

## 交银施罗德主题优选灵活配置混合型证券投资基金

## 2017年第三季度报告

报告期间：2017年7月1日至2017年9月30日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事和高级管理人员不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其中内容的真实性、准确性、完整性、及时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日复核了本报告期间的财务指标、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、重大遗漏。

基金托管人承诺以诚实信用、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。

本报告书内容财务数据未经审计。

本报告书自2017年11月1日起至2017年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 交银施罗德主题优选混合

基金主代码 6519700

交易代码 519700(场内) 519700(场外)

基金运作方式 灵活配置型开放式

报告期末基金份额总额 776,232,347.01

投资目标 本基金主要通过投资于具有明显行业优势的股票，将量化、规范化地选取具有较好成长前景的行业，力争实现基金资产的长期稳定增值。

投资策略 本基金主要分析基金管理人的投资风格、行业地位、管理能力、公司治理、估值水平、行业景气度、盈利能力、成长性、流动性等，精选出具有明显行业优势的股票，进行配置。同时，本基金将结合宏观经济形势、经济周期、行业政策、市场环境、资金面、估值水平、行业景气度、盈利能力、成长性、流动性等，精选出具有良好成长前景的行业，进行配置。并计划积极参加部分消费及成长行业和公司的投资机会，同时关注新能源汽车、LG、手机产业链等新兴战略方向。

业绩比较基准 60%×深证成份指数+4%×中债综合总收益指数

风险收益特征 本基金为股票型基金，属于较高风险、较高收益的基金品种，本基金额外风险主要来自于股票型基金和货币市场基金之差。

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 主要财务指标和基金净值表现

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 33,327,10,000

2.本期利润 66,372,428.01

3.加权平均基金份额本期利润 0.0902

4.期末基金份额净值 0.917,477,009.01

5.期末基金资产净值 1,111,000.00

注：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，计算费用后的实际收益水平要低于未计费的收益率。

2.本期已实现收益指基金利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣减相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

交银施罗德主题优选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

(2010年6月30日至2017年9月30日)

§ 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间 证券从业年限 说明

耿�生 管理层成员、股票投资总监、研究部总监、基金经理 2015-06-06 - 8年 衍生品先生，复旦大学硕士，历任长江证券研究所分析师，加入交银施罗德基金管理有限公司，担任行业分析师、基金经理助理。

注：本基金基金经理（或基金经理小组）后期变动（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 公平交易制度的执行情况

本公司制定了严密的公平交易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，旗下所有的所有产品组合，包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均严格按照制度进行公平交易。

本公司建立了公平交易的研究平台，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实现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，建立公平交易管理制度，对不同账户的交易，以公司名义进行的交易的场外交易，遵循“价格优先、时间优先、比例分配”的原则，全部通过交易系统进行比例分配；对于集中竞价交易，以公司名义进行的交易的场外交易，遵循“价格优先、时间优先、比例分配”的原则，按时间优先独立确定的投资方案对交易结果进行分配。

4.4 公平交易制度的执行情况

2017年二季度，国内经济保持相对平稳，人民币升值明显，整体社会经济总体呈现温和增长态势，外需表现强劲的态势。市场焦点主要集中在供给侧改革的短期预期以及地产周期的延续性。我们认为，对于两者对供需的直接影响，伴随着前期政策供给的偏紧，因此对于周期行业带来较大的投资机会。未来中国经济率水平在四季度可能难以持续上升，这将对A股市场产生一定正面作用，并可能推动消费以及成长类行业呈现较为明显的结构性行情。

4.5 公平交易行为的专项说明

本基金在本报期内不存在不公平交易行为。本公司报告期内，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0.5%的情形，本基金在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）同时向同一交易对手卖出或买入的情况。

4.6 报告期内公平交易的评估分析

2017年二季度，国内市场继续保持相对平稳，人民币升值明显，整体社会经济总体呈现温和增长态势，外需表现强劲的态势。市场焦点主要集中在供给侧改革的短期预期以及地产周期的延续性。我们认为，对于两者对供需的直接影响，伴随着前期政策供给的偏紧，因此对于周期行业带来较大的投资机会。未来中国经济率水平在四季度可能难以持续上升，这将对A股市场产生一定正面作用，并可能推动消费以及成长类行业呈现较为明显的结构性行情。

