

# 交银施罗德精选混合型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2024 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 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 2024 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	5
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	6
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>7</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
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	10
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	11
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>11</b>
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	16
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>37</b>
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
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	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	42
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	43
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	43
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	43

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 .....	43
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	43
7.12 投资组合报告附注 .....	43
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>44</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	44
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	44
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 .....	45
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>45</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>45</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	45
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 .....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	45
10.4 基金投资策略的改变 .....	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	45
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 .....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	46
10.8 其他重大事件 .....	48
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>49</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 .....	49
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	49
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>49</b>
12.1 备查文件目录 .....	49
12.2 存放地点 .....	49
12.3 查阅方式 .....	49

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	交银施罗德精选混合型证券投资基金
基金简称	交银精选混合
基金主代码	519688
前端交易代码	519688
后端交易代码	519689
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005 年 9 月 29 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	7,008,347,689.57 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将坚持并不断深化价值投资的基本理念，充分发挥专业研究与管理能力，自上而下配置资产，自下而上精选证券，有效控制风险，分享中国经济与资本市场高速成长的成果，谋求实现基金财产的长期稳定增长。
投资策略	自上而下配置资产，自下而上精选证券，有效控制下行风险。
业绩比较基准	75%×沪深 300 指数+25%×中证综合债券指数
风险收益特征	本基金是一只混合型基金，其风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。属于承担较高风险、预期收益较高的证券投资基金品种。

### 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
	联系电话	(021) 61055050
	电子邮箱	xxpl@jysld.com, disclosure@jysld.com
客户服务电话	400-700-5000, 021-61055000	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	谢卫（代任）	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》
登载基金中期报告正文的互联网网	www.fund001.com

址	
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(2024年1月1日-2024年6月30日)
本期已实现收益	-425,493,906.82
本期利润	-298,866,963.71
加权平均基金份额本期利润	-0.0423
本期加权平均净值利润率	-5.63%
本期基金份额净值增长率	-5.26%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)
期末可供分配利润	1,518,716,260.25
期末可供分配基金份额利润	0.2167
期末基金资产净值	5,189,159,714.23
期末基金份额净值	0.7404
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)
基金份额累计净值增长率	890.14%

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
过去一个月	-1.86%	0.60%	-2.27%	0.36%	0.41%	0.24%
过去三个月	-3.19%	0.86%	-1.15%	0.56%	-2.04%	0.30%
过去六个月	-5.26%	1.07%	1.72%	0.67%	-6.98%	0.40%
过去一年	-14.96%	0.97%	-6.01%	0.65%	-8.95%	0.32%

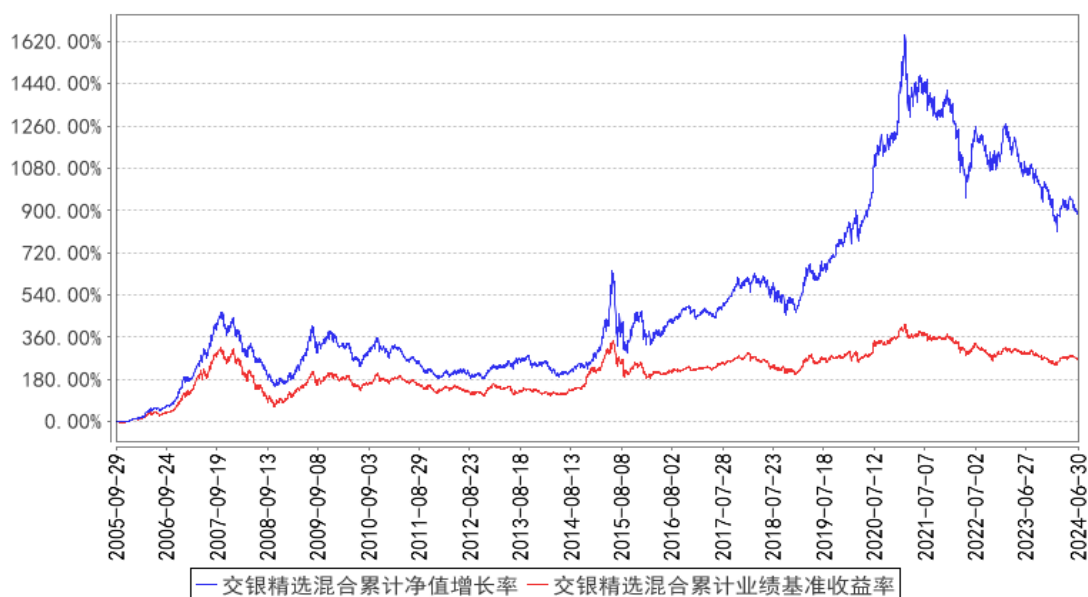
过去三年	-35.91%	1.12%	-23.22%	0.78%	- 12.69%	0.34%
自基金合同生效起至今	890.14%	1.46%	266.36%	1.21%	623.78 %	0.25%

