

交银施罗德卓越回报灵活配置混合型证券投资基金
2016 年半年度报告
2016 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：二〇一六年八月二十七日

§1 重要提示及目录

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 2016 年 8 月 26 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 2 月 17 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

| | |
|---|----|
| §1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示 | 2 |
| §2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况 | 5 |
| 2.2 基金产品说明 | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人 | 5 |
| 2.4 信息披露方式 | 6 |
| 2.5 其他相关资料 | 6 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 6 |
| 3.2 基金净值表现 | 7 |
| §4 管理人报告 | 8 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 8 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 9 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 9 |
| 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 | 10 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 11 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 11 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 11 |
| 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 | 11 |
| §5 托管人报告 | 11 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 11 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 12 |
| 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 | 12 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 12 |
| 6.1 资产负债表 | 12 |
| 6.2 利润表 | 14 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表 | 15 |
| 6.4 报表附注 | 16 |
| §7 投资组合报告 | 35 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 35 |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合 | 35 |
| 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合 | 35 |
| 7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合 | 36 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 | 36 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 37 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 40 |
| 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 | 40 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 | 41 |
| 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 | 41 |
| 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 | 41 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 | 41 |

| | |
|---|-----------|
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 41 |
| 7.12 投资组合报告附注 | 41 |
| §8 基金份额持有人信息 | 42 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 42 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 42 |
| 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 | 42 |
| §9 开放式基金份额变动 | 42 |
| §10 重大事件揭示 | 43 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 43 |
| 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 | 43 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 43 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 43 |
| 10.5 报告期内改聘会计师事务所情况 | 43 |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 | 44 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 44 |
| 10.8 其他重大事件 | 45 |
| §11 备查文件目录 | 46 |
| 11.1 备查文件目录 | 46 |
| 11.2 存放地点 | 46 |
| 11.3 查阅方式 | 46 |

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|------------------------|
| 基金名称 | 交银施罗德卓越回报灵活配置混合型证券投资基金 |
| 基金简称 | 交银卓越回报灵活配置混合 |
| 基金主代码 | 519764 |
| 交易代码 | 519764 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2016年2月17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 | 736,619,173.07 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，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，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 | 孙艳 | 方韡 |
| | 联系电话 | (021) 61055050 | 010-89936330 |

| | | |
|--------|--------------------------------------|-----------------------|
| 电子邮箱 | xxpl@jysld.com, disclosure@jysld.com | fangwei@citicbank.com |
| 客户服务电话 | 400-700-5000, 021-61055000 | 95558 |
| 传真 | (021) 61055054 | 010-85230024 |
| 注册地址 | 上海市浦东新区银城中路188号交通银行大楼二层(裙) | 北京市东城区朝阳门北大街9号 |
| 办公地址 | 上海市浦东新区世纪大道8号国金中心二期21-22楼 | 北京市东城区朝阳门北大街9号 |
| 邮政编码 | 200120 | 100010 |
| 法定代表人 | 于亚利 | 常振明 |

2.4 信息披露方式

| | |
|----------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》 |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | www.fund001.com, www.bocomschroder.com |
| 基金半年度报告备置地点 | 基金管理人的办公场所 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|----------------|----------------|
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司 | 北京市西城区太平桥大街17号 |

§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(2016年2月17日(基金合同生效日)至2016年6月30日) |
|---------------|-------------------------------------|
| 本期已实现收益 | 6,150,256.07 |
| 本期利润 | 6,579,070.07 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0105 |

| | |
|----------------------|-------------------------|
| 本期加权平均净值利润率 | 1.04% |
| 本期基金份额净值增长率 | 1.00% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2016年6月30日) |
| 期末可供分配利润 | 6,347,839.22 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.009 |
| 期末基金资产净值 | 743,667,614.75 |
| 期末基金份额净值 | 1.010 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2016年6月30日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 1.00% |

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、本基金合同生效日为2016年2月17日，自合同生效日起至本报告期末不足半年。

