

# 交银施罗德环球精选价值证券投资基金 2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：交银施罗德基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 08 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 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>	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§2 基金简介</b>	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 境外投资顾问和境外资产托管人	6
2.5 信息披露方式	6
2.6 其他相关资料	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§4 管理人报告</b>	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介	9
4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	9
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.9 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	11
<b>§5 托管人报告</b>	11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
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	12
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	16
<b>§7 投资组合报告</b>	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	37
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	37
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细	38
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动	45
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	51

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细 .....	51
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 .....	52
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细 .....	52
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 .....	52
7.11 投资组合报告附注.....	52
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>53</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	53
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 .....	53
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>53</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>53</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	53
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 .....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	54
10.4 基金投资策略的改变.....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	54
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 .....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	54
10.8 其他重大事件.....	57
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>59</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 .....	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	59
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>60</b>
12.1 备查文件目录.....	60
12.2 存放地点.....	60
12.3 查阅方式.....	60

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	交银施罗德环球精选价值证券投资基金
基金简称	交银环球精选混合 (QDII)
基金主代码	519696
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008 年 8 月 22 日
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	86,143,699.30 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过全球资产配置和灵活分散投资，在有效分散和控制风险的前提下，实现长期资本增值。
投资策略	自上而下配置资产，通过对全球宏观经济和各经济体的基本面分析，在不同区域间进行有效资产配置，自下而上精选证券，挖掘定价合理、具备持续竞争优势的上市公司股票进行投资，并有效控制下行风险。
业绩比较基准	70%×标准普尔全球大中盘指数 (S&P Global LargeMidCap Index)+30%×恒生指数
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。此外，本基金在全球范围内进行投资，除了需要承担国际市场的市场波动风险之外，还面临汇率风险、国别风险、新兴市场风险等海外市场投资所面临的特别投资风险。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	交银施罗德基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名 王晚婷	王小飞
	联系电话 (021) 61055050	021-60637103
	电子邮箱 xxpl@jysld.com, disclosure@jysld.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话	400-700-5000, 021-61055000	021-60637228
传真	(021) 61055054	021-60635778
注册地址	中国(上海)自由贸易试验区银城中路188号交通银行大楼二层(裙)	北京市西城区金融大街25号
办公地址	上海市浦东新区世纪大道8号国金中心二期21-22楼	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码	200120	100033
法定代表人	张宏良	张金良

## 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	Schroder Investment Management Limited	JPMorgan Chase Bank, National Association
	中文	施罗德投资管理有限公司	摩根大通银行
注册地址		英国伦敦	1111 Polaris Parkway, Columbus, OH 43240, U.S.A.
办公地址		31 Gresham Street London	383 Madison Avenue, New York, NY 10179-0001, U.S.A.
邮政编码		EC2V 7QA	10179-0001

## 2.5 信息披露方式

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

## 2.6 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(2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	10,774,722.96
本期利润	17,446,518.73
加权平均基金份额本期利润	0.1461
本期加权平均净值利润率	5.81%
本期基金份额净值增长率	8.19%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	122,967,792.48
期末可供分配基金份额利润	1.4275
期末基金资产净值	229,344,396.97
期末基金份额净值	2.662
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	338.27%

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	3.66%	0.87%	4.07%	0.61%	-0.41%	0.26%
过去三个月	7.82%	1.70%	8.83%	1.56%	-1.01%	0.14%
过去六个月	8.19%	1.36%	12.41%	1.26%	-4.22%	0.10%
过去一年	11.17%	1.12%	21.12%	1.03%	-9.95%	0.09%
过去三年	32.24%	0.93%	41.85%	0.89%	-9.61%	0.04%
自基金合同生效起至今	338.27%	0.97%	131.92%	1.05%	206.35%	-0.08%

注：本基金的业绩比较基准为  $70\% \times$  标准普尔全球大中盘指数

$(S\&P\text{ Global LargeMidCap Index}) + 30\% \times$  恒生指数，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

交银环球精选混合 (QDII) 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135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		
陈俊华	交银环球精选混合(QDII)、交银沪港深价值精选混合、交银核心资产混合、交银鸿光一年混合、交银鸿信一年持有期混合、交银鸿泰一年持有期混合的基金经理，公司跨境投资副总监	2015年11月21日	-	20年	硕士。历任国泰君安证券研究部研究员、中国国际金融有限公司研究部公用事业组负责人。2015年加入交银施罗德基金管理有限公司。
陈舒薇	交银环球精选混合(QDII)、交银鸿泰	2020年1月8日	-	16年	硕士。历任东方证券分析师、中金公司分析师、光大证券分析师、香港瑞士信贷分析师。2019年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任跨境投资部基金经理助

	一年持有期混合的基金经理				理。
--	--------------	--	--	--	----

- 注：1、本表所列基金经理（助理）任职日期和离职日期均以基金合同生效日或公司作出决定并公告（如适用）之日为准。
- 2、本表所列基金经理（助理）证券从业年限中的“证券从业”的含义遵从中国证券业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。
- 3、基金经理（或基金经理小组）期后变动（如有）敬请关注基金管理人发布的相关公告。

#### 4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

姓名	在境外投资顾问所任职务	证券从业年限	说明
Simon Webber	施罗德集团多区域（全球及国际）股票投资主管、全球和国际股票基金经理、全球气候变化股票基金经理	26 年	Simon Webber 先生，英国曼彻斯特大学物理学学士，CFA。1999 年加入施罗德投资管理有限公司，历任全球技术团队分析员。

#### 4.3 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。

#### 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.4.1 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。

#### 4.4.2 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。

### 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2025 年上半年，两个因素主导全球权益市场走向：在美国政府的关税政策下，全球风险偏好快速上升，市场巨幅调整，之后又因 90 天暂停期逐步回升；其次还是人工智能，年初受益于 DeepSeek 的面世，中国科技资产迎来一波系统性重估，相对应的，海外算力估值回落，进入二季度，在海外互联网龙头资本开支超预期的背景下，这一趋势逆转。回顾中美的经济趋势，美国完成从“补库存”向“主动去库存”过渡，资本开支周期接近尾声，整体经济韧性强于预期，但政策空间收窄；中国新旧动能转换加速，且短期受益于外需韧性和政策刺激，但地产/通缩压力制约复苏质量。市场表现方面，分板块来看，美股指数继续创新高，医药、公用、通讯表现较好；港股则是原材料、医药、科技领涨。

操作方面，本基金上半年股票仓位维持高位运行，以结构调整为主：欧美股方面，保持科技板块仓位，增加必选消费配置，相应降低可选消费、能源等板块配置；港股方面，增加创新药、金融、有色板块配置，同时降低科技、工业板块仓位。

#### 4.5.2 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。

### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2025 年下半年，美股继续保持谨慎乐观；港股或以结构性机会为主。

