交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

2019 半年度 报告摘要

2019年6月30日

基金管理人：交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人：中信银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一九年八月二十九日

1 重要提示

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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年8月28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。

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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至6月30日止。

2 基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	交银新回报灵活配置混合	
基金主代码	519752	
交易代码	519752	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年5月15日	
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	362,458,634.11份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	交银新回报灵活配置混合A	交银新回报灵活配置混合C
下属分级基金的交易代码	519752	519760
报告期末下属分级基金的份额总额	349,476,159.54份	12,982,474.57份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金结合基金管理人对宏观经济周期和金融市场运行趋势的判断，自上而下进行宏观分析，自下而上精选投资标的，通过灵活的资产配置策略和积极主动的投资管理，在控制下行风险的前提下，力争为投资者提供长期稳健的投资回报。
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，自上而下灵活调整基金大类资产配置比例和股票行业配置比例，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，自下而上精选股票和债券。
业绩比较基准	50%×沪深300指数收益率+50%×中债综合全价指数收益率
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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		交银施罗德基金管理有限公司	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王晚婷	李修滨
	联系电话	（021）61055050	4006800000
	电子邮箱	xxpl@jysld.com,disclosure@jysld.com	lixiubin@citicbank.com
客户服务电话		400-700-5000,021-61055000	95558
传真		（021）61055054	010-85230024

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.fund001.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人的办公场所

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1期间数据和指标	报告期（2019年1月1日至2019年6月30日）	
	交银新回报灵活配置混合A	交银新回报灵活配置混合C
本期已实现收益	13,949,796.07	1,037,907.12
本期利润	15,862,329.78	1,456,295.58
加权平均基金份额本期利润	0.0386	0.1464
本期基金份额净值增长率	3.57%	3.65%
3.1.2期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
	交银新回报灵活配置混合A	交银新回报灵活配置混合C
期末可供分配基金份额利润	0.180	3.115
期末基金资产净值	415,988,121.24	53,426,533.94
期末基金份额净值	1.190	4.115

注：1、上述基金A类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 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

交银新回报灵活配置混合A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	1.54%	0.16%	2.84%	0.57%	-1.30%	-0.41%
过去三个月	1.62%	0.11%	-0.54%	0.75%	2.16%	-0.64%
过去六个月	3.57%	0.10%	13.28%	0.77%	-9.71%	-0.67%
过去一年	3.75%	0.15%	6.62%	0.76%	-2.87%	-0.61%
过去三年	16.86%	0.17%	11.43%	0.55%	5.43%	-0.38%
自基金合同生效起至今	21.30%	0.15%	-5.74%	0.79%	27.04%	-0.64%

注：本基金的业绩比较基准为50%×沪深300指数收益率+50%×中债综合全价指数收益率，每日进行再平衡过程。

交银新回报灵活配置混合C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	1.50%	0.15%	2.84%	0.57%	-1.34%	-0.42%
过去三个月	1.66%	0.11%	-0.54%	0.75%	2.20%	-0.64%
过去六个月	3.65%	0.10%	13.28%	0.77%	-9.63%	-0.67%
过去一年	3.91%	0.15%	6.62%	0.76%	-2.71%	-0.61%
过去三年	304.61%	9.18%	11.43%	0.55%	293.18%	8.63%
自基金合同生效起至今	311.76%	8.37%	3.15%	0.63%	308.61%	7.74%

注：本基金的业绩比较基准为50%×沪深300指数收益率+50%×中债综合全价指数收益率，每日进行再平衡过程。

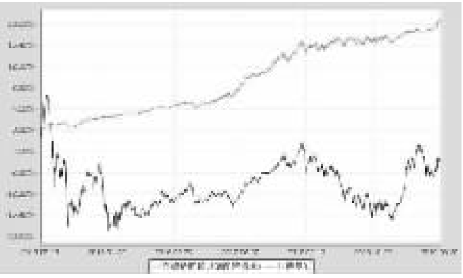
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

交银施罗德新回报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

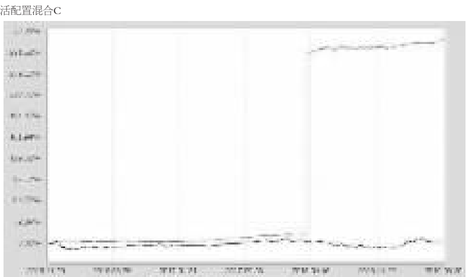
（2015年5月15日至2019年6月30日）

交银新回报灵活配置混合A



注：图示日期为2015年5月15日至2019年6月30日。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。

