



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  
 报告日期：二〇一九年八月二十九日

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预示其未来业绩表现，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。  
 本半年度报告概览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。  
 本报告中文档财务数据未经审计。  
 本报告日期为2019年1月1日起至6月30日止。

2.1 基金基本情况	
基金名称	交银施罗德投资
基金代码	00724
交易代码	00724
基金运作方式	契约型开放式
基金运作类型	混合型基金
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
报告期末基金份额总额	79,909,354.91份
基金存续期限	不定期

  

2.2 基金产品说明	
投资目标	本基金在控制风险的前提下，力争为投资者提供长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金股票资产投资的核心在于通过长期价格趋势研判来发现、持续跟踪标的资产估值成本，本基金在有效控制风险的前提下，适度参与个股投资，力争获取超额收益。本基金资产配置策略：本基金资产配置策略为：以中长期持有为主，适当参与个股投资，力争获取超额收益。本基金资产配置比例如下：股票资产占基金资产净值的比例不高于75%；本基金投资于港股的比例不高于股票资产的50%；债券资产占基金资产净值的比例不低于25%；现金资产占基金资产净值的比例不低于5%。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为：中证800指数收益率×75%+沪深300指数收益率×25%。
风险收益特征	本基金是一只混合型基金，其预期风险和预期收益水平高于货币型基金和债券型基金，低于股票型基金。

  

2.3 基金管理人及基金托管人		
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
信息公示负责人	姓名	王昕彤
	联系电话	021-60105500
	电子邮箱	xsp@funds.com.cn
客户服务电话	400-700-5000 / 021-60105500	95555
网址	021-60105504	010-85230024
基金基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fund901.com	
基金半年度财务报告披露网站	www.fund901.com	

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	6,364,502.29
本期公允价值变动收益	6,635,649.89
报告期内基金的投资收益	13,000,152.18
基金本期收益总额	4,169.49
3.1.2 期间数据和指标	报告期(2019年6月30日)
期末可供分配基金份额总额	0.010
期末可供分配基金份额净值	81.1762532
期末基金份额净值	1.0160

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 基金净值净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较						
期间	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
过去一个月	0.57%	0.14%	1.04%	0.30%	-1.11%	-0.16%
过去三个月	-1.36%	0.24%	0.39%	0.36%	-1.65%	-0.18%
过去六个月	4.16%	0.29%	8.07%	0.39%	-3.91%	-0.10%
过去一年	1.66%	0.25%	6.36%	0.36%	-4.70%	-0.11%
自基金合同生效以来	1.66%	0.26%	4.43%	0.37%	-2.83%	-0.11%

注：1、本基金的业绩比较基准为75%×中证800指数收益率+25%×沪深300指数收益率，每日进行净值跟踪。  
 3.2.2 基金合同生效以来本基金净值增长率变动情况与同期业绩比较基准收益率的对比图  
 交银施罗德量化智投策略定期开放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  
 (2019年1月18日至2019年6月30日)

注：本基金基金合同生效日为2018年5月18日，截至报告期末，本基金已完成建仓且报告期期末距建仓结束未满一年。本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月，截至建仓结束期，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。

## 交银施罗德致远量化智投策略定期开放混合型证券投资基金

### 2019 半年度 报告摘要

2019年6月30日

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事宜上，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约定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息内容的真实性、准确和完整发表意见  
 本托管人认为，交银施罗德基金管理人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，基金管理人编制和披露的交银施罗德致远量化智投策略定期开放混合型证券投资基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告等信息真实、准确、完整，未发现损害基金份额持有人利益的行为。

6.1 资产负债表

会计主体：交银施罗德致远量化智投策略定期开放混合型证券投资基金  
 报告截止日：2019年6月30日

项目	期末余额 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
资产：		
银行存款	6,471.1	3,325,737.58
结算备付金		15,919,345.57
存出保证金		37,294.35
应收利息	6,472.2	62,094,958.22
应收股利		13,194,958.22
其他资产		48,900,000.00
资产总计	12,943,643.30	194,367,952.60
负债和所有者权益：		
应付赎回款		100,662.39
应付管理人报酬		1,378,270.74
应付托管费		463,658.58
其他负债		11,376,525.32
所有者权益	11,801,152.67	72,899,443.57
所有者权益总计	11,801,152.67	72,899,443.57

