交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金
2023 年年度报告

2023 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：2024 年 3 月 29 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 2024 年 3 月 27 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 2023 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2

1.1 重要提示 2
1.2 目录 3

§2 基金简介 5

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 5
2.5 其他相关资料 6

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 6

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 8

§4 管理人报告 9

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遵规守信情况的说明 9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 10
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 13
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 13
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 13

§5 托管人报告 14

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 14
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 14
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 14

§6 审计报告 14

6.1 审计报告基本信息 14
6.2 审计报告的基本内容 14

§7 年度财务报表 16

7.1 资产负债表 16
7.2 利润表 18
7.3 净资产变动表 19
7.4 报表附注 21

§8 投资组合报告 55

8.1 期末基金资产组合情况 55

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 56
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 57
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 62
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 63
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 64
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 64
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 64
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 64
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 64
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 64
8.14 投资组合报告附注 64

§9 基金份额持有人信息 66

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 66
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 66
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 66

§10 开放式基金份额变动 66

§11 重大事件揭示 66

11.1 基金份额持有人大会决议 66
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 66
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 67
11.4 基金投资策略的改变 67
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 67
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 67
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 67
11.8 其他重大事件 70

§12 影响投资者决策的其他重要信息 71

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 71
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 71

§13 备查文件目录 71

13.1 备查文件目录 71
13.2 存放地点 72
13.3 查阅方式 72

§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双息平衡混合型证券投资基金
基金简称	交银定期支付双息平衡混合
基金主代码	519732
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 9 月 4 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	780,439,713.29 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金精选具有长期增长潜力和较好分红能力的股票，以及具有较高息票率的债券，力争实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金精选具有较好现金分红能力、长期增长潜力且估值水平合理的上市公司以及具有较高息票率的债券，通过在股票和债券等不同类别资产中的平衡配置，追求基金资产在风险可控前提下的持续增值，充分享受股票分红和债券利息的双重收益。
业绩比较基准	50%×中证红利指数收益率+50%×中债综合全价指数收益率
风险收益特征	本基金是一只混合型基金，在证券投资基金中属于较高风险的品种，其长期平均风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

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	任航
	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	2023 年	2022 年	2021 年
本期已实现收益	-190,838,282.61	-140,554,511.26	143,386,940.81
本期利润	-169,717,944.25	-453,954,902.50	-996,097,016.70
加权平均基金份额本期利润	-0.2029	-0.4905	-0.7706
本期加权平均净值利润率	-4.33%	-10.78%	-14.02%
本期基金份额净值增长率	-4.95%	-9.02%	-12.65%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
期末可供分配利润	2,125,984,417.42	2,575,340,929.98	3,106,694,862.79
期末可供分配基金份额利润	2.7241	2.9575	3.0809
期末基金资产净值	3,374,329,963.16	3,961,469,499.96	5,041,395,261.01
期末基金份额净值	4.324	4.549	5.000
3.1.3 累计期末指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末

基金份额累计净值增长率	332.40%	354.90%	400.00%

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

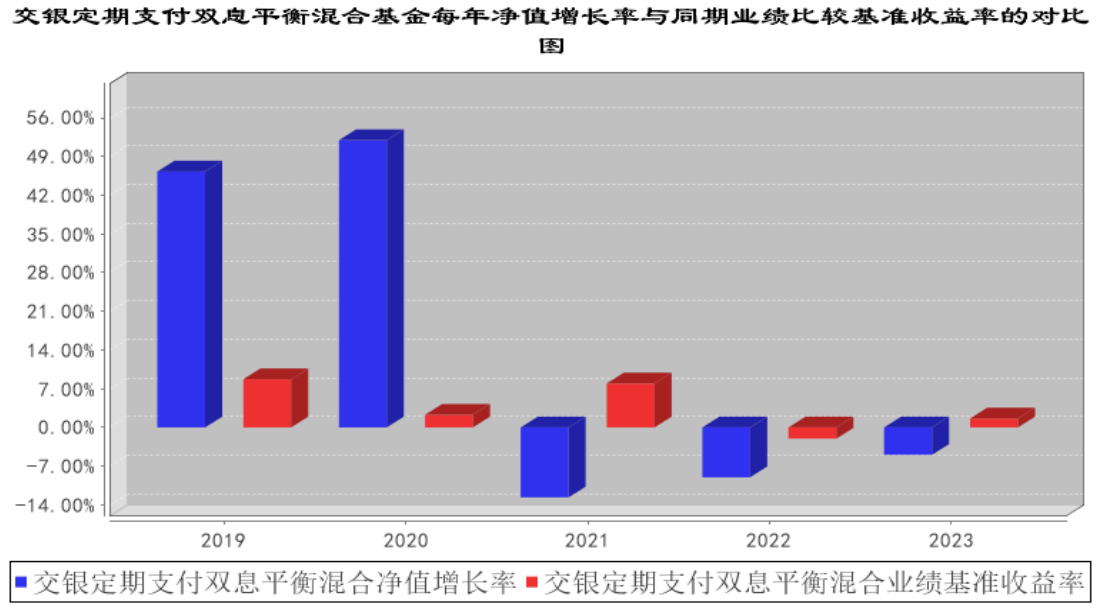
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-3.89%	0.72%	-1.44%	0.29%	-2.45%	0.43%
过去六个月	-13.38%	0.68%	-0.54%	0.32%	-12.84%	0.36%
过去一年	-4.95%	0.79%	1.63%	0.35%	-6.58%	0.44%
过去三年	-24.46%	0.96%	7.47%	0.51%	-31.93%	0.45%
过去五年	67.92%	1.03%	19.50%	0.55%	48.42%	0.48%
自基金合同生效起至今	332.40%	1.17%	65.86%	0.67%	266.54%	0.50%

注：本基金的业绩比较基准为 50%×中证红利指数收益率+50%×中债综合全价指数收益率，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

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。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

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
2023 年	-	-	-	-	-
2022 年	-	-	-	-	-

2021 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至报告期末，公司管理了包括货币型、债券型、混合型和股票型在内的 127 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		
黄鼎	交银定期支付双息平衡混合、交银启嘉混合的基金经理	2021 年 9 月 29 日	-	10 年	黄鼎先生，上海交通大学经济学硕士、武汉大学理学、金融学双学士。2013 年至 2015 年任博时基金研究员。2015 年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任行业分析师。

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

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

2023 年，经过一季度的经济补偿性复苏后，二至四季度地产、消费等部门复苏动能转弱，大盘整体先涨后跌，AI、中特估、红利等结构性行情带来更大市场波动和板块分化。尽管四季度美债利率显著回落，人民币汇率企稳回升，但市场信心仍然不足，以高股息资源股为代表的防御性板块取得相对收益并延续至今。展望 2024 年，随着我国中央财政发力、美债利率回落带来的国内货币政策放松空间提升，国内经济有望逐步筑底，市场风险偏好有望得到修复。

报告期内，本基金减持了顺周期相关标的，成长部分重点配置 AI 产业链，价值部分集中在供给格局改善的涤纶、航空、电力等方向。本基金总结回顾如下：（1）对 AI 这类新兴产业的规律认识不够深刻，当 AI 应用短期落地乏力且估值隐含乐观预期时，没有及时兑现收益，带来较大回撤。（2）选股时追求高收益率的框架造成持仓较多暴露在中小市值风格下，中小公司内生的脆弱性在弱经济环境下集中体现，使得组合面临较大的负向贝塔。（3）本着较高的收益率要求，错过了对红利资产的配置。未来我们将：1）更注重处理好基本面与估值的匹配关系；2）更多关注组合自上而下的风险因子，避免重选股带来的合成谬误；3）适度放低收益预期，在选股时提升对确定性的要求，提升组合稳健性。

