

交银施罗德瑞鑫定期开放灵活配置混合型证券投资基金

2018年度报告摘要

2018年12月31日
基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年三月二十一日
§ 重要提示

基金管理人的董事会、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，并对内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本基金报告已经本公司之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。
基金管理人严格遵守《基金法》等法律法规及基金合同，建立健全内部风险控制制度，确保基金运作的规范、安全、稳健，保护基金份额持有人的合法权益。
基金合同和基金招募说明书在法律允许的范围内不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，基金管理人承诺并愿意承担由此产生的法律责任。
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基金的招募说明书及其更新。
本年度报告摘要幅度自报告发布之日起，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。
本报告出自2018年1月1日起至12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称 交银施罗德瑞鑫定期开放灵活配置混合型证券投资基金

基金代码 003900

交易方式 线上线下

基金合同生效日 2016年12月10日

基金管理人 交银施罗德基金管理有限公司

基金托管人 招商银行股份有限公司

报告期末基金份额总额 300,204,260.10份

基金合同存续期 不定期

投资目标 本基金在控制风险的前提下，力争为投资者提供长期稳定的回报。

本基金充分发掘基金管理人的研究优势，在分析和判断宏观经济周期和金融市场运行趋势的基础上，自下而上地通过股票、债券等资产的配置，力求在严控风险的前提下实现基金资产的稳定增值。

投资策略 在严控风险的前提下，本基金将根据宏观经济形势、政策变化、市场环境、资金供求状况、估值水平、流动性等因素，综合运用资产配置策略、股票精选策略、债券投资策略、现金管理策略等，通过资产配置和个股精选，力争在严控风险的前提下实现基金资产的稳定增值。

业绩比较基准 60%×沪深300指数收益率+40%×中债总财富(全价)指数

风险收益特征 本基金是一只股票型基金，其风险和预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金，属于中高风险、预期收益较高的股票型投资基金品种。

2.2 基金产品说明

投资目标 本基金在控制风险的前提下，力争为投资者提供长期稳定的回报。

本基金充分发掘基金管理人的研究优势，在分析和判断宏观经济周期和金融市场运行趋势的基础上，自下而上地通过股票、债券等资产的配置，力求在严控风险的前提下实现基金资产的稳定增值。

业绩比较基准 60%×沪深300指数收益率+40%×中债总财富(全价)指数

风险收益特征 本基金是一只股票型基金，其风险和预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金，属于中高风险、预期收益较高的股票型投资基金品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目 基金管理人 基金托管人

名称 交银施罗德基金管理有限公司 招商银行股份有限公司

姓名 王晓华 龚禹

信息披露负责人 (021)61060660 0755-82190094

电子邮箱 xuping.yz@jzchina.com youchang@cmbschina.com

客户服务电话 400-700-5000; 021-61060660

传真 (021)61060664 0755-83196201

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 www.jzfund01.com

基金年度报告备查地点 基金管理人的办公场所

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标 金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标 2018年 2017年 2016年12月14日至基金合同生效日止(2016年12月10日)

本期已实现收益 12,799,222.16 16,883,216.79 569,130.73

本期利润 6,686,409.02 28,928,140.44 602,167.65

加权平均基金份额本期报酬率 0.0190 0.0064 0.0020

本期基金份额净增减额 173% 9.62% 0.20%

3.1.2 期末数据和指标 2018年末 2017年末 2016年末

期末可供分配基金份额利润 0.1008 0.0081 0.0019

期末基金总资产值 336,446,521.81 329,563,094.13 300,626,809.77

期末基金总负债值 11,174 1.01 1.0004

期末基金份额净值 1.0000 1.0000 1.0000

注:1. 上述基金净值指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用, 计入费用后的实际净值将低于所列数字;
2. 本期利润反映的是基金本期收入、收入损失、其他收入(不含公允价值变动损益)扣除费用后的余额, 本期利润为本期已实现收入扣除本期公允价值变动损益后的余额;
3. 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变幅及其与同期业绩比较基准收益率变幅的比较



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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率与其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.4 管理人报告

3.2.4.1 基金管理人及基金经理的简介

4.1 基金管理人及基金经理的简介

4.1.1 基金管理人及基金经理的简介

交银施罗德基金管理有限公司根据中国证监会证监基金字[2005]1128号文批准,由交通银行股份有限公司、施罗德投资管理有限公司、中国国际海运集装箱(集团)股份有限公司共同发起设立。公司成立于2005年8月4日,注册地在中国上海,注册资本为人民币亿元。其中,交通银行股份有限公司持有65%的股份,中国国际海运集装箱(集团)股份有限公司持有30%的股份,交银施罗德基金管理有限公司持有5%的股份。旗下下设交通施罗德资产管理(香港)有限公司和交银施罗德资产管理有限公司。

截至目前,本公司管理包括货币型、债券型、保本混合型、普通混合型和股票型在内的基金产品,其中股票型涵盖普通指数型、交易型开放式(ETF)、QDII等不同类别基金。

4.1.2 基金经理(基金经理小组)及基金经理助理的简介

姓名 职务 在本基金的基金管理人(助理) 从业年限 离任日期 离任原因

李晓华 女士,中国共产党党员,复旦大学应用数学与计算科学系学士,硕士,交银施罗德基金管理有限公司研究员,2012年起任交银施罗德基金管理有限公司基金经理助理,2017年3月起任基金经理。

王晓华 女士,中国共产党党员,交银施罗德基金管理有限公司总经理助理,2017年3月起任基金经理。

龚禹 女士,中国共产党党员,交银施罗德基金管理有限公司基金经理助理,2017年3月起任基金经理。

注:1. 本表所列基金经理(助理)任职日期和离职日期均以基金合同生效日或公司作出决定并公告之日(如适用)之日为准;
2. 本表摘录“证券从业”指从事于中国证监会认可的“证券从业”的含义,即从事于证券业、保险业、银行业、信托业、证券投资基金、证券业协会、证券业协会证券从业人员资格管理办公室(以下简称“从业”)的有关规定;

3. 基金经理(基金经理小组)后期变动(如有)请关注基金管理人发布的相关公告。

4.2 管理人对报告期内基本情况进行说明

在报告期内,基金管理人严格执行《中华人民共和国证券投资基金法》、

基金合同和基金的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,为基金持有人谋取最大利益。

4.2.1 管理人对报告期内基本情况进行说明

在报告期内,基金管理人严格执行《中华人民共和国证券投资基金法》、

基金合同和基金的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,为基金持有人谋取最大利益。

4.2.2 管理人对报告期内基金的运作总体情况

报告期内,本基金严格按照《基金法》、

基金合同和基金的相关法律法规的规定,并结合本基金的实际情况,在投资决策、基金交易、组合构建、资产配置、风险管理等方面,严格执行《基金法》、

基金合同和基金的相关法律法规的规定,并结合本基金的实际情况,在投资决策、基金交易、组合构建、资产配置、风险管理等方面,严格执行《基金法》、