注：1、本基金业绩比较基准自 2015 年 10 月 1 日起，由“75%×沪深 300 指数+25%×中信全债指数”变更为“75%×沪深 300 指数+25%×中证综合债券指数”，3.2.2 同。详情见本基金管理人于 2015 年 9 月 28 日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金业绩比较基准变更并修改基金合同相关内容的公告》。

2、本基金业绩比较基准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

交银精选混合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 130 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		
王崇	交银精选混合、交银新成长混合、交银瑞丰混合（LOF）的基金经理，权益部一级专家、公司权益投资副总监	2017 年 6 月 3 日	-	16 年	王崇先生，北京大学金融学博士。2008 年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任行业分析师、高级研究员。
张雪蓉	交银精选混合的基金经理	2023 年 1 月 7 日	-	9 年	张雪蓉女士，上海交通大学金融学硕士、复旦大学金融学学士。历任中金公司研究部研究员、华泰证券研究部研究员。2020 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、2024 年 8 月 3 日本基金管理人发布公告，王崇先生将不再担任本基金基金经理，本基金由张雪蓉女士单独管理。除此之外基金经理（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 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

2024 年上半年，市场表现较好的主要集中在：（1）特高压/AI 算力/变压器出海等高景气赛道；（2）海上风电/苹果产业链等有积极产业变化的方向；（3）银行/煤炭石油/家电等高股息资产；（4）电力水务等运营资产，表现不佳的行业主要集中在内需相关度较高的消费/地产/传媒/计算机/医药等方向。

本基金在上半年保持较高的仓位，并进行了一定程度的调仓。主要增持：（1）海缆配置，因看好国内海上风电加速推进，全球海风建设长期高景气持续，以及海缆稳定的竞争格局；（2）苹果产业链配置，因看好苹果加大 AI 投入以及未来几年潜在的端侧换机需求激发；（3）电力配置，因看好部分公司由于装机增长带来的高确定性增长以及分母端向下带来的估值提升。

#### 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

未来，本基金将会延续以下三个思路选择优秀标的配置：

（1）在独立产业趋势方向寻找优质标的：优选景气度可能边际上修、格局比较稳定、业绩兑现度高的，关注 AI/电网/海缆等方向；

（2）DCF 角度可能被低估的资产，需求稳定，格局优异，目前或者未来能提供稳定现金流来分红，关注白电/电力/白酒等；

（3）出海角度具备全球竞争力，在全球产能/渠道布局/品牌建设/客户合作等方面先发优势明显，有望持续受益于全球经济扩张及市占率提升的个股。

本基金会在未来不断拓展能力圈，优化投资框架，努力为持有人创造更好的收益率。

#### 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

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 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中期报告中的财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：交银施罗德精选混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	448,907,590.52	297,389,054.20
结算备付金		9,407,656.67	14,491,041.15
存出保证金		1,461,717.61	2,049,558.13
交易性金融资产	6.4.7.2	4,745,186,415.60	5,236,766,675.63
其中：股票投资		4,464,186,391.79	4,933,219,389.81
基金投资		-	-

债券投资		281,000,023.81	303,547,285.82
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	8,540,109.31
应收股利		-	-
应收申购款		567,850.64	1,059,325.68
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		5,205,531,231.04	5,560,295,764.10
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年6月30日</b>	<b>上年度末 2023年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	8,626,339.79
应付赎回款		3,571,274.01	5,662,049.04
应付管理人报酬		5,180,215.90	5,669,855.99
应付托管费		863,369.32	944,976.01
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,138.99	0.04
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	6,755,518.59	7,645,986.61
负债合计		16,371,516.81	28,549,207.48
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	3,107,013,045.03	3,138,180,448.70
未分配利润	6.4.7.12	2,082,146,669.20	2,393,566,107.92
净资产合计		5,189,159,714.23	5,531,746,556.62
负债和净资产总计		5,205,531,231.04	5,560,295,764.10

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.7404 元，基金份额总额 7,008,347,689.57 份。

## 6.2 利润表

会计主体：交银施罗德精选混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-261,780,946.99	-383,281,574.48
1. 利息收入		1,943,090.74	1,806,158.50
其中：存款利息收入	6.4.7.13	1,430,109.05	1,694,173.68
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		512,981.69	111,984.82
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-390,481,593.24	-105,497,525.93
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-444,692,999.35	-164,786,303.17
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	2,468,311.20	3,004,291.02
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	51,743,094.91	56,284,486.22
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	126,626,943.11	-279,788,287.78
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	130,612.40	198,080.73
<b>减：二、营业总支出</b>		37,086,016.72	61,497,217.88
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	31,672,303.10	52,586,281.61
2. 托管费	6.4.10.2.2	5,278,717.14	8,764,380.27
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
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	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		1,846.81	403.15
8. 其他费用	6.4.7.23	133,149.67	146,152.85
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-298,866,963.71	-444,778,792.36
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-298,866,963.71	-444,778,792.36
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-298,866,963.71	-444,778,792.36

