交银施罗德成长混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

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:二〇一八年十月二十六日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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10月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	交银成长混合
基金主代码	519692
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年10月23日
报告期末基金份额总额	673,828,260.80份
投资目标	本基金属于成长型混合型基金,主要通过投资于经过严格的品质筛选且具有良好成长性的上市公司的股票,在适度控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下,为基金份额持有人谋求长期、稳定的资本增值。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势,将严谨、规范化的选股方法与积极主动的投资风格相结合,在分析和判断宏观经济运行和行业景气变化,以及上市公司成长潜力的基础上,通过优选成长性好,成长具有可持续性、成长质量优良、定价相对合理的股票进行投资,以谋求超额收益。
业绩比较基准	75%×富时中国A600成长指数+25%×富时中国国债指数
风险收益特征	本基金是一只混合型基金,以具有良好成长性的公司为主要投资对象,追求超额收益,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。
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
下属两级基金的基金简称	交银成长混合A / 交银成长混合H
下属两级基金的交易代码	519692(前端),519693(后端) / 960016
报告期末下属两级基金的份额总额	673,528,577.48份 / 299,683.32份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日-2018年9月30日)	
	交银成长混合A	交银成长混合H
1.本期已实现收益	-134,163,322.39	-60,595.99
2.本期利润	-238,866,125.86	-107,277.20
3.加权平均基金份额本期利润	-0.3540	-0.3580
4.期末基金资产净值	2,341,839,939.22	1,046,650.85
5.期末基金份额净值	3.4770	3.4925

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

1、交银成长混合A:

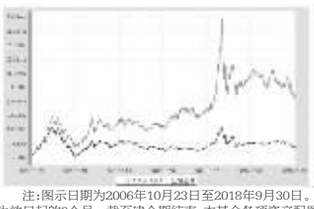
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-9.24%	1.34%	-6.26%	1.08%	-2.98%	0.26%

2、交银成长混合H:

阶段	净值增长率①	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	-9.30%	1.34%	-6.26%	1.08%	-3.04%	0.26%

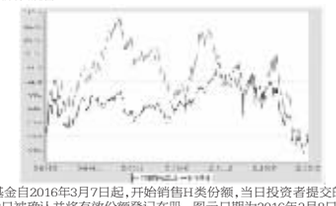
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

交银施罗德成长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的历史走势对比图
(2006年10月23日至2018年9月30日)



注:图示日期为2006年10月23日至2018年9月30日。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。

2. 交银成长混合H



注:本基金自2016年3月7日起,开始销售H类份额,当日投资者提交的申购申请于2016年3月8日被确认并将有效份额登记在册。图示日期为2016年3月8日至2018年9月30日。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王少成	交银成长混合、交银蓝筹混合、交银成长30混合、交银恒益灵活配置混合的基金经理,公司权益投资总监	2015-03-24	-	14年	王少成先生,复旦大学硕士学历。历任上海融昌资产管理公司研究员,中原证券投资经理,信诚基金管理有限公司研究总监助理,东吴基金管理有限公司投资经理、基金经理、投资部副总经理。其中2010年9月至2012年10月担任东吴新创业股票型证券投资基金基金经理,2011年2月至2012年11月担任东吴中证新兴产业指数证券投资基金基金经理,2011年5月至2012年11月担任东吴价值成长双动力股票型证券投资基金基金经理。2012年加入交银施罗德基金管理有限公司,历任公司权益部副总经理。2013年3月21日至2015年8月14日担任交银施罗德先进制造混合型证券投资基金(原交银施罗德先进制造股票证券投资基金)基金经理,2013年5月29日至2015年8月14日担任交银施罗德先锋混合型证券投资基金(原交银施罗德先锋股票证券投资基金)基金经理,2015年11月7日至2018年5月15日担任交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金的基金经理,2015年11月7日至2018年6月7日担任交银施罗德策略回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

注: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

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,基金投资管理符合有关法律法规和基金合同的规定,为基金持有人谋求最大利益。