美股市场，人工智能主题仍然是股票市场的投资主线，在训练大语言模型方面，更高的成本效率标志着创新的一个重要里程碑，随着进入门槛降低，可能会带来 AI 应用更广泛的采用和普及。历史一次又一次地证明，成本下降将推动总需求上升。当前地缘政治贸易形势的不确定性要求我们在执行投资决策前时刻保持谨慎，但我们也觉察到市场波动将带来投资机会。那些将长期规划、供应链韧性和多元化以及客户关系纳入考量的公司将更有能力应对“美国关税”及其带来

的竞争格局的变化。在不确定性加剧和市场风险上升时期，这类“优质”公司通常先面临抛售压力，但随着贸易的动态调整和市场的正常化，在风险调整后，它们将提供更高的回报。

港股市场，关税政策叠加国内经济情况，市场将大概率呈现震荡走势，高股息板块在利率下行的背景下或更受青睐。从基本面来看，业绩企稳向上的确认信号还未出现，仍需耐心等待。因而，在没有其他创新突破的情况下，下半年市场缺乏进一步上涨的动力，不排除有一些回撤和波动，或将以结构性机会为主，消费科技成长与分红轮动依然是一个整体策略。

我们会继续自下而上精选个股，努力为持有人赚取正收益。

#### 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

根据相关法律法规和基金合同要求，本基金本报告期内对可供分配利润进行了收益分配，具体情况参见 6.4.11 利润分配情况。

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

本基金本报告期内无需预警说明。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《中华人民共和

国证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：交银施罗德环球精选价值证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	27,141,304.74	9,573,371.67
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	211,598,664.22	82,187,290.80
其中：股票投资		211,598,664.22	82,187,290.80
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		-	-
应收股利		575,568.88	16,708.82
应收申购款		711,876.26	309,893.03
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		240,027,414.10	92,087,264.32
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025年6月30日</b>	<b>上年度末 2024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		11,446.64	3,018.78
应付赎回款		10,302,506.56	267,115.52
应付管理人报酬		242,823.75	139,147.01
应付托管费		40,470.63	27,056.36
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	85,769.55	95,552.01
负债合计		10,683,017.13	531,889.68
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.10	86,143,699.30	35,055,404.59
未分配利润	6.4.7.12	143,200,697.67	56,499,970.05
净资产合计		229,344,396.97	91,555,374.64
负债和净资产总计		240,027,414.10	92,087,264.32

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.662 元，基金份额总额 86,143,699.30 份。

## 6.2 利润表

会计主体：交银施罗德环球精选价值证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025年1月1日至2025 年6月30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024 年6月30日
<b>一、营业收入</b>		19,627,494.38	9,539,320.47
1. 利息收入		100,603.64	29,663.42
其中：存款利息收入	6.4.7.13	100,603.64	29,663.42
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”号填列）		17,972,286.73	-601,179.90
其中：股票投资收益	6. 4. 7. 14	14,748,835.02	-1,401,783.08
基金投资收益	6. 4. 7. 15	-	-
债券投资收益	6. 4. 7. 16	-	-
资产支持证券投资收益	6. 4. 7. 17	-	-
贵金属投资收益	6. 4. 7. 18	-	-
衍生工具收益	6. 4. 7. 19	-50.75	-590.14
股利收益	6. 4. 7. 20	3,223,502.46	801,193.32
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. 21	6,671,795.77	10,060,822.44
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-5,522,534.20	38,987.45
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6. 4. 7. 22	405,342.44	11,027.06
<b>减：二、营业总支出</b>		2,180,975.65	911,408.44
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	1,813,400.34	714,821.32
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	307,980.97	138,992.99
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. 23	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6. 4. 7. 24	59,594.34	57,594.13
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		17,446,518.73	8,627,912.03
<b>减：所得税费用</b>		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		17,446,518.73	8,627,912.03
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-

六、综合收益总额		17,446,518.73	8,627,912.03
----------	--	---------------	--------------

### 6.3 净资产变动表

会计主体：交银施罗德环球精选价值证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	35,055,404.59	-	56,499,970.05	91,555,374.64
二、本期期初净资产	35,055,404.59	-	56,499,970.05	91,555,374.64
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	51,088,294.71	-	86,700,727.62	137,789,022.33
(一)、综合收益总额	-	-	17,446,518.73	17,446,518.73
(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)	51,088,294.71	-	74,558,339.81	125,646,634.52
其中：1. 基金申购款	171,636,710.38	-	263,005,474.85	434,642,185.23
2. 基金赎回款	- 120,548,415.67	-	- 188,447,135.04	-308,995,550.71
(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)	-	-	-5,304,130.92	-5,304,130.92
四、本期期末净资产	86,143,699.30	-	143,200,697.67	229,344,396.97
项目	上年度可比期间 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	33,841,052.06	-	43,380,355.21	77,221,407.27
二、本期期初净资产	33,841,052.06	-	43,380,355.21	77,221,407.27

三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-700,439.59	-	7,726,271.28	7,025,831.69
(一)、综合收益总额	-	-	8,627,912.03	8,627,912.03
(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)	-700,439.59	-	-901,640.75	-1,602,080.34
其中：1.基金申购款	3,797,810.70	-	5,462,878.13	9,260,688.83
2.基金赎回款	-4,498,250.29	-	-6,364,518.88	-10,862,769.17
(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	33,140,612.47	-	51,106,626.49	84,247,238.96

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：

袁庆伟

周云康

许颖

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

交银施罗德环球精选价值证券投资基金(以下简称“本基金”)系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[2008]第 635 号《关于核准交银施罗德环球精选价值证券投资基金募集的批复》的准许,由交银施罗德基金管理有限公司向社会公开发行募集,基金合同于 2008 年 8 月 22 日生效,首次设立募集规模为 508,425,627.85 份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为交银施罗德基金管理有限公司,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司,境外资产托管人为摩根大通银行(JPMorganChaseBank, National Association),境外投资顾问为施罗德投资管理有限公司(Schroder Investment Management Limited)。

本基金投资于已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的股票，在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金，债券，货币市场工具以及中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合为：股票资产占基金资产的 60%-100%，债券、货币市场工具以及中国证监会允许本基金投资的其他金融工具占基金资产的 0%-40%。本基金的业绩比较基准为  $70\% \times \text{标准普尔全球大中盘指数} (\text{S\&P Global Large MidCap Index}) + 30\% \times \text{恒生指数}$ 。

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 2025 年 8 月 28 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>》以及参考本基金的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”）发布的有关规定及其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于 2025 年 06 月 30 日的财务状况以及 2025 年上半年的经营成果和净资产变动情况。

#### 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[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金

金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《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》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金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。对证券投资基金在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定；

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育附加；

基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免征营业税或增值税和企业所得税；

基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂未征收个人所得税和企业所得税。

## 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 2025年6月30日
----	-------------------

活期存款	27,141,304.74
等于：本金	27,139,631.70
加：应计利息	1,673.04
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	27,141,304.74

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2025 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	182,328,538.31	—	211,598,664.22	29,270,125.91
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—	—
债券	交易所市场	—	—	—
	银行间市场	—	—	—
	合计	—	—	—
资产支持证券	—	—	—	—
基金	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	182,328,538.31	—	211,598,664.22	29,270,125.91

#### 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 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	38,658.87
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	—

