交银施罗德股息优化混合型证券投资基金

2019年第二季度报告

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:二〇一九年七月十七日

§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2019年7月16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	交银股息优化混合
基金主代码	004868
交易代码	004868
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年8月25日
报告期末基金份额总额	93,268,185.67份
投资目标	本基金主要投资于具有稳定股息收益的优质成长性上市公司,以稳健收益为目标,追求长期的资产增值。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势,在分析和判断宏观经济周期和金融市场运行趋势的基础上,自上而下调整基金大类资产配置和股票行业配置策略,确定债券组合久期和债券类别配置;在严谨深入的股票和债券研究分析基础上,自下而上精选个券。其中,本基金在股票投资上突出对有稳定股息收益的股票的侧重,同时选取能够体现公司竞争比较优势、盈利能力、内生成长性因子和体现公司财务状况、抗周期波动和分红稳定性因子,力争投资于具有稳定股息收益的优质成长性上市公司。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+中证综合债券指数收益率×40%
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(2019年4月1日-2019年6月30日)
1.本期已实现收益	10,011,297.05
2.本期利润	5,543,039.81
3.加权平均基金份额本期利润	0.0558
4.期末基金资产净值	114,709,715.95
5.期末基金份额净值	1.2299

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。

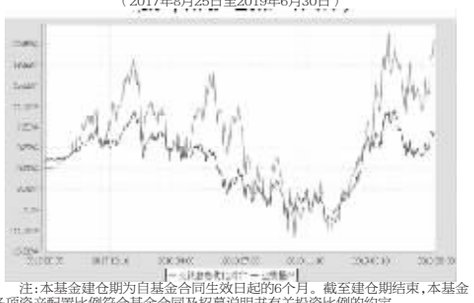
3.2 基金净值表现

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	4.62%	1.83%	-0.30%	0.91%	4.92%	0.92%

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

交银施罗德股息优化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
(2017年8月25日至2019年6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		
韩威俊	交银趋势混合、交银策略回报灵活配置混合、交银消费新驱动股票、交银股息优化混合、交银品质升级混合的基金经理	2017-08-25	-	13年	韩威俊先生,上海财经大学金融学硕士。历任申银万国证券研究所助理分析师、北京鼎天资产管理有限公司董事助理、申银万国证券研究所行业分析师、信诚基金管理有限公司投资分析师。2013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,基金整体运作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未发现异常交易行为。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超过该证券当日总成交量5%的情况有1次,是投资组合因投资策略需要而发生同日反向交易,未发现不公平交易和利益输送的情况。本基金与本公司管理的其他投资组合在不同时间窗口(如日内、3日内、5日内)同向交易的交易价差未发现异常。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

回顾2019年二季度,中美贸易战持续发酵,整个市场成交量大幅下滑,市场观望情绪明显提升。由于人民币贬值影响,外资在四至五月出现比较明显的流出,整个市场向集中度较高的龙头白马大幅集中。

本基金在2019年二季度基本上围绕着消费白马龙头作为底仓的配置思路,个股持仓比例有所提升,主要增持二季度业绩较好并且存在上调盈利预测可能性的个股,获得了比较明显的相对收益和绝对收益。

展望2019年三季度,预计市场流动性会出现比较明显的改善,特别是长端利率水平可能会有比较明显的下降。随着海外进入降息周期以后,人民币贬值压力也会有所降低,国内货币政策调整的空间也将变大,整个市场的流动性呈现较为宽松的状态。但是,由于宏观经济增速放缓以及各行业增速的放缓,全市场基本面开始出现一定的向下压力,在一定程度上对冲了流动性宽松。

本基金在三季度拟将保持消费白马和地产作为底仓的配置思路,同时考虑适当减持纯粹估值提升的个股。

4.5报告期内基金的业绩表现

本基金(各类)份额净值及业绩表现请见"3.1 主要财务指标" 及"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"部分披露。

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

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	108,575,405.23	90.91
	其中:股票	108,575,405.23	90.91
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	10,757,160.36	9.01
8	其他各项资产	93,143.34	0.08
9	合计	119,425,708.93	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

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	65,976.75	0.06
C	制造业	92,825,015.51	80.92
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	2,841,447.00	2.48
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	33,869.94	0.03
K	房地产业	10,251,353.67	8.94
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,999,530.00	1.74
N	水利、环境和公共设施管理业	535,105.76	0.47
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	23,106.60	0.02
S	综合	-	-
	合计	108,575,405.23	94.65

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	603369	今世缘	400,500	11,169,945.00	9.74
2	000858	五粮液	89,725	10,583,063.75	9.23
3	600559	老白干酒	798,362	10,450,558.58	9.11
4	600519	贵州茅台	10,577	10,407,768.00	9.07
5	300146	汤臣倍健	530,631	10,294,241.40	8.97
6	000651	格力电器	187,100	10,290,500.00	8.97
7	601155	新城控股	257,507	10,251,353.67	8.94
8	600887	伊利股份	305,241	10,198,101.81	8.89
9	603886	元祖股份	372,485	9,867,127.65	8.60
10	000661	长春高新	17,100	5,779,800.00	5.04

