

交银施罗德先进制造混合型证券投资基金
2018 年半年度报告摘要
2018 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：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年八月二十五日

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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 24 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 2018 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	交银先进制造混合	
基金主代码	519704	
交易代码	519704(前端)	519705(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011 年 6 月 22 日	
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,253,865,585.43 份	
基金合同存续期	不定期	

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过重点投资于与先进制造主题相关的优质企业，把握中国产业结构升级的投资机会，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，自下而上挖掘与先进制造主题相关的上市公司投资机会，以谋求良好收益。其中，本基金所指的先进制造，是指在中国经济和制造行业转型升级的大背景下，立足我国国情和科技、产业基础，通过信息化与工业化的深度融合，运用先进的科技技术、材料工艺以及生产方式，推进制造行业生产过程智能化、自动化和制造领域的互联网化，全面提升企业研发、生产、管理和服务水平等。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+中证综合债券指数收益率×40%
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高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王晚婷	贺倩
	联系电话	(021) 61055050	010-66060069

电子邮箱	xxpl@jysld.com, disclosure@jysld.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话	400-700-5000, 021-61055000	95599
传真	(021) 61055054	010-68121816

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（2018年1月1日至2018年6月30日）
本期已实现收益	-95,099,210.98
本期利润	-270,001,404.80
加权平均基金份额本期利润	-0.1859
本期基金份额净值增长率	-10.58%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.841
期末基金资产净值	2,308,893,968.72
期末基金份额净值	1.841

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	份额净值	业绩比较	业绩比较	①—③	②—④
----	------	------	------	------	-----	-----

	增长率①	增长率标准差②	基准收益率③	基准收益率标准差④		
过去一个月	-6.75%	1.76%	-4.40%	0.77%	-2.35%	0.99%
过去三个月	-9.74%	1.26%	-5.26%	0.68%	-4.48%	0.58%
过去六个月	-10.58%	1.29%	-8.69%	0.86%	-1.89%	0.43%
过去一年	4.48%	1.10%	-9.34%	0.79%	13.82%	0.31%
过去三年	21.68%	1.77%	-28.31%	1.41%	49.99%	0.36%
自基金合同生效起至今	180.11%	1.53%	40.31%	1.30%	139.80%	0.23%

注：1、本基金业绩比较基准自 2015 年 10 月 1 日起，由“75%×申银万国装备制造指数收益率+25%×中信标普全债指数收益率”变更为“75%×申银万国装备制造指数收益率+25%×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、本基金业绩比较基准自 2018 年 3 月 21 日起，由“75%×申银万国装备制造指数收益率+25%×中证综合债券指数收益率”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 2018 年 3 月 21 日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德先进制造混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

3、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

交银施罗德先进制造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
 （2011 年 6 月 22 日至 2018 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、保本混合型、普通混合型和股票型在内的 81 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	证券从 业年限	说明

		(助理) 期限			
		任职日期	离任日期		
任相栋	交银先进制造混合、交银经济新动力混合的基金经理	2015-01-21	2018-06-23	8 年	任相栋先生，上海交通大学金融学硕士。2010 年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任行业分析师。2015 年 1 月 21 日至 2018 年 6 月 22 日担任交银施罗德先进制造混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 10 月 20 日至 2018 年 6 月 22 日担任交银施罗德经济新动力混合型证券投资基金的基金经理。
刘鹏	交银先进制造混合的基金经理	2018-05-29	-	4 年	刘鹏先生，中国人民大学金融学硕士，北京理工大学经济学学士。2014 年 6 月加入交银施罗德基金管理有限公司，历任行业分析师。

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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循《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、监管部门的相关规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。

本报告期内，本基金整体运作合规合法，无不当内幕交易和关联交易，基金投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的约定，未发生损害基金持有人利益的行为。

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不存在异常交易行为。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没有超过该证券当日总成交量 5% 的情形，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出现异常。

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

上半年市场宽幅波动，在贸易战和棚改停摆预期的影响下，市场出现大幅波动。市场风格在六月曾经向周期板块倾斜，但从整个季度来看，各大指数均呈下跌态势。

本基金上半年未能跑赢业绩比较基准，主要原因在于基金业绩比较基准中的债券权重较大，二季度 A 股整体呈全面下跌，而中证综合债指数二季度收益为正，在此情景下仅通过权益投资配置跑赢业绩比较基准的难度较大。