3.2 基金净值表现

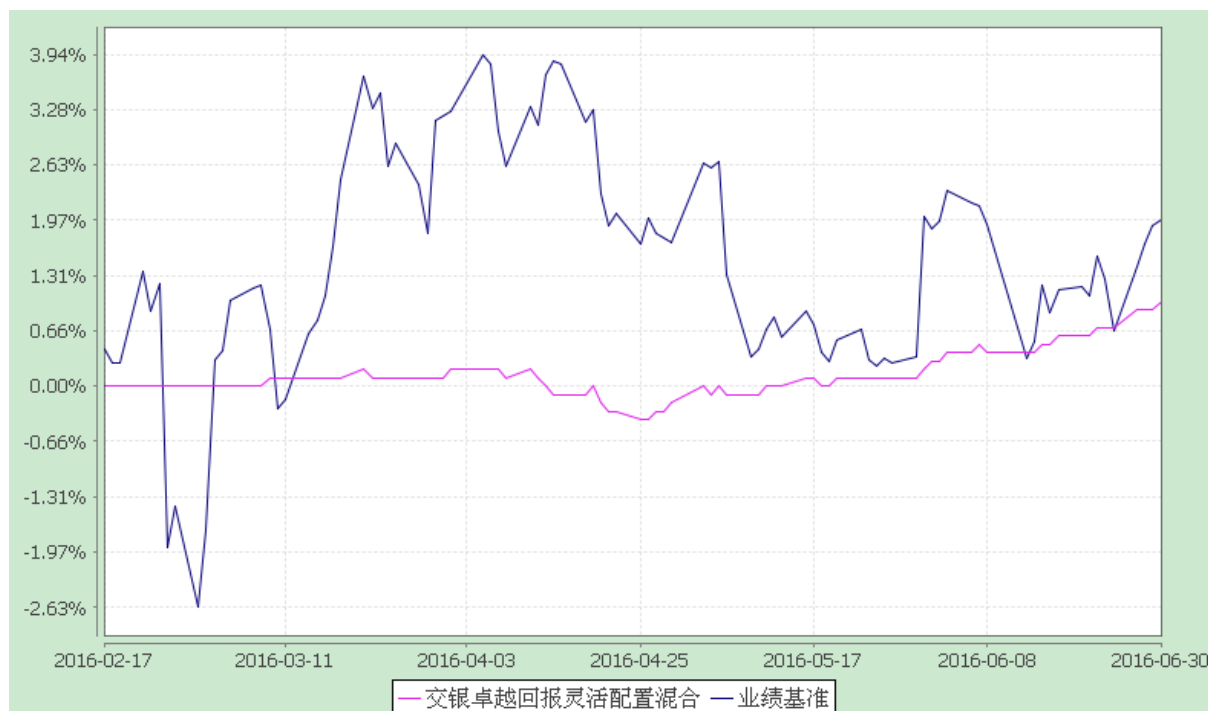
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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 | 0.80% | 0.07% | -0.04% | 0.50% | 0.84% | -0.43% |
| 过去三个月 | 0.90% | 0.08% | -1.18% | 0.51% | 2.08% | -0.43% |
| 自基金合同生效起至今 | 1.00% | 0.07% | 1.97% | 0.67% | -0.97% | -0.60% |

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

交银施罗德卓越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
 (2016年2月17日至2016年6月30日)



注：本基金基金合同生效日为2016年2月17日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间未满一年。本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至2016年6月30日，本基金尚处于建仓期。

§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54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 | 说明 |
|----|----|-----------|----|----|
|----|----|-----------|----|----|

| | | (助理) 期限 | | 从业年限 | |
|----|--|------------|------|------|--|
| | | 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、交银卓越回报灵活配置混合、交银优选回报灵活配置混合、交银优择回报灵活配置混合的基金经理 | 2016-02-17 | - | 6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。 |

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

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，是投资组合在合规范围内因被动超标调整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，经济运行呈现边际企稳，CPI 阶段性走高后回落，去杠杆背景下货币政策保持中性，财政政策积极发力，在全球低增长、低通胀、低利率的环境中，国内经济仍处于寻底的大周期中。在政策托底和经济内生下行动力的交织角力下，宏观趋势淡化，市场博弈性增加，各类资产波动性明显加大。报告期内，上证综指和创业板指分别下跌了 17.22%和 17.92%，10 年国债收益率小幅上行 2bp 到 2.84%，10 年国开收益率也小幅上行 3bp 到 3.30%。

策略层面，本基金年初关注债券市场交易机会，进行久期操作，重点参与利率债波段机会，同时重视短久期信用债的配置价值。IPO 新规运行以来，积极进行一级市场投资，同时也关注权益、转债市场的二级市场投资机会，努力为持有人赚取回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.010 元，本报告期份额净值增长率为 1.00%，同期业绩比较基准增长率为 1.97%。

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 2016 年下半年，经济增长面临的下行压力仍在，下行空间依赖政策路径，通胀进入年内下行通道后密切关注年底回升幅度。股票方面，维持“资产荒”格局下无需过度悲观的观点，关注经济下行压力下政策动向，继续关注市场面临的美联储加息预期摆动、英国脱欧事件发酵等因素带来的外围风险以及去产能去杠杆等风险，需要保持灵活、审慎。同时，二级市场震荡下继续关注一级市场的投资机会。债券方面，基本面支撑下长端收益率交易机会操作空间仍在，但需特别关注基本面边际变化和政策应对，同时，在供给侧改革的背景下，信用风险值得重点关注。

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

自 2016 年 2 月 17 日交银施罗德卓越回报灵活配置混合型证券投资基金（以下称

“交银卓越回报”或“本基金”）成立以来，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，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，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