4.7 管理人对报告期内基金投资策略的调整情况

本基金在本报期内不存在不公平交易行为。本公司报告期内，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0.5%的情形，本基金在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）同时向同一交易对手卖出或买入的情况。

4.8 影响投资者决策的其他因素

本基金在本报期内不存在不公平交易行为。本公司报告期内，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0.5%的情形，本基金在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）同时向同一交易对手卖出或买入的情况。

4.9 其他

本基金在本报期内不存在不公平交易行为。本公司报告期内，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0.5%的情形，本基金在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）同时向同一交易对手卖出或买入的情况。

4.10 公平交易制度的执行情况

本公司制定了严密的公平交易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，旗下所有的所有产品组合，包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均严格按照制度进行公平交易。

本公司建立了公平交易的研究平台，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实现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，建立公平交易管理制度，对不同账户的交易，以公司名义进行的交易的场外交易，遵循“价格优先、时间优先、比例分配”的原则，全部通过交易系统进行比例分配；对于集中竞价交易，以公司名义进行的交易的场外交易，遵循“价格优先、时间优先、比例分配”的原则，按时间优先独立确定的投资方案对交易结果进行分配。

4.11 公平交易制度的执行情况

2017年二季度，国内市场继续保持相对平稳，人民币升值明显，整体社会经济总体呈现温和增长态势，外需表现强劲的态势。市场焦点主要集中在供给侧改革的短期预期以及地产周期的延续性。我们认为，对于两者对供需的直接影响，伴随着前期政策供给的偏紧，因此对于周期行业带来较大的投资机会。未来中国经济率水平在四季度可能难以持续上升，这将对A股市场产生一定正面作用，并可能推动消费以及成长类行业呈现较为明显的结构性行情。

4.12 影响投资者决策的其他因素

本基金在本报期内不存在不公平交易行为。本公司报告期内，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0.5%的情形，本基金在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）同时向同一交易对手卖出或买入的情况。

4.13 其他

本基金在本报期内不存在不公平交易行为。本公司报告期内，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0.5%的情形，本基金在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）同时向同一交易对手卖出或买入的情况。

4.14 公平交易制度的执行情况

本公司制定了严密的公平交易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，旗下所有的所有产品组合，包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均严格按照制度进行公平交易。

本公司建立了公平交易的研究平台，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实现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，建立公平交易管理制度，对不同账户的交易，以公司名义进行的交易的场外交易，遵循“价格优先、时间优先、比例分配”的原则，全部通过交易系统进行比例分配；对于集中竞价交易，以公司名义进行的交易的场外交易，遵循“价格优先、时间优先、比例分配”的原则，按时间优先独立确定的投资方案对交易结果进行分配。

4.15 公平交易制度的执行情况

2017年二季度，国内市场继续保持相对平稳，人民币升值明显，整体社会经济总体呈现温和增长态势，外需表现强劲的态势。市场焦点主要集中在供给侧改革的短期预期以及地产周期的延续性。我们认为，对于两者对供需的直接影响，伴随着前期政策供给的偏紧，因此对于周期行业带来较大的投资机会。未来中国经济率水平在四季度可能难以持续上升，这将对A股市场产生一定正面作用，并可能推动消费以及成长类行业呈现较为明显的结构性行情。

4.16 影响投资者决策的其他因素

本基金在本报期内不存在不公平交易行为。本公司报告期内，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0.5%的情形，本基金在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）同时向同一交易对手卖出或买入的情况。

4.17 其他

本基金在本报期内不存在不公平交易行为。本公司报告期内，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0.5%的情形，本基金在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）同时向同一交易对手卖出或买入的情况。

4.18 公平交易制度的执行情况

本公司制定了严密的公平交易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，旗下所有的所有产品组合，包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均严格按照制度进行公平交易。

本公司建立了公平交易的研究平台，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实现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，建立公平交易管理制度，对不同账户的交易，以公司名义进行的交易的场外交易，遵循“价格优先、时间优先、比例分配”的原则，全部通过交易系统进行比例分配；对于集中竞价交易，以公司名义进行的交易的场外交易，遵循“价格优先、时间优先、比例分配”的原则，按时间优先独立确定的投资方案对交易结果进行分配。

