

# 交银施罗德全球精选价值证券投资基金 2025 年年度报告

2025 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2026 年 3 月 28 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 3 月 26 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 2025 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
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 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、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
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.....	10
4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	10
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	12
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.8 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.10 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明.....	14
4.11 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.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
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.....	15
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>15</b>
6.1 审计报告基本信息.....	15
6.2 审计报告的基本内容.....	15
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>17</b>
7.1 资产负债表.....	17
7.2 利润表.....	18
7.3 净资产变动表.....	19
7.4 报表附注.....	21

<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>48</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	48
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	48
8.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	49
8.4 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.....	49
8.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	56
8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	64
8.7 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.....	64
8.8 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.....	64
8.9 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.....	64
8.10 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.....	64
8.11 投资组合报告附注.....	64
<b>§9 基金份额持有人信息</b> .....	<b>65</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	65
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	65
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	65
<b>§10 开放式基金份额变动</b> .....	<b>65</b>
<b>§11 重大事件揭示</b> .....	<b>65</b>
11.1 基金份额持有人大会决议.....	65
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.....	65
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	66
11.4 基金投资策略的改变.....	66
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	66
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....	66
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	66
11.8 其他重大事件.....	70
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>72</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	72
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	73
<b>§13 备查文件目录</b> .....	<b>73</b>
13.1 备查文件目录.....	73
13.2 存放地点.....	73
13.3 查阅方式.....	73

## § 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	62,457,993.20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	王小飞
	联系电话	021-61055050
	电子邮箱	xxpl@jysld.com, disclosure@jysld.com
客户服务电话	400-700-5000, 021-61055000	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21-23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

## 2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层
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	2025 年	2024 年	2023 年
本期已实现收益	29,752,319.50	1,641,015.12	1,710,118.60
本期利润	37,739,117.28	10,774,259.73	4,968,339.25
加权平均基金份额本期利润	0.4065	0.3224	0.1468
本期加权平均净值利润率	15.32%	13.05%	6.52%
本期基金份额净值增长率	19.53%	14.46%	6.84%

3.1.2 期末数据和指标	2025 年末	2024 年末	2023 年末
期末可供分配利润	105,921,928.48	52,108,643.21	43,380,355.21
期末可供分配基金份额利润	1.6959	1.4865	1.2819
期末基金资产净值	183,688,561.03	91,555,374.64	77,221,407.27
期末基金份额净值	2.941	2.612	2.282
3.1.3 累计期末指标	2025 年末	2024 年末	2023 年末
基金份额累计净值增长率	384.21%	305.09%	253.91%

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后的实际收益水平要低于所列数字；

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

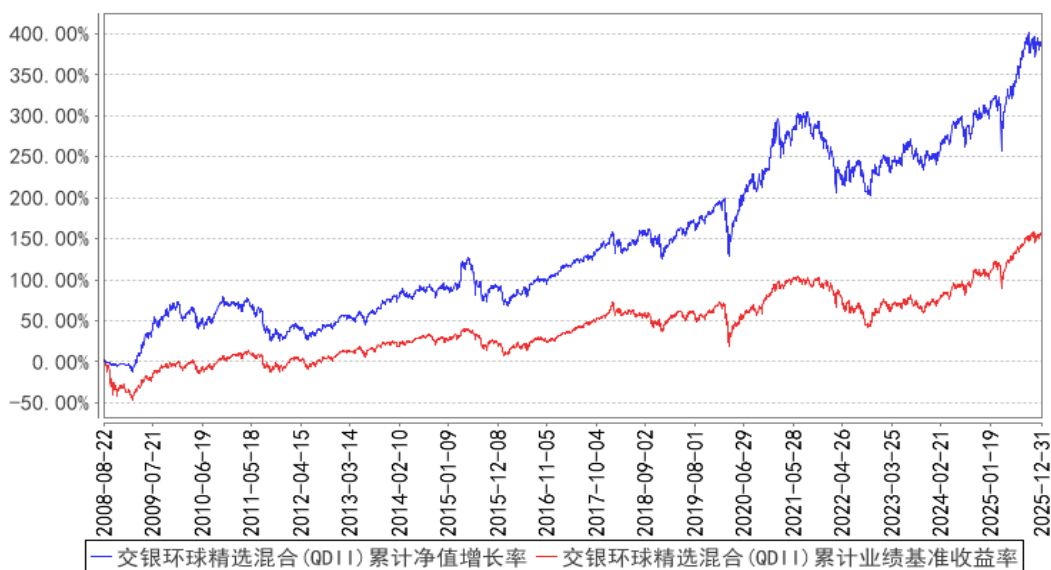
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.58%	0.88%	0.73%	0.68%	-3.31%	0.20%
过去六个月	10.48%	0.77%	9.77%	0.58%	0.71%	0.19%
过去一年	19.53%	1.09%	23.40%	0.97%	-3.87%	0.12%
过去三年	46.17%	0.89%	57.88%	0.82%	-11.71%	0.07%
过去五年	34.35%	0.97%	38.11%	0.88%	-3.76%	0.09%
自基金合同生效起至今	384.21%	0.97%	154.59%	1.04%	229.62%	-0.07%

注：本基金的业绩比较基准为 70%×标准普尔全球大中盘指数

(S&P Global LargeMidCap Index)+30%×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

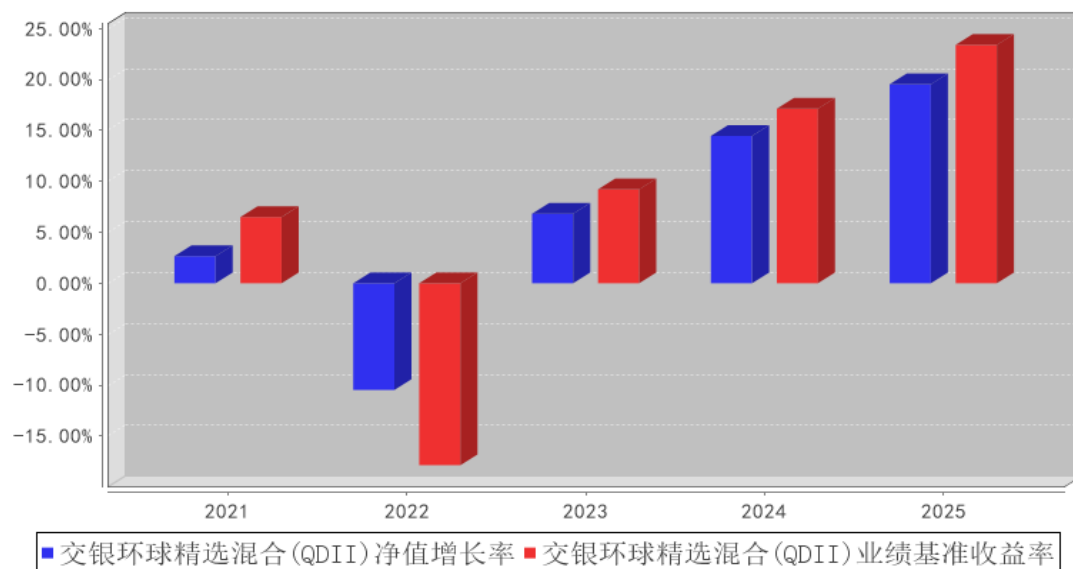
交银环球精选混合(QDII) 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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。

### 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

交银环球精选混合(QDII) 基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 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
2025 年	1.490	2,368,873.94	2,935,256.98	5,304,130.92	-
2024 年	-	-	-	-	-

