

交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金

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:中国建设银行股份有限公司

2018年上半年以来,去杠杆深化和贸易超预期影响估值水平和市场风险偏好,贸易
战导致贸易结构问题,美国是长期经济结构问题与中美汇率结构问题,去杠杆政策
主要目标是化解风险,而不是放大风险。

11重要提示
基金管理人、基金托管人、基金销售机构在不存在虚假记载、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法律责任。

46管理人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执行,并成立了
估值委员会,估值委员会成员由财务部、基金运营部、风险管理部等部门相关人员组成

21基金基本情况
基金名称:交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金
基金代码:519600(前号) 519601(后号)

47管理人报告期内基金利润分配情况说明
根据相关法律法规和基金合同约定,本基金报告期内对上一年度应分配可分配利润
进行了收益分配,具体请参见半年度报告正文 6.4利润分配情况说明

22基金产品说明
基金的投资目标:本基金的投资目标是长期稳健增值,力争实现长期复合投资回报,并
在有效控制风险的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资目标。

48报告期内管理人对于本基金有人投或基金资产净值预警情况的说明
本基金报告期内无预警说明

23基金管理人及基金托管人
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

49报告期内基金管理人遵守法律法规的声明
本基金管理人严格遵守国家有关法律、法规和基金合同的约定,在基金的投资过程中,
严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金管理条例》、《证券投资基金运作管理
办法》等法律法规及基金合同的约定,不存在违法违规及损害基金份额持有人利益的情
况。

24信息披露方式
基金年度报告全文的官方网站:www.fund001.com
基金半年度报告全文的官方网站:www.fund001.com

50报告期内基金管理人遵守法律法规的声明
本基金管理人严格遵守国家有关法律、法规和基金合同的约定,在基金的投资过程中,
严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金管理条例》、《证券投资基金运作管理
办法》等法律法规及基金合同的约定,不存在违法违规及损害基金份额持有人利益的情
况。

信息披露

61基金基本情况
基金名称:交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)
基金代码:519600(前号) 519601(后号)

62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28日以后颁布的企业会计准则(以下
简称“企业会计准则”)及相关规定进行编制,并参照《证券投资基金信息披露编报
规则》的要求进行编制。

63估值程序
本基金管理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
基金资产净值进行估值,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
作进行了监督,未发现基金管理人有关基金估值的事项有违法违规的行为。

64报告期内基金管理人遵守法律法规的声明
本基金管理人严格遵守国家有关法律、法规和基金合同的约定,在基金的投资过程中,
严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金管理条例》、《证券投资基金运作管理
办法》等法律法规及基金合同的约定,不存在违法违规及损害基金份额持有人利益的情
况。

65报告期内基金管理人遵守法律法规的声明
本基金管理人严格遵守国家有关法律、法规和基金合同的约定,在基金的投资过程中,
严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金管理条例》、《证券投资基金运作管理
办法》等法律法规及基金合同的约定,不存在违法违规及损害基金份额持有人利益的情
况。

66报告期内基金管理人遵守法律法规的声明
本基金管理人严格遵守国家有关法律、法规和基金合同的约定,在基金的投资过程中,
严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金管理条例》、《证券投资基金运作管理
办法》等法律法规及基金合同的约定,不存在违法违规及损害基金份额持有人利益的情
况。

67报告期内基金管理人遵守法律法规的声明
本基金管理人严格遵守国家有关法律、法规和基金合同的约定,在基金的投资过程中,
严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金管理条例》、《证券投资基金运作管理
办法》等法律法规及基金合同的约定,不存在违法违规及损害基金份额持有人利益的情
况。

68报告期内基金管理人遵守法律法规的声明
本基金管理人严格遵守国家有关法律、法规和基金合同的约定,在基金的投资过程中,
严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金管理条例》、《证券投资基金运作管理
办法》等法律法规及基金合同的约定,不存在违法违规及损害基金份额持有人利益的情
况。

69报告期内基金管理人遵守法律法规的声明
本基金管理人严格遵守国家有关法律、法规和基金合同的约定,在基金的投资过程中,
严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金管理条例》、《证券投资基金运作管理
办法》等法律法规及基金合同的约定,不存在违法违规及损害基金份额持有人利益的情
况。

70报告期内基金管理人遵守法律法规的声明
本基金管理人严格遵守国家有关法律、法规和基金合同的约定,在基金的投资过程中,
严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金管理条例》、《证券投资基金运作管理
办法》等法律法规及基金合同的约定,不存在违法违规及损害基金份额持有人利益的情
况。

71报告期内基金管理人遵守法律法规的声明
本基金管理人严格遵守国家有关法律、法规和基金合同的约定,在基金的投资过程中,
严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金管理条例》、《证券投资基金运作管理
办法》等法律法规及基金合同的约定,不存在违法违规及损害基金份额持有人利益的情
况。

