

交银施罗德策略回报灵活配置混合型证券投资基金

基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年三月二十七日

1.1 重要提示
基金管理人的董事会、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法律责任。
基金托管人中信银行股份有限公司(以下简称“中信银行”)根据基金合同规定,于2019年3月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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,也不保证基金份额持有人本金不受损失,不承担保本义务。
基金的投资价值并不体现其未来表现,投资者须自行承担投资风险。投资者在作出投资决策前请仔细阅读基金的投资说明书及基金合同。
本年度报告摘要源自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。
本报告自2019年1月1日起至12月31日止。

Table with 2 columns: Section (基金基本情况), Content (基金名称:交银施罗德策略回报灵活配置混合基金,基金代码:519170,基金简称:策略回报,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,基金合同生效日期:2015年4月27日,基金管理人网址:www.fund001.com,基金管理人客服电话:400-700-5000,基金管理人网址:www.fund001.com)

Table with 2 columns: Section (基金管理人及基金托管人), Content (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,基金管理人地址:上海市浦东新区银城中路200号,基金托管人地址:广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座11层,基金管理人法定代表人:陈其华,基金托管人法定代表人:李爱贞)

Table with 2 columns: Section (主要会计数据和财务指标), Content (主要会计数据和财务指标,单位:人民币元,报告期:2018年,2017年,2016年,本期利润总额:37,811,625.48,本期净利润:19,378,232.36)

Table with 2 columns: Section (3.1 期间损益和净值), Content (期间损益和净值,单位:人民币元,报告期:2018年,2017年,2016年,本期利润总额:37,811,625.48,本期净利润:19,378,232.36)

Table with 2 columns: Section (3.2 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), Content (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,单位:人民币元,报告期:2018年,2017年,2016年,基金份额净值增长率:11.46%,业绩比较基准收益率:10.22%)

Table with 2 columns: Section (3.3 基金份额持有人户数及持有人数量), Content (基金份额持有人户数及持有人数量,单位:人民币元,报告期:2018年,2017年,2016年,基金份额持有人户数:1,043,712,基金份额持有人数量:1,043,712)

Table with 2 columns: Section (3.4 基金份额持有人户数及持有人数量), Content (基金份额持有人户数及持有人数量,单位:人民币元,报告期:2018年,2017年,2016年,基金份额持有人户数:1,043,712,基金份额持有人数量:1,043,712)

Table with 2 columns: Section (3.5 基金份额持有人户数及持有人数量), Content (基金份额持有人户数及持有人数量,单位:人民币元,报告期:2018年,2017年,2016年,基金份额持有人户数:1,043,712,基金份额持有人数量:1,043,712)

Table with 2 columns: Section (3.6 基金份额持有人户数及持有人数量), Content (基金份额持有人户数及持有人数量,单位:人民币元,报告期:2018年,2017年,2016年,基金份额持有人户数:1,043,712,基金份额持有人数量:1,043,712)

Table with 2 columns: Section (3.7 基金份额持有人户数及持有人数量), Content (基金份额持有人户数及持有人数量,单位:人民币元,报告期:2018年,2017年,2016年,基金份额持有人户数:1,043,712,基金份额持有人数量:1,043,712)

Table with 2 columns: Section (3.8 基金份额持有人户数及持有人数量), Content (基金份额持有人户数及持有人数量,单位:人民币元,报告期:2018年,2017年,2016年,基金份额持有人户数:1,043,712,基金份额持有人数量:1,043,712)

Table with 2 columns: Section (3.9 基金份额持有人户数及持有人数量), Content (基金份额持有人户数及持有人数量,单位:人民币元,报告期:2018年,2017年,2016年,基金份额持有人户数:1,043,712,基金份额持有人数量:1,043,712)

Table with 2 columns: Section (3.10 基金份额持有人户数及持有人数量), Content (基金份额持有人户数及持有人数量,单位:人民币元,报告期:2018年,2017年,2016年,基金份额持有人户数:1,043,712,基金份额持有人数量:1,043,712)

Table with 2 columns: Section (3.11 基金份额持有人户数及持有人数量), Content (基金份额持有人户数及持有人数量,单位:人民币元,报告期:2018年,2017年,2016年,基金份额持有人户数:1,043,712,基金份额持有人数量:1,043,712)

