

交银施罗德鸿信一年持有期混合型证券投资  
基金  
2023 年第 3 季度报告

2023 年 9 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：中信银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 10 月 24 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 07 月 01 日起至 09 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	交银鸿信一年持有期混合
基金主代码	012833
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 8 月 6 日
报告期末基金份额总额	895,147,583.03 份
投资目标	在合理控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势，在分析和判断宏观经济周期和金融市场运行趋势的基础上，运用修正后的投资时钟分析框架，自上而下调整基金大类资产配置，确定债券组合久期和债券类别配置；在严谨深入的股票和债券研究分析基础上，自下而上精选个股和个券；在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力争获取投资组合的较高回报。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×10%+恒生指数收益率×5%+中证综合债券指数收益率×85%
风险收益特征	本基金是一只混合型基金，其预期风险和预期收益理论上高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。本基金可投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	交银鸿信一年持有期混合 A	交银鸿信一年持有期混合 C
下属分级基金的交易代码	012833	012834
报告期末下属分级基金的份额总额	661,396,513.09 份	233,751,069.94 份

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2023 年 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日）	
	交银鸿信一年持有期混合 A	交银鸿信一年持有期混合 C
1. 本期已实现收益	1,243,806.43	183,709.75
2. 本期利润	2,142,334.69	495,037.22
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0031	0.0020
4. 期末基金资产净值	659,065,146.34	230,930,025.09
5. 期末基金份额净值	0.9965	0.9879

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

交银鸿信一年持有期混合 A

阶段	净值增长率①	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	0.32%	0.21%	-0.07%	0.14%	0.39%	0.07%
过去六个月	-0.08%	0.22%	0.57%	0.13%	-0.65%	0.09%
过去一年	2.39%	0.24%	3.00%	0.16%	-0.61%	0.08%
自基金合同 生效起至今	-0.35%	0.20%	2.64%	0.17%	-2.99%	0.03%

交银鸿信一年持有期混合 C

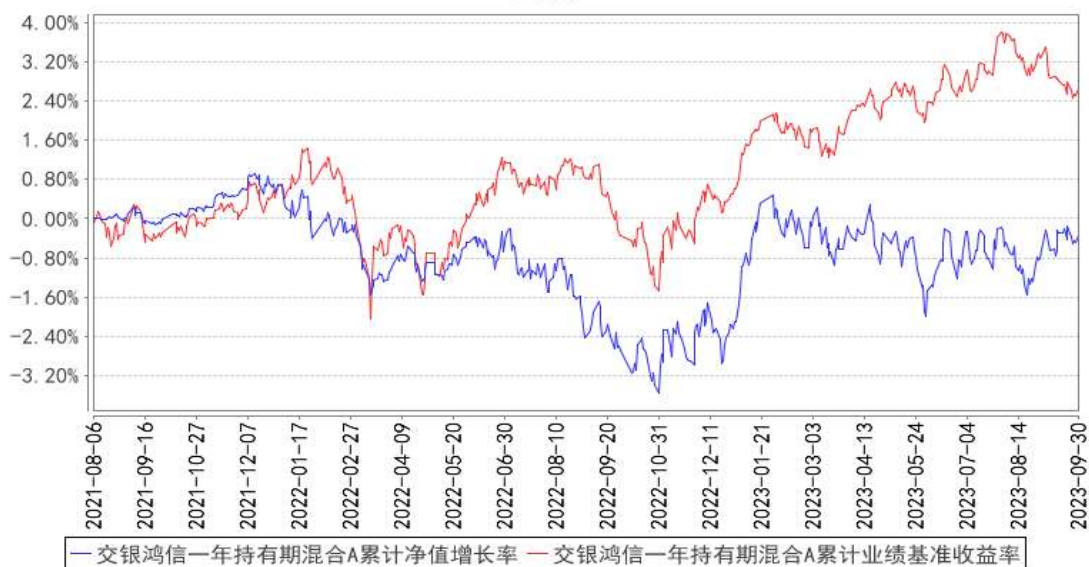
阶段	净值增长率①	净值增长率	业绩比较基	业绩比较基	①—③	②—④
----	--------	-------	-------	-------	-----	-----

