

---

**交银施罗德精选混合型证券投资基金**  
**2020 年年度报告**  
**2020 年 12 月 31 日**

基金管理人：交银施罗德基金管理有限公司  
基金托管人：中国农业银行股份有限公司  
报告送出日期：二〇二一年三月三十日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 3 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。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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
<b>§2 基金简介</b>	<b>7</b>
2.1 基金基本情况	7
2.2 基金产品说明	7
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	8
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
<b>§4 管理人报告</b>	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
<b>§5 托管人报告</b>	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
<b>§6 审计报告</b>	<b>17</b>
6.1 审计意见	17
6.2 形成审计意见的基础	17
6.3 其他信息	17
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任	17
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任	18
<b>§7 年度财务报表</b>	<b>19</b>
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	21
7.4 报表附注	23
<b>§8 投资组合报告</b>	<b>50</b>
8.1 期末基金资产组合情况	50
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	50
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	56
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	56
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	57
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	57
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	57
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	57
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	57
8.12 投资组合报告附注.....	57
<b>§9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>58</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	58
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	58
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	59
<b>§10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>59</b>
<b>§11 重大事件揭示.....</b>	<b>59</b>
11.1 基金份额持有人大会决议.....	59
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	59
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	59
11.4 基金投资策略的改变.....	60
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	60
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	60
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	60
11.8 其他重大事件.....	62
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>64</b>
12.1 影响投资者决策的其他重要信息.....	64
<b>§13 备查文件目录.....</b>	<b>65</b>
13.1 备查文件目录.....	65
13.2 存放地点.....	65
13.3 查阅方式.....	65

## §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	
交易代码	519688(前端)	519689(后端)
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	8,632,831,612.05 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	秦一楠
	联系电话	(021) 61055050	010-66060069
	电子邮箱	xxpl@jysld.com, disclosure@jysld.com	tgxxpl@abchina.com

客户服务电话	400-700-5000, 021-61055000	95599
传真	(021) 61055054	010-68121816
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号交通银行大楼二层（裙）	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址	上海市浦东新区世纪大道 8 号国金中心二期 21-22 楼	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	200120	100031
法定代表人	阮红	周慕冰

注：中国农业银行股份有限公司法定代表人已于 2021 年 2 月 9 日变更为谷澍。

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2020 年	2019 年	2018 年
本期已实现收益	2,050,992,168.49	1,031,992,984.25	-149,627,277.87
本期利润	3,384,609,634.30	2,049,092,649.55	-616,754,875.82
加权平均基金份额本期利润	0.4526	0.3032	-0.1169

本期加权平均净值利润率	45.34%	43.16%	-18.96%
本期基金份额净值增长率	55.07%	58.45%	-16.28%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>2020 年末</b>	<b>2019 年末</b>	<b>2018 年末</b>
期末可供分配利润	4,344,120,797.03	2,118,324,747.30	613,031,076.81
期末可供分配基金份额利润	0.5032	0.2841	0.0998
期末基金资产净值	10,541,386,185.73	6,170,535,478.38	3,336,301,939.91
期末基金份额净值	1.2211	0.8274	0.5431
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>2020 年末</b>	<b>2019 年末</b>	<b>2018 年末</b>
基金份额累计净值增长率	1,320.91%	816.33%	478.31%

注：1、本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）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	12.41%	0.94%	10.43%	0.74%	1.98%	0.20%
过去六个月	30.18%	1.17%	18.77%	1.01%	11.41%	0.16%
过去一年	55.07%	1.28%	21.26%	1.07%	33.81%	0.21%
过去三年	105.70%	1.31%	27.60%	1.00%	78.10%	0.31%
过去五年	150.40%	1.28%	36.77%	0.93%	113.63%	0.35%
自基金合同生效至今	1,320.91%	1.52%	372.81%	1.28%	948.10%	0.24%

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 和 3.2.3 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。

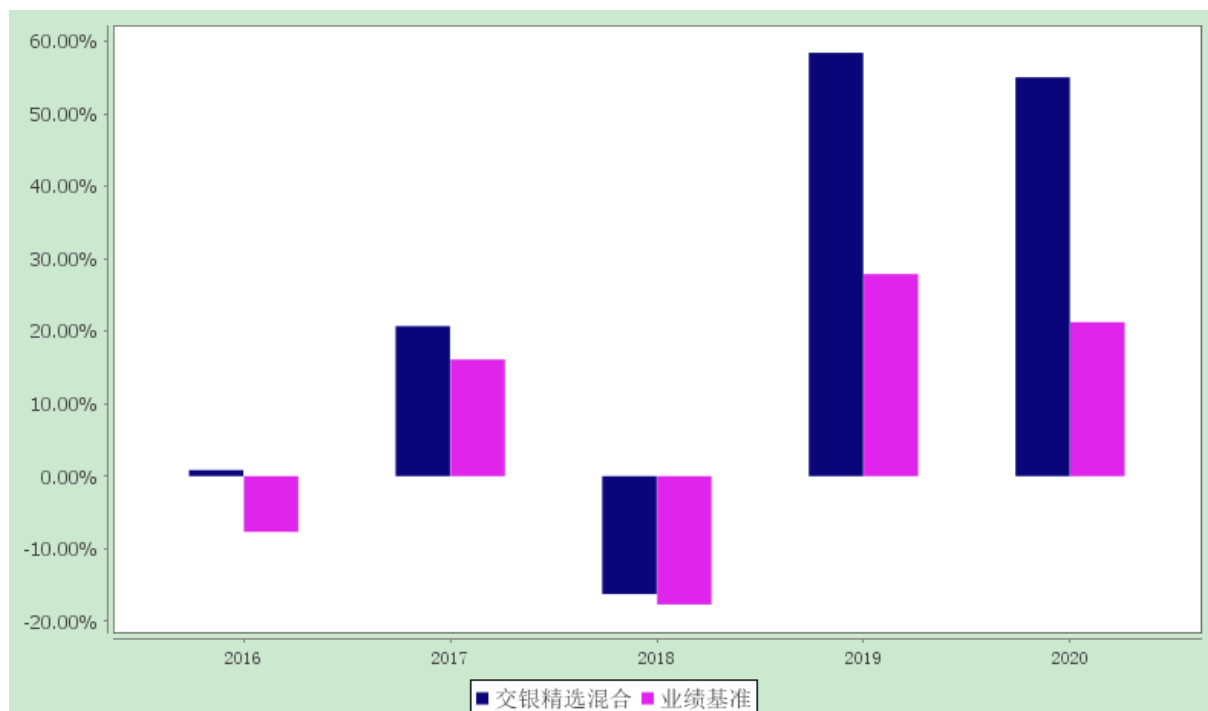
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



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

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2020 年	0.540	226,373,503.22	175,355,927.82	401,729,431.04	-
2019 年	0.280	107,068,552.87	82,672,538.21	189,741,091.08	-
2018 年	0.380	63,201,246.07	90,189,089.47	153,390,335.54	-
合计	1.200	396,643,302.16	348,217,555.50	744,860,857.66	-

## §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。

份。公司并下设交银施罗德资产管理（香港）有限公司和交银施罗德资产管理有限公司。

截至报告期末，公司管理了包括货币型、债券型、混合型和股票型在内的 94 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）及基金经理助理的简介