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

相比市场的悲观预期，我们对国内高端制造业的长期发展空间仍具备较强信心，我国在技术积累、产业配套、服务效率、成本优势等方面多年积累的竞争优势难以被他国超越，这些优势大部分依托于市场规模和人口素质，即使在人口结构的周期性变化中也将具备韧性；随着各行各业走出去开拓欧洲和发展中地区的市场，很多公司也将具备可观的增长潜力。

当前市场股债性价比处于历史低值水平，我们认为大部分具备成长潜力的公司的市值上涨空间将远远高于当下占优的红利资产，且下跌空间已经相对有限。我们将继续重点关注以泛 AI、新能源等为代表的科技成长板块的中长期表现。我们将加强深度研究，力争从以下几个方面抓住确定性的机会：（1）科技产业变革带来的爆发性增长；（2）供给出清带来的产业周期均值回归，继续重点关注以电力、航空为代表的行业迎来周期反转；（3）高性价比国货和工业品的进口替代，以及品牌和制造业出海带来的新成长机遇。我们将继续在逆势和顺势投资中做好权衡，力争为持有人创造长期稳定的超额回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2023 年度，根据《证券投资基金法》等法律法规及有关要求，本基金管理人诚实守信、勤勉尽责，依法履行基金管理人职责，落实风险控制，强化合规管理职能，确保基金管理业务运作的安全、规范，保护基金投资人的合法权益。

本报告期内，本基金管理人为了确保公司业务的规范运作，主要做了以下工作：

（一）继续深化全面风险管理，提高风险控制有效性。

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

（二）全面开展内部监督检查，强化公司内部控制。

公司审计部门坚持以法律法规和公司各项制度为依据，按照监管机构的要求对基金运作和公司经营所涉及的各个环节实施严格的稽核监督。通过对投资研究、市场销售、运营、信息技术等业务条线内部控制关键点开展定期和不定期检查，有效促进公司内部控制制度规范、执行有效，内控管理水平不断提升。

（三）持续夯实公司合规管理体系，合规文化建设取得新实效。

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

（四）强化培训教育及重点领域合规提示，牢固树立全员风险合规防范意识。

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

估值委员会会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后，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

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内无需预警说明。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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 2023 年 01 月 01 日至 2023 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(2024)第 25345 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	交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	(一)我们审计的内容 我们审计了交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金(以下简称“交银定期支付双息平衡混合基金”)的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。 (二)我们的意见

	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，公允反映了交银定期支付双息平衡混合基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	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。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于交银定期支付双息平衡混合基金，并履行了职业道德方面的其他责任。
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	交银定期支付双息平衡混合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。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估交银定期支付双息平衡混合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定期支付双息平衡混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督交银定期支付双息平衡混合基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 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： (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。 (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。 (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。 (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，就可能导致对交银定期支付双息平衡混合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定期支付双息平衡混合基金不能持续经营。 (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。 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。
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	2024 年 3 月 27 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	769,659,547.80	511,397,054.06
结算备付金		4,862,230.22	9,645,283.68
存出保证金		1,205,701.68	1,348,845.71
交易性金融资产	7.4.7.2	2,602,457,525.32	3,456,290,179.44
其中：股票投资		2,339,758,018.76	2,760,172,544.74
基金投资		-	-
债券投资		262,699,506.56	696,117,634.70
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	-	-
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		628,941.05	-
应收股利		-	-
应收申购款		6,499,315.57	2,136,298.70
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		3,385,313,261.64	3,980,817,661.59
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2023 年 12 月 31 日**	**上年度末 2022 年 12 月 31 日**
负 债：			
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		-	3,957,624.48
应付赎回款		4,262,369.19	3,569,071.70
应付管理人报酬		3,468,572.63	5,117,046.41
应付托管费		578,095.44	852,841.06
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		41,473.09	42,477.17
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	2,632,788.13	5,809,100.81
负债合计		10,983,298.48	19,348,161.63
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	780,439,713.29	870,791,749.92
未分配利润	7.4.7.12	2,593,890,249.87	3,090,677,750.04
净资产合计		3,374,329,963.16	3,961,469,499.96
负债和净资产总计		3,385,313,261.64	3,980,817,661.59

注： 报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 4.324 元，基金份额总额 780,439,713.29 份。

7.2 利润表

会计主体：交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-106,947,669.22	-379,927,361.67
1.利息收入		5,500,584.55	5,966,536.48
其中：存款利息收入	7.4.7.13	5,500,584.55	5,948,584.56
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		-	17,951.92
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-134,176,896.38	-73,435,994.73
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-148,236,625.55	-105,107,468.47
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-12,664,420.00	1,869,342.29
资产支持证券投资收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	26,724,149.17	29,802,131.45
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	21,120,338.36	-313,400,391.24
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	608,304.25	942,487.82
减：二、营业总支出		62,770,275.03	74,027,540.83
1．管理人报酬	7.4.10.2.1	53,579,215.40	63,231,922.75
2．托管费	7.4.10.2.2	8,929,869.24	10,538,653.87
3．销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4．投资顾问费		-	-
5．利息支出		-	-

其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7．税金及附加		10,521.52	4,763.19
8．其他费用	7.4.7.23	250,668.87	252,201.02
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-169,717,944.25	-453,954,902.50
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-169,717,944.25	-453,954,902.50
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-169,717,944.25	-453,954,902.50

7.3 净资产变动表

会计主体：交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	870,791,749.92	-	3,090,677,750.04	3,961,469,499.96
二、本期期初净资产	870,791,749.92	-	3,090,677,750.04	3,961,469,499.96
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-90,352,036.63	-	-496,787,500.17	-587,139,536.80
（一）、综合收益总额	-	-	-169,717,944.25	-169,717,944.25
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-90,352,036.63	-	-327,069,555.92	-417,421,592.55
其中：1.基金申购款	178,811,969.46	-	673,251,840.82	852,063,810.28
2.基金赎回款	-269,164,006.09	-	-1,000,321,396.	-1,269,485,402.8

			74	3
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	780,439,713.29	-	2,593,890,249.87	3,374,329,963.16
项目	上年度可比期间 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	1,008,368,926.00	-	4,033,026,335.01	5,041,395,261.01
二、本期期初净资产	1,008,368,926.00	-	4,033,026,335.01	5,041,395,261.01
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-137,577,176.08	-	-942,348,584.97	-1,079,925,761.05
（一）、综合收益总额	-	-	-453,954,902.50	-453,954,902.50
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-137,577,176.08	-	-488,393,682.47	-625,970,858.55
其中：1.基金申购款	186,878,145.97	-	661,027,500.33	847,905,646.30
2.基金赎回款	-324,455,322.05	-	-1,149,421,182.80	-1,473,876,504.85
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-

四、本期期末净资产	870,791,749.92	-	3,090,677,750.04	3,961,469,499.96

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：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]753 号《关于核准交银施罗德定期支付双息平衡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《交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 641,999,732.41 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 550 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双息平衡混合型证券投资基金基金合同》于 2013 年 9 月 4 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 642,313,653.44 份基金份额，其中认购资金利息折合 313,921.03 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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金基金合同》和《交银施罗德定期支付双息平衡混合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 6%。

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双息平衡混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法上市的股票(含中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票)、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它金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金投资于股票、权证等权益类资产占基金资产净值的 30%-70%，其中权证的投资比例不超过基金资产净值的 3%；债券、资产支持证券、货币市场工具、银行存款等固定收益类资产和现金不

