# 交银施罗德科技创新灵活配置混合型证券投资基金

## 2017 第四季度 报告

2017年12月31日

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:二〇一八年一月二十二日

§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2018年1月19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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 交银科技创新灵活配置混合 |
| 基金主代码 | 519767 |
| 交易代码 | 519767 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2016年5月5日 |
| 报告期末基金份额总额 | 85,843,210.37份 |
| 投资目标 | 本基金重点关注以科技为创新驱动力、在产业竞争中掌握核心竞争优势的优质上市公司,在控制风险并保持基金资产良好的流动性的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金将综合考虑国家经济政策、经济周期、各行业的相对估值水平和行业竞争格局等因素,进行大类资产在各行业间的配置。本基金聚焦于具有科技创新优势的行业和企业,深度挖掘依附于科技创新背后的新商业模式,重点关注以科技为创新驱动力、在产业竞争中掌握核心竞争优势的优质上市公司,致力于占领科技创新进程中的制高点。其中,本基金股票投资重点关注直接受益于科技创新红利、或在新科技、新技术推动下盈利水平长期显著提升的其他上市公司。 |
| 业绩比较基准 | 60%×沪深300指数+40%×中证综合债券指数 |
| 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(2017年10月1日-2017年12月31日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -6,508,219.90 |
| 2.本期利润 | -3,332,194.26 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0363 |
| 4.期末基金资产净值 | 79,762,769.99 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.929 |

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。

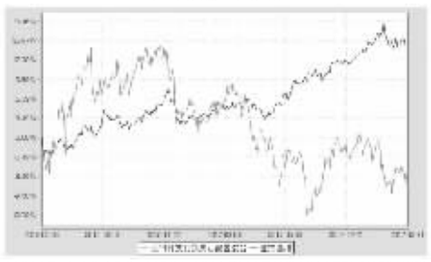
3.2 基金净值表现

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 | -3.93% | 0.99% | 2.86% | 0.49% | -6.79% | 0.50% |

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

交银施罗德科技创新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
(2016年5月5日至2017年12月31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 | | |
| 芮晨 | 交银先锋混合、交银科技创新灵活配置混合、交银数据产业灵活配置混合的基金经理 | 2016-05-05 | - | 10年 | 芮晨先生,内蒙古科技大学工学士,历任深圳尚诚资产管理有限公司研究员、研究副总监,国联安基金管理有限公司行业研究员、投资经理,浙商证券资产管理有限公司投资主办。2015年加入交银施罗德基金管理有限公司。 |

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年四季度,市场延续了前三季度的表现,低估值的股票表现较好,板块之间、板块的个股之间收益率分化明显。本基金仍然坚持新兴成长股的持股结构,目前来看仍需一定时间将成长性反映在股价上。

展望2018年,我们预计风格切换趋难发生,更多是个股间性价比的比较,看成长性和估值的匹配度。本基金过去一直致力选择成长性的股票,从结果来看,所选择的大多数公司还是表现出较高的成长性,但是由于选择买入时估值略高,在当前普遍估值较低的市场环境下表现不如价值投资股,虽然我们所选择的部分公司股价有所下行,但是这些公司的业绩数据相当靓丽,现在这些具备真正成长性个股的估值已经和价值股站在同一起跑线,未来如能继续表现出较高的成长性,就会有突显的性价比,值得继续关注。

4.5报告期内基金的业绩表现

截至2017年12月31日,本基金份额净值为0.929元,本报告期份额净值增长率为-3.93%,业绩比较基准增长率为2.86%。

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 | 69,465,854.08 | 86.45 |
| | 其中:股票 | 69,465,854.08 | 86.45 |
| 2 | 固定收益投资 | 4,124,100.00 | 5.13 |
| | 其中:债券 | 4,124,100.00 | 5.13 |
| | 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 | 6,504,828.31 | 8.10 |
| 7 | 其他资产 | 254,436.62 | 0.32 |
| 8 | 合计 | 80,349,219.01 | 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 | 39,867,258.79 | 49.98 |
| 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 | 8,573,742.62 | 10.75 |
| 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 | 13,450,884.75 | 16.86 |
| J | 金融业 | 1,556,640.00 | 1.95 |
| 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 | 6,017,327.92 | 7.54 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 69,465,854.08 | 87.09 |