其中：交易所市场	—
银行间市场	—
应付利息	—
预提审计费	7,439.10
预提信息披露费	39,671.58
合计	85,769.55

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	35,055,404.59	35,055,404.59
本期申购	171,636,710.38	171,636,710.38
本期赎回(以“-”号填列)	-120,548,415.67	-120,548,415.67
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	86,143,699.30	86,143,699.30

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	52,108,643.21	4,391,326.84	56,499,970.05
本期期初	52,108,643.21	4,391,326.84	56,499,970.05
本期利润	10,774,722.96	6,671,795.77	17,446,518.73
本期基金份额交易产生的变动数	65,388,557.23	9,169,782.58	74,558,339.81
其中：基金申购款	224,510,694.53	38,494,780.32	263,005,474.85
基金赎回款	-159,122,137.30	-29,324,997.74	-188,447,135.04
本期已分配利润	-5,304,130.92	—	-5,304,130.92
本期末	122,967,792.48	20,232,905.19	143,200,697.67

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	

活期存款利息收入	100,432.66
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	—
其他	170.98
合计	100,603.64

#### 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 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	14,748,835.02
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	14,748,835.02

##### 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 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出股票成交总额	341,410,491.12
减：卖出股票成本总额	325,409,534.67
减：交易费用	1,252,121.43
买卖股票差价收入	14,748,835.02

##### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 6.4.7.15 基金投资收益

无。

#### 6.4.7.16 债券投资收益

##### 6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

无。

##### 6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

**6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入**

无。

**6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入**

无。

**6.4.7.17 资产支持证券投资收益****6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成**

无。

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

无。

**6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入**

无。

**6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入**

无。

**6.4.7.18 贵金属投资收益****6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成**

无。

**6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

无。

**6.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

无。

**6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

无。

**6.4.7.19 衍生工具收益****6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
卖出权证成交总额	12,841.01
减：卖出权证成本总额	12,891.76
减：交易费用	—
减：买卖权证差价收入应缴 纳增值税额	—
买卖权证差价收入	-50.75

### 6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

### 6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	3,223,502.46
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	3,223,502.46

### 6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	6,671,795.77
股票投资	6,671,795.77
债券投资	—
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	6,671,795.77

### 6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	405,279.08
其他	63.36
合计	405,342.44

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。

### 6.4.7.23 信用减值损失

无。

### 6.4.7.24 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
审计费用	7,439.10
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行费用	11,832.36
存托保管费	651.30
合计	59,594.34

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

无。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

### 6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

#### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
交银施罗德基金管理有限公司（“交银施罗德基金公司”）	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金销售机构
摩根大通银行	境外资产托管人
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、基金投资顾问
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 基金交易**

无。

**6.4.10.1.5 权证交易**

无。

**6.4.10.1.6 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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,813,400.34	714,821.32
其中：应支付销售机构的客户维护费	661,004.45	197,431.08
应支付基金管理人的净管理费	1,152,395.89	517,390.24

注：自 2024 年 01 月 01 日至 2025 年 02 月 10 日，支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.80% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

根据基金管理人发布的相关公告，自 2025 年 02 月 11 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×适用费率÷当年天数。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	307,980.97	138,992.99

注：自 2024 年 01 月 01 日至 2025 年 02 月 10 日，支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.35% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

根据基金管理人发布的相关公告，自 2025 年 02 月 11 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×适用费率÷当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

无。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

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

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

无。

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

无。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期 2025年1月1日至2025年6 月30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年 6月30日
基金合同生效日（2008年8月 22日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	8,212,422.53	8,212,422.53
报告期内申购/买入总份额	508,794.58	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	8,721,217.11	8,212,422.53
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	10.12%	24.78%

注：1、如果本报告期内发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务。

2、如果本报告期内发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

3、基金管理人投资本基金适用的申购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

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

无。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月 30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024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
摩根大通银行_活期存款	8,451,085.24	41,939.03	5,877,851.09	27,480.47
中国建设银行_活期存款	18,690,219.50	58,493.63	664,197.55	2,168.45

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

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		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	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2025年1月14日	-	2025年1月13日	1.490	2,368,873.94	2,935,256.98	5,304,130.92	-
合计	-	-	-	1.490	2,368,873.94	2,935,256.98	5,304,130.92	-

#### 6.4.12 期末（2025年6月30日）本基金持有的流通受限证券

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

无。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金以股票为主要投资对象，属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种，其预期风险和收益水平高于混合型基金和债券型基金。本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。此外，本基金在全球范围内进行投资，除了需要承担国际市场的市场波动风险之外，还面临汇率风险、国别风险、新兴市场风险等海外市场投资所面临的特别投资风险。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，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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

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

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

##### 6.4.13.2 信用风险

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

为了规避信用风险，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充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国建设银行以及境外次托管人摩根大通银行，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在境内交易所进行的债券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，在境外交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性不重大。

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

本期末及上年度末，本基金未持有债券投资，因此信用风险对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

于报告期末，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

### 6.4.13.4 市场风险

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

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险, 其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有及承担的利率敏感性资产主要为银行存款, 除银行存款外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。

### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 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	27,141,304.74	-	-	-	27,141,304.74
交易性金融资产	-	-	-	211,598,664.22	211,598,664.22
应收股利	-	-	-	575,568.88	575,568.88
应收申购款	80.00	-	-	711,796.26	711,876.26
资产总计	27,141,384.74	-	-	212,886,029.36	240,027,414.10
负债					
应付赎回款	-	-	-	10,302,506.56	10,302,506.56
应付管理人报酬	-	-	-	242,823.75	242,823.75
应付托管费	-	-	-	40,470.63	40,470.63
应付清算款	-	-	-	11,446.64	11,446.64
其他负债	-	-	-	85,769.55	85,769.55
负债总计	-	-	-	10,683,017.13	10,683,017.13
利率敏感度缺口	27,141,384.74	-	-	-202,203,012.23	229,344,396.97
上年度末 2024 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	9,573,371.67	-	-	-	9,573,371.67
交易性金融资产	-	-	-	82,187,290.80	82,187,290.80
应收股利	-	-	-	16,708.82	16,708.82
应收申购款	798.95	-	-	309,094.08	309,893.03
资产总计	9,574,170.62	-	-	82,513,093.70	92,087,264.32
负债					
应付赎回款	-	-	-	267,115.52	267,115.52
应付管理人报酬	-	-	-	139,147.01	139,147.01
应付托管费	-	-	-	27,056.36	27,056.36
应付清算款	-	-	-	3,018.78	3,018.78
其他负债	-	-	-	95,552.01	95,552.01
负债总计	-	-	-	531,889.68	531,889.68
利率敏感度缺口	9,574,170.62	-	-	81,981,204.02	91,555,374.64

