

交银施罗德优选回报灵活配置混合型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

2018年6月30日 基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司 基金托管人:中信银行股份有限公司

1.1 重要提示

基金管理人、基金托管人、基金销售机构不存在虚假记载、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。

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。

Table with 2 columns: 基金基本情况, 基金产品说明

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

Table with 2 columns: 主要会计数据和财务指标, 基金净值表现

3.2 基金净值表现

Table with 2 columns: 基金净值表现, 基金业绩比较基准

3.3 基金业绩比较基准

3.4 基金业绩比较基准



图:本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至建仓期末,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。

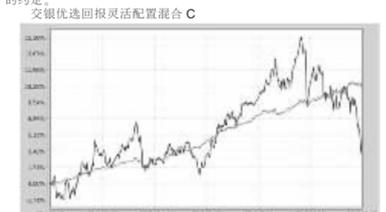


图:本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至建仓期末,本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及其管理基金的经验

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、中国际海运集装箱(集团)股份有限公司共同发起设立。

4.2 基金管理人及其管理基金的经验

4.3 基金管理人及其管理基金的经验

4.4 基金管理人及其管理基金的经验

4.5 基金管理人及其管理基金的经验

4.6 基金管理人及其管理基金的经验

4.7 基金管理人及其管理基金的经验

4.8 基金管理人及其管理基金的经验

4.9 基金管理人及其管理基金的经验

4.10 基金管理人及其管理基金的经验

4.11 基金管理人及其管理基金的经验

4.12 基金管理人及其管理基金的经验

4.13 基金管理人及其管理基金的经验

4.14 基金管理人及其管理基金的经验

4.15 基金管理人及其管理基金的经验

4.16 基金管理人及其管理基金的经验

4.17 基金管理人及其管理基金的经验

4.18 基金管理人及其管理基金的经验

4.19 基金管理人及其管理基金的经验

4.20 基金管理人及其管理基金的经验

理部负责对各账户公平交易执行事后分析,按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内同向交易交易差异进行分析,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 异常交易的专项说明

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没有超过该证券当日总成交量5%的情况。本基金与本公司管理的其他投资组合存在非同日常下(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 管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内本基金投资策略和市场分析

本报告期内,经济增速及市场预期在内部去杠杆进程和外部中美贸易摩擦的双重影响下呈现趋弱态势。固定资产投资增速走低,增速从二月份的7.9%回落至六月的6.0%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金(各类型)份额净值及业绩表现请见“3.1 主要财务指标”及“3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比”部分披露。

4.5 管理人对于宏观、证券市场及行业走势的简要展望

展望2018年下半年,紧信用环境下表外融资持续受到压缩,表内贷款和债券发行能否为实体经济融资需求提供有效供给仍待观察。

4.6 管理人对于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,经公司董事会批准并实行,并成立了估值委员会,估值委员会成员由研究员、基金运营部、风险管理部等部门相关人员组成。

4.7 管理人对于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,本基金在本报告期内对本报告期可供分配利润进行了收益分配,具体情况参见半年度报告正文“6.4.11 利润分配情况”。

4.8 报告期内管理人对于本基金持有人或基金资产净值预警情况的说明

本基金本报告期内无无需预警说明。

5 报告期内本基金托管人履行托管职责的情况

作为本基金的托管人,中信银行严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定。

6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:交银施罗德优选回报灵活配置混合型证券投资基金 报告截止日:2018年6月30日

Table with 2 columns: 资产负债表, 单位:人民币元

6.2 利润表

会计主体:交银施罗德优选回报灵活配置混合型证券投资基金 本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

Table with 2 columns: 利润表, 单位:人民币元

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:交银施罗德优选回报灵活配置混合型证券投资基金 本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

Table with 2 columns: 所有者权益(基金净值)变动表, 单位:人民币元

6.4 现金流量表

会计主体:交银施罗德优选回报灵活配置混合型证券投资基金 本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

Table with 2 columns: 现金流量表, 单位:人民币元

6.5 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:交银施罗德优选回报灵活配置混合型证券投资基金 本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

Table with 2 columns: 所有者权益(基金净值)变动表, 单位:人民币元

6.6 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:交银施罗德优选回报灵活配置混合型证券投资基金 本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