2023 年	-	-	-	-
合计	1.490	2,368,873.94	2,935,256.98	5,304,130.92

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至报告期末，公司管理了包括货币型、债券型、混合型和股票型在内的 143 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）、交银港股通优质精选混合的基金经理	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、2026 年 1 月 22 日本基金管理人发布公告，蔡铮先生自 2026 年 1 月 22 日起担任本基金基金经理、陈俊华女士自 2026 年 1 月 22 日起不再担任本基金基金经理，本基金由陈舒薇女士和蔡铮先生共同管理；

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

#### 4.2 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。

注：本基金已于 2026 年 3 月 21 日公告调整境外投资顾问安排，详情请见相关公告内容。

#### 4.3 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。

#### 4.4 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。

#### 4.4.2 公平交易制度的执行情况

本公司制定了严格的投资控制制度和公平交易监控制度来保证旗下基金运作的公平，旗下所管理的所有资产组合，包括证券投资基金和私募资产管理计划均严格遵循制度进行公平交易。

公司建立资源共享的投资研究信息平台，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。公司在交易执行环节实行集中交易制度，建立公平的交易分配制度。对于交易所公开竞价交易，遵循“价格优先、时间优先”的原则，全部通过交易系统进行比例分配；对于非集中竞价交易、以公司名义进行的场外交易，遵循公平交易分配原则对交易结果进行分配。

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

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

#### 4.4.3 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。

## 4.5 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 年美股整体震荡上行，三大指数均实现两位数上涨，主导因素：一是美联储货币政策转向，年内三次降息，流动性环境宽松，支撑风险偏好；二是 AI 产业持续爆发，算力、硬件、软件、云服务盈利超预期，科技巨头成为核心引擎；三是美国经济韧性超预期，就业与消费稳健，避免衰退。全年仅在关税政策扰动时出现短期调整，随后快速收复，成长板块显著跑赢价值；港股方面，整体先抑后扬、震荡修复。国内经济预期逐步企稳、政策暖风频出，叠加美联储降息周期开启，外资与南向资金回流，估值从历史低位明显修复。互联网平台、生物医药及部分高股息核心资产领涨，市场结构从单边防御转向成长与价值共振。

操作方面，本基金全年股票仓位维持高位运行，以结构调整为主：欧美股方面，增加了科技、医药板块配置，同时降低金融板块仓位；港股方面，增加原材料、创新药板块配置，同时降低工业、消费板块配置。整体通过降低前期涨幅较大且高估值的板块仓位，切到估值低、偏红利风格的板块上，来应对市场回调风险。全年账户考虑汇率因素表现持平于基准。

### 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 2026 年，美股继续保持谨慎乐观；港股较前期相对积极乐观。

美股市场，大概率延续上行，风格由“AI 龙头单核”向“盈利驱动+周期扩散”演变，但估值已高、情绪亢奋下对盈利上修与基本面兑现的依赖显著提升，期间波动与主题分化加大，对择股与行业轮动的能力要求更高。在此背景下，我们看好具备技术壁垒、现金流稳定且受益于 AI 渗透加速的科技大盘龙头标的。2026 年美联储降息节奏虽然不确定性加大，但预期仍有降息机会，金融条件边际放松利好风险资产与久期敏感行业。业绩来看，有望高双位数增长，AI 渗透加速或将带来企业净利率抬升，驱动盈利上修延续。

港股市场，在经历了近 5 个月的调整之后，港股资产的配置性价比上升，预期在业绩期后将维持震荡上行趋势。从流动性、业绩、政策角度分别来看：

（1）流动性：短期逆风，新兴市场资金流向日韩等周边市场，港股成为阶段性资金流出标的，

叠加做空比例上升，短期情绪与资金面形成负反馈；同时市场阶段性聚焦 AI 主题，港股相关叙事偏弱，进一步压制风险偏好。但全年来看，美联储仍有降息空间，因而港股仍具有流动性支撑，若国内流动性同期超预期宽松，则估值可能快速修复。

(2) 业绩：随着估值切换到 2026 年，相较于纳指，调整后的恒科性价比重新显现。同时，其他行业也有业绩转暖的迹象或者维持高景气，比如创新药、有色、化工以及出海标的等，自下而上的个股挖掘仍然有机会。

(3) 政策：消费的进一步刺激政策或仍需等待，但随着“十五五”的各项规划落地出台，市场仍能找到相对确定的成长投资方向。同时近期地缘政治多变，除了资源民族主义带来的原材料持续涨价以外，政局稳定国家的资产或将有地缘安全溢价，中国资产吸引力会进一步提升，其中具备防御属性及稳定现金流优势的港股红利低波板块有一定配置机会。

#### 4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2025 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。

(一) 加强全面风险管理能力建设，提升投资合规控制效能。

公司风险管理部门紧密跟踪法律法规要求，在严格管控基金日常投资运作风险的同时，持续完善全面风险管理体系，提升基金市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险等关键风险的管控水平。坚持风控先行，审慎评估各类新产品与新业务方案，切实保护投资者合法权益。推动风险管理数字化转型，不断加强智能风控平台建设，提升系统监测预警能力。

(二) 强化培训教育及重点领域合规提示，牢固树立全员风险合规防范意识。

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

(三) 持续夯实公司合规管理体系，合规文化建设成效显著。

公司内控合规部门着力持续夯实合规管理体系，体系内“三道防线”各司其职、协同发力。公司积极践行中国特色金融文化，促进合规文化建设取得新实效；公司紧密跟进《推动公募基金高质量发展行动方案》，持续扎实推进监管新规定跟踪落实工作，全年加强建立全面、系统、规范的规章制度体系，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) 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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定, 对基金所持有的投资品种进行估值。保证基金估值的公平、合理, 保持估值政策和程序的一贯性。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

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, 估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验, 熟悉相关法律法规, 具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。估值委员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应用性的情况后, 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。基金经理可参与估值原则和方法的讨论, 但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

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。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司签署服务协议, 由其按约定提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

#### 4.9 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的规定, 本基金对上一年度及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。

#### 4.10 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

#### 4.11 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合规守信、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关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 审计报告

## 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2026）审字第 70066074_B37 号

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	交银施罗德环球精选价值证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了交银施罗德环球精选价值证券投资基金的财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的交银施罗德环球精选价值证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了交银施罗德环球精选价值证券投资基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》和中国注册会计师职业道德守则，我们独立于交银施罗德环球精选价值证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。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。

其他信息	<p>交银施罗德环球精选价值证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，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导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估交银施罗德环球精选价值证券投资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，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督交银施罗德环球精选价值证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>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。</p> <p>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：</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(3) 评价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。</p> <p>(4) 对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，就可能对交银施罗德环球精选价值证券投资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</p>

	<p>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施罗德环球精选价值证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(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。</p> <p>我们与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。</p>	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	费泽旭	赵梓云
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层	
审计报告日期	2026年3月26日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：交银施罗德环球精选价值证券投资基金

报告截止日：2025年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	19,965,528.26	9,573,371.67
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	167,194,817.60	82,187,290.80
其中：股票投资		167,194,817.60	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		45,429.91	16,708.82
应收申购款		1,078,249.07	309,893.03
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		188,284,024.84	92,087,264.32
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	3,018.78
应付赎回款		4,207,730.58	267,115.52
应付管理人报酬		191,051.22	139,147.01
应付托管费		31,841.90	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	7.4.7.9	164,840.11	95,552.01
负债合计		4,595,463.81	531,889.68
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	62,457,993.20	35,055,404.59
未分配利润	7.4.7.12	121,230,567.83	56,499,970.05
净资产合计		183,688,561.03	91,555,374.64
负债和净资产总计		188,284,024.84	92,087,264.32