交银新回报灵活配置混合C



注：本基金自2015年11月19日起，开始销售C类份额，投资者提交的申购申请于2015年11月20日被确认并将有效份额登记在册。图示日期为2015年11月20日至2019年6月30日。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

交银施罗德基金管理有限公司是经中国证监会证监基金字[2005]128号文批准，由交通银行股份有限公司、施罗德投资管理有限公司、中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司共同发起设立。公司成立于2005年8月4日，注册地在中国上海，注册资本金为2亿元人民币。其中，交通银行股份有限公司持有65%的股份，施罗德投资管理有限公司持有30%的股份，中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司持有5%的股份。公司并下设交银施罗德资产管理（香港）有限公司和交银施罗德资产管理有限公司。

截至报告期末，公司管理了包括货币型、债券型、普通混合型和股票型在内的80只基金，其中股票型涵盖普通指数型、交易型开放式（ETF）、QDII等不同类型基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李娜	交银周期回报灵活配置混合、交银新回报灵活配置混合、交银多策略回报灵活配置混合、交银优选回报灵活配置混合、交银优择回报灵活配置混合、交银瑞鑫定期开放灵活配置混合、交银裕祥纯债债券、交银恒益灵活配置混合的基金经理	2015-08-04	-	9年	李娜女士，美国宾夕法尼亚大学应用数学与计算科学硕士。历任国泰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，历任债券分析师、基金经理助理。2017年3月2日至2018年4月10日担任交银施罗德瑞安定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017年2月24日至2018年7月18日担任交银施罗德瑞利定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年3月31日至2018年8月23日担任交银施罗德启通灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年12月21日至2018年11月16日担任交银施罗德瑞景定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年2月17日至2018年12月7日担任交银施罗德卓越回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年9月13日至2019年1月21日担任交银施罗德领先回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
王艺伟	交银信用添利债券(LOF)、交银双利债券、交银双轮动债券、交银定期支付月月丰债券、交银增强收益债券、交银强化回报债券、交银周期回报灵活配置混合、交银新回报灵活配置混合、交银多策略回报灵活配置混合、交银裕通纯债债券、交银荣鑫灵活配置混合、交银优选回报灵活配置混合、交银优择回报灵活配置混合、交银瑞鑫定期开放灵活配置混合、交银恒益灵活配置混合、交银安心收益债券、交银裕祥纯债债券、交银稳固收益债券的的基金经理助理	2019-06-27	-	7年	王艺伟女士，北京大学经济学硕士，吉林大学经济学学士、理学学士。2012年-2014年任光大证券研究所宏观分析师。2014年9月加入交银施罗德基金管理有限公司，历任研究员、研究部助理总经理。

注：1、本表所列基金经理（助理）任职日期和离职日期均以基金合同生效日或公司作出决定并公告（如适用）之日为准。

2、本表所列基金经理（助理）证券从业年限中的“证券从业”的含义遵从中国证券业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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下（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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内，2019年初社融拐点及春节错位令经济环比预期一度过高，后在经济环比自然回落、海外风险以及资金面三个因素的影响下，债市短端收益率基本回到三月底低位，长端呈现上行后震荡走平的格局。五月伴随季末来临，银行间流动性中性分化，短久期债券收益率上行，信用传导预期受阻，信用利差明显走廓。随着跨季资金流动性走宽，短端收益率下行，中高等级信用债收益率也出现回落，但中低等级信用债成交依然不多。

权益市场年初受益于社融向上拐点确立及流动性宽松，普遍上行，小盘股涨幅更为明显。至三月底，多数板块估值相对偏高。在经济增速环比回落，中美贸易争端再度演绎等事件影响下，大盘自四月中下旬震荡下行。行业层面看，部分消费及金融有一定绝对收益，TMT及强周期等板块表现偏弱。

组合操作层面，我们主要以中性久期高等级信用品种作为底仓配置品种。权益方面，二季度组合积极关注新股发行动态，进行权益一级市场投资，同时也关注二级市场的投资机会，五月适当增配盈利较为稳定，估值接近历史底部的权益持仓，以期增厚组合收益。