4.3 公平交易专项说明

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口(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报告期内基金的投资策略和运作分析

2018年三季度整个A股市场整体继续呈现盘恒下跌态势,各主要指数均回到过去一到三年较低位置附近。中美贸易博弈的反复加剧了人民币汇率的贬值压力,美元持续走强也加剧新兴市场国家资金流出压力。国内经济经济增长回落趋势显现,政府虽然持续不断的出台政策进行托底,但受到去杠杆的约束,更多停留在稳预期的阶段。

随着七、八月份托底政策不断推出,政策的持续方向性反复和形势的不确定性超出我们的预期,在上述市场环境中,本基金降低组合偏离和弹性,适度收缩仓位,均衡配置,力图回避风险。

四季度国内宏观经济政策依然需要在去杠杆和保增长之间保持平衡。考虑到外部环境的不确定性在增加,政策重点预计会相机调整,短期偏向保增长的概率在上升。中长期推动高质量发展的制度性框架的建立也值得关注。行业配置上,更加聚焦景气向上的行业,更加聚焦业绩持续成长确定的个股。

4.5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。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内无需预警说明。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,751,970,137.32	74.60
	其中:股票	1,751,970,137.32	74.60
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	121,377,800.00	5.17
	其中:债券	121,377,800.00	5.17
	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	290,000,555.00	12.35
	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	172,333,545.95	7.34
8	其他各项资产	12,798,417.36	0.54
9	合计	2,348,480,455.63	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	226,658,781.86	9.67
C	制造业	1,079,328,900.94	46.07
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	36,251,818.40	1.55
G	交通运输、仓储和邮政业	332,526,661.27	14.19
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,668,171.88	0.54
J	金融业	408,141.21	0.02
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	64,127,661.76	2.74
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	1,751,970,137.32	74.78

5.2.2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。

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600256	广汇能源	44,355,926	226,658,781.86	9.67
2	601100	恒立液压	9,827,957	219,458,279.81	9.37
3	002180	纳思达	7,553,694	195,187,452.96	8.33
4	000538	云南白药	2,086,856	155,637,720.48	6.64
5	600389	江山股份	4,682,859	102,460,954.92	4.37
6	600233	圆通速递	7,526,967	99,130,155.39	4.23
7	600115	东方航空	15,965,008	89,404,044.80	3.82
8	603885	吉祥航空	5,836,584	77,393,103.84	3.30
9	600066	宇通客车	5,262,397	77,199,363.99	3.30
10	300146	汤臣倍健	3,655,115	74,929,857.50	3.20

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	121,377,800.00	5.18
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
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	121,377,800.00	5.18

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	189937	18贴现国债37	1,220,000	121,377,800.00	5.18

5.6 报告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。

5.7 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。

5.8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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 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。

5.10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。

5.11投资组合报告附注

5.11.1报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

5.11.2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。

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	400,272.61
2	应收证券清算款	11,639,043.02
3	应收股利	-
4	应收利息	486,036.53
5	应收申购款	273,065.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,798,417.36

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000538	云南白药	155,637,720.48	6.64	重大事项

5.11.6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。

§6 基金中基金

6.1 报告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

本基金本报告期末未持有基金。

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

本基金本报告期内未交易或持有基金。

6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

§7 开放式基金份额变动

单位:份

项目	交银成长混合A	交银成长混合H
报告期期初基金份额总额	675,149,249.47	299,683.32
本报告期期间基金总申购份额	13,074,402.80	-
减:本报告期期间基金总赎回份额	14,695,074.79	-
本报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	673,528,577.48	299,683.32

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。

§8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内未发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期内未进行本基金的申购、赎回、红利再投等。

§9 备查文件目录

9.1备查文件目录

1、中国证监会批准交银施罗德成长股票证券投资基金募集的文件;

2、《交银施罗德成长混合型证券投资基金基金合同》;

3、《交银施罗德成长混合型证券投资基金招募说明书》;

4、《交银施罗德成长混合型证券投资基金托管协议》;

5、关于募集交银施罗德成长股票证券投资基金之法律意见书;

