

交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资  
基金  
2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：交银施罗德基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 08 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	5
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	13
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	13
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 .....	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>14</b>
6.1 资产负债表 .....	14
6.2 利润表 .....	15
6.3 净资产（基金净值）变动表 .....	17
6.4 报表附注 .....	19
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	46
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	47
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	47
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	47

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	47
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	47
7.11 投资组合报告附注 .....	47
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>48</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	48
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>48</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>49</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	49
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	49
10.4 基金投资策略的改变 .....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	49
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	50
10.8 其他重大事件 .....	50
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>51</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	51
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>51</b>
12.1 备查文件目录 .....	51
12.2 存放地点 .....	51
12.3 查阅方式 .....	51

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金	
基金简称	交银定期支付月月丰债券	
基金主代码	519730	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013 年 8 月 13 日	
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	45,289,254.29 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	交银定期支付月月丰债券 A	交银定期支付月月丰债券 C
下属分级基金的交易代码	519730	519731
报告期末下属分级基金的份额总额	8,688,983.92 份	36,600,270.37 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金精选具有较高息票率的债券，以获取稳定的债息收入，并通过适当参与股票市场，力争实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势，将严谨、规范化的基本面研究分析与积极主动的投资风格相结合，在分析和判断宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上，自上而下决定债券组合久期、期限结构配置及债券类别配置；同时在严谨深入的信用分析基础上，综合考量企业债券的信用评级以及各类债券的流动性、供求关系和收益率水平等，自下而上地精选具有较高息票率的个券。同时，本基金深度关注股票、权证一级市场和二级市场的运行状况与相应风险收益特征，在严格控制基金资产运作风险的基础上，把握投资机会。
业绩比较基准	90%×中债综合全价指数收益率+10%×沪深 300 指数收益率
风险收益特征	本基金是一只债券型基金，属于证券投资基金中中等风险的品种，其长期平均的预期收益和预期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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王小飞
	联系电话	021-60637103
	电子邮箱	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话	400-700-5000, 021-61055000	021-60637228

传真	(021) 61055054	021-60635778
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号交通银行大楼二层（裙）	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	上海市浦东新区世纪大道 8 号国金中心二期 21-22 楼	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	200120	100033
法定代表人	阮红	田国立

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)	
	交银定期支付月月丰债券 A	交银定期支付月月丰债券 C
本期已实现收益	106,027.33	191,305.97
本期利润	199,504.71	546,839.86
加权平均基金份额本期利润	0.0225	0.0192
本期加权平均净值利润率	1.45%	1.29%
本期基金份额净值增长率	1.44%	1.24%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
	期末可供分配利润	17,903,724.82
	期末可供分配基金份额利润	0.4892

期末基金资产净值	13,475,199.74	54,503,995.19
期末基金份额净值	1.5508	1.4892
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	55.08%	48.92%

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

交银定期支付月月丰债券 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
过去一个月	-0.03%	0.17%	0.28%	0.09%	-0.31%	0.08%
过去三个月	-0.42%	0.14%	0.33%	0.08%	-0.75%	0.06%
过去六个月	1.44%	0.16%	1.06%	0.08%	0.38%	0.08%
过去一年	-3.32%	0.16%	-0.23%	0.10%	-3.09%	0.06%
过去三年	-1.66%	0.22%	2.35%	0.12%	-4.01%	0.10%
自基金合同生效起至今	55.08%	0.28%	18.75%	0.15%	36.33%	0.13%

交银定期支付月月丰债券 C

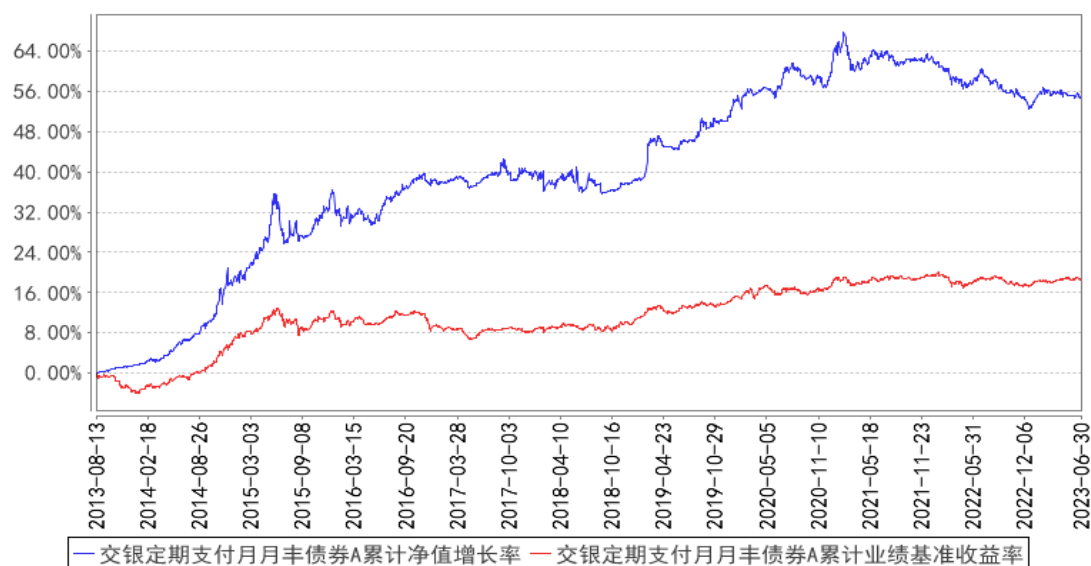
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.05%	0.18%	0.28%	0.09%	-0.33%	0.09%
过去三个月	-0.51%	0.14%	0.33%	0.08%	-0.84%	0.06%
过去六个月	1.24%	0.16%	1.06%	0.08%	0.18%	0.08%
过去一年	-3.71%	0.16%	-0.23%	0.10%	-3.48%	0.06%
过去三年	-2.86%	0.22%	2.35%	0.12%	-5.21%	0.10%