6.2 利润表

会计主体：交银施罗德致远量化智投策略定期开放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

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12月31日至 2018年6月30日
一、收入	10,052,484.68	33,561,504.54
1.利息收入	2,087,676.56	938,666.05
其中：存款利息收入	189,662.39	923,085.65
债券利息收入	2,147,789.78	217,600.40
买入返售金融资产收入		
其他利息收入		
2.投资收益(损失以“-”号填列)	7,848,418.69	689,225.71
其中：股票投资收益	5,061,017.27	-19,934.73
基金投资收益	6,471.3	34,623.00
资产管理收入	6,471.3	34,623.00
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6,472.15	-
汇兑收益	6,471.15	-
其他收入	6,471.15	-
二、费用	(1,966,434.79)	(466,352.71)
1.管理人报酬	(1,183,200.75)	(32,907.72)
2.托管费	(197,200.07)	(5,844.62)
3.销售服务费	(647.19)	(28,822.21)
4.交易费用		(34,843.21)
5.利息支出		(30,947.67)
6.其他费用	(647.20)	(2,481.22)
7.其他费用	(647.20)	(58,136.94)
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	8,035,649.89	-130,769.17
减：所得税费用		-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	8,035,649.89	-130,769.17

注：1、报告截止日2019年6月30日，基金份额净值1.0160元，基金份额总额79,909,354.91份。  
 2、本报告中“资产负债表和利润表附注”列示为年度报告正文中对应的附注号，投资者欲了解相应附注内容，应阅读披露于本基金网站上的半年度报告正文。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：交银施罗德致远量化智投策略定期开放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

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
一、所有者权益(基金净值)：		
1.基金份额持有人权益	12,943,643.30	33,561,504.54
2.未分配利润	(1,966,434.79)	(466,352.71)
二、所有者权益合计	10,977,208.51	33,095,151.83
三、所有者权益变动原因		
1.基金份额持有人权益变动	11,801,152.67	72,899,443.57
2.未分配利润变动	(1,966,434.79)	(466,352.71)
3.其他	(1,966,434.79)	(466,352.71)

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
一、收入	10,052,484.68	33,561,504.54
1.利息收入	2,087,676.56	938,666.05
其中：存款利息收入	189,662.39	923,085.65
债券利息收入	2,147,789.78	217,600.40
买入返售金融资产收入		
其他利息收入		
2.投资收益(损失以“-”号填列)	7,848,418.69	689,225.71
其中：股票投资收益	5,061,017.27	-19,934.73
基金投资收益	6,471.3	34,623.00
资产管理收入	6,471.3	34,623.00
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6,472.15	-
汇兑收益	6,471.15	-
其他收入	6,471.15	-
二、费用	(1,966,434.79)	(466,352.71)
1.管理人报酬	(1,183,200.75)	(32,907.72)
2.托管费	(197,200.07)	(5,844.62)
3.销售服务费	(647.19)	(28,822.21)
4.交易费用		(34,843.21)
5.利息支出		(30,947.67)
6.其他费用	(647.20)	(2,481.22)
7.其他费用	(647.20)	(58,136.94)
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	8,035,649.89	-130,769.17
减：所得税费用		-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	8,035,649.89	-130,769.17

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	13,194,958.22	16.20
	其中：境内权益	13,194,958.22	16.20
2	固定收益投资	48,900,000.00	60.03
	其中：银行存款	48,900,000.00	60.03
3	买入返售金融资产	-	-
4	其他金融资产	-	-
5	其他资产	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	衍生品投资	-	-
8	其他	-	-
9	合计	62,094,958.22	100.00