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、交银瑞丰混合的基金经理，公司权益投资副总监	2017-06-03	-	12 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。

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

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

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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 公平交易制度和控制方法

本公司制定了严格的投资控制制度和公平交易监控制度来保证旗下所管理的所有资产组合投资运作的公平。旗下所管理的所有资产组合，包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均严格遵循制度进行公平交易。制度中包含的主要控制方法如下：

（1）公司建立资源共享的投资研究信息平台，所有研究成果对所有投资组合公平开放，确保各投资组合在获得研究支持和实施投资决策方面享有公平的机会。

(2) 公司将投资管理职能和交易执行职能相隔离, 实行集中交易制度, 建立了合理且可操作的公平交易分配机制, 确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于交易所公开竞价交易, 遵循“时间优先、价格优先、比例分配”的原则, 全部通过交易系统进行比例分配; 对于非集中竞价交易、以公司名义进行的场外交易, 遵循“价格优先、比例分配”的原则按事前独立确定的投资方案对交易结果进行分配。

(3) 公司建立了清晰的投资授权制度, 明确各层级投资决策主体的职责和权限划分, 组合投资经理充分发挥专业判断能力, 不受他人干预, 在授权范围内独立行使投资决策权, 维护公平的投资管理环境, 维护所管理投资组合的合法利益, 保证各投资组合交易决策的客观性和独立性, 防范不公平及异常交易的发生。

(4) 公司建立统一的投资对象备选库和交易对手备选库, 制定明确的备选库建立、维护程序。在全公司适用股票、债券备选库的基础上, 根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和关联交易限制等, 按需要建立不同投资组合的投资对象风格库和交易对手备选库, 组合经理在此基础上根据投资授权构建投资组合。

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

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本公司制定了严格的投资控制制度和公平交易监控制度来保证旗下基金运作的公平, 旗下所管理的所有资产组合, 包括证券投资基金和特定客户资产管理专户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“时间优先、价格优先、比例分配”的原则, 全部通过交易系统进行比例分配; 对于非集中竞价交易、以公司名义进行的场外交易, 遵循“价格优先、比例分配”的原则按事前独立确定的投资方案对交易结果进行分配。

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

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

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年国内经济年初经历疫情冲击后持续复苏，货币政策层面虽然中期开始转向，但总体延续稳健略宽松货币政策，同时监管层延续房住不炒政策，引导企业融资成本下行，鼓励科技创新。A 股市场虽然在二月初和三月底受疫情影响短期大幅回调，但全年大部分时间都处于结构性牛市状态。从板块来看，大消费和新能源成为全年最强市场主线。在行业层面，新能源和新能源汽车，食品饮料、医药涨幅遥遥领先，大金融板块涨幅垫底。

本基金全年保持中性略高仓位，坚持自下而上选择具备竞争力的细分子行业龙头公司，上半年逐渐减持医药器械和医药服务相关标的，加仓物流服务类相关标的。下半年逐渐减持房地产开发类龙头个股，加仓石油化工和计算机相关标的。全年来看本基金跑赢业绩比较基准。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金（各类）份额净值及业绩表现请见“3.1 主要会计数据和财务指标”及“3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较”部分披露。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2021 年，我们维持谨慎乐观态度。我们观察到广谱层面的价格上涨（从工业大宗到农产品，从房价到服务），国内经济有走向过热的趋势，预计 2021 年货币政策继续转弯会对权益市场估值水平有所压制，2021 年上市公司业绩较快增长尤其是超预期增长可能是投资收益的重要来源。其次，四季度部分具备增长逻辑的热门行业热门个股估值继续拉升。我们认为其中确实有个别公司是可能通过持续兑现业绩高增长来消化估值的，但大部分公司股票而言结果大概率有两种，一是证实其核心资产盈利稳定能力，但股价泡沫化后未来多年收益率平庸化，二是高增长被证伪后股价大幅下跌。

本基金后续投资布局上拟规避过高估值的热门公司股票，以及强周期成长行业给出成长股估值的周期股。考虑到 2020 年国内外经济复苏的力度可能超预期，伴随 PPI 回升，配置上本基金将略向中上游制造业以及顺周期成长倾斜，2021 年我们将重点关注物流服务、大炼化、消费建材、餐饮供应链、军工半导体，软件互联网及企业级服务，具备提价能力的电子被动元器件，以及消费升级相关的产品和服务如高端白酒、

家电、教育等，坚持行业分散，个股精选、逆向投资，控制回撤，努力为基金持有人带来稳健回报。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2020 年度，根据《证券投资基金法》等法律法规及有关要求，本基金管理人诚实守信、勤勉尽责，依法履行基金管理人职责，落实风险控制，强化合规管理职能，确保基金管理业务运作的安全、规范，保护基金投资人的合法权益。

本报告期内，本基金管理人为了确保公司业务的规范运作，主要做了以下工作：

（一）继续深化全面风险管理，提高风险控制有效性。

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

（二）全面开展内部监督检查，强化公司内部控制。

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

（三）着力打造完备的合规管理体系，促进合规文化建设取得新成果。

公司法律合规部门着力搭建完备的合规管理体系，体系内三道防线各司其职、形成合力，促进公司合规文化建设取得新成果；全年重点推动新法规跟踪落实工作，认真分析潜在影响，利用系统化工具跟踪督促新法规予以贯彻落实；重点推进公司制度更新梳理及体系化建设工作，以持续抓好制度建设及执行助推公司合规管理常态长效发展。

（四）强化培训教育及重点领域合规提示，持续提高全员风险合规意识。

公司继续抓好全员风险合规教育工作。公司围绕行业热点、重点、难点问题，组织开展了多场培训工作，加强重点领域合规提示，加深了员工对新法律法规的理解及强化其风险合规意识，抓牢抓实员工合规底线教育，强化员工行为合规管控，提高了员工内部控制、风险管理的技能和水平，公司内部控制和风险管理基础得到进一步的夯实和优化。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

#### **4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

根据相关法律法规和基金合同要求，本基金对本报告期应分配的可供分配利润进行了收益分配，具体情况参见 7.4.8.2 资产负债表日后事项及 7.4.11 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**

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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，交银施罗德基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，交银施罗德基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## §6 审计报告

德师报(审)字(21)第 P01518 号

交银施罗德精选混合型证券投资基金全体持有人：

### 6.1 审计意见

我们审计了交银施罗德精选混合型投资基金(以下简称“交银精选基金”)的财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表，2020 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了交银精选基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。

### 6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于交银精选基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

### 6.3 其他信息

交银施罗德基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括交银精选基金 2020 年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

#### 6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

交银精选基金的基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估交银精选基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非管理层计划清算交银精选基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督交银精选基金的财务报告过程。

#### 6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(1)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(2)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(3)评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对交银精选基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致交银精选基金不能持续经营。

