交银施罗德数据产业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:中国农业银行股份有限公司

报告送出日期:二〇一八年八月二十五日

1 重要提示

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。本半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2018年8月24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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年1月1日起至6月30日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	交银数据产业灵活配置混合
基金主代码	519773
交易代码	519773
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年8月16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	986,084,960.13份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点关注数据产业链的上中下游企业,在控制风险并保持基金资产良好的流动性的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势,在分析和判断宏观经济周期和金融市场运行趋势的基础上,运用修正后的投资时钟分析框架,自上而下调整基金大类资产配置和股票行业配置策略,确定债券组合久期和债券类别配置;在严谨深入的股票和债券研究分析基础上,自下而上精选个券。本基金所定义的数据产业的主题范畴是指产生并存储着海量的数据资源的上游资源型公司;依托在数据处理技术上具有卡位优势的中游技术型公司,以及通过对开放数据的交叉关联运用对数据资源实现大数据价值挖掘后的下游平台型公司。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+中证综合债券指数收益率×40%
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	贺倩
	联系电话	(021)61055050	010-66060069
	电子邮箱	xxpl@ysld.com, disclosure@ysld.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-700-5000,021-61055000	95599
传真		(021)61055054	010-68121816

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.fund001.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人的办公场所

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年1月1日至2018年6月30日)
本期已实现收益	-50,205,297.04
本期利润	20,641,317.79
加权平均基金份额本期利润	0.0223
本期基金份额净值增长率	3.30%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.218
期末基金资产净值	770,860,262.74
期末基金份额净值	0.782

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)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-5.33%	2.71%	-4.40%	0.77%	-0.93%	1.94%
过去三个月	-12.82%	2.09%	-5.26%	0.68%	-7.56%	1.41%
过去六个月	3.30%	1.99%	-6.30%	0.69%	9.60%	1.30%
过去一年	-4.87%	1.60%	-0.68%	0.57%	-4.19%	1.03%
自基金合同生效起至今	-21.80%	1.39%	3.76%	0.49%	-25.56%	0.90%

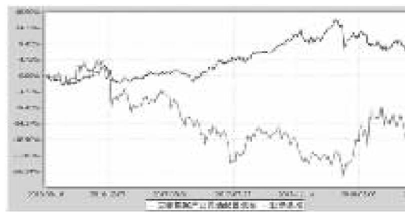
注:本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率×60%+中证综合债券指数收益率×40%,每日进行再平衡过程。

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

交银施罗德数据产业灵活配置混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2016年8月16日至2018年6月30日)



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

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

交银施罗德基金管理有限公司是经中国证监会证监基金字[2005]128号文批准,由交通银行股份有限公司、施罗德投资管理有限公司、中国国际海运集装箱(集团)股份有限公司共同发起设立。公司成立于2005年8月4日,注册地在中国上海,注册资本金为2亿元人民币。其中,交通银行股份有限公司持有65%的股份,施罗德投资管理有限公司持有30%的股份,中国国际海运集装箱(集团)股份有限公司持有5%的股份。公司并下设交银施罗德资产管理(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、保本混合型、普通混合型和股票型在内的81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		
芮晨	交银先锋混合、交银科技创新灵活配置混合、交银数据产业灵活配置混合的基金经理	2016-08-16	-	11年	芮晨先生,内蒙古科技大学工学士。历任深圳尚诚资产管理有限公司研究员、研究副总监,国联安基金管理有限公司行业研究员、投资经理,浙商证券资产管理有限公司投资主办。2015年加入交银施罗德基金管理有限公司。

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遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵循《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益。

本报告期内,本基金整体运作合规合法,无不当内幕交易和关联交易,基金投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的约定,未发生损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本公司制定了严格的投资控制制度和公平交易监控制度来保证旗下基金运作的公平,旗下所管理的所有资产组合,包括证券投资基金和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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年上半年,市场开始逐步验证我们在2017年基金年报中提出的,2018年"更多是个股间性价比的比较,着重在于成长性和估值的匹配度",印证了现阶段成长股性价比较高的逻辑。

