

交银施罗德先锋混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

本基金报告期内无需预留说明。

5.1 投资组合报告

5.1.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------------|------------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 1,043,576,427.30 | 94.13 |
| 2 | 其中:股票 | 1,043,576,427.30 | 94.13 |
| 3 | 固定收益投资 | 51,564,400.00 | 4.69 |
| 4 | 其中:债券 | 51,564,400.00 | 4.69 |
| 5 | 资产支持证券 | - | - |
| 6 | 贵金属投资 | - | - |
| 7 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 8 | 买入返售金融资产 | - | - |
| 9 | 其他投资 | - | - |
| 10 | 银行存款和结算备付金合计 | 8,946,910.04 | 0.81 |
| 11 | 其他流动资产 | 4,242,327.49 | 0.38 |
| 12 | 合计 | 1,108,619,664.83 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------------------|------------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 403,448,284.81 | 36.34 |
| 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 | 37,119,438.40 | 3.37 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息技术业 | 416,668,756.76 | 37.51 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 113,670,632.92 | 10.31 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 46,776,431.20 | 4.19 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 医药制造业 | - | - |
| P | 医药批发和零售 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| 合计 | | 1,043,576,427.30 | 94.10 |

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 | 300065 | 顺丰控股 | 4,429,282 | 109,289,250.36 | 9.82 |
| 2 | 300033 | 三七互娱 | 6,079,946 | 100,523,316.30 | 9.15 |
| 3 | 000019 | 招商局A | 4,368,000 | 100,146,071.20 | 9.09 |
| 4 | 300072 | 中航光电 | 1,754,616 | 70,617,888.72 | 6.37 |
| 5 | 002071 | 北方导航 | 1,400,948 | 69,700,210.60 | 6.26 |
| 6 | 002089 | 汇创世纪 | 7,032,280 | 69,700,210.60 | 6.26 |
| 7 | 000048 | 招商局B | 4,508,517 | 58,566,171.80 | 5.31 |
| 8 | 001156 | 中航机载 | 2,047,487 | 53,622,860.80 | 4.87 |
| 9 | 300012 | 华测导航 | 7,908,420 | 48,776,431.20 | 4.41 |
| 10 | 000536 | 中航电子 | 1,422,380 | 47,642,377.00 | 4.31 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 投资组合报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

| 姓名 | 职务 | 任职起始日期 | 离任日期 | 证券从业资格 | 说明 |
|----|----------------------|------------|------|--------|--|
| 刘勇 | 交银施罗德先锋混合型证券投资基金基金经理 | 2016-05-20 | - | 4/6 | 刘勇先生,中国人民大学管理学硕士,北京理工大学金融学硕士,曾任交通银行总行资产管理部副经理,交通银行总行资产管理部副经理,交通银行总行资产管理部副经理,交通银行总行资产管理部副经理,交通银行总行资产管理部副经理。 |

注:基金经理(或基金经理小组)离职说明(如有)敬请关注基金管理人发布的相关公告。

4.2 管理人对于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,并未有损害诚实信用、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,为基金份额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系统来保证旗下基金运作的公平,旗下所有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。

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没有超过该证券当日成交量5%的情形。本基金与本公司管理的其他投资组合存在不同时间段(如日内、3日内、5日内)同向交易的价格差未出现异常。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度,中美贸易摩擦进一步加剧了市场的估值,我们观察到股票市场上有低估值板块的估值存在修复空间,但受制于市场对未来经济前景较为悲观的态度,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能力。

现行政策在促进经济长期的良性发展,量足时或可看到行情效果,比如抑制房地产投资和购买力,压缩低效、鼓励发展硬科技等。本组合大部分持仓与贸易关联度较小,主要选择子行业景气、业绩持续增长的个股,大部分集中于科技行业。

展望四季度,我们仍然看好现有布局的权益仓位,计划维持持仓。

4.5 报告期内基金的投资表现

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人数或基金资产净值预留说明

本基金报告期内基金持有人人数或基金资产净值无需预留说明。

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

3.1 主要财务指标

| 项目 | 报告期 | 本报告期(2018年7月1日至2018年9月30日) |
|--------------|-----|----------------------------|
| 1.本期利润总额 | | -90,313,499.88 |
| 2.本期费用 | | -39,760,033.26 |
| 3.本期资产减值损失 | | -60.00 |
| 4.本期公允价值变动损益 | | 1,101,909,664.83 |