Table with 2 columns: Section (3.12 基金份额持有人户数及持有人数量), Content (基金份额持有人户数及持有人数量,单位:人民币元,报告期:2018年,2017年,2016年,基金份额持有人户数:1,043,712,基金份额持有人数量:1,043,712)

Table with 2 columns: Section (3.13 基金份额持有人户数及持有人数量), Content (基金份额持有人户数及持有人数量,单位:人民币元,报告期:2018年,2017年,2016年,基金份额持有人户数:1,043,712,基金份额持有人数量:1,043,712)

Table with 2 columns: Section (3.14 基金份额持有人户数及持有人数量), Content (基金份额持有人户数及持有人数量,单位:人民币元,报告期:2018年,2017年,2016年,基金份额持有人户数:1,043,712,基金份额持有人数量:1,043,712)

Table with 2 columns: Section (3.15 基金份额持有人户数及持有人数量), Content (基金份额持有人户数及持有人数量,单位:人民币元,报告期:2018年,2017年,2016年,基金份额持有人户数:1,043,712,基金份额持有人数量:1,043,712)

Table with 2 columns: Section (3.16 基金份额持有人户数及持有人数量), Content (基金份额持有人户数及持有人数量,单位:人民币元,报告期:2018年,2017年,2016年,基金份额持有人户数:1,043,712,基金份额持有人数量:1,043,712)

Table with 2 columns: Section (3.17 基金份额持有人户数及持有人数量), Content (基金份额持有人户数及持有人数量,单位:人民币元,报告期:2018年,2017年,2016年,基金份额持有人户数:1,043,712,基金份额持有人数量:1,043,712)

Table with 2 columns: Section (3.18 基金份额持有人户数及持有人数量), Content (基金份额持有人户数及持有人数量,单位:人民币元,报告期:2018年,2017年,2016年,基金份额持有人户数:1,043,712,基金份额持有人数量:1,043,712)

Table with 2 columns: Section (3.19 基金份额持有人户数及持有人数量), Content (基金份额持有人户数及持有人数量,单位:人民币元,报告期:2018年,2017年,2016年,基金份额持有人户数:1,043,712,基金份额持有人数量:1,043,712)

Table with 2 columns: Section (3.20 基金份额持有人户数及持有人数量), Content (基金份额持有人户数及持有人数量,单位:人民币元,报告期:2018年,2017年,2016年,基金份额持有人户数:1,043,712,基金份额持有人数量:1,043,712)

Table with 2 columns: Section (3.21 基金份额持有人户数及持有人数量), Content (基金份额持有人户数及持有人数量,单位:人民币元,报告期:2018年,2017年,2016年,基金份额持有人户数:1,043,712,基金份额持有人数量:1,043,712)

Table with 2 columns: Section (3.22 基金份额持有人户数及持有人数量), Content (基金份额持有人户数及持有人数量,单位:人民币元,报告期:2018年,2017年,2016年,基金份额持有人户数:1,043,712,基金份额持有人数量:1,043,712)

Table with 2 columns: Section (3.23 基金份额持有人户数及持有人数量), Content (基金份额持有人户数及持有人数量,单位:人民币元,报告期:2018年,2017年,2016年,基金份额持有人户数:1,043,712,基金份额持有人数量:1,043,712)

Table with 2 columns: Section (3.24 基金份额持有人户数及持有人数量), Content (基金份额持有人户数及持有人数量,单位:人民币元,报告期:2018年,2017年,2016年,基金份额持有人户数:1,043,712,基金份额持有人数量:1,043,712)

2018 年度 报告摘要

2018年12月31日

7.4.5.2 会计估计变更的说明
本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明
本基金本报告期无差错更正。