低于基金资产净值的 30%，其中现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为 50%×中证红利指数收益率+50%×中债综合全价指数收益率。

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 2024 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》、《交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国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 2023 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 12 月 31 日的财务状况以及 2023 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

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1)金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2)金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3)衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于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。

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

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。

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逐日确认。

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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》及中国基金业协会中基协字[2022]566 号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

根据中国证监会于 2024 年颁布的修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度

报告和中期报告>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	769,659,547.80	511,397,054.06
等于：本金	769,490,860.07	511,267,165.42
加：应计利息	168,687.73	129,888.64
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	769,659,547.80	511,397,054.06

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		2,444,270,578.35	-	2,339,758,018.76	-104,512,559.59
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债	交易所	281,987,309.56	806,493.26	262,699,506.56	-20,094,296.26

券	市场				
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	281,987,309.56	806,493.26	262,699,506.56	-20,094,296.26
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		2,726,257,887.91	806,493.26	2,602,457,525.32	-124,606,855.85
项目		上年度末 2022 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		2,871,286,817.22	-	2,760,172,544.74	-111,114,272.48
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	607,022,036.46	1,242,985.04	573,803,149.77	-34,461,871.73
	银行间市场	120,139,050.00	2,326,484.93	122,314,484.93	-151,050.00
	合计	727,161,086.46	3,569,469.97	696,117,634.70	-34,612,921.73
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		3,598,447,903.68	3,569,469.97	3,456,290,179.44	-145,727,194.21

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

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

无。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.8 其他资产

无。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	4,081.88	5,843.17
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	2,429,406.25	5,603,957.64
其中：交易所市场	2,429,406.25	5,603,642.64
银行间市场	-	315.00
应付利息	-	-
预提审计费	70,000.00	70,000.00
预提信息披露费	120,000.00	120,000.00
预提账户维护费	9,300.00	9,300.00
合计	2,632,788.13	5,809,100.81

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	870,791,749.92	870,791,749.92
本期申购	178,811,969.46	178,811,969.46
本期赎回（以“-”号填列）	-269,164,006.09	-269,164,006.09
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	780,439,713.29	780,439,713.29

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,575,340,929.98	515,336,820.06	3,090,677,750.04
本期期初	2,575,340,929.98	515,336,820.06	3,090,677,750.04
本期利润	-190,838,282.61	21,120,338.36	-169,717,944.25
本期基金份额交易产生的变动数	-258,518,229.95	-68,551,325.97	-327,069,555.92
其中：基金申购款	528,561,990.83	144,689,849.99	673,251,840.82
基金赎回款	-787,080,220.78	-213,241,175.96	- 1,000,321,396.74
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,125,984,417.42	467,905,832.45	2,593,890,249.87

7.4.7.13 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	5,330,923.27	5,782,894.26
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	146,481.30	142,409.18
其他	23,179.98	23,281.12

合计	5,500,584.55	5,948,584.56

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 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-148,236,625.55	-105,107,468.47
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	-148,236,625.55	-105,107,468.47

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	12,569,538,647.11	11,526,347,040.70
减：卖出股票成本总额	12,684,383,426.41	11,596,822,930.60
减：交易费用	33,391,846.25	34,631,578.57
买卖股票差价收入	-148,236,625.55	-105,107,468.47

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 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
债券投资收益——利息收入	3,538,168.13	5,767,534.70

债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-16,202,588.13	-3,898,192.41
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	-12,664,420.00	1,869,342.29

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 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,960,661,725.54	1,368,754,186.50
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,970,644,591.90	1,364,137,958.62
减：应计利息总额	6,090,699.46	8,433,402.58
减：交易费用	129,022.31	81,017.71
买卖债券差价收入	-16,202,588.13	-3,898,192.41

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	26,724,149.17	29,802,131.45
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	26,724,149.17	29,802,131.45

7.4.7.20 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	21,120,338.36	-313,400,391.24
股票投资	6,601,712.89	-273,032,349.33
债券投资	14,518,625.47	-40,368,041.91
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	21,120,338.36	-313,400,391.24

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	608,304.25	942,487.82
合计	608,304.25	942,487.82

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	70,000.00	70,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	23,468.87	25,001.02
债券账户费用	37,200.00	37,200.00
合计	250,668.87	252,201.02

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	基金管理人、基金销售机构

罗德基金公司”）	
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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	53,579,215.40	63,231,922.75
其中：应支付销售机构的客户维护费	21,358,079.88	26,120,109.49
应支付基金管理人的净管理费	32,221,135.52	37,111,813.26

注：自 2022 年 1 月 1 日至 2023 年 7 月 9 日，支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。根据《交银施罗德基金管理有限公司关于调整旗下部分基金管理费率和/或托管费率并修改基金合同等法律文件的公告》，自 2023 年 7 月

10 日起，支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值×约定年费率÷当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	8,929,869.24	10,538,653.87

注：自 2022 年 1 月 1 日至 2023 年 7 月 9 日，支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。根据《交银施罗德基金管理有限公司关于调整旗下部分基金管理费率和/或托管费率并修改基金合同等法律文件的公告》，自 2023 年 7 月 10 日起，支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝前一日基金资产净值×约定年费率÷当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

无。

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	769,659,547.80	5,330,923.27	511,397,054.06	5,782,894.26

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

无。

7.4.12 期末（2023 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
001239	永达股份	2023 年 12 月 4 日	6 个月以上	限售股	12.05	19.92	189	2,277.45	3,764.88	-
001306	夏厦精密	2023 年 11 月 9 日	6 个月以上	限售股	53.63	75.36	64	3,432.32	4,823.04	-
001326	联域股份	2023 年 11 月 1 日	6 个月以上	限售股	41.18	48.64	99	4,076.82	4,815.36	-
001358	兴欣新材	2023 年 12 月 14 日	6 个月以上	限售股	41.00	44.16	87	3,567.00	3,841.92	-

001378	德冠新材	2023年10月23日	6个月以上	限售股	31.68	31.27	205	6,494.40	6,410.35	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	6个月以上	限售股	25.82	31.80	306	7,900.92	9,730.80	-
301251	威尔高	2023年8月30日	6个月以上	限售股	28.88	34.59	321	9,270.48	11,103.39	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	6个月以上	限售股	36.90	50.85	198	7,306.20	10,068.30	-
301272	英华特	2023年7月6日	6个月以上	限售股	51.39	53.38	173	8,890.47	9,234.74	-
301291	明阳电气	2023年6月21日	6个月以上	限售股	38.13	28.36	1,206	45,984.78	34,202.16	-
301329	信音电子	2023年7月5日	6个月以上	限售股	21.00	22.23	458	9,618.00	10,181.34	-
301362	民爆光电	2023年7月27日	6个月以上	限售股	51.05	38.52	420	21,441.00	16,178.40	-
301371	敷尔佳	2023年7月24日	6个月以上	限售股	55.68	37.58	564	31,403.52	21,195.12	-
301372	科净源	2023年8月3日	6个月以上	限售股	45.00	43.59	231	10,395.00	10,069.29	-
301381	赛维时代	2023年7月5日	6个月以上	限售股	20.45	29.69	571	11,676.95	16,952.99	-