(5)评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。



德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

汪润松 季潇然

上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼

2021 年 3 月 26 日

## §7 年度财务报表

### 7.1 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：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	583,629,806.87	686,706,213.46
结算备付金		13,253,155.23	12,098,721.95
存出保证金		2,223,316.83	1,810,080.77
交易性金融资产	7.4.7.2	9,925,807,269.65	5,536,506,656.59
其中：股票投资		9,405,773,269.65	5,246,052,656.59
基金投资		-	-
债券投资		520,034,000.00	290,454,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		74,495,952.21	21,968,683.54
应收利息	7.4.7.5	4,726,376.73	4,917,908.55
应收股利		-	-
应收申购款		15,204,010.50	15,072,293.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>10,619,339,888.02</b>	<b>6,279,080,557.86</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2019 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	70,164,955.59
应付赎回款		56,671,235.24	23,725,386.98
应付管理人报酬		12,784,002.73	7,568,207.63
应付托管费		2,130,667.14	1,261,367.91
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	5,914,562.45	5,511,157.45
应交税费		4.00	0.11
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	453,230.73	314,003.81
<b>负债合计</b>		<b>77,953,702.29</b>	<b>108,545,079.48</b>
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	3,827,177,720.22	3,306,137,823.99
未分配利润	7.4.7.10	6,714,208,465.51	2,864,397,654.39
<b>所有者权益合计</b>		<b>10,541,386,185.73</b>	<b>6,170,535,478.38</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>10,619,339,888.02</b>	<b>6,279,080,557.86</b>

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.2211 元，基金份额总额 8,632,831,612.05 份。

## 7.2 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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		<b>3,551,354,177.47</b>	<b>2,158,270,036.87</b>
1.利息收入		12,953,083.64	11,565,538.64
其中：存款利息收入	7.4.7.11	5,835,051.26	5,189,003.89

债券利息收入		6,947,611.35	5,031,811.48
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		170,421.03	1,344,723.27
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,199,565,737.20	1,127,985,137.38
其中：股票投资收益	7.4.7.12	2,117,739,778.55	1,069,719,556.19
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	6,822,417.46	4,060,177.61
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	75,003,541.19	54,205,403.58
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	1,333,617,465.81	1,017,099,665.30
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	5,217,890.82	1,619,695.55
<b>减：二、费用</b>		<b>166,744,543.17</b>	<b>109,177,387.32</b>
1. 管理人报酬		111,311,047.90	70,971,289.02
2. 托管费		18,551,841.35	11,828,548.08
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	36,562,774.02	26,072,623.53
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		621.98	4,688.41
7. 其他费用	7.4.7.20	318,257.92	300,238.28
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>3,384,609,634.30</b>	<b>2,049,092,649.55</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>3,384,609,634.30</b>	<b>2,049,092,649.55</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	3,306,137,823.99	2,864,397,654.39	6,170,535,478.38
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	3,384,609,634.30	3,384,609,634.30
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	521,039,896.23	866,930,607.86	1,387,970,504.09
其中：1.基金申购款	2,916,704,739.09	3,860,590,879.76	6,777,295,618.85
2.基金赎回款	-2,395,664,842.86	-2,993,660,271.90	-5,389,325,114.76
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 (净值减少以“-”号填列)	-	-401,729,431.04	-401,729,431.04
五、期末所有者权益 (基金净值)	3,827,177,720.22	6,714,208,465.51	10,541,386,185.73
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	2,723,270,863.10	613,031,076.81	3,336,301,939.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	2,049,092,649.55	2,049,092,649.55
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	582,866,960.89	392,015,019.11	974,881,980.00
其中：1.基金申购款	1,832,911,875.33	1,168,577,756.85	3,001,489,632.18

2.基金赎回款	-1,250,044,914.44	-776,562,737.74	-2,026,607,652.18
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-189,741,091.08	-189,741,091.08
五、期末所有者权益（基金净值）	3,306,137,823.99	2,864,397,654.39	6,170,535,478.38

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：谢卫，主管会计工作负责人：夏华龙，会计机构负责人：单江

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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为 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 2021 年 3 月 26 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认

时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和贷款及应收款项，暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款及应收款项。

#### 金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。贷款及应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，贷款及应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价(包括转出的非现金资产或承担的新金融负债)之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金

融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层次的输入值确定公允价值计量层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是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；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

1) 对于银行间市场交易的固定收益品种，以及交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照第三方估值机构提供的估值确定公允价值。

2) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值；对于发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时股票公司公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，按照监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

3) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日无市价且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

4) 当投资品种不再存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### **7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。



#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。

资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额，确认资产支持证券利息收入。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

##### 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

债券投资收益为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

资产支持证券投资收益为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

- 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬和基金托管费按基金合同及相关公告约定的费率和计算方法逐日计提。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率逐日计提。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

1) 每年收益分配次数最多为 6 次，年度收益分配比例不低于基金年度已实现收益的 50%；

2) 收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。若基金份额持有人不选择，基金默认的收益分配方式是现金分红；分红方式最终以注册登记机构确认的分红方式为准；

3) 基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；

4) 基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；

5) 在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益每年至少分配一次，但若基金合同生效不满 3 个月则不进行收益分配；

6) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；

7) 每一基金份额享有同等分配权；

8) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 外币交易

本基金本报告期内无外币交易。

#### 7.4.4.13 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

1) 对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》(中基协发[2017]6号)，在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

2) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》(中国证监会公告[2017]13号)及《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》(中基协发[2013]13号)相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

3) 根据《关于发布<中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准>的通知》(中基协发[2014]24号)，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

## 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《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]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关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；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，暂不缴纳企业所得税。

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳；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。对基金持有的上市公司限售股, 解禁后取得的股息、红利收入, 按照上述规定计算纳税, 持股时间自解禁日起计算; 解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4) 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, 对受让方不再缴纳印花税。

(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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	583,629,806.87	686,706,213.46
定期存款	-	-
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	-	-
合计	583,629,806.87	686,706,213.46

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	7,309,267,834.00	9,405,773,269.65	2,096,505,435.65
贵金属投资-金交所	-	-	-

黄金合约				
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	519,129,906.07	520,034,000.00	904,093.93
	合计	519,129,906.07	520,034,000.00	904,093.93
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		7,828,397,740.07	9,925,807,269.65	2,097,409,529.58
项目		上年度末 2019 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		4,482,991,824.46	5,246,052,656.59	763,060,832.13
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	289,722,768.36	290,454,000.00	731,231.64
	合计	289,722,768.36	290,454,000.00	731,231.64
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		4,772,714,592.82	5,536,506,656.59	763,792,063.77

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融工具。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	117,408.00	167,816.75
应收定期存款利息	-	-

应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	6,560.29	5,988.84
应收债券利息	4,601,260.22	4,743,142.07
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	47.67	64.94
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	1,100.55	895.95
合计	4,726,376.73	4,917,908.55

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	5,914,162.45	5,506,773.00
银行间市场应付交易费用	400.00	4,384.45
合计	5,914,562.45	5,511,157.45

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	183,927.71	70,830.11
预提审计费	120,000.00	105,000.00
预提信息披露费	120,000.00	120,000.00
应付后端申购费	19,476.13	8,841.54
预提账户维护费	9,300.00	9,300.00

应付转出费	526.89	32.16
合计	453,230.73	314,003.81

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	7,457,562,962.33	3,306,137,823.99
本期申购	6,579,105,686.18	2,916,704,739.09
本期赎回（以“-”号填列）	-5,403,837,036.46	-2,395,664,842.86
本期末	8,632,831,612.05	3,827,177,720.22