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	70,895.43
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,729.13
5	应收申购款	20,518.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	93,143.34

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	117,810,214.32
本报告期期间基金总申购份额	8,095,853.64
减:本报告期期间基金总赎回份额	32,637,882.29
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	93,268,185.67

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 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 影响投资者决策的其他重要信息

根据有关法律法规规定和基金合同的约定,本基金可投资科创板股票。基金资产投资于科创板股票,会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险,包括但不限于市场风险、流动性风险、退市风险、集中度风险、系统性风险、政策风险等。有关详情请查阅本基金管理人于2019年6月22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可投资科创板股票的公告》。

§9 备查文件目录

9.1备查文件目录

1、中国证监会准予交银施罗德股息优化混合型证券投资基金募集注册的文件;

2、《交银施罗德股息优化混合型证券投资基金基金合同》;

3、《交银施罗德股息优化混合型证券投资基金招募说明书》;

4、《交银施罗德股息优化混合型证券投资基金托管协议》;

5、关于申请募集注册交银施罗德股息优化混合型证券投资基金的法律意见书;

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股息优化混合型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)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。

交银施罗德持续成长主题混合型证券投资基金

2019年第二季度报告

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:二〇一九年七月十七日

§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2019年7月16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	交银持续成长主题混合
基金主代码	005001
交易代码	005001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年1月12日
报告期末基金份额总额	1,443,281,161.81份
投资目标	本基金在有效控制组合风险并保持良好流动性的前提下,把握市场发展趋势,通过专业化研究分析,重点投资具备充分成长空间和拥有持续成长性的上市公司,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金通过定量与定性相结合的评价方法,评估其行业的持续成长性。通过对消费者需求变化趋势、产业结构变迁、全球技术创新和商业模式演化等多因素的分析和预测,得出各行业的相对投资价值与投资时机。除行业的持续成长性评估之外,本基金将基于对相关个股深入的基本面研究和细致的实地调研,结合交银施罗德企业成长性评价体系从行业前景、公司质量和成长性质量等方面对上市公司的持续成长性进行综合评价,精选个股,力争实现基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	75%×沪深300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(2019年4月1日-2019年6月30日)
1.本期已实现收益	78,245,729.27
2.本期利润	-102,816,938.66
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0661
4.期末基金资产净值	1,759,153,445.54
5.期末基金份额净值	1.2189

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;

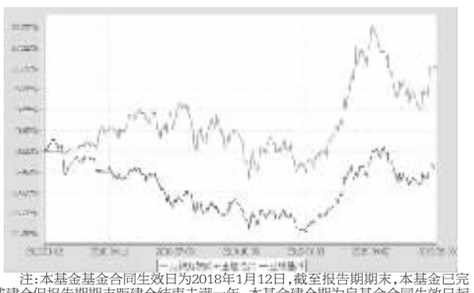
3.2 基金净值表现

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	-4.30%	1.55%	-0.61%	1.14%	-3.69%	0.41%

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

交银施罗德持续成长主题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
(2018年1月12日至2019年6月30日)



注:本基金基金合同生效日为2018年1月12日,截至报告期期末,本基金已完成建仓但报告期期末距建仓结束未满一年。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		
何帅	交银优势行业混合、交银阿尔法核心混合、交银持续成长主题混合的基金经理	2018-01-12	-	9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,基金整体运作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未发现异常交易行为。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超过该证券当日总成交量5%的情况有1次,是投资组合因投资策略需要而发生同日反向交易,未发现不公平交易和利益输送的情况。本基金与本公司管理的其他投资组合在不同时间窗口(如日内、3日内、5日内)同向交易的交易价差未发现异常。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2019年二季度A股市场风险偏好下降明显,上证指数下跌3.62%,创业板指数下跌10.75%。其中以食品饮料为代表的绩优白马等上涨明显。

本基金在二季度本跑赢业绩比较基准,主要原因是持仓结构偏向成长类,而"核心资产"等绩优白马配置较少。

站在目前的时点上,经历了年初以来市场较大幅度的上涨及二季度的回调,市场中不同行业或者标的的市场关注度及隐含回报率发生了较大分化。对于宏观经济基本面预期,短期数据表现不错,但是很难说中国经济的隐忧已经完全解除,后续几个季度还需要继续观察。预计在整体指数相对平稳的状态下,持续成长型公司可能将陆续涌现,或许是挑战选股能力的阶段,可以更多地去寻找变化,寻找能够展现新的积极前景的公司。我们希望通过深度研究,享受公司价值的可持续成长,并希望以此能够持续为持有人获得超额收益。

