

基金管理人：交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一九年七月十七日

基金管理人的董事及董事会秘书所制作的报告不存在虚假记载、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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同的规定，于2019年7月16日复核了本报告期内基金资产净值计算、申购和赎回价格的计算等项内容，在此基础上确认不存在虚假记载、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未来表现。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。

报告期末自2019年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 交银施罗德改革灵活配置混合型证券投资基金

基金代码 519756

交易方式 灵活开放式

基金合同生效日 2015年6月7日

报告期末基金总资产 550,237,313.44元

投资目标 本基金的主要投资管理人在合理控制投资风险的基础上，力争实现基金资产的长期增值。

§ 3 主要财务指标

报告期(2019年4月1日至2019年6月30日)

主要财务指标 单位:人民币元

1.本期已实现收益 12,905,426.90

2.本期利润 -21,712,538.89

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0389

4.期末基金资产净值 534,123,743.92

5.期末基金份额净值 0.971

注:1.上表基金净值增长率包括持有人认购或申购基金时的费用,计入费用后的实际收益率将低于所示的净值增长。

2.本期利润为本期已实现收益扣减本期期间费用后的余额,详阅“3.2.2.2.2 报告期末基金资产净值”部分。

3.2.2.1 本期报告期基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率 业绩比较基准收益率 ①-② ③ ④

过去三个月 0.64% -0.23% 0.86% -0.03%

注:1.本基金净值增长率采用四舍五入法保留到小数点后三位,净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额可能因舍入而产生差异。

2.本基金业绩基准的计算方法: A类基金的业绩基准=沪深300指数×40%+中证债券指数×60%。详阅“3.2.2.2.2 报告期末基金资产净值”部分。

3.2.2.2 本基金报告期基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:交银施罗德改革灵活配置混合型证券投资基金

份额累计净值与同期业绩比较基准收益率走势对比如图

(2019年4月10日至2019年6月30日)

由于外部环境的不确定有所增加,国企改革的进程并非一帆风顺,部分领域例如地方混改

交银施罗德国企改革灵活配置混合型证券投资基金

2019年第二季度报告

本基金报告期无按行业分类的股票投资损益组合

本基金报告期末未持有通过股票投资的股票。

§ 2.2 报告期内按行业分类的股票投资损益组合

本基金报告期末未持有通过股票投资的股票。

§ 2.3 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 300413 旗滨集团 445,420 18,284,491.00 3.42

2 600030 中信证券 2,799,900 18,040,937.00 3.38

3 601398 中国银行 16,491,411.00 3,099

4 600038 中航股份 400,000 16,408,000.00 3.07

5 600528 中国国旅 794,890 14,392,122.20 2.68

6 600915 中牧股份 962,760 13,334,266.00 2.50

7 600448 保利地产 1,034,234 13,196,258.84 2.47

8 300334 丽珠集团 888,400 13,183,566.00 2.47

9 600887 伊利股份 393,700 13,153,517.00 2.46

10 600967 内蒙一机 1,150,000 12,880,000.00 2.41

§ 2.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号 债券代码 债券名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 113517 涨停转债 188,329.00 0.04

§ 2.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号 债券代码 债券名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 113517 涨停转债 188,329.00 0.04