报告期内，本托管人按照国家有关法律法规、基金合同和托管协议要求，对基金管理人——交银施罗德基金管理有限公司在本基金投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。本报告期，本基金未进行利润分配，经本托管人复核，符合合同相关要求，不存在损害持有人利益的情况。

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

由本基金管理人——交银施罗德基金管理有限公司编制，并经本托管人复核审查的本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§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：交银施罗德卓越回报灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2016年6月30日 |
|----------|---------|-------------------|
| 资产： | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 888,666.91 |
| 结算备付金 | | 70,543.56 |
| 存出保证金 | | 41,130.48 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 957,172,194.03 |
| 其中：股票投资 | | 24,807,940.53 |
| 基金投资 | | - |
| 债券投资 | | 932,364,253.50 |
| 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 | - |
| 应收证券清算款 | | 919,531.56 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 9,258,986.13 |
| 应收股利 | | - |
| 应收申购款 | | 79,491.26 |
| 递延所得税资产 | | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - |
| 资产总计 | | 968,430,543.93 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2016年6月30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 | | 222,598,748.35 |
| 应付证券清算款 | | - |
| 应付赎回款 | | 1,538,839.00 |
| 应付管理人报酬 | | 305,398.75 |
| 应付托管费 | | 122,159.52 |
| 应付销售服务费 | | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 37,802.67 |
| 应交税费 | | - |
| 应付利息 | | 80,027.04 |
| 应付利润 | | - |
| 递延所得税负债 | | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 79,953.85 |
| 负债合计 | | 224,762,929.18 |
| 所有者权益： | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 736,619,173.07 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 7,048,441.68 |
| 所有者权益合计 | | 743,667,614.75 |
| 负债和所有者权益总计 | | 968,430,543.93 |

注：1、报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.010 元，基金份额总额

736,619,173.07 份。

2、本财务报表的实际编制期间为2016年2月17日(基金合同生效日)至2016年6月30日。

6.2 利润表

会计主体：交银施罗德卓越回报灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016年2月17日（基金合同生效日）至2016年6月30日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 |
|-----------------------|----------|------------------------------------|
| | | 2016年2月17日（基金合同生效日）至 2016年6月30日 |
| 一、收入 | | 9,887,951.20 |
| 1.利息收入 | | 8,042,360.39 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 86,973.57 |
| 债券利息收入 | | 7,631,957.51 |
| 资产支持证券利息收入 | | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 323,429.31 |
| 其他利息收入 | | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 1,326,409.72 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | 2,277,637.94 |
| 基金投资收益 | | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | -1,161,937.29 |
| 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 | 210,709.07 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | 428,814.00 |
| 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 | 90,367.09 |
| 减：二、费用 | | 3,308,881.13 |
| 1. 管理人报酬 | | 1,177,133.33 |
| 2. 托管费 | | 470,853.37 |

| | | |
|----------------------------|----------|---------------------|
| 3. 销售服务费 | | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.19 | 102,844.01 |
| 5. 利息支出 | | 1,474,295.59 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 1,474,295.59 |
| 6. 其他费用 | 6.4.7.20 | 83,754.83 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 6,579,070.07 |
| 减：所得税费用 | | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 6,579,070.07 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：交银施罗德卓越回报灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016年2月17日（基金合同生效日）至2016年6月30日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年2月17日（基金合同生效日）至2016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） | 264,790,092.60 | - | 264,790,092.60 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 6,579,070.07 | 6,579,070.07 |
| 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） | 471,829,080.47 | 469,371.61 | 472,298,452.08 |
| 其中：1.基金申购款 | 500,102,655.60 | 501,062.99 | 500,603,718.59 |
| 2.基金赎回款 | -28,273,575.13 | -31,691.38 | -28,305,266.51 |
| 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） | 736,619,173.07 | 7,048,441.68 | 743,667,614.75 |

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：朱鸣

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

交银施罗德卓越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]1793 号文《关于准予交银施罗德卓越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《交银施罗德卓越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 264,526,982.90 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(2016)第 136 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《交银施罗德卓越回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 2 月 17 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 264,790,092.60 份基金份额，其中认购资金利息折合 263,109.70 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《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德卓越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)。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%；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： $50\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 50\% \times \text{中债综合全价指数收益率}$ 。

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》、《交银施罗德卓越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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年 2 月 17 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日止期间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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 2 月 17 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2016 年 2 月 17 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当

期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动作为公允价值变动损益计入当期损益；在资产持有期间所取得的利息或现金股利以及处置时产生的处置损益计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资 and 衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时，处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分(包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等)为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分后的余额)。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(a) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(b) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和中小企业私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