301393	昊帆生物	2023年7月5日	6个月以上	限售股	67.68	59.37	260	17,596.80	15,436.20	-
301413	安培龙	2023年12月11日	6个月以上	限售股	33.25	58.19	164	5,453.00	9,543.16	-
301418	协昌科技	2023年8月10日	6个月以上	限售股	51.88	50.20	189	9,805.32	9,487.80	-
301456	盘古智能	2023年7月6日	6个月以上	限售股	37.96	30.39	407	15,449.72	12,368.73	-
301459	丰茂股份	2023年12月6日	6个月以上	限售股	31.90	39.84	208	6,635.20	8,286.72	-
301468	博盈特焊	2023年7月12日	6个月以上	限售股	47.58	30.22	598	28,452.84	18,071.56	-
301469	恒达新材	2023年8月10日	6个月以上	限售股	36.58	33.09	275	10,059.50	9,099.75	-
301486	致尚科技	2023年6月30日	6个月以上	限售股	57.66	47.25	482	27,792.12	22,774.50	-
301488	豪恩汽电	2023年6月26日	6个月以上	限售股	39.78	69.09	262	10,422.36	18,101.58	-
301489	思泉新材	2023年10月16日	6个月以上	限售股	41.66	64.11	128	5,332.48	8,206.08	-
301498	乖宝宠物	2023年8月9日	6个月以上	限售股	39.99	38.81	554	22,154.46	21,500.74	-

301505	苏州规划	2023 年 7 月 12 日	6 个月以上	限售股	26.35	35.81	194	5,111.90	6,947.14	-
301507	民生健康	2023 年 8 月 24 日	6 个月以上	限售股	10.00	15.85	851	8,510.00	13,488.35	-
301508	中机认检	2023 年 11 月 23 日	6 个月以上	限售股	16.82	26.68	419	7,047.58	11,178.92	-
301509	金凯生科	2023 年 7 月 26 日	6 个月以上	限售股	56.56	62.23	266	15,044.96	16,553.18	-
301515	港通医疗	2023 年 7 月 13 日	6 个月以上	限售股	31.16	28.27	230	7,166.80	6,502.10	-
301516	中远通	2023 年 12 月 1 日	6 个月以上	限售股	6.87	15.51	604	4,149.48	9,368.04	-
301517	陕西华达	2023 年 10 月 9 日	6 个月以上	限售股	26.87	43.69	185	4,970.95	8,082.65	-
301518	长华化学	2023 年 7 月 26 日	6 个月以上	限售股	25.75	23.01	385	9,913.75	8,858.85	-
301520	万邦医药	2023 年 9 月 18 日	6 个月以上	限售股	67.88	52.74	160	10,860.80	8,438.40	-
301525	儒竞科技	2023 年 8 月 23 日	6 个月以上	限售股	99.57	81.46	266	26,485.62	21,668.36	-
301526	国际复材	2023 年 12 月 19 日	6 个月以上	限售股	2.66	4.45	9,723	25,863.18	43,267.35	-

301529	福赛科技	2023年8月31日	6个月以上	限售股	36.60	37.88	182	6,661.20	6,894.16	-
301533	威马农机	2023年8月7日	6个月以上	限售股	29.50	33.16	225	6,637.50	7,461.00	-
301548	崇德科技	2023年9月11日	6个月以上	限售股	66.80	58.99	136	9,084.80	8,022.64	-
301550	斯菱股份	2023年9月6日	6个月以上	限售股	37.56	43.57	260	9,765.60	11,328.20	-
301555	惠柏新材	2023年10月24日	6个月以上	限售股	22.88	32.44	224	5,125.12	7,266.56	-
301558	三态股份	2023年9月21日	6个月以上	限售股	7.33	13.40	1,458	10,687.14	19,537.20	-
301566	达利凯普	2023年12月22日	6个月以上	限售股	8.90	22.14	576	5,126.40	12,752.64	-
301568	思泰克	2023年11月21日	6个月以上	限售股	23.23	35.58	246	5,714.58	8,752.68	-
301578	辰奕智能	2023年12月21日	6个月以上	限售股	48.94	68.32	118	5,774.92	8,061.76	-
601083	锦江航运	2023年11月28日	6个月以上	限售股	11.25	11.07	1,263	14,208.75	13,981.41	-
601096	宏盛华源	2023年12月15日	6个月以上	限售股	1.70	4.06	3,918	6,660.60	15,907.08	-

603004	鼎龙科技	2023年12月20日	6个月以上	限售股	16.80	31.19	195	3,276.00	6,082.05	-
603075	热威股份	2023年9月1日	6个月以上	限售股	23.10	23.31	182	4,204.20	4,242.42	-
603119	浙江荣泰	2023年7月21日	6个月以上	限售股	15.32	23.87	226	3,462.32	5,394.62	-
603193	润本股份	2023年10月9日	6个月以上	限售股	17.38	16.66	303	5,266.14	5,047.98	-
603231	索宝蛋白	2023年12月6日	6个月以上	限售股	21.29	21.53	161	3,427.69	3,466.33	-
603270	金帝股份	2023年8月25日	6个月以上	限售股	21.77	29.58	195	4,245.15	5,768.10	-
603273	天元智能	2023年10月16日	6个月以上	限售股	9.50	18.97	178	1,691.00	3,376.66	-
603275	众辰科技	2023年8月16日	6个月以上	限售股	49.97	39.70	193	9,644.21	7,662.10	-
603276	恒兴新材	2023年9月18日	6个月以上	限售股	25.73	24.88	134	3,447.82	3,333.92	-
603296	华勤技术	2023年8月1日	6个月以上	限售股	80.80	77.75	593	47,914.40	46,105.75	-
603373	安邦护卫	2023年12月13日	6个月以上	限售股	19.10	34.75	88	1,680.80	3,058.00	-

688548	广钢气体	2023 年 8 月 8 日	6 个月以上	限售股	9.87	12.75	4,048	39,953.76	51,612.00	-
688549	中巨芯	2023 年 8 月 30 日	6 个月以上	限售股	5.18	8.09	4,294	22,242.92	34,738.46	-
688563	航材股份	2023 年 7 月 12 日	6 个月以上	限售股	78.99	60.49	1,501	118,563.99	90,795.49	-
688573	信宇人	2023 年 8 月 9 日	6 个月以上	限售股	23.68	28.80	285	6,748.80	8,208.00	-
688582	芯动联科	2023 年 6 月 21 日	6 个月以上	限售股	26.74	38.67	648	17,327.52	25,058.16	-
688591	泰凌微	2023 年 8 月 18 日	6 个月以上	限售股	24.98	28.02	681	17,011.38	19,081.62	-
688602	康鹏科技	2023 年 7 月 13 日	6 个月以上	限售股	8.66	11.06	1,066	9,231.56	11,789.96	-
688603	天承科技	2023 年 6 月 30 日	6 个月以上	限售股	55.00	74.14	140	7,700.00	10,379.60	-
688612	威迈斯	2023 年 7 月 19 日	6 个月以上	限售股	47.29	37.97	422	19,956.38	16,023.34	-
688638	誉辰智能	2023 年 7 月 4 日	6 个月以上	限售股	83.90	59.68	141	11,829.90	8,414.88	-
688646	逸飞激光	2023 年 7 月 21 日	6 个月以上	限售股	46.80	36.07	219	10,249.20	7,899.33	-

688648	中邮科技	2023年11月6日	6个月以上	限售股	15.18	21.43	303	4,599.54	6,493.29	-
688651	盛邦安全	2023年7月19日	6个月以上	限售股	39.90	46.05	178	7,102.20	8,196.90	-
688652	京仪装备	2023年11月22日	6个月以上	限售股	31.95	52.25	416	13,291.20	21,736.00	-
688653	康希通信	2023年11月10日	6个月以上	限售股	10.50	15.99	648	6,804.00	10,361.52	-
688657	浩辰软件	2023年9月25日	6个月以上	限售股	103.40	78.23	101	10,443.40	7,901.23	-
688693	锴威特	2023年8月10日	6个月以上	限售股	40.83	43.41	178	7,267.74	7,726.98	-
688702	盛科通信	2023年9月6日	6个月以上	限售股	42.66	48.18	549	23,420.34	26,450.82	-
688716	中研股份	2023年9月13日	6个月以上	限售股	29.66	36.39	267	7,919.22	9,716.13	-
688719	爱科赛博	2023年9月20日	6个月以上	限售股	69.98	60.10	194	13,576.12	11,659.40	-
688720	艾森股份	2023年11月29日	6个月以上	限售股	28.03	49.84	165	4,624.95	8,223.60	-