72报告期内基金管理人遵守法律法规的声明
本基金管理人严格遵守国家有关法律、法规和基金合同的约定,在基金的投资过程中,
严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金管理条例》、《证券投资基金运作管理
办法》等法律法规及基金合同的约定,不存在违法违规及损害基金份额持有人利益的情
况。

73报告期内基金管理人遵守法律法规的声明
本基金管理人严格遵守国家有关法律、法规和基金合同的约定,在基金的投资过程中,
严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金管理条例》、《证券投资基金运作管理
办法》等法律法规及基金合同的约定,不存在违法违规及损害基金份额持有人利益的情
况。

74报告期内基金管理人遵守法律法规的声明
本基金管理人严格遵守国家有关法律、法规和基金合同的约定,在基金的投资过程中,
严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金管理条例》、《证券投资基金运作管理
办法》等法律法规及基金合同的约定,不存在违法违规及损害基金份额持有人利益的情
况。

75报告期内基金管理人遵守法律法规的声明
本基金管理人严格遵守国家有关法律、法规和基金合同的约定,在基金的投资过程中,
严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金管理条例》、《证券投资基金运作管理
办法》等法律法规及基金合同的约定,不存在违法违规及损害基金份额持有人利益的情
况。

76报告期内基金管理人遵守法律法规的声明
本基金管理人严格遵守国家有关法律、法规和基金合同的约定,在基金的投资过程中,
严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金管理条例》、《证券投资基金运作管理
办法》等法律法规及基金合同的约定,不存在违法违规及损害基金份额持有人利益的情
况。

77报告期内基金管理人遵守法律法规的声明
本基金管理人严格遵守国家有关法律、法规和基金合同的约定,在基金的投资过程中,
严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金管理条例》、《证券投资基金运作管理
办法》等法律法规及基金合同的约定,不存在违法违规及损害基金份额持有人利益的情
况。

78报告期内基金管理人遵守法律法规的声明
本基金管理人严格遵守国家有关法律、法规和基金合同的约定,在基金的投资过程中,
严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金管理条例》、《证券投资基金运作管理
办法》等法律法规及基金合同的约定,不存在违法违规及损害基金份额持有人利益的情
况。

79报告期内基金管理人遵守法律法规的声明
本基金管理人严格遵守国家有关法律、法规和基金合同的约定,在基金的投资过程中,
严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金管理条例》、《证券投资基金运作管理
办法》等法律法规及基金合同的约定,不存在违法违规及损害基金份额持有人利益的情
况。

80报告期内基金管理人遵守法律法规的声明
本基金管理人严格遵守国家有关法律、法规和基金合同的约定,在基金的投资过程中,
严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金管理条例》、《证券投资基金运作管理
办法》等法律法规及基金合同的约定,不存在违法违规及损害基金份额持有人利益的情
况。

81报告期内基金管理人遵守法律法规的声明
本基金管理人严格遵守国家有关法律、法规和基金合同的约定,在基金的投资过程中,
严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金管理条例》、《证券投资基金运作管理
办法》等法律法规及基金合同的约定,不存在违法违规及损害基金份额持有人利益的情
况。

82报告期内基金管理人遵守法律法规的声明
本基金管理人严格遵守国家有关法律、法规和基金合同的约定,在基金的投资过程中,
严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金管理条例》、《证券投资基金运作管理
办法》等法律法规及基金合同的约定,不存在违法违规及损害基金份额持有人利益的情
况。

83报告期内基金管理人遵守法律法规的声明
本基金管理人严格遵守国家有关法律、法规和基金合同的约定,在基金的投资过程中,
严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金管理条例》、《证券投资基金运作管理
办法》等法律法规及基金合同的约定,不存在违法违规及损害基金份额持有人利益的情
况。

84报告期内基金管理人遵守法律法规的声明
本基金管理人严格遵守国家有关法律、法规和基金合同的约定,在基金的投资过程中,
严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金管理条例》、《证券投资基金运作管理
办法》等法律法规及基金合同的约定,不存在违法违规及损害基金份额持有人利益的情
况。

85报告期内基金管理人遵守法律法规的声明
本基金管理人严格遵守国家有关法律、法规和基金合同的约定,在基金的投资过程中,
严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金管理条例》、《证券投资基金运作管理
办法》等法律法规及基金合同的约定,不存在违法违规及损害基金份额持有人利益的情
况。

86报告期内基金管理人遵守法律法规的声明
本基金管理人严格遵守国家有关法律、法规和基金合同的约定,在基金的投资过程中,
严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金管理条例》、《证券投资基金运作管理
办法》等法律法规及基金合同的约定,不存在违法违规及损害基金份额持有人利益的情
况。