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[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(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，股权的股息、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，于2015年9月8日前暂减按25%计入应纳税所得额，自2015年9月8日起，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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2016年6月30日 |
|------|-------------------|
| 活期存款 | 888,666.91 |
| 定期存款 | - |
| 其他存款 | - |

| | |
|----|------------|
| 合计 | 888,666.91 |
|----|------------|

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末 2016年6月30日 | | |
|---------------|-------|-------------------|----------------|---------------|
| | | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | 22,877,305.91 | 24,807,940.53 | 1,930,634.62 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 54,369,183.93 | 53,821,253.50 | -547,930.43 |
| | 银行间市场 | 879,496,890.19 | 878,543,000.00 | -953,890.19 |
| | 合计 | 933,866,074.12 | 932,364,253.50 | -1,501,820.62 |
| 资产支持证券 | | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - |
| 合计 | | 956,743,380.03 | 957,172,194.03 | 428,814.00 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2016年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息 | 426.64 |
| 应收定期存款利息 | - |
| 应收其他存款利息 | - |
| 应收结算备付金利息 | 31.70 |
| 应收债券利息 | 9,258,509.29 |
| 应收买入返售证券利息 | - |

| | |
|------------|--------------|
| 应收申购款利息 | - |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |
| 其他 | 18.50 |
| 合计 | 9,258,986.13 |

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2016年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 26,154.75 |
| 银行间市场应付交易费用 | 11,647.92 |
| 合计 | 37,802.67 |

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2016年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 3,778.75 |
| 预提信息披露费 | 50,782.95 |
| 预提审计费 | 25,392.15 |
| 合计 | 79,953.85 |

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年2月17日（基金合同生效日）至2016年6月 30日 | |
|---------------|--|----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 基金合同生效日 | 264,790,092.60 | 264,790,092.60 |
| 本期申购 | 500,102,655.60 | 500,102,655.60 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -28,273,575.13 | -28,273,575.13 |
| 本期末 | 736,619,173.07 | 736,619,173.07 |

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。

3、本基金自2016年1月11日至2016年2月5日止期间公开发售，共募集有效净认购资金264,526,982.90元。根据《交银施罗德卓越回报灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入263,109.70元在本基金成立后，折算为263,109.70份基金份额，划入基金份额持有人账户。

4、根据《交银施罗德卓越回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》及《交银施罗德卓越回报灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的相关规定，本基金于2016年2月17日(基金合同生效日)至2016年3月16日止期间暂不向投资人开放基金交易。日常申购业务和赎回业务自2016年3月17日起开始办理。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|--------------|------------|--------------|
| 本期利润 | 6,150,256.07 | 428,814.00 | 6,579,070.07 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 197,583.15 | 271,788.46 | 469,371.61 |
| 其中：基金申购款 | 297,007.36 | 204,055.63 | 501,062.99 |
| 基金赎回款 | -99,424.21 | 67,732.83 | -31,691.38 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 6,347,839.22 | 700,602.46 | 7,048,441.68 |

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年2月17日(基金合同生效日)至 2016年6月30日 |
|-----------|--|
| 活期存款利息收入 | 74,178.31 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | 12,670.79 |
| 其他 | 124.47 |
| 合计 | 86,973.57 |

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|------------|------------------------------------|
| | 2016年2月17日（基金合同生效日）至 2016年6月30日 |
| 卖出股票成交总额 | 24,237,352.24 |
| 减：卖出股票成本总额 | 21,959,714.30 |
| 买卖股票差价收入 | 2,277,637.94 |

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----------------------------|--------------------------------|
| | 2016年2月17日（基金合同生效日）至2016年6月30日 |
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付） 成交总额 | 261,830,896.96 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期 兑付）成本总额 | 261,247,846.01 |
| 减：应收利息总额 | 1,744,988.24 |
| 买卖债券（债转股及债券到期兑付） 差价收入 | -1,161,937.29 |

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-------------|------------------------------------|
| | 2016年2月17日（基金合同生效日）至2016年6月 30日 |
| 股票投资产生的股利收益 | 210,709.07 |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 210,709.07 |

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2016年2月17日（基金合同生效日）至2016年6月 30日 |
|------------|--|
| 1.交易性金融资产 | 428,814.00 |
| ——股票投资 | 1,930,634.62 |
| ——债券投资 | -1,501,820.62 |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——基金投资 | - |
| ——贵金属投资 | - |
| 2.衍生工具 | - |
| ——权证投资 | - |
| 3.其他 | - |
| 合计 | 428,814.00 |

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年2月17日（基金合同生效日）至2016年6月 30日 |
|---------|--|
| 基金赎回费收入 | 90,367.09 |
| 合计 | 90,367.09 |

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年2月17日（基金合同生效日）至2016年6月 30日 |
|-----------|--|
| 交易所市场交易费用 | 94,394.01 |
| 银行间市场交易费用 | 8,450.00 |
| 合计 | 102,844.01 |