		标准差②	准收益率③	准收益率标准差④		
过去三个月	0.21%	0.21%	-0.07%	0.14%	0.28%	0.07%
过去六个月	-0.29%	0.22%	0.57%	0.13%	-0.86%	0.09%
过去一年	1.98%	0.24%	3.00%	0.16%	-1.02%	0.08%
自基金合同生效起至今	-1.21%	0.20%	2.64%	0.17%	-3.85%	0.03%

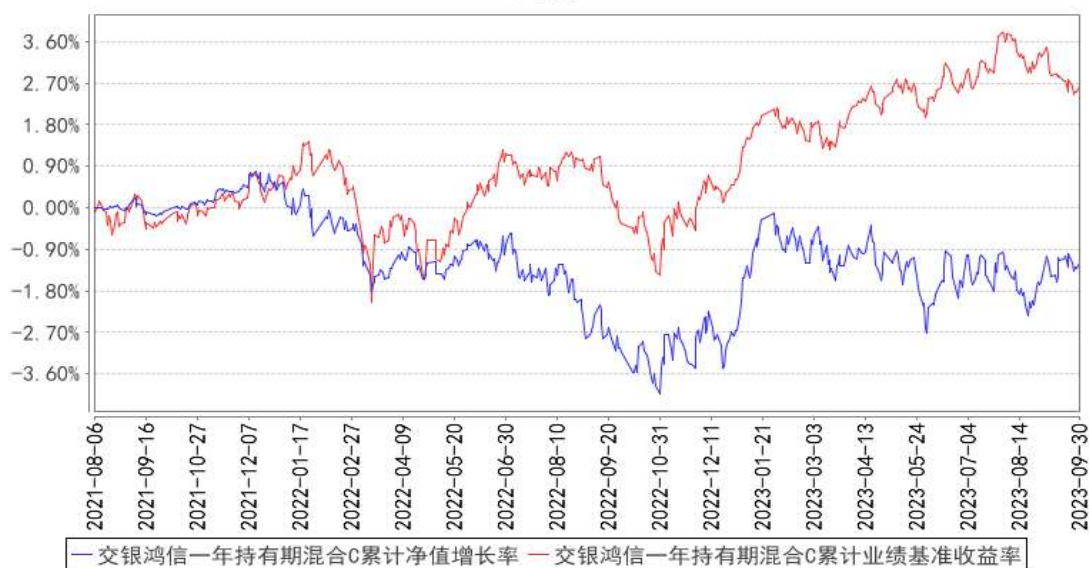
注：本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率×10%+恒生指数收益率×5%+中证综合债券指数收益率×85%，每日进行再平衡过程。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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

交银鸿信一年持有期混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



交银鸿信一年持有期混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈俊华	交银环球精选混合(QDII)、交银沪港深价值精选混合、交银核心资产混合、交银鸿光一年混合、交银鸿福六个月混合、交银鸿信一年持有期混合、交银鸿泰一年持有期混	2021年8月6日	-	18年	陈俊华女士，中国国籍，上海交通大学金融学硕士。历任国泰君安证券研究部研究员、中国国际金融有限公司研究部公用事业组负责人。2015年加入交银施罗德基金管理有限公司。2015年11月21日至2019年9月19日担任交银施罗德全球自然资源证券投资基金的基金经理。