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

本基金本期末及上年度末未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

### 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

金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

#### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日			
	美元 折合人民 币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
货币资金	3,883,777 .52	4,567,644.00	69.57	8,451,491.09
交易性金融资产	80,030,26 0.10	103,041,963.94	28,526,440.18	211,598,664.22
应收股利	11,404.30	546,211.84	17,952.74	575,568.88
资产合计	83,925,44 1.92	108,155,819.78	28,544,462.49	220,625,724.19
以外币计价的负债				
应付清算款	-	11,446.64	-	11,446.64
负债合计	-	11,446.64	-	11,446.64
资产负债表外汇风险敞口净额	83,925,44 1.92	108,144,373.14	28,544,462.49	220,614,277.55
项目	上年度末 2024年12月31日			
	美元 折合人民 币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
货币资金	4,654,330 .36	2,001,652.49	61.66	6,656,044.51
交易性金融资产	37,416,37 8.73	31,121,821.04	13,649,091.03	82,187,290.80

应收股利	8,928.48	-	7,780.34	16,708.82
资产合计	42,079,637.57	33,123,473.53	13,656,933.03	88,860,044.13
以外币计价的负债				
应付清算款	-	3,018.78	-	3,018.78
负债合计	-	3,018.78	-	3,018.78
资产负债表外汇风险敞口净额	42,079,637.57	33,120,454.75	13,656,933.03	88,857,025.35

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025年6月30日）	上年度末（2024年12月31日）
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	11,030,713.88	4,442,851.27
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-11,030,713.88	-4,442,851.27

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，所面临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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的其他价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。股票资产占基金资产的 60%-100%，债券、货币市场工具以及中国证监会允许本基金投资的其他金融工具占基金资产的 0%-40%。此外，本基

金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 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 2025年6月30日		上年度末 2024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	211,598,664.22	92.26	82,187,290.80	89.77
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
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	211,598,664.22	92.26	82,187,290.80	89.77

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 6.4.1)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（2025年6月30日）	上年度末（2024年12月31日）
	1. 业绩比较基准上涨 5%	11,695,271.28	4,347,883.03
	2. 业绩比较基准下降 5%	-11,695,271.28	-4,347,883.03

#### 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 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
第一层次	211,598,664.22	82,187,290.80
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	211,598,664.22	82,187,290.80

##### 6.4.14.2.2 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。对于公开市场交易的证券投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，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投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	211,598,664.22	88.16
	其中：普通股	211,598,664.22	88.16

	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	27,141,304.74	11.31
8	其他各项资产	1,287,445.14	0.54
9	合计	240,027,414.10	100.00

## 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
中国香港	103,041,963.94	44.93
美国	80,030,260.10	34.90
德国	5,499,880.70	2.40
英国	5,143,212.95	2.24
日本	3,644,121.93	1.59
西班牙	3,494,999.91	1.52
瑞士	3,391,944.02	1.48
荷兰	2,910,265.73	1.27
意大利	2,712,226.64	1.18
法国	1,729,788.30	0.75
合计	211,598,664.22	92.26

注：1、国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定；

2、ADR、GDR 按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

## 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
通讯	22,176,957.07	9.67
非必需消费品	30,386,284.73	13.25
必需消费品	11,991,851.87	5.23
能源	1,566,672.07	0.68

金融	29,450,675.36	12.84
医疗保健	23,643,512.75	10.31
工业	14,054,163.55	6.13
材料	12,239,997.11	5.34
房地产	7,786,776.90	3.40
科技	54,494,724.90	23.76
公用事业	3,807,047.91	1.66
合计	211,598,664.22	92.26

注：本报告采用彭博 BICS 一级分类标准编制。

#### 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名 称(中 文)	证券代 码	所在证 券市场	所属 国家 (地 区)	数量 (股)	公允价值	占基 金资 产净 值比 例 (%)
1	TCL Electroni cs Holdings Ltd	TCL 电 子控股 有限公 司	1070 HK	香港联 合交易 所	中国 香港	1,052,0 00	9,152,243.12	3.99
2	China Resources Mixc Lifestyle Services Ltd	华润万 象生活	1209 HK	香港联 合交易 所	中国 香港	225,000	7,786,776.90	3.40
3	Cowell e Holdings Inc	高伟电 子	1415 HK	香港联 合交易 所	中国 香港	306,000	7,604,162.11	3.32
4	Geely Automobil e Holdings Ltd	吉利汽 车	175 HK	香港联 合交易 所	中国 香港	494,000	7,189,906.95	3.13
5	China Hongqiao Group Ltd	中国宏 桥	1378 HK	香港联 合交易 所	中国 香港	399,000	6,542,233.14	2.85
6	Microsoft Corp	微软	MSFT US	美国证 券交易 所	美国	1,833	6,526,871.66	2.85
7	China	中国黄	2099	香港联	中国	88,000	5,697,763.97	2.48

	Gold International Resources Corp Ltd	金国际资源有限公司	HK	合交易所	香港			
8	Xiaomi Corp	小米集团	1810 HK	香港联合交易所	中国香港	102,800	5,620,121.90	2.45
9	Innovent Biologics Inc	信达生物制药	1801 HK	香港联合交易所	中国香港	76,500	5,469,415.68	2.38
10	Alphabet Inc	Alphabet 公司	GOOGL US	美国证券交易所	美国	3,936	4,965,500.47	2.17
11	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	香港交易所	388 HK	香港联合交易所	中国香港	13,000	4,964,933.76	2.16
12	Meta Platforms Inc	Meta 平台股份有限公司	META US	美国证券交易所	美国	896	4,734,187.20	2.06
13	China East Education Holdings Ltd	中国东方教育	667 HK	香港联合交易所	中国香港	700,000	4,264,203.64	1.86
14	Netflix Inc	奈飞公司	NFLX US	美国证券交易所	美国	437	4,189,211.36	1.83
15	Sichuan Kelun-Biotech Biopharmaceutical Co Ltd	四川科伦博泰生物医药股份有限公司	6990 HK	香港联合交易所	中国香港	13,800	4,117,710.55	1.80
16	Ping An Insurance Group Co of China Ltd	中国平安	2318 HK	香港联合交易所	中国香港	86,000	3,909,552.48	1.70
17	ANTA Sports Products	安踏体育	2020 HK	香港联合交易所	中国香港	44,200	3,809,057.35	1.66

	Ltd							
18	NVIDIA Corp	英伟达	NVDA US	美国证券交易所	美国	3,347	3,785,414.21	1.65
19	Semiconductor Manufacturing International Corp	中芯国际	981 HK	香港联合交易所	中国香港	85,000	3,464,893.44	1.51
20	HSBC Holdings PLC	汇丰控股	5 HK	香港联合交易所	中国香港	38,000	3,290,349.26	1.43
21	Spotify Technology SA	Spotify 科技股份有限公司	SPOT US	美国证券交易所	美国	588	3,229,931.11	1.41
22	Apple Inc	苹果公司	AAPL US	美国证券交易所	美国	2,171	3,188,612.75	1.39
23	SAP SE	SAP 公司	SAP GR	德国证券交易所	德国	1,334	2,890,450.54	1.26
24	Amazon.com Inc	亚马逊公司	AMZN US	美国证券交易所	美国	1,832	2,877,202.27	1.25
25	Visa Inc	维萨公司	V US	美国证券交易所	美国	1,117	2,839,035.26	1.24
26	Intesa Sanpaolo SpA	意大利联合圣保罗银行股份有限	ISP IM	意大利证券交易所	意大利	66,010	2,712,226.64	1.18
27	Mao Geping Cosmetics Co LTD	格菱控股	1318 HK	香港联合交易所	中国香港	26,300	2,597,452.65	1.13
28	American Express Co	美国运通	AXP US	美国证券交易所	美国	1,122	2,562,031.16	1.12
29	Procter & Gamble Co/The	宝洁	PG US	美国证券交易所	美国	2,085	2,377,959.50	1.04

