进出 12	1,600,000	164,288,482.19	6.42
3	012282520	22 南电 SCP010	1,500,000	150,777,780.82	5.89
4	020511	22 贴债 50	1,300,000	129,480,714.29	5.06
5	160207	16 国开 07	1,000,000	102,891,780.82	4.02

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

无。

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

无。

#### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

#### 8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 8.10.1 本期国债期货投资政策

无。

##### 8.10.2 本期国债期货投资评价

无。

## 8.11 投资组合报告附注

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

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

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）10 号行政处罚决定书，给予中国农业发展银行 480 万元人民币罚款的行政处罚。

2022 年 7 月 20 日，中国证券监督管理委员会下发《立案告知书》（证监立案字 0272022001 号）和《调查通知书》（证监调查字 0272022025 号），因公司涉嫌信息披露违法违规，根据《中华人民共和国证券法》《中华人民共和国行政处罚法》等法律法规，中国证监会决定对中国农业发展银行立案。

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。

2022 年 3 月 25 日，中国银保监会公示银保监罚决字（2022）9 号行政处罚决定书，给予中国进出口银行 420 万元人民币罚款的行政处罚。

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

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

### 8.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

### 8.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	431,773.83
2	应收清算款	78,314,587.41
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	106,793.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	78,853,154.74

### 8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110053	苏银转债	72,469,731.17	2.83
2	110068	龙净转债	59,249,788.65	2.31
3	113048	晶科转债	13,259,679.01	0.52
4	128121	宏川转债	3,902,571.49	0.15
5	127039	北港转债	1,286,114.19	0.05
6	113050	南银转债	1,005,503.33	0.04

### 8.11.5 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	600038	中直股份	14,275,716.00	0.56	重大事项

### 8.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
交银稳固收益债券 A	114,938	17,821.96	1,771,392,991.30	86.48	277,027,858.46	13.52
交银稳固收益债券 C	1,833	101,664.70	183,232,107.62	98.33	3,119,290.12	1.67
合计	116,771	19,138.08	1,954,625,098.92	87.46	280,147,148.58	12.54

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持	交银稳固收益债券 A	991,509.65	0.05
	交银稳固收益债券 C	1,641.50	0.00

有本基金			
	合计	993,151.15	0.04

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

无。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	交银稳固收益债券 A	交银稳固收益债券 C
基金合同生效日 (2019 年 5 月 31 日) 基金份额总额	744,437,272.39	-
本报告期期初基金 份额总额	38,166,353.01	-
本报告期基金总申 购份额	2,412,049,396.33	241,818,184.00
减：本报告期基金 总赎回份额	401,794,899.58	55,466,786.26
本报告期基金拆分 变动份额	-	-
本报告期期末基金 份额总额	2,048,420,849.76	186,351,397.74

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人的重大人事变动：2022 年 7 月 30 日本基金管理人发布公告，经公司第五届董事会第三十五次会议审议通过，夏华龙先生离任公司副总经理和首席信息官职位。

2、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动：2022 年 3 月，中国农业银行总行决定王霄勇任托管业务部总裁。2022 年 3 月，中国农业银行总行决定王洪滨任托管业务部高级专家。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

#### 11.4 基金投资策略的改变

无。

#### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)，本期审计费为 30,000.00 元。自本基金基金合同生效以来，本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

#### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

##### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金管理人及其高级管理人员本报告期内未受监管部门稽查或处罚。

##### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中无受稽查或处罚等情况。

#### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国泰君安证券	1	1,237,255,277.51	16.61	1,152,258.53	16.61	-
西部证券	1	904,979,260.17	12.15	842,808.39	12.15	-
光大证券	1	843,486,370.40	11.32	785,540.32	11.32	-
天风证券	1	559,881,012.21	7.51	521,417.04	7.51	-
长江证券	2	552,732,175.95	7.42	514,757.50	7.42	-
申万宏源证券	2	518,678,928.17	6.96	483,045.92	6.96	-
西南证券	1	508,954,264.88	6.83	473,985.33	6.83	-
华泰证券	1	505,971,814.15	6.79	471,211.84	6.79	-
招商证券	1	417,398,494.28	5.60	388,725.59	5.60	-
中金公司	1	404,853,939	5.43	377,038.78	5.43	-