4.4.2 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主要会计数据和财务指标” 及“3.2.1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。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2019年下半年，从高频数据看，我们认为经济基本面面临下行压力，因此对于债券市场我们维持中性偏乐观的看法，债市收益率的上行风险来自于中美关系进展好于预期，以及货币政策放松幅度不及预期。组合方面，我们计划底仓主要增配中短久期高等级信用品种，长端利率择机做波段操作。权益方面，我们将继续积极关注权益市场一级投资机会，同时密切跟踪个股业绩和行业景气变化，通过行业轮动及个股精选，力求控制组合回撤，努力为投资人取得稳定业绩回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序，经公司管理层批准后实行，并成立了估值委员会，估值委员会成员由研究部、基金运营部、风险管理部等人员和固定收益人员及基金经理组成。

公司严格按照新会计准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定进行估值，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。估值委员会的研究部成员按投资品种的不同性质，研究并参考市场普遍认同的做法，建议合理的估值模型，进行测算和认证，认可后交各估值委员会成员从基金会计、风险、合规等方面审批，一致同意后，报公司投资总监、总经理审批。

估值委员会会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后，及时召开临时会议进行研究，及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值委员会成员均具备相应的专业资格及工作经验。基金经理作为估值委员会成员，对本基金持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感，向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论。本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突，截止报告期末未有与任何外部估值定价服务机构签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内无需预警说明。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金2019年上半年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，交银施罗德基金管理有限公司在交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，交银施罗德基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金2019半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

6半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2019年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,419,024.97	2,375,808.70
结算备付金		1,390,872.94	416,374.12
存出保证金		68,856.12	51,433.34
交易性金融资产	6.4.7.2	484,348,650.36	501,592,357.71
其中：股票投资		81,126,820.36	67,050,157.71
基金投资		-	-
债券投资		403,221,830.00	434,542,200.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	1,700,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	6,164,207.67	8,769,125.11
应收股利		-	-
应收申购款		480,465.65	85,270.39
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		493,872,077.71	514,990,369.37
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		23,200,000.00	16,800,000.00
应付证券清算款		406,207.39	1,700,000.00
应付赎回款		259,647.91	167,423.25
应付管理人报酬		306,322.91	336,478.83
应付托管费		76,580.74	84,119.73
应付销售服务费		4,363.00	1,463.30
应付交易费用	6.4.7.7	57,638.66	54,933.28
应交税费		48,584.95	22,590.67
应付利息		-	15,534.25
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	98,076.97	329,316.39
负债合计		24,457,422.53	19,511,859.70
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	362,458,634.11	419,732,536.88
未分配利润	6.4.7.10	106,956,021.07	75,745,972.79
所有者权益合计		469,414,655.18	495,478,509.67
负债和所有者权益总计		493,872,077.71	514,990,369.37

注：1、报告截止日2019年6月30日，A类基金份额净值1.190元，C类基金份额净值4.115元，基金份额总额362,458,634.11份，其中A类基金份额349,476,159.54份，C类基金份额12,982,474.57份。

2、本摘要中资产负债表和利润表所列附注号为半年度报告正文中对应的附注号，投资者欲了解相应附注的内容，应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

6.2 利润表

会计主体：交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
一、收入		20,713,882.70	17,499,900.49
1.利息收入		9,470,360.88	13,086,589.48
其中：存款利息收入	6.4.7.11	54,540.55	42,696.66
债券利息收入		9,336,477.64	12,901,459.19
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		79,342.69	142,433.63
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		8,817,752.76	16,187,142.06
其中：股票投资收益	6.4.7.12	5,280,722.21	15,604,050.84
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	2,773,788.33	-295,343.57
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	763,242.22	878,434.79
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	2,330,922.17	-11,817,840.27
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	94,846.89	44,009.22
减：二、费用		3,395,257.34	4,079,222.05
1. 管理人报酬		2,066,980.42	2,809,640.73
2. 托管费		516,745.21	702,410.16
3. 销售服务费		19,947.24	1,435.44
4. 交易费用	6.4.7.19	178,193.55	118,510.91
5. 利息支出		472,568.21	210,659.59
其中：卖出回购金融资产支出		472,568.21	210,659.59
6.税金及附加		24,844.65	20,774.34
7. 其他费用	6.4.7.20	115,978.06	215,790.88
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		17,318,625.36	13,420,678.44
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		17,318,625.36	13,420,678.44