4.5报告期内基金的业绩表现

本基金(各类)份额净值及业绩表现请见"3.1 主要财务指标" 及"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"部分披露。

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

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,437,622,628.64	80.81
	其中:股票	1,437,622,628.64	80.81
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	29,847,000.00	1.68
	其中:债券	29,847,000.00	1.68
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	299,573,388.80	16.84
8	其他各项资产	12,032,209.12	0.68
9	合计	1,779,075,226.56	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

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	363,431.25	0.02
C	制造业	262,729,047.63	14.93
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	73,039,946.13	4.15
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	828,431,535.13	47.09
J	金融业	33,869.94	0.00
K	房地产业	55,957,515.68	3.18
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	85,869,957.60	4.88
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	11,518,275.00	0.65
Q	卫生和社会工作	119,655,943.68	6.80
R	文化、体育和娱乐业	23,106.60	0.00
S	综合	-	-
	合计	1,437,622,628.64	81.72

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	300188	美亚柏科	9,307,381	165,950,603.23	9.43
2	300365	恒华科技	7,672,082	124,364,449.22	7.07
3	300078	思创医惠	10,189,313	104,032,885.73	5.91
4	002044	美年健康	7,869,098	97,527,579.12	5.54
5	300012	华测检测	7,950,922	85,869,957.60	4.88
6	603039	泛微网络	1,007,557	74,760,729.40	4.25
7	300271	华宇软件	3,487,898	66,270,062.00	3.77
8	300609	汇纳科技	1,761,299	61,751,142.94	3.51
9	002410	广联达	1,782,893	58,639,350.77	3.33
10	603232	格尔软件	1,995,705	54,841,973.40	3.12

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	29,847,000.00	1.70
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
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	29,847,000.00	1.70

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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	199914	19贴现国债14	300,000	29,847,000.00	1.70

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	739,284.70
2	应收证券清算款	10,596,748.77
3	应收股利	-
4	应收利息	175,310.61
5	应收申购款	520,865.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,032,209.12

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002044	美年健康	6,602,400.00	0.38	限售股

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	1,719,702,155.80
本报告期期间基金总申购份额	61,434,678.66
减:本报告期期间基金总赎回份额	337,855,672.65
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	1,443,281,161.81

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 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 影响投资者决策的其他重要信息

根据有关法律法规规定和基金合同的约定,本基金可投资科创板股票。基金资产投资于科创板股票,会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险,包括但不限于市场风险、流动性风险、退市风险、集中度风险、系统性风险、政策风险等。有关详情请查阅本基金管理人于2019年6月22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可投资科创板股票的公告》。

§9 备查文件目录

9.1备查文件目录

1、中国证监会准予交银施罗德持续成长主题混合型证券投资基金募集注册的文件;

2、《交银施罗德持续成长主题混合型证券投资基金基金合同》;

3、《交银施罗德持续成长主题混合型证券投资基金招募说明书》;

4、《交银施罗德持续成长主题混合型证券投资基金托管协议》;

5、关于申请募集注册交银施罗德持续成长主题混合型证券投资基金的法律意见书;

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持续成长主题混合型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)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。

交银施罗德丰晟收益债券型证券投资基金

2019年第二季度报告

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

§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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月16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	交银丰晟收益债券
基金主代码	005577
基金运作方式	契约型,本基金在基金合同生效之日起两年(含两年)的期间内封闭式运作,封闭期结束后转为开放式运作。
基金合同生效日	2018年5月23日
报告期末基金份额总额	331,589,908.23份
投资目标	在严格控制风险的前提下,力求获得高于业绩基准的投资收益。
投资策略	封闭期内的投资策略: 本基金充分发挥基金管理人的研究优势,融合规范化的基本面研究和严谨的信用分析,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,充分利用封闭式运作优势,以买入持有和杠杆套息等为基本投资策略,获取稳定收益;同时,本基金将严格控制信用风险,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,自下而上精选投资标的。 转为开放式运作后的投资策略: 本基金充分发挥基金管理人的研究优势,融合规范化的基本面研究和严谨的信用分析,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,自上而下决定类属资产配置和债券组合久期、期限结构;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,自下而上精选投资标的。
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率
风险收益特征	本基金是一只债券型基金,其预期风险与预期收益高于货币市场基金,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	招商银行股份有限公司

下属两级基金的基金简称	交银丰晟收益债券A	交银丰晟收益债券C
下属两级基金的交易代码	005577	005578
报告期末下属两级基金的份额总额	330,813,244.80份	776,663.43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(2019年4月1日-2019年6月30日)	
	交银丰晟收益债券A	交银丰晟收益债券C
1.本期已实现收益	5,967,409.87	12,749.30
2.本期利润	3,536,206.57	7,052.60
3.加权平均基金份额本期利润	0.0107	0.0091
4.期末基金资产净值	353,194,372.94	826,784.25
5.期末基金份额净值	1.0677	1.0645

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