

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、误导性陈建立重大遗漏,并对其内容的真实性、推确性和完整性承担个别及连带责任。 基金化管及中域收收银行股价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、误导性除处或者重大遗漏。

基金管理人來結以確实信用、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。 基金的过在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。

基金简称	交银先锋混合			
基金主代码	519698			
交易代码	519698(前端)	519699(后端)		
基金运作方式	契约型开放式			
基金合同生效日	2009年4月10日			
报告期末基金份额总额	935,080,540.20(5)			
投资目标	本基金主要通过投资于 的股票,特别是处于快返 制风险的前提下,为基金	本基金主要通过投资于经过严格的品质筛选且具有持续成长潜力企业的股票,特别是处于快速成长过程中的中型及小型企业股票,在通度控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求长期持续的资本增值。		
投资策略	本基金充分发挥基金管 和行业景气变化,以及」 性好、成长具有可持续性 处于快速成长过程中的 益。	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运行 和行业解气变化。以及上带公司成长精力的基础上,主要通过优选成长 性好,成长周月可持续性。成长顶量优良。定价相对全部的股票。特别是 处于快速成长过程中的中型及小型企业股票进行投资,以谋求超额收益。		
业绩比较基准	75%×中证700指数+25	%×中证综合债券指数		
风险收益特征	干快速成长过程中的中	金,以具有持续成长潜力企业的股票,特别是约型及小型企业为主要投资对象,追求超额收益债券型基金和货币市场基金,低于股票型基金 即效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		

	主要财务指标	(2018年7月1日-2018年9月30日)	
	1.本期已实现收益	-90,313,691.85	
	2.本期利润	-33,750,031.26	
	3.加权平均基金份额本期利润	-0.0396	
	4.期末基金资产净值	1,101,990,240.38	
	5.期末基金份额净值	1.1785	
用后	注:1、上述基金业绩指标不包 的实际收益水平要低于所列数	2括持有人认购或交易基金的各项费用,计力 数字:	人去
	2、本期已实现收益指基金本其	期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允份	'nί

| からい | か

益率变动的比较 安银施罗德先锋混合型证券投资基金 分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 (2009年4月10日至2018年9月30日)

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 並或重大遗漏,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局际,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

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

§ 2 基金产品概况

指数收益率+25%×中证综合债券指数收益率"变更为"60%×沪深300指数收益

率+40%×中证综合债券指数收益率",详情见本基金管理人于2018年3月21日发

布的《交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德先进制造混合型证券投资基

§3 主要财务指标和基金净值表现

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

注:1、本基金业绩比较基准自2015年10月1日起,由"75%×申银万国装备制造指数收益率+25%×中信标普全债指数收益率"变更为"75%×申银万国装备制造指数收益率25%×中证综合债券指数收益率"。32.2同。详情见本基金管理人于2015年9月28日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金业

缴比较基准变更并修改基金合同相交内容的公告。 本基金业绩比较基准自2018年3月21日起,由"75%×申银万国装备制设 指数收益率-25%×中证综合债券指数收益率"变更为"60%×沪深300指数收益 率+40%×中证综合债券指数收益率",3.2.2同。详情见本基金管理人于2018年3

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。 极主动的投资风格相结合,自下而上挖掘与先进制造主题相关; 公司投资机会,以减求良好收益。其中,本基金所指的先进制造,

单位:人民币元

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

並可以任主義所不以及其不及及。 近日知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日山

证基金一定盈利。

2资目标

3.1 主要财务指标

3.2 基金净值表现

争值增长 率①

交银施罗德先锋混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

姓名	姓名 即务 任本基金的基金经理		基金经理期限	证券从业年限	说明
X1:-E1	101.97	任职日期	离任日期	HESTALMET-RR	0691
芮晨	交锋交技灵置交据灵置的经银混银创活混银产活混基理 先合.科新配合数业配合金里	2015-05-18	-	11年	丙展先生,内蒙古科技大学工