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年2月17日（基金合同生效日）至2016年6月 30日 |
|-------|--|
| 审计费用 | 25,392.15 |
| 信息披露费 | 50,782.95 |
| 银行汇划费 | 7,179.73 |
| 其他 | 400.00 |
| 合计 | 83,754.83 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年2月17日（基金合同生效日）至2016年6月 30日 |
|---------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 1,177,133.33 |
| 其中：支付销售机构的客户维护 费 | 186,361.51 |

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.5%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×0.5%÷当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年2月17日（基金合同生效日）至2016年6月 30日 |
|----------------|--|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 470,853.37 |

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.2%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×0.2%÷当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内未发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.4.2 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

本报告期内除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金。

6.4.10.5 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 2016年2月17日（基金合同生效日）至2016年6月30日 | |
|------------|--------------------------------------|-----------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中信银行股份有限公司 | 888,666.91 | 74,178.31 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中信银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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

| 6.4.12.1.1 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 |
| 601966 | 玲珑轮胎 | 2016-06-28 | 2016-07-06 | 新股网下申购 | 12.98 | 12.98 | 6,246 | 81,073.08 | 81,073.08 | - |
| 603016 | 新宏泰 | 2016-06-27 | 2016-07-01 | 新股网下申购 | 8.49 | 8.49 | 1,602 | 13,600.98 | 13,600.98 | - |

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.12.2 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 |
|--------|------|------------|------|--------|------------|--------|--------|------------|------------|----|
| 300166 | 东方国信 | 2016-06-08 | 重大事项 | 27.47 | - | - | 20,000 | 520,188.00 | 549,400.00 | - |
| 601611 | 中国核建 | 2016-06-30 | 重大事项 | 20.92 | 2016-07-01 | 23.01 | 20,672 | 71,731.84 | 432,458.24 | - |

注：本基金截至 2016 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。

6.4.12.3 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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。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）。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，通过精选具有长期增长潜力和较好分红能力的股票，以及具有较高息票率的债券，力争实现基金资产的长期增值。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立合规审核及风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由风险管理部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。风险管理部对公司总经理负责。督察长独立行使督察权利，直接对董事会负责，就内部控制制度和执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能，定期和不定期地向董事会报告公司内部控制执行情况。

本基金的基金管理人建立了以合规审核及风险管理委员会为核心的，由督察长、风险控制委员会、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中信银行，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2016年6月30日 |
|--------|-------------------|
| A-1 | 190,034,000.00 |
| A-1 以下 | - |
| 未评级 | 500,115,000.00 |
| 合计 | 690,149,000.00 |

注：未评级部分为政策性金融债和企业超短期融资债券。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2016年6月30日 |
|--------|-------------------|
| AAA | 240,888,993.50 |

| | |
|--------|----------------|
| AAA 以下 | 1,326,260.00 |
| 未评级 | - |
| 合计 | 242,215,253.50 |

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券部分在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2016 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 222,598,748.35 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动

利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金、存出保证金等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2016年6月30日 | 1年以内 | 1至5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|-------------------|-----------------------|-----------------------|----------|----------------------|-----------------------|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 888,666.91 | - | - | - | 888,666.91 |
| 结算备付金 | 70,543.56 | - | - | - | 70,543.56 |
| 存出保证金 | 41,130.48 | - | - | - | 41,130.48 |
| 交易性金融资产 | 717,828,354.20 | 214,535,899.30 | - | 24,807,940.53 | 957,172,194.03 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 919,531.56 | 919,531.56 |
| 应收利息 | - | - | - | 9,258,986.13 | 9,258,986.13 |
| 应收申购款 | - | - | - | 79,491.26 | 79,491.26 |
| 资产总计 | 718,828,695.15 | 214,535,899.30 | - | 35,065,949.48 | 968,430,543.93 |
| 负债 | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 222,598,748.35 | - | - | - | 222,598,748.35 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 1,538,839.00 | 1,538,839.00 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 305,398.75 | 305,398.75 |
| 应付托管费 | - | - | - | 122,159.52 | 122,159.52 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 37,802.67 | 37,802.67 |
| 应付利息 | - | - | - | 80,027.04 | 80,027.04 |
| 其他负债 | - | - | - | 79,953.85 | 79,953.85 |
| 负债总计 | 222,598,748.35 | - | - | 2,164,180.83 | 224,762,929.18 |
| 利率敏感度缺口 | 496,229,946.80 | 214,535,899.30 | - | 32,901,768.65 | 743,667,614.75 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 | |
|----|--------------------|----------------------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币万元） |
| | | 本期末 2016年6月30日 |
| | 市场利率下降 25 个基点 | 增加约 195 |
| | 市场利率上升 25 个基点 | 减少约 194 |