在去杠杆政策和贸易战、人民币贬值的内外背景下，市场对全球经济预期回落，市场赚钱效应回落，成交量萎缩。无论从估值角度还是历史相对位置，中期看 A 股指数向上的风险较大。从长期看，尽管受到各种宏观因素扰动，我们依然认为中国经济复兴是大势所趋，龙头或主流公司仍较具成长性，很多现在规模还不小但具备强竞争力的公司在各种悲观预期和不利的交易结构下被错杀，相信这类标的会成为本基金关注和研究的重点。

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 主要财务指标”及“3.2.1 本报告期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

本基金未来计划仍将维持中性仓位，并提高流动性，力求控制好业绩回撤，努力为持有人取得稳健回报。

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其适用性的情况后，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

根据相关法律法规和基金合同要求，本基金本报告期内对本报告期可供分配利润进行了收益分配，具体情况参见半年度报告正文 6.4.11 利润分配情况。

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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证

券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—交银施罗德基金管理有限公司 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事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本基金的投资运作、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本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、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：交银施罗德先进制造混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	138,307,050.56	169,868,058.21
结算备付金		10,614,267.83	14,473,918.30
存出保证金		2,883,109.12	3,587,001.36
交易性金融资产	6.4.7.2	2,177,867,558.89	2,671,185,947.30
其中：股票投资		2,077,867,558.89	2,528,760,547.30
基金投资		-	-
债券投资		100,000,000.00	142,425,400.00
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	-	186,200,503.10
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	3,467,314.24	2,875,796.30
应收股利		-	-
应收申购款		3,294,537.95	14,455,286.62
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,336,433,838.59	3,062,646,511.19
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 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		12,664,075.85	84,620,357.22
应付赎回款		3,508,006.68	5,254,256.61
应付管理人报酬		3,021,408.37	3,684,078.95
应付托管费		503,568.07	614,013.15
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	7,632,811.34	7,830,516.44
应交税费		1,912.58	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	208,086.98	418,711.50
负债合计		27,539,869.87	102,421,933.87
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	1,253,865,585.43	1,363,020,411.24
未分配利润	6.4.7.10	1,055,028,383.29	1,597,204,166.08
所有者权益合计		2,308,893,968.72	2,960,224,577.32
负债和所有者权益总计		2,336,433,838.59	3,062,646,511.19

注：1、报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.841 元，基金份额总额

1,253,865,585.43 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：交银施罗德先进制造混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		-222,086,831.12	-1,867,649.33
1.利息收入		3,985,510.03	4,665,914.69
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,298,581.38	1,619,438.63
债券利息收入		2,185,382.19	983,720.27
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		501,546.46	2,062,755.79
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-55,967,201.88	40,159,703.47
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-72,696,957.90	27,717,892.98
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	90,300.10	183,660.00
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	16,639,455.92	12,258,150.49
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-174,902,193.82	-47,839,210.28
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	4,797,054.55	1,145,942.79
减：二、费用		47,914,573.68	42,149,180.85
1. 管理人报酬		22,618,672.91	22,941,839.52
2. 托管费		3,769,778.82	3,823,639.92

3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	21,289,066.60	15,153,062.04
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		1,503.92	-
7. 其他费用	6.4.7.20	235,551.43	230,639.37
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-270,001,404.80	-44,016,830.18
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-270,001,404.80	-44,016,830.18

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：交银施罗德先进制造混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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）	1,363,020,411.24	1,597,204,166.08	2,960,224,577.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-270,001,404.80	-270,001,404.80
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）	-109,154,825.81	-138,556,433.76	-247,711,259.57
其中：1. 基金申购款	1,285,583,718.73	1,427,530,563.92	2,713,114,282.65
2. 基金赎回款	-1,394,738,544.54	-1,566,086,997.68	-2,960,825,542.22
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）	-	-133,617,944.23	-133,617,944.23
五、期末所有者权益（基金净值）	1,253,865,585.43	1,055,028,383.29	2,308,893,968.72