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。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,118,324,747.30	746,072,907.09	2,864,397,654.39
本期利润	2,050,992,168.49	1,333,617,465.81	3,384,609,634.30
本期基金份额交易产生的变动数	576,533,312.28	290,397,295.58	866,930,607.86
其中：基金申购款	2,663,493,812.90	1,197,097,066.86	3,860,590,879.76
基金赎回款	-2,086,960,500.62	-906,699,771.28	-2,993,660,271.90
本期已分配利润	-401,729,431.04	-	-401,729,431.04
本期末	4,344,120,797.03	2,370,087,668.48	6,714,208,465.51

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	5,632,953.53	5,013,922.26
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-



结算备付金利息收入	149,339.21	116,276.25
其他	52,758.52	58,805.38
合计	5,835,051.26	5,189,003.89

**7.4.7.12 股票投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	11,822,415,388.32	8,376,659,456.59
减：卖出股票成本总额	9,704,675,609.77	7,306,939,900.40
买卖股票差价收入	2,117,739,778.55	1,069,719,556.19

**7.4.7.13 债券投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付） 成交总额	564,521,075.72	418,173,928.09
减：卖出债券（债转股及债券到期兑 付）成本总额	548,335,332.30	412,129,162.45
减：应收利息总额	9,363,325.96	1,984,588.03
买卖债券差价收入	6,822,417.46	4,060,177.61

**7.4.7.14 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

**7.4.7.15 衍生工具收益**

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

**7.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
----	---	--

股票投资产生的股利收益	75,003,541.19	54,205,403.58
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	75,003,541.19	54,205,403.58

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	1,333,617,465.81	1,017,099,665.30
——股票投资	1,333,444,603.52	1,016,289,233.66
——债券投资	172,862.29	810,431.64
——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	1,333,617,465.81	1,017,099,665.30

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	5,135,433.38	1,397,263.70
基金转换费收入	82,457.44	222,431.85
合计	5,217,890.82	1,619,695.55

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产；  
2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的

不低于赎回费的 25% 归入基金资产。

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	36,561,574.02	26,071,541.03
银行间市场交易费用	1,200.00	1,082.50
合计	36,562,774.02	26,072,623.53

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
审计费用	120,000.00	105,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
银行费用	41,057.92	38,038.28
债券账户费用	37,200.00	37,200.00
合计	318,257.92	300,238.28

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 或有事项

无。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

根据相关法律法规和基金合同要求，本基金本报告期内已实施的利润分配情况请参见附注 7.4.11 利润分配情况。本基金的基金管理人于 2021 年 1 月 22 日宣告分红，向截至 2021 年 1 月 26 日止在本基金注册登记人中国证券登记结算有限公司登记在册的基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 0.740 元。

### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
交银施罗德基金管理有限公司 (“交银施罗德基	基金管理人、基金销售机构

金公司”)	
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	基金托管人、基金销售机构
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	基金管理人的股东、基金销售机构
施罗德投资管理有限公司	基金管理人的股东
中国国际海运集装箱(集团)股份有限公司	基金管理人的股东
交银施罗德资产管理有限公司	基金管理人的子公司
上海直源投资管理有限公司	受基金管理人控制的公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	111,311,047.90	70,971,289.02
其中：支付销售机构的客户维护费	16,920,985.81	5,999,117.31

注：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： $\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.5\% \div \text{当年天数}$ 。

###### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	18,551,841.35	11,828,548.08

注：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： $\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% \div \text{当年天数}$ 。

**7.4.10.2.3 销售服务费**

无。

**7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

**7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况****7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本报告期内及上年度可比期间未发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

**7.4.10.4.2 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**

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金。

**7.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	583,629,806.87	5,632,953.53	686,706,213.46	5,013,922.26

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行同业利率计息。

**7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

**7.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

**7.4.11 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

1	2020-07-23	2020-07-23	0.540	226,373,503.22	175,355,927.82	401,729,431.04	-
合计			0.540	226,373,503.22	175,355,927.82	401,729,431.04	-

#### 7.4.12 期末（2020 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	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
002352	顺丰控股	2020-07-17	2021-01-18	限售股	60.00	86.91	2,430,000	145,800,000.00	211,191,300.00	-
002459	晶澳科技	2020-10-30	2021-04-30	非公开发行	21.30	36.86	2,347,418	50,000,003.40	86,525,827.48	-
002493	荣盛石化	2020-10-12	2021-04-12	非公开发行	17.42	26.32	4,477,612	78,000,001.04	117,850,747.84	-
003030	祖名股份	2020-12-25	2021-01-06	新股未上市	15.18	15.18	480	7,286.40	7,286.40	-
003031	中瓷电子	2020-12-24	2021-01-04	新股未上市	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-
300144	宋城演艺	2020-11-20	2021-05-20	限售股	17.73	16.86	8,150,000	144,499,500.00	137,409,000.00	-
300767	震安科技	2020-11-04	2021-05-06	限售股	65.93	68.85	600,000	39,558,000.00	41,310,000.00	-
300860	锋尚文化	2020-08-06	2021-02-24	限售股	138.02	126.67	381	52,585.62	48,261.27	-
300861	美畅股份	2020-08-06	2021-02-24	限售股	43.76	51.10	895	39,165.20	45,734.50	-
300864	南大环境	2020-08-13	2021-02-25	限售股	71.71	90.85	166	11,903.86	15,081.10	-
300868	杰美特	2020-08-12	2021-02-24	限售股	41.26	43.28	593	24,467.18	25,665.04	-

交银施罗德精选混合型证券投资基金 2020 年年度报告

300869	康泰医学	2020-08-12	2021-02-24	限售股	10.16	110.88	862	8,757.92	95,578.56	-
300870	欧陆通	2020-08-13	2021-02-24	限售股	36.81	65.67	478	17,595.18	31,390.26	-
300872	天阳科技	2020-08-14	2021-02-25	限售股	21.34	37.84	871	18,587.14	32,958.64	-
300873	海晨股份	2020-08-14	2021-03-02	限售股	30.72	41.32	484	14,868.48	19,998.88	-
300876	蒙泰高新	2020-08-14	2021-02-25	限售股	20.09	36.62	350	7,031.50	12,817.00	-
300877	金春股份	2020-08-17	2021-03-03	限售股	30.54	50.85	569	17,377.26	28,933.65	-
300878	维康药业	2020-08-17	2021-03-03	限售股	41.34	48.72	401	16,577.34	19,536.72	-
300879	大叶股份	2020-08-25	2021-03-01	限售股	10.58	27.12	466	4,930.28	12,637.92	-
300881	盛德鑫泰	2020-08-25	2021-03-05	限售股	14.17	32.31	291	4,123.47	9,402.21	-
300882	万胜智能	2020-08-27	2021-03-10	限售股	10.33	25.79	440	4,545.20	11,347.60	-
300884	狄耐克	2020-11-05	2021-05-12	限售股	24.87	33.51	499	12,410.13	16,721.49	-
300886	华业香料	2020-09-08	2021-03-16	限售股	18.59	45.67	147	2,732.73	6,713.49	-
300887	谱尼测试	2020-09-09	2021-03-16	限售股	44.47	74.52	210	9,338.70	15,649.20	-
300888	稳健医疗	2020-09-09	2021-03-17	限售股	74.30	156.39	10,265	762,689.50	1,605,343.35	-
300889	爱克股份	2020-09-09	2021-03-16	限售股	27.97	30.12	479	13,397.63	14,427.48	-
300890	翔丰华	2020-09-10	2021-03-18	限售股	14.69	48.85	286	4,201.34	13,971.10	-
300891	惠云钛业	2020-09-10	2021-03-17	限售股	3.64	16.40	1,143	4,160.52	18,745.20	-
300892	品渥食品	2020-09-11	2021-03-24	限售股	26.66	60.01	272	7,251.52	16,322.72	-
300893	松原股份	2020-09-17	2021-03-24	限售股	13.47	35.08	276	3,717.72	9,682.08	-
300895	铜牛信息	2020-09-17	2021-03-24	限售股	12.65	45.30	283	3,579.95	12,819.90	-
300896	爱美客	2020-09-21	2021-03-29	限售股	118.27	603.36	473	55,941.71	285,389.28	-
30090	广联	2020-	2021-	限售	17.87	33.16	879	15,70	29,14	-

