

交银施罗德新生活力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

1.1 重要提示
基金管理人、基金托管人、基金销售机构... 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...

2.1 基金基本情况
基金名称:交银施罗德新生活力灵活配置混合
基金代码:519772

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人, 基金销售机构, 基金注册登记机构, 基金投资顾问

2.2 基金主要财务指标
截至本报告期末基金份额净值:1.586
本报告期末基金份额持有人户数:1,586

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人, 基金销售机构, 基金注册登记机构, 基金投资顾问

2.3 基金主要财务指标和基金净值表现
主要财务指标:截至2019年6月30日,本报告期末基金份额净值1.586

3 主要会计数据和财务指标
截至2019年6月30日,本报告期末基金份额净值1.586

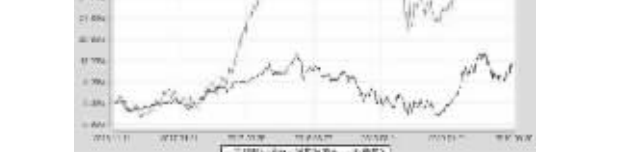
Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人, 基金销售机构, 基金注册登记机构, 基金投资顾问

3.1 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准:沪深300指数收益率\*40%+中证综合债券指数收益率\*60%

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人, 基金销售机构, 基金注册登记机构, 基金投资顾问

3.2 基金业绩比较基准
截至2019年6月30日,本报告期末基金份额净值1.586

3.3 基金业绩比较基准
截至2019年6月30日,本报告期末基金份额净值1.586



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规定。

4 管理人报告
4.1 基金管理人及基金经理情况
4.1.1 基金管理人及基金经理的基本情况

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,由交银银行股份有限公司、施罗德投资管理(中国)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...

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

4.1.2 基金基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

Table with 2 columns: 姓名, 职务, 任职本基金的基金经理(助理)期限, 证券从业年限

注:1.本基金基金经理(助理)任职日期和离职日期均以基金合同生效日或公告作出决定日为准。

4.2 管理人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守了《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...

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易专项说明
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...

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超过该证券当日总成交量的5%的情况有1次...

4.4 管理人报告期内本基金投资策略和业绩表现的说明
2019年上半年,美国通胀预期升温,国内也整体流动性宽松,一季度大幅上升的社融数据给市场注入了较多的流动性...

4.5 报告期内本基金的投资策略和业绩表现的说明
报告期内,本基金管理人严格遵守了《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...

4.6 管理人报告期内本基金投资运作情况的说明
本基金管理人制定了健全、有效的投资决策流程和风险控制流程,并成立了估值委员会,估值委员会成员由基金经理、基金运营部、风险管理部、IT人员和运营部人员组成...

4.7 基金管理人报告期内本基金投资运作情况的说明
本基金管理人制定了健全、有效的投资决策流程和风险控制流程,并成立了估值委员会,估值委员会成员由基金经理、基金运营部、风险管理部、IT人员和运营部人员组成...

4.8 基金管理人报告期内本基金投资运作情况的说明
本基金管理人制定了健全、有效的投资决策流程和风险控制流程,并成立了估值委员会,估值委员会成员由基金经理、基金运营部、风险管理部、IT人员和运营部人员组成...

4.9 基金管理人报告期内本基金投资运作情况的说明
本基金管理人制定了健全、有效的投资决策流程和风险控制流程,并成立了估值委员会,估值委员会成员由基金经理、基金运营部、风险管理部、IT人员和运营部人员组成...

4.10 基金管理人报告期内本基金投资运作情况的说明
本基金管理人制定了健全、有效的投资决策流程和风险控制流程,并成立了估值委员会,估值委员会成员由基金经理、基金运营部、风险管理部、IT人员和运营部人员组成...

4.11 基金管理人报告期内本基金投资运作情况的说明
本基金管理人制定了健全、有效的投资决策流程和风险控制流程,并成立了估值委员会,估值委员会成员由基金经理、基金运营部、风险管理部、IT人员和运营部人员组成...

4.8 报告期内管理人对本基金持有人户数或基金份额净值预警情况的说明

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生活力灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、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生活力灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、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,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为...

5.3 托管人对本半年度报告中基金净值等信息的真实、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在交银施罗德新生活力灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、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,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为...