自基金合同生效 起至今	48.92%	0.28%	18.75%	0.15%	30.17%	0.13%
----------------	--------	-------	--------	-------	--------	-------

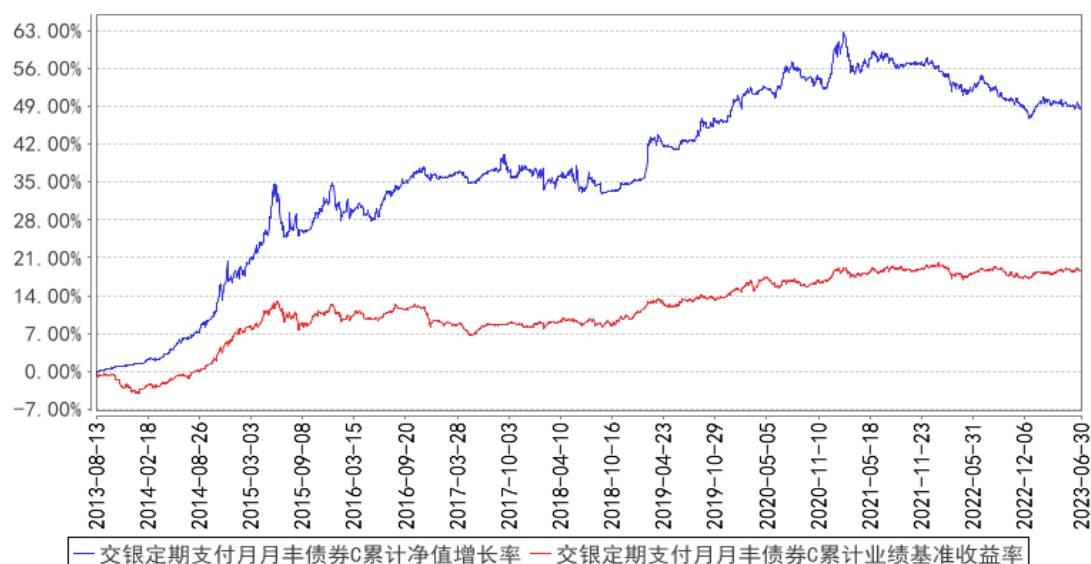
注：本基金的业绩比较基准为  $90\% \times$  中债综合全价指数收益率  $+10\% \times$  沪深 300 指数收益率，每日进行再平衡过程。

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

交银定期支付月月丰债券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



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



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至报告期末，公司管理了包括货币型、债券型、混合型和股票型在内的 122 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		
唐贇	交银信用添利债券（LOF）、交银双轮动债券、交银定期支付月月丰债券的基金经理	2020 年 7 月 14 日	-	13 年	唐贇先生，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。2015 年 11 月 7 日至 2023 年 5 月 5 日担任交银施罗德双利债券证券投资基金的基金经理。2020 年 7 月 14 日至 2023 年 5 月

					5 日担任交银施罗德强化回报债券型证券投资基金的基金经理。
邵文婷	交银上证 180 公司治理 ETF 及其联接、交银深证 300 价值 ETF 及其联接、交银中证海外中国互联网指数 ( QDII-LOF)、交银中证环境治理指数 (LOF)、交银创业板 50 指数、交银国证新能源指数 (LOF)、交银定期支付月月丰债券的基金经理	2022 年 11 月 30 日	-	7 年	邵文婷女士，中国国籍，英国诺丁汉大学金融与投资硕士、西南财经大学数学与经济学双学士。2016 年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任量化投资部研究员、投资经理。

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 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年上半年，债市呈现小牛市行情，收益率见顶回落。一季度，收益率震荡上行。一月初，居民取现需求抬升，资金面趋紧带动短端利率抬升，春节前央行持续大力度投放，经济复苏预期下市场弱势盘整。春节期间，全国返乡客流量明显修复，旅游和餐饮消费数据略好于预期，但节后债市利空出尽，叠加股市走弱，长端收益率小幅下行。进入三月，政府工作报告制定的增速目标和财政预算指标均处于市场预期区间的下限，债市情绪转为积极。随后，美国硅谷银行爆发风险事件，全球风险资产承压，避险情绪下债市延续走强。3 月 17 日，央行超预期宣布降准 0.25%，资金面逐步转松，中短端下行幅度大于长端，收益率曲线呈现陡峭化。二季度，债市收益率震荡下行。四月初，部分中小银行跟进存款利率下调，债市情绪转向积极，收益率小幅下行。四月，