	合的基金经理，公司跨境投资副总监				
于海颖	交银纯债债券发起、交银丰晟收益债券、交银裕泰两年定期开放债券、交银裕坤纯债一年定期开放债券、交银鸿光一年混合、交银鸿福六个月混合、交银鸿信一年持有期混合、交银鸿泰一年持有期混合、交银裕盈纯债债券、交银裕如纯债债券的基金经理，公司固定收益（公募）投资总监	2021 年 8 月 6 日	-	17 年	于海颖女士，天津大学数量经济学硕士、经济学学士。历任北方国际信托投资股份有限公司固定收益研究员，光大保德信基金管理有限公司交易员、基金经理助理、基金经理，银华基金管理有限公司基金经理，五矿证券有限公司固定收益事业部投资管理部总经理。其中 2007 年 11 月 9 日至 2010 年 8 月 30 日任光大保德信货币市场基金基金经理，2008 年 10 月 29 日至 2010 年 8 月 30 日任光大保德信增利收益债券型证券投资基金基金经理，2011 年 6 月 28 日至 2013 年 6 月 16 日任银华永祥保本混合型证券投资基金基金经理，2011 年 8 月 2 日至 2014 年 4 月 24 日任银华货币市场证券投资基金基金经理，2012 年 8 月 9 日至 2014 年 10 月 7 日任银华纯债信用主题债券型证券投资基金（LOF）基金经理，2013 年 4 月 1 日至 2014 年 4 月 24 日任银华交易型货币市场基金基金经理，2013 年 8 月 7 日至 2014 年 10 月 7 日任银华信用四季红债券型证券投资基金基金经理，2013 年 9 月 18 日至 2014 年 10 月 7 日任银华信用季季红债券型证券投资基金基金经理，2014 年 5 月 8 日至 2014 年 10 月 7 日任银华信用债券型证券投资基金（LOF）基金经理。2016 年加入交银施罗德基金管理有限公司。2017 年 6 月 10 日至 2018 年 7 月 18 日担任交银施罗德丰硕收益债券型证券投资基金的基金经理。2017 年 6 月 10 日至 2019 年 3 月 14 日担任交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金、交银施罗德强化回报债券型证券投资基金、交银施罗德增利增强债券型证券投资基金、交银施罗德增强收益债券型证券投资基金、转型前的交银施罗德荣鑫保本混合型证券投资基金、转型前的交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 12 月 29 日至 2020 年 8 月 21 日担任交银施罗德丰盈收益债

					券型证券投资基金的基金经理。2017 年 6 月 10 日至 2020 年 8 月 21 日担任交银施罗德增利债券证券投资基金的基金经理。2018 年 5 月 25 日至 2021 年 1 月 15 日担任交银施罗德裕如纯债债券型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

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

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

## 4.3 公平交易专项说明

### 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

本基金是通过体系化的运维方式，不断优化股债配置，以实现有效控制回撤、追求长期稳健收益为目标。自成立以来，我们坚守这一目标和运作方式，在明确整体配置方案后，严格执行操作纪律，局部优化持仓。三季度，我们小幅降低股票仓位至 20% 上下，主要进行结构调整。下面，我们分别从股、债方面进行回顾、分析和展望。

股票市场方面：2023 年三季度，全球主要证券市场震荡下行。海外方面，通胀居高不下，加息预期仍在；国内方面，中期报告整体表现一般，缺少亮点。面对不确定性，投资人选择谨慎应对，风险偏好下降。

回顾我们的操作，我们小幅降低了股票仓位，但仍坚持自下而上寻找投资标的。我们的考量与股票配置思路如下：1) 我们预计经济将逐步复苏，但复苏需要时间。短期宏观数据的波动，会降低投资者偏好。公司成长的确性和估值安全边际变得更为严苛和重要。2) 我们认为消费者行为会发生变化。在流动性宽裕，经济增速趋缓的背景下，那些率先满足客户的必要性需求，或拥有品牌力产品的公司，才有望实现成长，获取超额收益。3) 面对外部环境的不确定性，我们认为同一行业内公司表现会加速分化，需要从治理结构、财务弹性空间和估值水平三方面去筛选更稳妥的标的。

为落实上述思路，我们进行了组合的调整，重点关注并增持了两类标的：1) 满足企业和个人发展需要的“资源品”，不仅包括实物资源，还包括通讯资源、媒介资源等；2) 充分发挥制造业优势，建立自有渠道网络、发展品牌的企业。减少了中游制造业标的和宏观经济数据相关度高的标的。