§ 2.6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金总份额 586,153,389.20

报告期期间基金总份额增加量 3,873,227.67

报告期末基金总份额 590,020,616.87

§ 2.7 基金管理人运用基金资产进行关联交易的情况

7.1 基金管理人与本基金份额持有人之间的关联交易情况

7.2 基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

7.3 基金管理人与本公司高级管理人员、基金经理等发生关联交易的情况

7.4 基金管理人与本公司股东之间发生的关联交易情况

7.5 基金管理人与本公司关联方之间发生的关联交易情况

7.6 基金管理人与本公司董事、监事、高级管理人员之间的关联交易情况

7.7 基金管理人与本公司股东、实际控制人及其关联人、董事、监事、高级管理人员之间的关联交易情况

7.8 基金管理人与本公司董事、监事、高级管理人员、基金经理等之间存在控制关系的关联人之间的关联交易情况

7.9 基金管理人与本公司董事、监事、高级管理人员、基金经理等之间存在密切联系的关联人之间的关联交易情况

7.10 基金管理人与本公司董事、监事、高级管理人员、基金经理等之间存在其他利益关系的关联人之间的关联交易情况

7.11 基金管理人与本公司董事、监事、高级管理人员、基金经理等之间存在其他利益关系的关联人之间的关联交易情况

7.12 基金管理人与本公司董事、监事、高级管理人员、基金经理等之间存在其他利益关系的关联人之间的关联交易情况

7.13 基金管理人与本公司董事、监事、高级管理人员、基金经理等之间存在其他利益关系的关联人之间的关联交易情况

7.14 基金管理人与本公司董事、监事、高级管理人员、基金经理等之间存在其他利益关系的关联人之间的关联交易情况

7.15 基金管理人与本公司董事、监事、高级管理人员、基金经理等之间存在其他利益关系的关联人之间的关联交易情况

7.16 基金管理人与本公司董事、监事、高级管理人员、基金经理等之间存在其他利益关系的关联人之间的关联交易情况

7.17 基金管理人与本公司董事、监事、高级管理人员、基金经理等之间存在其他利益关系的关联人之间的关联交易情况

7.18 基金管理人与本公司董事、监事、高级管理人员、基金经理等之间存在其他利益关系的关联人之间的关联交易情况

7.19 基金管理人与本公司董事、监事、高级管理人员、基金经理等之间存在其他利益关系的关联人之间的关联交易情况

7.20 基金管理人与本公司董事、监事、高级管理人员、基金经理等之间存在其他利益关系的关联人之间的关联交易情况

7.21 基金管理人与本公司董事、监事、高级管理人员、基金经理等之间存在其他利益关系的关联人之间的关联交易情况

7.22 基金管理人与本公司董事、监事、高级管理人员、基金经理等之间存在其他利益关系的关联人之间的关联交易情况

7.23 基金管理人与本公司董事、监事、高级管理人员、基金经理等之间存在其他利益关系的关联人之间的关联交易情况

7.24 基金管理人与本公司董事、监事、高级管理人员、基金经理等之间存在其他利益关系的关联人之间的关联交易情况

7.25 基金管理人与本公司董事、监事、高级管理人员、基金经理等之间存在其他利益关系的关联人之间的关联交易情况

7.26 基金管理人与本公司董事、监事、高级管理人员、基金经理等之间存在其他利益关系的关联人之间的关联交易情况

7.27 基金管理人与本公司董事、监事、高级管理人员、基金经理等之间存在其他利益关系的关联人之间的关联交易情况

7.28 基金管理人与本公司董事、监事、高级管理人员、基金经理等之间存在其他利益关系的关联人之间的关联交易情况

7.29 基金管理人与本公司董事、监事、高级管理人员、基金经理等之间存在其他利益关系的关联人之间的关联交易情况

7.30 基金管理人与本公司董事、监事、高级管理人员、基金经理等之间存在其他利益关系的关联人之间的关联交易情况

7.31 基金管理人与本公司董事、监事、高级管理人员、基金经理等之间存在其他利益关系的关联人之间的关联交易情况

7.32 基金管理人与本公司董事、监事、高级管理人员、基金经理等之间存在其他利益关系的关联人之间的关联交易情况

7.33 基金管理人与本公司董事、监事、高级管理人员、基金经理等之间存在其他利益关系的关联人之间的关联交易情况

7.34 基金管理人与本公司董事、监事、高级管理人员、基金经理等之间存在其他利益关系的关联人之间的关联交易情况

7.35 基金管理人与本公司董事、监事、高级管理人员、基金经理等之间存在其他利益关系的关联人之间的关联交易情况

7.36 基金管理人与本公司董事、监事、高级管理人员、基金经理等之间存在其他利益关系的关联人之间的关联交易情况

7.37 基金管理人与本公司董事、监事、高级管理人员、基金经理等之间存在其他利益关系的关联人之间的关联交易情况

7.38 基金管理人与本公司董事、监事、高级管理人员、基金经理等之间存在其他利益关系的关联人之间的关联交易情况

7.39 基金管理人与本公司董事、监事、高级管理人员、基金经理等之间存在其他利益关系的关联人之间的关联交易情况

7.40 基金管理人与本公司董事、监事、高级管理人员、基金经理等之间存在其他利益关系的关联人之间的关联交易情况

7.41 基金管理人与本公司董事、监事、高级管理人员、基金经理等之间存在其他利益关系的关联人之间的关联交易情况

7.42 基金管理人与本公司董事、监事、高级管理人员、基金经理等之间存在其他利益关系的关联人之间的关联交易情况

7.43 基金管理人与本公司董事、监事、高级管理人员、基金经理等之间存在其他利益关系的关联人之间的关联交易情况

7.44 基金管理人与本公司董事、监事、高级管理人员、基金经理等之间存在其他利益关系的关联人之间的关联交易情况

7.45 基金管理人与本公司董事、监事、高级管理人员、基金经理等之间存在其他利益关系的关联人之间的关联交易情况

7.46 基金管理人与本公司董事、监事、高级管理人员、基金经理等之间存在其他利益关系的关联人之间的关联交易情况

7.47 基金管理人与本公司董事、监事、高级管理人员、基金经理等之间存在其他利益关系的关联人之间的关联交易情况

7.48 基金管理人与本公司董事、监事、高级管理人员、基金经理等之间存在其他利益关系的关联人之间的关联交易情况

7.49 基金管理人与本公司董事、监事、高级管理人员、基金经理等之间存在其他利益关系的关联人之间的关联交易情况

7.50 基金管理人与本公司董事、监事、高级管理人员、基金经理等之间存在其他利益关系的关联人之间的关联交易情况

7.51 基金管理人与本公司董事、监事、高级管理人员、基金经理等之间存在其他利益关系的关联人之间的关联交易情况

7.52 基金管理人与本公司董事、监事、高级管理人员、基金经理等之间存在其他利益关系的关联人之间的关联交易情况

7.53 基金管理人与本公司董事、监事、高级管理人员、基金经理等之间存在其他利益关系的关联人之间的关联交易情况

7.54 基金管理人与本公司董事、监事、高级管理人员、基金经理等之间存在其他利益关系的关联人之间的关联交易情况

7.55 基金管理人与本公司董事、监事、高级管理人员、基金经理等之间存在其他利益关系的关联人之间的关联交易情况

7.56 基金管理人与本公司董事、监事、高级管理人员、基金经理等之间存在其他利益关系的关联人之间的关联交易情况

7.57 基金管理人与本公司董事、监事、高级管理人员、基金经理等之间存在其他利益关系的关联人之间的关联交易情况

7.58 基金管理人与本公司董事、监事、高级管理人员、基金经理等之间存在其他利益关系的关联人之间的关联交易情况

7.59 基金管理人与本公司董事、监事、高级管理人员、基金经理等之间存在其他利益关系的关联人之间的关联交易情况

7.60 基金管理人与本公司董事、监事、高级管理人员、基金经理等之间存在其他利益关系的关联人之间的关联交易情况

7.61 基金管理人与本公司董事、监事、高级管理人员、基金经理等之间存在其他利益关系的关联人之间的关联交易情况

7.62 基金管理人与本公司董事、监事、高级管理人员、基金经理等之间存在其他利益关系的关联人之间的关联交易情况