制造业 PMI 回落至荣枯线下方，十年国债利率震荡下行。随后，公布的四月经济数据全面低于预期，基本面利好下市场延续震荡偏强。临近五月底，商品和股市大幅下跌带动市场风险偏好走低，但由于人民币汇率快速贬值，市场担忧货币政策的宽松空间有限，长端收益率窄幅震荡，而短端受益于资金面宽松明显下行，收益率曲线呈现牛陡。进入六月，月中央行超预期宣布降息，当日国债收益率下行后市场担忧稳增长政策发力，叠加汇率继续贬值，收益率明显上行并回吐降息后涨幅，月底政策温和发力，市场情绪有所修复，收益率小幅下行。权益方面，年初 A 股市场快速上行，主要指数均明显上涨。一月，北向资金净买入超 1400 亿元，创单月净流入金额历史新高。二月以来，市场行情有所分化，计算机、传媒、通信以及电子等数字经济相关板块成为市场热点。进入二季度，A 股市场整体呈现震荡下行态势，主要宽基指数均收跌。期间国内经济复苏放缓，人民币兑美元贬值压力较高，海外局势动荡，北向资金流入趋势亦放缓。四月以来，计算机、电子、通信以及传媒等前期热门板块也相继回调。六月初，在国内稳增长政策出台、美联储六月不加息、中美关系缓和等影响下，市场出现了一定反弹。报告期内，组合的债券资产维持短久期利率债配置，权益资产在行业和风格配置上较为均衡。

#### 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 年下半年，国内政策边际变化和经济修复节奏将成为影响债市的主要因素。一季度，国内复工复产、消费场景修复，经济上冲动能释放。进入二季度，环比修复斜率快速放缓，经济内生性动能弱于预期。考虑去年同期基数仅 0.4%，今年二季度 GDP 增速录得 6.3%，表现明显偏弱，且大幅低于预期的 6.8%，两年平均 3.4%，较一季度的 4.5%显著回落。预计二季度大概率录得年内高点，上半年 GDP 同比增长 5.5%，意味着下半年增速需要在 4.6%以上，才能完成全年增速目标。整体而言，年内经济动能高点已过，在需求端未见修复前，全年经济增速实现 5%目标仍需要政策托底。市场更加关注经济环比动能，在积压订单释放和需求脉冲式上行后，基本面修复节奏有所放缓。下半年居民消费和地产市场的改善情况，以及海外需求下行导致出口回落仍是潜在预期差。考虑猪肉供给压力较大，将继续拖累食品价格，叠加工业品需求不足，PPI 仍在底部震荡，下半年国内通胀压力整体可控。政策方面，专项债发行节奏或将加快，由于上半年土地出让收入增速较低，财政扩张来托底基建的诉求仍在，预计政策性金融工具等准财政措施将再度重启。考虑信贷投放有所降温，后续货币政策仍有进一步加码的空间，预计资金面保持平稳，但阶段性波动增大。对于债券市场，我们认为下半年或呈现震荡的态势。从中期来看，国债收益率仍有下

行空间。权益方面，六月以来稳增长政策有所加码，央行降息、新能源车购置税减免政策出台或将助力国内经济增长动能回升。从中长期来看，我们对 A 股市场维持谨慎乐观的看法。预计后续产业政策的出台将对 A 股市场形成一定支撑，未来符合产业趋势、估值合理、基本面较为确定的优质标的值得关注。组合策略方面，债券端，我们计划继续保持组合的利率债配置，并视组合规模情况，择机增加信用债的配置仓位。权益端，我们将继续保持组合权益仓位，争取能把握住增厚组合收益的机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

本基金本报告期内无需预警说明。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支、等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	13,557,804.63	9,374,481.33
结算备付金		191,317.20	65,964.30
存出保证金		10,951.25	2,315.39
交易性金融资产	6.4.7.2	65,147,233.27	61,230,064.87
其中：股票投资		9,990,721.82	7,820,341.71
基金投资		-	-
债券投资		55,156,511.45	53,409,723.16
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	2,000,000.00	2,999,517.26
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		713,563.19	-
应收股利		-	-
应收申购款		260.00	747.59

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		81,621,129.54	73,673,090.74
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-301.09	-
应付清算款		13,461,626.69	8,066,611.37
应付赎回款		-	73,265.61
应付管理人报酬		31,949.06	21,249.21
应付托管费		9,128.29	6,071.22
应付销售服务费		13,781.44	8,577.01
应付投资顾问费		-	-
应交税费		4,825.66	4,888.95
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	120,924.56	66,624.74
负债合计		13,641,934.61	8,247,288.11
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.10	45,289,254.29	44,121,612.39
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	22,689,940.64	21,304,190.24
净资产合计		67,979,194.93	65,425,802.63
负债和净资产总计		81,621,129.54	73,673,090.74

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 45,289,254.29 份，其中交银定期支付月月丰债券 A 基金份额总额 8,688,983.92 份，基金份额净值 1.5508 元；交银定期支付月月丰债券 C 基金份额总额 36,600,270.37 份，基金份额净值 1.4892 元。

## 6.2 利润表

会计主体：交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		1,142,963.82	-101,921.78
1. 利息收入		14,516.93	1,214.19
其中：存款利息收入	6.4.7.13	5,040.70	1,136.14
债券利息收入		-	-

资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		9,476.23	78.05
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		679,414.48	-91,405.21
其中：股票投资收益	6.4.7.14	130,047.89	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	453,108.29	-99,976.49
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	96,258.30	8,571.28
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	449,011.27	-11,791.98
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	21.14	61.22
<b>减：二、营业总支出</b>		396,619.25	135,786.25
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	195,705.56	43,408.15
2. 托管费	6.4.10.2.2	55,915.89	12,402.34
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	84,509.46	4,818.68
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		1,919.25	1,878.84
其中：卖出回购金融资产支出		1,919.25	1,878.84
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		82.51	0.27
8. 其他费用	6.4.7.23	58,486.58	73,277.97
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		746,344.57	-237,708.03
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		746,344.57	-237,708.03