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 | 233,268 | 7,382,932.20 | 9.26 |
| 2 | 300271 | 华宇软件 | 405,500 | 6,033,840.00 | 7.56 |
| 3 | 300347 | 泰格医药 | 171,044 | 6,017,327.92 | 7.54 |
| 4 | 600693 | 东百集团 | 480,087 | 4,925,692.62 | 6.18 |
| 5 | 002599 | 盛通股份 | 388,220 | 4,584,878.20 | 5.75 |
| 6 | 300447 | 全信股份 | 218,964 | 4,123,092.12 | 5.17 |
| 7 | 300130 | 新国都 | 160,521 | 3,830,031.06 | 4.80 |
| 8 | 603108 | 润达医疗 | 297,800 | 3,648,050.00 | 4.57 |
| 9 | 300279 | 和晶科技 | 284,950 | 3,601,768.00 | 4.52 |
| 10 | 002440 | 闰土股份 | 170,400 | 3,355,176.00 | 4.21 |

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 | 3,991,200.00 | 5.00 |
| | 其中:政策性金融债 | 3,991,200.00 | 5.00 |
| 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) | 132,900.00 | 0.17 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 4,124,100.00 | 5.17 |

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 | 108601 | 国开1703 | 40,000 | 3,991,200.00 | 5.00 |
| 2 | 128029 | 太阳转债 | 1,329 | 132,900.00 | 0.17 |

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 | 26,760.06 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 98,684.30 |
| 5 | 应收申购款 | 128,992.26 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 254,436.62 |

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 | 101,029,398.96 |
| 本报告期期间基金总申购份额 | 3,678,302.74 |
| 减:本报告期期间基金总赎回份额 | 18,864,491.33 |
| 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 | 85,843,210.37 |

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

§8备查文件目录

8.1备查文件目录

1.中国证监会准予交银施罗德科技创新灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件;
2.《交银施罗德科技创新灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;
3.《交银施罗德科技创新灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》;
4.《交银施罗德科技创新灵活配置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科技创新灵活配置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科技创新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@jyfd.com。

# 交银施罗德蓝筹混合型证券投资基金

## 2017 第四季度 报告

2017年12月31日

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:二〇一八年一月二十二日

§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2018年1月19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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

| | | |
|---|---|---|
| 基金简称 | 交银蓝筹混合 | |
| 基金主代码 | 519694 | |
| 交易代码 | 519694(前端) | 519695(后端) |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2007年8月8日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 2,556,147,225.23份 | |
| 投资目标 | 本基金为一只蓝筹混合型基金,主要通过投资于业绩优良、发展稳定、在行业内占有支配性地位、分红稳定的蓝筹上市公司股票,在有效控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下,追求在稳定分红的基础上实现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,将严谨、规范化的选股方法与积极主动的投资风格相结合,通过优选业绩优良、发展稳定、在行业内占有支配性地位、分红稳定的蓝筹上市公司股票进行投资,以谋求基金资产的长期稳定增长。 | |
| 业绩比较基准 | 75%×中证100指数+25%×中证综合债券指数 | |
| 风险收益特征 | 本基金是一只混合型基金,以优质蓝筹股为主要投资对象,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(2017年10月1日-2017年12月31日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 93,609,128.88 |
| 2.本期利润 | 18,490,161.52 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0071 |
| 4.期末基金资产净值 | 2,487,033,549.83 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.9730 |

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

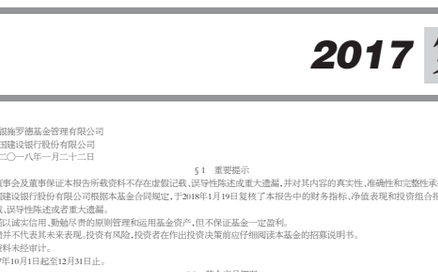
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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 | 0.75% | 0.68% | 6.06% | 0.68% | -5.31% | 0.00% |