项目	上年度可比期间		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 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)	1,223,221,570.26	1,407,738,318.98	2,630,959,889.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	-44,016,830.18	-44,016,830.18
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)	124,328,006.73	159,279,968.51	283,607,975.24
其中：1.基金申购款	617,878,630.48	726,398,484.48	1,344,277,114.96
2.基金赎回款	-493,550,623.75	-567,118,515.97	-1,060,669,139.72
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)	1,347,549,576.99	1,523,001,457.31	2,870,551,034.30

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：阮红，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

交银施罗德先进制造混合型证券投资基金(原名为交银施罗德先进制造股票证券投资基金，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[2011]第 639 号《关于核准交银施罗德先进制造股票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《交银施罗德先进制造股票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 1,917,255,974.38 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(2011)第 256 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《交银施罗德先进制造股票证券投资基金基金合同》于 2011 年 6 月 22 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,917,686,091.76 份

基金份额，其中认购资金利息折合 430,117.38 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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》及基金管理人于 2015 年 8 月 5 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变更基金类别及修改基金名称并相应修改基金合同和托管协议的公告》，交银施罗德先进制造股票证券投资基金自 2015 年 8 月 8 日起更名为交银施罗德先进制造混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德先进制造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(包括中小板、创业板以及其他经中国证监会核准上市的股票)、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(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 60%-95%，其中，投资于大装备制造类行业上市公司股票的比例不低于股票资产的 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 5%-40%，其中基金持有的权证不超过基金资产净值的 3%，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%。本基金的业绩比较基准为 $75\% \times$ 申银万国装备制造指数收益率 $+25\% \times$ 中证综合债券指数收益率。根据 2018 年 2 月 13 日至 2018 年 3 月 19 日本基金基金份额持有人大会审议通过的《关于交银施罗德先进制造混合型证券投资基金调整投资范围及修改基金合同有关事项的议案》所修订的《交银施罗德先进制造混合型证券投资基金基金合同》，及基金管理人于 2018 年 3 月 21 日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德先进制造混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》的有关规定，自 2018 年 3 月 20 日起，本基金的投资范围变更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、创业板以及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（含国债、央行票据、金融债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、企业债券、公司债券、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换公司债券、次级债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、货币市场工具、债券回购、同业存单、银行存款（含协议存款、定期存款及其他银行存款）、权证、资产支持证券、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的相关规定）。本基金的投资组合比例变更为：股票资产占基金资产的 50%-95%，其中，投资于先进制造主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；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，本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、应收申购款等。本基金的业绩比较基准变更为： $\text{沪深 300 指数收益率} \times 60\% + \text{中证综合债券指数收益率} \times 40\%$ 。

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》、《交银施罗德先进制造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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年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需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日前取得的基金、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基金份额净值、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
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	基金托管人、基金销售机构
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
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 2018年1月1日至2018年 6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	22,618,672.91	22,941,839.52
其中：支付销售机构的客户维护费	4,374,146.61	3,285,792.06

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 2018年1月1日至2018年 6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,769,778.82	3,823,639.92

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

本报告期内及上年度可比期间未发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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
中国农业银行股份 有限公司	138,307,050.56	1,127,222.80	337,671,33 2.55	1,520,601.82

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（2018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
60310 5	芯能 科技	2018- 06-29	2018- 07-09	新股 未上	4.83	4.83	3,410	16,47 0.30	16,47 0.30	-

				市						
603693	江苏新能	2018-06-25	2018-07-03	新股未上市	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	-
603706	东方环宇	2018-06-29	2018-07-09	新股未上市	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	-
601138	工业富联	2018-05-28	2019-06-10	限售股	13.77	16.40	2,343,558	32,270,793.66	38,434,351.20	-

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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600217	中再资环	2018-03-29	重大事项	4.80	-	-	12,372,177	83,292,659.00	59,386,449.60	-