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中需要限售的部分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、基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

3、基金作为特定投资者，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。

4、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

本基金是一只混合型基金，在证券投资基金中属于较高风险的品种，其长期平均风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法上市的股票（含中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票、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它金融工具（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，通过精选具有长期增长潜力和较好分红能力的股票，以及具有较高息票率的债券，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。

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。

于 2023 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 7.79%（2022 年 12 月 31 日：14.48%）。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

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

无。

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 2023 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约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 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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及应收申购款等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	769,659,547.80	-	-	-	769,659,547.80
结算备付金	4,862,230.22	-	-	-	4,862,230.22
存出保证金	1,205,701.68	-	-	-	1,205,701.68
交易性金融资产	34,479,198.89	192,186,200.89	36,034,106.78	2,339,758,018.76	2,602,457,525.32
应收申购款	47,406.96	-	-	6,451,908.61	6,499,315.57

应收清算款	-	-	-	628,941.05	628,941.05
资产总计	810,254,085.55	192,186,200.89	36,034,106.78	2,346,838,868.42	3,385,313,261.64
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,262,369.19	4,262,369.19
应付管理人报酬	-	-	-	3,468,572.63	3,468,572.63
应付托管费	-	-	-	578,095.44	578,095.44
应交税费	-	-	-	41,473.09	41,473.09
其他负债	-	-	-	2,632,788.13	2,632,788.13
负债总计	-	-	-	10,983,298.48	10,983,298.48
利率敏感度缺口	810,254,085.55	192,186,200.89	36,034,106.78	2,335,855,569.94	3,374,329,963.16
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					
货币资金	511,397,054.06	-	-	-	511,397,054.06
结算备付金	9,645,283.68	-	-	-	9,645,283.68
存出保证金	1,348,845.71	-	-	-	1,348,845.71
交易性金融资产	122,314,484.93	497,332,227.45	76,470,922.32	2,760,172,544.74	3,456,290,179.44
应收申购款	60,670.71	-	-	2,075,627.99	2,136,298.70
资产总计	644,766,339.09	497,332,227.45	76,470,922.32	2,762,248,172.73	3,980,817,661.59
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,569,071.70	3,569,071.70
应付管理人报酬	-	-	-	5,117,046.41	5,117,046.41
应付托管费	-	-	-	852,841.06	852,841.06
应付清算款	-	-	-	3,957,624.48	3,957,624.48
应交税费	-	-	-	42,477.17	42,477.17
其他负债	-	-	-	5,809,100.81	5,809,100.81
负债总计	-	-	-	19,348,161.63	19,348,161.63
利率敏感度缺口	644,766,339.09	497,332,227.45	76,470,922.32	2,742,900,011.10	3,961,469,499.96

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

于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 7.79%(2022 年 12 月 31 日：17.57%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2022 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以

外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票（含存托凭证）、权证等权益类资产占基金资产净值的 30%-70%，其中权证的投资比例不超过基金资产净值的 3%；债券、资产支持证券、货币市场工具、银行存款等固定收益类资产和现金不低于基金资产净值的 30%，其中现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 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	2,339,758,018.76	69.34	2,760,172,544.74	69.68
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	262,699,506.56	7.79	573,803,149.77	14.48
交易性金融资产－贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,602,457,525.32	77.13	3,333,975,694.51	84.16

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		
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 12 月 31 日）	上年度末 （2022 年 12 月 31 日 ）

	1.业绩比较基准上涨 5%	187,230,943.86	227,490,589.80
	2.业绩比较基准下降 5%	-187,230,943.86	-227,490,589.80

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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	2,601,361,753.11	3,261,067,465.76
第二层次	59,260.32	193,229,155.60
第三层次	1,036,511.89	1,993,558.08
合计	2,602,457,525.32	3,456,290,179.44

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	-	1,993,558.08	1,993,558.08
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	5,023,602.93	5,023,602.93
转出第三层次	-	4,806,692.13	4,806,692.13
当期利得或损失总额	-	-1,173,956.99	-1,173,956.99
其中：计入损益的利得或损失	-	-1,173,956.99	-1,173,956.99
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,036,511.89	1,036,511.89
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	-	78,239.60	78,239.60
项目	上年度可比期间 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	-	32,962,571.18	32,962,571.18
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	5,773,869.38	5,773,869.38
转出第三层次	-	33,280,275.25	33,280,275.25
当期利得或损失总额	-	-3,462,607.23	-3,462,607.23
其中：计入损益的利得或损失	-	-3,462,607.23	-3,462,607.23
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,993,558.08	1,993,558.08
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	-	225,438.96	225,438.96

注：于 2023 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 2023 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	1,036,511.89	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	14.62%~219.88%	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	1,993,558.08	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	21.27%~247.56%	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 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(2022 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货币资金、买入返售金融资产、应收款项、卖出回购金融资产款和其他金融负债，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	2,339,758,018.76	69.11
	其中：股票	2,339,758,018.76	69.11

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	262,699,506.56	7.76
	其中：债券	262,699,506.56	7.76
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	774,521,778.02	22.88
8	其他各项资产	8,333,958.30	0.25
9	合计	3,385,313,261.64	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,500,439,521.27	44.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	385,586,945.74	11.43
E	建筑业	16,396,617.20	0.49
F	批发和零售业	21,525,365.63	0.64
G	交通运输、仓储和邮政业	172,750,411.24	5.12
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	125,419,799.60	3.72
J	金融业	14,432,040.00	0.43
K	房地产业	9,069,506.60	0.27
L	租赁和商务服务业	23,183,822.40	0.69
M	科学研究和技术服务业	10,937,498.17	0.32
N	水利、环境和公共设施管理业	16,971,569.10	0.50
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	97,873.81	0.00
R	文化、体育和娱乐业	8,593,680.00	0.25
S	综合	34,353,368.00	1.02
	合计	2,339,758,018.76	69.34