五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		746,344.57	-237,708.03

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	44,121,612.39	-	21,304,190.24	65,425,802.63
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)	44,121,612.39	-	21,304,190.24	65,425,802.63
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,167,641.90	-	1,385,750.40	2,553,392.30
(一)、综合收益总额	-	-	746,344.57	746,344.57
(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)	1,167,641.90	-	639,405.83	1,807,047.73
其中：1. 基金申购款	17,936,723.90	-	8,817,507.76	26,754,231.66
2. 基金赎回款	-16,769,082.00	-	-8,178,101.93	-24,947,183.93
(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)	45,289,254.29	-	22,689,940.64	67,979,194.93
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	8,317,324.97	-	5,151,758.65	13,469,083.62
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)	8,317,324.97	-	5,151,758.65	13,469,083.62
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-838,251.44	-	-723,603.71	-1,561,855.15
(一)、综合收益总额	-	-	-237,708.03	-237,708.03
(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)	-838,251.44	-	-485,895.68	-1,324,147.12
其中：1. 基金申购款	151,255.36	-	84,846.34	236,101.70
2. 基金赎回款	-989,506.80	-	-570,742.02	-1,560,248.82
(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)	7,479,073.53	-	4,428,154.94	11,907,228.47

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

谢卫

印皓

单江

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]754号《关于核准交银施罗德定期支付月月丰债券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《交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币344,213,956.62元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2013)第508号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金基金合同》于2013年8月13日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为344,340,245.54份基金份额,其中认购资金利息折合126,288.92份基金份额。本基金的基金管理人为交银施罗德基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金基金合同》和《交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金招募说明书》,本基金自募集期起根据费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取前端认购/申购费用、赎回时收取赎回费用的,称为A类基金份额;在投资者认购/申购时不收取认购/申购费用,赎回时收取短期赎回费,并从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为C类基金份额。

根据《交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金基金合同》和《交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金每月定期按照约定的年化现金支付比率,以约定的定期支付基准日的基金份额净值为基础,计算当期基金份额持有人可获得支付的现金,并自动赎回基金份额持有人所持的对应金额的基金份额,以该自动赎回的资金向基金份额持有人进行现金支付。本基金当前的年化现金支付比率为4%。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证)、债券、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(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产净值的80%,对股票、权证等权益类资产的投资比例不高于基金资产的20%;其中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%，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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为  $90\% \times$  中债综合全价指数收益率  $+10\% \times$  沪深 300 指数收益率。

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 8 月 30 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

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

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年上半年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[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。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	13,557,804.63
等于：本金	13,557,601.08
加：应计利息	203.55
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	13,557,804.63

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	9,928,216.17	-	9,990,721.82	62,505.65
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	402,081.45	55,156,511.45	74,802.98
	银行间市场	-	-	-
	合计	402,081.45	55,156,511.45	74,802.98
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	64,607,843.19	402,081.45	65,147,233.27	137,308.63

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	2,000,000.00	-

银行间市场	-	-
合计	2,000,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。
----

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	71,952.98
其中：交易所市场	71,952.98
银行间市场	-

应付利息	-
预提审计费	14,876.39
预提信息披露费	24,795.19
预提账户维护费	9,300.00
合计	120,924.56

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

交银定期支付月月丰债券 A

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	9,112,295.25	9,112,295.25
本期申购	68,757.97	68,757.97
本期赎回（以“-”号填列）	-492,069.30	-492,069.30
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	8,688,983.92	8,688,983.92

交银定期支付月月丰债券 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	35,009,317.14	35,009,317.14
本期申购	17,867,965.93	17,867,965.93
本期赎回（以“-”号填列）	-16,277,012.70	-16,277,012.70
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	36,600,270.37	36,600,270.37

注：1、如果本报告期间发生红利再投、转换入业务，则总申购份额中包含该业务；

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

无。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

交银定期支付月月丰债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,207,555.57	-389,093.21	4,818,462.36



本期利润	106,027.33	93,477.38	199,504.71
本期基金份额交易产生的变动数	-245,034.54	13,283.29	-231,751.25
其中：基金申购款	40,306.38	-2,289.06	38,017.32
基金赎回款	-285,340.92	15,572.35	-269,768.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,068,548.36	-282,332.54	4,786,215.82

## 交银定期支付月月丰债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	17,940,300.58	-1,454,572.70	16,485,727.88
本期利润	191,305.97	355,533.89	546,839.86
本期基金份额交易产生的变动数	933,331.92	-62,174.84	871,157.08
其中：基金申购款	9,405,603.57	-626,113.13	8,779,490.44
基金赎回款	-8,472,271.65	563,938.29	-7,908,333.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	19,064,938.47	-1,161,213.65	17,903,724.82

## 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	2,498.47
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	2,031.29
其他	510.94
合计	5,040.70

## 6.4.7.14 股票投资收益

## 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	130,047.89
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	130,047.89

## 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	71,862,474.68
减：卖出股票成本总额	71,517,951.66
减：交易费用	214,475.13
买卖股票差价收入	130,047.89

## 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

## 6.4.7.15 债券投资收益

## 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	389,257.59
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	63,850.70
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	453,108.29

## 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	94,880,056.10
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	93,469,289.00
减：应计利息总额	1,345,455.62
减：交易费用	1,460.78
买卖债券差价收入	63,850.70

## 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

## 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

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

无。

## 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.17 贵金属投资收益

## 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

## 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

## 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.18 衍生工具收益

## 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	96,258.30
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	96,258.30

## 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	449,011.27
股票投资	218,520.34
债券投资	230,490.93
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	449,011.27

## 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	21.14
合计	21.14

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

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

## 6.4.7.22 信用减值损失

无。

## 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	14,876.39
信息披露费	24,795.19
证券出借违约金	-
银行费用	215.00
债券账户费用	18,600.00
合计	58,486.58

