

**上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金**  
**2016 年年度报告摘要**  
**2016 年 12 月 31 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：二〇一七年三月二十九日

## § 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(以下简称“中国农业银行”)根据本基金合同规定，于 2017 年 3 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	交银上证 180 公司治理 ETF
场内简称	治理 ETF
基金主代码	510010
交易代码	510010
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2009 年 9 月 25 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	520,524,362 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2009 年 12 月 15 日

注：本表所列的基金主代码 510010 为本基金二级市场交易代码，本基金一级市场申购赎回代码为 510011。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。
投资策略	本基金采用完全复制法，跟踪上证 180 公司治理指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。
业绩比较基准	上证 180 公司治理指数
风险收益特征	本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，紧密跟踪标的指数，具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。

## 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	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙艳	林葛
	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

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fund001.com, www.bocomschroder.com
基金年度报告备置地点	基金管理人的办公场所

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	14,350,453.38	402,333,204.87	426,435,114.77
本期利润	-29,389,639.28	173,016,612.40	1,010,245,629.65
加权平均基金份额本期利润	-0.0416	0.1635	0.3434
本期基金份额净值增长率	-6.48%	-3.27%	69.15%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配基金份额利润	0.068	0.099	-0.026

期末基金资产净值	503,136,621.18	673,466,951.24	2,026,435,361.07
期末基金份额净值	0.967	1.034	1.069

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
过去三个月	4.77%	0.74%	4.98%	0.74%	-0.21%	0.00%
过去六个月	10.64%	0.74%	9.29%	0.73%	1.35%	0.01%
过去一年	-6.48%	1.36%	-8.36%	1.35%	1.88%	0.01%
过去三年	53.01%	1.82%	43.35%	1.83%	9.66%	-0.01%
过去五年	61.17%	1.67%	44.23%	1.68%	16.94%	-0.01%
自基金合同生效起至今	7.62%	1.60%	5.52%	1.62%	2.10%	-0.02%

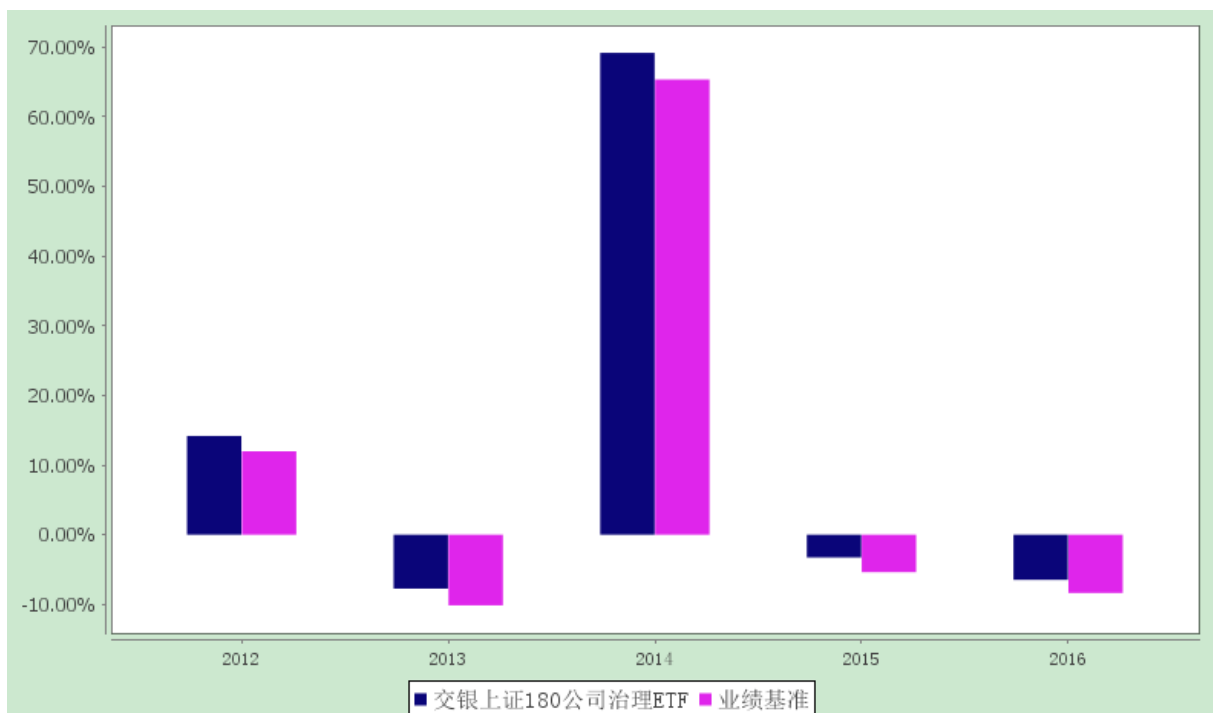
注：本基金的业绩比较基准为上证 180 公司治理指数。

### 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



注：本基金建仓期为自基金合同生效日起的3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。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每 10 份基金 份额分 红数	现金形式发放 总额	再投资形式发 放总额	年度利润分配 合计	备注
2016 年	-	-	-	-	-
2015 年	-	-	-	-	-
2014 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