注:本基金业绩比较基准自2015年10月1日起,由“75%×中证100指数+25%×中信全债指数”变更为“75%×中证100指数+25%×中证综合债券指数”,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

交银施罗德蓝筹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
(2007年8月8日至2017年12月31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 | | |
| 陈孜铎 | 交银蓝筹混合的基金经理,公司研究部助理总经理 | 2014-10-22 | - | 9年 | 陈孜铎先生,清华大学材料科学与工程硕士,2008年加入交银施罗德基金管理有限公司,历任行业分析师、高级研究员。 |

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年四季度整个A股市场呈现震荡调整走势,风格分化依然明显,白马消费价值成长龙头延续前述趋势继续向上,而市场大多数股票再次进入调整阶段。进入四季度随着十九大召开完毕,金融去杠杆进程进入下半场,金融体系资金价格水平明显提高,风险偏好下降。

在上述市场环境中,本基金在四季度相对稳健均衡,风格偏离度有所控制,整体录得小幅正收益。

展望2018年,十九大召开之后未来五年的发展方向得以奠定,中长期的市场发展方向将逐渐清晰,金融去杠杆进程进入下半场,短期内利率的上涨显对市场有一定不利影响,但整体政治周期开启后市场逐步回归正常化,经济复苏的结构性转变螺旋向上,本基金会密切关注十九大之后中期方向性的指引以及产业的变化,为后续中长期投资奠定较好的基础。在上述的基本判断下,我们对中期市场更为乐观,配置上将更加稳健均衡,计划依然以增速与估值相对匹配、资产价值相对坚实的子行业与标的作为基础资产,在此基础上积极寻找向上的机会,在新兴产业、消费升级、价值股、优质成长股领域做一定布局。

4.5报告期内基金的业绩表现

截至2017年12月31日,本基金份额净值为0.9730元,本报告期份额净值增长率为0.78%,同期业绩比较基准增长率为6.06%。

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 | 1,995,422,921.72 | 79.43 |
| | 其中:股票 | 1,995,422,921.72 | 79.43 |
| 2 | 固定收益投资 | 124,212,300.00 | 4.94 |
| | 其中:债券 | 124,212,300.00 | 4.94 |
| | 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 | 255,502,003.25 | 10.17 |
| | 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 | 129,534,510.41 | 5.16 |
| 7 | 其他资产 | 7,586,391.37 | 0.30 |
| 8 | 合计 | 2,512,258,126.75 | 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 | 35,849,044.00 | 1.44 |
| B | 采矿业 | 41,071,000.00 | 1.65 |
| C | 制造业 | 1,107,563,496.43 | 44.53 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 16,143.20 | 0.00 |
| E | 建筑业 | 144,387,573.38 | 5.81 |
| F | 批发和零售业 | 193,326,948.00 | 7.77 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 17,942.76 | 0.00 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 47,030,748.67 | 1.89 |
| J | 金融业 | 290,892,208.00 | 11.70 |
| K | 房地产业 | 106,125,000.00 | 4.27 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 28,682,196.40 | 1.15 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 32,323.20 | 0.00 |
| 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 | 428,297.68 | 0.02 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 1,995,422,921.72 | 80.23 |

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 | 002180 | 纳思达 | 7,300,000 | 199,363,000.00 | 8.02 |
| 2 | 300129 | 泰胜风能 | 16,813,190 | 135,346,179.50 | 5.44 |
| 3 | 300413 | 快乐购 | 4,207,638 | 125,597,994.30 | 5.05 |
| 4 | 601398 | 工商银行 | 20,000,000 | 124,000,000.00 | 4.99 |
| 5 | 600048 | 保利地产 | 7,500,000 | 106,125,000.00 | 4.27 |
| 6 | 601288 | 农业银行 | 27,000,000 | 103,410,000.00 | 4.16 |
| 7 | 002304 | 洋河股份 | 850,570 | 97,815,550.00 | 3.93 |
| 8 | 000858 | 五粮液 | 1,200,000 | 95,856,000.00 | 3.85 |
| 9 | 000538 | 云南白药 | 900,963 | 91,709,023.77 | 3.69 |
| 10 | 002001 | 新和成 | 2,100,000 | 79,926,000.00 | 3.21 |