### 6.3 净资产变动表

会计主体：交银施罗德精选混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	3,138,180,448.70	-	2,393,566,107.92	5,531,746,556.62
二、本期期初净资产	3,138,180,448.70	-	2,393,566,107.92	5,531,746,556.62
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-31,167,403.67	-	311,419,438.72	-342,586,842.39
（一）、综合收益总额	-	-	298,866,963.71	-298,866,963.71
（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）	-31,167,403.67	-	-12,552,475.01	-43,719,878.68
其中：1. 基金申购款	210,382,304.55	-	153,248,839.03	363,631,143.58
2. 基金赎回款	-	-	-	-407,351,022.26
	241,549,708.22		165,801,314.04	

(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	3,107,013,045.03	-	2,082,146,669.20	5,189,159,714.23
项目	上年度可比期间 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	3,312,879,077.49	-	3,630,653,830.37	6,943,532,907.86
二、本期期初净资产	3,312,879,077.49	-	3,630,653,830.37	6,943,532,907.86
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-32,192,889.73	-	468,907,155.91	-501,100,045.64
(一)、综合收益总额	-	-	444,778,792.36	-444,778,792.36
(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)	-32,192,889.73	-	-24,128,363.55	-56,321,253.28
其中：1. 基金申购款	224,956,713.26	-	265,735,429.90	490,692,143.16
2. 基金赎回款	-	-	-	-547,013,396.44
	257,149,602.99		289,863,793.45	
(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	3,280,686,187.76	-	3,161,746,674.46	6,442,432,862.22

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

交银施罗德精选混合型证券投资基金(原交银施罗德精选股票证券投资基金,以下简称“本基金”)系由基金管理人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》、《交银施罗德精选股票证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)以证监基金字[2005]140号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集基金份额 4,874,882,643.01份,经德勤华永会计师事务所有限公司验证,并出具了编号为德师报(验)字(05)第 0038 号验资报告。《交银施罗德精选股票证券投资基金基金合同》(以下简称“原基金合同”)于 2005 年 9 月 29 日正式生效。本基金的管理人为交银施罗德基金管理有限公司,托管人为中国农业银行股份有限公司(以下简称“中国农业银行”)。

根据 2007 年 1 月 23 日《交银施罗德基金管理有限公司关于对交银施罗德精选股票证券投资基金实施基金份额拆分和限量销售的公告》,根据拆分前基金份额净值和公告的基金份额拆分比例计算公式,基金份额拆分比例为 1:2.255776094(保留到小数点后 9 位),拆分后的基金份额净值为 1.0000 元。本基金注册登记机构于 2007 年 1 月 29 日对基金份额持有人经重新计算的基金份额进行了变更登记。

2015 年 8 月,本基金更名为交银施罗德精选混合型证券投资基金,公告了《交银施罗德精选混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“修改后的基金合同”)。根据《中华人民共和国证券投资基金法》、修改后的基金合同和定期更新的本基金招募说明书的有关规定,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、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、存托凭证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。基金的投资组合为:股票资产占基金资产的 60%-95%,债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 5%-40%,其中,基金保留的现金以及投资于一年期以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。

本基金的业绩比较基准自 2015 年 10 月 1 日起,由“75%×沪深 300 指数+25%×中信全债指数”变更为“75%×沪深 300 指数+25%×中证综合债券指数”。



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 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》、《交银施罗德精选混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2024 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 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及 2024 年上半年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[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、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》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、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]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》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税；2018年1月1日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

(2) 对证券投资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，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不计缴企业所得税。

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司代扣代缴个人所得税；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 对于基金从事A股买卖，出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税；自2023年8月28日起，出让方减按0.05%的税率缴纳证券(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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
活期存款	448,907,590.52
等于：本金	448,828,620.08
加：应计利息	78,970.44
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	448,907,590.52

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	4,563,695,530.45	-	4,464,186,391.79	- 99,509,138.66
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	4,900.00	6.74	5,069.16 162.42
	银行间市场	279,626,561.50	1,244,954.65	280,994,954.65 123,438.50
	合计	279,631,461.50	1,244,961.39	281,000,023.81 123,600.92
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	4,843,326,991.95	1,244,961.39	4,745,186,415.60	- 99,385,537.74

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,166.94
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	6,642,111.63
其中：交易所市场	6,640,536.63
银行间市场	1,575.00
应付利息	-
预提审计费	42,267.68
预提信息披露费	59,672.34
预提账户维护费	9,300.00
合计	6,755,518.59

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	7,078,665,860.92	3,138,180,448.70
本期申购	474,539,097.82	210,382,304.55
本期赎回（以“-”号填列）	-544,857,269.17	-241,549,708.22
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	7,008,347,689.57	3,107,013,045.03

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,963,538,849.37	430,027,258.55	2,393,566,107.92
本期期初	1,963,538,849.37	430,027,258.55	2,393,566,107.92
本期利润	-425,493,906.82	126,626,943.11	-298,866,963.71
本期基金份额交易产生的变动数	-19,328,682.30	6,776,207.29	-12,552,475.01
其中：基金申购款	108,033,303.08	45,215,535.95	153,248,839.03
基金赎回款	-127,361,985.38	-38,439,328.66	-165,801,314.04
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,518,716,260.25	563,430,408.95	2,082,146,669.20

