

交银施罗德阿尔法核心混合型证券投资基金

2019年第二季度报告

市场中不同行业或标的的市场关注度及市场情绪发生了较大分化,对于宏观经济基本预期、短期数据表现不错,但考虑到中国经济的隐忧已经完全解除,后续几个季度还需要继续跟踪。预计在整体指数相对平稳的状态下,持续成长型公司可能继续涌现,或许是挑战选股难度的阶段,可以多地去寻找变化、寻找能展新的积极前景的公司,我们希望通过深入研究,找到需求可持续增长的行业,竞争力持续扩大的公司,享受公允价值的可持续成长,并希望以此能够持续为持有人获得超额收益。

4.5报告期内基金的业绩表现
本基金(各券)份额净值及业绩表现现况“3.1 主要财务指标”及“3.2.1 本报告期末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 报告期末基金资产组合情况
金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	3,650,626.02	60.80
2	固定收益投资	5,929,629.52	97.76
3	贵金属投资	79,485,453.24	1,294.24
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	145,353,216.23	2,385.67
7	其他资产	1,879,263.24	3.08
8	合计	159,898,188.01	2,641.95

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
金额单位:人民币元

代码	行业名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	医药、生物、医药	451,689.28	0.74
B	电子	691,312.26	1.13
C	综合	765,304,227.22	12.56
D	轻工、纺织、化工、有色金属和国防军工	1,424,000.00	2.35
E	食品饮料	20,369,816.00	33.61
F	交通运输	153,341,246.24	25.05
G	农林牧渔、国防军工	79,349,616.00	13.03
H	公用事业	1,746,366,624.00	28.69
I	金融、地产	1,597,922.83	0.26
J	其他	140,273,178.24	2.29
K	股票投资合计	3,650,626.02	60.80
L	报告期末按行业分类的股票投资组合	—	—
M	报告期末按行业分类的股票投资组合	—	—
N	报告期末按行业分类的股票投资组合	—	—
O	报告期末按行业分类的股票投资组合	—	—
P	报告期末按行业分类的股票投资组合	—	—
Q	报告期末按行业分类的股票投资组合	—	—
R	报告期末按行业分类的股票投资组合	—	—
S	合计	3,650,626.02	60.80

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	占基金资产净值比例(%)
1	600569	金力永磁	16,944,327.00	762.82	1.25
2	600036	招商银行	1,644,633,327.42	95.26	1.56
3	600024	山东鲁泰	—	—	—
4	600000	浦发银行	—	—	—
5	600015	民生银行	—	—	—
6	600031	三一重工	—	—	—
7	600012	宝钢股份	—	—	—
8	600041	华仪股份	—	—	—
9	600018	华能国际	—	—	—
10	600011	华丰集团	—	—	—

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 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	190013	19国债01	862,976,243.24	14.05
2	190014	19国债02	862,976,243.24	14.05
3	190015	19国债03	862,976,243.24	14.05
4	190016	19国债04	862,976,243.24	14.05
5	190017	19国债05	862,976,243.24	14.05
6	190018	19国债06	862,976,243.24	14.05
7	190019	19国债07	862,976,243.24	14.05
8	190020	19国债08	862,976,243.24	14.05
9	190021	19国债09	862,976,243.24	14.05
10	190022	19国债10	862,976,243.24	14.05

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

序号	名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	平安银行	—	—
2	招商银行	—	—
3	浦发银行	—	—
4	民生银行	—	—
5	交通银行	—	—
6	中信银行	—	—
7	华夏银行	—	—
8	兴业银行	—	—
9	光大银行	—	—
10	工商银行	—	—

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明细

序号	名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	黄金	79,485,453.24	1.29
2	白银	—	—
3	铂金	—	—
4	钌	—	—
5	铑	—	—

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细

序号	名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	中国平安	—	—
2	招商银行	—	—
3	浦发银行	—	—
4	民生银行	—	—
5	交通银行	—	—

5.9 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股指期货投资明细

序号	名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	沪深300	—	—
2	中证500	—	—
3	中证800	—	—
4	中证1000	—	—
5	中证2000	—	—

5.10 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国债期货投资明细

序号	名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国债期货	—	—
2	股指期货	—	—
3	商品期货	—	—
4	期权	—	—
5	其他	—	—

5.11 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细

序号	名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	中国平安	—	—
2	招商银行	—	—
3	浦发银行	—	—
4	民生银行	—	—
5	交通银行	—	—