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.941 元，基金份额总额 62,457,993.20 份。

## 7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		41,405,663.89	12,644,524.97
1. 利息收入		145,708.37	62,222.72
其中：存款利息收入	7.4.7.13	145,708.37	62,222.72
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 “-”填列）		38,224,303.74	3,342,878.72
其中：股票投资收益	7.4.7.14	33,834,769.35	1,462,695.15
基金投资收益	7.4.7.15	-	-

债券投资收益	7.4.7.16	-	-
资产支持证券投资 收益	7.4.7.17	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.18	-	-
衍生工具收益	7.4.7.19	-8,457.15	1,043.18
股利收益	7.4.7.20	4,397,991.54	1,879,140.39
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产 生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益 (损失以“-”号填 列)	7.4.7.21	7,986,797.78	9,133,244.61
4. 汇兑收益(损失以 “-”号填列)		-5,538,074.22	79,936.40
5. 其他收入(损失以 “-”号填列)	7.4.7.22	586,928.22	26,242.52
<b>减：二、营业总支出</b>		3,666,546.61	1,870,265.24
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,998,040.38	1,484,080.72
2. 托管费	7.4.10.2.2	505,421.04	288,571.21
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资 产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.23	-	-
7. 税金及附加		-	3.76
8. 其他费用	7.4.7.24	163,085.19	97,609.55
<b>三、利润总额(亏损总 额以“-”号填列)</b>		37,739,117.28	10,774,259.73
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以 “-”号填列)</b>		37,739,117.28	10,774,259.73
<b>五、其他综合收益的税 后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		37,739,117.28	10,774,259.73

### 7.3 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12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日
----	-----------------------------

	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	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)	27,402,588.61	-	64,730,597.78	92,133,186.39
(一)、综合收益总额	-	-	37,739,117.28	37,739,117.28
(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)	27,402,588.61	-	32,295,611.42	59,698,200.03
其中：1. 基金申购款	206,997,108.80	-	329,923,634.34	536,920,743.14
2. 基金赎回款	-	-	-	-477,222,543.11
	179,594,520.19		297,628,022.92	
(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	62,457,993.20	-	121,230,567.83	183,688,561.03
项目	上年度可比期间			
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	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)	1,214,352.53	-	13,119,614.84	14,333,967.37
(一)、综合收益总额	-	-	10,774,259.73	10,774,259.73
(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)	1,214,352.53	-	2,345,355.11	3,559,707.64

“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	12,101,921.16	-	18,513,678.88	30,615,600.04
2. 基金赎回款	-10,887,568.63	-	-16,168,323.77	-27,055,892.40
(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	35,055,404.59	-	56,499,970.05	91,555,374.64

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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]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(JPMorgan Chase Bank, 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%。

本基金的基金资产将投资于全球主要证券市场,其中投资于与中国证监会签订了双边监管合

作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产的比例不超过基金资产净值的 10%。

如与中国证监会签订双边监管合作谅解备忘录的国家或地区增加、减少或变更，本基金投资的主要证券市场将相应调整。

本基金对基金的投资限于除香港以外的国际市场。

如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

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 Global Large Mid Cap Index)  $+30\% \times$  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 2026 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 7.4.4 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。

#### 7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

###### (1) 金融资产的分类

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

#### 债务工具

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

##### 以摊余成本计量：

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

##### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

#### 权益工具

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

#### (2) 金融负债

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

#### (3) 衍生金融工具

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

#### 7.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期

损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分/折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分/折算日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分/折算比例计算确认。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计

亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为:按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息后的净额确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费(若有)在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金的每份基金份额享有同等分配权;收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额,不足以支付银行转账或其他手续费用时,基金登记结算机构可将投资人的现金红利按红利划款日的基金份额净值自动转为基金份额;本基金收益每年最多分配 10 次,年度基金收益分配比例不低于年度可分配收益的 10%;在符合有关基金分红条件的前提下,本基金收益每年至少分配一次,但若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配;本基金收益分配方式分为两种:现金分红与红利再投资,投资人可选择现金红利或将现金红利按红利再投日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资;若投资人不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;基金投资当期出现净亏损,则不进行收益分配;基金当期收益应先弥补上期亏损后,方可进行当期收益分配;法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。外币货币性项目(如涉

及），于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

无。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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；

根据财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期；

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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	19,965,528.26	9,573,371.67

等于：本金	19,964,409.70	9,573,056.46
加：应计利息	1,118.56	315.21
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	19,965,528.26	9,573,371.67

注：于 2025 年 12 月 31 日，活期存款中包括的外币余额为美元活期存款 487,765.95 元（折合人民币 3,428,409.32 元），港币活期存款 7,396,786.37 元（折合人民币 6,679,743.56 元），欧元活期存款 8.26 元（折合人民币 68.17 元），加币活期存款 0.01 元（折合人民币 0.05 元）和韩元活期存款 27.00 元（折合人民币 0.13 元）。于 2024 年 12 月 31 日，活期存款中包括的外币余额为美元活期存款 647,477.93 元（折合人民币 4,654,330.36 元），港币活期存款 2,162,764.38 元（折合人民币 2,001,652.49 元），欧元活期存款 8.26 元（折合人民币 61.48 元），加币活期存款 0.01 元（折合人民币 0.05 元）和韩元活期存款 27.00 元（折合人民币 0.13 元）。

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	136,609,689.68	-	167,194,817.60	30,585,127.92
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	136,609,689.68	-	167,194,817.60	30,585,127.92
项目	上年度末 2024年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	59,588,960.66	-	82,187,290.80	22,598,330.14
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	59,588,960.66	-	82,187,290.80	22,598,330.14

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

##### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

##### 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

##### 7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

#### 7.4.7.5 债权投资

##### 7.4.7.5.1 债权投资情况

无。

##### 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.8 其他资产

无。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	14,840.11	552.01
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	30,000.00	15,000.00
预提信息披露费	120,000.00	80,000.00
合计	164,840.11	95,552.01

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	
	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	206,997,108.80	206,997,108.80
本期赎回（以“-”号填列）	-179,594,520.19	-179,594,520.19
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	62,457,993.20	62,457,993.20
-----	---------------	---------------

注：1、如果本报告期间发生红利再投、转换入业务，则总申购份额中包含该业务；

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

#### 7.4.7.11 其他综合收益

无。

#### 7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	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	29,752,319.50	7,986,797.78	37,739,117.28
本期基金份额交易产生的变动数	29,365,096.69	2,930,514.73	32,295,611.42
其中：基金申购款	281,508,244.53	48,415,389.81	329,923,634.34
基金赎回款	-252,143,147.84	-45,484,875.08	-297,628,022.92
本期已分配利润	-5,304,130.92	-	-5,304,130.92
本期末	105,921,928.48	15,308,639.35	121,230,567.83

#### 7.4.7.13 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12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
活期存款利息收入	145,475.87	62,170.19
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	232.50	52.53
合计	145,708.37	62,222.72

#### 7.4.7.14 股票投资收益

##### 7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
股票投资收益——买卖 股票差价收入	33,834,769.35	1,462,695.15
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	33,834,769.35	1,462,695.15

