

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：二〇一九年七月十七日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事局及高级管理人员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的规定，于2019年7月16日对本报告中的财务指标、净值表现、目标收益率和投资组合报告等内容，进行逐项复核，没有发现所载内容存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人承诺，以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

细阅读相关法律文件及基金合同。

本报告期截至2019年6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 交银施罗德核心资产混合型证券投资基金

基金主代码 000623

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2019年1月16日

报告期末基金份额总额 292,626,230.00份

投资目标 本基金主要投资于具有核心资产的上市公司的，在合理控制风

险的前提下，力争保持基金资产因流动性的情况下，力争实现基金资产

的长期稳定增值。

业绩比较基准 沪深300指数收益率×90%+中证综合债券指数收

益率×10%

风险收益特征 本基金为混合型基金，属于较高风险、较高收益的品种。

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

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2019年1月1日-2019年6月30日)

1.本期已实现收益 3,161,240.44

2.本期利润 -2,426,070.02

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0096

4.期末基金资产净值 302,669,803.76

5.期末基金份额净值 1.0343

注：1.上述业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计价费用后实

际收益水平将低于上述数字。

2.本期利润是根据本基金合同规定的收益分配原则，由本期利润加上本期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

益扣除相关费用后的余额。

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 净值增长长 度(%) 基准收益 率差额(%) 标准差(%) (1)-(3) (2)-(4)

过去三个月 -1.89% 1.30% -0.95% 0.07% -1.03% 0.33%

3.2.2 本报告期基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益历史走势对比图

(2019年1月1日至2019年6月30日)

注：本基金基金合同生效日为2019年1月16日，基金合同生效日至报告期末，本基金运作时间未满半年。本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至2019年6月30日，本基金尚未处于建仓期。

# 交银施罗德核心资产混合型证券投资基金

## 2019年第二季度报告

### § 4 管理人报告

#### 4.1 基金经理（或基金经理助理）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
陈华伟	环球精选基金经理 （GDR）、交银施罗德股息精选基金经理 （GDR）、交银施罗德混合基金经理 （GDR）、交银施罗德灵活配置基金经理 （GDR）、交银施罗德量化基金经理 （GDR）、交银施罗德量化基金经理 （GDR）	2019-01-18	-	14年 陈华伟女士，中国国籍，上海交通大学金融学硕士。现任职于交银施罗德基金管理有限公司，中国金融国际有限公司研究部公用事业组负责人，交银施罗德基金管理有限公司研究部公用事业组组长，交银施罗德基金管理有限公司基金经理。

的概数较小，但是也是最重要的，我们仍然密切关注“减税降费”对于企业的实质性的改善效果，而这也将在下半年逐步体现。上市公司层面，我们仍然看好消费、科技板块，对于制造业，也保持乐观。目前制造业的估值已经部分反映了悲观预期，从基本面看，实体经济已经经历了一段出清的过程，行业分化加速，部分龙头企业开始逐步企稳，且更长期，更值得关注的是，全国范围内，中国的“制造业供应链”优势十分显著且难以撼动。我们相信，在制造业领域，仍会有一批优秀的公司，优质的投资者的。下半年，我们仍坚持买入优质股票，努力为投资人赚钱回报。

4.2 报告期内本基金的基金绩效表现

本基金在报告期内的基金绩效评价，详见附录四《基金绩效评价报告》。

4.3 报告期内基金组合投资情况

本基金是一只混合型基金，其风险和收益水平高于货币市场基金，低于股票型基金。

风险收益特征 本基金在投资运作过程中，综合考虑信用、期限、流动性、风险、收益等多方面因素，通过主动管理，寻求在风险调整后的收益差额的基础上，获取超越业绩基准的收益。

