交银施罗德主题优选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：中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设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	交银主题优选混合	
基金主代码	519700	
交易代码	519700(前端)	519701(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2010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	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	455,862,663.54份	
基金合同存续期	不定期	

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金力图通过前瞻性的主题优选，积极把握行业和个股投资机会，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，在分析和判断宏观经济发展趋势、经济周期和市场环境变化趋势的基础上，动态调整投资组合比例，自上而下灵活配置资产；通过优选主题配置和挖掘预期具有良好增长前景的优势行业相结合的方式，精选个股，以谋求超额收益。
业绩比较基准	60%×沪深300指数收益率+40%×中证综合债券指数收益率
风险收益特征	本基金是一只灵活配置的混合型基金，属于基金中的中高风险品种，本基金的风险与预期收益介于股票型基金和债券型基金之间。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王晚婷	田青
	联系电话	（021）61055050	010-67595096
	电子邮箱	xxpl@jysld.com,disclosure@jysld.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-700-5000，021-61055000	010-67595096
传真		（021）61055054	010-66275853

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）
本期已实现收益	85,031,409.32
本期利润	127,818,402.45
加权平均基金份额本期利润	0.2815
本期基金份额净值增长率	28.64%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.253
期末基金资产净值	571,024,467.90
期末基金份额净值	1.253

注：1、本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 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

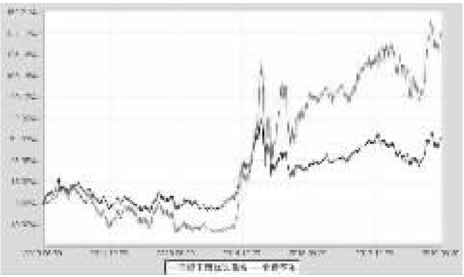
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	3.64%	0.82%	3.45%	0.69%	0.19%	0.13%
过去三个月	0.64%	1.06%	-0.30%	0.91%	0.94%	0.15%
过去六个月	28.64%	1.17%	16.79%	0.92%	11.85%	0.25%
过去一年	12.18%	1.28%	8.53%	0.91%	3.65%	0.37%
过去三年	30.44%	1.01%	18.44%	0.66%	12.00%	0.35%
自基金合同生效至今	143.50%	1.40%	54.25%	0.89%	89.25%	0.51%

注：1、本基金业绩比较基准自2015年10月1日起，由“60%×沪深300指数收益率+40%×中信标普全债指数收益率”变更为“60%×沪深300指数收益率+40%×中证综合债券指数收益率”，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》。

2、本基金的业绩比较基准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

交银施罗德主题优选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
（2010年6月30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		
沈楠	交银主题优选混合、交银国企改革灵活配置混合的基金经理	2015-05-05	-	10年	沈楠先生，复旦大学硕士。历任长江证券高级分析师，2011年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任行业分析师、基金经理助理。

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》、基金合同和其他有关法律法规的规定，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

2019年上半年，受到贸易争端进一步升级的影响，国内经济冷热不均需求趋缓。财政政策持续发力于基建、新能源、汽车家电消费以及旧改等方向。与此同时，伴随个别银行信用风险暴露短期影响同业市场，流动性分层现象显现但整体仍然趋松。我们认为中期来看年初低点大概率是市场底部区域。未来国内需求改善将对冲外需下滑的不确定性。市场仍然处于可为阶段，2019年投资机会预计将多于2018年。

报告期内，本基金在一季度增持了部分食品等消费性企业的投资，在二季度进一步增持了包括消费及成长相关的行业领域，主要集中包括食品、造纸、高端制造、计算机、电子以及军工等。

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，我们认为如果贸易争端在下半年趋于缓和，那么预计将出现更多的投资机会，市场的估值有望进一步抬升。伴随科创板的上市和国内重大资产重组审批的放松，更多优质资产将登陆资本市场，上市企业的分化会加大，拥有较好现金流以及商业壁垒的企业，与外部不利因素相关性低的行业公司仍将得到市场更多的青睐，本基金仍将加大此类个股配置，同时继续关注高端制造、半导体等进口替代升级领域，计算机、通信等技术升级领域以及食品、医药等必须消费品。

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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