本基金上半年保持高仓位运行,主要布局在成长性较好的个股上面,组合现有持仓的估值,仍在较为合理的范围。

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

2018年下半年,我们认为市场仍然会着重于个股间性价比比较这一逻辑。当前看来,成长股中部分股票的基本面仍有进一步加速的迹象,这样看性价比将进一步凸显。而随着经济逐步下行,我们预计周期股的增速会逐步放缓,所以性价比将随着时间推移可能越来越不具备优势。消费类板块不排除个别公司由于产品创新,增速可以持续加速,但预计板块整体增速平稳,性价比由于过去两年股价大幅上涨,吸引力有所降低。所以下半年我们主要会看好并选择基本面持续加速,同时过去两年估值还在下移的公司。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内无需预警说明。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中,本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《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2018年1月1日至2018年6月30日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为,交银施罗德基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《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 托管人对本半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《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半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 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:交银施罗德数据产业灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资产:		-	-
银行存款	6.4.7.1	19,687,518.12	71,126,402.13
结算备付金		622,999.92	532,591.02
存出保证金		189,952.89	220,045.30
交易性金融资产	6.4.7.2	751,288,402.24	677,674,301.94
其中:股票投资		727,282,802.24	637,722,901.94
基金投资		-	-
债券投资		24,005,600.00	39,951,400.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	779,792.06	1,111,717.69
应收股利		-	-
应收申购款		220,852.03	233,415.44
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		772,789,517.26	750,898,473.52
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
负债:		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		307,356.08	6,164,426.19
应付管理人报酬		917,486.12	974,132.89
应付托管费		152,914.36	162,355.48
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	365,092.64	326,642.25
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	186,405.32	341,621.51
负债合计		1,929,254.52	7,969,178.32
所有者权益:		-	-
实收基金	6.4.7.9	986,084,960.13	981,496,058.83
未分配利润	6.4.7.10	-215,224,697.39	-238,566,763.63
所有者权益合计		770,860,262.74	742,929,295.20
负债和所有者权益总计		772,789,517.26	750,898,473.52

注:1、报告截止日2018年6月30日,基金份额净值0.782元,基金份额总额986,084,960.13份。

2、本摘要中资产负债表和利润表所列附注号为半年度报告正文中对应的附注号,投资者欲了解相应附注的内容,应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

6.2 利润表

会计主体:交银施罗德数据产业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

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入		28,886,510.67	-158,689,142.24
1.利息收入		542,212.15	1,061,185.32
其中:存款利息收入	6.4.7.11	133,685.86	225,224.90
债券利息收入		408,526.29	759,879.40
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	76,081.02
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-42,794,991.02	22,614,327.11
其中:股票投资收益	6.4.7.12	-45,044,365.70	19,997,598.76
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	68,500.08	-127,400.00
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	2,180,874.60	2,744,128.35
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	6.4.7.17	70,846,614.83	-182,677,081.40
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	6.4.7.18	292,674.71	312,426.73
减:二、费用		8,245,192.88	13,505,682.27
1.管理人报酬		5,542,222.19	9,799,766.70
2.托管费		923,703.72	1,633,294.40
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.19	1,574,848.14	1,856,982.65
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		-	-
7.其他费用	6.4.7.20	204,418.83	215,638.52
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		20,641,317.79	-172,194,824.51
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		20,641,317.79	-172,194,824.51

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:交银施罗德数据产业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

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30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)	981,496,058.83	-238,566,763.63	742,929,295.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	20,641,317.79	20,641,317.79
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)	4,588,901.30	2,700,748.45	7,289,649.75
其中:1.基金申购款	231,857,955.54	-43,256,042.79	188,601,912.75
2.基金赎回款	-227,269,054.24	45,956,791.24	-181,312,263.00
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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	986,084,960.13	-215,224,697.39	770,860,262.74
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30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)	1,547,911,693.24	-91,922,834.98	1,455,988,858.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-172,194,824.51	-172,194,824.51
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)	-188,324,800.87	21,668,431.20	-166,656,369.67
其中:1.基金申购款	36,007,870.52	-3,875,764.47	32,132,106.05
2.基金赎回款	-224,332,671.39	25,544,195.67	-198,788,475.72
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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,359,586,892.37	-242,449,228.29	1,117,137,664.08

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人:阮红,主管会计工作负责人:夏华龙,会计机构负责人:单江

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

交银施罗德数据产业灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"本基金")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[2016]1060号文《关于准予交银施罗德数据产业灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准,由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》和《交银施罗德数据产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币2,198,288,802.57元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第1082号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《交银施罗德数据产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2016年8月16日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为2,200,062,808.52份基金份额,其中认购资金利息折合1,774,005.95份基金份额。本基金的基金管理人为交银施罗德基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德数据产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、中期票据、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的0%-95%;本基金投资数据产业链上中下游相关证券的比例不低于非现金基金资产的80%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金保留的现金或者投资于到期日在一年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为:60%×沪深300指数+40%×中证综合债券指数。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(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〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《交银施罗德数据产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2018年6月30日的财务状况以及2018年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]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》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品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。对资管产品在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,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对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,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2)对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,股票的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,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,暂免征收个人所得税。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)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 关联方关系

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

本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
交银施罗德基金管理有限公司("交银施罗德基金公司")	基金管理人、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司("中国农业银行")	基金托管人、基金销售机构
交通银行股份有限公司("交通银行")	基金管理人的股东、基金销售机构