30	Broadcom Inc	博通股份有限公司	AVGO US	美国证券交易所	美国	1,203	2,373,841.51	1.04
31	Eli Lilly and Co	礼来	LLY US	美国证券交易所	美国	409	2,282,360.47	1.00
32	Keymed Biosciences Inc	康诺亚	2162 HK	香港联合交易所	中国香港	52,000	2,190,830.37	0.96
33	Fuyao Glass Industry Group Co Ltd	福耀玻璃	3606 HK	香港联合交易所	中国香港	42,400	2,167,229.52	0.94
34	Shenzhou International Group Holdings Ltd	申洲国际	2313 HK	香港联合交易所	中国香港	42,000	2,137,208.65	0.93
35	Arista Networks Inc	Arista 网络股份有限公司	ANET US	美国证券交易所	美国	2,912	2,132,738.22	0.93
36	Boston Scientific Corp	波士顿科学	BSX US	美国证券交易所	美国	2,728	2,097,573.46	0.91
37	Sinotruk Hong Kong Ltd	中国重汽	3808 HK	香港联合交易所	中国香港	98,000	2,046,562.40	0.89
38	General Electric Co	通用电气航空航天	GE US	美国证券交易所	美国	1,069	1,969,688.15	0.86
39	Haleon PLC	Haleon 公司	HLN LN	英国伦敦证券交易所	英国	53,429	1,961,974.04	0.86
40	NextEra Energy Inc	新纪元能源公司	NEE US	美国证券交易所	美国	3,945	1,960,467.80	0.85
41	Booking Holdings Inc	Booking 控股股份有限公司	BKNG US	美国证券交易所	美国	47	1,947,814.11	0.85
42	ASML	阿斯麦	ASML	荷兰证	荷兰	335	1,906,743.98	0.83

	Holding NV	控股公司	NA	券交易所				
43	Iberdrola SA	伊维尔德罗拉有限公司	IBE SM	西班牙证券交易所	西班牙	13,495	1,846,580.11	0.81
44	Zai Lab Ltd	再鼎医药	9688 HK	香港联合交易所	中国香港	70,000	1,752,281.28	0.76
45	Schneider Electric SE	施耐德电气股份公司	SU FP	法国证券交易所	法国	912	1,729,788.30	0.75
46	Morgan Stanley	摩根士丹利	MS US	美国证券交易所	美国	1,705	1,719,254.48	0.75
47	Lloyds Banking Group PLC	劳埃德银行集团	LLOY LN	英国伦敦证券交易所	英国	220,941	1,662,080.48	0.72
48	Banco Bilbao Vizcaya Argentari	西班牙对外银行	BBVA SM	西班牙证券交易所	西班牙	15,032	1,648,419.80	0.72
49	Coterra Energy Inc	Coterra 能源股份有限公司	CTRA US	美国证券交易所	美国	8,623	1,566,672.07	0.68
50	Coca-Cola Co/The	可口可乐	KO US	美国证券交易所	美国	3,012	1,525,490.50	0.67
51	Tesco PLC	特易购	TSCO LN	英国伦敦证券交易所	英国	38,597	1,519,158.43	0.66
52	Elevance Health Inc	Elevance 健康股份有限公司	ELV US	美国证券交易所	美国	537	1,495,227.66	0.65
53	Siemens AG	西门子	SIE GR	德国证券交易所	德国	811	1,487,129.44	0.65
54	Mitsubishi UFJ Financial Group	三菱日联金融集团	8306 JP	日本东京证券交易所	日本	15,000	1,474,132.09	0.64

55	Uber Technologies Inc	优步技术股份有限公司	UBER US	美国证券交易所	美国	2,170	1,449,337.31	0.63
56	Advanced Micro Devices Inc	AMD 公司	AMD US	美国证券交易所	美国	1,419	1,441,427.78	0.63
57	TJX Cos Inc/The	TJX 公司	TJX US	美国证券交易所	美国	1,608	1,421,496.95	0.62
58	China Taiping Insurance Holdings Co Ltd	中国太平	966 HK	香港联合交易所	中国香港	100,600	1,403,630.66	0.61
59	Duality Biotherapeutics Inc	映恩生物制药(苏州)有限公司	9606 HK	香港联合交易所	中国香港	6,500	1,402,463.38	0.61
60	GE Vernova Inc	通用电气 Vernova 股份有限公司	GEV US	美国证券交易所	美国	362	1,371,246.29	0.60
61	J&T Global Express Ltd	极兔速递环球有限公司	1519 HK	香港联合交易所	中国香港	220,000	1,360,240.83	0.59
62	Cie Financiere Richemont SA	瑞士历峰集团	CFR SW	瑞士证券交易所	瑞士	996	1,338,040.47	0.58
63	Liberty Media Corp-Liberty Formula One	Liberty 传媒公司-Liberty 一级方程式	FWONK US	美国证券交易所	美国	1,701	1,272,473.36	0.55
64	Veeva Systems Inc	Veeva Systems 股份	VEEV US	美国证券交易所	美国	596	1,228,674.04	0.54

		有限公司						
65	Howmet Aerospace Inc	Howmet 航空航天股份有限公司	HWM US	美国证券交易所	美国	908	1,209,846.64	0.53
66	Adobe Inc	奥多比	ADBE US	美国证券交易所	美国	432	1,196,432.28	0.52
67	Parker-Hannifin Corp	派克汉尼汾	PH US	美国证券交易所	美国	235	1,175,015.83	0.51
68	Keyence Corp	株式会社 KEYENCE	6861 JP	日本东京证券交易所	日本	400	1,146,596.74	0.50
69	Bayerische Motoren Werke AG	宝马汽车股份公司	BMW GR	德国证券交易所	德国	1,772	1,122,300.72	0.49
70	Alcon Inc	爱尔康公司	ALC SW	瑞士证券交易所	瑞士	1,661	1,048,143.47	0.46
71	Cadence Design Systems Inc	Cadence Design 系统股份有限公司	CDNS US	美国证券交易所	美国	472	1,041,195.46	0.45
72	AutoZone Inc	AutoZone 公司	AZO US	美国证券交易所	美国	39	1,036,400.42	0.45
73	Bridgestone Corp	普利司通株式会社	5108 JP	日本东京证券交易所	日本	3,500	1,023,393.10	0.45
74	Costco Wholesale Corp	开市客	COST US	美国证券交易所	美国	142	1,006,295.00	0.44
75	Roche Holding AG	罗氏	ROG SW	瑞士证券交易所	瑞士	433	1,005,760.08	0.44
76	Heineken NV	荷兰喜力公司	HEIA NA	荷兰证券交易所	荷兰	1,614	1,003,521.75	0.44
77	Home	家得宝	HD US	美国证	美国	382	1,002,608.32	0.44