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	002436	兴森科技	10,647,500	156,837,675.00	4.65
2	601233	桐昆股份	7,195,696	108,870,880.48	3.23
3	000690	宝新能源	20,497,232	90,802,737.76	2.69
4	300308	中际旭创	704,197	79,510,883.27	2.36
5	600011	华能国际	10,031,492	77,242,488.40	2.29
6	300724	捷佳伟创	959,793	71,034,279.93	2.11
7	600060	海信视像	3,322,908	69,448,777.20	2.06
8	000543	皖能电力	11,025,214	69,017,839.64	2.05
9	601111	中国国航	8,620,800	63,276,672.00	1.88
10	600029	南方航空	9,663,400	55,661,184.00	1.65
11	300203	聚光科技	3,317,293	52,579,094.05	1.56
12	600079	人福医药	1,942,112	48,280,904.32	1.43
13	002487	大金重工	1,769,500	47,104,090.00	1.40
14	600483	福能股份	5,683,050	46,998,823.50	1.39
15	603305	旭升集团	2,040,700	40,263,011.00	1.19
16	603606	东方电缆	888,700	37,991,925.00	1.13
17	000988	华工科技	1,155,400	34,384,704.00	1.02
18	600603	广汇物流	4,415,600	34,353,368.00	1.02
19	002608	江苏国信	4,556,100	29,933,577.00	0.89
20	600115	中国东航	7,655,200	29,702,176.00	0.88
21	002609	捷顺科技	2,532,304	28,918,911.68	0.86
22	002517	恺英网络	2,435,100	27,200,067.00	0.81
23	002241	歌尔股份	1,205,600	25,329,656.00	0.75
24	600027	华电国际	4,805,676	24,701,174.64	0.73
25	603889	新澳股份	3,440,970	24,499,706.40	0.73
26	300474	景嘉微	343,900	24,317,169.00	0.72
27	603885	吉祥航空	1,996,202	23,954,424.00	0.71
28	300280	紫天科技	541,700	23,146,841.00	0.69
29	605090	九丰能源	812,820	22,702,062.60	0.67
30	300136	信维通信	953,800	22,509,680.00	0.67
31	000938	紫光股份	1,139,300	22,045,455.00	0.65
32	688382	益方生物	1,429,778	21,646,838.92	0.64
33	600153	建发股份	2,230,408	21,478,829.04	0.64
34	300260	新莱应材	701,856	21,357,478.08	0.63
35	300856	科思股份	327,050	20,352,321.50	0.60
36	300218	安利股份	1,500,600	20,333,130.00	0.60
37	002353	杰瑞股份	720,516	20,253,704.76	0.60
38	688501	青达环保	1,209,271	20,231,103.83	0.60
39	301155	海力风电	335,585	19,849,852.75	0.59

40	300476	胜宏科技	1,053,000	19,427,850.00	0.58
41	000700	模塑科技	2,692,851	18,849,957.00	0.56
42	688362	甬矽电子	719,725	18,849,597.75	0.56
43	300130	新国都	775,900	18,776,780.00	0.56
44	688111	金山办公	57,799	18,276,043.80	0.54
45	603138	海量数据	1,000,800	17,814,240.00	0.53
46	300910	瑞丰新材	386,890	17,773,726.60	0.53
47	688286	敏芯股份	240,256	17,226,355.20	0.51
48	603986	兆易创新	184,200	17,018,238.00	0.50
49	600323	瀚蓝环境	977,952	16,947,908.16	0.50
50	300604	长川科技	427,500	16,240,725.00	0.48
51	003006	百亚股份	1,050,000	15,918,000.00	0.47
52	603239	浙江仙通	1,004,600	15,340,242.00	0.45
53	688668	鼎通科技	272,488	15,074,036.16	0.45
54	300633	开立医疗	309,800	14,653,540.00	0.43
55	301117	佳缘科技	267,783	14,596,851.33	0.43
56	600989	宝丰能源	987,975	14,592,390.75	0.43
57	300033	同花顺	92,000	14,432,040.00	0.43
58	688331	荣昌生物	230,427	14,300,299.62	0.42
59	688176	亚虹医药	1,283,491	13,836,032.98	0.41
60	603278	大业股份	1,079,200	13,597,920.00	0.40
61	688143	长盈通	371,116	13,118,950.60	0.39
62	002845	同兴达	735,800	13,060,450.00	0.39
63	002648	卫星化学	841,874	12,417,641.50	0.37
64	002230	科大讯飞	263,400	12,216,492.00	0.36
65	688596	正帆科技	301,886	11,963,742.18	0.35
66	301397	溯联股份	264,512	11,950,652.16	0.35
67	300628	亿联网络	404,342	11,948,306.10	0.35
68	002262	恩华药业	439,000	11,905,680.00	0.35
69	603712	七一二	363,400	11,450,734.00	0.34
70	300416	苏试试验	586,060	10,765,922.20	0.32
71	600023	浙能电力	2,313,600	10,665,696.00	0.32
72	300661	圣邦股份	117,281	10,439,181.81	0.31
73	688719	爱科赛博	159,054	10,213,648.60	0.30
74	300831	派瑞股份	832,500	10,206,450.00	0.30
75	002475	立讯精密	293,300	10,104,185.00	0.30
76	300445	康斯特	561,800	9,792,174.00	0.29
77	600764	中国海防	389,300	9,713,035.00	0.29
78	688311	盟升电子	189,636	9,673,332.36	0.29
79	600266	城建发展	1,873,865	9,069,506.60	0.27
80	300129	泰胜风能	840,200	9,048,954.00	0.27
81	300443	金雷股份	324,000	8,939,160.00	0.26
82	000090	天健集团	1,916,982	8,818,117.20	0.26

83	300133	华策影视	1,464,000	8,593,680.00	0.25
84	000400	许继电气	378,500	8,311,860.00	0.25
85	605289	罗曼股份	131,800	7,578,500.00	0.22
86	603890	春秋电子	651,300	7,457,385.00	0.22
87	002149	西部材料	465,100	7,311,372.00	0.22
88	000883	湖北能源	1,636,300	6,921,549.00	0.21
89	002039	黔源电力	478,680	6,600,997.20	0.20
90	002765	蓝黛科技	942,200	6,322,162.00	0.19
91	300288	朗玛信息	383,200	6,303,640.00	0.19
92	688636	智明达	59,881	3,904,241.20	0.12
93	688443	智翔金泰	30,329	1,211,643.55	0.04
94	688472	阿特斯	79,935	1,009,579.05	0.03
95	688563	航材股份	15,010	917,546.29	0.03
96	688361	中科飞测	8,303	617,992.29	0.02
97	688378	奥来德	12,193	577,216.62	0.02
98	688548	广钢气体	40,476	527,361.68	0.02
99	301526	国际复材	97,225	527,153.41	0.02
100	688409	富创精密	6,334	496,015.54	0.01
101	603296	华勤技术	5,925	472,079.23	0.01
102	688484	南芯科技	10,071	401,329.35	0.01
103	688549	中巨芯	42,933	358,533.28	0.01
104	688531	日联科技	3,460	349,736.80	0.01
105	688146	中船特气	10,101	343,535.01	0.01
106	301383	天键股份	4,925	320,125.00	0.01
107	688652	京仪装备	4,157	247,131.25	0.01
108	601096	宏盛华源	39,171	213,323.88	0.01
109	301566	达利凯普	5,755	162,891.85	0.00
110	601083	锦江航运	12,630	155,955.24	0.00
111	301508	中机认检	4,186	140,801.39	0.00
112	688653	康希通信	6,478	127,078.12	0.00
113	301516	中远通	6,033	124,517.13	0.00
114	301413	安培龙	1,633	118,542.96	0.00
115	301568	思泰克	2,456	109,572.88	0.00
116	301261	恒工精密	1,973	101,693.80	0.00
117	688720	艾森股份	1,644	97,348.14	0.00
118	301459	丰茂股份	2,077	95,083.08	0.00
119	301578	辰奕智能	1,175	89,662.16	0.00
120	603004	鼎龙科技	1,948	69,190.05	0.00
121	001306	夏厦精密	631	56,221.59	0.00
122	301239	普瑞眼科	575	49,450.00	0.00
123	301267	华厦眼科	1,509	48,423.81	0.00
124	001239	永达股份	1,887	44,228.22	0.00
125	001358	兴欣新材	867	41,281.92	0.00