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谥昭

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 4.3 公平交易专项说明

43.1 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

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

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。 432 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 报告期内基金的投资策略和运作分析 三季度、中美贸易战恶化进一步压缩了市场的估值,我们看到股票市场上有很多板块和个股的估值已经非常具有吸引力,但是由于市场对未来抱有较为悲观

的态度,建仓意愿较低。但我们认为中国市场的容量足够大,也有足够的自我调节 。 现行的政策都在促使经济长期的良性发展,假以时日或可看到施行效果,比

如抑制房地产投资和购买冲动、压缩负债、鼓励发展硬科技等。本组合大部分持仓 与贸易战关联较小,主要选择子行业景气、业绩持续增长的个股,大部分集中于科 展望四季度,我们仍然看好现已布局的行业的景气度,计划维持持仓。

本基金(各类)份额净值及业绩表现。 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 ‡	设告期末基金资产组合	情况	
序号	项目	金額(元)	占基金总资产的比例(%)
	权益投资	1,043,576,427.16	94.13

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值 比例(%)
Α	农、林、牧、渔业	-	
В	采矿业	-	
C	制造业	430,445,206.81	39.0
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	37,119,420.48	3.3
G	交通运输、仓储和邮政业	-	
Н	住宿和餐饮业	-	
I	信息传输、软件和信息技术服务业	416,656,757.95	37.8
J	金融业	-	
K	房地产业	113,578,610.72	10.3
L	租赁和商务服务业	-	
M	科学研究和技术服务业	45,776,431.20	4.1
N	水利、环境和公共设施管理业	-	
0	居民服务、修理和其他服务业	-	
P	教育	-	
Ω	卫生和社会工作	-	
R	文化、体育和娱乐业	-	
-0	tria A		

5.2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合 本基金本报告期末末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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	比例(%)
1	300365	恒华科技	4,428,252	109,289,259.36	9.92
2	300253	卫宁健康	6,970,965	100,521,315.30	9.12
3	000977	浪潮信息	4,158,890	100,146,071.20	9.09
-4	300572	安车检测	1,734,616	76,617,988.72	6.95
Б	002371	北方华创	1,490,948	70,164,012.88	6.37
6	002599	盛通股份	7,032,280	69,760,217.60	6.33
7	600048	保利地产	4,926,517	59,955,711.89	5.44
8	601155	新城控股	2,047,457	53,622,898.83	4.87
9	300012	华测检测	7,838,430	45,776,431.20	4.15
10	600536	中国软件	1,422,380	41,462,377.00	3.76
5.4 报	告期末按债	券品种分类	的债券投资组	合	

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

数量(张 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。

本基金本报告期末未持有权证。

责和处罚。

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

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

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

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

	名称	序号
288,580.18	存出保证金	1
2,200,088.34	应收证券清算款	2
-	应收股利	3
779,206.68	应收利息	4
975,052.29	应收申购款	5
-	其他应收款	6
-	待摊费用	7
-	其他	8
4,242,927.49	合计	9

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 由于四金五人的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差

66 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

《7 开放式基金份额变动

	单位:
报告期期初基金份额总额	723,522,709.84
本报告期期间基金总申购份额	333,185,554.58
减:本报告期期问基金总赎回份额	121,627,724.22
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	935,080,540.20

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

1、中国证监会核准交银施罗德先锋股票证券投资基金募集的文件; 2、《交银施罗德先锋混合型证券投资基金基金合同》;

3、《交银施罗德先锋混合型证券投资基金招募说明书》; 4、《交银施罗德先锋混合型证券投资基金托管协议》;

5、基金管理人业务资格批件、营业执照; 6、基金托管人业务资格批件、营业执照:

7、关于申请募集交银施罗德先锋股票证券投资基金之法律意见书;

8、报告期内交银施罗德先锋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。

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

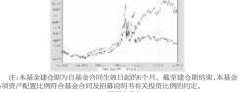
投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人交银施罗德基金管理有限 公司。本公司客户服务中心电话:400-700-5000 (免长途话费) 021-61055000,电子邮件:services@jysld.com。