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
交银施罗德基金管理有限公司（“交银施罗德基金公司”）	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金销售机构
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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

本报告期实际与基金发生关联交易的关联方及关联交易具体情况请见下述内容。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

无。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

无。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

###### 6.4.10.1.4 权证交易

无。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

## 6.4.10.2 关联方报酬

### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	195,705.56	43,408.15
其中：支付销售机构的客户维护费	54,768.68	17,231.81

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。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	55,915.89	12,402.34

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.2%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.2%÷当年天数。

### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	交银定期支付月月丰债 券 A	交银定期支付月月丰债 券 C	合计
交通银行股份有限公司	-	656.84	656.84
交银施罗德基金管理有限 公司	-	6,611.93	6,611.93
中国建设银行股份有限公司	-	1,382.99	1,382.99
合计	-	8,651.76	8,651.76
获得销售服务费的各关联方	上年度可比期间		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		

名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	交银定期支付月月丰债券 A	交银定期支付月月丰债券 C	合计
交通银行股份有限公司	-	787.17	787.17
交银施罗德基金管理有限公司	-	690.75	690.75
中国建设银行股份有限公司	-	1,460.96	1,460.96
合计	-	2,938.88	2,938.88

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，按月支付给交银施罗德基金公司，再由交银施罗德基金公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

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

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

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

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

无。

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

无。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

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

无。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行_活期存款	13,557,804.63	2,498.47	433,659.85	1,015.69

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

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

无。

#### 6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

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

无。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只债券型基金，属于证券投资基金中中等风险的品种，其长期平均的预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、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（但须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以上风险控制在限定的范围之内，通过精选具有较高息票率的债券，以获取稳定的债息收入，并通过适当参与股票市场，力争实现基金资产的长期增值。

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，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

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

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

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

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券（2022 年 12 月 31 日：本基金持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 4.61%）。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

于 2023 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有-301.09(应计利息支出)元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他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，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

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

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的

基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	13,557,804.63	-	-	-	13,557,804.63
结算备付金	191,317.20	-	-	-	191,317.20
存出保证金	10,951.25	-	-	-	10,951.25
交易性金融资产	55,156,511.45	-	-	9,990,721.82	65,147,233.27
买入返售金融资产	2,000,000.00	-	-	-	2,000,000.00
应收申购款	260.00	-	-	-	260.00
应收清算款	-	-	-	713,563.19	713,563.19
资产总计	70,916,844.53	-	-	10,704,285.01	81,621,129.54
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	31,949.06	31,949.06
应付托管费	-	-	-	9,128.29	9,128.29
应付清算款	-	-	-	13,461,626.69	13,461,626.69
卖出回购金融资产款	-301.09	-	-	-	-301.09
应付销售服务费	-	-	-	13,781.44	13,781.44
应交税费	-	-	-	4,825.66	4,825.66
其他负债	-	-	-	120,924.56	120,924.56
负债总计	-301.09	-	-	13,642,235.70	13,641,934.61
利率敏感度缺口	70,917,145.62	-	-	-2,937,950.69	67,979,194.93
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	9,374,481.33	-	-	-	9,374,481.33
结算备付金	65,964.30	-	-	-	65,964.30
存出保证金	2,315.39	-	-	-	2,315.39
交易性金融资产	50,487,022.60	2,712,430.51	210,270.05	7,820,341.71	61,230,064.87
买入返售金融资产	2,999,517.26	-	-	-	2,999,517.26
应收申购款	267.98	-	-	479.61	747.59
资产总计	62,929,568.86	2,712,430.51	210,270.05	7,820,821.32	73,673,090.74
负债					
应付赎回款	-	-	-	73,265.61	73,265.61
应付管理人报酬	-	-	-	21,249.21	21,249.21
应付托管费	-	-	-	6,071.22	6,071.22
应付清算款	-	-	-	8,066,611.37	8,066,611.37
应付销售服务费	-	-	-	8,577.01	8,577.01
应交税费	-	-	-	4,888.95	4,888.95
其他负债	-	-	-	66,624.74	66,624.74
负债总计	-	-	-	8,247,288.11	8,247,288.11
利率敏感度缺口	62,929,568.86	2,712,430.51	210,270.05	-426,466.79	65,425,802.63

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

## 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	市场利率上升 25 个基点	-81,437.17	-61,304.69
市场利率下降 25 个基点	81,711.50	61,697.96	

## 6.4.13.4.2 外汇风险

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

## 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产净值的 80%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

## 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	9,990,721.82	14.70	7,820,341.71	11.95
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-

交易性金融资产—债券投资	-	-	3,025,438.10	4.62
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	9,990,721.82	14.70	10,845,779.81	16.58

注：债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2023 年 6 月 30 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 14.70%(2022 年 12 月 31 日：16.56%)，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(2022 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	9,990,721.82	10,840,779.39
第二层次	55,156,511.45	50,389,285.48

第三层次	-	-
合计	65,147,233.27	61,230,064.87

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

无。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	9,990,721.82	12.24
	其中：股票	9,990,721.82	12.24
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	55,156,511.45	67.58
	其中：债券	55,156,511.45	67.58
	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	2,000,000.00	2.45
	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	13,749,121.83	16.85
8	其他各项资产	724,774.44	0.89
9	合计	81,621,129.54	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例
----	------	---------	-----------