#### 7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月 31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年 12月31日
卖出股票成交总 额	499,620,325.68	58,113,422.69
减：卖出股票成本 总额	464,086,674.71	56,453,418.99
减：交易费用	1,698,881.62	197,308.55
买卖股票差价收 入	33,834,769.35	1,462,695.15

#### 7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 7.4.7.15 基金投资收益

无。

#### 7.4.7.16 债券投资收益

##### 7.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

无。

##### 7.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

##### 7.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

##### 7.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

#### 7.4.7.17 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

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

无。

## 7.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

## 7.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

## 7.4.7.18 贵金属投资收益

## 7.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

无。

## 7.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

## 7.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

## 7.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

## 7.4.7.19 衍生工具收益

## 7.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
卖出权证成交总额	50,388.53	27,103.48
减：卖出权证成本总额	58,845.68	26,029.00
减：交易费用	-	-
减：买卖权证差价收入 应缴纳增值税额	-	31.30
买卖权证差价收入	-8,457.15	1,043.18

## 7.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 7.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
股票投资产生的股利	4,397,991.54	1,879,140.39

收益		
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	4,397,991.54	1,879,140.39

#### 7.4.7.21 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 12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024 年12月31日
1. 交易性金融资产	7,986,797.78	9,133,244.61
股票投资	7,986,797.78	9,133,244.61
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	7,986,797.78	9,133,244.61

#### 7.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12 月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024 年12月31日
基金赎回费收入	586,864.86	26,242.52
其他	63.36	-
合计	586,928.22	26,242.52

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的25%归入基金资产。

2、本基金的赎回费收入包括转换费收入，其中转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的不低于赎回费的25%归入转出基金的基金资产。

#### 7.4.7.23 信用减值损失

无。

#### 7.4.7.24 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
审计费用	30,000.00	15,000.00
信息披露费	120,000.00	80,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	11,982.36	1,383.77
存托保管费	1,102.83	1,225.78
合计	163,085.19	97,609.55

#### 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 2026 年 01 月 13 日宣告分红，向截至 2026 年 01 月 15 日止登记在册的基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 1.700 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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

无。

###### 7.4.10.1.2 债券交易

无。

**7.4.10.1.3 债券回购交易**

无。

**7.4.10.1.4 基金交易**

无。

**7.4.10.1.5 权证交易**

无。

**7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金**

无。

**7.4.10.2 关联方报酬****7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年 12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024 年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,998,040.38	1,484,080.72
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,105,075.58	409,325.92
应支付基金管理人的净管理费	1,254,095.45	776,853.89
应支付投资顾问的投资顾问费	638,869.35	297,900.91

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。

**7.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年 12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	505,421.04	288,571.21

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。

**7.4.10.2.3 销售服务费**

无。

**7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

无。

**7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明****7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

无。

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

无。

**7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况****7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自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12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31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
报告期间申购/买入总份额	508,794.58	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	8,721,217.11	-
报告期末持有的基金份额	-	8,212,422.53
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	23.43%

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；

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。

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

无。

**7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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
摩根大通银行_活期存款	10,107,678.33	59,437.18	6,655,938.86	56,404.79
中国建设银行_活期存款	9,857,849.93	86,038.69	2,917,432.81	5,765.40

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，存款利率参考银行同业利率及银行存款利率确定。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

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	-

#### 7.4.12 期末（2025 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

无。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

#### 7.4.13.2 信用风险

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

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。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

### 7.4.13.3 流动性风险

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

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

于报告期末，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同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。

### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期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。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

### 7.4.13.4 市场风险

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

#### 7.4.13.4.1 利率风险

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

本基金持有及承担的利率敏感性资产主要为货币资金，除货币资金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。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 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	19,965,528.26	-	-	-	19,965,528.26
交易性金融资产	-	-	-	167,194,817.60	167,194,817.60
应收股利	-	-	-	45,429.91	45,429.91
应收申购款	1,627.95	-	-	1,076,621.12	1,078,249.07
资产总计	19,967,156.21	-	-	168,316,868.63	188,284,024.84
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,207,730.58	4,207,730.58
应付管理人报酬	-	-	-	191,051.22	191,051.22
应付托管费	-	-	-	31,841.90	31,841.90
其他负债	-	-	-	164,840.11	164,840.11
负债总计	-	-	-	4,595,463.81	4,595,463.81
利率敏感度缺口	19,967,156.21	-	-	163,721,404.82	183,688,561.03
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。

#### 7.4.13.4.1.2 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。

#### 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。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2025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	3,428,409 .32	6,679,743.56	68.35	10,108,221.23
交易性金融资产	57,728,05 8.90	84,214,144.31	25,252,614.39	167,194,817.60
应收股利	5,763.20	17,955.37	21,711.34	45,429.91
资产合计	61,162,23 1.42	90,911,843.24	25,274,394.08	177,348,468.74
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净额	61,162,23 1.42	90,911,843.24	25,274,394.08	177,348,468.74
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	31,121,821.04	13,649,091.03	82,187,290.80

	8.73			
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

#### 7.4.13.4.2.2 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12月31日）	上年度末（2024年12月31日）
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	8,867,423.44	4,442,851.27
2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-8,867,423.44	-4,442,851.27	

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金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。

#### 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 2025年12月31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	167,194,817.60	91.02	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	167,194,817.60	91.02	82,187,290.80	89.77

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元)	
		本期末(2025年12月31日)	上年度末(2024年12月31日)
	1. 业绩比较基准上涨 5%	9,651,720.72	4,347,883.03
2. 业绩比较基准下降 5%	-9,651,720.72	-4,347,883.03	

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	167,194,817.60	82,187,290.80
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	167,194,817.60	82,187,290.80

##### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于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。

##### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

###### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

无。

###### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

无。

##### 7.4.14.3 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。

##### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括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。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	167,194,817.60	88.80
	其中：普通股	167,194,817.60	88.80
	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	19,965,528.26	10.60
8	其他各项资产	1,123,678.98	0.60
9	合计	188,284,024.84	100.00

### 8.2 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	84,214,144.31	45.85
美国	57,728,058.90	31.43
英国	6,413,239.83	3.49
荷兰	3,508,848.45	1.91
德国	3,366,068.57	1.83
西班牙	3,217,767.04	1.75
瑞士	3,109,558.42	1.69
日本	2,604,233.00	1.42
意大利	1,780,458.04	0.97
法国	1,252,441.04	0.68
合计	167,194,817.60	91.02

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。

### 8.3 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	25,011,282.80	13.62
非必需消费品	20,235,495.69	11.02
必需消费品	6,613,909.35	3.60
能源	1,706,501.86	0.93
金融	21,176,178.50	11.53
医疗保健	22,216,793.52	12.09
工业	8,876,940.34	4.83
材料	16,329,252.36	8.89
房地产	5,367,249.95	2.92
科技	36,628,282.23	19.94
公用事业	3,032,931.00	1.65
合计	167,194,817.60	91.02

注：本报告采用彭博 BICS 一级分类标准编制。

### 8.4 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	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股	700 HK	香港联合交易所	中国香港	17,000	9,195,862.26	5.01
2	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	中国宏桥集团有限公司	1378 HK	香港联合交易所	中国香港	296,000	8,719,516.05	4.75
3	SEMICONDUCTOR MANUFACTURER-H	中芯国际集成电路制造有限公司	981 HK	香港联合交易所	中国香港	105,000	6,774,983.57	3.69
4	ALPHABET INC-CL A	谷歌公司	GOOGL US	美国证券交易所	美国	2,787	6,131,440.13	3.34
5	China Gold	中国黄金国际	2099 HK	香港联合交易所	中国香港	40,900	5,795,127.10	3.15