	Depot Inc/The			券交易 所				
78	Guming Holdings Ltd	古茗控股有限公司	1364 HK	香港联合交易所	中国香港	42,800	997,236.37	0.43
79	Salesforce Inc	Salesforce.com 股份有限公司	CRM US	美国证券交易所	美国	482	940,901.90	0.41
80	Fair Isaac Corp	费埃哲公司	FICO US	美国证券交易所	美国	68	889,823.14	0.39
81	BeiGene Ltd	百济神州有限公司	6160 HK	香港联合交易所	中国香港	5,800	781,746.35	0.34
82	COSCO SHIPPING Energy Transport ation Co Ltd	中远海能	1138 HK	香港联合交易所	中国香港	94,000	558,048.93	0.24
83	Meituan	美团点评	3690 HK	香港联合交易所	中国香港	3,400	388,502.15	0.17
84	Orient Securities Co Ltd/China	东方证券	3958 HK	香港联合交易所	中国香港	74,000	375,206.15	0.16

## 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

### 7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	Xiaomi Corp	1810 HK	26,495,849.62	28.94
2	Tencent Holdings Ltd	700 HK	19,081,906.31	20.84
3	ANTA Sports Products Ltd	2020 HK	18,796,843.98	20.53
4	TCL Electronics Holdings Ltd	1070 HK	18,326,572.07	20.02
5	Agricultural Bank of China Ltd	1288 HK	14,910,504.86	16.29

6	Industrial & Commercial Bank of China Ltd	1398 HK	14,601,092.53	15.95
7	Fuyao Glass Industry Group Co Ltd	3606 HK	12,407,587.90	13.55
8	Semiconductor Manufacturing International Corp	981 HK	10,991,150.07	12.00
9	China Hongqiao Group Ltd	1378 HK	10,071,271.53	11.00
10	China Resources Mixc Lifestyle Services Ltd	1209 HK	9,195,018.79	10.04
11	Giant Biogene Holding Co Ltd	2367 HK	9,132,264.70	9.97
12	Cowell e Holdings Inc	1415 HK	8,767,026.49	9.58
13	Geely Automobile Holdings Ltd	175 HK	8,765,292.85	9.57
14	Sinotruk Hong Kong Ltd	3808 HK	7,797,475.54	8.52
15	Sunny Optical Technology Group Co Ltd	2382 HK	7,777,203.42	8.49
16	Alphabet Inc	GOOGL US	6,854,830.44	7.49
17	Microsoft Corp	MSFT US	6,733,910.57	7.36
18	Bank of China Ltd	3988 HK	6,690,853.22	7.31
19	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	388 HK	6,470,018.03	7.07
20	China Gold International Resources Corp Ltd	2099 HK	5,961,980.73	6.51
21	Meta Platforms Inc	META US	5,930,893.84	6.48
22	Alibaba Group Holding Ltd	9988 HK	5,861,812.01	6.40
23	Apple Inc	AAPL US	5,259,080.18	5.74
24	C&D International Investment Group Ltd	1908 HK	5,154,290.63	5.63

25	NVIDIA Corp	NVDA US	5,115,392.88	5.59
26	Mao Geping Cosmetics Co LTD	1318 HK	4,951,237.63	5.41
27	GDS Holdings Ltd	9698 HK	4,408,375.84	4.81
28	Amazon. com Inc	AMZN US	4,249,399.03	4.64
29	Elevance Health Inc	ELV US	4,143,667.08	4.53
30	Netflix Inc	NFLX US	4,107,958.41	4.49
31	China Taiping Insurance Holdings Co Ltd	966 HK	4,036,205.79	4.41
32	Ping An Insurance Group Co of China Ltd	2318 HK	3,850,935.82	4.21
33	Sichuan Kelun-Biotech Biopharmaceutical Co Ltd	6990 HK	3,850,518.05	4.21
34	Kingdee International Software Group Co Ltd	268 HK	3,753,748.39	4.10
35	Eli Lilly and Co	LLY US	3,737,278.31	4.08
36	Visa Inc	V US	3,684,837.05	4.02
37	Boston Scientific Corp	BSX US	3,683,075.80	4.02
38	Trip. com Group Ltd	9961 HK	3,645,874.42	3.98
39	SAP SE	SAP GR	3,601,909.13	3.93
40	NextEra Energy Inc	NEE US	3,523,232.30	3.85
41	Procter & Gamble Co/The	PG US	3,511,282.37	3.84
42	Broadcom Inc	AVGO US	3,489,579.85	3.81
43	Intesa Sanpaolo SpA	ISP IM	3,334,212.69	3.64
44	Spotify Technology SA	SPOT US	3,315,373.62	3.62
45	China East Education Holdings Ltd	667 HK	3,309,030.61	3.61
46	HSBC Holdings PLC	5 HK	3,304,351.12	3.61
47	American Express Co	AXP US	3,107,342.51	3.39

48	Haleon PLC	HLN LN	3,023,316.68	3.30
49	Cie Financiere Richemont SA	CFR SW	2,969,850.88	3.24
50	Morgan Stanley	MS US	2,935,302.34	3.21
51	Arista Networks Inc	ANET US	2,842,315.95	3.10
52	Innovent Biologics Inc	1801 HK	2,799,596.53	3.06
53	Schneider Electric SE	SU FP	2,737,960.56	2.99
54	CSSC Offshore and Marine Engineering Group Co Ltd	317 HK	2,594,793.42	2.83
55	Minth Group Ltd	425 HK	2,569,386.46	2.81
56	Coterra Energy Inc	CTRA US	2,462,225.15	2.69
57	Lloyds Banking Group PLC	LLOY LN	2,393,022.37	2.61
58	Parker-Hannifin Corp	PH US	2,300,734.32	2.51
59	TotalEnergies SE	TTE FP	2,285,946.03	2.50
60	General Electric Co	GE US	2,257,652.47	2.47
61	ASML Holding NV	ASML NA	2,256,600.66	2.46
62	Uber Technologies Inc	UBER US	2,239,420.11	2.45
63	AMETEK Inc	AME US	2,208,116.60	2.41
64	Booking Holdings Inc	BKNG US	2,183,385.95	2.38
65	Shenzhou International Group Holdings Ltd	2313 HK	2,141,982.90	2.34
66	Coca-Cola Co/The	KO US	2,126,211.90	2.32
67	Iberdrola SA	IBE SM	2,057,859.67	2.25
68	Salesforce Inc	CRM US	2,005,187.93	2.19
69	Laopu Gold Co Ltd	6181 HK	1,971,235.00	2.15
70	Howmet Aerospace Inc	HWM US	1,915,747.77	2.09
71	Banco Bilbao Vizcaya Argentari	BBVA SM	1,894,735.16	2.07
72	AutoZone Inc	AZO US	1,892,697.97	2.07
73	Veeva Systems Inc	VEEV US	1,873,086.22	2.05