			(%)
A	农、林、牧、渔业	8,430.00	0.01
B	采矿业	537,496.00	0.79
C	制造业	7,569,695.32	11.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	79,348.00	0.12
E	建筑业	209,245.00	0.31
F	批发和零售业	399,545.00	0.59
G	交通运输、仓储和邮政业	160,536.00	0.24
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	503,972.00	0.74
J	金融业	322,263.00	0.47
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	20,855.00	0.03
M	科学研究和技术服务业	155,407.00	0.23
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	23,929.50	0.04
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	9,990,721.82	14.70

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	1,100	251,669.00	0.37
2	603889	新澳股份	27,200	204,272.00	0.30
3	000858	五粮液	1,200	196,284.00	0.29
4	600511	国药股份	3,600	139,860.00	0.21
5	605266	健之佳	1,600	134,128.00	0.20
6	600809	山西汾酒	700	129,549.00	0.19
7	002475	立讯精密	3,900	126,555.00	0.19
8	300760	迈瑞医疗	400	119,920.00	0.18
9	600237	铜峰电子	13,700	112,751.00	0.17
10	300791	仙乐健康	3,800	110,352.00	0.16
11	688078	龙软科技	2,100	108,255.00	0.16
12	600729	重庆百货	3,300	103,752.00	0.15



13	002459	晶澳科技	2,400	100,080.00	0.15
14	600150	中国船舶	3,000	98,730.00	0.15
15	600309	万华化学	1,100	96,624.00	0.14
16	688111	金山办公	200	94,444.00	0.14
17	300896	爱美客	200	88,990.00	0.13
18	603197	保隆科技	1,600	86,800.00	0.13
19	300121	阳谷华泰	9,000	85,950.00	0.13
20	301122	采纳股份	2,400	85,488.00	0.13
21	300316	晶盛机电	1,200	85,080.00	0.13
22	605369	拱东医疗	1,500	84,060.00	0.12
23	300673	佩蒂股份	6,000	84,000.00	0.12
24	600933	爱柯迪	3,600	83,844.00	0.12
25	000568	泸州老窖	400	83,828.00	0.12
26	688733	壹石通	2,700	83,592.00	0.12
27	601319	中国人保	14,300	83,512.00	0.12
28	600129	太极集团	1,400	83,286.00	0.12
29	688345	博力威	2,200	81,642.00	0.12
30	300274	阳光电源	700	81,641.00	0.12
31	300219	鸿利智汇	11,000	80,850.00	0.12
32	300856	科思股份	1,000	78,770.00	0.12
33	605507	国邦医药	3,700	78,699.00	0.12
34	603338	浙江鼎力	1,400	78,414.00	0.12
35	600850	电科数字	3,300	77,847.00	0.11
36	603105	芯能科技	4,600	77,694.00	0.11
37	688030	山石网科	3,600	77,148.00	0.11
38	002129	TCL 中环	2,300	76,360.00	0.11
39	688556	高测股份	1,400	74,396.00	0.11
40	688267	中触媒	3,500	73,745.00	0.11
41	600066	宇通客车	5,000	73,700.00	0.11
42	600161	天坛生物	2,600	70,590.00	0.10
43	003011	海象新材	2,184	70,434.00	0.10
44	002032	苏泊尔	1,400	70,000.00	0.10
45	603611	诺力股份	2,600	68,484.00	0.10
46	688037	芯源微	400	68,380.00	0.10
47	603688	石英股份	600	68,304.00	0.10
48	688599	天合光能	1,600	68,176.00	0.10
49	603215	比依股份	3,800	68,172.00	0.10
50	605167	利柏特	7,000	67,760.00	0.10
51	600732	爱旭股份	2,200	67,650.00	0.10
52	601958	金钼股份	6,000	66,900.00	0.10
53	600389	江山股份	2,800	66,500.00	0.10
54	601336	新华保险	1,800	66,186.00	0.10
55	688019	安集科技	400	65,932.00	0.10

56	603757	大元泵业	2,200	65,648.00	0.10
57	300633	开立医疗	1,200	65,400.00	0.10
58	002049	紫光国微	700	65,275.00	0.10
59	300416	苏试试验	3,000	64,680.00	0.10
60	600803	新奥股份	3,400	64,532.00	0.09
61	603619	中曼石油	3,800	64,296.00	0.09
62	002674	兴业科技	5,200	64,220.00	0.09
63	603518	锦泓集团	5,600	63,560.00	0.09
64	601163	三角轮胎	4,000	63,480.00	0.09
65	603657	春光科技	3,600	63,180.00	0.09
66	002641	公元股份	11,200	63,168.00	0.09
67	605088	冠盛股份	3,600	61,740.00	0.09
68	600210	紫江企业	11,600	61,712.00	0.09
69	603890	春秋电子	7,200	61,632.00	0.09
70	300518	盛讯达	2,800	61,404.00	0.09
71	603558	健盛集团	7,400	61,124.00	0.09
72	603337	杰克股份	3,200	60,928.00	0.09
73	002986	宇新股份	2,200	60,676.00	0.09
74	301003	江苏博云	2,600	60,086.00	0.09
75	605117	德业股份	400	59,820.00	0.09
76	002293	罗莱生活	5,200	59,800.00	0.09
77	002870	香山股份	1,800	59,706.00	0.09
78	605166	聚合顺	6,400	59,648.00	0.09
79	688330	宏力达	1,700	59,636.00	0.09
80	300871	回盛生物	3,600	59,328.00	0.09
81	605189	富春染织	3,600	59,076.00	0.09
82	600820	隧道股份	9,800	58,898.00	0.09
83	600489	中金黄金	5,700	58,881.00	0.09
84	603345	安井食品	400	58,720.00	0.09
85	603527	众源新材	4,800	58,656.00	0.09
86	600583	海油工程	10,000	58,500.00	0.09
87	688613	奥精医疗	2,400	58,296.00	0.09
88	601567	三星医疗	4,600	58,098.00	0.09
88	603966	法兰泰克	4,600	58,098.00	0.09
89	605099	共创草坪	2,600	58,058.00	0.09
90	603303	得邦照明	4,200	58,002.00	0.09
91	300438	鹏辉能源	1,200	57,648.00	0.08
92	601021	春秋航空	1,000	57,470.00	0.08
93	600498	烽火通信	2,800	57,036.00	0.08
94	300616	尚品宅配	2,800	56,784.00	0.08
95	300777	中简科技	1,200	56,712.00	0.08
96	688098	申联生物	7,600	56,088.00	0.08
97	601020	华钰矿业	6,500	55,835.00	0.08

