交银施罗德优势行业灵活配置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:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商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	交银优势行业混合
基金主代码	519697
交易代码	519697
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年1月21日
报告期末基金份额总额	224,643,753.30份
投资目标	根据宏观经济周期和市场环境的变化,自上而下灵活配置资产,积极把握行业发展趋势和行业景气轮换中蕴含的投资机会,在控制风险并保持基金资产良好的流动性的前提下,力求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,在分析和判断宏观经济周期和市场环境变化趋势的基础上,动态调整投资组合比例,自上而下灵活配置资产;通过把握和判断行业发展趋势及行业景气程度变化,挖掘预期具有良好增长前景的优势行业,精选个股,以谋求超额收益。
业绩比较基准	60%×沪深300指数收益率+40%×中证综合债券指数收益率
风险收益特征	本基金是一只灵活配置的混合型基金,属于基金中的较高风险品种,风险与预期收益介于股票型基金和债券型基金之间。
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

§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	35,275,029.55
2.本期利润	44,966,483.06
3.加权平均基金份额本期利润	0.1888
4.期末基金资产净值	609,272,402.68
5.期末基金份额净值	2.712

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

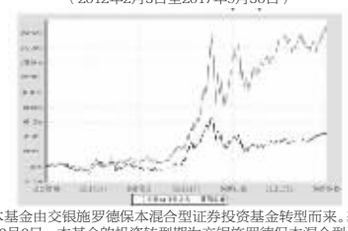
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	7.83%	0.88%	3.04%	0.35%	4.79%	0.53%

注:本基金业绩比较基准自2015年10月1日起,由"60%×沪深300指数收益率+40%×中信标普全债指数收益率"变更为"60%×沪深300指数收益率+40%×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

交银施罗德优势行业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

(2012年2月3日至2017年9月30日)



注:本基金由交银施罗德保本混合型证券投资基金转型而来。基金转型日为2012年2月3日。本基金的投资转型期为交银施罗德保本混合型证券投资基金保本周期到期选择期截止日次日(即2012年2月3日)起的3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		
何帅	交银优势行业混合、交银阿尔法核心混合的基金经理	2015-07-09	-	7年	何帅先生,上海财经大学硕士。历任国联安基金管理有限公司研究员。2012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

2017年三季度A股市场机会较多,上证指数上涨4.9%,创业板指数上涨2.7%。其中新能源车产业链、周期板块、白酒等上涨明显。

本基金在三季度获得一定超额收益,主要原因在于钢铁等周期性板块以及光通讯等成长类个股的配置带来的收益。

三季度供给侧改革力度加深,同时环保压力加大,使得部分工业品价格持续上涨,而龙头企业则受益明显。三季度周期类公司的业绩明显超越市场预期。不过大量企业关停及限产,也影响了三季度工业增加值的恢复,使得经济增长速度略低于此前预期。我们预计后续经济增长仍具备较大韧性,持续处于不温不火的过程中。在货币中性,特别是金融去杠杆较为稳定的环境下,市场流动性边际趋紧,市场大幅上涨较难,但大量优质成长股估值处于较合理甚至低估状态,市场大的下跌风险不大。市场整体预计震荡走势概率较大。

进入第四季度后,我们将把更多目光聚焦于明后年具有较大增长潜力的公司。而选择可持续成长的行业及公司,也一直是本基金主要的选股方式,如光通讯、出版传媒、一线景区酒店、计算机服务等未来几年仍将保持较快增长速度和前景的行业。我们将坚持挖掘具备持续成长性及竞争力的公司,并在合理的估值体系下进行配置,力争为投资人获得持续稳定的超额回报。

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2.712元,本报告期份额净值增长率为7.83%,同期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	477,118,730.15	77.50
	其中:股票	477,118,730.15	77.50
2	固定收益投资	29,958,000.00	4.87
	其中:债券	29,958,000.00	4.87
	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	97,069,514.37	15.77
7	其他资产	11,498,718.78	1.87
8	合计	615,644,963.30	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	-	-
C	制造业	209,242,848.76	34.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,093.44	0.01
E	建筑业	14,811,825.00	2.43
F	批发和零售业	68,650.23	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	23,718,205.44	3.89
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	102,682,975.72	16.85
J	金融业	-	-
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	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	32,510,504.83	5.34
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	22,174,245.76	3.64
R	文化、体育和娱乐业	71,878,380.97	11.80
S	综合	-	-
	合计	477,118,730.15	78.31