注：本基金截至 2018 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

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	2,077,867,558.89	88.93
	其中：股票	2,077,867,558.89	88.93
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	100,000,000.00	4.28
	其中：债券	100,000,000.00	4.28
	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	148,921,318.39	6.37
8	其他各项资产	9,644,961.31	0.41
9	合计	2,336,433,838.59	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	36,715,656.55	1.59
C	制造业	1,673,730,707.24	72.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,559.85	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	9,964,482.00	0.43
G	交通运输、仓储和邮政业	94,231,137.70	4.08

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	58,156,063.47	2.52
K	房地产业	110,844,557.70	4.80
L	租赁和商务服务业	33,970,590.72	1.47
M	科学研究和技术服务业	60,182,803.66	2.61
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,077,867,558.89	89.99

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	601100	恒立液压	10,114,600	211,192,848.00	9.15
2	300014	亿纬锂能	6,963,756	122,562,105.60	5.31
3	600967	内蒙一机	9,435,093	120,203,084.82	5.21
4	600066	宇通客车	6,097,990	117,020,428.10	5.07
5	600048	保利地产	9,085,578	110,844,051.60	4.80
6	002271	东方雨虹	5,492,848	93,433,344.48	4.05
7	300433	蓝思科技	4,141,480	86,888,250.40	3.76
8	600029	南方航空	9,976,466	84,301,137.70	3.65

9	601877	正泰电器	3,767,397	84,088,301.04	3.64
10	600690	青岛海尔	3,864,511	74,430,481.86	3.22

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	600066	宇通客车	327,824,185.99	11.07
2	601398	工商银行	249,696,933.67	8.44
3	300014	亿纬锂能	218,979,387.03	7.40
4	601877	正泰电器	190,480,770.66	6.43
5	300003	乐普医疗	185,652,531.20	6.27
6	600048	保利地产	179,408,809.58	6.06
7	600038	中直股份	175,781,085.96	5.94
8	002353	杰瑞股份	169,525,586.68	5.73
9	002709	天赐材料	167,683,239.23	5.66
10	601100	恒立液压	157,909,677.15	5.33
11	600499	科达洁能	148,575,843.94	5.02
12	002456	欧菲科技	145,323,892.39	4.91
13	600029	南方航空	134,143,218.68	4.53
14	002027	分众传媒	133,245,394.87	4.50
15	600482	中国动力	128,716,511.75	4.35
16	000528	柳工	122,821,717.81	4.15
17	300433	蓝思科技	121,801,203.59	4.11

18	300124	汇川技术	120,778,585.11	4.08
19	000581	威孚高科	119,861,547.45	4.05
20	300059	东方财富	115,038,841.81	3.89
21	000063	中兴通讯	112,797,453.35	3.81
22	000725	京东方 A	108,231,927.00	3.66
23	300602	飞荣达	106,946,711.87	3.61
24	600297	广汇汽车	103,875,424.18	3.51
25	002271	东方雨虹	103,118,195.20	3.48
26	601939	建设银行	101,273,469.25	3.42
27	601012	隆基股份	100,662,375.30	3.40
28	600967	内蒙一机	94,163,945.76	3.18
29	600690	青岛海尔	91,496,681.87	3.09
30	000960	锡业股份	85,362,668.31	2.88
31	600196	复星医药	85,204,298.15	2.88
32	600217	中再资环	83,292,659.00	2.81
33	600118	中国卫星	82,732,056.04	2.79
34	601989	中国重工	73,028,131.00	2.47
35	600019	宝钢股份	72,981,847.48	2.47
36	002025	航天电器	70,947,756.27	2.40
37	603338	浙江鼎力	70,028,107.25	2.37
38	300012	华测检测	67,797,647.97	2.29
39	002624	完美世界	65,442,451.42	2.21
40	603799	华友钴业	65,126,270.11	2.20
41	000661	长春高新	64,759,978.46	2.19
42	600893	航发动力	64,713,567.06	2.19
43	601318	中国平安	60,120,160.57	2.03

