交银施罗德先进制造混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一七年十月二十五日

§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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年10月24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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	交银先进制造混合	
基金主代码	519704	
交易代码	519704(前端)	519706(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011年6月22日	
报告期末基金份额总额	1,317,601,550.99份	
投资目标	本基金通过重点投资于与装备制造相关的优质企业,把握中国产业结构升级的投资机会。在控制风险并保持基金资产良好的流动性的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。	
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势,将严谨、规范化的选股方法与积极主动的投资风格相结合。在控制风险并保持基金资产良好的流动性的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。	
业绩比较基准	75%×申银万国装备制造指数收益率+25%×中证综合债券指数收益率	
风险收益特征	本基金是一只混合型基金,其风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金,低于股票型基金。属于承担较高风险、预期收益较高的证券投资基金品种。	
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2017年7月1日-2017年9月30日)
1.本期已实现收益	210,303,034.97
2.本期利润	367,082,174.90
3.加权平均基金份额本期利润	0.2997
4.期末基金资产净值	3,205,112,483.00
5.期末基金份额净值	2.433

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

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	14.23%	0.91%	4.31%	0.66%	9.92%	0.25%

注:本基金业绩比较基准自2015年10月1日起,由"75%×申银万国装备制造指数收益率+25%×中信标普全债指数收益率"变更为"75%×申银万国装备制造指数收益率+25%×中证综合债券指数收益率",3.2.2同。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自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

交银施罗德先进制造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

(2011年6月22日至2017年9月30日)

注:本基金建仓期为自基金合同生效日起的6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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
任相栋	交银先进制造混合、交银经济新动力混合的基金经理	2015-01-21	-	7年	任相栋先生,上海交通大学金融学硕士。2010年加入交银施罗德基金管理有限公司,历任行业分析师。

注:基金经理(或基金经理小组)期后变动(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循了《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公平的机会。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,全部通过交易系统进行比例分配;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"的原则按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和结果的监督。

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量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在不同时间窗下(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

在金融去杠杆暂告段落、经济复苏带动下,三季度市场涨幅明显,市场的主线是有色、钢铁、采掘等周期性板块和5G、电动汽车等新兴板块。创业板的表现仍落后于上证综指和中小板指数,背后市场的逻辑仍然围绕"估值和业绩"的逻辑,而不是"远期"梦想的逻辑。

本基金三季度跑赢业绩比较基准,主要是把握了市场反弹中相关个股的投资机会。

展望未来,我们认为市场更加注重估值和业绩的主逻辑不会变化,部分高估值且缺乏业绩驱动力的股票虽然有短期反弹的可能,但难有持续性的表现。四季度整体市场的表现较难预测,主要在于经济是否会在四季度有明显的阶段性回落,重大政治社会事件对风险偏好的影响,以及未来的经济金融政策都有较大的不确定性。本基金四季度将维持中性仓位,力求控制好业绩回撤,同时部分回避年初以来涨幅较好的板块和方向以防受到上涨回调的影响,在滞胀板块和个股中寻找投资机会。本基金将继续致力于在控制好风险的情况下,努力为持有人取得稳健回报。

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2.433元,本报告期份额净值增长率为14.23%,同期业绩比较基准增长率4.31%。

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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,626,260,604.99	80.00
	其中:股票	2,626,260,604.99	80.00
2	固定收益投资	142,604,000.00	4.34
	其中:债券	142,604,000.00	4.34
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	284,933,067.40	8.68
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	198,868,668.64	6.06
7	其他资产	30,195,891.68	0.92
8	合计	3,282,862,232.71	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

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	39,793.60	0.00
C	制造业	2,186,116,616.02	68.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,691,309.44	0.49
E	建筑业	26,777,225.00	0.84
F	批发和零售业	26,380.90	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	25,571.91	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	139,104,646.02	4.34
J	金融业	85,639,641.05	2.67
K	房地产业	63,203,202.16	1.97
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	115,299.99	0.00
R	文化、体育和娱乐业	109,520,918.90	3.42
S	综合	-	-
	合计	2,626,260,604.99	81.94

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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300129	泰胜风能	32,105,552	246,570,639.36	7.69
2	600066	宇通客车	7,662,814	188,605,224.40	5.88
3	601766	中国中车	12,932,400	125,832,252.00	3.93
4	600499	科达洁能	9,315,267	107,218,723.17	3.35
5	300308	中际装备	2,118,391	102,932,618.69	3.21
6	002624	完美世界	3,122,509	102,293,394.84	3.19
7	002180	纳思达	3,442,189	97,689,323.82	3.05
8	000725	京东方A	22,002,630	96,811,572.00	3.02
9	600967	内蒙一机	5,886,917	79,591,117.84	2.48
10	002045	国光电器	4,560,331	78,620,106.44	2.45

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	142,604,000.00	4.45
	其中:政策性金融债	142,604,000.00	4.45
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	142,604,000.00	4.45

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五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	170207	17国开07	1,000,000	99,690,000.00	3.11
2	108601	国开1703	430,000	42,914,000.00	1.34