87报告期内基金管理人遵守法律法规的声明
本基金管理人严格遵守国家有关法律、法规和基金合同的约定,在基金的投资过程中,
严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金管理条例》、《证券投资基金运作管理
办法》等法律法规及基金合同的约定,不存在违法违规及损害基金份额持有人利益的情
况。

88报告期内基金管理人遵守法律法规的声明
本基金管理人严格遵守国家有关法律、法规和基金合同的约定,在基金的投资过程中,
严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金管理条例》、《证券投资基金运作管理
办法》等法律法规及基金合同的约定,不存在违法违规及损害基金份额持有人利益的情
况。

89报告期内基金管理人遵守法律法规的声明
本基金管理人严格遵守国家有关法律、法规和基金合同的约定,在基金的投资过程中,
严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金管理条例》、《证券投资基金运作管理
办法》等法律法规及基金合同的约定,不存在违法违规及损害基金份额持有人利益的情
况。

90报告期内基金管理人遵守法律法规的声明
本基金管理人严格遵守国家有关法律、法规和基金合同的约定,在基金的投资过程中,
严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金管理条例》、《证券投资基金运作管理
办法》等法律法规及基金合同的约定,不存在违法违规及损害基金份额持有人利益的情
况。

2018年半年度报告摘要

721报告期内基金行业分类的境内股票投资组合
基金单位:人民币元

Table with columns: 代码, 行业名称, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

722报告期内基金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

73期末买入金额占基金资产净值比例大排行的前十名股票投资明细
基金单位:人民币元

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

74报告期内股票投资组合的重大变动
741买入买入金额超出期初基金资产净值2%或20名股票投资明细

Table with columns: 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(%)

742卖出卖出金额超出期初基金资产净值2%或20名股票投资明细
基金单位:人民币元

Table with columns: 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(%)

743买入股票的成本及卖出股票的收入总额
基金单位:人民币元

744卖出股票的成本及卖出股票的收入总额
基金单位:人民币元

75期末按债券品种分类的债券投资组合
基金单位:人民币元

Table with columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

76期末按公允价值占基金资产净值比例大排行的前五名债券投资明细
基金单位:人民币元

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

77报告期内基金资产支持证券投资情况
本基金本报告期末持有资产支持证券

78报告期内基金资产支持证券投资情况
本基金本报告期末持有资产支持证券

79报告期内基金资产支持证券投资情况
本基金本报告期末持有资产支持证券

80报告期内基金资产支持证券投资情况
本基金本报告期末持有资产支持证券

81报告期内基金资产支持证券投资情况
本基金本报告期末持有资产支持证券

82报告期内基金资产支持证券投资情况
本基金本报告期末持有资产支持证券

83期末基金管理人及基金托管人持有的本基金基金份额的情况
基金单位:人民币元

91开放式基金份额变动
单位:份

基金合同生效以来2018年6月30日基金份额总额
7,016,138,522.08

注:1.如果本报告期间发生转换入、红利再投资业务,则总申购份额中包含该业务;
2.如果本报告期间发生转换转出业务,则总赎回份额中包含该业务。

01基金份额持有人大会决议
本基金报告期内未召开基金份额持有人大会。

02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、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

03涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼
本基金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。

04基金投资策略的改变
本基金本报告期间投资策略未发生变动。

05本报告期间有基金发生的重大诉讼事件
06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。

07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

08基金管理人及其高级管理人员、基金经理等相关人员受监管部门稽查或处罚
基金管理人及其高级管理人员、基金经理等相关人员受监管部门稽查或处罚

09基金租用证券交易单元的情况
基金租用证券交易单元进行证券投资及佣金支付情况

31.1期间损益指标
报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

Table with columns: 项目, 报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

注:1.本基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益
率水平较前所述数字。
2.本期业绩比较基准本期期初投资人投资收益率,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除
相关费用后的余额,本期期间为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

Table with columns: 阶段, 份额净值增长率①, 业绩比较基准收益率②, 份额净值增长率③-②

注:1.本基金业绩比较基准自2018年7月1日起,由“69%\*MSCI中国A股指数+30%\*新华B
中国央企国企指数”变更为“69%\*MSCI中国A股指数+30%\*中信标普综合指数”。
2.本基金业绩比较基准自2018年6月1日起,由“69%\*MSCI中国A股指数+30%\*中信标
普综合指数”变更为“69%\*MSCI中国A股指数+30%\*中证综合指数”。
3.222,详情请见本基
金管理人于2018年6月28日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于变更交银
施罗德稳健配置混合型证券投资基金业绩比较基准并修改基金合同相关内容的公告》。

3.222,详情请见本基
金管理人于2018年6月28日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于变更交银
施罗德稳健配置混合型证券投资基金业绩比较基准并修改基金合同相关内容的公告》。