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于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%；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%。本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2016年6月30日 | |
|--------------|-------------------|------------------|
| | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资 | 24,807,940.53 | 3.34 |

| | | |
|---------------|----------------------|-------------|
| 交易性金融资产—基金投资 | - | - |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | | |
| 衍生金融资产—权证投资 | - | - |
| 其他 | | |
| 合计 | 24,807,940.53 | 3.34 |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于2016年6月30日，由于本基金运行期间不足一年，尚不存在足够的经验数据，因此无法对本基金资产净值对于其他价格风险的敏感性作定量分析。

§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 | 24,807,940.53 | 2.56 |
| | 其中：股票 | 24,807,940.53 | 2.56 |
| 2 | 固定收益投资 | 932,364,253.50 | 96.28 |
| | 其中：债券 | 932,364,253.50 | 96.28 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 959,210.47 | 0.10 |
| 7 | 其他各项资产 | 10,299,139.43 | 1.06 |
| 8 | 合计 | 968,430,543.93 | 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 | 1,295,000.00 | 0.17 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 14,323,579.47 | 1.93 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 432,458.24 | 0.06 |
| F | 批发和零售业 | 3,033,000.00 | 0.41 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 610,586.10 | 0.08 |
| J | 金融业 | 1,524,000.00 | 0.20 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 20,126.10 | 0.00 |
| 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 | 580,400.00 | 0.08 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 2,988,790.62 | 0.40 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 24,807,940.53 | 3.34 |

7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过沪港通投资的股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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 | 600519 | 贵州茅台 | 16,000 | 4,670,720.00 | 0.63 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 2 | 000963 | 华东医药 | 45,000 | 3,033,000.00 | 0.41 |
| 3 | 600276 | 恒瑞医药 | 72,000 | 2,887,920.00 | 0.39 |
| 4 | 601166 | 兴业银行 | 100,000 | 1,524,000.00 | 0.20 |
| 5 | 300144 | 宋城演艺 | 60,000 | 1,494,600.00 | 0.20 |
| 6 | 300133 | 华策影视 | 95,966 | 1,494,190.62 | 0.20 |
| 7 | 600521 | 华海药业 | 52,000 | 1,264,640.00 | 0.17 |
| 8 | 002582 | 好想你 | 30,000 | 1,185,600.00 | 0.16 |
| 9 | 300203 | 聚光科技 | 40,000 | 1,056,000.00 | 0.14 |
| 10 | 000821 | 京山轻机 | 50,000 | 881,000.00 | 0.12 |
| 11 | 600066 | 宇通客车 | 40,000 | 792,000.00 | 0.11 |
| 12 | 002041 | 登海种业 | 50,000 | 777,000.00 | 0.10 |
| 13 | 300347 | 泰格医药 | 20,000 | 580,400.00 | 0.08 |
| 14 | 300166 | 东方国信 | 20,000 | 549,400.00 | 0.07 |
| 15 | 300463 | 迈克生物 | 20,000 | 541,400.00 | 0.07 |
| 16 | 002299 | 圣农发展 | 20,000 | 518,000.00 | 0.07 |
| 17 | 300367 | 东方网力 | 20,000 | 496,600.00 | 0.07 |
| 18 | 601611 | 中国核建 | 20,672 | 432,458.24 | 0.06 |
| 19 | 601127 | 小康股份 | 8,662 | 206,761.94 | 0.03 |
| 20 | 601966 | 玲珑轮胎 | 6,246 | 81,073.08 | 0.01 |
| 21 | 603131 | 上海沪工 | 1,263 | 76,664.10 | 0.01 |
| 22 | 300515 | 三德科技 | 1,355 | 63,508.85 | 0.01 |
| 23 | 300518 | 盛讯达 | 1,306 | 61,186.10 | 0.01 |
| 24 | 002799 | 环球印务 | 1,080 | 47,131.20 | 0.01 |
| 25 | 603958 | 哈森股份 | 2,372 | 34,394.00 | 0.00 |
| 26 | 002802 | 洪汇新材 | 1,629 | 24,565.32 | 0.00 |
| 27 | 603909 | 合诚股份 | 1,095 | 20,126.10 | 0.00 |

| | | | | | |
|----|--------|-----|-------|-----------|------|
| 28 | 603016 | 新宏泰 | 1,602 | 13,600.98 | 0.00 |
|----|--------|-----|-------|-----------|------|

