

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：二〇一九年一月二十一日

§ 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的规定，于2019年1月18日核对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请仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期从财务资料未统计。

本报告期自2018年10月1日起至2018年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称：交银施罗德趋势优先混合型证券投资基金

基金代码：631992

交易代码：631992(场内) 631992(场外)

基金上市方式：定期开放式

基金合同生效日：2010年10月20日

报告期末基金份额总额：304,466,971.00份

基金类型：股票型证券投资基金

基金管理人：交银施罗德基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标 报告期 (2018年10月11日-2018年12月31日)

1.本期已实现收益 -20,040,931.92

2.本期利润 -40,801,237.40

3.加权平均基金份额利润率 -0.5660

4.期末基金份额净值 299,526,034.46

5.期末基金份额净值 -1.125

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，计费费用影响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（不含公允价值变动损益）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损益；

3.2.2 基金净值表现

本基金在报告期内不存在异常交易行为。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。

交银施罗德趋势优先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

(2010年12月22日至2018年12月31日)

交银施罗德趋势优先混合型证券投资基金

2018年第四季度报告

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、完整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的规定，于2019年1月18日核对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请仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期从财务资料未统计。

本报告期自2018年10月1日起至2018年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称：交银施罗德趋势优先混合型证券投资基金

基金代码：631992

交易代码：631992(场内) 631992(场外)

基金上市方式：定期开放式

基金合同生效日：2010年10月20日

报告期末基金份额总额：304,466,971.00份

基金类型：股票型证券投资基金

基金管理人：交银施罗德基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标 报告期 (2018年10月11日-2018年12月31日)

1.本期已实现收益 -20,040,931.92

2.本期利润 -40,801,237.40

3.加权平均基金份额利润率 -0.5660

4.期末基金份额净值 299,526,034.46

5.期末基金份额净值 -1.125

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，计费费用影响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（不含公允价值变动损益）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损益；

3.2.2 基金净值表现

本基金在报告期内不存在异常交易行为。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。

交银施罗德趋势优先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

(2010年12月22日至2018年12月31日)

信息披露 Disclosure

交银施罗德趋势优先混合型证券投资基金

2018年第四季度报告

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、完整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的规定，于2019年1月18日核对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请仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期从财务资料未统计。

本报告期自2018年10月1日起至2018年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称：交银施罗德趋势优先混合型证券投资基金

基金代码：631992

交易代码：631992(场内) 631992(场外)

基金上市方式：定期开放式

基金合同生效日：2010年10月20日

报告期末基金份额总额：304,466,971.00份

基金类型：股票型证券投资基金

基金管理人：交银施罗德基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标 报告期 (2018年10月11日-2018年12月31日)

1.本期已实现收益 -20,040,931.92

2.本期利润 -40,801,237.40

3.加权平均基金份额利润率 -0.5660

4.期末基金份额净值 299,526,034.46

5.期末基金份额净值 -1.125

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，计费费用影响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（不含公允价值变动损益）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损益；

3.2.2 基金净值表现

本基金在报告期内不存在异常交易行为。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。

交银施罗德趋势优先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

(2010年12月22日至2018年12月31日)

交银施罗德趋势优先混合型证券投资基金

2018年第四季度报告

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、完整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的规定，于2019年1月18日核对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请仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期从财务资料未统计。

本报告期自2018年10月1日起至2018年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称：交银施罗德趋势优先混合型证券投资基金

基金代码：631992

交易代码：631992(场内) 631992(场外)

基金上市方式：定期开放式

基金合同生效日：2010年10月20日

报告期末基金份额总额：304,466,971.00份

基金类型：股票型证券投资基金

基金管理人：交银施罗德基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标 报告期 (2018年10月11日-2018年12月31日)

1.本期已实现收益 -20,040,931.92

2.本期利润 -40,801,237.40

3.加权平均基金份额利润率 -0.5660

4.期末基金份额净值 299,526,034.46

5.期末基金份额净值 -1.125

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，计费费用影响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（不含公允价值变动损益）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损益；

3.2.2 基金净值表现

本基金在报告期内不存在异常交易行为。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。

交银施罗德趋势优先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

(2010年12月22日至2018年12月31日)

交银施罗德趋势优先混合型证券投资基金

2018年第四季度报告

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、完整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的规定，于2019年1月18日核对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请仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期从财务资料未统计。

本报告期自2018年10月1日起至2018年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称：交银施罗德趋势优先混合型证券投资基金

基金代码：631992