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	419,732,536.88	75,745,972.79	495,478,509.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	17,318,625.36	17,318,625.36
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-57,273,902.77	13,891,422.92	-43,382,479.85
其中：1.基金申购款	165,259,284.60	64,310,101.43	229,569,386.03
2.基金赎回款	-222,533,187.37	-50,418,678.51	-272,951,865.88
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	362,458,634.11	106,956,021.07	469,414,655.18
项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	632,895,555.79	79,870,758.91	712,766,314.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	13,420,678.44	13,420,678.44
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-15,961,704.01	6,067,947.86	-9,893,756.15
其中：1.基金申购款	8,587,330.65	12,725,661.75	21,312,992.40
2.基金赎回款	-24,549,034.66	-6,657,713.89	-31,206,748.55
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	616,933,851.78	99,359,385.21	716,293,236.99

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：谢卫，主管会计工作负责人：夏华龙，会计机构负责人：单江

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]678号文《关于准予交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准，由交银施罗德基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币8,746,682,723.65元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第487号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年5月15日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为8,747,076,426.25份基金份额，其中认购资金利息折合393,702.60份基金份额。本基金的基金管理人为交银施罗德基金管理有限公司，基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据《关于交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金增加C类份额并修改基金合同、托管协议的公告》，本基金自2015年11月19日起增加收取销售服务费的C类份额，并对本基金的基金合同、托管协议作相应修改。在本基金增加收取销售服务费的C类份额后，原有的基金份额全部自动划归为本基金A类份额。对投资者申购时收取申购费用，赎回时收取赎回费用，且不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为A类基金份额；对投资者申购时不收取申购费用，但在赎回时收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为C 类基金份额。本基金增加C类基金份额后，将分别设置对应的基金代码并分别计算基金份额净值。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额，但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、中期票据、货币市场工具、权证、资产支持证券、银行存款、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的0%-95%，股票资产按照基金所持有的股票市值以及买入、卖出股指期货合约价值合计(轧差计算)；权证的投资比例不超过基金资产净值的3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的10%；基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%。本基金的业绩比较基准为50%×沪深300指数收益率+50%×中债综合全价指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2019上半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2019年6月30日的财务状况以及2019上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2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。

6.4.5.3差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
交银施罗德基金管理有限公司（“交银施罗德基金公司”）	基金管理人、基金销售机构
中信银行股份有限公司（“中信银行”）	基金托管人、基金销售机构
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,066,980.42	2,809,640.73
其中：支付销售机构的客户维护费	154,387.12	80,052.46

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值0.80%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值×0.80%÷当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	516,745.21	702,410.16

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝前一日基金资产净值×0.20%÷当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	交银新回报灵活配置混合A	交银新回报灵活配置混合C	合计
交银施罗德基金公司	-	7,681.83	7,681.83
合计	-	7,681.83	7,681.83
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	交银新回报灵活配置混合A	交银新回报灵活配置混合C	合计
交银施罗德基金公司	-	79.85	79.85
合计	-	79.85	79.85

注：支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日C类基金份额对应的基金资产净值0.1%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日基金销售服务费＝前一日C类基金份额对应的资产净值×0.1%÷当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本基金本报告期内及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信银行股份有限公司	1,419,024.97	45,245.93	713,843.22	33,193.27

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.9 期末（2019年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.9.1.1受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300788	中信出版	2019-06-27	2019-07-05	新股未上市	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-
601236	红塔证券	2019-06-26	2019-07-05	新股未上市	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-

注：1、基金可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股份，所认购的股份自发行结束之日起12个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，自股份解除限售之日起12个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过其持有该次非公开发行股份数量的50%；采取集中竞价交易方式的，在任意连续90日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的1%；采取大宗交易方式的，在任意连续90日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的2%。此外，本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后6个月内，不得转让所受让的股份。

2、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起12个月内不得转让。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2019年6月30日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额23,200,000.00元，截至2019年7月1日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7 投资组合报告