		. 90				
民生证券	1	383, 522, 238 . 59	5. 15	357, 169. 62	5. 15	-
广发证券	1	205, 332, 027 . 89	2. 76	191, 225. 02	2. 76	-
兴业证券	1	154, 380, 188 . 15	2. 07	143, 776. 75	2. 07	-
东方证券	1	76, 676, 992. 75	1. 03	71, 407. 19	1. 03	-
北京高华 证券	1	70, 327, 957. 67	0. 94	65, 496. 55	0. 94	-
瑞银证券	1	52, 048, 618. 41	0. 70	48, 472. 59	0. 70	-
信达证券	1	46, 615, 568. 34	0. 63	43, 413. 11	0. 63	-
海通证券	1	7, 520, 280. 8 0	0. 10	7, 003. 75	0. 10	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
华信证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
新时代证 券	1	-	-	-	-	-
中信建投 证券	1	-	-	-	-	-

## 11. 7. 2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名 称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债 券 成交总额 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 (%)
国泰君 安证券	25, 660, 137 . 01	3. 68	172, 350, 000. 00	2. 76	-	-
西部证 券	54, 077, 981 . 55	7. 76	274, 590, 000. 00	4. 40	-	-
光大证	98, 409, 395	14. 13	19, 573, 000. 0	0. 31	-	-

券	.40		0			
天风证 券	162,805,34 7.91	23.37	638,523,000. 00	10.22	-	-
长江证 券	17,546,224 .25	2.52	319,182,000. 00	5.11	-	-
申万宏 源证券	20,666,871 .10	2.97	616,780,000. 00	9.87	-	-
西南证 券	31,525,571 .89	4.53	508,745,000. 00	8.14	-	-
华泰证 券	47,004,580 .70	6.75	389,289,000. 00	6.23	-	-
招商证 券	45,015,389 .03	6.46	1,082,600,00 0.00	17.33	-	-
中金公 司	6,957,659. 25	1.00	53,290,000.0 0	0.85	-	-
民生证 券	32,948,107 .03	4.73	724,045,000. 00	11.59	-	-
广发证 券	94,803,208 .40	13.61	696,605,000. 00	11.15	-	-
兴业证 券	34,941,453 .55	5.02	411,911,000. 00	6.59	-	-
东方证 券	-	-	182,267,000. 00	2.92	-	-
北京高 华证券	-	-	38,000,000.0 0	0.61	-	-
瑞银证 券	6,535,092. 60	0.94	8,516,000.00	0.14	-	-
信达证 券	17,709,686 .68	2.54	98,907,000.0 0	1.58	-	-
海通证 券	-	-	12,100,000.0 0	0.19	-	-
渤海证 券	-	-	-	-	-	-
川财证 券	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-
国联证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
华宝证 券	-	-	-	-	-	-
华西证	-	-	-	-	-	-

券						
华信证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
新时代 证券	-	-	-	-	-	-
中信建 投证券	-	-	-	-	-	-

注：1、报告期内，本基金交易单元未发生变化；

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

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

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	交银施罗德稳固收益债券型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	公司网站	2022 年 1 月 21 日
2	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 3 月 18 日
3	交银施罗德稳固收益债券型证券投资基金 2021 年年度报告	公司网站	2022 年 3 月 30 日
4	交银施罗德稳固收益债券型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	公司网站	2022 年 4 月 21 日
5	交银施罗德基金管理有限公司关于增聘交银施罗德稳固收益债券型证券投资基金基金经理的公告	上海证券报、公司网站	2022 年 4 月 21 日
6	交银施罗德稳固收益债券型证券投资基金基金产品资料概要更新(2022 年第 1 号)	公司网站	2022 年 4 月 26 日
7	交银施罗德稳固收益债券型证券投资基金(更新)招募说明书(2022 年第 1 号)	公司网站	2022 年 4 月 26 日
8	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德稳固收益债券型证券投资基金“3 年运作周期”第 1 期到期的提示性公告	上海证券报、公司网站	2022 年 5 月 26 日
9	交银施罗德稳固收益债券型证券投资基金基金产品资料概要更新(2022	公司网站	2022 年 5 月 27 日