交银施罗德精选混合型证券投资基金 2020 年年度报告

0	航空	10-19	04-29	股				7.73	7.64	
300909	汇创达	2020-11-11	2021-05-18	限售股	29.57	40.67	386	11,414.02	15,698.62	-
300911	亿田智能	2020-11-24	2021-06-03	限售股	24.35	33.06	309	7,524.15	10,215.54	-
300917	特发服务	2020-12-14	2021-06-21	限售股	18.78	31.94	281	5,277.18	8,975.14	-
300918	南山智尚	2020-12-15	2021-06-22	限售股	4.97	8.94	1,063	5,283.11	9,503.22	-
300919	中伟股份	2020-12-15	2021-06-23	限售股	24.60	61.51	610	15,006.00	37,521.10	-
300922	天秦装备	2020-12-18	2021-06-25	限售股	16.05	31.58	287	4,606.35	9,063.46	-
300925	法本信息	2020-12-21	2021-06-30	限售股	20.08	37.33	353	7,088.24	13,177.49	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-01-07	新股未上市	10.76	10.76	3,225	34,701.00	34,701.00	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-07-07	限售股	10.76	10.76	359	3,862.84	3,862.84	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-01-07	新股未上市	13.39	13.39	1,946	26,056.94	26,056.94	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	限售股	13.39	13.39	217	2,905.63	2,905.63	-
300999	金龙鱼	2020-09-29	2021-04-15	限售股	25.70	88.29	12,114	311,329.80	1,069,545.06	-
603613	国联股份	2020-12-02	2021-05-27	非公开发行	74.75	120.01	895,496	66,938,326.00	107,468,474.96	-
603613	国联股份	2020-12-07	2021-06-07	限售股	85.90	119.71	446,500	38,354,350.00	53,450,515.00	-
603658	安图生物	2020-07-16	2021-01-18	限售股	142.20	142.79	580,000	82,476,000.00	82,818,200.00	-
603866	桃李面包	2020-09-02	2021-03-02	限售股	59.13	57.29	470,000	27,791,100.00	26,926,300.00	-
605277	新亚电子	2020-12-25	2021-01-06	新股未上市	16.95	16.95	507	8,593.65	8,593.65	-
68800	澜起	2020-	2021-	限售	76.03	78.90	660,0	50,17	52,07	-



8	科技	09-23	03-23	股			00	9,800.00	4,000.00	
688017	绿的谐波	2020-08-21	2021-03-01	限售股	35.06	137.81	4,138	145,078.28	570,257.78	-
688060	云涌科技	2020-07-03	2021-01-11	限售股	44.47	81.69	2,400	106,728.00	196,056.00	-
688095	福昕软件	2020-09-01	2021-03-08	限售股	238.53	228.79	1,981	472,527.93	453,232.99	-
688155	先惠技术	2020-08-03	2021-02-18	限售股	38.77	67.26	2,403	93,164.31	161,625.78	-
688179	阿拉丁	2020-10-16	2021-04-26	限售股	19.43	64.24	3,944	76,631.92	253,362.56	-
688286	敏芯股份	2020-07-31	2021-02-10	限售股	62.67	117.33	1,681	105,348.27	197,231.73	-
688339	亿华通	2020-07-31	2021-02-10	限售股	76.65	257.95	2,761	211,630.65	712,199.95	-
688557	兰剑智能	2020-11-25	2021-06-02	限售股	27.70	32.75	1,812	50,192.40	59,343.00	-
688559	海目星	2020-08-28	2021-03-09	限售股	14.56	30.97	5,924	86,253.44	183,466.28	-
688608	恒玄科技	2020-12-07	2021-06-16	限售股	162.07	272.00	4,179	677,290.53	1,136,688.00	-
688617	惠泰医疗	2020-12-30	2021-01-07	新股未上市	74.46	74.46	1,673	124,571.58	124,571.58	-
688981	中芯国际	2020-07-09	2021-01-18	限售股	27.46	56.57	462,175	12,691,325.50	26,145,239.75	-

注：1、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2、本基金可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

3、本基金可作为特定投资者，参与上市公司公开或非公开发行股份认购。本基金可作为特定投资者所认购的 2020 年 2 月 14 日前发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起 12 个月内不得转让。本基金所认购的 2020 年 2 月 14 日(含)后发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。本基金持有的上市公司非公开发行股份，采取集中竞价交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 1%，且自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不

得超过本基金持有该次非公开发行股份数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

4、本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。本基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

5、本基金可以通过网下发行获配的创业板股票。发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，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。

#### 7.4.13.2 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。

### 7.4.13.3 流动性风险

#### 7.4.13.3.1 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。

### 7.4.13.4 市场风险

#### 7.4.13.4.1 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、债券投资与买入返售金融资产。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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
-----	-------	-------	--------	------	------	-----	----

交银施罗德精选混合型证券投资基金 2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 日							
资产							
银行存款	583,629,806.87	-	-	-	-	-	583,629,806.87
结算备付金	13,253,155.23	-	-	-	-	-	13,253,155.23
存出保证金	2,223,316.83	-	-	-	-	-	2,223,316.83
交易性金融资产	20,002,000.00	-	500,032,000.00	-	-	9,405,773,269.65	9,925,807,269.65
应收证券清算款	-	-	-	-	-	74,495,952.21	74,495,952.21
应收利息	-	-	-	-	-	4,726,376.73	4,726,376.73
应收申购款	88,755.54	-	-	-	-	15,115,254.96	15,204,010.50
资产总计	619,197,034.47	-	500,032,000.00	-	-	9,500,110,853.55	10,619,339,888.02
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	56,671,235.24	56,671,235.24
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	12,784,002.73	12,784,002.73
应付托管费	-	-	-	-	-	2,130,667.14	2,130,667.14
应付交易费用	-	-	-	-	-	5,914,562.45	5,914,562.45
应交税费	-	-	-	-	-	4.00	4.00
其他负债	-	-	-	-	-	453,230.73	453,230.73
负债总计	-	-	-	-	-	77,953,702.29	77,953,702.29
利率敏感度缺口	619,197,034.47	-	500,032,000.00	-	-	9,422,157,151.26	10,541,386,185.73
上年度末 2019 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							