## § 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 69 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		
蔡铮	交银环球精选混合(QDII)、交银上证 180 公司治理 ETF 及其	2012-12-27	-	7 年	蔡铮先生，中国国籍，复旦大学电子工程硕士。历任瑞士银行香港分行分析员。2009 年加入交

	联接、交银深证 300 价值 ETF 及其联接、交银全球资源混合(QDII)、交银国证新能源指数分级、交银中证海外中国互联网指数 (QDII-LOF)、交银中证互联网金融指数分级、交银中证环境治理指数 (LOF) 的基金经理，公司量化投资部副总经理			银施罗德基金管理有限公司，历任投资研究部数量分析师、基金经理助理、量化投资部助理总经理。2012 年 12 月 27 日至 2015 年 6 月 30 日担任交银施罗德沪深 300 行业分层等权重指数证券投资基金基金经理。2015 年 8 月 13 日至 2016 年 7 月 18 日担任交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	---

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 公平交易制度和控制方法

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所管理的所有资产组合投资运作的公平。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。制度中包含的主要控制方法如下：

(1) 公司建立资源共享的投资研究信息平台，所有研究成果对所有投资组合公平开放，确保各投资组合在获得研究支持和实施投资决策方面享有公平的机会。

(2) 公司将投资管理职能和交易执行职能相隔离，实行集中交易制度，建立了合理且可操作的公平交易分配机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。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。

(3) 公司建立了清晰的投资授权制度，明确各层级投资决策主体的职责和权限划分，组合投资经理充分发挥专业判断能力,不受他人干预,在授权范围内独立行使投资决策权，维护公平的投资管理环境，维护所管理投资组合的合法利益,保证各投资组合交易决策的客观性和独立性，防范不公平及异常交易的发生。

(4) 公司建立统一的投资对象备选库和交易对手备选库，制定明确的备选库建立、维护程序。在全公司适用股票、债券备选库的基础上，根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和关联交易限制等，按需要建立不同投资组合的投资对象风格库和交易对手备选库，组合经理在此基础上根据投资授权构建投资组合。

(5) 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投资组合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。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合。通过投资交易监控、交易数据分析、专项稽核检查等，本基金管理人未发现任何违反公平交易制度的行为。

### 4.3.3 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 2 次，是投资组合因投资策略或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

2016 年国内经济增速仍呈现弱企稳的态势，内需疲软，面临一定的不确定性，经济基本面对资本市场的支持力度较为有限。A 股市场在上半年表现出大幅向下后盘整震荡的格局，1 月份市场在熔断机制的磁吸效应的影响下、在人民币贬值风险的担忧中大幅快速下跌，此后 2、3 月份随着人民币汇率企稳、银行信贷投入加大、经济数据有所好转等利好因素，市场总体表现出震荡格局。4-6 月份随着美元加息预期的反复、英国脱欧事件以及国内局部流动性和信用违约等宏观风险的释放，整体市场的风险偏好有所修复。第三季度工业增加值和 PPI 继续回落，经济增长和企业盈利下行压力较大，同时货币政策延续宽松。随着监管层扩大清理配资范围以及人民币贬值影响，市场出现大幅下跌。进入到 10 月、11 月，市场整体表现较强，行至 12 月初房地产结构性调控政策、部分金融领域去杠杆引发了一定短期流动性风险，并对债券市场产生一定扰动，A 股市场随之出现一定程度的调整。作为跟踪基准指数的指数基金，在 2016 年度总体呈现出快速下挫后震荡上行的走势。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 12 月 31 日，本基金份额净值 0.967 元，本报告期份额净值增长率为-6.48%，同期业绩比较基准增长率为-8.36%。

#### 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 2017 年，国内经济已有所企稳，处于阶段性弱复苏期间，预计将继续维持温和增长的态势。我们对经历了调整后的 A 股市场总体维持乐观的看法。

#### 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**

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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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 审计报告

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）对上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金 2016 年 12 月 31 日的资产负债表，2016 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注出具了标准无保留意见的审计报告【普华永道中天审字(2017)第 20176 号】。投资者可通过本基金年度报告正文查看该审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金  
报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	4,420,616.90	10,060,255.22
结算备付金		316.03	2,271.22
存出保证金		6,617.23	123,700.46
交易性金融资产	7.4.7.2	499,474,841.40	669,337,860.02
其中：股票投资		499,474,841.40	669,337,860.02
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	975.92	2,276.90
应收股利		-	-
应收申购款		-	-