74	Heineken NV	HEIA NA	1,870,953.86	2.04
75	TJX Cos Inc/The	TJX US	1,865,523.86	2.04
76	Tesco PLC	TSCO LN	1,845,030.94	2.02
77	Adobe Inc	ADBE US	1,841,601.41	2.01
78	Mitsubishi UFJ Financial Group	8306 JP	1,836,603.05	2.01
79	Siemens AG	SIE GR	1,834,983.90	2.00

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

### 7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	Xiaomi Corp	1810 HK	25,053,215.94	27.36
2	Tencent Holdings Ltd	700 HK	23,178,478.34	25.32
3	TCL Electronics Holdings Ltd	1070 HK	18,085,613.30	19.75
4	Agricultural Bank of China Ltd	1288 HK	16,807,072.90	18.36
5	ANTA Sports Products Ltd	2020 HK	16,544,460.73	18.07
6	Industrial & Commercial Bank of China Ltd	1398 HK	15,637,158.23	17.08
7	Fuyao Glass Industry Group Co Ltd	3606 HK	12,833,482.57	14.02
8	Giant Biogene Holding Co Ltd	2367 HK	9,948,082.85	10.87
9	Sunny Optical Technology Group Co Ltd	2382 HK	6,978,391.79	7.62
10	Bank of China Ltd	3988 HK	6,576,720.04	7.18
11	Semiconductor Manufacturing International Corp	981 HK	6,116,340.50	6.68
12	Sinotruk Hong Kong Ltd	3808 HK	5,845,955.70	6.39
13	Alibaba Group Holding Ltd	9988 HK	5,624,884.23	6.14
14	Microsoft Corp	MSFT US	4,962,813.14	5.42

15	China Hongqiao Group Ltd	1378 HK	4, 564, 555. 26	4. 99
16	C&D International Investment Group Ltd	1908 HK	4, 498, 533. 91	4. 91
17	NVIDIA Corp	NVDA US	4, 440, 107. 28	4. 85
18	Alphabet Inc	GOOGL US	4, 356, 931. 04	4. 76
19	Trip. com Group Ltd	9961 HK	4, 046, 703. 99	4. 42
20	Kingdee International Software Group Co Ltd	268 HK	3, 987, 314. 01	4. 36
21	Meta Platforms Inc	META US	3, 403, 007. 14	3. 72
22	Mao Geping Cosmetics Co LTD	1318 HK	3, 229, 305. 89	3. 53
23	China Resources Mixc Lifestyle Services Ltd	1209 HK	3, 202, 356. 23	3. 50
24	TotalEnergies SE	TTE FP	3, 190, 411. 83	3. 48
25	GDS Holdings Ltd	9698 HK	3, 189, 506. 63	3. 48
26	Netflix Inc	NFLX US	3, 105, 126. 03	3. 39
27	Apple Inc	AAPL US	2, 969, 576. 58	3. 24
28	Amazon. com Inc	AMZN US	2, 834, 342. 67	3. 10
29	Elevance Health Inc	ELV US	2, 697, 249. 97	2. 95
30	China Taiping Insurance Holdings Co Ltd	966 HK	2, 582, 038. 19	2. 82
31	CSSC Offshore and Marine Engineering Group Co Ltd	317 HK	2, 566, 602. 78	2. 80
32	Intesa Sanpaolo SpA	ISP IM	2, 554, 493. 82	2. 79
33	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	388 HK	2, 553, 399. 01	2. 79
34	Minth Group Ltd	425 HK	2, 449, 729. 00	2. 68
35	Cie Financiere Richemont SA	CFR SW	2, 394, 008. 59	2. 61
36	SAP SE	SAP GR	2, 392, 002. 85	2. 61
37	Visa Inc	V US	2, 389, 956. 63	2. 61

38	China Gold International Resources Corp Ltd	2099 HK	2,383,008.92	2.60
39	Merck & Co Inc	MRK US	2,302,130.18	2.51
40	Procter & Gamble Co/The	PG US	2,264,176.11	2.47
41	Eli Lilly and Co	LLY US	2,262,674.21	2.47
42	Spotify Technology SA	SPOT US	2,247,565.68	2.45
43	GE Vernova Inc	GEV US	2,237,190.53	2.44
44	Schneider Electric SE	SU FP	2,221,579.76	2.43
45	Lloyds Banking Group PLC	LLOY LN	2,204,958.66	2.41
46	AMETEK Inc	AME US	2,196,739.73	2.40
47	Geely Automobile Holdings Ltd	175 HK	2,195,357.40	2.40
48	Parker-Hannifin Corp	PH US	2,086,178.22	2.28
49	Yue Yuen Industrial Holdings Ltd	551 HK	2,068,208.16	2.26
50	American Express Co	AXP US	1,926,964.85	2.10
51	Cowell e Holdings Inc	1415 HK	1,848,866.45	2.02
52	Iberdrola SA	IBE SM	1,837,142.85	2.01

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

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	448,136,271.30
卖出收入（成交）总额	341,410,491.12

注：“买入成本”或“卖出收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

无。

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

无。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细无。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细无。

#### 7.11 投资组合报告附注

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

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

7.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	—
2	应收清算款	—
3	应收股利	575, 568. 88
4	应收利息	—
5	应收申购款	711, 876. 26
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	1, 287, 445. 14

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 (%)
16,999	5,067.57	8,829,729.18	10.25	77,313,970.12	89.75

### 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	20,855.75	0.02

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

无。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2008 年 8 月 22 日)	508,425,627.85
基金份额总额	
本报告期期初基金份额总额	35,055,404.59
本报告期基金总申购份额	171,636,710.38
减：本报告期基金总赎回份额	120,548,415.67
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期末基金份额总额	86,143,699.30

注：1、如果本报告期内发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；

2、如果本报告期内发生转换出业务，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，公司总经理由袁庆伟女士担任，谢卫先生不再担任公司总经理；印皓女士不再担任公司副总经理。
2、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动：中国建设银行股份有限公司（以下简称“中

国建设银行”）研究决定，聘任陈颖钰为中国建设银行资产托管业务部总经理。陈颖钰女士曾先后在中国建设银行财务会计、重组改制、资产负债、同业业务、金融科技等领域工作，并在中国建设银行总行同业业务中心、财务会计部、资产托管业务部以及山东省分行、建信金融科技有限责任公司等机构担任领导职务，具有丰富的财会、科技和资金资产管理经验。