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：交银施罗德主题优选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	62,434,723.20	67,402,028.03
结算备付金		2,335,414.87	1,057,705.52
存出保证金		497,048.45	457,152.75
交易性金融资产	6.4.7.2	514,843,573.69	273,915,208.26
其中：股票投资		454,198,358.15	240,348,032.28
基金投资		-	-
债券投资		60,645,215.54	33,567,175.98
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	-	100,000,350.00
应收证券清算款		-	3,880,844.55
应收利息	6.4.7.5	222,641.60	170,370.70
应收股利		-	-
应收申购款		412,488.95	145,313.71
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		580,745,890.76	447,028,973.52
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		-	-
应付证券清算款		6,283,200.63	-
应付赎回款		1,023,042.20	115,588.11
应付管理人报酬		683,035.47	587,055.28
应付托管费		113,839.24	97,842.57
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,518,303.71	948,572.28
应交税费		75.00	2,025.84
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	99,926.61	329,768.20
负债合计		9,721,422.86	2,080,852.28
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	455,862,663.54	456,759,358.17
未分配利润	6.4.7.10	115,161,804.36	-11,811,236.93
所有者权益合计		571,024,467.90	444,948,121.24
负债和所有者权益总计		580,745,890.76	447,028,973.52

注：1、报告截止日2019年6月30日，基金份额净值1.253元，基金份额总额455,862,663.54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：交银施罗德主题优选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		137,002,609.53	10,167,794.02
1.利息收入		849,977.83	871,897.93
其中：存款利息收入	6.4.7.11	633,350.06	381,093.68
债券利息收入		197,298.96	473,842.27
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		19,328.81	16,961.98
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		93,286,962.72	46,346,720.72
其中：股票投资收益	6.4.7.12	90,297,231.75	43,437,095.30
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	360,336.91	945,208.22
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	2,629,394.06	1,964,417.20
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	42,786,993.13	-37,657,511.73
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	78,675.85	606,687.10
减：二、费用		9,184,207.08	9,858,032.47
1. 管理人报酬		3,916,839.03	3,938,713.43
2. 托管费		652,806.48	656,452.22
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	4,497,858.29	5,046,199.77
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		99.49	94.87
7. 其他费用	6.4.7.20	116,603.79	216,572.18
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		127,818,402.45	309,761.55
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		127,818,402.45	309,761.55

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：交银施罗德主题优选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）	456,759,358.17	-11,811,236.93	444,948,121.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	127,818,402.45	127,818,402.45
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）	-896,694.63	-845,361.16	-1,742,055.79
其中：1.基金申购款	79,852,957.36	15,096,315.29	94,949,272.65
2.基金赎回款	-80,749,651.99	-15,941,676.45	-96,691,328.44
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）	455,862,663.54	115,161,804.36	571,024,467.90
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）	743,206,379.30	97,663,654.50	840,870,033.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	309,761.55	309,761.55
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）	-258,312,569.44	-41,331,784.60	-299,644,354.04
其中：1.基金申购款	179,256,476.20	30,058,963.51	209,315,439.71
2.基金赎回款	-437,569,045.64	-71,390,748.11	-508,959,793.75
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）	484,893,809.86	56,641,631.45	541,535,441.31

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

交银施罗德主题优选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[2010]第624号《关于核准交银施罗德主题优选灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》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《交银施罗德主题优选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3,234,778,164.71元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2010)第166号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《交银施罗德主题优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2010年6月30日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为3,235,642,950.36份基金份额，其中认购资金利息折合864,785.65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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德主题优选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、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券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。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为30%-80%，债券、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的20%-70%，其中基金保留的现金以及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，存出保证金及应收申购款等。自基金合同生效日至2015年9月30日，本基金的业绩比较基准为：60%×沪深300指数收益率+40%×中信标普全债指数收益率。根据本基金的基金管理人于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》，自2015年10月1日起，本基金的业绩比较基准变更为：60%×沪深300指数收益率+40%×中证综合债券指数收益率。

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》、《交银施罗德主题优选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
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	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	3,916,839.03	3,938,713.43
其中：支付销售机构的客户维护费	1,042,141.24	983,402.40

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%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×1.5%÷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	652,806.48	656,452.22

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.25%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×0.25%÷当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费

无。

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
中国建设银行股份有限公司	62,434,723.20	610,474.54	77,805,926.53	353,478.67

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
002044	美年健康	2019-05-22	2019-11-22	限售股	13.51	11.79	400,000	5,404,000.00	4,716,000.00	-
300661	圣邦股份	2019-05-14	2019-11-14	限售股	84.30	95.18	71,174	5,999,968.20	6,774,341.32	-
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