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	300365	恒华科技	1,450,227	54,340,005.69	8.92
2	002343	慈文传媒	1,123,532	43,491,923.72	7.14
3	600054	黄山旅游	1,780,893	30,097,091.70	4.94
4	300271	华宇软件	1,893,100	29,664,877.00	4.87
5	603096	新经典	472,265	28,373,681.20	4.66
6	002045	国光电器	1,477,587	25,473,599.88	4.18
7	000858	五粮液	433,057	24,805,504.96	4.07
8	300308	中际装备	504,804	24,528,426.36	4.03
9	002120	韵达股份	514,718	23,718,205.44	3.89
10	300502	新易盛	690,917	23,622,452.23	3.88

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	29,958,000.00	4.92
	其中:政策性金融债	29,958,000.00	4.92
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	29,958,000.00	4.92

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	160217	16国开17	300,000	29,958,000.00	4.92

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	383,035.43
2	应收证券清算款	9,652,457.77
3	应收股利	-
4	应收利息	648,178.44
5	应收申购款	815,047.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,498,718.78

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	255,606,174.48
本报告期期间基金总申购份额	18,977,964.76
减:本报告期期间基金总赎回份额	49,940,375.94
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	224,643,753.30

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、中国证监会批准交银施罗德保本混合型证券投资基金募集的文件;

2、《交银施罗德优势行业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3、《交银施罗德优势行业灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》;

4、《交银施罗德优势行业灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

5、《交银施罗德保本混合型证券投资基金基金合同》;

6、《交银施罗德保本混合型证券投资基金招募说明书》;

7、《交银施罗德保本混合型证券投资基金托管协议》;

8、《交银施罗德保本混合型证券投资基金保函》;

9、上海源泰律师事务所出具的《关于申请募集交银施罗德保本混合型证券投资基金之法律意见书》;

10、上海市通力律师事务所出具的《关于交银施罗德保本混合型证券投资基金保本周期到期转型方案及基金合同修改的法律意见》;

11、基金管理人业务资格批件、营业执照;

12、基金托管人业务资格批件、营业执照;

13、报告期内交银施罗德优势行业灵活配置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。

交银施罗德信用添利债券证券投资基金(LOF)

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	交银信用添利债券(LOF)	
场内简称	交银添利	
基金主代码	164902	
交易代码	164902(前端)	164903(后端)
基金运作方式	上市契约型开放式	
基金合同生效日	2011年1月27日	
报告期末基金份额总额	166,415,401.35份	
投资目标	本基金根据宏观经济运行状况和金融市场的运行趋势,自上而下进行宏观分析,自下而上精选个券,在控制信用风险、利率风险和流动性风险前提下,力求通过主动承担适度信用风险获得持续投资收益,谋求基金资产的长期稳定增长。	
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势,将规范化的基本面研究、严谨的信用分析与积极主动的投资风格相结合。在分析和判断宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上,动态调整大类金融资产比例,自上而下决定债券组合久期及债券类属配置;在严谨深入的信用分析基础上,综合考量信用债券的信用评级,以及各类债券的流动性、供求关系和收益率水平等,自下而上地精选个券。同时,本基金也会关注股票一级市场,权证一级市场等其它相关市场存在的投资机会,力争实现基金总体风险收益特征保持不变前提下的基金资产增值最大化。	
业绩比较基准	80%×中债企业债总全价指数收益率+20%×中债国债总全价指数收益率	
风险收益特征	本基金是一只债券型基金,属于证券投资基金中中等风险的品种,其长期平均的预期收益和风险高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。	
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	

注:根据本基金《基金合同》及《招募说明书》的相关规定,本基金在基金合同生效之日起三年(含三年)的期间内,采取封闭式运作,在深圳证券交易所上市交易,封闭期结束后转为上市开放式基金(LOF)。本基金封闭期自2011年1月27日(基金合同生效日)起至2014年1月27日止,自2014年1月28日起基金运作方式转为"上市契约型开放式",并于同日起开放本基金的申购、赎回业务。本基金在募集期仅开通前端基金份额的认购,转为上市开放式基金(LOF)后同时开通前端基金份额和后端基金份额的申购和赎回。

§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	2,123,252.48
2.本期利润	2,127,802.92
3.加权平均基金份额本期利润	0.0118
4.期末基金资产净值	229,949,123.86
5.期末基金份额净值	1.382

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	0.88%	0.07%	-1.56%	0.04%	2.44%	0.03%