98	300839	博汇股份	4,200	55,818.00	0.08
99	601318	中国平安	1,200	55,680.00	0.08
100	688196	卓越新能	1,200	55,500.00	0.08
101	301030	仕净科技	800	55,280.00	0.08
102	300122	智飞生物	1,250	55,250.00	0.08
103	300801	泰和科技	3,400	54,740.00	0.08
104	300908	仲景食品	1,200	54,420.00	0.08
105	605377	华旺科技	3,000	54,150.00	0.08
106	600028	中国石化	8,400	53,424.00	0.08
107	300685	艾德生物	2,200	53,372.00	0.08
108	002594	比亚迪	200	51,654.00	0.08
109	688777	中控技术	800	50,224.00	0.07
110	300855	图南股份	1,400	49,448.00	0.07
111	002865	钧达股份	300	45,759.00	0.07
112	601766	中国中车	7,000	45,500.00	0.07
113	688112	鼎阳科技	800	42,224.00	0.06
114	688981	中芯国际	766	38,698.32	0.06
115	000921	海信家电	1,400	37,730.00	0.06
116	603871	嘉友国际	2,400	37,704.00	0.06
117	600926	杭州银行	3,200	37,600.00	0.06
118	601989	中国重工	7,800	37,596.00	0.06
119	600406	国电南瑞	1,500	34,650.00	0.05
120	600938	中国海油	1,900	34,428.00	0.05
121	002847	盐津铺子	400	34,020.00	0.05
122	600118	中国卫星	1,200	33,852.00	0.05
123	002422	科伦药业	1,100	32,648.00	0.05
124	601600	中国铝业	5,800	31,842.00	0.05
125	002371	北方华创	100	31,765.00	0.05
126	601088	中国神华	1,000	30,750.00	0.05
127	000030	富奥股份	6,100	30,744.00	0.05
128	000521	长虹美菱	4,000	30,560.00	0.04
129	002559	亚威股份	3,400	30,192.00	0.04
130	601717	郑煤机	2,400	29,880.00	0.04
131	002603	以岭药业	1,100	28,259.00	0.04
132	688425	铁建重工	5,700	27,417.00	0.04
133	688223	晶科能源	1,900	26,714.00	0.04
134	002128	电投能源	2,000	26,440.00	0.04
135	601006	大秦铁路	3,500	26,005.00	0.04
136	601012	隆基绿能	900	25,803.00	0.04
137	601117	中国化学	3,100	25,668.00	0.04
138	300015	爱尔眼科	1,290	23,929.50	0.04
139	601899	紫金矿业	2,100	23,877.00	0.04
140	601611	中国核建	2,700	22,815.00	0.03

141	300059	东方财富	1,600	22,720.00	0.03
142	600339	中油工程	5,400	21,978.00	0.03
143	000028	国药一致	500	21,805.00	0.03
144	601998	中信银行	3,600	21,528.00	0.03
145	603986	兆易创新	200	21,250.00	0.03
146	601390	中国中铁	2,800	21,224.00	0.03
147	300795	米奥会展	500	20,855.00	0.03
148	600438	通威股份	600	20,586.00	0.03
149	002812	恩捷股份	200	19,270.00	0.03
150	601668	中国建筑	3,300	18,942.00	0.03
151	601598	中国外运	3,900	18,174.00	0.03
152	601186	中国铁建	1,800	17,730.00	0.03
153	601898	中煤能源	2,000	16,880.00	0.02
154	000725	京东方 A	4,100	16,769.00	0.02
155	601868	中国能建	7,100	16,614.00	0.02
156	001872	招商港口	900	15,543.00	0.02
157	600970	中材国际	1,200	15,300.00	0.02
158	600011	华能国际	1,600	14,816.00	0.02
159	601658	邮储银行	2,900	14,181.00	0.02
160	603260	合盛硅业	200	14,004.00	0.02
161	002466	天齐锂业	200	13,982.00	0.02
162	603799	华友钴业	300	13,773.00	0.02
163	601288	农业银行	3,900	13,767.00	0.02
164	000792	盐湖股份	700	13,419.00	0.02
165	300347	泰格医药	200	12,908.00	0.02
166	688303	大全能源	300	12,135.00	0.02
167	300014	亿纬锂能	200	12,100.00	0.02
168	601669	中国电建	2,100	12,054.00	0.02
169	000301	东方盛虹	1,000	11,820.00	0.02
170	000625	长安汽车	900	11,637.00	0.02
171	600089	特变电工	500	11,145.00	0.02
172	600111	北方稀土	400	9,592.00	0.01
173	601225	陕西煤业	500	9,095.00	0.01
174	002714	牧原股份	200	8,430.00	0.01
175	601857	中国石油	1,100	8,217.00	0.01
176	603993	洛阳钼业	1,500	7,995.00	0.01
177	300142	沃森生物	300	7,935.00	0.01
178	603659	璞泰来	200	7,644.00	0.01
179	601100	恒立液压	100	6,433.00	0.01
180	603259	药明康德	100	6,231.00	0.01
181	002460	赣锋锂业	100	6,096.00	0.01
182	002493	荣盛石化	500	5,820.00	0.01
183	601919	中远海控	600	5,640.00	0.01