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	活期存款利息收入	1,294,099.43
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	124,541.72	
其他	11,467.90	
合计	1,430,109.05	

### 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 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-444,692,999.35
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	-444,692,999.35

#### 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 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	8,586,555,316.33
减：卖出股票成本总额	9,013,352,644.29
减：交易费用	17,895,671.39
买卖股票差价收入	-444,692,999.35

#### 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 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	2,730,803.59
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-262,492.39
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	2,468,311.20

#### 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 2024年1月1日至2024年6月30日
----	----------------------------

卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	270,380,616.15
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	265,340,354.02
减：应计利息总额	5,300,772.85
减：交易费用	1,981.67
买卖债券差价收入	-262,492.39

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 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	51,743,094.91
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	51,743,094.91

**6.4.7.20 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	126,626,943.11
股票投资	126,272,100.46
债券投资	354,842.65
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	126,626,943.11

**6.4.7.21 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	130,612.40
合计	130,612.40

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。

**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
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	42,267.68
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	12,609.65
债券账户费用	18,600.00
合计	133,149.67

### 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。

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 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	31,672,303.10	52,586,281.61
其中：应支付销售机构的客户维 护费	9,940,301.21	15,283,405.03
应支付基金管理人的净管理费	21,732,001.89	37,302,876.58

注：自 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 07 月 09 日，支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5%÷当年天数。

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 07 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 1.2% 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：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.2%÷当年天数。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	5,278,717.14	8,764,380.27

注：自 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 07 月 09 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。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

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及/或托管费率并修改基金合同等法律文件的公告》，自 2023 年 07 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 0.2% 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。

#### 6.4.10.3 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自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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例(%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例(%)
交银施罗德 资产管理有 限公司	21,788,865.89	0.31	21,788,865.89	0.31

注：关联方投资本基金的费率按照基金合同和招募说明书规定的确定，符合公允性要求。

#### 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 2024年1月1日至2024年6月 30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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
中国农业银行_活期存款	448,907,590.52	1,294,099.43	443,087,635.51	1,573,724.51

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（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

## 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001359	平安电工	2024年3月19日	6个月以上	限售股	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
001379	腾达科技	2024年1月11日	6个月以上	限售股	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	-
001387	雪祺电气	2024年1月4日	6个月以上	限售股	15.38	15.25	133	2,045.54	2,028.25	-
001387	雪祺电气	2024年6月3日	1-6个月（含）	限售股送股	-	15.25	40	-	610.00	-
001389	广合科技	2024年3月26日	6个月以上	限售股	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
301392	汇成真空	2024年5月28日	6个月以上	限售股	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301502	华阳智	2024年1月26日	6个月以上	限售股	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-

	能	日									
301536	星辰科技	2024年3月20日	6个月以上	限售股	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-	
301538	骏鼎达	2024年3月13日	6个月以上	限售股	55.82	91.24	107	5,972.74	9,762.68	-	
301538	骏鼎达	2024年5月22日	1-6个月(含)	限售股送股	-	91.24	43	-	3,923.32	-	
301539	宏鑫科技	2024年4月3日	6个月以上	限售股	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-	
301565	中仑新材	2024年6月13日	6个月以上	限售股	11.88	18.98	711	8,446.68	13,494.78	-	
301566	达利凯普	2023年12月22日	6个月以上	限售股	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-	
301580	爱迪特	2024年6月19日	6个月以上	限售股	44.95	65.93	202	9,079.90	13,317.86	-	
301587	中瑞股份	2024年3月27日	6个月以上	限售股	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-	
301588	美新科技	2024年3月6日	6个月以上	限售股	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-	
301589	诺瓦星云	2024年2月1日	6个月以上	限售股	126.89	188.01	691	87,680.99	129,914.91	-	
301589	诺瓦星	2024年5月30日	1-6个月(含)	限售股送股	-	188.01	553	-	103,969.53	-	

	云	日								
301591	肯特股份	2024年2月20日	6个月以上	限售股	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-
601033	永兴股份	2024年1月11日	6个月以上	限售股	16.20	15.96	1,258	20,379.60	20,077.68	-
603082	北自科技	2024年1月23日	6个月以上	限售股	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	6个月以上	限售股	18.65	18.65	129	2,405.85	2,405.85	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	1个月内(含)	新股未上市	18.65	18.65	1,158	21,596.70	21,596.70	-
603312	西典新能	2024年1月4日	6个月以上	限售股	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	-
603325	博隆技术	2024年1月3日	6个月以上	限售股	72.46	68.06	66	4,782.36	4,491.96	-
603341	龙旗科技	2024年2月23日	6个月以上	限售股	26.00	37.49	298	7,748.00	11,172.02	-
603344	星德胜	2024年3月13日	6个月以上	限售股	19.18	22.66	182	3,490.76	4,124.12	-
603350	安乃达	2024年6月26日	1个月内(含)	新股未上市	20.56	20.56	945	19,429.20	19,429.20	-
603350	安乃达	2024年6月26日	6个月以上	限售股	20.56	20.56	106	2,179.36	2,179.36	-