债券市场方面：回顾 2023 年三季度，债券市场在央行超预期降息、宽信用政策密集落地、跨季流动性收敛等因素影响下，收益率先下后上，期限利差有所收窄。七月初，资金面明显转松，叠加季初理财规模回暖，带动配置力量上升，债市呈现震荡偏强，月底优化房地产等政策出台带动债市出现下跌，十年国债收益率上行 7bp 至 2.66%。进入八月，资金面整体偏宽松带动短端利率小幅下行，长端窄幅震荡。8 月 15 日，央行超预期宣布降息，分别降低七天逆回购和 MLF 利率 10bp 和 15bp，收益率快速下行，当日长端收益率下行 4-5bp，短端小幅下行 2bp。但降息后，受到缴税和政府债缴款的影响，资金面持续收敛，带动短端利率明显上行。八月底至九月初，一线城市先后宣布执行“认房不认贷”，同时，央行发文提出降低首付比例和下调存量按揭利率，地产政策密集落地冲击债市情绪，随后央行宣布降准 0.25%，次日小幅增量续作 MLF，但价格维持不变，市场降息预期落空。月底广州放松部分区域限购，跨季资金面延续紧平衡，叠加止盈盘压力下，十年国债收益率上行至 2.70% 高点，随后情绪略有修复，带动利率小幅下行。截



止 9 月 27 日，一年国债较季初上行 34BP 至 2.21%，十年国债则上行 5BP 至 2.69%。

报告期内，组合根据策略配置建议动态的进行了债券仓位的调整，组合增持了部分流动性良好的银行债和中高等级信用品种，并减持了部分静态收益较低品种，并替换为流动性良好的中高等级信用品种和利率债品种，后续会继续根据市场曲线变动情况和规模变动情况，动态进行组合的结构优化和调整。

股票市场方面：展望 2023 年四季度，我们更为从容和乐观，认为有机会筛选出更多具备阿尔法的标的，为组合带来贡献。源自：1) 在全球经济增速缓慢复苏的情况下，各行业内公司的差异都进一步扩大。深入的产业、公司分析，将更有助于获取投资收益。2) 市场整体的流动性仍将宽裕，各种不同的投资策略：主动、被动、宏观对冲、行业基金、量化都在市场上交易，增加了股价活跃度和发生偏离的可能性，这也为主动投资提供了更多的操作机会。3) 自七月底以来，一系列的宏观、财政和市场支持政策密集推出，伴随时间的推移，政策效果将逐步体现。而市场整体的估值水平持续回落，目前很多公司估值已经回到多年较低水平。4) 在港股市场，部分创新药、新兴消费公司的基本面和估值背离进一步扩大，我们亦将密切关注潜在投资机会。

债券市场方面：展望 2023 年四季度，国内稳增长政策效果和经济回升斜率将成为影响债市的主要因素。经济增速在二季度放缓后，当前已基本确认底部。八月底以来，政策密集落地，后续传导到实体需求改善有待进一步观察，在这种情况下预计货币政策将延续稳健宽松。通胀数据在三季度确认见底后，有望小幅回升，考虑猪肉供给压力较大，预计将继续拖累食品价格，国内通胀压力整体可控。在经济动能回暖、政策温和发力、流动性保持平稳下，四季度债券收益率或呈现震荡的态势。站在目前时点来看，债市受到宽信用政策冲击收益率曲线较为平坦，跨季后资金需求下降，流动性边际转松或带动行情修复。展望中期，将继续根据基本面情况和政策情况进行组合配置，并根据预期差力求把握交易性机会。

#### 4.5 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 主要财务指标”及“3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较”部分披露。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内无需预警说明。

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	190,055,325.09	20.22
	其中：股票	190,055,325.09	20.22
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	571,845,557.64	60.83
	其中：债券	571,845,557.64	60.83
	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	69,978,372.61	7.44
	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	107,037,871.37	11.39
8	其他资产	1,143,334.43	0.12
9	合计	940,060,461.14	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通机制投资香港股票的公允价值为 61,058,744.66 元，占基金资产净值比例为 6.86%。

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	4,641,525.00	0.52
B	采矿业	22,890,624.00	2.57
C	制造业	56,004,954.87	6.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	33,563.97	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	79,198.63	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	11,579,040.00	1.30
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	202,657.42	0.02
J	金融业	14,217,108.00	1.60
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	9,790,495.00	1.10
M	科学研究和技术服务业	5,014,013.24	0.56
N	水利、环境和公共设施管理业	36,252.84	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	21,185.46	0.00
R	文化、体育和娱乐业	4,485,962.00	0.50
S	综合	-	-
	合计	128,996,580.43	14.49

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
通信服务	24,562,844.55	2.76
能源	23,821,879.02	2.68
房地产	7,951,007.01	0.89
可选消费	4,723,014.08	0.53
合计	61,058,744.66	6.86