3.2 基金净值表现

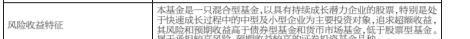
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 净值增长率 | 业绩比较基准 | ①-② | ③-④ |
|-------|-------|--------|--------|-------|
| 过去三个月 | 0.83% | 1.8% | -0.97% | 0.02% |

注:1.本基金业绩比较基准自2015年10月1日起,由“75%×中证700指数收益率+25%×中债综合债券指数”变更为“75%×中证700指数收益率+25%×中债综合债券指数”,3.2.2项下,请详见本基金管理人于2015年9月29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绩比较基准变更并修改基金合同相关内容的公告》。

3.2.2 本基金自合同生效以来,本基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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(2009年4月15日至2018年9月30日)



注:本基金建仓期为自基金合同生效之日起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约定。

3.3 主要财务指标

| 项目 | 报告期 | 本报告期(2018年7月1日至2018年9月30日) |
|--------------|-----|----------------------------|
| 1.本期利润总额 | | -381,543,034.11 |
| 2.本期费用 | | 6,382,753.60 |
| 3.本期资产减值损失 | | 0.00 |
| 4.本期公允价值变动损益 | | 3,276,079,072.60 |

3.2 基金净值表现

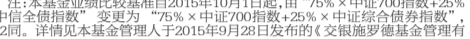
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 净值增长率 | 业绩比较基准 | ①-② | ③-④ |
|-------|-------|--------|--------|-------|
| 过去三个月 | 0.83% | 1.8% | -0.97% | 0.02% |

注:1.本基金业绩比较基准自2015年10月1日起,由“75%×沪深300指数收益率+25%×中债综合债券指数收益率”变更为“75%×沪深300指数收益率+40%×中债综合债券指数收益率”,详见本基金管理人于2015年9月29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决议变更业绩比较基准的公告》。

3.2.2 本基金自合同生效以来,本基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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(2014年9月12日至2018年9月30日)



注:本基金建仓期为自基金合同生效之日起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约定。

3.3 主要财务指标

| 项目 | 报告期 | 本报告期(2018年7月1日至2018年9月30日) |
|--------------|-----|----------------------------|
| 1.本期利润总额 | | -381,543,034.11 |
| 2.本期费用 | | 6,382,753.60 |
| 3.本期资产减值损失 | | 0.00 |
| 4.本期公允价值变动损益 | | 3,276,079,072.60 |

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

| 阶段 | 净值增长率 | 业绩比较基准 | ①-② | ③-④ |
|-------|-------|--------|--------|-------|
| 过去三个月 | 0.83% | 1.8% | -0.97% | 0.02% |

注:1.本基金业绩比较基准自2015年10月1日起,由“75%×沪深300指数收益率+25%×中债综合债券指数收益率”变更为“75%×沪深300指数收益率+40%×中债综合债券指数收益率”,详见本基金管理人于2015年9月29日发布的《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决议变更业绩比较基准的公告》。

3.2.2 本基金自合同生效以来,本基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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(2014年9月12日至2018年9月30日)



注:本基金建仓期为自基金合同生效之日起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约定。

3.3 主要财务指标

| 项目 | 报告期 | 本报告期(2018年7月1日至2018年9月30日) |
|--------------|-----|----------------------------|
| 1.本期利润总额 | | -381,543,034.11 |
| 2.本期费用 | | 6,382,753.60 |
| 3.本期资产减值损失 | | 0.00 |
| 4.本期公允价值变动损益 | | 3,276,079,072.60 |

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

| 阶段 | 净值增长率 | 业绩比较基准 | ①-② | ③-④ |
|-------|-------|--------|--------|-------|
| 过去三个月 | 0.83% | 1.8% | -0.97% | 0.02% |

注:1.本基金业绩比较基准自2015年10月1日起,由“75%×沪深300指数收益率+25%×中债综合债券指数收益率”变更为“75%×沪深300指数收益率+40%×中债综合债券指数收益率”,详见本基金管理人于2015年9月29日发布的《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决议变更业绩比较基准的公告》。

3.2.2 本基金自合同生效以来,本基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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(2014年9月12日至2018年9月30日)