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

5.9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。

5.10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。

5.11投资组合报告附注

5.11.1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。

5.11.2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。

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,108,578.68
2	应收证券清算款	15,381,558.04
3	应收股利	-
4	应收利息	1,667,757.02
5	应收申购款	11,037,867.94
6	其他应收款	130.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	30,195,891.68

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	1,347,549,576.99
本报告期期间基金总申购份额	646,730,333.93
减:本报告期期间基金总赎回份额	676,678,359.93
本报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	1,317,601,550.99

注:1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务,则总申购份额中包含该业务;

2、如果本报告期间发生转换出业务,则总赎回份额中包含该业务。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内未发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.2基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期内未进行本基金的申购、赎回、红利再投等。

§8备查文件目录

8.1备查文件目录

1、中国证监会核准交银施罗德先进制造股票证券投资基金募集的文件;

2、《交银施罗德先进制造混合型证券投资基金基金合同》;

3、《交银施罗德先进制造混合型证券投资基金招募说明书》;

4、《交银施罗德先进制造混合型证券投资基金托管协议》;

5、关于募集交银施罗德先进制造股票证券投资基金之法律意见书;

6、基金管理人业务资格批件、营业执照;

7、基金托管人业务资格批件、营业执照;

8、报告期内交银施罗德先进制造混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

8.2存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

8.3查阅方式

投资者可在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅备查文件,或者登录基金管理人的网站(www.fund001.com,www.bocomschroder.com)查阅。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人交银施罗德基金管理有限公司。本公司客户服务中心电话:400-700-5000(免长途话费),021-61055000,电子邮件:services@jysld.com。

交银施罗德消费新驱动股票型证券投资基金

2017年第三季度报告

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:二〇一七年十月二十五日

§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2017年10月24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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	交银消费新驱动股票	
基金主代码	519714	
交易代码	519714(前端)	519715(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年7月1日	
报告期末基金份额总额	897,443,347.97份	
投资目标	本基金通过重点投资于与消费服务相关的优质企业,把握经济转型背景下中国消费升级趋势的投资机会。在控制风险并保持基金资产良好的流动性的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。	
投资策略	本基金充分发挥基金管理人研究优势,将严谨、规范化的选股方法与积极主动的投资风格相结合。在经济转型大背景下,深入研究消费服务行业的发展趋势,积极挖掘不同子行业和子行业景气度新变化下的个股投资机会,通过团队对个股深入的基本面研究和细致的实地调研,精选个股,以谋求超额收益。	
业绩比较基准	85%×中证内地消费主题指数+15%×中证综合债券指数	
风险收益特征	本基金是一只股票型基金,其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金,属于承担较高预期风险、预期收益较高的证券投资基金品种。	
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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2017年7月1日-2017年9月30日)
1.本期已实现收益	26,298,181.43
2.本期利润	63,318,787.52
3.加权平均基金份额本期利润	0.0651
4.期末基金资产净值	880,450,829.29
5.期末基金份额净值	0.981

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

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	7.45%	0.62%	3.77%	0.68%	3.68%	-0.06%

注:本基金业绩比较基准自2015年10月1日起,由"85%×中证内地消费主题指数+15%×中信标普全债指数"变更为"85%×中证内地消费主题指数+15%×中证综合债券指数",3.2.2同。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自基金转型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

交银施罗德消费新驱动股票型证券投资基金
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
(2015年7月1日至2017年9月30日)

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。基金转型日为2015年7月1日。本基金的投资转型期为交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金转型实施日(即2015年7月1日)起的6个月。截至投资转型期结束,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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
盖婷婷	交银消费新驱动股票、交银医药创新股票、交银恒益灵活配置混合的基金经理	2015-07-01	-	11年	盖婷婷女士,上海交通大学硕士。历任信诚基金管理有限公司分析师、研究总监助理。2011年加入交银施罗德基金管理有限公司,历任行业分析师。

注:基金经理(或基金经理小组)期后变动(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循了《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公平的机会。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,全部通过交易系统进行比例分配;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"的原则按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和结果的监督。

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量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在不同时间窗下(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

三季度市场风险偏好显著上升,钢铁、煤炭、有色等周期股因为二季度业绩超预期表现靓丽,而新能源汽车、5G、苹果产业链等概念板块也因为风险偏好上升而出现了显著的上涨。

本基金三季度仍然延续之前的操作思路:在持有消费白马股的基础上,积极寻找成长股配置,在板块选择上以医药、电子行业为主。

四季度市场有望演绎估值切换行情,成长股经过两年的估值消化预计已经获得安全边际,同时从基本面的角度看,很多细分领域的龙头公司显示出较快的增长潜力。本基金在四季度可能会加快成长股的配置节奏,积极布局四季度以及明年成长股的投资机会。

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0.981元,本报告期份额净值增长率为7.45%,同期业绩比较基准增长率为3.77%。

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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	731,853,438.38	82.07
	其中:股票	731,853,438.38	82.07
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	158,689,630.72	17.79
7	其他资产	1,237,694.13	0.14
8	合计	891,780,763.23	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

