

## 交银施罗德阿尔法核心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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一九年八月二十九日

## 1 重要提示

基金管理人的董事、监事和高级管理人员在所载文件不存在虚假记载、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署同意，并将董事长签章。

基金管理人经中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年8月26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，对虚假记载、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。

基金经理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，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告全文。

本报告由基金管理人财务部门复核。

本报告期自2019年1月1日起至6月30日止。

## 2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

|           |                       |
|-----------|-----------------------|
| 基金简称      | 交银施罗德阿尔法核心            |
| 基金主代码     | 519712                |
| 交易代码      | 519712(前端) 519713(后端) |
| 基金运作方式    | 契约型开放式                |
| 基金合同生效日   | 2012年3月1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          |
| 基金份额总额    | 1,782,107,607.33份     |
| 基金合同的终止情形 | 不定期                   |

## 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 本基金通过积极发掘选股优势，结合基本面多因子指标等综合管理手段选取具有显著阿尔法收益特征，自下而上择股并保持股票组合与基准指数的偏离度在合理范围内。 |
| 投资策略   | 本基金充分发掘基金经理的专业能力，以数量化方法辅助基本面分析，通过深入研究识别选股机会，结合基本面多因子指标自上而下精选个股，以求实现超额收益。   |
| 业绩比较基准 | 75%×沪深300指数收益率+25%×中证综合债指数收益率  |
| 风险收益特征 | 本基金是一只偏股型基金，其风险和预期收益水平高于货币市场基金，低于股票型基金，属于中高风险、中高收益的基金品种。                   |

## 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              | 中国建设银行股份有限公司                         |
| 住所     | 上海市浦东新区银城中路16号             | 北京市西城区金融大街25号                        |
| 法定代表人  | 王耽邦                        | 周青                                   |
| 信息披露负责 | 021-61050500               | 010-67595096                         |
| 联系人    | 电子邮箱                       | sepi@jysl.fund, dachengkeji@jysl.com |
| 客户服务电话 | 400-700-5000, 021-61050000 | 010-67595096                         |
| 传真     | 021-61050504               | 010-66275853                         |

## 2.4 信息披露方式

|                   |                 |
|-------------------|-----------------|
| 披露基金净值信息的管理人互联网网址 | www.fund101.com |
| 基金管理人公告发布点        | 基金管理人的公告场所      |

## 3 主要财务指标和财务指标

## 3.1 主要会计数据和财务指标

## 3.1.1 期间数据和指标

## 3.1.2 本期已实现收益

## 3.1.3 本期利润

## 3.1.4 平均基金份额本期利润

## 3.1.5 期末基金份额增长

## 3.1.6 期末可供分配基金份额利润

## 3.1.7 期末基金资产净值

## 3.1.8 期末基金资产份额

## 3.1.9 期末基金资产净值

## 3.1.10 期末基金份额净值

## 3.1.11 期末基金份额总额

## 3.1.12 本期末资产配置比例

## 3.1.13 本期末负债情况

## 3.1.14 本期末资产情况

## 3.1.15 本期末负债情况

## 3.1.16 本期末资产情况

## 3.1.17 本期末负债情况

## 3.1.18 本期末资产情况

## 3.1.19 本期末负债情况

## 3.1.20 本期末资产情况

## 3.1.21 本期末负债情况

## 3.1.22 本期末资产情况

## 3.1.23 本期末负债情况

## 3.1.24 本期末资产情况

## 3.1.25 本期末负债情况

## 3.1.26 本期末资产情况

## 3.1.27 本期末负债情况

## 3.1.28 本期末资产情况

## 3.1.29 本期末负债情况

## 3.1.30 本期末资产情况

## 3.1.31 本期末负债情况

## 3.1.32 本期末资产情况

## 3.1.33 本期末负债情况

## 3.1.34 本期末资产情况

## 3.1.35 本期末负债情况

## 3.1.36 本期末资产情况

## 3.1.37 本期末负债情况

## 3.1.38 本期末资产情况

## 3.1.39 本期末负债情况

## 3.1.40 本期末资产情况

## 3.1.41 本期末负债情况

## 3.1.42 本期末资产情况

## 3.1.43 本期末负债情况

## 3.1.44 本期末资产情况

## 3.1.45 本期末负债情况

## 3.1.46 本期末资产情况

## 3.1.47 本期末负债情况

## 3.1.48 本期末资产情况

## 3.1.49 本期末负债情况

## 3.1.50 本期末资产情况

## 3.1.51 本期末负债情况

## 3.1.52 本期末资产情况

## 3.1.53 本期末负债情况

## 3.1.54 本期末资产情况

## 3.1.55 本期末负债情况

## 3.1.56 本期末资产情况

## 3.1.57 本期末负债情况

## 3.1.58 本期末资产情况

## 3.1.59 本期末负债情况

## 3.1.60 本期末资产情况

## 3.1.61 本期末负债情况

## 3.1.62 本期末资产情况

## 3.1.63 本期末负债情况

## 3.1.64 本期末资产情况

## 3.1.65 本期末负债情况

## 3.1.66 本期末资产情况

## 3.1.67 本期末负债情况

## 3.1.68 本期末资产情况

## 3.1.69 本期末负债情况

## 3.1.70 本期末资产情况

## 3.1.71 本期末负债情况

## 3.1.72 本期末资产情况

## 3.1.73 本期末负债情况

## 3.1.74 本期末资产情况

## 3.1.75 本期末负债情况

## 3.1.76 本期末资产情况

## 3.1.77 本期末负债情况

## 3.1.78 本期末资产情况

## 3.1.79 本期末负债情况

## 3.1.80 本期末资产情况

## 3.1.81 本期末负债情况

## 3.1.82 本期末资产情况

## 3.1.83 本期末负债情况

## 3.1.84 本期末资产情况

## 3.1.85 本期末负债情况

## 3.1.86 本期末资产情况

## 3.1.87 本期末负债情况

## 3.1.88 本期末资产情况

## 3.1.89 本期末负债情况

## 3.1.90 本期末资产情况

## 3.1.91 本期末负债情况

## 3.1.92 本期末资产情况

## 3.1.93 本期末负债情况

## 3.1.94 本期末资产情况

## 3.1.95 本期末负债情况

## 3.1.96 本期末资产情况

## 3.1.97 本期末负债情况

## 3.1.98 本期末资产情况

## 3.1.99 本期末负债情况

## 3.1.100 本期末资产情况

## 3.1.101 本期末负债情况

## 3.1.102 本期末资产情况

## 3.1.103 本期末负债情况

## 3.1.104 本期末资产情况

## 3.1.105 本期末负债情况

## 3.1.106 本期末资产情况

## 3.1.107 本期末负债情况

## 3.1.108 本期末资产情况

## 3.1.109 本期末负债情况

## 3.1.110 本期末资产情况

## 3.1.111 本期末负债情况

## 3.1.112 本期末资产情况

## 3.1.113 本期末负债情况

## 3.1.114 本期末资产情况

## 3.1.115 本期末负债情况

## 3.1.116 本期末资产情况

## 3.1.117 本期末负债情况

## 3.1.118 本期末资产情况

## 3.1.119 本期末负债情况

## 3.1.120 本期末资产情况

## 3.1.121