Table with 2 columns: 所有者权益(基金净值)变动表, 单位:人民币元

6.7 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:交银施罗德优选回报灵活配置混合型证券投资基金 本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

Table with 2 columns: 所有者权益(基金净值)变动表, 单位:人民币元

6.8 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:交银施罗德优选回报灵活配置混合型证券投资基金 本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

Table with 2 columns: 所有者权益(基金净值)变动表, 单位:人民币元

6.9 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:交银施罗德优选回报灵活配置混合型证券投资基金 本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

Table with 2 columns: 所有者权益(基金净值)变动表, 单位:人民币元

6.10 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:交银施罗德优选回报灵活配置混合型证券投资基金 本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

Table with 2 columns: 所有者权益(基金净值)变动表, 单位:人民币元

6.11 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:交银施罗德优选回报灵活配置混合型证券投资基金 本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

Table with 2 columns: 所有者权益(基金净值)变动表, 单位:人民币元

6.12 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:交银施罗德优选回报灵活配置混合型证券投资基金 本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

Table with 2 columns: 所有者权益(基金净值)变动表, 单位:人民币元

6.13 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:交银施罗德优选回报灵活配置混合型证券投资基金 本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

Table with 2 columns: 所有者权益(基金净值)变动表, 单位:人民币元

6.14 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:交银施罗德优选回报灵活配置混合型证券投资基金 本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

Table with 2 columns: 所有者权益(基金净值)变动表, 单位:人民币元

6.15 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:交银施罗德优选回报灵活配置混合型证券投资基金 本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

Table with 2 columns: 所有者权益(基金净值)变动表, 单位:人民币元

6.16 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:交银施罗德优选回报灵活配置混合型证券投资基金 本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

Table with 2 columns: 所有者权益(基金净值)变动表, 单位:人民币元

6.17 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:交银施罗德优选回报灵活配置混合型证券投资基金 本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

Table with 2 columns: 所有者权益(基金净值)变动表, 单位:人民币元

6.18 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:交银施罗德优选回报灵活配置混合型证券投资基金 本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

Table with 2 columns: 所有者权益(基金净值)变动表, 单位:人民币元

6.19 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:交银施罗德优选回报灵活配置混合型证券投资基金 本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

Table with 2 columns: 所有者权益(基金净值)变动表, 单位:人民币元

6.20 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:交银施罗德优选回报灵活配置混合型证券投资基金 本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

Table with 2 columns: 所有者权益(基金净值)变动表, 单位:人民币元

6.21 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:交银施罗德优选回报灵活配置混合型证券投资基金 本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

Table with 2 columns: 所有者权益(基金净值)变动表, 单位:人民币元

6.22 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:交银施罗德优选回报灵活配置混合型证券投资基金 本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

Table with 2 columns: 所有者权益(基金净值)变动表, 单位:人民币元

6.23 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:交银施罗德优选回报灵活配置混合型证券投资基金 本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

Table with 2 columns: 所有者权益(基金净值)变动表, 单位:人民币元

理部负责对各账户公平交易执行事后分析,按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内同向交易交易差异进行分析,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 异常交易的专项说明

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没有超过该证券当日总成交量5%的情况。本基金与本公司管理的其他投资组合存在非同日常下(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 管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内本基金投资策略和市场分析

本报告期内,经济增速及市场预期在内部去杠杆进程和外部中美贸易摩擦的双重影响下呈现趋弱态势。固定资产投资增速走低,增速从二月份的7.9%回落至六月的6.0%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金(各类型)份额净值及业绩表现请见“3.1 主要财务指标”及“3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比”部分披露。

4.5 管理人对于宏观、证券市场及行业走势的简要展望

展望2018年下半年,紧信用环境下表外融资持续受到压缩,表内贷款和债券发行能否为实体经济融资需求提供有效供给仍待观察。

4.6 管理人对于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,经公司董事会批准并实行,并成立了估值委员会,估值委员会成员由研究员、基金运营部、风险管理部等部门相关人员组成。

4.7 管理人对于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,本基金在本报告期内对本报告期可供分配利润进行了收益分配,具体情况参见半年度报告正文“6.4.11 利润分配情况”。