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末基金资产净值 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 | 占期末基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|--------------|-----------------|
| 1 | 600276 | 恒瑞医药 | 9,702,228.25 | 1.30 |
| 2 | 600519 | 贵州茅台 | 4,720,000.00 | 0.63 |
| 3 | 002582 | 好想你 | 4,216,700.00 | 0.57 |
| 4 | 000963 | 华东医药 | 3,808,824.56 | 0.51 |
| 5 | 300144 | 宋城演艺 | 2,781,103.09 | 0.37 |
| 6 | 300203 | 聚光科技 | 2,017,775.00 | 0.27 |
| 7 | 000892 | 星美联合 | 1,618,124.15 | 0.22 |
| 8 | 601166 | 兴业银行 | 1,545,000.00 | 0.21 |
| 9 | 300133 | 华策影视 | 1,518,595.99 | 0.20 |
| 10 | 600257 | 大湖股份 | 1,219,865.76 | 0.16 |
| 11 | 002152 | 广电运通 | 1,197,087.58 | 0.16 |
| 12 | 600521 | 华海药业 | 1,107,428.17 | 0.15 |
| 13 | 002364 | 中恒电气 | 893,076.60 | 0.12 |
| 14 | 300141 | 和顺电气 | 811,248.00 | 0.11 |
| 15 | 600066 | 宇通客车 | 807,360.00 | 0.11 |
| 16 | 002041 | 登海种业 | 765,790.00 | 0.10 |
| 17 | 000821 | 京山轻机 | 756,965.00 | 0.10 |
| 18 | 601199 | 江南水务 | 744,009.00 | 0.10 |
| 19 | 600172 | 黄河旋风 | 642,305.77 | 0.09 |

| | | | | |
|----|--------|------|------------|------|
| 20 | 300347 | 泰格医药 | 594,673.00 | 0.08 |
|----|--------|------|------------|------|

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末基金资产净值 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 | 占期末基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------------|----------------|
| 1 | 600276 | 恒瑞医药 | 6,594,559.80 | 0.89 |
| 2 | 002582 | 好想你 | 3,923,948.72 | 0.53 |
| 3 | 000892 | 星美联合 | 1,567,146.00 | 0.21 |
| 4 | 002152 | 广电运通 | 1,285,805.00 | 0.17 |
| 5 | 600257 | 大湖股份 | 1,200,144.00 | 0.16 |
| 6 | 300144 | 宋城演艺 | 1,123,352.40 | 0.15 |
| 7 | 300203 | 聚光科技 | 1,042,483.01 | 0.14 |
| 8 | 600519 | 贵州茅台 | 1,038,806.00 | 0.14 |
| 9 | 300141 | 和顺电气 | 952,859.00 | 0.13 |
| 10 | 002364 | 中恒电气 | 919,925.04 | 0.12 |
| 11 | 601199 | 江南水务 | 749,874.00 | 0.10 |
| 12 | 000963 | 华东医药 | 699,600.00 | 0.09 |
| 13 | 600172 | 黄河旋风 | 664,152.32 | 0.09 |
| 14 | 300100 | 双林股份 | 624,400.00 | 0.08 |
| 15 | 002797 | 第一创业 | 269,750.00 | 0.04 |
| 16 | 300516 | 久之洋 | 255,812.10 | 0.03 |
| 17 | 603528 | 多伦科技 | 225,696.08 | 0.03 |
| 18 | 300512 | 中亚股份 | 156,562.34 | 0.02 |
| 19 | 300511 | 雪榕生物 | 155,707.63 | 0.02 |

| | | | | |
|----|--------|-----|------------|------|
| 20 | 603737 | 三棵树 | 149,420.20 | 0.02 |
|----|--------|-----|------------|------|

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 | 44,837,020.21 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 24,237,352.24 |

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 | 49,978,000.00 | 6.72 |
| | 其中：政策性金融债 | 49,978,000.00 | 6.72 |
| 4 | 企业债券 | 53,821,253.50 | 7.24 |
| 5 | 企业短期融资券 | 640,171,000.00 | 86.08 |
| 6 | 中期票据 | 188,394,000.00 | 25.33 |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 932,364,253.50 | 125.37 |

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(元) | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 101452005 | 14 华能集 MTN002 | 600,000 | 64,224,000.00 | 8.64 |

| | | | | | |
|---|-----------|-------------------|---------|---------------|------|
| 2 | 101354015 | 13 南电 MTN002 | 500,000 | 52,580,000.00 | 7.07 |
| 3 | 101551020 | 15 中油股 MTN001 | 500,000 | 50,970,000.00 | 6.85 |
| 4 | 011699511 | 16 大渡河 SCP001 | 500,000 | 50,035,000.00 | 6.73 |
| 5 | 011699493 | 16 建发集 SCP002 | 500,000 | 50,005,000.00 | 6.72 |
| 5 | 011699522 | 16 顺鑫控股 SCP001 | 500,000 | 50,005,000.00 | 6.72 |
| 5 | 011699496 | 16 渝水务 SCP003 | 500,000 | 50,005,000.00 | 6.72 |