		日								
603375	盛景微	2024年1月17日	6个月以上	限售股	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-
603381	永臻股份	2024年6月19日	6个月以上	限售股	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	-
688691	灿芯股份	2024年4月2日	6个月以上	限售股	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
688692	达梦数据	2024年6月4日	6个月以上	限售股	86.96	174.93	175	15,218.00	30,612.75	-
688695	中创股份	2024年3月6日	6个月以上	限售股	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688709	成都华微	2024年1月31日	6个月以上	限售股	15.69	18.79	1,045	16,396.05	19,635.55	-

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

2、上表所披露的受限期指自该证券实际取得之日起至可流通日之间的受限期限。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，本基金的运作涉及的金融工具主要包括股票投资、债券投资、权证投资等。与这些金融工具有关的风险，以及本基金管理人管理此类风险所采取的风险管理政策如下所述。

本基金管理人从事风险管理的目标是使本基金在风险和收益之间取得适当的平衡，将风险对本基金经营业绩的负面影响降低到最低水平，使基金持有人的利益最大化。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人风险管理的基本策略是识别和分析本基金运作时本基金面临的各种类型的风险，确定适当的风险容忍度，并及时可靠地对各种风险进行监督，将风险控制在限定的范围之内。

本基金目前面临的主要风险包括：信用风险、流动性风险和市场风险。与本基金相关的市场风险主要包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

本基金的基金管理人建立了以全面、独立、相互制约以及定性和定量相结合为原则的，由董事会最终负责、业务部门进行风险评估和监控、风险管理部监察执行的，同时督察长行使独立监察权力的风险管理组织架构体系。

### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指金融工具的一方到期无法履行约定义务致使本基金遭受损失的风险。本基金的信用风险主要存在于银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资、买入返售金融资产、应收利息及其他。

本基金的银行存款存放于本基金的基金托管行-中国农业银行。本基金认为与中国农业银行相关的信用风险不重大。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

对于与债券投资等投资品种相关的信用风险，本基金管理人通过对投资品种的信用等级评估来选择适当的投资对象，并限制单个投资品种的持有比例来管理信用风险。

#### 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

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

流动性风险指因市场交易相对不活跃导致基金投资资产无法以适当价格及时变现，进而无法应对债务到期偿付或投资者赎回款按时支付的风险。

本基金坚持组合管理、分散投资的原则开展投资活动，所持证券均在证券交易所或银行间同业市场交易，并严格遵守基金管理人流动性相关交易限制；本期末本基金未持有具有重大流动性风险的投资品种。同时，本基金在需要时可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金，以缓解流动性风险。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人在基金合同中约定了巨额赎回条款，设计了非常情况下赎回资金的处理模式，控制因开放模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金的基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

截止本报告期末及上年度末，本基金无重大流动性风险。

### 6.4.13.4 市场风险

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的利率敏感性资产主要是银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资。基于本基金产品性质，生息资产占基金资产绝对比重较小，因此本基金并不存在重大的利率风险。本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，通过对短期利率水平的预测、收益率曲线分析、利率重定价日组合及类别品种配置、调整投资组合的久期、凸性等方法对上述利率风险进行管理。

## 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	448,907,590.52	-	-	-	448,907,590.52
结算备付金	9,407,656.67	-	-	-	9,407,656.67
存出保证金	1,461,717.61	-	-	-	1,461,717.61
交易性金融资产	280,994,954.65	1,689.14	3,380.02	4,464,186,391.79	4,745,186,415.60
应收申购款	3,093.60	-	-	564,757.04	567,850.64
资产总计	740,775,013.05	1,689.14	3,380.02	4,464,751,148.83	5,205,531,231.04
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,571,274.01	3,571,274.01
应付管理人报酬	-	-	-	5,180,215.90	5,180,215.90
应付托管费	-	-	-	863,369.32	863,369.32
应交税费	-	-	-	1,138.99	1,138.99
其他负债	-	-	-	6,755,518.59	6,755,518.59
负债总计	-	-	-	16,371,516.81	16,371,516.81
利率敏感度缺口	740,775,013.05	1,689.14	3,380.02	4,448,379,632.02	5,189,159,714.23
上年度末 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	297,389,054.20	-	-	-	297,389,054.20
结算备付金	14,491,041.15	-	-	-	14,491,041.15
存出保证金	2,049,558.13	-	-	-	2,049,558.13
交易性金融资产	303,543,234.97	2,150.77	1,900.08	4,933,219,389.81	5,236,766,675.63
应收申购款	17,295.22	-	-	1,042,030.46	1,059,325.68
应收清算款	-	-	-	8,540,109.31	8,540,109.31
资产总计	617,490,183.67	2,150.77	1,900.08	4,942,801,529.58	5,560,295,764.10
负债					
应付赎回款	-	-	-	5,662,049.04	5,662,049.04
应付管理人报酬	-	-	-	5,669,855.99	5,669,855.99
应付托管费	-	-	-	944,976.01	944,976.01
应付清算款	-	-	-	8,626,339.79	8,626,339.79
应交税费	-	-	-	0.04	0.04
其他负债	-	-	-	7,645,986.61	7,645,986.61
负债总计	-	-	-	28,549,207.48	28,549,207.48
利率敏感度缺口	617,490,183.67	2,150.77	1,900.08	4,914,252,322.10	5,531,746,556.62

