

交银施罗德持续成长主题混合型证券投资基金

2019年第一季度报告

报告期基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

4.6 报告期内基金持有人数或基金份额净值预警说明

本基金报告期内内无需预警说明

5.5 投资组合报告

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(%)

1 权益投资 1,924,389,231,660 83.04

其中：股票 1,924,389,231,660 83.04

2 基金投资 - -

3 固定收益投资 81,669,100,000 3.62

其中：债券 81,669,100,000 3.62

货币市场基金 - -

4 货币市场基金 - -

5 金融衍生品投资 - -

6 买入返售金融资产 - -

其中：买断式到期的买入返售金融资产 - -

7 衍生工具投资准备金合计 209,762,399,320 13.60

8 其他资产 22,622,755,198 0.98

9 内部 2,317,442,477,717 100.00

10 合计 2,190,702,368,000 -

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细

序号 债券代码 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 1990000 10年期国债 810,000 80,598,000,000 3.68%

2 1200000 10年期国债 10,812 1,081,200,000 0.05%

3 金债债券 - -

4 企债债券 - -

5 中期票据 - -

6 可转债(可交换债) 1,081,200,000 0.05%

7 同业存单 - -

8 其他 - -

9 其他 1,719,702,368,000 100.00%

10 合计 1,719,702,368,000 100.00%

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贵金属投资明细

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 A 农林、牧、渔业 - -

2 B 制造业 - -

3 C 交通运输、仓储和邮政业 909,649,454,323 32.97

4 D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 - -

5 E 建筑业 - -

6 F 制造和修理业 - -

7 G 交通运输、仓储和邮政业 - -

8 H 银行业 884,728,180,214 30.39

9 J 金融业 134,343,000 0.01

10 K 研究、技术服务和地质勘查业 70,998,202,622 3.24

11 L 租赁和商务服务业 - -

12 M 科学、研究和技术服务业 90,775,414,40 4.14

13 N 水利、环境和公共设施管理业 - -

14 O 制造服务、修理和其他服务业 - -

15 P 教育 - -

16 Q 卫生和社会工作 201,173,212,056 13.31

17 R 文化、体育和娱乐业 76,562,031,72 3.60

S 综合 - -

18 合计 1,924,389,231,660 83.04

5.5 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

5.2 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

A 农、林、牧、渔业 - -

B 制造业 - -

C 交通运输、仓储和邮政业 909,649,454,323 32.97

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 - -

E 建筑业 - -

F 制造和修理业 - -

G 交通运输、仓储和邮政业 - -

H 银行业 884,728,180,214 30.39

I J 金融业 134,343,000 0.01

K 研究、技术服务和地质勘查业 70,998,202,622 3.24

L 租赁和商务服务业 - -

M 科学、研究和技术服务业 90,775,414,40 4.14

N 水利、环境和公共设施管理业 - -

O 制造服务、修理和其他服务业 - -

P 教育 - -

Q 卫生和社会工作 201,173,212,056 13.31

R 文化、体育和娱乐业 76,562,031,72 3.60

S 综合 - -

5.5 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

A 农、林、牧、渔业 - -

B 制造业 - -

C 交通运输、仓储和邮政业 909,649,454,323 32.97

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 - -

E 建筑业 - -

F 制造和修理业 - -

G 交通运输、仓储和邮政业 - -

H 银行业 884,728,180,214 30.39

I J 金融业 134,343,000 0.01

K 研究、技术服务和地质勘查业 70,998,202,622 3.24

L 租赁和商务服务业 - -

M 科学、研究和技术服务业 90,775,414,40 4.14

N 水利、环境和公共设施管理业 - -

O 制造服务、修理和其他服务业 - -

P 教育 - -

Q 卫生和社会工作 201,173,212,056 13.31

R 文化、体育和娱乐业 76,562,031,72 3.60

S 综合 - -

5.5 报告期末按行业分类的其他证券投资组合

5.2 报告期末按行业分类的其他证券投资组合

序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

A 农、林、牧、渔业 - -

B 制造业 - -

C 交通运输、仓储和邮政业 909,649,454,323 32.97

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 - -

E 建筑业 - -

F 制造和修理业 - -

G 交通运输、仓储和邮政业 - -

H 银行业 884,728,180,214 30.39

I J 金融业 134,343,000 0.01

K 研究、技术服务和地质勘查业 70,998,202,622 3.24

L 租赁和商务服务业 - -

M 科学、研究和技术服务业 90,775,414,40 4.14

N 水利、环境和公共设施管理业 - -

O 制造服务、修理和其他服务业 - -

P 教育 - -

Q 卫生和社会工作 201,173,212,056 13.31

R 文化、体育和娱乐业 76,562,031,72 3.60

S 综合 - -

5.5 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

A 农、林、牧、渔业 - -

B 制造业 - -

C 交通运输、仓储和邮政业 909,649,454,323 32.97

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 - -

E 建筑业 - -

F 制造和修理业 - -

G 交通运输、仓储和邮政业 - -

H 银行业 884,728,180,214 30.39

I J 金融业 134,343,000 0.01

K 研究、技术服务和地质勘查业 70,998,202,622 3.24

L 租赁和商务服务业 - -

M 科学、研究和技术服务业 90,775,414,40 4.14

N 水利、环境和公共设施管理业 - -

O 制造服务、修理和其他服务业 - -

P 教育 - -

Q 卫生和社会工作 201,173,212,056 13.31

R 文化、体育和娱乐业 76,562,031,72 3.60

S 综合 - -

5.5 报告期末按行业分类的其他证券投资组合

5.2 报告期末按行业分类的其他证券投资组合

序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

A 农、林、牧、渔业 - -

B 制造业 - -

C 交通运输、仓储和邮政业 909,649,454,323 32.97

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 - -

E 建筑业 - -

F 制造和修理业 - -

G 交通运输、仓储和邮政业 - -

H 银行业 884,728,180,214 30.39

I J 金融业 134,343,000 0.01

K 研究、技术服务和地质勘查业 70,998,202,622 3.24

L 租赁和商务服务业 - -

M 科学、研究和技术服务业 90,775,414,40 4.14

N 水利、环境和公共设施管理业 - -

O 制造服务、修理和其他服务业 - -

P 教育 - -

Q 卫生和社会工作 201,173,212,056 13.31

R 文化、体育和娱乐业 76,562,031,72 3.60

S 综合 - -

5.5 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

A 农、林、牧、渔业 - -