注:本基金建仓期为自基金合同生效之日起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约定。

3.3 主要财务指标

| 项目 | 报告期 | 本报告期(2018年7月1日至2018年9月30日) |
|--------------|-----|----------------------------|
| 1.本期利润总额 | | -381,543,034.11 |
| 2.本期费用 | | 6,382,753.60 |
| 3.本期资产减值损失 | | 0.00 |
| 4.本期公允价值变动损益 | | 3,276,079,072.60 |

3.2 基金净值表现

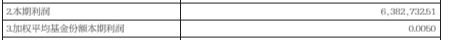
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 净值增长率 | 业绩比较基准 | ①-② | ③-④ |
|-------|-------|--------|--------|-------|
| 过去三个月 | 0.83% | 1.8% | -0.97% | 0.02% |

注:1.本基金业绩比较基准自2015年10月1日起,由“75%×沪深300指数收益率+25%×中债综合债券指数收益率”变更为“75%×沪深300指数收益率+40%×中债综合债券指数收益率”,详见本基金管理人于2015年9月29日发布的《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决议变更业绩比较基准的公告》。

3.2.2 本基金自合同生效以来,本基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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(2014年9月12日至2018年9月30日)



注:本基金建仓期为自基金合同生效之日起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约定。

3.3 主要财务指标

| 项目 | 报告期 | 本报告期(2018年7月1日至2018年9月30日) |
|--------------|-----|----------------------------|
| 1.本期利润总额 | | -381,543,034.11 |
| 2.本期费用 | | 6,382,753.60 |
| 3.本期资产减值损失 | | 0.00 |
| 4.本期公允价值变动损益 | | 3,276,079,072.60 |

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

| 阶段 | 净值增长率 | 业绩比较基准 | ①-② | ③-④ |
|-------|-------|--------|--------|-------|
| 过去三个月 | 0.83% | 1.8% | -0.97% | 0.02% |

注:1.本基金业绩比较基准自2015年10月1日起,由“75%×沪深300指数收益率+25%×中债综合债券指数收益率”变更为“75%×沪深300指数收益率+40%×中债综合债券指数收益率”,详见本基金管理人于2015年9月29日发布的《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决议变更业绩比较基准的公告》。

3.2.2 本基金自合同生效以来,本基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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(2014年9月12日至2018年9月30日)



注:本基金建仓期为自基金合同生效之日起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约定。

3.3 主要财务指标

| 项目 | 报告期 | 本报告期(2018年7月1日至2018年9月30日) |
|--------------|-----|----------------------------|
| 1.本期利润总额 | | -381,543,034.11 |
| 2.本期费用 | | 6,382,753.60 |
| 3.本期资产减值损失 | | 0.00 |
| 4.本期公允价值变动损益 | | 3,276,079,072.60 |

3.2 基金净值表现

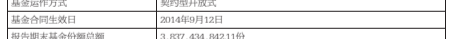
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 净值增长率 | 业绩比较基准 | ①-② | ③-④ |
|-------|-------|--------|--------|-------|
| 过去三个月 | 0.83% | 1.8% | -0.97% | 0.02% |

注:1.本基金业绩比较基准自2015年10月1日起,由“75%×沪深300指数收益率+25%×中债综合债券指数收益率”变更为“75%×沪深300指数收益率+40%×中债综合债券指数收益率”,详见本基金管理人于2015年9月29日发布的《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决议变更业绩比较基准的公告》。

3.2.2 本基金自合同生效以来,本基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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(2014年9月12日至2018年9月30日)



注:本基金建仓期为自基金合同生效之日起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约定。

3.3 主要财务指标

| 项目 | 报告期 | 本报告期(2018年7月1日至2018年9月30日) |
|--------------|-----|----------------------------|
| 1.本期利润总额 | | -381,543,034.11 |
| 2.本期费用 | | 6,382,753.60 |
| 3.本期资产减值损失 | | 0.00 |
| 4.本期公允价值变动损益 | | 3,276,079,072.60 |

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

| 阶段 | 净值增长率 | 业绩比较基准 | ①-② | ③-④ |
|-------|-------|--------|--------|-------|
| 过去三个月 | 0.83% | 1.8% | -0.97% | 0.02% |

注:1.本基金业绩比较基准自2015年10月1日起,由“75%×沪深300指数收益率+25%×中债综合债券指数收益率”变更为“75%×沪深300指数收益率+40%×中债综合债券指数收益率”,详见本基金管理人于2015年9月29日发布的《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决议变更业绩比较基准的公告》。

3.2.2 本基金自合同生效以来,本基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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(2014年9月12日至2018年9月30日)