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

于 2024 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为

5.42%(2023 年 12 月 31 日: 5.49%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2023 年 12 月 31 日: 同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金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

其他价格风险是指金融工具的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。该风险可能与特定投资品种相关，也有可能与整体投资品种相关。本基金的金融资产以公允价值计量，所有其他价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。

本基金在购建资产配置和基金资产投资组合的基础上，通过建立事前和事后跟踪误差的方式，对基金资产的市场价格风险进行管理。

本基金投资组合中股票资产占基金资产的 60%-95%，债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 5%-40%，其中，基金保留的现金以及投资于一年期以内的政府债券的比例合计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。于资产负债表日，本基金面临的其他价格风险列示如下：

##### 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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	4,464,186,391.79	86.03	4,933,219,389.81	89.18
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	5,069.16	0.00	4,050.85	0.00
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	4,464,191,460.95	86.03	4,933,223,440.66	89.18

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

假设	1. 除本基金业绩比较标准外的其他市场变量保持不变。		
	2. 观察有效期设定为一年期间。		
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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	1. 业绩比较基准上升5%	337,999,970.41	337,440,206.10
2. 业绩比较基准下降5%	-337,999,970.41	-337,440,206.10	

## 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。

## 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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	4,463,666,200.91	4,932,134,521.05
第二层次	281,050,340.48	303,604,395.37
第三层次	469,874.21	1,027,759.21
合计	4,745,186,415.60	5,236,766,675.63

## 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。

## 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	4,464,186,391.79	85.76
	其中：股票	4,464,186,391.79	85.76
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	281,000,023.81	5.40
	其中：债券	281,000,023.81	5.40
	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	458,315,247.19	8.80
8	其他各项资产	2,029,568.25	0.04
9	合计	5,205,531,231.04	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,555,138,880.99	68.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	243,675,952.00	4.70
E	建筑业	129,924,372.52	2.50

F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	12,604.38	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	258,074,892.17	4.97
J	金融业	129,836,614.80	2.50
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	56,665,843.12	1.09
M	科学研究和技术服务业	18,973.79	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	20,077.68	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	90,817,971.56	1.75
R	文化、体育和娱乐业	208.78	0.00
S	综合	-	-
	合计	4,464,186,391.79	86.03

### 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	600809	山西汾酒	1,392,440	293,637,747.20	5.66
2	000333	美的集团	4,501,655	290,356,747.50	5.60
3	600522	中天科技	18,224,186	288,853,348.10	5.57
4	000596	古井贡酒	1,354,434	285,880,384.38	5.51
5	600487	亨通光电	16,836,430	265,510,501.10	5.12
6	300760	迈瑞医疗	788,808	229,472,135.28	4.42
7	002517	恺英网络	21,622,501	206,494,884.55	3.98
8	600795	国电电力	25,698,800	153,935,812.00	2.97
9	002475	立讯精密	3,833,878	150,709,744.18	2.90
10	600690	海尔智家	5,267,805	149,500,305.90	2.88
11	002353	杰瑞股份	4,211,700	147,746,436.00	2.85
12	002384	东山精密	6,634,053	137,324,897.10	2.65
13	000651	格力电器	3,499,281	137,241,800.82	2.64
14	603816	顾家家居	4,048,520	130,726,710.80	2.52
15	601117	中国化学	15,766,650	129,917,196.00	2.50
16	000338	潍柴动力	7,635,420	123,999,220.80	2.39
17	000400	许继电气	3,111,000	107,049,510.00	2.06
18	300750	宁德时代	534,800	96,280,044.00	1.86
19	603882	金域医学	3,340,124	90,817,971.56	1.75