7.2 期末按行业分类的权益投资组合  
 7.2.1 报告期末按行业分类的境内权益投资组合

代码	行业名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	246,308.00	0.31
B	采矿业	402,221.00	0.50
C	制造业	7,382,810.00	9.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	598,171.00	0.74
E	建筑业	296,130.00	0.36
F	批发和零售业	480,340.92	0.59
G	交通运输、仓储和邮政业	394,421.60	0.49
H	住宿和餐饮业	936,230.00	1.15
I	房地产业	962,485.20	1.18
J	金融业	4,382,738.00	5.36
K	房地产业	1,004,914.00	1.23
L	租赁和商务服务业	193,770.00	0.24
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	医药、健康和高新技术产业	-	-
P	教育	-	-
Q	综合和其他	-	-
R	文化、体育和娱乐业	399,650.00	0.49
S	综合	399,650.00	0.49
T	合计	13,194,958.22	16.23

7.2.2 报告期末按行业分类的港股投资权益投资组合  
 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

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	002195	三安光电	97,380	378,308.20	0.47
2	002563	中航光电	27,000	265,740.00	0.33
3	603299	嘉华铁路	12,000	324,660.00	0.41
4	002286	京东方A	2,200	139,977.00	0.17
5	002299	卓创信息	11,900	301,308.00	0.37
6	600099	东方电气	13,000	292,632.00	0.36
7	600675	东方网力	36,200	284,170.00	0.35
8	600893	华鲁恒升	9,400	275,796.00	0.34
9	601872	招商公路	58,300	254,188.00	0.31
10	600355	华鲁股份	28,800	248,544.00	0.31

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

7.4 买入资产金额超过期初基金资产净值2%或20%的股票明细

序号	股票代码	股票名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	002195	三安光电	378,308.20	0.47
2	600099	东方电气	292,632.00	0.36
3	000909	中信银行	1,238,640.00	1.55
4	002599	奥康医药	1,201,892.00	1.51
5	600782	新凤鸣	1,148,598.46	1.42
6	601293	安达科技	1,099,712.54	1.37
7	600289	嘉华铁路	1,084,120.00	1.35
8	603557	普华药业	1,027,713.00	1.28
9	600885	宏发股份	984,623.28	1.24
10	600875	东方电气	970,158.00	1.21
11	000887	中顺洁柔	964,510.00	1.21
12	002597	招商公路	913,600.00	1.13
13	000999	壹桥股份	899,424.00	1.12
14	600697	紫光股份	886,010.00	1.10
15	002299	卓创信息	371,710.00	0.46
16	601848	西药产业	326,561.00	0.41
17	601100	恒信证券	299,482.00	0.37
18	600260	华鲁恒升	291,249.00	0.35
19	600770	东方网力	283,992.00	0.35
20	600884	招商公路	245,767.50	0.31

注：“本期买入资产金额”按买入成交金额(成交单乘以成交量)填列，不考虑相关交易费用。  
 7.4.2 买入资产金额超过期初基金资产净值2%或20%的股票明细

序号	股票代码	股票名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	000056	金科股份	2,928,205.00	1.31
2	600875	东方电气	1,961,968.00	0.83
3	002299	卓创信息	1,856,566.00	0.81
4	000909	中信银行	1,728,010.00	0.77
5	600626	华鲁恒升	1,533,779.00	0.69
6	002195	三安光电	1,486,244.00	0.67
7	002599	奥康医药	1,377,280.00	0.62
8	002599	奥康医药	1,377,280.00	0.62
9	000975	招商公路	1,278,920.98	0.57
10	601005	重庆钢铁	1,257,548.00	0.56
11	601007	华鲁恒升	1,238,044.00	0.55
12	600782	新凤鸣	1,232,444.00	0.55
13	002244	珠江集团	1,207,254.00	0.54
14	600673	招商公路	1,187,261.00	1.51
15	002173	华鲁恒升	1,166,876.00	0.52
16	002007	招商公路	1,156,760.00	0.52
17	000580	安泰集团	1,102,423.00	0.49
18	300888	长药科技	1,074,100.00	0.48
19	600801	新华证券	1,069,500.00	0.48
20	600660	招商公路	1,062,444.00	0.47

注：“本期累计卖出金额”按卖出成交金额(成交单乘以成交量)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

7.5 期末按券种分类的债券投资组合

序号	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国债券		