

交银施罗德优择回报灵活配置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:中信银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年八月二十九日

1 重要提示

基金管理人的董事会、监事会对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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据基金合同的规定,在2019年8月20日复核了本报告,报告内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人承诺以真实信用、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。

基金管理人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。

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

本报告的财务资料未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至6月30日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称:交银施罗德优择回报灵活配置混合型证券投资基金

基金代码:649170

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2016年4月22日

基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司

基金托管人:中信银行股份有限公司

报告期末基金资产总额:694,456,438.51份

报告期末基金份额净值:230.56609份

2.2 基金产品简介

投资目标:本基金在控制风险和保持资产流动性的情况下,通过适时的资产配置和积极的择时操作,力争实现基金资产的长期稳定增值。

本基金充分发掘基金管理人的投资优势,在充分分析宏观经济周期和金融市场运行特征的基础上,通过资产配置和积极的择时操作,在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。

投资策略:本基金通过深入研究宏观经济、政策、行业、公司等多方面的因素,结合对证券市场的深入分析,在严格控制风险的前提下,通过资产配置和积极的择时操作,力争实现基金资产的长期稳定增值。

业绩比较基准:本基金业绩比较基准为4.5%×沪深300指数收益率+5.0%×中债综合全价收益率,每日进行再平衡。

风险收益特征:本基金是一只中高风险、中高收益的混合型证券投资基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司

基金托管人:中信银行股份有限公司

3 主要数据和财务指标

金单位:人民币元

3.1 本期财务报告指标

报告期(2019年1月1日至2019年6月30日)

交银施罗德优择回报灵活配置混合型证券投资基金

本期末

资产总额:262,369.43

负债总额:76,215,681.69

所有者权益(基金净值):694,456,438.51

报告期末基金份额净值:230.56609份

3.2 主要会计数据和财务指标

报告期(2019年1月1日至2019年6月30日)

交银施罗德优择回报灵活配置混合型证券投资基金

本期

营业收入:26,891,896.95

本期利润:10,524,106.03

加权平均基金份额本期利润:0.0281

本期基金份额净值增长率:2.6%

本期基金份额净值增长率标准差:25.0%

3.3 本期末基金资产净值

报告期(2019年1月1日至2019年6月30日)

交银施罗德优择回报灵活配置混合型证券投资基金

本期末

资产总额:262,369.43

负债总额:76,215,681.69

所有者权益(基金净值):694,456,438.51

报告期末基金份额净值:230.56609份

3.4 主要会计数据和财务指标

报告期(2019年1月1日至2019年6月30日)

交银施罗德优择回报灵活配置混合型证券投资基金

本期

营业收入:26,891,896.95

本期利润:10,524,106.03

加权平均基金份额本期利润:0.0281

本期基金份额净值增长率:2.6%

本期基金份额净值增长率标准差:25.0%

3.5 本期末基金资产净值

报告期(2019年1月1日至2019年6月30日)

交银施罗德优择回报灵活配置混合型证券投资基金

本期末

资产总额:262,369.43

负债总额:76,215,681.69

所有者权益(基金净值):694,456,438.51

报告期末基金份额净值:230.56609份

3.6 本期末基金资产净值

报告期(2019年1月1日至2019年6月30日)

交银施罗德优择回报灵活配置混合型证券投资基金

本期末

资产总额:262,369.43

负债总额:76,215,681.69

所有者权益(基金净值):694,456,438.51

报告期末基金份额净值:230.56609份

3.7 本期末基金资产净值

报告期(2019年1月1日至2019年6月30日)

交银施罗德优择回报灵活配置混合型证券投资基金

本期末

资产总额:262,369.43

负债总额:76,215,681.69

所有者权益(基金净值):694,456,438.51

报告期末基金份额净值:230.56609份

3.8 本期末基金资产净值

报告期(2019年1月1日至2019年6月30日)

交银施罗德优择回报灵活配置混合型证券投资基金

本期末

资产总额:262,369.43

负债总额:76,215,681.69

所有者权益(基金净值):694,456,438.51

报告期末基金份额净值:230.56609份

3.9 本期末基金资产净值

报告期(2019年1月1日至2019年6月30日)

交银施罗德优择回报灵活配置混合型证券投资基金

本期末

资产总额:262,369.43

负债总额:76,215,681.69

所有者权益(基金净值):694,456,438.51

报告期末基金份额净值:230.56609份

3.10 本期末基金资产净值

报告期(2019年1月1日至2019年6月30日)

交银施罗德优择回报灵活配置混合型证券投资基金

本期末

资产总额:262,369.43

负债总额:76,215,681.69

所有者权益(基金净值):694,456,438.51

报告期末基金份额净值:230.56609份

3.11 本期末基金资产净值

报告期(2019年1月1日至2019年6月30日)

交银施罗德优择回报灵活配置混合型证券投资基金

本期末

资产总额:262,369.43

负债总额:76,215,681.69

所有者权益(基金净值):694,456,438.51

报告期末基金份额净值:230.56609份

3.12 本期末基金资产净值

报告期(2019年1月1日至2019年6月30日)

交银施罗德优择回报灵活配置混合型证券投资基金

本期末

资产总额:262,369.43

负债总额:76,215,681.69

所有者权益(基金净值):694,456,438.51

报告期末基金份额净值:230.56609份

3.13 本期末基金资产净值

报告期(2019年1月1日至2019年6月30日)

交银施罗德优择回报灵活配置混合型证券投资基金

本期末

资产总额:262,369.43

负债总额:76,215,681.69

所有者权益(基金净值):694,456,438.51

报告期末基金份额净值:230.56609份

3.14 本期末基金资产净值

报告期(2019年1月1日至2019年6月30日)

交银施罗德优择回报灵活配置混合型证券投资基金

本期末

资产总额:262,369.43

负债总额:76,215,681.69

所有者权益(基金净值):694,456,438.51

报告期末基金份额净值:230.56609份

3.15 本期末基金资产净值

报告期(2019年1月1日至2019年6月30日)

交银施罗德优择回报灵活配置混合型证券投资基金

本期末

资产总额:262,369.43

负债总额:76,215,681.69

所有者权益(基金净值):694,456,438.51

报告期末基金份额净值:230.56609份

3.16 本期末基金资产净值

报告期(2019年1月1日至2019年6月30日)

交银施罗德优择回报灵活配置混合型证券投资基金

本期末

资产总额:262,369.43

负债总额:76,215,681.69

所有