### 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

本报告期内，经履行适当程序，本基金聘请安永华明会计师事务所（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 (%)	
UOB Kay Hian Limite d	—	511,898,219 .13	64.83	614,277.83	97.03	—
BofA Se curities Inc	—	46,592,315. 08	5.90	1,608.50	0.25	—
Morgan Stanley & Co. LLC N	—	23,653,299. 67	3.00	1,243.34	0.20	—

ew York							
Penserra Securi ties LLC	—	23,540,888. 46	2.98	1,177.97	0.19	—	
Goldman Sachs & Co. LLC N ew York	—	23,012,636. 36	2.91	1,113.76	0.18	—	
Jefferie s LLC New Y ork	—	20,883,987. 32	2.65	568.57	0.09	—	
TD Securiti es (USA) LLC	—	19,885,817. 41	2.52	1,152.00	0.18	—	
BNP Paribas	—	16,624,846. 83	2.11	1,962.99	0.31	—	
UBS Sec urities LLC Stamfo rd	—	12,849,276. 43	1.63	435.69	0.07	—	
Guzman & Company	—	12,344,827. 56	1.56	538.80	0.09	—	
Optiver Vof Amster dam	—	10,354,970. 30	1.31	1,257.54	0.20	—	
Virtu Americas LLC	—	9,946,069.1 2	1.26	329.24	0.05	—	
BMO Capital Markets Corp.	—	9,462,325.5 8	1.20	534.30	0.08	—	
Jefferie s Internat ional Limited	—	9,067,180.2 5	1.15	1,069.48	0.17	—	
Goldman	—	7,813,049.3	0.99	1,019.95	0.16	—	

Sachs Internat ional		8				
UBS AG	–	6,212,846.2 6	0.79	751.98	0.12	–
Morgan Stanley & Co. Internat ional PLC	–	3,950,600.0 1	0.50	789.97	0.12	–
Instinet Europe Limite d Lon don	–	3,499,950.1 8	0.44	350.01	0.06	–
J. P. Morgan Securiti es PLC	–	3,343,090.2 6	0.42	560.91	0.09	–
RBC Europe Limited	–	2,787,118.6 8	0.35	278.67	0.04	–
Joh. Berenber g Gossler & Co. KG	–	2,593,406.2 2	0.33	312.29	0.05	–
Macquari e Securiti es (Austral ia) Limited	–	2,254,891.9 6	0.29	450.91	0.07	–
Liquidne t Europe Limited	–	1,981,200.7 7	0.25	209.61	0.03	–
J. P. Mo rgan Se curities (Asia P acific) Limite d	–	1,864,403.7 0	0.24	372.76	0.06	–

UBS Securities Asia Limited	—	1,097,480.59	0.14	219.40	0.03	—
Merrill Lynch International	—	959,512.23	0.12	191.80	0.03	—
Redburn (Europe) Limited London	—	581,141.26	0.07	237.69	0.04	—
Barclays Capital Securities Limited London	—	366,538.98	0.05	45.80	0.01	—
Virtu Europe Trading Limited	—	124,872.44	0.02	15.61	0.00	—

注：1、本公司从事境外投资业务时，将需要委托境外券商代理或协助进行交易操作。公司作为基金管理人将勤勉尽责地承担受信责任，挑选、委托合适的境外券商以取得有益于基金持有人利益的最佳执行；

2、本公司投资海外市场，遵循公平分配、最佳执行的原则。公司挑选券商并开户均主要遵循以下原则：券商基本面评价，包括财务状况和经营状况；券商研究及服务质量，包括其研究报告质量、数量和及时性，包括券商在股票配售等公司行为发生时所提供的服务；券商的交易执行能力，即是否对投资指令进行了有效的执行以及能否取得较高质量的成交结果。衡量券商交易执行能力的指标主要有：是否完成交易、成交的及时性、成交价格、对市场价格及流动性的影响等。能够及时准确高效地提供结算等后台业务支持。

#### 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

无。

#### 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	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德环球精选价值证券投资基金暂停及恢复大额申购（定期定	中国证监会规定媒体及公司网站	2025年1月8日

	额投资) 业务的公告		
2	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德环球精选价值证券投资基金分红公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2025 年 1 月 10 日
3	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德环球精选价值证券投资基金于境外主要市场节假日暂停及节后恢复基金申购、赎回和定期定额投资业务的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2025 年 1 月 16 日
4	交银施罗德基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2025 年 1 月 21 日
5	交银施罗德环球精选价值证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒体及公司网站	2025 年 1 月 21 日
6	交银施罗德基金管理有限公司关于调低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	2025 年 2 月 11 日
7	交银施罗德环球精选价值证券投资基金托管协议更新	中国证监会规定媒体及公司网站	2025 年 2 月 11 日
8	交银施罗德环球精选价值证券投资基金基金合同更新	中国证监会规定媒体及公司网站	2025 年 2 月 11 日
9	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德环球精选价值证券投资基金于境外主要市场节假日暂停及节后恢复基金申购、赎回和定期定额投资业务的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2025 年 2 月 13 日
10	交银施罗德环球精选价值证券投资基金招募说明书更新	中国证监会规定媒体及公司网站	2025 年 2 月 13 日
11	交银施罗德环球精选价值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	2025 年 2 月 13 日
12	交银施罗德环球精选价值证券投资基金 2024 年年度报告	中国证监会规定媒体及公司网站	2025 年 3 月 28 日
13	交银施罗德基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司交易及佣金支付情况公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2025 年 3 月 31 日
14	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德环球精选价值证券投资基金于境外主要市场节假日暂停及节后恢复基金申购、赎回和定期定额投资业务的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2025 年 4 月 15 日
15	交银施罗德环球精选价值证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒体及公司网站	2025 年 4 月 21 日
16	交银施罗德基金管理有限公司关于增加中国邮政储蓄银行股份有限公	中国证监会规定媒体及公司网站	2025 年 4 月 22 日

	司为旗下基金的销售机构的公告		
17	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德环球精选价值证券投资基金于境外主要市场节假日暂停及节后恢复基金申购、赎回和定期定额投资业务的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2025 年 5 月 21 日
18	交银施罗德基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2025 年 6 月 7 日
19	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德环球精选价值证券投资基金于境外主要市场节假日暂停及节后恢复基金申购、赎回和定期定额投资业务的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2025 年 6 月 16 日
20	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德环球精选价值证券投资基金于境外主要市场节假日暂停及节后恢复基金申购、赎回和定期定额投资业务的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2025 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	2025/1/1-2025/6/30	8,212,422.53	508,794.58	-	8,721,217.11	10.12
产品特有风险							
本基金报告期内出现单一投资者持有基金份额比例超过基金总份额 20%的情况。如该类投资者集中赎回，可能会对本基金带来流动性冲击，从而影响基金的投资运作和收益水平。基金管理人将加强流动性管理，防范相关风险，保护持有人利益。							

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据有关法律法规及本基金基金合同的有关规定，经与基金托管人协商一致，本基金管理人于 2025 年 2 月 11 日起调低本基金的管理费率和托管费率，并对涉及的各基金的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。

## § 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环球精选价值证券投资基金募集的文件；
- 2、《交银施罗德环球精选价值证券投资基金基金合同》；
- 3、《交银施罗德环球精选价值证券投资基金招募说明书》；
- 4、《交银施罗德环球精选价值证券投资基金托管协议》；
- 5、关于申请募集交银施罗德环球精选价值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环球精选价值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](http://www.fund001.com))查阅。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得上述文件的复印件。

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。本公司客户服务电话：400-700-5000（免长途话费），021-61055000，电子邮件：[services@jysld.com](mailto:services@jysld.com)。