20	601398	工商银行	13,934,400	79,426,080.00	1.53
21	002594	比亚迪	312,149	78,115,287.25	1.51
22	002463	沪电股份	1,977,998	72,196,927.00	1.39
23	603338	浙江鼎力	1,152,800	69,652,176.00	1.34
24	600031	三一重工	4,211,700	69,493,050.00	1.34
25	688036	传音控股	870,468	66,625,620.72	1.28
26	002984	森麒麟	2,728,793	65,736,623.37	1.27
27	300308	中际旭创	435,089	59,990,071.32	1.16
28	000543	皖能电力	6,458,400	57,156,840.00	1.10
29	002027	分众传媒	9,350,400	56,663,424.00	1.09
30	600941	中国移动	476,100	51,180,750.00	0.99
31	601336	新华保险	1,678,660	50,410,159.80	0.97
32	603198	迎驾贡酒	856,293	49,236,847.50	0.95
33	002311	海大集团	1,002,200	47,153,510.00	0.91
34	600309	万华化学	552,900	44,707,494.00	0.86
35	002850	科达利	465,498	35,554,737.24	0.69
36	600027	华电国际	4,695,000	32,583,300.00	0.63
37	300502	新易盛	173,500	18,312,925.00	0.35
38	601100	恒立液压	333,415	15,530,470.70	0.30
39	600312	平高电气	715,000	13,906,750.00	0.27
40	300360	炬华科技	815,000	13,855,000.00	0.27
41	688692	达梦数据	1,745	382,889.35	0.01
42	301589	诺瓦星云	1,244	233,884.44	0.00
43	603381	永臻股份	1,778	49,273.14	0.00
44	301526	国际复材	9,723	32,377.59	0.00
45	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
46	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
47	601033	永兴股份	1,258	20,077.68	0.00
48	688709	成都华微	1,045	19,635.55	0.00
49	688652	京仪装备	416	16,261.44	0.00
50	601096	宏盛华源	3,918	16,024.62	0.00
51	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.00
52	301508	中机认检	419	15,486.24	0.00
53	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
54	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
55	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
56	601083	锦江航运	1,263	12,074.28	0.00
57	301516	中远通	604	11,252.52	0.00
58	603341	龙旗科技	298	11,172.02	0.00
59	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
60	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
61	300395	菲利华	300	9,225.00	0.00
62	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00

63	301489	思泉新材	128	9,034.24	0.00
64	301413	安培龙	214	8,848.90	0.00
65	688653	康希通信	648	8,346.24	0.00
66	301459	丰茂股份	208	8,259.68	0.00
67	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
68	001296	长江材料	564	8,037.00	0.00
69	301196	唯科科技	271	8,002.63	0.00
70	002304	洋河股份	98	7,912.52	0.00
71	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
72	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
73	301193	家联科技	475	7,581.00	0.00
74	603176	汇通集团	1,924	7,176.52	0.00
75	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
76	603216	梦天家居	772	7,086.96	0.00
77	001219	青岛食品	598	7,038.46	0.00
78	301083	百胜智能	416	6,751.68	0.00
79	603048	浙江黎明	464	6,737.28	0.00
80	688720	艾森股份	165	6,689.10	0.00
81	688648	中邮科技	303	6,617.52	0.00
82	301555	惠柏新材	224	6,345.92	0.00
83	603150	万朗磁塑	251	6,285.04	0.00
84	301578	辰奕智能	154	6,093.78	0.00
85	603213	镇洋发展	799	5,976.52	0.00
86	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
87	001234	泰慕士	333	5,657.67	0.00
88	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
89	301111	粤万年青	379	5,287.05	0.00
90	605033	美邦股份	423	5,253.66	0.00
91	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
92	001378	德冠新材	205	4,891.30	0.00
93	002493	荣盛石化	500	4,830.00	0.00
94	301118	恒光股份	315	4,696.65	0.00
95	301021	英诺激光	290	4,547.20	0.00
96	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
97	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
98	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
99	001326	联域股份	99	3,550.14	0.00
100	301228	实朴检测	373	3,487.55	0.00
101	001306	夏厦精密	64	3,455.36	0.00
102	603004	鼎龙科技	195	3,305.25	0.00
103	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
104	603273	天元智能	178	3,266.30	0.00
105	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00



106	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
107	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
108	603231	索宝蛋白	161	2,743.44	0.00
109	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00
110	001239	永达股份	189	2,623.32	0.00
111	001358	兴欣新材	122	2,503.44	0.00
112	603373	安邦护卫	88	2,419.12	0.00
113	600779	水井坊	53	1,994.39	0.00
114	002832	比音勒芬	64	1,546.88	0.00
115	600458	时代新材	95	959.50	0.00
116	300115	长盈精密	80	959.20	0.00
117	600029	南方航空	90	530.10	0.00
118	002966	苏州银行	50	375.00	0.00
119	300144	宋城演艺	26	208.78	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	000333	美的集团	332,764,355.23	6.02
2	000596	古井贡酒	297,390,512.98	5.38
3	002475	立讯精密	258,235,434.47	4.67
4	600487	亨通光电	251,512,515.56	4.55
5	002517	恺英网络	217,852,735.30	3.94
6	600795	国电电力	190,452,069.00	3.44
7	002594	比亚迪	183,310,264.69	3.31
8	002984	森麒麟	171,055,975.63	3.09
9	601899	紫金矿业	165,396,416.80	2.99
10	002920	德赛西威	160,091,779.38	2.89
11	600690	海尔智家	153,642,724.50	2.78
12	000651	格力电器	151,171,564.96	2.73
13	000338	潍柴动力	143,137,534.00	2.59
14	600809	山西汾酒	141,005,655.65	2.55
15	603338	浙江鼎力	138,785,890.43	2.51
16	002850	科达利	137,168,683.07	2.48
17	300750	宁德时代	136,841,214.84	2.47
18	600522	中天科技	132,721,129.47	2.40
19	603198	迎驾贡酒	126,782,558.30	2.29
20	601117	中国化学	124,016,926.50	2.24
21	002384	东山精密	119,716,051.84	2.16
22	601208	东材科技	119,049,501.18	2.15