递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		503,903,367.48	679,526,363.82
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年12月31日</b>	<b>上年度末 2015年12月 31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	5,227,707.67
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		243,669.08	272,808.45
应付托管费		48,733.81	54,561.69
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	64,343.41	94,334.77
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	410,000.00	410,000.00
负债合计		766,746.30	6,059,412.58
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	467,597,333.19	585,277,225.07
未分配利润	7.4.7.10	35,539,287.99	88,189,726.17
所有者权益合计		503,136,621.18	673,466,951.24
负债和所有者权益总计		503,903,367.48	679,526,363.82

注：1、报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.967 元，基金份额总额 520,524,362.00 份。

2、本摘要中资产负债表和利润表所列附注号为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年度报告正文。

## 7.2 利润表

会计主体：上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日 至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		<b>-24,452,443.90</b>	<b>182,270,330.78</b>
1.利息收入		47,318.98	99,523.48
其中：存款利息收入	7.4.7.11	47,294.01	99,478.62
债券利息收入		24.97	44.86
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		19,233,244.47	408,765,923.70
其中：股票投资收益	7.4.7.12	1,513,248.13	388,024,806.70
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	20,747.43	136,121.54
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	17,699,248.91	20,604,995.46
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-43,740,092.66	-229,316,592.47
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	7,085.31	2,721,476.07
<b>减：二、费用</b>		<b>4,937,195.38</b>	<b>9,253,718.38</b>
1. 管理人报酬		3,217,235.19	6,045,188.46
2. 托管费		643,447.05	1,209,037.57
3. 销售服务费		-	-



4. 交易费用	7.4.7.19	436,218.75	1,194,811.49
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	640,294.39	804,680.86
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-29,389,639.28</b>	<b>173,016,612.40</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-29,389,639.28</b>	<b>173,016,612.40</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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）	585,277,225.07	88,189,726.17	673,466,951.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-29,389,639.28	-29,389,639.28
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）	-117,679,891.88	-23,260,798.90	-140,940,690.78
其中：1.基金申购款	156,307,642.80	-4,936,929.27	151,370,713.53
2.基金赎回款	-273,987,534.68	-18,323,869.63	-292,311,404.31
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	467,597,333.19	35,539,287.99	503,136,621.18

益（基金净值）			
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31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）	1,702,787,038.34	323,648,322.73	2,026,435,361.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	173,016,612.40	173,016,612.40
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）	-1,117,509,813.27	-408,475,208.96	-1,525,985,022.23
其中：1.基金申购款	20,515,827,261.10	6,724,667,884.54	27,240,495,145.64
2.基金赎回款	-21,633,337,074.37	-7,133,143,093.50	-28,766,480,167.87
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）	585,277,225.07	88,189,726.17	673,466,951.24

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金（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[2009]第 795 号《关于核准上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》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《上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，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 1,009,243,480.00 元(含募集股票市值)，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 (2009)第 179 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2009 年 9 月 25 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,009,284,164.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 40,684.00 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《上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的基金管理人交银施罗德基金管理有限公司确定 2009 年 12 月 4 日为本基金的基金份额折算日。当日上证 180 公司治理指数收盘值为 938.90 点,基金资产净值为 1,054,880,523.33 元,折算前基金份额总额为 1,009,284,164.00 份,折算前基金份额净值为 1.045 元。根据基金份额折算公式,基金份额折算比例为 1.11319302,折算后基金份额总额为 1,123,524,362.00 份,折算后基金份额净值为 0.939 元。交银施罗德基金管理有限公司已根据上述折算比例,对各基金份额持有人认购的基金份额进行了折算,并由基金注册登记人中国证券登记结算有限责任公司于 2009 年 12 月 7 日进行了变更登记。经上海证券交易所(以下简称“上交所”)上证债字[2009]第 215 号文审核同意,本基金于 2009 年 12 月 15 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数上证 180 公司治理指数,追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化;主要投资范围为标的指数的成份股和备选成份股,该部分资产比例不低于基金资产净值的 95%;本基金也可少量投资于新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。在正常市场情况下,本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.1%,年跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为上证 180 公司治理指数。

交银施罗德基金管理有限公司以本基金为目标 ETF,于 2009 年 9 月 29 日募集成立了交银施罗德上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“180 公司治理 ETF 联接基金”)。180 公司治理 ETF 联接基金为契约型开放式基金,投资目标与本基金类似,将绝大多数基金资产投资于本基金。

本财务报表由本基金的基金管理人交银施罗德基金管理有限公司于 2017 年 3 月 24 日批准报出。

#### 7.4.2 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》、《上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

### 7.4.3 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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 7.4.4 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。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 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。