6、基金管理人业务资格批件、营业执照;

7、基金托管人业务资格批件、营业执照;

8、报告期内交银施罗德成长混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

9.2存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

9.3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。

交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金

2018年第三季度报告

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:二〇一八年十月二十六日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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10月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	交银纯债债券发起
基金主代码	519718
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年12月19日
报告期末基金份额总额	383,308,387.09份
投资目标	本基金为纯债基金,在严格控制投资风险的基础上,追求稳定的当期收益和基金资产的稳健增值。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势,将规范化的基本面研究、严谨的信用分析与积极主动的投资风格相结合,在分析和判断宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上,动态调整大类金融资产比例;自上而下决定债券组合久期、期限结构、债券类别配置策略;在严谨深入的分析基础上,综合考量各类债券的流动性、供求关系和收益率水平等,自下而上地精选个券。
业绩比较基准	中债综合全价指数
风险收益特征	本基金是一只债券型基金,属于证券投资基金中中等风险的品种,其长期平均的预期收益和风险高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。
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
下属两级基金的基金简称	交银纯债债券发起A/B / 交银纯债债券发起C
下属两级基金的交易代码	519718(前端),519719(后端) / 519720
报告期末下属两级基金的份额总额	369,013,020.09份 / 14,295,367.00份

注:1、本基金A类基金份额采用前端收费模式,B类基金份额采用后端收费模式,前端交易代码固为A类基金份额交易代码,后端交易代码固为B类基金份额交易代码。

2、本基金为发起式基金。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日-2018年9月30日)	
	交银纯债债券发起A/B	交银纯债债券发起C
1.本期已实现收益	9,731,548.38	242,362.95
2.本期利润	11,955,974.32	113,912.00
3.加权平均基金份额本期利润	0.0224	0.0070
4.期末基金资产净值	392,560,875.10	15,055,604.38
5.期末基金份额净值	1.064	1.053

注:1、本基金A/B类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

1、交银纯债债券发起A/B:

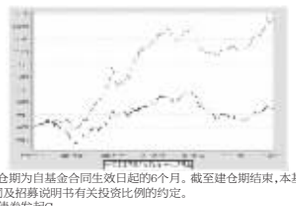
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.60%	0.10%	0.57%	0.07%	2.03%	0.03%

2、交银纯债债券发起C:

阶段	净值增长率①	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	2.43%	0.10%	0.57%	0.07%	1.86%	0.03%

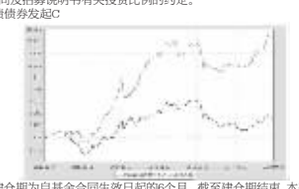
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2012年12月19日至2018年9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。

2. 交银纯债债券发起C



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 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
于海颖	交银增利债券、交银纯债债券发起、交银保证保本基金、交银定期支付月月丰债券、交银增强收益债券、交银增利增强债券、交银丰盈收益债券、交银灵活配置混合、交银稳健回报债券、交银丰境收益债券、交银裕如纯债债券的基金经理,公司固定收益(LOF)基金经理	2017-06-10	-	12年	于海颖女士,天津大学数量经济学硕士、经济学学士。历任北方国际信托投资股份有限公司固定收益研究员,光大保德信基金管理有限公司交易员、基金经理助理、基金经理,银华基金管理有限公司基金经理、五矿证券有限公司固定收益事业部投资管理部总经理。其中2007年11月9日至2010年8月30日任光大保德信货币市场基金基金经理,2008年10月29日至2010年8月30日任光大保德信增利收益债券型证券投资基金基金经理,2011年6月20日至2013年6月16日任银华永祥保本混合型证券投资基金基金经理,2011年8月2日至2014年4月24日任银华货币市场证券投资基金基金经理,2012年8月9日至2014年10月7日任银华纯债信用主题债券型证券投资基金(LOF)基金经理,2013年4月1日至2014年4月24日任银华交易型货币市场基金基金经理,2013年8月7日至2014年10月7日任银华信用四季红债券型证券投资基金基金经理,2013年9月18日至2014年10月7日任银华信用季季红债券型证券投资基金基金经理,2014年5月8日至2014年10月7日任银华信用债券型证券投资基金(LOF)基金经理,2016年加入交银施罗德基金管理有限公司,2017年6月10日至2018年7月18日担任交银施罗德丰硕收益债券型证券投资基金的基金经理。
魏玉敏	交银增利债券、交银纯债债券发起、交银丰境收益债券、交银裕如纯债债券的基金经理	2018-08-29	-	6年	魏玉敏女士,厦门大学金融学硕士、学士。2012年至2013年任招商证券固定收益研究员,2013年至2016年任国信证券固定收益研究员,2016年加入交银施罗德基金管理有限公司,历任基金经理助理。

