

交银施罗德蓝筹混合型基金

2017年第三季度报告



注:本基金建仓期为自基金合同生效日起的96个月。截至建仓期结束,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约定。

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限	说明
陈庆华先生	交银施罗德基金投资理财部总经理	2014-10-22	10年	陈庆华先生,清华大学材料科学与工硕士,2008年加入交银施罗德基金管理有限公司,历任行业分析师,高级研究员。

注:基金经理(或基金经理小组)期满后变动(如有)敬请关注基金管理人发布的相关公告。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
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,基金投资管理符合有关法律法规和基金合同的规定,为基金持有人谋求最大利益。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 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监控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客户资产管理专户均严格执行遵规进行公平交易。

公司建立投资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,全部通过交易系统按比例分配;对于非集中竞价交易,以公司名义进行的场外交易,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分配。

公司中央交易室和风险管理部进行日常交易行为监控,风险管理部负责对各账户公平交易进行事后分析,于每季度和每年度分别对公司管理的不同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内同向交易的交易价差进行分析,通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程合规性的监督。

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,未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明
本基金于本报告期内不存在异常交易行为。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没有超过该证券当日总成交量5%的情形。本基金与本公司管理的其他投资组合不在不同时间窗(如日内、3日内、5日内)同向交易的交易价差未出现异常。

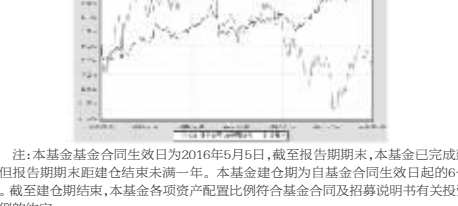
4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析
2017年三季度,整个A股市场呈现震荡格局,七月开始整体波动叠加在政策利好影响下但前期持续的收缩成为反弹主要动力,到八、九月开始整体市场风险偏好大幅提升,半导体、5G各种新兴成长主题反复出现。整个三季度基金取得较好收益,从市场环境上看,临近十九大风险偏好仍有短期提升空间,但经济数据尚难判断,经济回落速度依然好于市场一致预期,部分行业在本报告期内业绩持续性有超预期表现。

交银施罗德蓝筹混合型基金证券投资组合
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



注:本基金基金合同生效以来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

交银施罗德科技新灵活配置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
(2016年5月5日至2017年9月30日)



注:本基金基金合同生效日为2016年5月5日,截至报告期末,本基金已完成建仓但报告期末距建仓结束未满一年。本基金建仓期自基金合同生效日起的96个月。截至建仓期结束,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约定。

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限	说明
魏晨	交银施罗德基金投资理财部副经理	2016-06-06	10年	魏晨先生,内蒙古工业大学工学士,历任招商局资产管理股份有限公司研究员、研究助理,国联安基金管理公司研究员,2016年加入交银施罗德基金管理有限公司,历任行业分析师,交银施罗德基金投资理财部副经理。

注:基金经理(或基金经理小组)期满后变动(如有)敬请关注基金管理人发布的相关公告。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
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,基金投资管理符合有关法律法规和基金合同的规定,为基金持有人谋求最大利益。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 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监控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客户资产管理专户均严格执行遵规进行公平交易。

公司建立投资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,全部通过交易系统按比例分配;对于非集中竞价交易,以公司名义进行的场外交易,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分配。

公司中央交易室和风险管理部进行日常交易行为监控,风险管理部负责对各账户公平交易进行事后分析,于每季度和每年度分别对公司管理的不同投资组合的体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口内同向交易的交易价差进行分析,通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程合规性的监督。

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,未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明
本基金于本报告期内不存在异常交易行为。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没有超过该证券当日总成交量5%的情形。本基金与本公司管理的其他投资组合不在不同时间窗(如日内、3日内、5日内)同向交易的交易价差未出现异常。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析
2017年三季度,宏观经济基本呈二季度趋势的延续,股票市场持续上涨,本符合我们之前的判断,我们仍然坚持在几个大类资产类别中,寻找股票可能具备最具配置价值的判断。在股票市场来看,我们维持现阶段成长股长期具备配置价值的判断。从三季度的表现来看,成长类股票的收益已经基本达到周期及消费类型的股票的低水平。

三季度本基金保持高仓位新兴成长股的配置。
展望四季度,我们认为成长股的配置价值或将进一步显现。本基金四季度仍将坚持成长股配置的方向。

4.5报告期内基金的业绩表现
截至2017年9月30日,本基金份额净值为70.967元,本报告期份额净值增长率为2.00%,业绩比较基准增长率为3.04%。

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预警说明。

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	32,132,089.24	91.76
2	固定收益投资	33,133,089.24	91.76
3	其中:债券	-	-
4	资产支持证券	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
8	银行存款和结算备付金合计	8,301,072.68	8.17
9	其他资产	65,389.59	0.06
10	合计	101,560,042.51	100.00