	International Resources Corp Ltd	资源有限公司		所				
6	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	133,800	5,188,416.93	2.82
7	NVIDIA CORP	英伟达公司	NVDA US	美国证券交易所	美国	3,944	5,170,076.01	2.81
8	MICROSOFT CORP	微软公司	MSFT US	美国证券交易所	美国	1,440	4,894,946.29	2.66
9	HSBC HOLDINGS PLC	汇丰控股有限公司	5 HK	香港联合交易所	中国香港	43,600	4,819,307.31	2.62
10	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	香港交易及结算有限公司	388 HK	香港联合交易所	中国香港	12,900	4,748,326.78	2.58
11	TCL Electronics Holdings Ltd	TCL 电子控股有限公司	1070 HK	香港联合交易所	中国香港	489,000	4,583,771.15	2.50
12	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	吉利汽车控股有限公司	175 HK	香港联合交易所	中国香港	256,000	4,138,183.17	2.25
13	Sichuan Kelun-Biotech Biopharmaceutical Co Ltd	四川科伦博泰生物制药股份有限公司	6990 HK	香港联合交易所	中国香港	10,900	3,860,564.40	2.10
14	Wuxi Biologics Cayman Inc	药明生物	2269 HK	香港联合交易所	中国香港	134,500	3,818,752.71	2.08
15	APPLE INC	苹果公司	AAPL US	美国证券交易所	美国	1,770	3,382,203.74	1.84

				所				
16	CHINA EAST EDUCATION HOLDING	中国东方教育控股有限公司	667 HK	香港联合交易所	中国香港	548,000	3,285,983.30	1.79
17	Broadcom Inc	博通股份有限公司	AVGO US	美国证券交易所	美国	1,247	3,033,536.60	1.65
18	Meta Platforms Inc	Meta 平台股份有限公司	META US	美国证券交易所	美国	594	2,755,946.51	1.50
19	Keymed Biosciences Inc	康诺亚	2162 HK	香港联合交易所	中国香港	52,000	2,509,965.59	1.37
20	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	银河娱乐集团有限公司	27 HK	香港联合交易所	中国香港	70,000	2,422,368.74	1.32
21	ELI LILLY & CO	礼来	LLY US	美国证券交易所	美国	290	2,190,576.13	1.19
22	Lens Technology Co Ltd	蓝思科技股份有限公司	6613 HK	香港联合交易所	中国香港	94,800	2,160,799.16	1.18
23	AMAZON.COM INC	亚马逊公司	AMZN US	美国证券交易所	美国	1,297	2,104,236.74	1.15
24	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	210,000	1,981,765.66	1.08
25	VISA INC-CLASS A SHARES	维萨公司	V US	美国证券交易所	美国	790	1,947,405.65	1.06
26	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	玖龙纸业(控股)有限公司	2689 HK	香港联合交易所	中国香港	340,000	1,814,609.21	0.99
27	ASML Holding NV	阿斯麦控股公司	ASML NA	荷兰证券交易所	荷兰	237	1,802,346.59	0.98
28	INTESA	意大利	ISP IM	意大利	意大	36,433	1,780,458.04	0.97

	SANPAOLO	联合圣保罗银行股份有限公司		证券交易所	利			
29	ASTRAZENECA PLC	阿斯利康公共有限公司	AZN LN	英国伦敦证券交易所	英国	1,356	1,767,448.20	0.96
30	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	西班牙对外银行	BBVA SM	西班牙证券交易所	西班牙	10,644	1,761,412.19	0.96
31	Roche Holding AG	罗氏	ROG SW	瑞士证券交易所	瑞士	602	1,752,709.82	0.95
32	Arista Networks Inc	Arista 网络股份有限公司	ANET US	美国证券交易所	美国	1,854	1,707,503.71	0.93
33	Shell PLC	壳牌公共有限公司	SHELL NA	荷兰证券交易所	荷兰	6,569	1,706,501.86	0.93
34	AMERICAN EXPRESS CO	美国运通	AXP US	美国证券交易所	美国	635	1,651,193.40	0.90
35	Tesco PLC	特易购	TSCO LN	英国伦敦证券交易所	英国	38,942	1,626,172.88	0.89
36	NextEra Energy Inc	新纪元能源公司	NEE US	美国证券交易所	美国	2,794	1,576,576.15	0.86
37	Netflix Inc	奈飞公司	NFLX US	美国证券交易所	美国	2,350	1,548,697.68	0.84
38	MORGAN STANLEY	摩根士丹利	MS US	美国证券交易所	美国	1,207	1,506,122.20	0.82
39	SAP SE	SAP 公司	SAP GR	德国证券交易所	德国	870	1,496,078.95	0.81
40	IBERDROLA SA	伊维尔德罗拉股份公	IBE SM	西班牙证券交易所	西班牙	9,556	1,456,354.85	0.79

		司						
41	Monster Beverage Corp	怪兽饮料公司	MNST US	美国证券交易所	美国	2,548	1,373,112.35	0.75
42	Cie Financiere Richemont SA	瑞士历峰集团	CFR SW	瑞士证券交易所	瑞士	889	1,356,848.60	0.74
43	PROCTER & GAMBLE CO/THE	宝洁	PG US	美国证券交易所	美国	1,290	1,299,413.55	0.71
44	Orient Securities Co Ltd/China	东方证券	3958 HK	香港联合交易所	中国香港	210,000	1,297,155.71	0.71
45	COCA-COLA CO/THE	可口可乐	KO US	美国证券交易所	美国	2,549	1,252,536.31	0.68
46	Schneider Electric SE	施耐德电气股份公司	SU FP	法国证券交易所	法国	646	1,252,441.04	0.68
47	Tencent Music Entertainment Group	腾讯音乐娱乐集团	1698 HK	香港联合交易所	中国香港	20,000	1,246,223.11	0.68
48	BOOKING HOLDINGS INC	缤客控股公司	BKNG US	美国证券交易所	美国	33	1,242,170.94	0.68
49	Tapestry Inc	Tapestry 公司	TPR US	美国证券交易所	美国	1,380	1,239,336.29	0.67
50	Laopu Gold Co Ltd	老铺黄金股份有限公司	6181 HK	香港联合交易所	中国香港	2,100	1,171,991.56	0.64
51	GSK PLC	葛兰素史克公共有限公司	GSK LN	英国伦敦证券交易所	英国	6,685	1,152,837.34	0.63
52	MEITUAN-CLASS B	美团	3690 HK	香港联合交易所	中国香港	12,200	1,138,090.68	0.62

53	General Electric Co	通用电气航空航天	GE US	美国证券交易所	美国	496	1,073,880.31	0.58
54	Haleon PLC	Haleon 公司	HLN LN	英国伦敦证券交易所	英国	29,997	1,062,674.26	0.58
55	Innovent Biologics Inc	信达生物制药	1801 HK	香港联合交易所	中国香港	15,000	1,032,875.13	0.56
56	PARKER HANNIFIN CORP	派克汉尼汾公司	PH US	美国证券交易所	美国	166	1,025,553.65	0.56
57	SharkNinja Inc	尚科宁家	SN US	美国证券交易所	美国	1,292	1,016,187.35	0.55
58	TJX COMPANIES INC	TJX 公司	TJX US	美国证券交易所	美国	913	985,760.59	0.54
59	Bayerische Motoren Werke AG	宝马汽车股份公司	BMW GR	德国证券交易所	德国	1,254	963,996.65	0.52
60	HOYA CORP	Hoya 株式会社	7741 JP	日本东京证券交易所	日本	900	955,761.84	0.52
61	Spotify Technology SA	Spotify 科技股份有限公司	SPOT US	美国证券交易所	美国	234	955,116.50	0.52
62	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	939,128.45	0.51
63	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	643	926,591.66	0.50
64	SIEMENS AG-REG	西门子	SIE GR	德国证券交易所	德国	459	905,992.97	0.49
65	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	195	895,793.50	0.49