5.12 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资产支持证券投资明细

序号	名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	平安银行	—	—
2	招商银行	—	—
3	浦发银行	—	—
4	民生银行	—	—
5	交通银行	—	—

5.13 其他资产构成

序号	名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	银行存款	145,353,216.23	2,385.67
2	结算备付金	—	—
3	应收利息	—	—
4	应收股利	—	—
5	其他	—	—

5.14 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。

5.15 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。

5.16 投资组合报告附注
5.1.1 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责和处罚。

5.1.2 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。

5.1.3 其他资产构成

序号	名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	银行存款	145,353,216.23	2,385.67
2	结算备付金	—	—
3	应收利息	—	—
4	应收股利	—	—
5	其他	—	—

5.17 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权证投资明细

序号	名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	中国平安	—	—
2	招商银行	—	—
3	浦发银行	—	—
4	民生银行	—	—
5	交通银行	—	—

5.18 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国债期货投资明细

序号	名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国债期货	—	—
2	股指期货	—	—
3	商品期货	—	—
4	期权	—	—
5	其他	—	—

5.19 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细

序号	名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	中国平安	—	—
2	招商银行	—	—
3	浦发银行	—	—
4	民生银行	—	—
5	交通银行	—	—

5.20 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资产支持证券投资明细

序号	名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	平安银行	—	—
2	招商银行	—	—
3	浦发银行	—	—
4	民生银行	—	—
5	交通银行	—	—

基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年七月十七日

5.1 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月16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应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期自2019年4月1日起至6月30日止。

5.2 基金产品概况

基金名称	交银施罗德阿尔法核心混合型证券投资基金
基金代码	501072
基金简称	交银阿尔法核心
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	2015年7月13日
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

3.1 主要财务指标
单位:人民币元

主要财务指标	本报告期末	本报告期末比上年末增减
1.基金份额净值	1.0000	0.0000
2.基金份额持有人数量	1,000,000	0.00%
3.基金资产净值	1,000,000,000	0.00%
4.基金总资产	1,000,000,000	0.00%
5.基金净资产	1,000,000,000	0.00%

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,计入费用后的实际收益率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值变动收益。

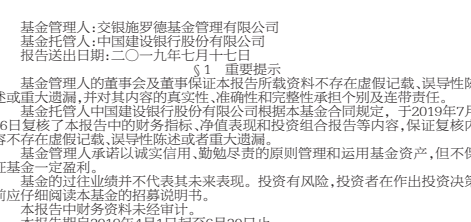
3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

期间	净值增长率	业绩比较基准	净值增长率与业绩比较基准收益率的差额
过去一个月	-0.05%	1.00%	-0.05%
过去三个月	-0.15%	3.00%	-0.15%
过去六个月	-0.35%	6.00%	-0.35%
过去一年	-0.55%	9.00%	-0.55%
过去两年	-0.75%	12.00%	-0.75%

注: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%×中债综合全价指数收益率”变更为“75%×沪深300指数收益率+25%×中证综合债券指数收益率”,3.2.2附注。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绩比较基准变更并修改基金合同相关内容的公告》。

3.2.2 基金净值表现以本基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

交银施罗德阿尔法核心混合型证券投资基金历史走势图对比图
(2015年8月3日至2019年6月30日)



基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年七月十七日

5.1 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月16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应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期自2019年4月1日起至6月30日止。

5.2 基金产品概况

基金名称	交银施罗德消费新驱动股票型证券投资基金
基金代码	501074
基金简称	交银消费新驱动
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	2015年7月13日
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

3.1 主要财务指标
单位:人民币元

主要财务指标	本报告期末	本报告期末比上年末增减
1.基金份额净值	0.9812	-0.0188
2.基金份额持有人数量	312,204,248	0.00%
3.基金资产净值	312,204,248	0.00%
4.基金总资产	312,204,248	0.00%
5.基金净资产	312,204,248	0.00%

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,计入费用后的实际收益率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值变动收益。

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

期间	净值增长率	业绩比较基准	净值增长率与业绩比较基准收益率的差额
过去一个月	-0.15%	0.00%	-0.15%
过去三个月	-0.35%	0.00%	-0.35%
过去六个月	-0.55%	0.00%	-0.55%
过去一年	-0.75%	0.00%	-0.75%
过去两年	-0.95%	0.00%	-0.95%

注:本基金由交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金转型而来,基金原名为2015年7月1日。本基金的业绩比较基准为交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金业绩比较基准(即2015年7月1日)起的一个月,截至投资报告期结束,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规定。

4.1