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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	454,198,358.15	78.21
	其中：股票	454,198,358.15	78.21
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	60,645,215.54	10.44
	其中：债券	60,645,215.54	10.44
	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	64,770,138.07	11.15
8	其他各项资产	1,132,179.00	0.19
9	合计	580,745,890.76	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	10,396,782.22	1.82
B	采矿业	6,287,660.95	1.10
C	制造业	280,470,986.66	49.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,868,000.00	0.50
E	建筑业	6,898,335.00	1.21
F	批发和零售业	12,398,461.00	2.17
G	交通运输、仓储和邮政业	9,341,052.44	1.64
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	55,152,873.55	9.66
J	金融业	26,563,869.94	4.65
K	房地产业	8,522,000.00	1.49
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	7,888,320.00	1.38
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	8,085,473.43	1.42
Q	卫生和社会工作	4,933,936.36	0.86
R	文化、体育和娱乐业	14,390,606.60	2.52
S	综合	-	-
	合计	454,198,358.15	79.54

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	002216	三全食品	2,268,900	23,188,158.00	4.06
2	600967	内蒙一机	1,844,586	20,659,363.20	3.62
3	002511	中顺洁柔	1,540,410	18,916,234.80	3.31
4	300014	亿纬锂能	540,000	16,448,400.00	2.88
5	603345	安井食品	294,146	15,119,104.40	2.65
6	600195	中牧股份	1,074,630	14,883,625.50	2.61
7	603160	汇顶科技	104,833	14,550,820.40	2.55
8	002191	劲嘉股份	1,162,400	14,425,384.00	2.53
9	300413	芒果超媒	350,000	14,367,500.00	2.52
10	600038	中直股份	313,742	12,869,696.84	2.25

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	002555	三七互娱	34,808,896.39	7.82
2	300498	温氏股份	29,212,649.00	6.57
3	002511	中顺洁柔	29,060,212.04	6.53
4	603160	汇顶科技	28,609,788.25	6.43
5	600967	内蒙一机	26,777,384.30	6.02
6	002607	中公教育	24,728,274.74	5.56
7	300014	亿纬锂能	22,858,554.72	5.14
8	603871	嘉友国际	22,630,136.00	5.09
9	600030	中信证券	21,767,639.70	4.89
10	300207	欣旺达	21,691,564.51	4.88
11	601688	华泰证券	21,467,444.93	4.82
12	603345	安井食品	21,181,648.11	4.76
13	300413	芒果超媒	21,026,291.00	4.73
14	002044	美年健康	20,551,045.00	4.62
15	000923	河北宣工	20,071,085.25	4.51
16	601838	成都银行	19,800,259.00	4.45
17	000403	振兴生化	19,755,143.94	4.44
18	002216	三全食品	19,747,968.84	4.44
19	601166	兴业银行	18,336,610.80	4.12
20	600339	中油工程	17,534,981.00	3.94
21	002869	金溢科技	17,508,362.00	3.93
22	002322	理工环科	17,292,650.06	3.89
23	600195	中牧股份	16,122,334.60	3.62
24	300661	圣邦股份	16,076,478.30	3.61
25	600131	岷江水电	15,932,786.01	3.58
26	000768	中航飞机	15,620,837.45	3.51
27	603666	亿嘉和	15,318,071.00	3.44
28	002697	红旗连锁	15,167,263.60	3.41
29	603708	家家悦	15,161,841.10	3.41
30	300253	卫宁健康	15,151,717.00	3.41
31	600580	卧龙电驱	14,959,932.22	3.36
32	600216	浙江医药	14,855,310.95	3.34
33	601233	桐昆股份	14,241,739.19	3.20
34	300188	美亚柏科	14,165,182.20	3.18
35	002191	劲嘉股份	14,024,095.00	3.15
36	600297	广汇汽车	13,831,741.00	3.11
37	002271	东方雨虹	13,470,469.30	3.03
38	002410	广联达	13,240,068.80	2.98
39	603588	高能环境	12,880,016.00	2.89
40	603018	中设集团	12,848,050.00	2.89
41	603197	保隆科技	12,693,170.76	2.85
42	603713	密尔克卫	12,638,487.61	2.84
43	002821	凯莱英	12,136,244.38	2.73
44	603026	石大胜华	11,973,895.00	2.69
45	603707	健友股份	11,738,197.50	2.64
46	300724	捷佳伟创	11,172,200.00	2.51
47	300648	星云股份	10,982,853.96	2.47
48	002153	石基信息	10,947,644.38	2.46
49	002180	纳思达	10,915,055.94	2.45
50	002343	慈文传媒	10,892,368.52	2.45
51	002019	亿帆医药	10,828,549.44	2.43
52	002276	万马股份	10,564,062.00	2.37
53	603882	金域医学	10,316,740.76	2.32
54	300203	聚光科技	10,243,204.00	2.30
55	300078	思创医惠	10,185,104.00	2.29
56	300360	炬华科技	10,132,652.24	2.28
57	600570	恒生电子	10,112,503.65	2.27
58	603111	康尼机电	10,090,043.89	2.27
59	002695	煌上煌	10,035,160.98	2.26
60	002010	传化智联	10,014,849.00	2.25
61	300511	雪榕生物	9,671,193.44	2.17
62	600893	航发动力	9,570,090.42	2.15
63	600038	中直股份	9,459,829.00	2.13
64	300552	万集科技	9,053,061.00	2.03
65	300365	恒华科技	8,944,658.88	2.01
66	600256	广汇能源	8,929,183.00	2.01