		司						
66	KLA CORP	科磊公司	KLAC US	美国证券交易所	美国	104	888,217.65	0.48
67	MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GRO	三菱日联金融集团	8306 JP	日本东京证券交易所	日本	7,700	860,690.07	0.47
68	MEDTRONIC PLC	美敦力	MDT US	美国证券交易所	美国	1,238	835,880.92	0.46
69	BOSTON SCIENTIFIC CORP	波士顿科学	BSX US	美国证券交易所	美国	1,229	823,670.98	0.45
70	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	中远海运能源运输股份有限公司	1138 HK	香港联合交易所	中国香港	94,000	814,921.55	0.44
71	LLOYDS BANKING GROUP PLC	劳埃德银行集团	LLOY LN	英国伦敦证券交易所	英国	86,597	804,107.15	0.44
72	Uber Technologies Inc	优步技术股份有限公司	UBER US	美国证券交易所	美国	1,389	797,734.99	0.43
73	BRIDGESTONE CORP	普利司通株式会社	5108 JP	日本东京证券交易所	日本	5,000	787,781.09	0.43
74	AUTOZONE INC	AutoZone 股份有限公司	AZO US	美国证券交易所	美国	32	762,821.61	0.42
75	Cadence Design Systems Inc	Cadence 设计系统股份有限公司	CDNS US	美国证券交易所	美国	334	733,818.81	0.40
76	Qyuns Therapeutics Co Ltd	江苏荃信生物医药有限公司	2509 HK	香港联合交易所	中国香港	34,000	576,622.01	0.31
77	HANG LUNG PROPERTIES	恒隆地产有限公司	101 HK	香港联合交易所	中国香港	23,000	178,833.02	0.10

	S LTD	公司		所			
--	-------	----	--	---	--	--	--

## 8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

### 8.5.1 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	Tencent Holdings Ltd	700 HK	27,300,591.80	29.82
2	Xiaomi Corp	1810 HK	26,495,849.62	28.94
3	Industrial & Commercial Bank of China Ltd	1398 HK	23,091,598.89	25.22
4	ANTA Sports Products Ltd	2020 HK	18,796,843.98	20.53
5	TCL Electronics Holdings Ltd	1070 HK	18,326,572.07	20.02
6	Agricultural Bank of China Ltd	1288 HK	14,910,504.86	16.29
7	HSBC HOLDINGS PLC	5 HK	12,789,840.45	13.97
8	Fuyao Glass Industry Group Co Ltd	3606 HK	12,407,587.90	13.55
9	SEMICONDUCTOR MANUFACTURI-H	981 HK	11,966,207.87	13.07
10	Sunny Optical Technology Group Co Ltd	2382 HK	11,919,571.35	13.02
11	Cowell e Holdings Inc	1415 HK	11,459,120.53	12.52
12	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	1378 HK	11,103,761.07	12.13
13	China Gold International Resources Corp Ltd	2099 HK	11,065,132.89	12.09
14	China Resources Mixc Lifestyle Services Ltd	1209 HK	9,195,018.79	10.04
15	Giant Biogene Holding Co ltd	2367 HK	9,132,264.70	9.97
16	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	175 HK	8,765,292.85	9.57

17	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	388 HK	8,300,333.00	9.07
18	Sinotruk Hong Kong Ltd	3808 HK	7,797,475.54	8.52
19	MICROSOFT CORP	MSFT US	7,244,748.87	7.91
20	NVIDIA CORP	NVDA US	7,225,484.82	7.89
21	ALPHABET INC-CL A	GOOGL US	6,854,830.44	7.49
22	Bank of China Ltd	3988 HK	6,690,853.22	7.31
23	Meta Platforms Inc	META US	5,930,893.84	6.48
24	Alibaba Group Holding Ltd	9988 HK	5,861,812.01	6.40
25	APPLE INC	AAPL US	5,702,818.12	6.23
26	C&D International Investment Group Ltd	1908 HK	5,154,290.63	5.63
27	CHINA EAST EDUCATION HOLDING	667 HK	5,132,021.82	5.61
28	Mao Geping Cosmetics Co LTD	1318 HK	4,951,237.63	5.41
29	Sichuan Kelun-Biotech Biopharmaceutical Co Ltd	6990 HK	4,719,876.95	5.16
30	MEITUAN-CLASS B	3690 HK	4,506,381.77	4.92
31	Broadcom Inc	AVGO US	4,461,330.88	4.87
32	GDS Holdings Ltd	9698 HK	4,408,375.84	4.81
33	Wuxi Biologics Cayman Inc	2269 HK	4,318,390.29	4.72
34	AMAZON.COM INC	AMZN US	4,249,399.03	4.64
35	Elevance Health Inc	ELV US	4,143,667.08	4.53
36	Netflix Inc	NFLX US	4,107,958.41	4.49
37	China Taiping Insurance Holdings Co Ltd	966 HK	4,036,205.79	4.41
38	Ping An Insurance Group Co of China Ltd	2318 HK	3,850,935.82	4.21
39	Kingdee International Software Group Co Ltd	268 HK	3,753,748.39	4.10
40	ELI LILLY & CO	LLY US	3,737,278.31	4.08

41	VISA INC-CLASS A SHARES	V US	3,684,837.05	4.02
42	BOSTON SCIENTIFIC CORP	BSX US	3,683,075.80	4.02
43	Trip.com Group Ltd	9961 HK	3,645,874.42	3.98
44	SAP SE	SAP GR	3,601,909.13	3.93
45	NextEra Energy Inc	NEE US	3,523,232.30	3.85
46	PROCTER & GAMBLE CO/THE	PG US	3,511,282.37	3.84
47	Laopu Gold Co Ltd	6181 HK	3,505,248.71	3.83
48	INTESA SANPAOLO	ISP IM	3,334,212.69	3.64
49	Spotify Technology SA	SPOT US	3,315,373.62	3.62
50	J&T Global Express Ltd	1519 HK	3,279,665.99	3.58
51	Cie Financiere Richemont SA	CFR SW	3,250,808.40	3.55
52	Haleon PLC	HLN LN	3,138,042.11	3.43
53	AMERICAN EXPRESS CO	AXP US	3,107,342.51	3.39
54	MORGAN STANLEY	MS US	2,935,302.34	3.21
55	Arista Networks Inc	ANET US	2,842,315.95	3.10
56	Innovent Biologics Inc	1801 HK	2,799,596.53	3.06
57	Schneider Electric SE	SU FP	2,737,960.56	2.99
58	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	27 HK	2,683,668.09	2.93
59	Lens Technology Co Ltd	6613 HK	2,674,209.02	2.92
60	CSSC Offshore and Marine Engineering Group Co Ltd	317 HK	2,594,793.42	2.83
61	BeiGene Ltd	6160 HK	2,586,194.14	2.82
62	Minth Group Ltd	425 HK	2,569,386.46	2.81
63	Roche Holding AG	ROG SW	2,555,380.69	2.79
64	COCA-COLA CO/THE	KO US	2,509,753.98	2.74
65	Coterra Energy Inc	CTRA US	2,462,225.15	2.69