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 | 119,886,000.00 | 4.82 |
| | 其中:政策性金融债 | 119,886,000.00 | 4.82 |
| 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) | 4,326,300.00 | 0.17 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 124,212,300.00 | 4.99 |

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 | 170203 | 17国开03 | 1,000,000 | 99,930,000.00 | 4.02 |
| 2 | 108601 | 国开1703 | 200,000 | 19,956,000.00 | 0.80 |
| 3 | 123004 | 铁汉转债 | 43,263 | 4,326,300.00 | 0.17 |

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 | 892,125.56 |
| 2 | 应收证券清算款 | 2,342,214.79 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 3,679,484.12 |
| 5 | 应收申购款 | 672,566.90 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 7,586,391.37 |

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 | 2,689,383,175.16 |
| 本报告期期间基金总申购份额 | 49,546,879.34 |
| 减:本报告期期间基金总赎回份额 | 182,782,829.27 |
| 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 | 2,556,147,225.23 |

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蓝筹股票证券投资基金募集的文件;
2.《交银施罗德蓝筹混合型证券投资基金基金合同》;
3.《交银施罗德蓝筹混合型证券投资基金招募说明书》;
4.《交银施罗德蓝筹混合型证券投资基金托管协议》;
5.关于募集交银施罗德蓝筹股票证券投资基金之法律意见书;
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蓝筹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@jyfd.com。

# 交银施罗德理财21天债券型证券投资基金

## 2017 第四季度 报告

2017年12月31日

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:二〇一八年一月三十二日

§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2018年1月19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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 交银理财21天债券 |
| 基金主代码 | 519716 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2012年11月5日 |
| 报告期末基金份额总额 | 8,657,802,713.85份 |
| 投资目标 | 本基金在追求本金安全、保持资产流动性的基础上,努力追求绝对收益,为基金份额持有人谋求资产的稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金在保持组合流动性的前提下,结合对国内外宏观经济运行、金融市场运行、资金流动格局、货币市场收益率曲线形态等各方面的分析,合理安排组合期限结构,积极选择投资工具,采取主动性的投资策略和精细化的操作手法。 |
| 业绩比较基准 | 七天通知存款税后利率 |
| 风险收益特征 | 本基金属于债券型证券投资基金,长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场型证券投资基金。 |
| 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 |
| 下属两级基金的基金简称 | 交银理财21天债券A / 交银理财21天债券B |
| 下属两级基金的交易代码 | 519716 / 519717 |
| 报告期末下属两级基金的份额总额 | 10,350,329.85份 / 8,647,452,384.00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(2017年10月1日-2017年12月31日) | |
|---|---|---|
| | 交银理财21天债券A | 交银理财21天债券B |
| 1.本期已实现收益 | 117,620.31 | 60,961,212.64 |
| 2.本期利润 | 117,620.31 | 60,961,212.64 |
| 3.期末基金资产净值 | 10,350,329.85 | 8,647,452,384.00 |

注:1、自2013年1月9日起,本基金实行销售服务费分类收费方式,分设两类基金份额:A类基金份额和B类基金份额。A类基金份额与B类基金份额的管理费、托管费相同,A类基金份额按照0.30%的年费率计提销售服务费,B类基金份额按照0.01%的年费率计提销售服务费。在计算主要财务指标时,A类基金份额与分类前基金连续计算,B类基金份额按新设基金计算;
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,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1. 交银理财21天债券A:

| 阶段 | 净值收益率① | 净值收益率标准差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 | 1.0729% | 0.0008% | 0.3403% | 0.0000% | 0.7326% | 0.0008% |

注:1.本表净值