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	600066	宇通客车	341,262,677.75	11.53
2	002624	完美世界	250,228,440.86	8.45
3	601398	工商银行	248,884,104.20	8.41
4	600967	内蒙一机	222,862,485.12	7.53
5	002709	天赐材料	221,677,021.72	7.49
6	300003	乐普医疗	210,543,545.15	7.11
7	002027	分众传媒	200,931,721.05	6.79
8	000725	京东方 A	158,511,157.05	5.35
9	601877	正泰电器	153,985,360.62	5.20
10	600038	中直股份	138,205,252.60	4.67
11	002456	欧菲科技	137,719,108.60	4.65
12	600499	科达洁能	136,182,958.46	4.60
13	601012	隆基股份	135,220,042.02	4.57
14	300124	汇川技术	135,089,345.22	4.56
15	600482	中国动力	122,495,635.54	4.14
16	000528	柳工	119,751,370.12	4.05
17	300059	东方财富	119,524,617.92	4.04
18	000581	威孚高科	114,809,515.66	3.88
19	600705	中航资本	114,590,941.90	3.87
20	002353	杰瑞股份	112,154,576.84	3.79

21	000063	中兴通讯	108,014,972.19	3.65
22	600297	广汇汽车	105,851,486.13	3.58
23	601939	建设银行	94,397,530.15	3.19
24	002025	航天电器	89,203,597.54	3.01
25	601100	恒立液压	86,507,510.17	2.92
26	600196	复星医药	85,430,609.86	2.89
27	300014	亿纬锂能	84,511,759.01	2.85
28	600487	亨通光电	83,591,529.45	2.82
29	600118	中国卫星	75,663,266.01	2.56
30	600183	生益科技	72,894,805.86	2.46
31	601139	深圳燃气	72,664,736.65	2.45
32	600019	宝钢股份	71,184,306.35	2.40
33	300373	扬杰科技	71,008,182.24	2.40
34	300129	泰胜风能	69,158,658.95	2.34
35	601989	中国重工	69,102,588.04	2.33
36	002180	纳思达	68,287,883.03	2.31
37	300308	中际旭创	65,094,597.57	2.20
38	600030	中信证券	64,656,099.33	2.18
39	601318	中国平安	61,840,402.22	2.09
40	603799	华友钴业	61,236,492.69	2.07
41	002343	慈文传媒	60,860,541.55	2.06
42	300413	快乐购	60,652,742.08	2.05
43	600559	老白干酒	60,186,259.70	2.03

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	6,884,323,740.74
卖出股票的收入（成交）总额	7,087,133,277.53

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	100,000,000.00	4.33
	其中：政策性金融债	100,000,000.00	4.33
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	100,000,000.00	4.33

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	170207	17 国开 07	1,000,000	100,000,000.00	4.33

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	2,883,109.12
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,467,314.24
5	应收申购款	3,294,537.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,644,961.31

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

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
108,532	11,552.96	512,024,033.30	40.84%	741,841,552.13	59.16%

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	808,190.34	0.06%

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	10~50
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（2011年6月22日）基金份额总额	1,917,686,091.76
本报告期期初基金份额总额	1,363,020,411.24
本报告期基金总申购份额	1,285,583,718.73
减：本报告期基金总赎回份额	1,394,738,544.54
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,253,865,585.43

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

本基金管理人于 2018 年 2 月 13 日起至 2018 年 3 月 19 日止以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，就本基金调整投资范围及修改基金合同事宜进行表决。根据基金份额持有人大会的决议，修订后的《交银施罗德先进制造混合型证券投资基金基金合同》、《交银施罗德先进制造混合型证券投资基金托管协议》自本次基金份额持有人大会决议公告之日，即 2018 年 3 月 21 日起生效；为了不影响本基金原有基金份额持有人的利益，修订后的《交银施罗德先进制造混合型证券投资基金招募说明书》中对于“对持续持有期少于 7 日的投资人收取 1.5% 的赎回费”的条款于 2018 年 3 月 28 日起正式实施；对于“对持续持有期大于等于 7 日但少于 30 日的投资人收取 0.75% 的赎回费”的条款于 2018 年 4 月 20 日起正式实施。详情请查阅本基金管理人于 2018 年 3 月 21 日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德先进制造混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

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：2018 年 6 月 30 日本基金管理人发布公告，经公司第四届董事会第三十二次会议审议通过，同意苏奋先生辞去公司督察长职务，并决定由公司总经理阮红女士代为履行公司督察长职务。期后变动（如有）敬请关注基金管理人发布的相关公告。
- 2、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动：本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