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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,542,222.19	9,799,766.70
其中:支付销售机构的客户维护费	2,265,666.65	4,286,719.30

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:

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5%÷当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	923,703.72	1,633,294.40

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:

日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费

无。

6.4.8.3 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。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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。

6.4.8.4.2 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。

6.4.8.5 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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	19,687,518.12	122,790.77	52,231,197.77	205,108.27

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。

6.4.8.6 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证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

6.4.9 期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.9.2 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。

6.4.9.3 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 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	727,282,802.24	94.11
	其中:股票	727,282,802.24	94.11
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	24,005,600.00	3.11
	其中:债券	24,005,600.00	3.11
	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	20,310,518.04	2.63
8	其他各项资产	1,190,596.98	0.15
9	合计	772,789,517.26	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	357,402,707.44	46.36
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	38,607,167.28	5.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	294,555,869.52	38.21
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	36,717,058.00	4.76
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	727,282,802.24	94.35

7.2.2 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。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	300365	恒华科技	3,602,456	74,318,667.28	9.64
2	300253	卫宁健康	5,641,532	69,898,581.48	9.07
3	000977	浪潮信息	2,636,100	62,870,985.00	8.16
4	002599	盛通股份	5,369,302	56,001,819.86	7.26
5	300271	华宇软件	2,958,809	52,311,743.12	6.79
6	300130	新国都	3,262,548	44,011,772.52	5.71
7	603108	润达医疗	3,440,924	38,607,167.28	5.01
8	300012	华测检测	6,396,700	36,717,058.00	4.76
9	300212	易华录	1,419,500	33,571,175.00	4.36
10	300572	安车检测	679,101	33,418,560.21	4.34

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000977	浪潮信息	60,111,923.06	8.09
2	300130	新国都	47,837,398.60	6.44
3	300253	卫宁健康	46,293,163.81	6.23
4	300212	易华录	40,379,390.66	5.44
5	300496	中科创达	38,328,132.55	5.16
6	300502	新易盛	37,159,060.46	5.00
7	300572	安车检测	32,290,464.64	4.35
8	300012	华测检测	28,868,169.00	3.89
9	600038	中直股份	24,472,731.00	3.29
10	300170	汉得信息	22,326,769.43	3.01
11	300226	上海钢联	21,757,298.00	2.93
12	600536	中国软件	20,312,865.60	2.73
13	603108	润达医疗	16,522,299.35	2.22
14	000066	中国长城	16,047,724.60	2.16
15	600525	长园集团	15,899,970.30	2.14
16	002156	通富微电	15,192,757.00	2.04
17	600588	用友网络	13,905,192.00	1.87
18	603517	绝味食品	12,182,127.18	1.64
19	300114	中航电测	11,870,268.50	1.60
20	300271	华宇软件	8,015,613.91	1.08

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300347	泰格医药	95,350,950.49	12.83
2	300226	上海钢联	43,722,415.85	5.89
3	600693	东百集团	41,156,557.75	5.54
4	603006	联明股份	34,975,182.82	4.71
5	300502	新易盛	34,271,282.72	4.61
6	300170	汉得信息	27,065,083.00	3.64
7	002094	青岛金王	23,931,715.70	3.22
8	300365	恒华科技	21,999,742.06	2.96
9	600588	用友网络	20,706,053.19	2.79
10	000538	云南白药	17,465,352.13	2.35
11	300271	华宇软件	16,703,394.06	2.25
12	300279	和晶科技	16,117,260.13	2.17
13	002156	通富微电	13,388,704.20	1.80
14	603517	绝味食品	12,859,151.46	1.73
15	603096	新经典	12,509,250.80	1.68
16	300231	银信科技	11,407,589.88	1.54
17	300061	康旗股份	10,426,977.55	1.40
18	002180	纳思达	8,880,665.37	1.20
19	300348	长亮科技	6,417,279.00	0.86
20	603108	润达医疗	6,234,851.58	0.84

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票的成本(成交)总额	560,254,824.61
卖出股票的收入(成交)总额	496,533,933.44

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	8,000,800.00	1.04
2	央行票据	-	-
3	金融债券	16,004,800.00	2.08
	其中:政策性金融债	16,004,800.00	2.08
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	24,005,600.00	3.11

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	170410	17农发10	160,000	16,004,800.00	2.08
2	019571	17国债17	80,000	8,000,800.00	1.04

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 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。

7.11 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体除新国都(证券代码:300130)外,未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之一新国都(证券代码:300130)于2017年12月28日收到已收购的嘉联支付有限公司的通知说明,获悉嘉联支付宁波分公司于2017年12月27日收到中国人民银行宁波市中心支行出具的行政处罚决定书(甬银处罚字〔2017〕42号),嘉联支付宁波分公司因阻碍反洗钱检查、未按照规定履行客户身份识别义务、与身份不明的客户进行交易或者为客户开立匿名账户、假名账户、未按照规定报送可疑交易报告的行为予以罚款,共计人民币188万元。