交银施罗德先进制造混合型证券投资基金

月21日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德先进制造混合型

证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》 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

至银施罗德先进制造混合型证券投资基金 交银施罗德先进制造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 (2011年6月22日至2018年9月30日)



姓名	ann de	任本基金的基	基金经理期限	证券从业年限	284.00
姓名	职务	任职日期	离任日期	HE 93° ANNE 41° FRR	说明
刘鹏	交银先 进制合金 理	2018-05-29	-	4年	刘鹏先生,中国人民大学金融学硕士,北京理工大学经济学学士。2014年6月加入交银施罗德基金管理有限公司,历任行业分析师。

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 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 运用基金资产,基金投资官员 人谋求最大利益。 4.3 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 作的公平。底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 专户均率格益增制度进行公平交易。 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,遗憾"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

4.3.1 公平交易制度的执行情况

格优心、比例分配、印原则、全部通过公易系统址行比例分配、对于非典平宽扩交易、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。 公司中央交易运和风险管理部进行日常投资交易行为监控、风险管理部负责对条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 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

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

本量並工本保证期份小仔生所名类的行列。本保查期份,A公司管理出別有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交换少的单边交易是没有超过该证券当日总成交监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暂下(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 报告期内基金的投资策略和运作分析
三季度市场显着分化、银行板块带动上证50在三季度上涨5.11%,而创业板、

中小板指均有两位数下跌。

2018年是国内经济历史积压问题显现的一年,二季报提及的去杠杆、贸易战、 、民币贬值预期、全球经济回落四个外部风险看,国内的去杠杆在趋缓,汇率在资

本管制和央行预期引导下暂时稳定,但其他两大风险进一步放大, 在此背景下,我们认为还没有明显看到经济基本面快速下行预期,业绩仍有下行空间。但无论从估值角度还是历史相对位置,A股整体或处于底部区域。因 此,我们积极寻找抗周期的方向和标的以及代表中国制造业未来的战略性标的, 并保持中性仓位。

展望未来,短期我们依然会保持二季度的配置策略,等待基本面风险释放。中 长期,我们依然看好中国制造的持续升级,并以此为主线选择和储备标的。本基金 对主动仓位择时保持审慎态度,并保持组合良好流动性。力求控制好业绩回撤,努 力为持有人取得稳健同报。

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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,832,889,676.66	80.05
	其中:股票	1,832,889,676.66	80.05
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	114,413,500.00	5.00
	其中:债券	114,413,500.00	5.00
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买人返售金融资产	-	-
	其中: 汉斯式回购的买人返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	289,618,705.35	12.65

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

Α	农、林、牧、渔业	-	-
В	采矿业	166,262,435.68	7.31
C	制造业	1,295,546,857.91	56.95
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	24,498,267.65	1.08
G	交通运输、仓储和邮政业	73,307,992.80	3.22
Н	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	22,647,443.00	1.00
J	金融业	23,101,163.08	1.02
K	房地产业	169,380,773.38	7.45
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	22,602,768.08	0.99
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	35,541,975.08	1.56
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,832,889,676.66	80.56

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

15.15	82391099	8234-6145	SOCIET (HISC)	257CBF1EL(7C)	比例(%)
1	601100	恒立液压	9,716,526	216,970,025.58	9.54
2	600967	内蒙一机	13,389,849	185,315,510.16	8.15
3	600038	中直股份	4,142,231	165,109,327.66	7.26
4	600256	广汇能源	27,305,888	139,533,087.68	6.13
5	000768	中航飞机	8,662,034	137,553,099.92	6.05
6	600048	保利地产	7,136,132	86,846,726.44	3.82
7	603338	浙江縣力	1,425,048	77,237,601.60	3.39
8	300146	汤臣倍健	3,338,414	68,437,487.00	3.01
9	600990	四创电子	1,534,605	65,988,015.00	2.90
10	000002	万科A	2,628,853	63,881,127.90	2.81
5.4 报	告期末按信	贵券品种分类的	的债券投资组	合	