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

交银施罗德先进制造混合型证券投资基金于 2018 年 3 月 20 日召开基金份额持有人大会审议并表决通过了《关于交银施罗德先进制造混合型证券投资基金调整投资范围及修改基金合同有关事项的议案》，修订后的《交银施罗德先进制造混合型证券投资基金基金合同》与《交银施罗德先进制造混合型证券投资基金托管协议》自 2018 年 3 月 21 日起生效。基金的投资目标、投资范围、投资策略、业绩比较基准、投资比例限制、估值方法等按照修订后的《交银施罗德先进制造混合型证券投资基金基金合同》相关规定进行运作。前述修改变更事项已按照相关法律法规及基金合同的约定履行相关手续。

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	2	843,413,523.27	6.06%	785,468.19	6.06%	-
招商证券股份有限公司	1	731,290,890.36	5.25%	681,048.69	5.25%	-
广发证券股份有限公司	1	718,567,964.52	5.16%	669,197.53	5.16%	-
海通证券股份有限公司	1	645,387,077.82	4.64%	601,048.86	4.64%	-
华泰证券股份有限公司	1	618,376,687.82	4.44%	575,894.60	4.44%	-
瑞银证券有限责任公司	1	561,250,612.80	4.03%	522,692.79	4.03%	-
光大证券股份有限公司	1	371,417,248.58	2.67%	345,901.36	2.67%	-
国泰君安证券股份有限公司	1	336,385,048.78	2.42%	313,276.14	2.42%	-
长江证券股	2	3,317,155,295.9	23.82%	3,089,270.15	23.82%	-

份有限公司		1				
国信证券股份 有限公司	2	28,651,284.82	0.21%	26,683.05	0.21%	-
兴业证券股份 有限公司	1	231,496,997.70	1.66%	215,592.06	1.66%	-
东兴证券股份 有限公司	1	216,035,693.76	1.55%	201,194.33	1.55%	-
西部证券股份 有限公司	1	2,085,105,266.6 2	14.98%	1,941,862.96	14.98%	-
天风证券股份 有限公司	1	1,964,041,053.9 5	14.11%	1,829,111.52	14.11%	-
华宝证券有 限责任公司	2	177,910,051.05	1.28%	165,687.32	1.28%	-
西南证券股份 有限公司	1	1,076,827,259.4 2	7.73%	1,002,843.43	7.73%	-
新时代证券 股份有限公 司	1	-	-	-	-	-
中信建投证 券股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
中信证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
渤海证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
东方证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
东海证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
东北证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
川财证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
方正证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
北京高华证 券有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
国联证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金 融股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
信达证券股	1	-	-	-	-	-

份有限公司						
宏信证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
华西证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
上海华信证 券有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
民生证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
平安证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
国融证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
九州证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-

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。

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

无。

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

1、本基金管理人依据国家税收法律、法规、规章及税收规范性文件的规定，对管理的基金产品运营过程中产生的应税收入，计提及缴纳增值税及附加税费，该部分税费由基金资产承担。详情请见有关公告。

2、本基金管理人于 2018 年 2 月 13 日起至 2018 年 3 月 19 日止以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，就本基金调整投资范围及修改基金合同事宜进行表决。根据基金份额持有人大会的决议，修订后的《交银施罗德先进制造混合型证券投资基金基金合同》、《交银施罗德先进制造混合型证券投资基金托管协议》自本次基金份额持有人大会决议公告之日，即 2018 年 3 月 21 日起

生效；为了不影响本基金原有基金份额持有人的利益，修订后的《交银施罗德先进制造混合型证券投资基金招募说明书》中对于“对持续持有期少于 7 日的投资人收取 1.5% 的赎回费”的条款于 2018 年 3 月 28 日起正式实施；对于“对持续持有期大于等于 7 日但少于 30 日的投资人收取 0.75% 的赎回费”的条款于 2018 年 4 月 20 日起正式实施。详情请查阅本基金管理人于 2018 年 3 月 21 日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德先进制造混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。