4.8 报告期内管理人对于本基金持有人或基金资产净值预警情况的说明

本基金本报告期内无无需预警说明。

5 报告期内本基金托管人履行托管职责的情况

作为本基金的托管人,中信银行严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定。

6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:交银施罗德优选回报灵活配置混合型证券投资基金 报告截止日:2018年6月30日

Table with 2 columns: 资产负债表, 单位:人民币元

6.2 利润表

会计主体:交银施罗德优选回报灵活配置混合型证券投资基金 本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

Table with 2 columns: 利润表, 单位:人民币元

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:交银施罗德优选回报灵活配置混合型证券投资基金 本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

Table with 2 columns: 所有者权益(基金净值)变动表, 单位:人民币元

6.4 现金流量表

会计主体:交银施罗德优选回报灵活配置混合型证券投资基金 本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

Table with 2 columns: 现金流量表, 单位:人民币元

6.5 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:交银施罗德优选回报灵活配置混合型证券投资基金 本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

Table with 2 columns: 所有者权益(基金净值)变动表, 单位:人民币元

6.6 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:交银施罗德优选回报灵活配置混合型证券投资基金 本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

Table with 2 columns: 所有者权益(基金净值)变动表, 单位:人民币元

6.7 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:交银施罗德优选回报灵活配置混合型证券投资基金 本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

Table with 2 columns: 所有者权益(基金净值)变动表, 单位:人民币元

6.8 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:交银施罗德优选回报灵活配置混合型证券投资基金 本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

Table with 2 columns: 所有者权益(基金净值)变动表, 单位:人民币元

6.9 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:交银施罗德优选回报灵活配置混合型证券投资基金 本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

Table with 2 columns: 所有者权益(基金净值)变动表, 单位:人民币元

6.10 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:交银施罗德优选回报灵活配置混合型证券投资基金 本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

Table with 2 columns: 所有者权益(基金净值)变动表, 单位:人民币元

6.11 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:交银施罗德优选回报灵活配置混合型证券投资基金 本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

Table with 2 columns: 所有者权益(基金净值)变动表, 单位:人民币元

6.12 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:交银施罗德优选回报灵活配置混合型证券投资基金 本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

Table with 2 columns: 所有者权益(基金净值)变动表, 单位:人民币元

6.13 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:交银施罗德优选回报灵活配置混合型证券投资基金 本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

Table with 2 columns: 所有者权益(基金净值)变动表, 单位:人民币元

6.14 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:交银施罗德优选回报灵活配置混合型证券投资基金 本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

Table with 2 columns: 所有者权益(基金净值)变动表, 单位:人民币元

6.15 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:交银施罗德优选回报灵活配置混合型证券投资基金 本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

Table with 2 columns: 所有者权益(基金净值)变动表, 单位:人民币元

6.16 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:交银施罗德优选回报灵活配置混合型证券投资基金 本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

Table with 2 columns: 所有者权益(基金净值)变动表, 单位:人民币元

6.17 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:交银施罗德优选回报灵活配置混合型证券投资基金 本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

Table with 2 columns: 所有者权益(基金净值)变动表, 单位:人民币元

6.18 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:交银施罗德优选回报灵活配置混合型证券投资基金 本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

Table with 2 columns: 所有者权益(基金净值)变动表, 单位:人民币元

6.19 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:交银施罗德优选回报灵活配置混合型证券投资基金 本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

Table with 2 columns: 所有者权益(基金净值)变动表, 单位:人民币元

6.20 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:交银施罗德优选回报灵活配置混合型证券投资基金 本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

Table with 2 columns: 所有者权益(基金净值)变动表, 单位:人民币元

6.21 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:交银施罗德优选回报灵活配置混合型证券投资基金 本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

Table with 2 columns: 所有者权益(基金净值)变动表, 单位:人民币元

6.22 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:交银施罗德优选回报灵活配置混合型证券投资基金 本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

Table with 2 columns: 所有者权益(基金净值)变动表, 单位:人民币元

6.23 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:交银施罗德优选回报灵活配置混合型证券投资基金 本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

Table with 2 columns: 所有者权益(基金净值)变动表, 单位:人民币元

理部负责对各账户公平交易执行事后分析,按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内同向交易交易差异进行分析,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 异常交易的专项说明

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没有超过该证券当日总成交量5%的情况。本基金与本公司管理的其他投资组合存在非同日常下(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 管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明