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	31,649,852.00	3.59
B	采矿业	-	-
C	制造业	375,017,913.92	42.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,093.44	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	116,309,000.84	13.21
G	交通运输、仓储和邮政业	25,571.91	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,659,556.03	0.98
J	金融业	36,402,647.57	4.13
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	17,452,500.00	1.98
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	38,925,009.50	4.42
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	73,682,152.54	8.37
R	文化、体育和娱乐业	33,698,140.63	3.83
S	综合	-	-
	合计	731,853,438.38	83.12

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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600887	伊利股份	2,766,474	76,078,035.00	8.64
2	300347	泰格医药	2,539,415	73,566,852.55	8.36
3	601607	上海医药	2,203,535	52,311,920.90	5.94
4	600132	重庆啤酒	2,172,941	47,956,807.87	5.45
5	600197	伊力特	1,943,700	44,705,100.00	5.08
6	603986	兆易创新	305,266	39,763,949.16	4.52
7	600054	黄山旅游	2,303,255	38,925,009.50	4.42
8	600486	扬农化工	878,274	34,208,772.30	3.89
9	002343	慈文传媒	870,198	33,685,364.58	3.83
10	000998	隆平高科	1,217,302	31,649,852.00	3.59

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五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

5.9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。

5.10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。

5.11投资组合报告附注

5.11.1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。

5.11.2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。

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	221,224.69
2	应收证券清算款	102,066.16
3	应收股利	-
4	应收利息	32,121.45
5	应收申购款	882,281.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,237,694.13

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	1,063,879,949.55
本报告期期间基金总申购份额	81,407,861.27
减:本报告期期间基金总赎回份额	247,844,462.85
本报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	897,443,347.97

注:1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务,则总申购份额中包含该业务;

2、如果本报告期间发生转换出业务,则总赎回份额中包含该业务。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	14,776,472.35
本报告期买入/申购总份额	-
本报告期卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	14,776,472.35
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	1.65

7.2基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期内未进行本基金的申购、赎回、红利再投等。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017/7/1-2017/9/30	267,378,787.88	-	180,000,000.00	87,378,787.88	9.74%
	2	2017/7/1-2017/9/30	187,163,992.87	-	-	187,163,992.87	20.86%
	3	2017/7/1-2017/9/30	178,093,499.55	-	-	178,093,499.55	19.84%
	4	2017/7/1-2017/9/30	178,252,228.16	-	-	178,252,228.16	19.86%
产品持有风险							
本基金本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例超过基金总份额20%的情况,如该类投资者集中赎回,可能会对本基金带来流动性冲击,从而影响基金的投资运作和收益水平。基金管理人将加强流动性管理,防范相关风险,保护持有人利益。							

§9备查文件目录

9.1备查文件目录

1、中国证监会批准交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金募集的文件;

2、《交银施罗德消费新驱动股票型证券投资基金基金合同》;

3、《交银施罗德消费新驱动股票型证券投资基金招募说明书》;

4、《交银施罗德消费新驱动股票型证券投资基金托管协议》;

5、《交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金基金合同》;

6、《交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金招募说明书》;

7、《交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金托管协议》;

8、基金管理人业务资格批件、营业执照;

9、基金托管人业务资格批件、营业执照;

10、关于申请募集交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金之法律意见书;

11、关于《申请交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金变更注册为交银施罗德消费新驱动股票型证券投资基金》的法律意见;

12、报告期内交银施罗德消费新驱动股票型证券投资基金、交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

9.2存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

9.3查阅方式

投资者可在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅备查文件,或者登录基金管理人的网站(www.fund001.com,www.bocomschroder.com)查阅。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人交银施罗德基金管理有限公司。本公司客户服务中心电话:400-700-5000(免长途话费),021-61055000,电子邮件:services@jysld.com。

交银施罗德现金宝货币市场基金

2017年第三季度报告

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:二〇一七年十月二十五日

§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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年10月24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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	交银现金宝货币	
基金主代码	000710	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014年9月12日	
报告期末基金份额总额	3,727,102,413.22份	
投资目标	在力求本金安全性和资产充分流动性的前提下,追求超过业绩比较基准的投资收益。	
投资策略	本基金在保持组合高度流动性的前提下,结合对国内外宏观经济运行、金融市场运行、资金流动格局、货币市场收益率曲线形态等各方面的分析,合理安排组合期限结构,积极选择投资工具,采取主动性的投资策略和精细化的操作手法。	
业绩比较基准	活期存款利率(税后)	
风险收益特征	本基金属于货币市场基金,是证券投资基金中的低风险品种,长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。	
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	
下属两级基金的基金简称	交银现金宝货币A	交银现金宝货币E
下属两级基金的交易代码	000710	002918
报告期末下属两级基金的份额总额	3,676,581,945.98份	50,520,467.24份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2017年7月1日-2017年9月30日)	
	交银现金宝货币A	交银现金宝货币E
1. 本期已实现收益	36,364,569.48	300,685.51
2. 本期利润	36,364,569.48	300,685.51
3. 期末基金资产净值	3,676,581,945.98	50,520,467.24

注:1、本基金实行销售服务费分类收费方式,分设两类基金份额:A类基金份额和E类基