

# 交银施罗德持续成长主题混合型证券投资基金

# 2019年半年度报告摘要

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:2019年八月二十九日

## 1.1 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,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年8月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

本报告期末财务资料未经审计。  
本报告期自2019年1月1日起至6月30日止。

## 2.1 基金基本情况

基金名称	交银施罗德持续成长主题混合
基金代码	050001
交易代码	050001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年11月12日
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金合同终止日	不定期

## 2.2 基金产品说明

本基金是有效规避组合风险并持有良好流动性资产的前提下,把握市场波动趋势,通过专业化研究分析,重点投资具备充分成长空间和拥有持续成长性上市公司,力争实现基金资产的长期稳定增值。

本基金通过定量与定性相结合的方法,评估其行业持续增长、成长性、通过对财务报表变化分析、产业结构、技术创新和商业模式演化等因素的深入分析研究,得出行业投资价值与商业模式。

本基金的过往业绩并不代表其未来表现,投资者有风险,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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细信息,应阅读半年度报告正文。

## 2.3 基金管理人及基金托管人

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	中国工商银行股份有限公司
姓名	陈军	张珊珊
联系电话	(021)61055680	010-66108799
电子邮箱	zhangshans@icbc.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务热线	400-700-5000,021-60555000	95588
网址	(021)61055654	010-66108798

## 2.4 信息披露方式

信息披露半年度报告正文的置阅人查阅网址	www.fund001.com
基金半年度报告摘要置阅	基金管理人官方网站

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

项目	本期	上年同期	单位:人民币元
1.1 期间损益和指标	报告期(2019年1月1日至2019年6月30日)	上年同期	
本期已实现收益	213,293,374.94	-	
本期利润	382,575,837.20	-	
加权平均基金份额本期利润	0.2284	-	
本期基金份额净值增长率	26.30%	-	
1.2 期末指标和指标	报告期末(2019年6月30日)	上年末	
期末可供分配基金份额利润	0.1548	-	
期末基金份额净值	1.789,153,445.54	1.789,153,445.54	
期末基金份额持有人数	1,219,967	1,219,967	

注:1、本基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用导致收益指标降低以下列数据。

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 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	基金份额净值增长率①	业绩比较基准收益率②	①-②	③-④
过去一个月	6.99%	1.38%	4.88%	2.72%
过去三个月	-4.36%	1.59%	-6.41%	-3.69%
过去六个月	26.30%	1.95%	20.61%	5.69%
过去一年	11.69%	1.53%	8.88%	1.40%
自基金合同生效至今	21.89%	1.49%	-3.90%	25.79%

注:本基金的业绩比较基准为75%×沪深300指数收益率+25%×中证综合债券指数收益率,每日进行再平衡过程。

3.2.2 自基金合同生效以来基金净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

交银施罗德持续成长主题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(2018年1月12日至2019年6月30日)



注:本基金合同生效日为2018年11月12日,截至报告期末,本基金已完成建仓但报告期末建仓结束未逾一年,本基金建仓日为自基金合同生效日起的96个月,截至建仓结束,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。

## 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理的经验

交银施罗德基金管理有限公司是经中国证监会证监基金字[2005]128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,注册资本金为2亿元人民币。其中,交通银行股份有限公司持有65%的股份,施罗德投资管理有限公司持有30%的股份,中国国际海运集装箱(集团)股份有限公司持有5%的股份。公司并下设交银施罗德资产管理(香港)有限公司和交银施罗德资产管理(英国)有限公司。

截至报告期末,公司管理了包括货币型、债券型、普通混合型和股票型在内的80只基金,其中股票型基金涵盖普通指数型、交易型开放式(ETF)、ODI等不同类型基金。

### 4.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

姓名	职务	任职日期	基金经理年限	证券从业年限	说明
何剑	交银施罗德基金组合、交银阿尔法核心	2018-01-12	9年	9年	何剑先生,上海财经大学硕士,曾任国投证券资产管理公司研究员,2012年加入交银施罗德基金管理有限公司,历任组合基金经理。

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(如适用)之日为准。

2、本表所列基金经理(助理)从业年限中的“证券从业年限”的含义遵从中国证券业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、基金经理(或基金经理小组)期间变动(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投资运作合规情况的说明

在报告期内,本基金管理人严格遵守了《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,并本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,基金整体运作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控制制度来保证旗下基金运作的公平,旗下所管理的所有资产组合,包括证券投资基金和特定资产管理专户均严格遵循制度进行公平交易。

公司建立资源共享的投资研究信息平台,确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有平等的机会。公司在交易执行环节实行集中交易制度,建立公平的交易分配制度,对于交易所公开竞价交易,遵循“时间优先、价格优先、比例分配”的原则,全部通过交易系统统一执行,对于非集中竞价交易,以公司名义进行的市场外交易,遵循“价格优先、比例分配”的原则事前独立确定的投资方案对交易结果进行评价。

公司中央交易室和风险管理部进行日常投资交易行为监控,风险管理部负责对各账户公平交易进行事后分析,于每季度和每半年度分别对不同的投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口向交易的价差进行分析,通过公平分析和信息披露来加强对公平交易制度的执行和监督。