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	601100	恒立液压	36,146,517.77	8.12
2	600030	中信证券	31,511,304.20	7.08
3	600115	东方航空	30,752,515.99	6.91
4	002555	三七互娱	29,628,777.54	6.66
5	603160	汇顶科技	20,457,027.79	4.60
6	603871	嘉友国际	20,289,143.33	4.56
7	002869	金溢科技	20,115,462.62	4.52
8	600297	广汇汽车	19,138,475.68	4.30
9	000403	振兴生化	18,882,463.71	4.24
10	002511	中顺洁柔	18,767,573.66	4.22
11	600131	岷江水电	18,507,067.75	4.16
12	002410	广联达	18,326,733.00	4.12
13	002607	中公教育	18,061,045.78	4.06
14	603708	家家悦	17,376,846.10	3.91
15	002271	东方雨虹	16,405,485.21	3.69
16	000768	中航飞机	16,100,023.87	3.62
17	600580	卧龙电驱	16,029,419.56	3.60
18	000923	河北宣工	15,916,209.39	3.58
19	300498	温氏股份	15,897,031.14	3.57
20	300207	欣旺达	15,747,080.84	3.54
21	600339	中油工程	15,022,306.20	3.38
22	300529	健帆生物	14,856,643.16	3.34
23	603197	保隆科技	14,750,617.63	3.32
24	000966	长源电力	14,412,479.84	3.24
25	300271	华宇软件	14,193,937.03	3.19
26	002044	美年健康	14,160,765.70	3.18
27	300003	乐普医疗	13,847,761.60	3.11
28	601838	成都银行	13,709,999.40	3.08
29	002236	大华股份	13,562,219.38	3.05
30	603588	高能环境	13,432,800.44	3.02
31	002191	劲嘉股份	13,300,128.35	2.99
32	601688	华泰证券	13,231,526.64	2.97
33	002821	凯莱英	13,177,800.20	2.96
34	002010	传化智联	13,031,751.96	2.93
35	603666	亿嘉和	12,850,889.42	2.89
36	300014	亿纬锂能	12,813,877.37	2.88
37	002180	纳思达	12,441,953.07	2.80
38	600570	恒生电子	12,047,770.44	2.71
39	600967	内蒙一机	11,900,119.00	2.67
40	603882	金域医学	11,842,963.00	2.66
41	300648	星云股份	11,778,429.30	2.65
42	300511	雪榕生物	11,663,246.13	2.62
43	600038	中直股份	11,515,513.14	2.59
44	603686	龙马环卫	11,342,519.00	2.55
45	603713	密尔克卫	10,969,995.24	2.47
46	002276	万马股份	10,936,546.00	2.46
47	002019	亿帆医药	10,932,575.96	2.46
48	601233	桐昆股份	10,752,918.00	2.42
49	300360	炬华科技	10,726,055.00	2.41
50	603026	石大胜华	10,675,472.17	2.40
51	603345	安井食品	10,534,650.00	2.37
52	601166	兴业银行	10,318,529.98	2.32
53	601231	环旭电子	10,307,386.00	2.32
54	300661	圣邦股份	10,304,657.00	2.32
55	002343	慈文传媒	10,276,001.60	2.31
56	300454	深信服	10,275,450.28	2.31
57	603707	健友股份	10,141,245.09	2.28
58	002405	四维图新	9,963,204.00	2.24
59	300078	思创医惠	9,576,155.84	2.15
60	002695	煌上煌	9,554,415.90	2.15
61	600893	航发动力	9,337,212.00	2.10
62	300253	卫宁健康	9,336,350.02	2.10
63	002322	理工环科	9,244,450.00	2.08
64	601877	正泰电器	9,066,367.01	2.04
65	601111	中国国航	8,908,219.03	2.00