66	LLOYDS BANKING GROUP PLC	LLOY LN	2,393,022.37	2.61
67	Tesco PLC	TSCO LN	2,333,969.27	2.55
68	PARKER HANNIFIN CORP	PH US	2,300,734.32	2.51
69	TotalEnergies SE	TTE FP	2,285,946.03	2.50
70	General Electric Co	GE US	2,257,652.47	2.47
71	ASML Holding NV	ASML NA	2,256,600.66	2.46
72	Uber Technologies Inc	UBER US	2,239,420.11	2.45
73	AMETEK Inc	AME US	2,208,116.60	2.41
74	BOOKING HOLDINGS INC	BKNG US	2,183,385.95	2.38
75	KLA CORP	KLAC US	2,143,126.15	2.34
76	Shenzhou International Group Holdings Ltd	2313 HK	2,141,982.90	2.34
77	IBERDROLA SA	IBE SM	2,070,729.43	2.26
78	Salesforce Inc	CRM US	2,005,187.93	2.19
79	AUTOZONE INC	AZO US	2,002,145.51	2.19
80	China Life Insurance Co Ltd	2628 HK	1,993,950.02	2.18
81	Howmet Aerospace Inc	HWM US	1,915,747.77	2.09
82	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	BBVA SM	1,894,735.16	2.07
83	Veeva Systems Inc	VEEV US	1,873,086.22	2.05
84	Heineken NV	HEIA NA	1,870,953.86	2.04
85	TJX COMPANIES INC	TJX US	1,865,523.86	2.04
86	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	2689 HK	1,862,836.70	2.03
87	Adobe Inc	ADBE US	1,841,601.41	2.01
88	Tencent Music Entertainment Group	1698 HK	1,839,995.26	2.01
89	mitsubishi UFJ FINANCIAL GRO	8306 JP	1,836,603.05	2.01
90	SIEMENS AG-REG	SIE GR	1,834,983.90	2.00

注：1、“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；

2、此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

## 8.5.2 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	30,250,818.04	33.04
2	Industrial & Commercial Bank of China Ltd	1398 HK	23,846,704.81	26.05
3	TCL Electronics Holdings Ltd	1070 HK	23,192,490.65	25.33
4	Tencent Holdings Ltd	700 HK	23,178,478.34	25.32
5	ANTA Sports Products Ltd	2020 HK	20,174,088.42	22.03
6	Agricultural Bank of China Ltd	1288 HK	16,807,072.90	18.36
7	Fuyao Glass Industry Group Co Ltd	3606 HK	15,039,014.41	16.43
8	Cowell e Holdings Inc	1415 HK	13,416,623.93	14.65
9	Sunny Optical Technology Group Co Ltd	2382 HK	10,712,284.83	11.70
10	China Gold International Resources Corp Ltd	2099 HK	10,659,737.63	11.64
11	Giant Biogene Holding Co ltd	2367 HK	9,948,082.85	10.87
12	HSBC HOLDINGS PLC	5 HK	8,857,783.38	9.67
13	Sinotruk Hong Kong Ltd	3808 HK	7,892,405.50	8.62
14	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	1378 HK	7,501,010.12	8.19
15	MICROSOFT CORP	MSFT US	6,872,081.96	7.51
16	Bank of China Ltd	3988 HK	6,576,720.04	7.18
17	China Resources Mixc Lifestyle Services Ltd	1209 HK	6,316,338.54	6.90
18	SEMICONDUCTOR MANUFACTURI-H	981 HK	6,116,340.50	6.68
19	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	175 HK	6,102,129.65	6.66

20	ALPHABET INC-CL A	GOOGL US	5,911,456.70	6.46
21	Alibaba Group Holding Ltd	9988 HK	5,624,884.23	6.14
22	Mao Geping Cosmetics Co LTD	1318 HK	5,583,348.10	6.10
23	NVIDIA CORP	NVDA US	5,578,995.37	6.09
24	Innovent Biologics Inc	1801 HK	5,325,139.69	5.82
25	Meta Platforms Inc	META US	4,932,964.58	5.39
26	Netflix Inc	NFLX US	4,883,856.63	5.33
27	C&D International Investment Group Ltd	1908 HK	4,498,533.91	4.91
28	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	388 HK	4,411,042.59	4.82
29	Ping An Insurance Group Co of China Ltd	2318 HK	4,266,342.90	4.66
30	Elevance Health Inc	ELV US	4,058,765.66	4.43
31	China Taiping Insurance Holdings Co Ltd	966 HK	4,053,694.35	4.43
32	Trip.com Group Ltd	9961 HK	4,046,703.99	4.42
33	Kingdee International Software Group Co Ltd	268 HK	3,987,314.01	4.36
34	Spotify Technology SA	SPOT US	3,973,830.75	4.34
35	MEITUAN-CLASS B	3690 HK	3,962,604.83	4.33
36	APPLE INC	AAPL US	3,951,187.53	4.32
37	INTESA SANPAOLO	ISP IM	3,842,726.91	4.20
38	AMAZON.COM INC	AMZN US	3,691,225.15	4.03
39	SAP SE	SAP GR	3,352,958.85	3.66
40	LLOYDS BANKING GROUP PLC	LLOY LN	3,245,930.13	3.55
41	VISA INC-CLASS A SHARES	V US	3,217,059.72	3.51
42	TotalEnergies SE	TTE FP	3,190,411.83	3.48
43	GDS Holdings Ltd	9698 HK	3,189,506.63	3.48

44	PROCTER & GAMBLE CO/THE	PG US	3,155,302.15	3.45
45	Advanced Micro Devices Inc	AMD US	3,109,072.77	3.40
46	Coterra Energy Inc	CTRA US	3,061,564.86	3.34
47	AMERICAN EXPRESS CO	AXP US	3,061,191.61	3.34
48	GE Vernova Inc	GEV US	2,926,542.37	3.20
49	ELI LILLY & CO	LLY US	2,908,979.20	3.18
50	CHINA EAST EDUCATION HOLDING	667 HK	2,816,302.95	3.08
51	BOSTON SCIENTIFIC CORP	BSX US	2,781,456.45	3.04
52	Cie Financiere Richemont SA	CFR SW	2,774,914.85	3.03
53	Schneider Electric SE	SU FP	2,708,240.30	2.96
54	Haleon PLC	HLN LN	2,684,817.67	2.93
55	Arista Networks Inc	ANET US	2,643,324.88	2.89
56	General Electric Co	GE US	2,639,577.42	2.88
57	CSSC Offshore and Marine Engineering Group Co Ltd	317 HK	2,566,602.78	2.80
58	Liberty Media Corp-Liberty Formula One	FWONK US	2,504,759.60	2.74
59	Mint Group Ltd	425 HK	2,449,729.00	2.68
60	PARKER HANNIFIN CORP	PH US	2,441,718.34	2.67
61	Broadcom Inc	AVGO US	2,379,698.79	2.60
62	IBERDROLA SA	IBE SM	2,351,792.95	2.57
63	Uber Technologies Inc	UBER US	2,345,617.11	2.56
64	Merck & Co Inc	MRK US	2,302,130.18	2.51
65	NextEra Energy Inc	NEE US	2,267,902.91	2.48
66	BOOKING HOLDINGS INC	BKNG US	2,202,939.86	2.41
67	AMETEK Inc	AME US	2,196,739.73	2.40
68	Fair Isaac Corp	FICO US	2,172,489.40	2.37