7.1 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	81,126,820.36	16.43
	其中：股票	81,126,820.36	16.43
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	403,221,830.00	81.64
	其中：债券	403,221,830.00	81.64
	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	2,809,897.91	0.57
8	其他各项资产	6,713,529.44	1.36
9	合计	493,872,077.71	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1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	274,809.05	0.06
C	制造业	33,499,873.55	7.14
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	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	6,698,127.22	1.43
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,355,000.00	0.29
J	金融业	32,033,869.94	6.82
K	房地产业	6,034,204.00	1.29
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	1,207,830.00	0.26
R	文化、体育和娱乐业	23,106.60	0.00
S	综合	-	-
	合计	81,126,820.36	17.28

7.2.2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。

7.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601398	工商银行	2,000,000	11,780,000.00	2.51
2	601601	中国太保	300,000	10,953,000.00	2.33
3	600519	贵州茅台	10,000	9,840,000.00	2.10
4	601288	农业银行	2,000,000	7,200,000.00	1.53
5	600009	上海机场	79,949	6,698,127.22	1.43
6	600887	伊利股份	200,000	6,682,000.00	1.42
7	600048	保利地产	472,900	6,034,204.00	1.29
8	002271	东方雨虹	199,963	4,531,161.58	0.97
9	600104	上汽集团	160,000	4,080,000.00	0.87
10	600690	海尔智家	200,000	3,458,000.00	0.74

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

7.4报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601398	工商银行	11,338,800.00	2.29
2	601601	中国太保	10,400,314.00	2.10
3	601288	农业银行	7,620,000.00	1.54
4	600519	贵州茅台	6,244,346.00	1.26
5	600048	保利地产	4,828,978.00	0.97
6	600009	上海机场	4,487,323.00	0.91
7	600104	上汽集团	3,922,263.00	0.79
8	600887	伊利股份	3,100,575.94	0.63
9	000538	云南白药	3,027,609.28	0.61
10	600690	海尔智家	2,258,386.37	0.46
11	002555	三七互娱	1,003,419.00	0.20
12	600989	宝丰能源	270,838.72	0.05
13	600968	海油发展	157,918.44	0.03
14	601298	青岛港	109,487.50	0.02
15	600928	西安银行	90,684.36	0.02
16	002958	青农商行	70,092.00	0.01
17	603379	三美股份	66,546.36	0.01
18	002955	鸿合科技	58,070.28	0.01
19	300770	新媒股份	45,972.07	0.01
20	300773	拉卡拉	41,600.00	0.01

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。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601398	工商银行	8,118,626.00	1.64
2	600519	贵州茅台	5,875,089.23	1.19
3	601318	中国平安	4,472,529.00	0.90
4	601939	建设银行	3,742,050.00	0.76
5	601088	中国神华	3,531,810.00	0.71
6	600887	伊利股份	3,342,097.73	0.67
7	000001	平安银行	2,998,360.00	0.61
8	601668	中国建筑	2,778,094.00	0.56
9	601766	中国中车	2,727,690.00	0.55
10	600276	恒瑞医药	2,651,614.40	0.54
11	601186	中国铁建	2,258,202.00	0.46
12	600028	中国石化	2,010,600.00	0.41
13	600436	片仔癀	1,627,317.00	0.33
14	601877	正泰电器	1,586,262.75	0.32
15	600690	海尔智家	1,205,450.00	0.24
16	600048	保利地产	1,185,266.00	0.24
17	600009	上海机场	995,768.00	0.20
18	300146	汤臣倍健	985,543.00	0.20
19	601100	恒立液压	889,217.00	0.18
20	002044	美年健康	832,159.80	0.17

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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	59,722,142.15
卖出股票的收入（成交）总额	56,409,129.25

注：“买入股票成本” 或 “卖出股票收入” 均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	28,397,028.00	6.05
	其中：政策性金融债	28,397,028.00	6.05
4	企业债券	191,939,000.00	40.89
5	企业短期融资券	20,058,000.00	4.27
6	中期票据	161,523,000.00	34.41
7	可转债（可交换债）	1,304,802.00	0.28
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	403,221,830.00	85.90

7.6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	108603	国开1804	283,800	28,397,028.00	6.05
2	101800696	18闽投MTN002	200,000	20,484,000.00	4.36
3	143662	18国电02	200,000	20,462,000.00	4.36
3	101800784	18光明MTN001	200,000	20,462,000.00	4.36
5	143647	18电投03	200,000	20,460,000.00	4.36

7.7 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。

7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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。

7.10 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。

7.11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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1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。