7.4.5.4 其他重要事项
本基金本报告期无其他重要事项。

7.4.5.5 其他重要事项
本基金本报告期无其他重要事项。

7.4.5.6 其他重要事项
本基金本报告期无其他重要事项。

7.4.5.7 其他重要事项
本基金本报告期无其他重要事项。

7.4.5.8 其他重要事项
本基金本报告期无其他重要事项。

7.4.5.9 其他重要事项
本基金本报告期无其他重要事项。

7.4.5.10 其他重要事项
本基金本报告期无其他重要事项。

7.4.5.11 其他重要事项
本基金本报告期无其他重要事项。

7.4.5.12 其他重要事项
本基金本报告期无其他重要事项。

7.4.5.13 其他重要事项
本基金本报告期无其他重要事项。

7.4.5.14 其他重要事项
本基金本报告期无其他重要事项。

7.4.5.15 其他重要事项
本基金本报告期无其他重要事项。

7.4.5.16 其他重要事项
本基金本报告期无其他重要事项。

7.4.5.17 其他重要事项
本基金本报告期无其他重要事项。

7.4.5.18 其他重要事项
本基金本报告期无其他重要事项。

7.4.5.19 其他重要事项
本基金本报告期无其他重要事项。

7.4.5.20 其他重要事项
本基金本报告期无其他重要事项。

7.4.5.21 其他重要事项
本基金本报告期无其他重要事项。

7.4.5.22 其他重要事项
本基金本报告期无其他重要事项。

7.4.5.23 其他重要事项
本基金本报告期无其他重要事项。

7.4.5.24 其他重要事项
本基金本报告期无其他重要事项。

7.4.5.25 其他重要事项
本基金本报告期无其他重要事项。

7.4.5.26 其他重要事项
本基金本报告期无其他重要事项。

7.4.5.27 其他重要事项
本基金本报告期无其他重要事项。

7.4.5.28 其他重要事项
本基金本报告期无其他重要事项。

7.4.5.29 其他重要事项
本基金本报告期无其他重要事项。

7.4.5.30 其他重要事项
本基金本报告期无其他重要事项。

7.4.5.31 其他重要事项
本基金本报告期无其他重要事项。

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例(%), 16, 600559, 白云山, 32,849,985.92, 4.33

注:“本期累计买入金额”按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。
8.4.2买入股票市值占期末基金资产净值2%或20%的股票明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计卖出金额, 占期末基金资产净值比例(%), 1, 600887, 伊泰煤炭, 101,284,512.25, 13.38

注:“本期累计卖出金额”按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。
8.4.3买入股票的成本占期末基金资产净值比例

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例(%), 1, 600887, 伊泰煤炭, 101,284,512.25, 13.38

注:“本期累计买入金额”按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。
8.4.3.1买入股票的成本占期末基金资产净值比例

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例(%), 1, 600887, 伊泰煤炭, 101,284,512.25, 13.38

注:“本期累计买入金额”按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。
8.4.3.2买入股票的成本占期末基金资产净值比例

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例(%), 1, 600887, 伊泰煤炭, 101,284,512.25, 13.38

注:“本期累计买入金额”按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。
8.4.3.3买入股票的成本占期末基金资产净值比例

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例(%), 1, 600887, 伊泰煤炭, 101,284,512.25, 13.38

注:“本期累计买入金额”按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。
8.4.3.4买入股票的成本占期末基金资产净值比例

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例(%), 1, 600887, 伊泰煤炭, 101,284,512.25, 13.38

注:“本期累计买入金额”按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。
8.4.3.5买入股票的成本占期末基金资产净值比例

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例(%), 1, 600887, 伊泰煤炭, 101,284,512.25, 13.38

注:“本期累计买入金额”按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。
8.4.3.6买入股票的成本占期末基金资产净值比例

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例(%), 1, 600887, 伊泰煤炭, 101,284,512.25, 13.38

注:“本期累计买入金额”按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。
8.4.3.7买入股票的成本占期末基金资产净值比例

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例(%), 1, 600887, 伊泰煤炭, 101,284,512.25, 13.38

注:“本期累计买入金额”按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。
8.4.3.8买入股票的成本占期末基金资产净值比例

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例(%), 1, 600887, 伊泰煤炭, 101,284,512.25, 13.38

注:“本期累计买入金额”按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。
8.4.3.9买入股票的成本占期末基金资产净值比例

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例(%), 1, 600887, 伊泰煤炭, 101,284,512.25, 13.38

注:“本期累计买入金额”按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。
8.4.3.10买入股票的成本占期末基金资产净值比例

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例(%), 1, 600887, 伊泰煤炭, 101,284,512.25, 13.38

注:“本期累计买入金额”按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。
8.4.3.11买入股票的成本占期末基金资产净值比例

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例(%), 1, 600887, 伊泰煤炭, 101,284,512.25, 13.38

注:“本期累计买入金额”按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。
8.4.3.12买入股票的成本占期末基金资产净值比例

注:“本期累计买入金额”按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。
8.4.3.13买入股票的成本占期末基金资产净值比例