126	603231	索宝蛋白	1,610	37,546.81	0.00
127	603373	安邦护卫	876	36,981.40	0.00
128	301291	明阳电气	1,206	34,202.16	0.00
129	688702	盛科通信	549	26,450.82	0.00
130	688582	芯动联科	648	25,058.16	0.00
131	688570	天玛智控	884	24,053.64	0.00
132	688576	西山科技	240	23,071.20	0.00
133	688543	国科军工	410	22,919.00	0.00
134	301486	致尚科技	482	22,774.50	0.00
135	301525	儒竞科技	266	21,668.36	0.00
136	301498	乖宝宠物	554	21,500.74	0.00
137	301371	敷尔佳	564	21,195.12	0.00
138	688581	安杰思	163	20,344.03	0.00
139	301310	鑫宏业	409	19,897.85	0.00
140	301558	三态股份	1,458	19,537.20	0.00
141	688591	泰凌微	681	19,081.62	0.00
142	301488	豪恩汽电	262	18,101.58	0.00
143	301468	博盈特焊	598	18,071.56	0.00
144	688562	航天软件	726	17,424.00	0.00
145	688458	美芯晟	221	17,008.16	0.00
146	301381	赛维时代	571	16,952.99	0.00
147	301509	金凯生科	266	16,553.18	0.00
148	301362	民爆光电	420	16,178.40	0.00
149	688612	威迈斯	422	16,023.34	0.00
150	688629	华丰科技	708	15,505.20	0.00
151	301393	昊帆生物	260	15,436.20	0.00
152	688334	西高院	888	15,389.04	0.00
153	301382	蜂助手	408	14,532.96	0.00
154	688593	新相微	959	14,116.48	0.00
155	301332	德尔玛	1,122	13,710.84	0.00
156	301305	朗坤环境	753	13,591.65	0.00
157	301507	民生健康	851	13,488.35	0.00
158	688523	航天环宇	472	12,659.04	0.00
159	688623	双元科技	178	12,634.44	0.00
160	301456	盘古智能	407	12,368.73	0.00
161	688620	安凯微	1,016	12,009.12	0.00
162	301315	威士顿	226	11,946.36	0.00
163	301225	恒勃股份	333	11,921.40	0.00
164	688602	康鹏科技	1,066	11,789.96	0.00
165	301550	斯菱股份	260	11,328.20	0.00
166	301399	英特科技	293	11,213.11	0.00
167	301251	威尔高	321	11,103.39	0.00
168	688603	天承科技	140	10,379.60	0.00

169	301329	信音电子	458	10,181.34	0.00
170	301372	科净源	231	10,069.29	0.00
171	301376	致欧科技	420	10,046.40	0.00
172	301202	朗威股份	306	9,730.80	0.00
173	688716	中研股份	267	9,716.13	0.00
174	301418	协昌科技	189	9,487.80	0.00
175	301272	英华特	173	9,234.74	0.00
176	301469	恒达新材	275	9,099.75	0.00
177	301518	长华化学	385	8,858.85	0.00
178	301520	万邦医药	160	8,438.40	0.00
179	301323	新莱福	228	8,433.72	0.00
180	688638	誉辰智能	141	8,414.88	0.00
181	688573	信宇人	285	8,208.00	0.00
182	301489	思泉新材	128	8,206.08	0.00
183	688651	盛邦安全	178	8,196.90	0.00
184	301517	陕西华达	185	8,082.65	0.00
185	301548	崇德科技	136	8,022.64	0.00
186	301232	飞沃科技	165	8,000.85	0.00
187	688657	浩辰软件	101	7,901.23	0.00
188	688646	逸飞激光	219	7,899.33	0.00
189	688693	锴威特	178	7,726.98	0.00
190	603275	众辰科技	193	7,662.10	0.00
191	301170	锡南科技	250	7,607.50	0.00
192	301533	威马农机	225	7,461.00	0.00
193	688429	时创能源	346	7,331.74	0.00
194	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
195	301337	亚华电子	232	7,101.52	0.00
196	300804	广康生化	226	6,974.36	0.00
197	301505	苏州规划	194	6,947.14	0.00
198	301529	福赛科技	182	6,894.16	0.00
199	301515	港通医疗	230	6,502.10	0.00
200	688648	中邮科技	303	6,493.29	0.00
201	001378	德冠新材	205	6,410.35	0.00
202	603270	金帝股份	195	5,768.10	0.00
203	603119	浙江荣泰	226	5,394.62	0.00
204	603193	润本股份	303	5,047.98	0.00
205	001326	联域股份	99	4,815.36	0.00
206	603075	热威股份	182	4,242.42	0.00
207	001282	三联锻造	105	3,797.85	0.00
208	603273	天元智能	178	3,376.66	0.00
209	603276	恒兴新材	134	3,333.92	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002230	科大讯飞	291,879,651.70	7.37
2	300724	捷佳伟创	232,169,249.52	5.86
3	300308	中际旭创	224,088,241.64	5.66
4	002236	大华股份	183,194,278.40	4.62
5	600266	城建发展	166,292,855.81	4.20
6	000977	浪潮信息	156,352,071.81	3.95
7	300476	胜宏科技	154,338,973.67	3.90
8	600011	华能国际	151,175,309.00	3.82
9	300502	新易盛	142,940,497.72	3.61
10	002436	兴森科技	136,347,281.82	3.44
11	300059	东方财富	135,939,365.01	3.43
12	688041	海光信息	132,495,411.12	3.34
13	002142	宁波银行	130,047,224.63	3.28
14	600036	招商银行	128,725,829.02	3.25
15	300260	新莱应材	115,739,343.28	2.92
16	603986	兆易创新	114,539,902.61	2.89
17	300474	景嘉微	110,320,920.42	2.78
18	000938	紫光股份	106,872,878.22	2.70
19	601012	隆基绿能	105,287,101.00	2.66
20	600153	建发股份	99,381,414.96	2.51
21	688032	禾迈股份	81,915,449.45	2.07
22	002555	三七互娱	79,252,515.24	2.00

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	002230	科大讯飞	285,356,594.36	7.20
2	600036	招商银行	224,047,417.01	5.66
3	300308	中际旭创	196,890,259.01	4.97
4	002236	大华股份	179,163,755.75	4.52
5	002493	荣盛石化	178,594,429.32	4.51
6	600266	城建发展	162,714,883.77	4.11
7	002142	宁波银行	157,177,120.78	3.97
8	000977	浪潮信息	154,070,363.64	3.89
9	688041	海光信息	151,183,423.96	3.82

10	300476	胜宏科技	147,006,256.46	3.71
11	000301	东方盛虹	140,090,511.18	3.54
12	300502	新易盛	137,815,107.77	3.48
13	300059	东方财富	129,879,333.71	3.28
14	600011	华能国际	127,507,276.00	3.22
15	300724	捷佳伟创	127,255,796.82	3.21
16	000539	粤电力 A	111,785,617.04	2.82
17	601012	隆基绿能	109,924,689.07	2.77
18	300474	景嘉微	103,880,222.34	2.62
19	600258	首旅酒店	103,856,683.72	2.62
20	002463	沪电股份	103,537,475.54	2.61
21	000600	建投能源	100,871,648.64	2.55
22	002409	雅克科技	100,810,465.12	2.54
23	603986	兆易创新	96,928,909.01	2.45
24	600023	浙能电力	94,411,291.06	2.38
25	601233	桐昆股份	93,921,171.97	2.37
26	600153	建发股份	90,522,501.00	2.29
27	600325	华发股份	89,867,639.91	2.27
28	688498	源杰科技	85,991,678.79	2.17
29	002555	三七互娱	85,820,639.76	2.17
30	603816	顾家家居	85,752,107.22	2.16
31	601138	工业富联	85,516,986.68	2.16
32	002436	兴森科技	84,417,805.83	2.13
33	002020	京新药业	82,126,178.93	2.07
34	300031	宝通科技	80,366,539.55	2.03
35	300260	新莱应材	79,811,083.59	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	12,257,367,187.54
卖出股票收入（成交）总额	12,569,538,647.11