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	1,534,121,803.13
卖出股票的收入（成交）总额	1,452,665,041.78

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	19,898,000.00	3.48
2	央行票据	-	-
3	金融债券	9,995,000.00	1.75
	其中：政策性金融债	9,995,000.00	1.75
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）	30,752,215.54	5.39
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	60,645,215.54	10.62

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	199914	19贴现国债14	200,000	19,898,000.00	3.48
2	190206	19国开06	100,000	9,995,000.00	1.75
3	113013	国君转债	50,000	5,662,000.00	0.99
4	128045	机电转债	32,998	3,621,860.48	0.63
5	113020	桐昆转债	30,000	3,564,600.00	0.62

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	497,048.45
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	222,641.60
5	应收申购款	412,488.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,132,179.00

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113013	国君转债	5,662,000.00	0.99
2	128045	机电转债	3,621,860.48	0.63
3	113020	桐昆转债	3,564,600.00	0.62
4	128016	雨虹转债	3,411,000.00	0.60
5	113525	台华转债	3,195,900.00	0.56
6	128019	久立转2	2,840,561.56	0.50
7	110042	航电转债	2,276,200.00	0.40
8	110048	福能转债	2,227,600.00	0.39
9	123003	蓝思转债	1,935,400.00	0.34
10	128047	光电转债	1,734,300.00	0.30
11	113517	曙光转债	282,793.50	0.05

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

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

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
33,025	13,803.56	111,513,522.85	24.46%	344,349,140.69	75.54%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	41,411.79	0.01%

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	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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010年6月30日）基金份额总额	3,235,642,950.36
本报告期期初基金份额总额	456,759,358.17
本报告期基金总申购份额	79,852,957.36
减：本报告期基金总赎回份额	80,749,651.99
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	455,862,663.54

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：本基金托管人中国建设银行股份有限公司于2019年6月4日发布公告，聘任蔡亚蓉为资产托管业务部总经理。

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	
申万宏源证券有限公司	1	568,434,950.37	19.04%	529,381.22	19.04%	-
中信证券股份有限公司	1	54,461,197.75	1.82%	50,720.23	1.82%	-
东方证券股份有限公司	2	538,859,953.40	18.05%	501,840.76	18.05%	-
川财证券有限责任公司	1	29,701,310.04	1.00%	27,660.84	1.00%	-
方正证券股份有限公司	1	281,186,857.69	9.42%	261,870.13	9.42%	-
中泰证券股份有限公司	2	242,607,625.91	8.13%	225,940.99	8.13%	-
中国银河证券股份有限公司	2	23,525,187.77	0.79%	21,909.43	0.79%	-
国泰君安证券股份有限公司	1	219,966,317.06	7.37%	204,854.35	7.37%	-
西南证券股份有限公司	1	219,818,080.72	7.36%	204,716.31	7.36%	-
招商证券股份有限公司	1	193,241,745.52	6.47%	179,966.03	6.47%	-
国信证券股份有限公司	1	182,055,633.33	6.10%	169,545.81	6.10%	-
东吴证券股份有限公司	1	179,352,388.82	6.01%	167,031.69	6.01%	-
中信建投证券股份有限公司	2	128,687,774.97	4.31%	120,012.94	4.32%	-
长城证券股份有限公司	1	122,861,469.92	4.12%	114,421.06	4.12%	-
华创证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
上海华信证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
第一创业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国联证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	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
申万宏源证券有限公司	7,059,268.70	13.27%	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	4,588,657.60	8.62%	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	4,443,968.90	8.35%	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	4,316,667.38	8.11%	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	4,907,499.87	9.22%	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	18,768,796.20	35.27%	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	9,129,800.79	17.16%	-	-	-	-

注：1、报告期内，本基金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 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》。