报告期内本公司严格执行公平交易制度,公平对待旗下各投资组合,未发现任何不公平交易和利益输送行为。

4.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内未发生异常交易行为。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超过该证券当日总成交量5%的情况有1次,是投资组合因投资策略调整而发生同日反向交易,未发现不公平交易和利益输送的情况。本基金与本公司管理的其他投资组合不存在不同时间窗(如日内、3日内、5日内)同向交易的交易均未发现异常。

4.4 管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019年上半年A股市场经历了明显的波动,年初上证指数最高时上涨32%,随后由于外围不稳定因素担忧,又在一个月之内下跌了15%,整体而言,上半年以食品饮料为代表的“核心资产”上涨明显,而“成长类”个股依然低迷。

本基金截至上半年结束资产配置较为平衡,虽然持仓结构基本为“成长类”,但医药服务和部分消费行业个股表现优异。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金(各类)份额净值及业绩表现详见“3.1主要会计数据和财务指标”及“3.2.1基金净值表现”及其与同期业绩比较基准收益率的比较”部分披露。

4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

站在目前的时点上,标榜的年初以来市场较大幅度的上涨及二季度的回落,市场不同行业或者标的的行业关注度及涨幅回报率存在了较

大分化。对于宏观经济基本面预期,短期数据表现不错,但后续几个季度还需继续观察。预计在整体指数相对平稳的状态下,持续成长型基金可能持续走强,特别是进入下半年后,一些公司随着业绩的不断上行,其性价比也会上升。我们希望通过深入研究,找到需求可持续增长的行业,竞争力可持续提升的公司,享受公司价值的可持续发展,并希望通过此能够长期持有,获得超额收益。

4.6 管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序,经公司管理层批准并执行,并成立了估值委员会,估值委员会成员由研究员部、基金运营部、风险管理部等人员和固定收益人员及相关估值组成。

公司严格按照新会计准则、证监会相关规则和基金合同关于估值的约定进行估值,保证基金估值的公平、合理,保持估值政策和程序的一贯性。估值委员会的研究部负责投资品种的公允价值,同时参考市场普遍认同的做法,建议合理的估值模型,进行测算和认定,认可后交各估值委员会成员从基金会计、风险、合规等方面审批,一致同意后,报公司投资总监、总经理审批。

估值委员会会定期讨论估值政策和程序进行评价,在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后,及时召开临时会议进行研究,及时修订估值方法,以保证其持续适用。估值委员会成员均具备相应的专业资格及工作经验。基金经理作为估值委员会负责人,对本基金持仓证券的交易情况,信息披露情况保持持续的职业道德,向估值委员会提供估值参考信息,参与估值政策讨论。本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突,截止报告期末未有与任何外部估值定价服务机构将合约。

4.7 管理人对于报告期内基金投资情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对于基金持有人人数或基金份额净值预警情况的说明

本基金本报告期内无预警说明。

5 托管人报告

5.1 报告期内,本基金托管人遵守法律法规

本报告期内,本基金托管人在对交银施罗德持续成长主题混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,交银施罗德持续成长主题混合型证券投资基金的基金管理人和交银施罗德基金管理有限公司在交银施罗德持续成长主题混合型证券投资基金的投资运作、基金净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等方面,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的约定进行。本报告期内,交银施罗德持续成长主题混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对交银施罗德基金管理有限公司编制的交银施罗德持续成长主题混合型证券投资基金2019年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

## 6.1 资产负债表

会计主体:交银施罗德持续成长主题混合型证券投资基金  
报告截止日:2019年6月30日

资产	附注	本期	上期	单位:人民币元
流动资产:				
货币资金	6.4.7.1	297,596,744.74	132,151,166.65	
结算备付金		1,976,646.06	2,820,617.28	
存出保证金		739,284.70	656,526.50	
应收利息	6.4.7.2	1,467,489,628.64	1,446,341,999.46	
其中:应收债券利息		1,437,622,628.64	1,346,941,999.46	
其他流动资产		29,847,000.00	99,400,000.00	
资产支持证券投资		-	-	
可供出售金融资产	6.4.7.3	-	150,000,465.00	
买入返售金融资产		-	-	
应收股利	6.4.7.5	10,596,748.77	8,033,058.00	
应收利息		173,310.61	409,417.67	
应收申购款		52,863,014.00	887,470.22	
理财产品投资		-	-	
其他资产	6.4.7.6	1,779,973,226.56	1,741,208,206.86	
资产和所有者权益总计		2,019,967,312.61	2,019,967,312.61	
负债:				
交易性金融负债		-	-	
应付短期融资款	6.4.7.3	-	-	
应付债券		-	-	
应付赎回款		11,667,614.77	18,350,313.69	
应付基金赎回款		3,782,241.20	3,582,285.15	
应付管理人报酬		2,080,239.47	2,235,320.00	
应付托管费		346,706.56	375,561.61	
应付销售服务费		-	-	
应付交易费用	6.4.7.7	1,920,278.80	2,195,688.16	
应付利息		-	3,269.59	
应付利润		-	-	
递延所得税负债		-	-	
其他负债	6.4.7.8	124,600.22	412,724.44	
负债合计		19,921,780.22	24,875,184.44	
所有者权益:				
实收基金	6.4.7.9	1,443,281,161.81	1,778,527,133.81	
未分配利润	6.4.7.10	315,872,283.73	-62,099,031.41	
所有者权益合计		1,799,153,445.54	1,741,208,206.82	
负债和所有者权益总计		1,799,973,226.56	1,741,208,206.86	