4.19 公平交易制度的执行情况

2017年二季度，国内市场继续保持相对平稳，人民币升值明显，整体社会经济总体呈现温和增长态势，外需表现强劲的态势。市场焦点主要集中在供给侧改革的短期预期以及地产周期的延续性。我们认为，对于两者对供需的直接影响，伴随着前期政策供给的偏紧，因此对于周期行业带来较大的投资机会。未来中国经济率水平在四季度可能难以持续上升，这将对A股市场产生一定正面作用，并可能推动消费以及成长类行业呈现较为明显的结构性行情。

4.20 影响投资者决策的其他因素

本基金在本报期内不存在不公平交易行为。本公司报告期内，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0.5%的情形，本基金在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）同时向同一交易对手卖出或买入的情况。

4.21 其他

本基金在本报期内不存在不公平交易行为。本公司报告期内，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0.5%的情形，本基金在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）同时向同一交易对手卖出或买入的情况。

4.22 公平交易制度的执行情况

本公司制定了严密的公平交易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，旗下所有的所有产品组合，包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均严格按照制度进行公平交易。

本公司建立了公平交易的研究平台，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实现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，建立公平交易管理制度，对不同账户的交易，以公司名义进行的交易的场外交易，遵循“价格优先、时间优先、比例分配”的原则，全部通过交易系统进行比例分配；对于集中竞价交易，以公司名义进行的交易的场外交易，遵循“价格优先、时间优先、比例分配”的原则，按时间优先独立确定的投资方案对交易结果进行分配。

4.23 公平交易制度的执行情况

2017年二季度，国内市场继续保持相对平稳，人民币升值明显，整体社会经济总体呈现温和增长态势，外需表现强劲的态势。市场焦点主要集中在供给侧改革的短期预期以及地产周期的延续性。我们认为，对于两者对供需的直接影响，伴随着前期政策供给的偏紧，因此对于周期行业带来较大的投资机会。未来中国经济率水平在四季度可能难以持续上升，这将对A股市场产生一定正面作用，并可能推动消费以及成长类行业呈现较为明显的结构性行情。

4.24 影响投资者决策的其他因素

本基金在本报期内不存在不公平交易行为。本公司报告期内，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0.5%的情形，本基金在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）同时向同一交易对手卖出或买入的情况。

4.25 其他

本基金在本报期内不存在不公平交易行为。本公司报告期内，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0.5%的情形，本基金在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）同时向同一交易对手卖出或买入的情况。

4.26 公平交易制度的执行情况

本公司制定了严密的公平交易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，旗下所有的所有产品组合，包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均严格按照制度进行公平交易。

本公司建立了公平交易的研究平台，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实现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，建立公平交易管理制度，对不同账户的交易，以公司名义进行的交易的场外交易，遵循“价格优先、时间优先、比例分配”的原则，全部通过交易系统进行比例分配；对于集中竞价交易，以公司名义进行的交易的场外交易，遵循“价格优先、时间优先、比例分配”的原则，按时间优先独立确定的投资方案对交易结果进行分配。

4.27 公平交易制度的执行情况

2017年二季度，国内市场继续保持相对平稳，人民币升值明显，整体社会经济总体呈现温和增长态势，外需表现强劲的态势。市场焦点主要集中在供给侧改革的短期预期以及地产周期的延续性。我们认为，对于两者对供需的直接影响，伴随着前期政策供给的偏紧，因此对于周期行业带来较大的投资机会。未来中国经济率水平在四季度可能难以持续上升，这将对A股市场产生一定正面作用，并可能推动消费以及成长类行业呈现较为明显的结构性行情。

4.28 影响投资者决策的其他因素

本基金在本报期内不存在不公平交易行为。本公司报告期内，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0.5%的情形，本基金在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）同时向同一交易对手卖出或买入的情况。

4.29 其他

本基金在本报期内不存在不公平交易行为。本公司报告期内，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0.5%的情形，本基金在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）同时向同一交易对手卖出或买入的情况。