

交银施罗德成长30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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一八年十月二十六日

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规定。

投资组合参与的交易所公开竞价同一反向交易或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)同向交易的投资交易未出现异常。

5.1.1 报告期期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末持有处于转股期的可转换债券。

Table with 2 columns: 基金名称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日期, 基金管理人, 基金托管人

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 基金经理: 王亚伟, 基金经理: 王鹏

4.1 基金业绩(或基金经理小组)简介
王亚伟, 复旦大学金融学硕士, 曾任: 嘉实证券投资部副经理、嘉实基金资产管理部副经理、嘉实基金资产管理部副经理、嘉实基金资产管理部副经理、嘉实基金资产管理部副经理。

Table with 5 columns: 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(%)

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规定。

4.2 公平交易专项说明
本公司制定了严格的投资控制制度和公平交易监控系统来保证旗下基金运作的公平,旗下所管理的所有投资组合,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。

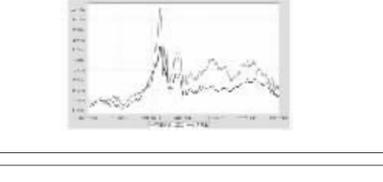
5.1 报告期末基金资产组合情况
序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

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。

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系统来保证旗下基金运作的公平,旗下所管理的所有投资组合,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。

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

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五名债券投资明细
5.6.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债投资明细



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。

4.3 公平交易专项说明
4.3.2 异常交易的专项说明
本公司建立了严格的投资控制制度和公平交易监控系统来保证旗下基金运作的公平,旗下所管理的所有投资组合,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。

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
5.7.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名黄金投资明细

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

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规定。

4.1 基金业绩(或基金经理小组)简介
姓名 职务 任职日期 离任日期 基金经理: 杨洁贞, 基金经理: 杨洁贞

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(%)

Table with 2 columns: 基金名称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日期, 基金管理人, 基金托管人

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 基金经理: 王亚伟, 基金经理: 王鹏

4.1 基金业绩(或基金经理小组)简介
王亚伟, 复旦大学金融学硕士, 曾任: 嘉实证券投资部副经理、嘉实基金资产管理部副经理、嘉实基金资产管理部副经理、嘉实基金资产管理部副经理、嘉实基金资产管理部副经理。

Table with 5 columns: 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(%)

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规定。

4.2 公平交易专项说明
4.2.1 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系统来保证旗下基金运作的公平,旗下所管理的所有投资组合,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。

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

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。

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系统来保证旗下基金运作的公平,旗下所管理的所有投资组合,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。

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五名债券投资明细
5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债投资明细

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
5.7.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名黄金投资明细

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

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规定。

4.1 基金业绩(或基金经理小组)简介
姓名 职务 任职日期 离任日期 基金经理: 杨洁贞, 基金经理: 杨洁贞

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(%)

Table with 2 columns: 基金名称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日期, 基金管理人, 基金托管人

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 基金经理: 王亚伟, 基金经理: 王鹏

4.1 基金业绩(或基金经理小组)简介
王亚伟, 复旦大学金融学硕士, 曾任: 嘉实证券投资部副经理、嘉实基金资产管理部副经理、嘉实基金资产管理部副经理、嘉实基金资产管理部副经理、嘉实基金资产管理部副经理。

Table with 5 columns: 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(%)

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规定。

4.2 公平交易专项说明
4.2.1 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系统来保证旗下基金运作的公平,旗下所管理的所有投资组合,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。

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

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。

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系统来保证旗下基金运作的公平,旗下所管理的所有投资组合,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。

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五名债券投资明细
5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债投资明细

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
5.7.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名黄金投资明细

5.1.1 报告期期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末持有处于转股期的可转换债券。

Table with 5 columns: 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(%)

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五名债券投资明细
5.6.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债投资明细

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
5.7.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名黄金投资明细

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股指期货投资明细
5.8.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细

5.9 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期权投资明细
5.9.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名期权投资明细

5.10 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货币市场基金投资明细
5.10.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名货币市场基金投资明细

5.11 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其他基金投资明细
5.11.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他基金投资明细

5.12 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衍生品投资明细
5.12.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名衍生品投资明细

5.13 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其他资产投资明细
5.13.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细

5.14 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其他资产投资明细
5.14.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细

5.15 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其他资产投资明细
5.15.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细

5.16 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其他资产投资明细
5.16.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细