注:1、报告截止日2019年6月30日,基金份额净值1.2199元,基金份额总额1,443,281,161.81份。

2、本摘要中资产负债表和利润表所列附注内容为半年度报告正文中对应的附注,投资者欲了解相应附注内容,应阅读载于基金管理人网站的本年度报告正文。

## 6.2 利润表

会计主体:交银施罗德持续成长主题混合型证券投资基金  
本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

项目	附注	本期	上年同期	单位:人民币元
一、营业收入		405,454,168.95	67,601.00	
1.利息收入		1,570,656.63	13,014,110.02	
其中:存款利息收入	6.4.7.11	747,134.92	7,994,048.08	
债券利息收入		805,431.19	-	
资产支持证券投资		-	-	
买入返售金融资产收入		17,486.52	5,000,069.94	
其他利息收入		-	-	
2.投资收益(损失以“-”号填列)		229,620,728.00	91,510,230.52	
其中:股权投资收益	6.4.7.12	255,546,790.11	82,721,162.43	
公允价值变动收益		-	-	
3.其他业务收入		-	-	
4.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		-	-	
5.其他业务收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.18	1,910,918.96	4,284,164.82	
二、营业支出		22,476,258.75	21,773,888.12	
1.管理费		13,620,560.08	12,683,127.79	
2.托管费		2,271,760.08	2,115,521.23	
3.销售服务费		-	-	
4.交易费用	6.4.7.19	6,847,996.48	6,705,956.86	
5.利息支出		-	-	
其中:卖出回购金融资产支出		-	-	
6.税金及附加		59.18	13,599.98	
7.其他费用	6.4.7.20	128,042.33	195,628.26	
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		382,575,837.20	176,253,912.22	
减:所得税费用		-	-	
净利润(净亏损以“-”号填列)		382,575,837.20	176,253,912.22	
归属于基金持有人的净利润		382,575,837.20	176,253,912.22	
归属于基金管理人的净利润		-	-	
归属于基金持有人的净利润(净收益以“-”号填列)		382,575,837.20	176,253,912.22	
归属于基金管理人的净利润(净损失以“-”号填列)		-	-	
四、期末所有者权益(基金净值)		1,443,281,161.81	1,741,208,206.82	

注:1、本报告期利润总额和净利润的金额与资产负债表中的期末所有者权益合计(基金净值)的金额相等。

2、本报告期利润总额和净利润的金额与利润表中的利润总额和净利润的金额相等。

3、本报告期利润总额和净利润的金额与利润表中的利润总额和净利润的金额相等。

4、本报告期利润总额和净利润的金额与利润表中的利润总额和净利润的金额相等。

5、本报告期利润总额和净利润的金额与利润表中的利润总额和净利润的金额相等。

6、本报告期利润总额和净利润的金额与利润表中的利润总额和净利润的金额相等。

7、本报告期利润总额和净利润的金额与利润表中的利润总额和净利润的金额相等。

8、本报告期利润总额和净利润的金额与利润表中的利润总额和净利润的金额相等。

9、本报告期利润总额和净利润的金额与利润表中的利润总额和净利润的金额相等。

10、本报告期利润总额和净利润的金额与利润表中的利润总额和净利润的金额相等。

11、本报告期利润总额和净利润的金额与利润表中的利润总额和净利润的金额相等。

12、本报告期利润总额和净利润的金额与利润表中的利润总额和净利润的金额相等。

13、本报告期利润总额和净利润的金额与利润表中的利润总额和净利润的金额相等。

14、本报告期利润总额和净利润的金额与利润表中的利润总额和净利润的金额相等。

15、本报告期利润总额和净利润的金额与利润表中的利润总额和净利润的金额相等。

16、本报告期利润总额和净利润的金额与利润表中的利润总额和净利润的金额相等。

17、本报告期利润总额和净利润的金额与利润表中的利润总额和净利润的金额相等。

18、本报告期利润总额和净利润的金额与利润表中的利润总额和净利润的金额相等。

19、本报告期利润总额和净利润的金额与利润表中的利润总额和净利润的金额相等。

20、本报告期利润总额和净利润的金额与利润表中的利润总额和净利润的金额相等。

21、本报告期利润总额和净利润的金额与利润表中的利润总额和净利润的金额相等。

22、本报告期利润总额和净利润的金额与利润表中的利润总额和净利润的金额相等。

23、本报告期利润总额和净利润的金额与利润表中的利润总额和净利润的金额相等。

24、本报告期利润总额和净利润的金额与利润表中的利润总额和净利润的金额相等。

25、本报告期利润总额和净利润的金额与利润表中的利润总额和净利润的金额相等。