交银施罗德精选混合型证券投资基金 2020 年年度报告

银行存款	686,706,213.46	-	-	-	-	-	686,706,213.46
结算备付金	12,098,721.95	-	-	-	-	-	12,098,721.95
存出保证金	1,810,080.77	-	-	-	-	-	1,810,080.77
交易性金融资产	-	-	290,454,000.00	-	-	5,246,052,656.59	5,536,506,656.59
应收证券清算款	-	-	-	-	-	21,968,683.54	21,968,683.54
应收利息	-	-	-	-	-	4,917,908.55	4,917,908.55
应收申购款	307,037.86	-	-	-	-	14,765,255.14	15,072,293.00
资产总计	700,922,054.04	-	290,454,000.00	-	-	5,287,704,503.82	6,279,080,557.86
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	70,164,955.59	70,164,955.59
应付赎回款	-	-	-	-	-	23,725,386.98	23,725,386.98
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	7,568,207.63	7,568,207.63
应付托管费	-	-	-	-	-	1,261,367.91	1,261,367.91
应付交易费用	-	-	-	-	-	5,511,157.45	5,511,157.45
应交税费	-	-	-	-	-	0.11	0.11
其他负债	-	-	-	-	-	314,003.81	314,003.81
负债总计	-	-	-	-	-	108,545,079.48	108,545,079.48
利率敏感度缺口	700,922,054.04	-	290,454,000.00	-	-	5,179,159,424.34	6,170,535,478.38

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

**7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析**

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 4.93%(2019 年 12 月 31 日：4.71%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2019 年 12 月 31 日：同)。

**7.4.13.4.2 外汇风险**

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

**7.4.13.4.3 其他价格风险**

其他价格风险是指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。本基金在构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：

**7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口**

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基 金资 产净 值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	9,405,773,269.65	89.23	5,246,052,656.59	85.02
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	9,405,773,269.65	89.23	5,246,052,656.59	85.02

#### 7.4.13.4.3.2 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：人民币万元）	
		本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准下降 5%	减少约 56,273	减少约 32,521
	2.业绩比较基准上升 5%	增加约 56,273	增加约 32,521

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 不以公允价值计量的金融工具

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。

##### (b) 以公允价值计量的金融工具

##### (i) 金融工具公允价值计量的方法

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层次的输入值确定公允价值计量层次。公允价值计量层次可分为：

第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值是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；

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (ii) 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层次的余额为 8,454,838,337.11 元，属于第二层次的余额为 1,470,968,932.54 元，无属于第三层次的余额(2019 年 12 月 31 日：第一层次 4,898,129,554.54 元，第二层次 638,377,102.05 元，无属于第三层次的余额)。

##### (iii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金分别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根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。

如本财务报告 7.4.4.5 部分所述，本基金交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债除外)本期采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值，相关固定收益品种的公允价值层次归入第二层次。

(iv) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	9,405,773,269.65	88.57
	其中：股票	9,405,773,269.65	88.57
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	520,034,000.00	4.90
	其中：债券	520,034,000.00	4.90
	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	596,882,962.10	5.62
8	其他各项资产	96,649,656.27	0.91
9	合计	10,619,339,888.02	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净
----	------	------	--------



			值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	735,158.00	0.01
B	采矿业	156,307,938.13	1.48
C	制造业	5,858,765,922.89	55.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	16,322.72	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	1,014,684,940.51	9.63
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	614,127,468.98	5.83
J	金融业	504,489,392.76	4.79
K	房地产业	502,801,862.08	4.77
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	441,599,472.24	4.19
N	水利、环境和公共设施管理业	76,959.71	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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	312,167,831.63	2.96
S	综合	-	-
	合计	9,405,773,269.65	89.23

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	002352	顺丰控股	11,536,581	1,014,664,941.63	9.63
2	002271	东方雨虹	20,539,756	796,942,532.80	7.56
3	002493	荣盛石化	22,248,479	608,504,385.71	5.77
4	603517	绝味食品	7,738,281	600,026,308.74	5.69
5	600519	贵州茅台	291,214	581,845,572.00	5.52

6	002841	视源股份	4,549,356	523,312,420.68	4.96
7	002049	紫光国微	3,876,263	518,682,752.03	4.92
8	601318	中国平安	5,800,062	504,489,392.76	4.79
9	002415	海康威视	9,543,434	462,951,983.34	4.39
10	603259	药明康德	3,275,909	441,330,460.48	4.19
11	000733	振华科技	6,445,722	379,330,739.70	3.60
12	601155	新城控股	9,239,724	321,819,586.92	3.05
13	300144	宋城演艺	18,009,513	312,119,570.36	2.96
14	603613	国联股份	2,514,981	311,154,908.76	2.95
15	601233	桐昆股份	14,460,631	297,744,392.29	2.82
16	002230	科大讯飞	6,850,620	279,984,839.40	2.66
17	001914	招商积余	8,405,634	180,973,300.02	1.72
18	002311	海大集团	2,657,305	174,053,477.50	1.65
19	688301	奕瑞科技	927,101	159,173,970.69	1.51
20	601899	紫金矿业	16,825,397	156,307,938.13	1.48
21	002475	立讯精密	2,658,392	149,188,959.04	1.42
22	600346	恒力石化	4,639,276	129,760,549.72	1.23
23	002459	晶澳科技	2,347,418	86,525,827.48	0.82
24	603658	安图生物	580,000	82,818,200.00	0.79
25	605123	派克新材	897,267	72,104,376.12	0.68
26	688008	澜起科技	660,000	52,074,000.00	0.49
27	601717	郑煤机	4,722,323	51,614,990.39	0.49
28	300767	震安科技	728,900	50,719,700.00	0.48
29	603866	桃李面包	470,000	26,926,300.00	0.26
30	688981	中芯国际	462,175	26,145,239.75	0.25
31	300559	佳发教育	1,650,000	22,110,000.00	0.21
32	600522	中天科技	1,809,947	19,619,825.48	0.19
33	300888	稳健医疗	10,265	1,605,343.35	0.02
34	688608	恒玄科技	4,179	1,136,688.00	0.01
35	300999	金龙鱼	12,114	1,069,545.06	0.01
36	002299	圣农发展	27,700	735,158.00	0.01
37	688339	亿华通	2,761	712,199.95	0.01
38	688017	绿的谐波	4,138	570,257.78	0.01
39	688686	奥普特	2,330	505,144.00	0.00
40	300919	中伟股份	6,093	485,591.86	0.00
41	688095	福昕软件	1,981	453,232.99	0.00
42	688658	悦康药业	16,580	404,054.60	0.00
43	300896	爱美客	473	285,389.28	0.00
44	688179	阿拉丁	3,944	253,362.56	0.00
45	688286	敏芯股份	1,681	197,231.73	0.00
46	688060	云涌科技	2,400	196,056.00	0.00
47	688559	海目星	5,924	183,466.28	0.00
48	300925	法本信息	3,528	162,719.99	0.00