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	-	-
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）	262,699,506.56	7.79
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	262,699,506.56	7.79

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	110068	龙净转债	281,550	38,651,299.71	1.15
2	113667	春 23 转债	189,400	25,120,251.73	0.74
3	127058	科伦转债	124,600	22,565,479.88	0.67
4	113588	润达转债	113,400	18,931,104.74	0.56
5	110047	山鹰转债	168,980	18,548,865.16	0.55

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 本基金投资股指期货的投资政策

无。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

8.11.2 本期国债期货投资评价

无。

8.12 投资组合报告附注

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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体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。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,205,701.68
2	应收清算款	628,941.05
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	6,499,315.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,333,958.30

8.12.4 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	110068	龙净转债	38,651,299.71	1.15
2	113667	春 23 转债	25,120,251.73	0.74
3	127058	科伦转债	22,565,479.88	0.67
4	113588	润达转债	18,931,104.74	0.56
5	110047	山鹰转债	18,548,865.16	0.55
6	113039	嘉泽转债	18,505,319.55	0.55
7	110063	鹰 19 转债	18,108,626.32	0.54
8	111000	起帆转债	17,738,868.70	0.53
9	113582	火炬转债	16,641,709.90	0.49
10	110075	南航转债	16,408,525.27	0.49
11	110048	福能转债	15,930,333.73	0.47
12	113594	淳中转债	13,540,215.58	0.40
13	123118	惠城转债	11,095,051.24	0.33
14	123192	科思转债	10,913,855.05	0.32

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§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

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（%）
433,843	1,798.90	37,377,891.56	4.79	743,061,821.73	95.21

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	234,142.78	0.03

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	-

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013 年 9 月 4 日）基金份额总额	642,313,653.44
本报告期期初基金份额总额	870,791,749.92
本报告期基金总申购份额	178,811,969.46
减：本报告期基金总赎回份额	269,164,006.09
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	780,439,713.29

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人的重大人事变动：本报告期内，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。

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 70,000.00 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

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。

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(%)	
华泰证券	1	5,147,090,026.48	20.75	4,113,307.65	20.08	-
国海证券	1	4,311,535,485.17	17.38	3,590,861.57	17.53	-
国金证券	2	3,172,688,564.44	12.79	2,491,229.66	12.16	-
国信证券	1	2,199,917,125.91	8.87	1,749,029.41	8.54	-
兴业证券	1	1,690,366,861.26	6.82	1,372,987.70	6.70	-
招商证券	1	1,432,805,129.88	5.78	1,272,411.83	6.21	-
申万宏源证券	3	1,269,390,881.11	5.12	1,065,372.99	5.20	-
华创证券	1	1,175,358,986.42	4.74	999,974.38	4.88	-

光大证券	2	1,034,645,566.41	4.17	946,390.40	4.62	-
安信证券	2	743,983,678.52	3.00	667,965.60	3.26	-
天风证券	1	587,154,025.13	2.37	495,600.76	2.42	-
海通证券	1	473,350,366.81	1.91	341,416.56	1.67	-
中金公司	2	433,604,427.32	1.75	403,819.57	1.97	-
国泰君安证券	1	421,008,394.31	1.70	382,590.72	1.87	-
瑞银证券	1	338,252,210.51	1.36	312,263.60	1.52	-
中信证券	1	268,887,659.49	1.08	197,875.03	0.97	-
东北证券	2	68,900,792.80	0.28	64,168.37	0.31	-
长江证券	1	32,049,391.44	0.13	17,511.91	0.09	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中银国际证券	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(%)
华泰证券	835,891,620.98	24.98	-	-	-	-
国海证券	431,552,926.52	12.90	-	-	-	-
国金证券	322,974,020.58	9.65	-	-	-	-
国信证券	301,521,805.03	9.01	-	-	-	-

兴业证券	215,498,595.12	6.44	-	-	-	-
招商证券	334,415,993.60	9.99	-	-	-	-
申万宏源证券	243,143,968.06	7.27	-	-	-	-
华创证券	117,929,980.25	3.52	-	-	-	-
光大证券	58,265,481.07	1.74	-	-	-	-
安信证券	139,444,632.57	4.17	-	-	-	-
天风证券	67,616,269.34	2.02	-	-	-	-
海通证券	117,177,030.98	3.50	-	-	-	-
中金公司	19,755,288.00	0.59	-	-	-	-
国泰君安证券	109,162,393.19	3.26	-	-	-	-
瑞银证券	31,600,023.46	0.94	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-

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	交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金 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双息平衡混合型证券投资基金 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双息平衡混合型证券投资基金 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
5	交银施罗德基金管理有限公司关于增加博时财富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 6 月 21 日
6	交银施罗德基金管理有限公司关于直销平台基金投资顾问业务中交易本公司旗下基金免收相关费用的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2023 年 7 月 7 日
7	交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金基金合同	中国证监会规定媒体及公司网站	2023 年 7 月 8 日
8	交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金托管协议	中国证监会规定媒体及公司网站	2023 年 7 月 8 日
9	交银施罗德基金管理有限公司关于调整旗下部分基金管理费率和或托管费率并修改基金合同等法律文件的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2023 年 7 月 8 日
10	交银施罗德基金管理有限公司关于直销平台基金投资顾问业务中交易本公司旗下基金免收相关费用的提示性公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2023 年 7 月 8 日
11	交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金(更新)招募说明书(2023 年第 1 号)	中国证监会规定媒体及公司网站	2023 年 7 月 11 日
12	交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金基金产品资料概要更新(2023 年第 1 号)	中国证监会规定媒体及公司网站	2023 年 7 月 11 日
13	交银施罗德定期支付双息平衡混合	中国证监会规定媒体及	2023 年 7 月 20 日

	型证券投资基金 2023 年第 2 季度报告	公司网站	
14	交银施罗德基金管理有限公司关于增加南京证券股份有限公司为旗下基金的销售机构的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2023 年 8 月 14 日
15	交银施罗德基金管理有限公司关于终止凤凰金信（海口）基金销售有限公司办理相关销售业务的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2023 年 8 月 30 日
16	交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金 2023 年中期报告	中国证监会规定媒体及公司网站	2023 年 8 月 30 日
17	交银施罗德基金管理有限公司关于增加深圳前海微众银行股份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 9 月 8 日
18	交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金基金产品资料概要更新(2023 年第 2 号)	中国证监会规定媒体及公司网站	2023 年 10 月 13 日
19	交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金(更新)招募说明书(2023 年第 2 号)	中国证监会规定媒体及公司网站	2023 年 10 月 13 日
20	交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金 2023 年第 3 季度报告	中国证监会规定媒体及公司网站	2023 年 10 月 24 日
21	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德资产管理（香港）有限公司解散的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2023 年 12 月 29 日
22	交银施罗德基金管理有限公司关于增加东吴证券股份有限公司为旗下基金的销售机构的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2023 年 12 月 29 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

无。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

为更好地满足广大投资者的投资需求，降低投资者的投资成本，经与基金托管人协商一致，本基金管理人于 2023 年 7 月 10 日起调整部分基金的管理费率和/或托管费率，并对基金合同和其他法律文件作相应修改，欲知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定期支付双息平衡混合型证券投资基金募集的文件；

2、《交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金基金合同》；

3、《交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金招募说明书》；

4、《交银施罗德定期支付双息平衡混合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双息平衡混合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双息平衡混合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。