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

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金总资产的比例(%)
A	农林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	271,602,748.00	10.46
C	制造业	1,230,578,760.40	47.28
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	31,053.44	0.00
E	建筑业	177,464,384.00	6.94
F	批发和零售业	243,363.69	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	26,571.00	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	146,787,469.03	5.65
J	金融业	350,492,227.64	13.49
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	13,117,173.66	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	41,311,070.48	1.69
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社公工作	75,427,289.00	2.90
R	文化、体育和娱乐业	120,130.12	0.00
S	综合	-	-
合计		2,307,703,470.94	88.85

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金总资产的比例(%)
A	农林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	271,602,748.00	10.46
C	制造业	1,230,578,760.40	47.28
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	31,053.44	0.00
E	建筑业	177,464,384.00	6.94
F	批发和零售业	243,363.69	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	26,571.00	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	146,787,469.03	5.65
J	金融业	350,492,227.64	13.49
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	13,117,173.66	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	41,311,070.48	1.69
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社公工作	75,427,289.00	2.90
R	文化、体育和娱乐业	120,130.12	0.00
S	综合	-	-
合计		2,307,703,470.94	88.85

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金总资产的比例(%)
A	农林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	271,602,748.00	10.46
C	制造业	1,230,578,760.40	47.28
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	31,053.44	0.00
E	建筑业	177,464,384.00	6.94
F	批发和零售业	243,363.69	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	26,571.00	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	146,787,469.03	5.65
J	金融业	350,492,227.64	13.49
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	13,117,173.66	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	41,311,070.48	1.69
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社公工作	75,427,289.00	2.90
R	文化、体育和娱乐业	120,130.12	0.00
S	综合	-	-
合计		2,307,703,470.94	88.85

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金总资产的比例(%)
A	农林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	271,602,748.00	10.46
C	制造业	1,230,578,760.40	47.28
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	31,053.44	0.00
E	建筑业	177,464,384.00	6.94
F	批发和零售业	243,363.69	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	26,571.00	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	146,787,469.03	5.65
J	金融业	350,492,227.64	13.49
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	13,117,173.66	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	41,311,070.48	1.69
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社公工作	75,427,289.00	2.90
R	文化、体育和娱乐业	120,130.12	0.00
S	综合	-	-
合计		2,307,703,470.94	88.85

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金总资产的比例(%)
A	农林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	271,602,748.00	10.46
C	制造业	1,230,578,760.40	47.28
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	31,053.44	0.00
E	建筑业	177,464,384.00	6.94
F	批发和零售业	243,363.69	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	26,571.00	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	146,787,469.03	5.65
J	金融业	350,492,227.64	13.49
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	13,117,173.66	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	41,311,070.48	1.69
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社公工作	75,427,289.00	2.90
R	文化、体育和娱乐业	120,130.12	0.00
S	综合	-	-
合计		2,307,703,470.94	88.85

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金总资产的比例(%)
A	农林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	271,602,748.00	10.46
C	制造业	1,230,578,760.40	47.28
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	31,053.44	0.00
E	建筑业	177,464,384.00	6.94
F	批发和零售业	243,363.69	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	26,571.00	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	146,787,469.03	5.65
J	金融业	350,492,227.64	13.49
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	13,117,173.66	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	41,311,070.48	1.69
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社公工作	75,427,289.00	2.90
R	文化、体育和娱乐业	120,130.12	0.00
S	综合	-	-
合计		2,307,703,470.94	88.85

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金总资产的比例(%)
A	农林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	271,602,748.00	10.46
C	制造业	1,230,578,760.40	47.28
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	31,053.44	0.00
E	建筑业	177,464,384.00	6.94
F	批发和零售业	243,363.69	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	26,571.00	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	146,787,469.03	5.65
J	金融业	350,492,227.64	13.49
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	13,117,173.66	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	41,311,070.48	1.69
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社公工作	75,427,289.00	2.90
R	文化、体育和娱乐业	120,130.12	0.00
S	综合	-	-
合计		2,307,703,470.94	88.85

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金总资产的比例(%)
A	农林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	271,602,748.00	10.46
C	制造业	1,230,578,760.40	47.28
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	31,053.44	0.00
E	建筑业	177,464,384.00	6.94
F	批发和零售业	243,363.69	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	26,571.00	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	146,787,469.03	5.65
J	金融业	350,492,227.64	13.49
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	13,117,173.66	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	41,311,070.48	1.69
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社公工作	75,427,289.00	2.90
R	文化、体育和娱乐业	120,130.12	0.00
S	综合	-	-
合计		2,307,703,470.94	88.85

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金总资产的比例(%)
A	农林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	271,602,748.00	10.46
C	制造业	1,230,578,760.40	47.28
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	31,053.44	0.00
E	建筑业	177,464,384.00	6.94
F	批发和零售业	243,363.69	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	26,571.00	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	146,787,469.03	5.65
J	金融业	350,492,227.64	13.49
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	13,117,173.66	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	41,311,070.48	1.69
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P</			