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	000568	泸州老窖	396,349,004.27	7.16
2	002475	立讯精密	359,512,812.38	6.50
3	600519	贵州茅台	334,700,186.60	6.05
4	603259	药明康德	265,897,381.66	4.81
5	002714	牧原股份	251,766,039.68	4.55
6	600276	恒瑞医药	245,884,233.07	4.44
7	002422	科伦药业	224,195,708.28	4.05
8	603501	韦尔股份	211,840,136.38	3.83
9	002920	德赛西威	191,041,252.34	3.45
10	600079	人福医药	185,759,392.22	3.36
11	601899	紫金矿业	178,142,705.00	3.22
12	601233	XD 桐昆股	156,895,488.73	2.84
13	601126	四方股份	138,323,022.58	2.50
14	002463	沪电股份	126,577,716.32	2.29
15	600809	山西汾酒	114,482,309.00	2.07
16	601208	东材科技	112,588,195.88	2.04
17	300750	宁德时代	112,360,421.00	2.03
18	002517	恺英网络	106,049,652.00	1.92
19	002594	比亚迪	105,980,598.73	1.92
20	300760	迈瑞医疗	105,699,660.22	1.91

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	8,418,047,545.81
卖出股票收入（成交）总额	8,586,555,316.33

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	69,886,546.15	1.35
2	央行票据	-	-
3	金融债券	211,108,408.50	4.07

	其中：政策性金融债	211,108,408.50	4.07
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）	5,069.16	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	281,000,023.81	5.42

## 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	240304	24 进出 04	1,000,000	100,268,767.12	1.93
2	240411	24 农发 11	700,000	70,176,745.21	1.35
3	249927	24 贴现国债 27	700,000	69,886,546.15	1.35
4	230306	23 进出 06	400,000	40,662,896.17	0.78
5	123236	家联转债	19	2,247.01	0.00

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

无。

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

无。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

## 7.12 投资组合报告附注

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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体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。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,461,717.61
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	567,850.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,029,568.25

### 7.12.4 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	123236	家联转债	2,247.01	0.00
2	113665	汇通转债	1,689.14	0.00

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 (%)
321,157	21,822.19	584,871,783.43	8.35	6,423,475,906.14	91.65

### 8.2 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	2,689,876.39	0.04
------------------	--------------	------

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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 部门负责人持有本开放式基金	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2005年9月29日） 基金份额总额	4,874,882,643.01
本报告期期初基金份额总额	7,078,665,860.92
本报告期基金总申购份额	474,539,097.82
减：本报告期基金总赎回份额	544,857,269.17
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	7,008,347,689.57

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德勤华永会计师事务所（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 (%)	
兴业证券	1	3,405,221,817.07	20.03	2,505,903.19	20.03	-
国海证券	1	3,252,840,494.94	19.13	2,393,772.37	19.13	-
华泰证券	1	2,722,265,182.89	16.01	2,003,319.92	16.01	-
申万宏源证券	3	2,483,358,555.19	14.61	1,827,514.81	14.61	-
国金证券	2	1,359,443,113.12	8.00	1,000,435.31	8.00	-
国信证券	1	1,138,842,553.34	6.70	838,071.38	6.70	-
中金公司	2	1,118,486,410.81	6.58	823,092.98	6.58	-
光大证券	2	619,039,233.11	3.64	455,551.21	3.64	-
中信证券	1	497,806,717.96	2.93	366,336.55	2.93	-
招商证券	1	159,390,587.56	0.94	117,290.06	0.94	-
国泰君安证券	1	155,072,063.82	0.91	114,116.03	0.91	-
华创证券	1	91,027,049.38	0.54	66,986.75	0.54	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
国投证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-

瑞银证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	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	-	-	-	-	-

## 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(%)
兴业证券	10,173,393.48	99.99	2,877,422,000.00	49.34	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	905,069,000.00	15.52	-	-
国金证券	1,000.00	0.01	1,736,099,000.00	29.77	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	313,340,000.00	5.37	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东北证	-	-	-	-	-	-

券						
国投证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
瑞银证 券	-	-	-	-	-	-
天风证 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。

### 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	交银施罗德精选混合型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒体及公司网站	2024 年 1 月 20 日
2	交银施罗德精选混合型证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会规定媒体及公司网站	2024 年 3 月 29 日
3	交银施罗德基金管理有限公司高级管理人员任职公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2024 年 3 月 30 日
4	交银施罗德精选混合型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒体及公司网站	2024 年 4 月 20 日
5	交银施罗德基金管理有限公司关于终止上海钜派钰茂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	2024 年 5 月 23 日



6	交银施罗德精选混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒体及公司网站	2024 年 6 月 27 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精选股票证券投资基金募集的文件；
- 2、《交银施罗德精选混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《交银施罗德精选混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《交银施罗德精选混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、关于募集交银施罗德精选股票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精选混合型证券投资基金在规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印件或复印件。

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。