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

§ 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(人民币)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	242,632,733.77	78.00
2	固定收益投资	242,632,733.77	78.00
3	贵金属	-	-
4	定期存款	9,999,000.00	3.21
5	货币市场基金	9,999,000.00	3.21
6	其他	-	-
7	应收申购款	800,000.00	0.00
8	应付赎回款	10,840,000.00	3.58
9	应付交易费用	400,000.00	0.13
10	预提费用	379,394.80	0.01
合计		302,669,803.76	100.00

注：以上数据为采用全球行业分类标准（GICS）。

5.2 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

本基金在报告期内的股票投资组合，详见附录四《基金组合投资情况》。

5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.3.1 本报告期末按行业分类的境内股票投资组合

序号 行业类别 公允价值 占基金资产净值比例(%)

1 农、林、牧、渔业 - -

2 制造业 186,328.85 0.06

3 采矿业 74,907,638.76 24.75

4 电力、热力、燃气及水生产和供应业 - -

5 建筑业 - -

6 食品、饮料及烟草制造业 18,840,087.18 6.22

7 交通运输、仓储和邮政业 - -

8 其他行业 9,132,391.50 2.94

9 合计 311,086,204.90 100.00

5.3.2 本报告期末按行业分类的港股通股票投资组合

5.3.3 本报告期末按行业分类的境内外币股权投资组合

5.3.4 本报告期末按行业分类的其他投资品种

5.4 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

本基金在报告期内的债券投资组合，详见附录四《基金组合投资情况》。

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十名资产支持证券投资明细

本基金在报告期内的资产支持证券投资组合，详见附录四《基金组合投资情况》。

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贵金属投资明细

本基金在报告期内的贵金属投资组合，详见附录四《基金组合投资情况》。

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十名保险及赔款准备金投资明细

本基金在报告期内的保险及赔款准备金投资组合，详见附录四《基金组合投资情况》。

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十名基金投资明细

本基金在报告期内的基金投资组合，详见附录四《基金组合投资情况》。

5.9 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组合

本基金在报告期内的股票投资组合，详见附录四《基金组合投资情况》。

5.10 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组合

本基金在报告期内的债券投资组合，详见附录四《基金组合投资情况》。

5.11 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组合

本基金在报告期内的资产支持证券投资组合，详见附录四《基金组合投资情况》。

5.12 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贵金属投资组合

本基金在报告期内的贵金属投资组合，详见附录四《基金组合投资情况》。

5.13 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保险及赔款准备金投资组合

本基金在报告期内的保险及赔款准备金投资组合，详见附录四《基金组合投资情况》。

5.14 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基金投资组合

本基金在报告期内的基金投资组合，详见附录四《基金组合投资情况》。

5.15 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组合

本基金在报告期内的股票投资组合，详见附录四《基金组合投资情况》。

5.16 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组合

本基金在报告期内的债券投资组合，详见附录四《基金组合投资情况》。

5.17 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组合

本基金在报告期内的资产支持证券投资组合，详见附录四《基金组合投资情况》。

5.18 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贵金属投资组合

本基金在报告期内的贵金属投资组合，详见附录四《基金组合投资情况》。

5.19 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保险及赔款准备金投资组合

本基金在报告期内的保险及赔款准备金投资组合，详见附录四《基金组合投资情况》。

5.20 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基金投资组合

本基金在报告期内的基金投资组合，详见附录四《基金组合投资情况》。

5.21 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组合

本基金在报告期内的股票投资组合，详见附录四《基金组合投资情况》。

5.22 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组合

本基金在报告期内的债券投资组合，详见附录四《基金组合投资情况》。

5.23 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组合

本基金在报告期内的资产支持证券投资组合，详见附录四《基金组合投资情况》。

5.24 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贵金属投资组合

本基金在报告期内的贵金属投资组合，详见附录四《基金组合投资情况》。

5.25 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保险及赔款准备金投资组合

本基金在报告期内的保险及赔款准备金投资组合，详见附录四《基金组合投资情况》。

5.26 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基金投资组合

本基金在报告期内的基金投资组合，详见附录四《基金组合投资情况》。