49	688155	先惠技术	2,403	161,625.78	0.00
50	688617	惠泰医疗	1,673	124,571.58	0.00
51	300922	天秦装备	2,863	108,883.46	0.00
52	688560	明冠新材	3,832	105,226.72	0.00
53	300920	润阳科技	2,503	97,316.64	0.00
54	300869	康泰医学	862	95,578.56	0.00
55	688678	福立旺	4,198	91,516.40	0.00
56	688698	伟创电气	4,751	84,995.39	0.00
57	688618	三旺通信	1,117	59,938.22	0.00
58	688557	兰剑智能	1,812	59,343.00	0.00
59	300860	锋尚文化	381	48,261.27	0.00
60	688679	通源环境	3,139	47,869.75	0.00
61	300861	美畅股份	895	45,734.50	0.00
62	300926	博俊科技	3,584	38,563.84	0.00
63	300872	天阳科技	902	34,175.70	0.00
64	300870	欧陆通	478	31,390.26	0.00
65	300900	广联航空	879	29,147.64	0.00
66	300927	江天化学	2,163	28,962.57	0.00
67	300877	金春股份	569	28,933.65	0.00
68	300868	杰美特	593	25,665.04	0.00
69	003026	中晶科技	461	21,740.76	0.00
70	300873	海晨股份	484	19,998.88	0.00
71	300878	维康药业	401	19,536.72	0.00
72	300891	惠云钛业	1,143	18,745.20	0.00
73	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.00
74	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.00
75	605186	健麾信息	626	17,609.38	0.00
76	300884	狄耐克	499	16,721.49	0.00
77	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.00
78	300892	品渥食品	272	16,322.72	0.00
79	300909	汇创达	386	15,698.62	0.00
80	300887	谱尼测试	210	15,649.20	0.00
81	300864	南大环境	166	15,081.10	0.00
82	605500	森林包装	762	14,980.92	0.00
83	605377	华旺科技	750	14,977.50	0.00
84	300889	爱克股份	479	14,427.48	0.00
85	003027	同兴环保	349	14,008.86	0.00
86	300890	翔丰华	286	13,971.10	0.00
87	300895	铜牛信息	283	12,819.90	0.00
88	300876	蒙泰高新	350	12,817.00	0.00
89	300879	大叶股份	466	12,637.92	0.00
90	300882	万胜智能	440	11,347.60	0.00
91	605155	西大门	350	10,668.00	0.00

92	300911	亿田智能	309	10,215.54	0.00
93	300893	松原股份	276	9,682.08	0.00
94	300918	南山智尚	1,063	9,503.22	0.00
95	300881	盛德鑫泰	291	9,402.21	0.00
96	605299	舒华体育	738	9,335.70	0.00
97	300917	特发服务	281	8,975.14	0.00
98	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.00
99	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.00
100	300886	华业香料	147	6,713.49	0.00
101	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002352	顺丰控股	924,619,652.17	14.98
2	002049	紫光国微	659,481,327.29	10.69
3	002493	荣盛石化	527,928,202.36	8.56
4	002230	科大讯飞	513,294,784.35	8.32
5	601318	中国平安	475,000,277.36	7.70
6	300144	宋城演艺	462,514,115.02	7.50
7	002415	海康威视	429,874,753.26	6.97
8	002841	视源股份	419,946,799.87	6.81
9	600519	贵州茅台	405,610,567.30	6.57
10	000002	万科 A	387,646,614.46	6.28
11	603259	药明康德	384,747,409.69	6.24
12	601155	新城控股	323,754,650.04	5.25
13	002475	立讯精密	313,325,157.93	5.08
14	601233	桐昆股份	308,120,569.95	4.99
15	000733	振华科技	296,529,106.04	4.81
16	002311	海大集团	286,032,469.93	4.64
17	603517	绝味食品	278,255,094.48	4.51
18	603195	公牛集团	272,740,434.13	4.42
19	002044	美年健康	234,133,040.26	3.79
20	600048	保利地产	229,366,320.14	3.72
21	601899	紫金矿业	224,476,013.72	3.64
22	002271	东方雨虹	222,083,149.86	3.60
23	603613	国联股份	206,830,728.23	3.35
24	001914	招商积余	192,958,724.05	3.13
25	600887	伊利股份	181,672,228.88	2.94

26	002142	宁波银行	168,968,449.47	2.74
27	688301	奕瑞科技	166,325,986.82	2.70
28	002027	分众传媒	164,618,751.63	2.67
29	002050	三花智控	159,379,292.63	2.58
30	600522	中天科技	152,769,356.59	2.48
31	002507	涪陵榨菜	129,546,807.47	2.10
32	300750	宁德时代	126,673,105.63	2.05
33	000860	顺鑫农业	125,048,401.09	2.03

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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000002	万科 A	808,187,678.08	13.10
2	600048	保利地产	753,041,180.19	12.20
3	002230	科大讯飞	672,662,245.25	10.90
4	002475	立讯精密	515,774,714.20	8.36
5	600529	山东药玻	477,781,372.03	7.74
6	002044	美年健康	456,172,213.36	7.39
7	002050	三花智控	422,041,813.33	6.84
8	601166	兴业银行	394,170,989.49	6.39
9	601601	中国太保	392,685,253.93	6.36
10	002049	紫光国微	371,803,262.41	6.03
11	002271	东方雨虹	369,211,002.02	5.98
12	002410	广联达	344,247,125.96	5.58
13	002311	海大集团	304,658,166.37	4.94
14	002352	顺丰控股	292,418,445.66	4.74
15	603195	公牛集团	278,316,978.49	4.51
16	600763	通策医疗	269,425,132.98	4.37
17	601658	邮储银行	267,594,299.91	4.34
18	300036	超图软件	216,382,901.01	3.51
19	300012	华测检测	209,871,150.03	3.40
20	300750	宁德时代	188,548,749.50	3.06
21	601398	工商银行	180,384,330.25	2.92
22	002607	中公教育	178,135,223.62	2.89
23	600887	伊利股份	177,652,236.06	2.88
24	601155	新城控股	177,165,233.28	2.87
25	300724	捷佳伟创	163,633,254.41	2.65

26	603882	金域医学	161,811,320.09	2.62
27	000860	顺鑫农业	161,038,593.33	2.61
28	300144	宋城演艺	160,445,502.33	2.60
29	002142	宁波银行	156,021,243.85	2.53
30	002507	涪陵榨菜	151,021,284.78	2.45
31	002027	分众传媒	146,287,688.49	2.37
32	002460	赣锋锂业	144,690,783.82	2.34
33	601899	紫金矿业	139,878,521.12	2.27
34	600522	中天科技	133,161,157.76	2.16

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

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	12,530,951,619.31
卖出股票的收入（成交）总额	11,822,415,388.32

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	520,034,000.00	4.93
	其中：政策性金融债	520,034,000.00	4.93
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	520,034,000.00	4.93

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产
----	------	------	-------	------	-------

					净值比例 (%)
1	200216	20 国开 16	3,200,000	320,544,000.00	3.04
2	200406	20 农发 06	1,300,000	129,688,000.00	1.23
3	200211	20 国开 11	500,000	49,800,000.00	0.47
4	200201	20 国开 01	200,000	20,002,000.00	0.19

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

**8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

本基金本报告期末未持有权证。

**8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

本基金本报告期末未持有股指期货。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

本基金本报告期末未持有国债期货。

**8.12 投资组合报告附注**

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

**8.12.2** 本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

**8.12.3 其他资产构成**

金额单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,223,316.83
2	应收证券清算款	74,495,952.21
3	应收股利	-
4	应收利息	4,726,376.73
5	应收申购款	15,204,010.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	96,649,656.27
---	----	---------------

#### 8.12.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002352	顺丰控股	211,191,300.00	2.00	限售股
2	002493	荣盛石化	117,850,747.84	1.12	非公开发行

#### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

### §9 基金份额持有人信息

#### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
894,512	9,650.88	2,232,031,922.07	25.86%	6,400,799,689.98	74.14%

#### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	3,657,288.63	0.04%



**9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况**

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

**§10 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	7,457,562,962.33
本报告期基金总申购份额	6,579,105,686.18
减：本报告期基金总赎回份额	5,403,837,036.46
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	8,632,831,612.05

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。

**§11 重大事件揭示****11.1 基金份额持有人大会决议**

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

**11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动**

1、基金管理人的重大人事变动：本报告期内，本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

2、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动：本基金托管人中国农业银行股份有限公司于 2020 年 8 月任命刘琳为托管业务部副总裁。

**11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

本报告期内未发生涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

#### 11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

#### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所为德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）。报告年度支付给德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）的审计费 120,000.00 元，自本基金基金合同生效以来，本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

#### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

##### 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。

##### 2、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金托管人及其高级管理人员本报告期内未受监管部门稽查或处罚。

#### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券股份有限公司	1	797,815,252.90	3.32%	743,008.51	3.32%	-
国金证券股份有限公司	2	663,042,342.92	2.76%	617,491.34	2.76%	-
华西证券股份有限公司	1	655,350,544.49	2.73%	610,328.58	2.72%	-
华泰证券股份有限公司	1	616,693,094.92	2.56%	574,327.49	2.56%	-
天风证券股份有限公司	1	4,658,197,722.07	19.37%	4,338,185.14	19.36%	-
中泰证券股份有限公司	1	457,445,301.39	1.90%	426,019.96	1.90%	-
国信证券股份有限公司	1	34,817,276.46	0.14%	32,424.29	0.14%	-
安信证券股份有限公司	2	278,934,660.15	1.16%	259,770.90	1.16%	-

光大证券股份有限公司	2	2,730,039,379.63	11.35%	2,542,487.20	11.35%	-
申万宏源证券有限公司	3	2,622,371,319.94	10.90%	2,451,123.93	10.94%	-
东北证券股份有限公司	2	2,216,088,257.74	9.22%	2,063,848.29	9.21%	-
兴业证券股份有限公司	1	2,112,159,761.20	8.78%	1,967,055.81	8.78%	-
中信证券股份有限公司	1	1,943,692,428.32	8.08%	1,810,161.67	8.08%	-
中国国际金融股份有限公司	2	1,698,210,724.62	7.06%	1,585,848.53	7.08%	-
国泰君安证券股份有限公司	1	1,530,263,307.07	6.36%	1,425,143.95	6.36%	-
华创证券有限责任公司	1	1,033,355,476.63	4.30%	962,364.53	4.29%	-
中国银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
英大证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中银国际证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国海证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

#### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成	成交金额	占当期回购成交总	成交金额	占当期权证成交总

		交总额的 比例		额的比例		额的比例
光大证券股份有限公司	2,574,736.48	9.87%	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	11,787,625.70	45.21%	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	11,712,001.90	44.92%	-	-	-	-

注：1、报告期内，本基金退租交易单元为长城证券股份有限公司，其他交易单元未发生变化；

2、租用证券公司专用交易单元的选择标准主要包括：券商基本面评价（财务状况和经营状况）、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、租用证券公司专用交易单元的程序：首先根据租用证券公司专用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专用交易单元。研究部提交方案，并上报公司批准。

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	交银施罗德基金管理有限公司关于增加阳光人寿保险股份有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2020-01-20
2	交银施罗德精选混合型证券投资基金 2019 年第 4 季度报告	公司网站	2020-01-21
3	交银施罗德精选混合型证券投资基金（更新）招募说明书摘要（2019 年第 3 号）	公司网站	2020-01-23
4	交银施罗德精选混合型证券投资基金（更新）招募说明书（2019 年第 3 号）	公司网站	2020-01-23
5	交银施罗德基金管理有限公司关于春节假期调整延期办理有关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2020-01-31
6	交银施罗德基金管理有限公司关于终止泰诚财富基金销售（大连）有限公司办理相关销售业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2020-03-21

7	交银施罗德精选混合型证券投资基金 2019 年年度报告	公司网站	2020-03-30
8	交银施罗德基金管理有限公司关于暂停部分销售机构办理相关销售业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2020-04-13
9	交银施罗德精选混合型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	公司网站	2020-04-22
10	交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金投资非公开发行股票的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2020-05-21
11	交银施罗德基金管理有限公司关于增加中信证券华南股份有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2020-05-27
12	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德精选混合型证券投资基金调整大额申购（转换转入、定期定额投资）业务限额的公告	上海证券报、公司网站	2020-06-17
13	交银施罗德基金管理有限公司关于增加华鑫证券有限责任公司为旗下基金销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2020-06-22
14	交银施罗德精选混合型证券投资基金 2020 年第 2 季度报告	公司网站	2020-07-21
15	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德精选混合型证券投资基金分红的公告	上海证券报、公司网站	2020-07-21
16	交银施罗德基金管理有限公司关于增加东莞证券股份有限公司为旗下基金的销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2020-08-14
17	交银施罗德精选混合型证券投资基金 2020 年中期报告	公司网站	2020-08-29
18	交银施罗德精选混合型证券投资基金基金产品资料概要	公司网站	2020-08-31
19	交银施罗德基金管理有限公司关于增加泛华普益基金销售有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2020-09-07
20	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司为旗下基金销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2020-09-23
21	交银施罗德基金管理有限公司关于暂停上海凯石财富基金销售有限公司办理相关销售业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2020-09-29
22	交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金投资非公开发行股票的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2020-10-14

23	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(2020 年第 1 号)	公司网站	2020-10-21
24	交银施罗德精选混合型证券投资基金(更新)招募说明书(2020 年第 1 号)	公司网站	2020-10-21
25	交银施罗德精选混合型证券投资基金 2020 年第 3 季度报告	公司网站	2020-10-28
26	交银施罗德基金管理有限公司关于增加上海中欧财富基金销售有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2020-10-30
27	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德精选混合型证券投资基金调整大额申购(转换转入、定期定额投资)业务限额的公告	上海证券报、公司网站	2020-11-07
28	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德精选混合型证券投资基金调整大额申购(转换转入、定期定额投资)业务限额的公告	上海证券报、公司网站	2020-11-18
29	交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金投资非公开发行的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2020-12-04
30	交银施罗德基金管理有限公司关于增加中国人寿保险股份有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2020-12-14
31	交银施罗德精选混合型证券投资基金托管协议	公司网站	2020-12-28
32	交银施罗德精选混合型证券投资基金基金合同	公司网站	2020-12-28
33	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(2020 年第 2 号)	公司网站	2020-12-28
34	交银施罗德精选混合型证券投资基金(更新)招募说明书(2020 年第 2 号)	公司网站	2020-12-28
35	交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司手机银行基金前端申购(含定期定额投资)费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2020-12-31

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 影响投资者决策的其他重要信息

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《存托凭证发行与交易管理办法(试行)》等法律法规及本基金基金合同、招募说明书及其更新等规定,

经与基金托管人协商一致，本基金管理人对本基金参与存托凭证投资修订了基金合同等法律文件，欲知详情请查阅本基金管理人发布的最新法律文件。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准交银施罗德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指定报刊上各项公告的原稿。

### 13.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

### 13.3 查阅方式

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

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

二〇二一年三月三十日