	年第 2 号)		
10	交银施罗德稳固收益债券型证券投资基金(更新)招募说明书(2022 年第 2 号)	公司网站	2022 年 5 月 27 日
11	交银施罗德基金管理有限公司关于增加申万宏源证券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 6 月 2 日
12	交银施罗德基金管理有限公司关于增加华龙证券股份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、公司网站	2022 年 6 月 30 日
13	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德稳固收益债券型证券投资基金基金经理变更的公告	上海证券报、公司网站	2022 年 7 月 9 日
14	交银施罗德稳固收益债券型证券投资基金基金产品资料概要更新(2022 年第 3 号)	公司网站	2022 年 7 月 13 日
15	交银施罗德稳固收益债券型证券投资基金(更新)招募说明书(2022 年第 3 号)	公司网站	2022 年 7 月 13 日
16	交银施罗德稳固收益债券型证券投资基金 2022 年第 2 季度报告	公司网站	2022 年 7 月 20 日
17	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德稳固收益债券型证券投资基金开放日常转换业务的公告	上海证券报、公司网站	2022 年 7 月 21 日
18	交银施罗德基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2022 年 7 月 30 日
19	交银施罗德稳固收益债券型证券投资基金托管协议	公司网站	2022 年 8 月 12 日
20	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德稳固收益债券型证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同和托管协议的公告	上海证券报、公司网站	2022 年 8 月 12 日
21	交银施罗德稳固收益债券型证券投资基金(A 类份额)基金产品资料概要更新(2022 年第 4 号)	公司网站	2022 年 8 月 12 日
22	交银施罗德稳固收益债券型证券投资基金(C 类份额)基金产品资料概要更新(2022 年第 4 号)	公司网站	2022 年 8 月 12 日
23	交银施罗德稳固收益债券型证券投资基金(更新)招募说明书(2022 年第 4 号)	公司网站	2022 年 8 月 12 日
24	交银施罗德稳固收益债券型证券投资基金基金合同	公司网站	2022 年 8 月 12 日

25	交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金投资非公开发行股票的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2022 年 8 月 18 日
26	交银施罗德稳固收益债券型证券投资基金 2022 年中期报告	公司网站	2022 年 8 月 30 日
27	交银施罗德基金管理有限公司关于增加中国人寿保险股份有限公司为旗下基金的销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2022 年 8 月 31 日
28	交银施罗德基金管理有限公司关于增加华宝证券有限责任公司为旗下基金的销售机构的公告	上海证券报、证券时报、公司网站	2022 年 8 月 31 日
29	交银施罗德基金管理有限公司关于调整直销中心柜台投资者最低认申购金额限制的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2022 年 9 月 3 日
30	交银施罗德基金管理有限公司关于增加广发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 9 月 22 日
31	交银施罗德基金管理有限公司关于增加招商银行股份有限公司为旗下基金销售机构的公告	上海证券报、公司网站	2022 年 10 月 11 日
32	交银施罗德稳固收益债券型证券投资基金 2022 年第 3 季度报告	公司网站	2022 年 10 月 25 日
33	交银施罗德基金管理有限公司关于增加华泰证券股份有限公司为旗下基金的销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2022 年 12 月 9 日
34	交银施罗德基金管理有限公司关于增加腾安基金销售（深圳）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 12 月 9 日
35	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德稳固收益债券型证券投资基金 A 类基金份额暂停申购（转换转入、定期定额投资）业务的公告	上海证券报、公司网站	2022 年 12 月 17 日
36	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德稳固收益债券型证券投资基金 C 类基金份额暂停大额申购（转换转入、定期定额投资）业务的公告	上海证券报、公司网站	2022 年 12 月 17 日
37	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德稳固收益债券型证券投资基金分红公告	上海证券报、公司网站	2022 年 12 月 21 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	2022/1/1-2022/12/31	-	311,938,595.72	117,632,234.22	194,306,361.50	8.69
	2	2022/1/1-2022/12/31	17,651,368.05	-	-	17,651,368.05	0.79

#### 产品特有风险

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

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金基金合同的有关规定，经与基金托管人协商一致，本基金管理人于 2022 年 8 月 17 日起对本基金增加 C 类基金份额，并对本基金的基金合同、托管协议作相应修改，欲详情请查阅本基金管理人发布的最新法律文件。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《交银施罗德稳固收益债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《交银施罗德稳固收益债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《交银施罗德稳固收益债券型证券投资基金托管协议》；
- 5、《交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金基金合同》；
- 6、《交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金招募说明书》；
- 7、《交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金托管协议》；
- 8、《交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金保证合同》；
- 9、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 10、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 11、关于申请募集交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金之法律意见书；

12、关于修改《交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金基金合同》的法律意见书

13、报告期内交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金、交银施罗德稳固收益债券型证券投资基金在规定报刊上各项公告的原稿。

### 13.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

### 13.3 查阅方式

投资者可在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅备查文件，或者登录基金管理人的网站(www.fund001.com)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。