注：本报告采用中证 CICS 一级分类标准编制。

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	600938	中国海油	603,300	12,753,762.00	1.43
1	00883 HK	中国海洋石油	377,752	4,776,651.90	0.54
2	01088 HK	中国神华	700,000	16,315,461.40	1.83
3	600690	海尔智家	570,100	13,454,360.00	1.51
4	00941 HK	中国移动	221,000	13,323,712.31	1.50
5	601766	中国中车	2,245,200	13,111,968.00	1.47
6	002352	顺丰控股	283,800	11,579,040.00	1.30
7	00700 HK	腾讯控股	40,000	11,239,132.24	1.26
8	000063	中兴通讯	316,600	10,346,488.00	1.16
9	601699	潞安环能	533,800	10,136,862.00	1.14
10	601288	农业银行	2,722,400	9,800,640.00	1.10

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	91,380,739.73	10.27
2	央行票据	-	-
3	金融债券	173,754,788.79	19.52
	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	306,710,029.12	34.46
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	571,845,557.64	64.25
----	----	----------------	-------

### 5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	232280003	22 成都银行二级资本债 01	500,000	51,882,273.97	5.83
2	019694	23 国债 01	500,000	50,688,136.99	5.70
3	102101756	21 郑州建投 MTN002	500,000	50,445,950.82	5.67
4	2328020	23 渤海银行 02	500,000	50,106,196.72	5.63
5	102102172	21 西海发展 MTN001	300,000	31,420,763.84	3.53

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

无。

### 5.7 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。

### 5.8 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权证投资明细

无。

### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

#### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

#### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

#### 5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

## 5.11 投资组合报告附注

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

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

2023 年 5 月 8 日，福建证监局公示政监管措施决定书 202318 号行政处罚决定书，给予兴业银行股份有限公司采取责令改正的行政监管措施。

2022 年 12 月 20 日，四川银保监局公示川银保监罚决字（2022）95 号行政处罚决定书，给予成都银行股份有限公司罚款 650 万元人民币罚款的行政处罚。

2023 年 4 月 25 日，天津证监局公示津证监措施 20238 号行政处罚决定书，给予渤海银行采取责令改正的行政监管措施。

2023 年 3 月 13 日，中国人民银行公示银罚决字（2023）16 号行政处罚决定书，给予渤海银行警告，没收违法所得 106.98 万元人民币，并处罚款 1589.48 万元人民币罚款的行政处罚。

2023 年 2 月 24 日，中国银行保险监督管理委员会公示银保监罚决字（2023）21 号行政处罚决定书，给予渤海银行 860 万元人民币罚款的行政处罚。

2023 年 2 月 17 日，中国银行保险监督管理委员会公示银保监罚决字（2023）8 号行政处罚决定书，给予渤海银行 430 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。

### 5.11.2 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

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。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	127,147.29
2	应收证券清算款	726,251.98
3	应收股利	289,707.16
4	应收利息	-
5	应收申购款	228.00
6	其他应收款	-

7	其他	-
8	合计	1,143,334.43

**5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

无。

**5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

无。

**5.11.6 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。

**§6 开放式基金份额变动**

单位：份

项目	交银鸿信一年持有期混合 A	交银鸿信一年持有期混合 C
报告期期初基金份额总额	729,465,629.44	261,316,245.30
报告期期间基金总申购份额	25,448.25	6,378.52
减：报告期期间基金总赎回份额	68,094,564.60	27,571,553.88
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	661,396,513.09	233,751,069.94

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

2、如果本报告期间发生转换出、份额类别调整业务，则总赎回份额中包含该业务。

**§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况**

**7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况**

无。

**7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细**

无。

**§8 影响投资者决策的其他重要信息**

**8.1 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。

## 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予交银施罗德鸿信一年持有期混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《交银施罗德鸿信一年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《交银施罗德鸿信一年持有期混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《交银施罗德鸿信一年持有期混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、关于申请募集注册交银施罗德鸿信一年持有期混合型证券投资基金的法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、报告期内交银施罗德鸿信一年持有期混合型证券投资基金在规定报刊上各项公告的原稿。

### 9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

### 9.3 查阅方式

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

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