184	601788	光大证券	300	4,767.00	0.01
185	002709	天赐材料	100	4,119.00	0.01
186	300759	康龙化成	100	3,828.00	0.01
187	603806	福斯特	100	3,719.00	0.01
188	002241	歌尔股份	200	3,550.00	0.01
189	601881	中国银河	200	2,322.00	0.00
190	300371	汇中股份	60	786.00	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	1,220,976.80	1.87
2	688981	中芯国际	640,424.57	0.98
3	600519	贵州茅台	540,978.00	0.83
4	688111	金山办公	499,704.00	0.76
5	000858	五粮液	453,778.00	0.69
6	000568	泸州老窖	428,715.00	0.66
7	600016	民生银行	420,135.00	0.64
8	300760	迈瑞医疗	394,591.00	0.60
9	605218	伟时电子	384,870.00	0.59
10	601012	隆基绿能	378,296.00	0.58
11	688599	天合光能	368,483.85	0.56
12	003011	海象新材	364,687.88	0.56
13	688012	中微公司	355,808.82	0.54
14	603889	新澳股份	336,054.00	0.51
15	601006	大秦铁路	316,931.00	0.48
16	688078	龙软科技	314,032.92	0.48
17	002475	立讯精密	313,907.00	0.48
18	603657	春光科技	311,642.00	0.48
19	002594	比亚迪	310,246.00	0.47
20	601998	中信银行	293,013.00	0.45

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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	1,113,310.40	1.70
2	600519	贵州茅台	707,176.00	1.08
3	688981	中芯国际	596,310.38	0.91

4	600016	民生银行	504,929.00	0.77
5	605218	伟时电子	433,136.00	0.66
6	000568	泸州老窖	413,472.00	0.63
7	002594	比亚迪	406,338.00	0.62
8	688111	金山办公	401,222.32	0.61
9	601012	隆基绿能	395,071.00	0.60
10	688012	中微公司	358,266.49	0.55
11	003011	海象新材	351,713.00	0.54
12	000913	钱江摩托	320,884.00	0.49
13	300760	迈瑞医疗	307,466.00	0.47
14	601857	中国石油	292,546.00	0.45
15	300124	汇川技术	290,738.00	0.44
16	000858	五粮液	290,240.00	0.44
17	002401	中远海科	288,823.00	0.44
18	601006	大秦铁路	288,177.00	0.44
19	600438	通威股份	285,260.00	0.44
20	688599	天合光能	284,391.99	0.43

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	73,469,811.43
卖出股票收入（成交）总额	71,862,474.68

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	55,156,511.45	81.14
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	55,156,511.45	81.14

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	019703	23 国债 10	261,000	26,237,364.66	38.60
2	019688	22 国债 23	186,000	18,808,182.41	27.67
3	019694	23 国债 01	100,000	10,110,964.38	14.87

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

无。

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

无。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

## 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

## 7.10.1 本期国债期货投资政策

无。

## 7.10.2 本期国债期货投资评价

无。

## 7.11 投资组合报告附注

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

## 7.11.2 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。

## 7.11.3 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	10,951.25
2	应收清算款	713,563.19
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	260.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	724,774.44

#### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

#### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

#### 7.11.6 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
交银定期支付月月丰债券 A	396	21,941.88	3,208,563.41	36.93	5,480,420.51	63.07
交银定期支付月月丰债券 C	104	351,925.68	34,733,710.36	94.90	1,866,560.01	5.10
合计	500	90,578.51	37,942,273.77	83.78	7,346,980.52	16.22

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	交银定期支付月月丰债券 A	6.39	0.00
	交银定期支付月月丰债券 C	294.80	0.00
	合计	301.19	0.00

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

无。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份



项目	交银定期支付月月丰债券 A	交银定期支付月月丰债券 C
基金合同生效日 (2013 年 8 月 13 日) 基金份额总额	214,214,667.51	130,125,578.03
本报告期期初基金份额总额	9,112,295.25	35,009,317.14
本报告期基金总申购份额	68,757.97	17,867,965.93
减: 本报告期基金总赎回份额	492,069.30	16,277,012.70
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	8,688,983.92	36,600,270.37

注: 1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务, 则总申购份额中包含该业务;

2、如果本报告期间发生转换出业务, 则总赎回份额中包含该业务。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

无。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 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。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金托管人及其高级管理人员本报告期内未受监管部门稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
申万宏源证券	1	82,739,892.98	56.93	74,898.68	57.10	-
中信建投证券	2	62,592,393.13	43.07	56,269.53	42.90	-

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
申万宏源证券	171,773,297.80	90.90	91,041,000.00	95.19	-	-
中信建投证券	17,188,792.90	9.10	4,600,000.00	4.81	-	-

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。

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒体及公司网站	2023 年 1 月 19 日
2	交银施罗德基金管理有限公司关于增加济安财富（北京）基金销售有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2023 年 2 月 10 日

3	交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会规定媒体及公司网站	2023 年 3 月 30 日
4	交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒体及公司网站	2023 年 4 月 21 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金募集的文件；
- 2、《交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金托管协议》；
- 5、关于募集交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金之法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、报告期内交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

### 12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

### 12.3 查阅方式

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

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