69	Costco Wholesale Corp	COST US	2,148,599.44	2.35
70	Shenzhen International Group Holdings Ltd	2313 HK	2,143,371.80	2.34
71	TJX COMPANIES INC	TJX US	2,136,307.38	2.33
72	COCA-COLA CO/THE	KO US	2,118,978.65	2.31
73	Home Depot Inc/The	HD US	2,118,021.77	2.31
74	Adobe Inc	ADBE US	2,114,832.70	2.31
75	J&T Global Express Ltd	1519 HK	2,072,352.46	2.26
76	Yue Yuen Industrial Holdings Ltd	551 HK	2,068,208.16	2.26
77	ASML Holding NV	ASML NA	2,033,805.84	2.22
78	Keyence Corp	6861 JP	2,018,827.98	2.21
79	Baidu Inc	9888 HK	1,973,032.55	2.16
80	MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GRO	8306 JP	1,971,724.02	2.15
81	Sichuan Kelun-Biotech Biopharmaceutical Co Ltd	6990 HK	1,966,057.73	2.15
82	China Life Insurance Co Ltd	2628 HK	1,959,035.89	2.14
83	Duality Biotherapeutics Inc	9606 HK	1,932,686.60	2.11
84	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	BBVA SM	1,896,909.79	2.07
85	SIEMENS AG-REG	SIE GR	1,877,178.65	2.05
86	Veeva Systems Inc	VEEV US	1,864,089.53	2.04

注：1、“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；

2、此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

### 8.5.3 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	541,094,562.61
卖出收入（成交）总额	499,620,325.68

注：“买入成本”或“卖出收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相

关交易费用。

**8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合**

无。

**8.7 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。

**8.8 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。

**8.9 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。

**8.10 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。

**8.11 投资组合报告附注**

**8.11.1 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。

**8.11.2 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。

**8.11.3 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	45,429.91
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,078,249.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,123,678.98

**8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

无。

**8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

无。

### 8.11.6 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。

## § 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 (%)
18,866	3,310.61	22,859.63	0.04	62,435,133.57	99.96

### 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	7,312.84	0.01

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

无。

## § 10 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） 基金份额总额	508,425,627.85
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	206,997,108.80
减：本报告期基金总赎回份额	179,594,520.19
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	62,457,993.20

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，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。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

无。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。本期审计费为 30,000.00 元。目前该事务所已为本基金提供审计服务 2 年。

### 11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，未发生基金管理人受调查或处罚等情况。

#### 11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，未发生基金管理人相关从业人员受调查或处罚等情况。

#### 11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，未发生基金托管人受调查或处罚等情况。

#### 11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，未发生基金托管人相关从业人员受调查或处罚等情况。

### 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 (%)	
UOB Kay Hian	-	697,953,162.31	67.06	837,543.74	97.26	-

Limite d						
BofA Se curities Inc	-	51,478,144.62	4.95	1,822.16	0.21	-
Morgan Stanley & Co. LLC N ew York	-	30,527,953.24	2.93	1,468.76	0.17	-
Penserra Securi ties LLC	-	26,977,527.85	2.59	1,326.24	0.15	-
Jefferie s LLC New Y ork	-	26,471,465.63	2.54	821.60	0.1	-
Goldman Sachs & Co. LLC N ew York	-	26,412,510.23	2.54	1,507.10	0.18	-
TD Securiti es (USA) LLC	-	23,323,740.97	2.24	1,297.32	0.15	-
UBS Sec urities LLC Stamfo rd	-	18,399,279.67	1.77	640.02	0.07	-
BNP Paribas	-	16,985,980.53	1.63	2,008.11	0.23	-
Guzman & Company	-	15,153,675.17	1.46	610.80	0.07	-
BMO Capital Markets Corp.	-	13,621,085.06	1.31	723.20	0.08	-
Virtu Americas LLC	-	13,309,744.77	1.28	447.39	0.05	-
UBS AG	-	11,261,591.35	1.08	1,368.73	0.16	-

Optiver Vof Amster dam	-	11,124,512.94	1.07	1,353.78	0.16	-
Jefferie s Internat ional Limited	-	9,067,180.25	0.87	1,069.48	0.12	-
Goldman Sachs Internat ional	-	8,535,767.27	0.82	1,134.89	0.13	-
J.P. Morgan Securiti es PLC	-	5,785,756.44	0.56	849.80	0.1	-
Virtu Europe Trading Limited	-	5,407,717.31	0.52	675.94	0.08	-
Morgan Stanley & Co. Internat ional PLC	-	3,950,600.01	0.38	789.97	0.09	-
RBC Europe Limited	-	3,591,277.42	0.35	359.06	0.04	-
Instinet Europe Limite d Lon don	-	3,499,950.18	0.34	350.01	0.04	-
Joh. Berenber g Gossler & Co. KG	-	3,226,853.32	0.31	391.49	0.05	-
Macquari e Securiti es (Austral	-	3,005,822.96	0.29	601.05	0.07	-

ia) Limited						
J.P. Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	-	2,798,744.99	0.27	559.60	0.06	-
Liquidnet Europe Limited	-	1,981,200.77	0.19	209.61	0.02	-
UBS Securities Asia Limited	-	1,920,192.42	0.18	383.94	0.04	-
J.P. Morgan Securities LLC	-	1,177,447.07	0.11	51.09	0.01	-
Merrill Lynch International	-	1,099,482.62	0.11	275.75	0.03	-
Instinet LLC	-	990,097.29	0.10	75.33	0.01	-
Barclays Capital Securities Limited London	-	834,049.96	0.08	92.54	0.01	-
Redburn (Europe) Limited London	-	581,141.26	0.06	237.69	0.03	-
Citigroup Global Markets Limited	-	261,232.41	0.03	52.20	0.01	-

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。

### 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

无。

### 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8日
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
7	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
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	中国证监会规定媒体及公司网站	2025年2月13日

	额投资业务的公告		
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司为旗下基金的销售机构的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2025 年 4 月 22 日
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
21	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 7 月 2 日
22	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 7 月 11 日

23	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 7 月 11 日
24	交银施罗德环球精选价值证券投资基金 2025 年第 2 季度报告	中国证监会规定媒体及公司网站	2025 年 7 月 18 日
25	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 8 月 28 日
26	交银施罗德环球精选价值证券投资基金 2025 年中期报告	中国证监会规定媒体及公司网站	2025 年 8 月 29 日
27	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 10 月 27 日
28	交银施罗德环球精选价值证券投资基金 2025 年第 3 季度报告	中国证监会规定媒体及公司网站	2025 年 10 月 28 日
29	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 11 月 25 日
30	交银施罗德基金管理有限公司关于暂停旗下基金在中国农业银行股份有限公司办理定期定额赎回业务的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2025 年 12 月 15 日
31	交银施罗德基金管理有限公司董事变更公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2025 年 12 月 20 日
32	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 12 月 22 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)

		20%的时间区 间					
机构	1	2025/1/1- 2025/12/31	8,212,4 22.53	508,794 .58	8,721,2 17.11	-	-
产品特有风险							
本基金本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。							

## 12.2 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。

## § 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。

### 13.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

### 13.3 查阅方式

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

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