本基金管理人对该证券投资决策程序的说明如下:本基金管理人对证券投资特别是重仓股的投资有严格的投资决策流程控制。本基金在对该证券的投资也严格执行投资决策流程。在对该证券的选择上,严格执行公司股票池审核流程进入公司股票池。在对该证券的持有过程中公司研究员密切关注上市公司动向。在上述事件发生时及时分析其对投资决策的影响,经过分析认为上述事件对上市公司财务状况、经营成果和现金流量未产生重大的实质性影响,所以不影响对该公司基本面和公司治理的投资判断。

7.12.2 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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	189,952.89
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	779,792.06
5	应收申购款	220,852.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,190,596.98

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
12,730	77,461.51	147,142,778.71	14.92%	838,942,181.42	85.08%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	190,346.63	0.02%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2016年8月16日)基金份额总额	2,200,062,808.52
本报告期期初基金份额总额	981,496,058.83
本报告期基金总申购份额	231,857,955.54
减:本报告期基金总赎回份额	227,269,054.24
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	986,084,960.13

注:1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务,则总申购份额中包含该业务;

2、如果本报告期间发生转换出业务,则总赎回份额中包含该业务。

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人的重大人事变动:2018年6月30日本基金管理人发布公告,经公司第四届董事会第三十二次会议审议通过,同意苏奋先生辞去公司督察长职务,并决定由公司总经理阮红女士代为履行公司督察长职务。期后变动(如有)敬请关注基金管理人发布的相关公告。

2、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动:本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务。

10.7 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。

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 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	
西部证券股份有限公司	1	91,421,119.78	8.65%	85,140.44	8.65%	-
光大证券股份有限公司	1	83,092,397.05	7.86%	77,384.38	7.86%	-
国泰君安证券股份有限公司	1	60,219,943.00	5.70%	56,083.26	5.70%	-
天风证券股份有限公司	1	60,212,861.74	5.70%	56,076.06	5.70%	-
长江证券股份有限公司	2	528,757,943.20	50.03%	492,432.18	50.03%	-
招商证券股份有限公司	1	52,316,989.31	4.95%	48,724.10	4.95%	-
华泰证券股份有限公司	1	50,513,126.01	4.78%	47,044.37	4.78%	-
广发证券股份有限公司	1	4,828,176.27	0.46%	4,496.44	0.46%	-
申万宏源证券有限公司	2	3,703,375.65	0.35%	3,448.96	0.35%	-
海通证券股份有限公司	1	29,764,273.14	2.82%	27,719.55	2.82%	-
瑞银证券有限责任公司	1	29,173,912.41	2.76%	27,169.25	2.76%	-
西南证券股份有限公司	1	26,660,192.10	2.52%	24,828.53	2.52%	-
东兴证券股份有限公司	1	23,102,103.12	2.19%	21,515.07	2.19%	-
国信证券股份有限公司	2	13,022,345.27	1.23%	12,127.76	1.23%	-
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
渤海证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
川财证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
华宝证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
上海华信证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
宏信证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
新时代证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
信达证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国联证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

10.8.2 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	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
西部证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	11,027,499.92	73.35%	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
西南证券股份有限公司	4,006,800.00	26.65%	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
渤海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
川财证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华宝证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
上海华信证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
宏信证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
新时代证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
信达证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国联证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

注:1、报告期内,本基金新增加交易单元为西部证券股份有限公司,其它交易单元未发生变化;

2、租用证券公司交易单元的选择标准主要包括:券商基本面评价(财务状况、经营状况)、券商研究机构评价(报告质量、及时性和数量)、券商每日信息评价(及时性和有效性)和券商协作表现评价等四个方面;

3、租用证券公司交易单元的程序:首先根据租用证券公司交易单元的选择标准进行综合评价,然后根据评价选择基金交易单元。研究部提交方案,并上报公司批准。

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 影响投资者决策的其他重要信息

1、本基金管理人依据国家税收法律、法规、规章及税收规范性文件的规定,对管理的基金产品运营过程中产生的应税收入,计提及缴纳增值税及附加税费,该部分税费由基金资产承担。详情请见有关公告。

2、根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》的有关规定及相关监管要求,经与基金托管人协商一致并报监管机构备案,基金管理人对本基金基金合同等法律文件作相应修改。请投资者关注基金合同中"对持续持有期少于7日的基金份额持有人收取不低于1.5%的赎回费并全额计入基金财产"的条款已于2018年3月31日起正式实施。欲知详情请查阅本基金管理人于2018年3月22日发布的有关公告及法律文件。