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|-------------------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 101452005 | 14 华能集 MTN002 | 600,000 | 64,224,000.00 | 8.64 |
| 2 | 101354015 | 13 南电 MTN002 | 500,000 | 52,580,000.00 | 7.07 |
| 3 | 101551020 | 15 中油股 MTN001 | 500,000 | 50,970,000.00 | 6.85 |
| 4 | 011699511 | 16 大渡河 SCP001 | 500,000 | 50,035,000.00 | 6.73 |
| 5 | 011699493 | 16 建发集 SCP002 | 500,000 | 50,005,000.00 | 6.72 |
| 5 | 011699522 | 16 顺鑫控股 SCP001 | 500,000 | 50,005,000.00 | 6.72 |
| 5 | 011699496 | 16 渝水务 SCP003 | 500,000 | 50,005,000.00 | 6.72 |

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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 | 41,130.48 |
| 2 | 应收证券清算款 | 919,531.56 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 9,258,986.13 |
| 5 | 应收申购款 | 79,491.26 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 10,299,139.43 |

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 |
| 1,705 | 432,034.71 | 499,499,500.50 | 67.81% | 237,119,672.57 | 32.19% |

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 | - | - |

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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金 | 0 |
| 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（2016年2月17日）基金份额总额 | 264,790,092.60 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 | 500,102,655.60 |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回 | 28,273,575.13 |

| | |
|------------------------|----------------|
| 回份额 | |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 736,619,173.07 |

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：本报告期内，经公司第四届董事会第九次会议审议通过，乔宏军先生不再担任公司副总经理职务。基金管理人就上述重大人事变动已按照相关规定向监管部门报告并履行了必要的信息披露程序。

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

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

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。

10.6 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

针对中国证监会在2015年“两加强两遏制”检查后就公司内部控制提出的改进意见及采取责令改正的行政监管措施，以及上海证监局于本报告期内对公司相关负责人的警示，公司认真落实整改要求，完成相关问题的整改并向监管部门上报专项报告。整改工作中，公司进一步加强制度建设和风控措施，提升公司内部控制和风险管理水平。

除上述情况外,报告期内管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

(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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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 | |
| 安信证券股份有限公司 | 2 | 68,321,648.16 | 100.00% | 63,628.00 | 100.00% | - |

10.7.2 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 |
| 安信证券股份有限公司 | 54,369,183.93 | 100.00% | 1,806,500.00 | 100.00% | - | - |

注：1、报告期内基金交易单元未发生变化；

2、租用证券公司专用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、租用证券公司专用交易单元的程序：首先根据租用证券公司专用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专用交易单元。研究部提交方案，并上报公司批准。

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日 |
|----|------|--------|-------|
|----|------|--------|-------|

| | | | 期 |
|----|---|------------------|------------|
| 1 | 交银施罗德卓越回报灵活配置混合型证券投资基金基金份额发售公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016-01-06 |
| 2 | 交银施罗德卓越回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同摘要 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016-01-06 |
| 3 | 交银施罗德卓越回报灵活配置混合型证券投资基金招募说明书 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016-01-06 |
| 4 | 交银施罗德基金管理有限公司关于增加上海利得基金销售有限公司和北京乐融多源投资咨询有限公司为交银施罗德卓越回报灵活配置混合型证券投资基金销售机构的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016-01-13 |
| 5 | 交银施罗德基金管理有限公司关于增加上海陆金所资产管理有限公司和上海凯石财富基金销售有限公司为交银施罗德卓越回报灵活配置混合型证券投资基金销售机构的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016-01-18 |
| 6 | 交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德卓越回报灵活配置混合型证券投资基金延长募集期限的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016-01-28 |
| 7 | 交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德卓越回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016-02-18 |
| 8 | 交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德卓越回报灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、定期定额投资业务并参与部分销售机构申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016-03-16 |
| 9 | 交银施罗德基金管理有限公司关于调整投资者场外投资旗下部分基金单笔最低赎回份额限制的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016-03-25 |
| 10 | 交银施罗德基金管理有限公司关于网上直销交易平台关闭支付宝基金网上支付服务的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016-05-10 |
| 11 | 交银施罗德基金管理有限公司关于旗下基金所持停牌股票估值调整的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016-06-02 |
| 12 | 交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司基金网上银行、手机银行前端申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016-06-29 |
| 13 | 交银施罗德基金管理有限公司关于增加北京汇成基金销售有限公司为旗下部分基金的场外销售机构并参与电子交易平台基金前端申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016-06-29 |

§11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予交银施罗德卓越回报灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《交银施罗德卓越回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《交银施罗德卓越回报灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《交银施罗德卓越回报灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、关于申请募集注册交银施罗德卓越回报灵活配置混合型证券投资基金的法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、报告期内交银施罗德卓越回报灵活配置混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

11.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

11.3 查阅方式

投资者可在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅备查文件，或者登录基金管理人的网站(www.fund001.com, www.bocomschroder.com)查阅。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人交银施罗德基金管理有限公司。本公司客户服务中心电话：400-700-5000（免长途话费），021-61055000，电子邮件：services@jysld.com。