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

交银施罗德信用添利债券证券投资基金(LOF)
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1月27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		
唐赟	交银信用添利债券(LOF)、交银双利债券、交银双轮动债券、交银添利保本混合、交银裕通纯债债券的基金经理	2015-08-04	-	5年	唐赟先生,香港城市大学电子工程硕士。历任通打银行环球企业策略理财产品经理、平安资产管理公司信用分析员。2012年加入交银施罗德基金管理有限公司,历任固定收益研究员、基金经理助理。

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

本报告期内,供给侧改革继续推进、环保限产趋严带来了工业品价格的剧烈波动,引发了市场对经济增长预期和通胀预期的变化。货币政策维持中性,在超储率位于低位的情况下,伴随着缴准、缴税等时点资金面不时出现紧张局面,非银机构融资成本上升。美元指数大幅走低,人民币升值明显,但外汇占款依然维持流出状态。在国内外多重因素的影响下,报告期内债券市场收益率震荡走高。

报告期内,本基金始终维持存单、短融为主的短久期底仓组合,在市场收益率震荡上行的过程中获取了稳定的票息收入,同时择机进行了长久期债券的波段操作,增强组合收益,也配置一定的转债仓位,选择正股基本面稳健、转债估值合理的个券,为组合提供弹性。

展望2017年四季度,经济基本面会对债市形成一定支撑,上半年需求较强的房地产、基建和出口均显出一定的疲态,我们预计这些因素将带动名义增速逐步下行,但是监管政策仍未落地、通胀预期升温、海外货币政策紧缩等因素对债券市场仍然存在制约,我们判断债券市场收益率会震荡下行。信用债的信用利差又仍处于历史低位,尤其是低等级信用债利差未能充分反应未来的信用风险,我们将一如既往地规避中低评级信用债。在利率曲线平坦的情况下,我们将维持目前的债券偏短的久期配置,并将根据宏观及监管政策的变化择机拉长久期。

对于可转债,我们认为随着新的发行办法确定,转债供给将会明显提速,目前存量转债估值相对较高,行业分布有限,我们将更加关注转债新券的机会,期待四季度可转债资产的表现。

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1.382元,本报告期份额净值增长率为0.88%,同期业绩比较基准增长率为-1.56%。

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	1,416,800.00	0.54
	其中:股票	1,416,800.00	0.54
2	固定收益投资	256,997,200.00	97.06
	其中:债券	256,997,200.00	97.06
	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	2,184,283.67	0.82
7	其他资产	4,173,166.84	1.58
8	合计	264,771,450.51	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

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	-	-
C	制造业	1,416,800.00	0.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
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	-	-
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,416,800.00	0.62

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	002241	歌尔股份	70,000	1,416,800.00	0.62

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	3,792,780.00	1.65
2	央行票据	-	-
3	金融债券	39,610,000.00	17.23
	其中:政策性金融债	39,610,000.00	17.23
4	企业债券	49,387,500.00	21.48
5	企业短期融资券	110,425,000.00	48.02
6	中期票据	50,337,000.00	21.89
7	可转债(可交换债)	3,444,920.00	1.50
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	256,997,200.00	111.76

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	170215	17国开15	300,000	30,129,000.00	13.10
2	1382136	13乌兰煤MTN1	200,000	20,098,000.00	8.74
3	041662052	16常熟投资CP001	200,000	20,090,000.00	8.74
4	041760016	17乐清国投CP001	200,000	20,040,000.00	8.71
5	1182277	11中铁建MTN1	100,000	10,294,000.00	4.48

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	16,989.26
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,155,227.90
5	应收申购款	949.68
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,173,166.84

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	192,913,668.89
本报告期期间基金总申购份额	30,401,668.73
减:本报告期期间基金总赎回份额	56,899,936.27
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	166,415,401.35

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	73,528,676.47
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	73,528,676.47
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	44.18

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	73,528,676.47	-	-	73,528,676.47	44.18%
产品特有风险							
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、中国证监会核准交银施罗德信用添利债券证券投资基金募集的文件;

2、《交银施罗德信用添利债券证券投资基金基金合同》;

3、《交银施罗德信用添利债券证券投资基金招募说明书》;

4、《交银施罗德信用添利债券证券投资基金托管协议》;

5、基金管理人业务资格批件、营业执照;

6、基金托管人业务资格批件、营业执照;

7、关于申请募集交银施罗德信用添利债券证券投资基金之法律意见书;

8、报告期内交银施罗德信用添利债券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。

交银施罗德医药创新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:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商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	交银医药创新股票
基金主代码	004075
交易代码	004075
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年3月23日
报告期末基金份额总额	747,921,190.10份
投资目标	本基金将深度挖掘医药创新过程中产业的各类投资机会,精选医药创新主题的优质上市