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

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

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

本基金本报告期末未持有权证。

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

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

5.11.3其他资产构成

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的 5.11.6投资组合报告附注的其他文字描述部分 由于四舍五人的原因,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 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

注:1、如果本报告期间发生转换人、红利再投业务、则总申购份额中包含

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 基金管理人运用周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。

82基金管理人运用固有资金投资水基金交易阻细 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 中国证监会核准存组施罗德失进制造股票证券投资其全募集的文件

中国证监会准予交银施罗德先进制造混合型证券投资基金变更注册的文

3、《交银施罗德先进制造混合型证券投资基金基金合同》:

4、《交银施罗德先进制造混合型证券投资基金招募说明书》; 5、《交银施罗德先进制造混合型证券投资基金招募说明书》; 6、关于申请募集交银施罗德先进制造股票证券投资基金之法律意见书;

7、关于申请变更注册交银施罗德先进制造混合型证券投资基金的法律意见 8、基金管理人业务资格批件、营业执照;

9、基金托管人业务资格批件、营业执照

9.2存放地点

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%的

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

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用中式 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。

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 报告送出日期:二〇一八年十月二十六日

报古医山口期:一〇一八年十月二十六日 東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 述或直大遗漏,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。 基金托管人中信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

。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 基金 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。

基金简称	交银现金宝货币			
基金主代码	000710			
基金运作方式	契约型开放式			
基金合同生效日	2014年9月12日			
报告期末基金份额总额	3,837,434,842.11(f)			
投资目标	在力求本金安全性和资产充分流动性的前提下, 追求超过业绩比较基准的投资收益。			
投资策略	本基金在保持组合高度流动性的前提下,结合对国内外宏观经济运行。 金融市场运行,资金流动格局,货币市场收益率曲线形态等各方面的分 析,合理安排组合顺限结构,取极选择投资工具,采取主动性的投资策 略和精细化的操作手法。			
业绩比较基准	活期存飲利率(税后)			
风险收益特征	本基金属于货币市场基金,是证券投资基金中的低风险品种,长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。			
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司			
基金托管人	中信银行股份有限公司			
下属两级基金的基金简称	交银现金宝货币A	交银现金宝货币E		
下属两级基金的交易代码	000710	002918		
报告期末下属两级基金的份额总额	3.425.723.330.36(2)	411.711.511.75f ?		

1、本基金实行销售服务费分类收费方式,分设两类基金份额: A类基金 和E类基金份额。A类基金份额与E类基金份额的管理费、托管费相同,A类基金份额按照0.25%的年费率计提销售服务费,E类基金份额按照0.01%的年费率计提销售 服务费。在计算主要财务指标时、A类基金份额与分类前基金连续计算、E类基金份 额按新设基金计算: T异; 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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

3.1 主要财务指标

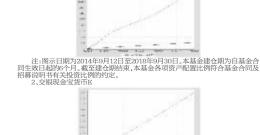
1、交银现金宝货币A

主要财务指标

变动收益,扣除相关费用后的余额、本明利高收入、过度收益、美国吃人、个百么儿间国变动收益,扣除相关费用后的余额、本明利润为本明已实现收益加上本明公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。 2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较交银现金宝货币A:

主:本基金收益分配按日结转 交银现金宝货币E 净值收益率 标准差2 阶段 10-3 2-4

交银施罗德现金宝货币市场基金 安银施罗德现金宝货币市场基金 份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图 (2014年9月12日至2018年9月30日)



注:本基金自2016年8月15日起增加E类基金份额类别,投资者提交的申购申请于2016年9月13日被确认并将有效份额登记在册。图示日期为2016年9月13日至2018年9月30日。 6.4 等用人担生