7.12.2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。

7.12.3期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	68,856.12
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,164,207.67
5	应收申购款	480,465.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,713,529.44

7.12.4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。

7.12.5 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。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

1、本基金本报告期末未持有处于交换期的可交换债券。

2、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。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
交银新回报灵活配置混合A	12,984	26,915.91	294,201,461.10	84.18%	55,274,698.44	15.82%
交银新回报灵活配置混合C	1,055	12,305.66	10,441,589.44	80.43%	2,540,885.13	19.57%
合计	14,039	25,817.98	304,643,050.54	84.05%	57,815,583.57	15.95%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	交银新回报灵活配置混合A	108,555.93	0.03%
	交银新回报灵活配置混合C	46.69	0.00%
	合计	108,602.62	0.03%

8.3期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	交银新回报灵活配置混合A	0~10
	交银新回报灵活配置混合C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	交银新回报灵活配置混合A	0
	交银新回报灵活配置混合C	0
	合计	0

9开放式基金份额变动

单位：份

项目	交银新回报灵活配置混合A	交银新回报灵活配置混合C
基金合同生效日（2015年5月15日）基金份额总额	8,747,076,426.25	-
本报告期期初基金份额总额	415,041,442.81	4,691,094.07
本报告期基金总申购份额	152,658,535.26	12,600,749.34
减：本报告期基金总赎回份额	218,223,818.53	4,309,368.84
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	349,476,159.54	12,982,474.57

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。

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人的重大人事变动：2019年2月28日本基金管理人发布公告，经公司第五届董事会第五次会议审议通过，选举谢卫先生担任公司总经理。

2、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动：本报告期内，经中信银行股份有限公司董事会会议审议通过，聘任方合英先生为中信银行行长，任职资格于2019年3月29日获中国银行保险监督管理委员批复核准。孙德顺先生因年龄原因不再担任执行董事、行长等职务。根据工作需要，任命杨璋琪先生担任资产托管部副总经理，主持资产托管部相关工作。

10.3涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

10.5本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

10.6为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务。

10.7管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

1、管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金管理人及其高级管理人员本报告期内未受监管部门稽查或处罚。

2、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金托管人及其高级管理人员本报告期内未受监管部门稽查或处罚。

10.8基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国金证券股份有限公司	2	804,407.90	0.70%	749.13	0.70%	-
安信证券股份有限公司	2	60,021,214.73	52.36%	55,897.31	52.36%	-
中信证券股份有限公司	1	48,363,886.13	42.19%	45,041.28	42.19%	-
中泰证券股份有限公司	3	3,364,144.97	2.93%	3,133.01	2.93%	-
国盛证券有限责任公司	1	2,087,490.11	1.82%	1,944.06	1.82%	-
新时代证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

10.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国金证券股份有限公司	28,474,133.60	10.17%	70,000,000.00	4.63%	-	-
安信证券股份有限公司	212,302,075.34	75.84%	412,200,000.00	27.24%	-	-
中信证券股份有限公司	38,331,645.23	13.69%	379,700,000.00	25.09%	-	-
中泰证券股份有限公司	823,594.71	0.29%	256,300,000.00	16.94%	-	-
国盛证券有限责任公司	-	-	395,000,000.00	26.10%	-	-

注：1、报告期内，本基金新增加国盛证券有限责任公司，其它交易单元未发生变化；

2、租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：券商基本面评价（财务状况、经营状况）、券商研究机构（评价报告质量、及时性和数量）、券商每日信息评价（及时性和有效性）和券商协作表现评价等四个方面；

3、租用证券公司交易单元的程序：首先根据租用证券公司交易单元的选择标准进行综合评价，然后根据评价选择基金交易单元。研究部提交方案，并上报公司批准。

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2019/1/1-2019/6/30	200,035,000.00	-	200,035,000.00	-	-
	2	2019/1/1-2019/6/30	144,229,807.69	-	-	144,229,807.69	39.79%
	3	2019/1/1-2019/6/30	-	102,475,661.83	-	102,475,661.83	28.27%
产品特有风险							
本基金本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例超过基金总份额20%的情况。如该类投资者集中赎回，可能会对本基金带来流动性冲击，从而影响基金的投资运作和收益水平。基金管理人将加强流动性管理，防范相关风险，保护持有人利益。							

11.2 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》。