注: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

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,基金投资管理符合有关法律法规和基金合同的规定,为基金持有人谋求最大利益。

4.3 公平交易专项说明

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口(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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2018年三季度A股市场波动加大,上证指数下跌0.92%,但创业板指数下跌12.16%。本基金在三季度表现较为稳定,持仓个股互有涨跌。

对于经济、利率及股票市场,我们目前都持中性态度。经济增速缓慢回落,但不确定性逐季加大,宏观政策基本确认由中性向适度宽松转变,货币政策整体宽松但传导至实体经济需要时间,股票市场在此环境下预计以震荡走势为主。从中长期的角度,股票市场的波动、甚至经济的波动更多提供的是机会,而非风险。我们将持续关注那些在经济周期下行过程中竞争力不受影响的公司,甚至市场份额反而提升的公司。我们希望通过深度研究,找到需求可持续增长的行业,竞争力可持续拓宽的公司,从公司价值的可持续成长空间中获利,并希望能够持续为持有人获得超额收益。

4.5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。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内无需预警说明。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	504,902,057.40	94.34
	其中:债券	497,902,057.40	93.03
	资产支持证券	7,000,000.00	1.31
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	22,687,032.39	4.24
8	其他各项资产	7,598,551.15	1.42
9	合计	535,187,640.94	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2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。

5.3 报告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

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	19,304,000.00	4.74
2	央行票据	-	-
3	金融债券	62,143,864.00	15.25
	其中:政策性金融债	62,143,864.00	15.25
4	企业债券	166,074,193.40	40.74
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	250,380,000.00	61.43
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	497,902,057.40	122.15

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	180406	18农发06	400,000	40,916,000.00	10.04
2	101800295	18浙山钱江MTN002	300,000	30,846,000.00	7.57
3	143496	18沪资01	300,000	30,774,000.00	7.55
4	143563	18张江01	300,000	30,222,000.00	7.41
5	101775005	17杭州城建MTN001	300,000	30,087,000.00	7.38

5.6 报告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。

5.7 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。

5.8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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 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。

5.10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。

5.11投资组合报告附注

5.11.1报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

5.11.2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。

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	33,214.62
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,408,467.70
5	应收申购款	156,868.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,598,551.15

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5报告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。

5.11.6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。

§6 基金中基金

6.1 报告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

本基金本报告期末未持有基金。

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

本基金本报告期内未交易或持有基金。

6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

§7 开放式基金份额变动

单位:份

项目	交银纯债债券发起A/B	交银纯债债券发起C
报告期期初基金份额总额	458,158,467.75	5,650,674.55
本报告期期间基金总申购份额	377,810,542.78	52,635,888.15
减:本报告期期间基金总赎回份额	466,955,990.44	43,991,195.70
本报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	369,013,020.09	14,295,367.00

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。

§8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内未发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期内未进行本基金的申购、赎回、红利再投等。

§9 备查文件目录

9.1备查文件目录

1、中国证监会批准交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金募集的文件;

2、《交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》;

3、《交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金招募说明书》;

4、《交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金托管协议》;

5、关于募集交银施罗德纯债债券型发起式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纯债债券型发起式证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

9.2存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

9.3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。

交银施罗德持续成长主题混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一八年十月二十六日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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