姓名	职务	任本基金的基	基金经理期限	证券从业	说明
ALTI	400	任职日期	离任日期	年限	0071
黄莹洁	交别, 交别, 交别, 交别, 交别, 交别, 一般, 一般, 一般, 一般, 一般, 一般, 一般, 一般	2015-05-27	-	10年	剪莹洁女士,香港大学工商 管理硕士,北京大学经济 学个管理学双学士,历任中 高基金管理有限公司交易 负。2012年加入交银施罗德 基金管理有限公司,历任年 大交易至交易员。2016年7月 月20日至2018年3月18日日 任交银施罗德丰泽收益债 参型证券投资基金的基金 经理。
连端清	交财的企业。 交财的企业, 实外, 实外, 实外, 实外, 实外, 实外, 实外, 实外	2015-08-04	-	5年	產端清先生,复旦大学经济 学博士,历任交通银行总行 金融市场部、规附证券研广省 所研究员、中航信托资产省 交包施业等基金合理相关。 公司8年3月31日至 2018年3月31日至 2018年3月31日租任交银 要等指外地價债券型证券 投资基金的基金处理。 投资基金的基金处理。

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。

的相关公告。

4.2 报告期内本基金还在"克想"行情语记说明

4.2 报告期内本基金产作遵规"行情情记说明

4.2 报告期内本基金产作遵规"行情情记说明

基金局面和其他相关法律法规的规定,并本看诚实信用,勤勉是责的原则管理和
运用基金资产,基金投管理价合有关法律法规和基金合同的规定,为基金持有
人课永被大利战。

4.3 公平交易专项说明

4.3 公平交易专项说明

4.3 公平交易专项说明

4.3 公平交易专项说明

4.5 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
专户均严格健阔制度进行公平交易。

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员方面享有公平的机会、公司在交易执行环行变行集中交易制制度,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、

2018年第三季度报告 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。 公司中央交易强和风险管理部进行后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 组合的整体应益率差异分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口间向交易的

交银施罗德现金宝货币市场基金

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

细

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个银行 市场交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明 本基金本报告期内债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。 5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

四 报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明 本基金合同约定:"本基金投资组合的平均剩余期限超过120天情况说明 2026"。本程告期内、本基金未发生超标情况。 5.32 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

6.6报告期末按辦会成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明

摊余成本(元 148,546,4 5.7 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

本基金本报告期内未存在负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。 报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明 本基金本报告期内未存在正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。 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十名资产支持证 本基金本报告期末未持有资产支持证券。 5.9.1基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价,即计价对象以买人成本列示,按票面利率或商 定利率并考虑其买人时的溢价与折价,在其剩余期限内按照实际利率和摊余成本 逐日推销计算损益。 5.92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 5.9.3其他各项资产构成

0.4投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五人的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。 § 6 开放式基金份额变动

	項目	交银现金宝货币A	交银现金宝货币E	
	报告期期初基金份额总额	2,995,788,827.31	407,800,174.24	
	报告期期问基金总申购份额	17,127,719,907.40	3,922,541.15	
	报告期期问基金总赎回份额	16,697,785,404.35	11,203.64	
	报告期期末基金份额总额	3,425,723,330.36	411,711,511.75	
	注:1、如果本报告期间发生转	换入、份额类别调整、	红利再投业务,则总申	败
份客	顶中包含该业务;			
	2、如果本报告期间发生转换	出、份额类别调整业务	,则总赎回份额中包含	讨这

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

单位:份

、本基金管理人本报 期末持有本基金A类 类基金总份额的0.00%;持有本基金E类份额258,876.13份,占本基金期末E类基

业务.

8.1备查文件目录 1.中国证监会推予交粮施罗德现金宝货币市场基金募集注册的文件; 2.《交银施罗德现金宝货币市场基金基金合同》; 3.《交银施罗德现金宝货币市场基金托营协识》; 4.《交银施罗德现金宝货币市场基金托营协议》; 5.英阳请募集交粮施罗德现金宝货市市场基金的法律意见书; 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.报告期内安银施罗德观金宝货币市场基金在指定报刊上各项公告的原稿。 8.2存放地点 备查文件存放于基金管理人的办公场所。 8.3查阅方式

图3上(下行政) 4基型 日主/(137)公园/(138)。
8.3 擅同方式
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数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。本见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。