6.1 资产负债表
单位:人民币元

Table with 2 columns: 资产, 负债和所有者权益

6.2 利润表
单位:人民币元

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期

6.3 所有者权益(基金净值)变动表
单位:人民币元

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期

6.4 现金流量表
单位:人民币元

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期

6.5 所有者权益(基金净值)变动表
单位:人民币元

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期

6.6 资产负债表
单位:人民币元

Table with 2 columns: 资产, 负债和所有者权益

6.7 利润表
单位:人民币元

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期

6.8 所有者权益(基金净值)变动表
单位:人民币元

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期

6.9 现金流量表
单位:人民币元

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期

6.10 资产负债表
单位:人民币元

Table with 2 columns: 资产, 负债和所有者权益

6.11 利润表
单位:人民币元

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期

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
本基金本报告期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《关于进一步全面推开营业税改征增值税试点金融业有关问题的通知》、财税[2016]70号《关于金融同业往来利息免税政策的通知》、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有关问题的通知》、财税[2017]15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,已纳增值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。

(2) 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。

(3) 对基金从证券市场取得的收入,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。

(4) 对基金取得的企业债利息和收入,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,持股时间在解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂按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。

(5) 基金买卖股票印花税的税率减半征收,买入股票不征收股票交易印花税。

(6) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按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

6.4.7.2 本报告期与关联方发生关联交易的所有关联方

Table with 2 columns: 关联方名称, 与本基金的关系

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

6.4.8.2 关联方报酬
单位:人民币元

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期

6.4.8.3 销售服务费
单位:人民币元

Table with 2 columns: 关联方名称, 本期, 上期

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 本基金在承销期间参与关联方承销的情况

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

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 因认购未上市债券而暂时未上市流通受限证券

Table with 2 columns: 基金代码, 基金名称, 成功认购日期, 可流通日期, 流通受限类型, 认购数量, 期末数量, 数量限制, 期末公允价值, 公允价值变动, 备注

注:1.本基金作为特定投资者,认购中国证监会上市公司证券发行管理办法规定的非公开发行股份,所认购的股份自发行结束之日起12个月内不得转让。根据《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股份,认购的股份自发行结束之日起12个月内不得转让。

2. 基金作为特定投资者,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

6.4.9.3 期末未上市债券而暂时未上市流通受限证券

6.4.9.4 期末未上市债券而暂时未上市流通受限证券

7.1 期末基金资产组合情况
单位:人民币元

Table with 2 columns: 序号, 行业类别, 金额, 占基金总资产的比例(%)

7.2 报告期内按行业分类的股票投资组合
单位:人民币元

Table with 2 columns: 代码, 行业类别, 公允价值, 占基金总资产比例(%)

7.2 报告期内按行业分类的港股通投资股票投资组合

7.3 期末按公允价值占基金资产净值大小排名的前十名股票投资明细
单位:人民币元

Table with 2 columns: 代码, 行业类别, 公允价值, 占基金总资产比例(%)

Table with 2 columns: 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(%)

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

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

Table with 2 columns: 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(%)

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

Table with 2 columns: 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(%)

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/成交金额和卖出股票的收入/成交金额
单位:人民币元

Table with 2 columns: 买入股票的成本/成交金额, 卖出股票的收入/成交金额

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

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资组合

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

7.8 本报告期末未持有资产支持证券

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名贵金属投资明细

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.12.1 投资组合报告附注

7.12.2 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,在本报告编制前一年

7.12.3 期末其他各项资产构成

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8 基金持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构
单位:份

Table with 2 columns: 持有人户数(户), 户持有基金份额, 机构投资者持有基金份额, 个人投资者持有基金份额

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

9 开放式基金份额变动
单位:份

Table with 2 columns: 基金合同生效日(2014年11月11日), 基金期初份额, 基金期末份额

注:1.如本报告期前发生转换转入、红利再投资业务,则总申购份额中包含该业务;

2.如本报告期前发生转换转出业务,则总赎回份额中包含该业务。

10 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的名称

10.1 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的名称

10.2 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的名称

10.3 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的名称

10.4 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的名称

10.5 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的名称

10.6 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的名称

10.7 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的名称

10.8 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的名称

10.9 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的名称

10.10 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的名称

注:1.报告期内,本基金新增中国国债期货,其他交易单元未发生变更;

2. 报告期内,本基金新增中国国债期货,其他交易单元未发生变更;

3. 报告期内,本基金新增中国国债期货,其他交易单元未发生变更;

11 影响投资决策的其他重要信息

11.1 影响投资决策的其他重要信息