#### 7.4.5.2 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。

#### 7.4.5.3 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。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)于 2016 年 5 月 1 日前，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。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。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。

(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。

#### 7.4.7 关联方关系

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
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	基金托管人
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	基金管理人的股东
施罗德投资管理有限公司	基金管理人的股东
中国国际海运集装箱(集团)股份有限公司	基金管理人的股东
交银施罗德上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金(“180 公司治理 ETF 联接基金”)	本基金的基金管理人管理的其他基金
交银施罗德资产管理有限公司	基金管理人的子公司
上海直源投资管理有限公司	受基金管理人控制的公司
交烨投资管理(上海)有限公司	受基金管理人控制的公司

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。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 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。

##### 7.4.8.2 关联方报酬

###### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日

当期发生的基金应支付的管理费	3,217,235.19	6,045,188.46
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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。

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	643,447.05	1,209,037.57

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.1% 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 × 0.1% ÷ 当年天数。

#### 7.4.8.2.3 销售服务费

无。

#### 7.4.8.3 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。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 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。

##### 7.4.8.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金	持有的基金份额	持有的基金份额占基金

		总份额的比 例		总份额的比 例
180 公司治理 ETF 联接基金	479,424,699.00	92.10%	607,424,699.00	93.23%

#### 7.4.8.5 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		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年12月31日		2015年1月1日至2015年12月31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	4,420,616.90	44,957.61	10,060,255.22	72,335.95

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。

#### 7.4.8.6 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。

#### 7.4.8.7 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。

### 7.4.9 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

#### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

#### 7.4.9.2 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 (单位：股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
600406	国电南 瑞	2016-12- 28	重大事项	16.63	-	-	178,324	2,594,402.70	2,965,528.12	-
600645	中源协 和	2016-12- 13	重大事项	26.80	-	-	36,300	1,199,544.20	972,840.00	-
600649	城投控 股	2016-12- 06	重大事项	20.34	-	-	176,400	3,298,676.15	3,587,976.00	-
601727	上海电 气	2016-08- 31	重大事项	8.42	-	-	355,100	3,797,834.40	2,989,942.00	-

注：本基金截至2016年12月31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。

#### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

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。

#### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 基金申购款

于 2016 年度，本基金申购基金份额的对价总额为 151,370,713.53 元(2015 年：27,240,495,145.64 元)，其中包括以股票支付的申购款 147,395,589.00 元和以现金支付的申购款 3,975,124.53 元(2015 年：以股票支付的申购款 25,658,116,437.50 元和以现金支付的申购款 1,582,378,708.14 元)。

##### (2) 公允价值

###### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

###### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

###### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层次的余额为 488,958,555.28 元，属于第二层次的余额为 10,516,286.12 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 640,441,217.87 元，第二层次 28,896,642.15 元，无第三层次)。

###### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。

###### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

###### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015 年 12 月 31 日：无)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(3) 除基金申购款和公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	499,474,841.40	99.12
	其中：股票	499,474,841.40	99.12
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	4,420,932.93	0.88
7	其他各项资产	7,593.15	0.00
8	合计	503,903,367.48	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

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	1,020,454.32	0.20
B	采矿业	21,643,882.79	4.30
C	制造业	101,183,248.05	20.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	26,520,106.94	5.27
E	建筑业	44,603,324.85	8.87
F	批发和零售业	9,316,225.96	1.85
G	交通运输、仓储和邮政业	14,828,236.32	2.95
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,413,836.45	3.26
J	金融业	230,895,166.00	45.89
K	房地产业	28,605,947.19	5.69
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	972,840.00	0.19
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	987,310.53	0.20
S	综合	2,484,262.00	0.49
	合计	499,474,841.40	99.27

### 8.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

### 8.2.3 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。

## 8.3 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

### 8.3.1 期末指数投资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	601318	中国平安	1,362,800	48,284,004.00	9.60
2	601166	兴业银行	1,678,962	27,098,446.68	5.39
3	600016	民生银行	2,973,619	27,000,460.52	5.37
4	600036	招商银行	1,296,082	22,811,043.20	4.53
5	600000	浦发银行	1,086,204	17,607,366.84	3.50
6	601668	中国建筑	1,888,346	16,730,745.56	3.33
7	601398	工商银行	2,709,751	11,950,001.91	2.38
8	601766	中国中车	1,152,590	11,260,804.30	2.24
9	601601	中国太保	390,699	10,849,711.23	2.16
10	601211	国泰君安	575,792	10,703,973.28	2.13

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年度报告正文。

### 8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 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	601318	中国平安	62,965,593.42	9.35
2	601211	国泰君安	14,145,281.16	2.10
3	601985	中国核电	5,838,013.05	0.87
4	600266	北京城建	3,998,594.00	0.59
5	600900	长江电力	3,668,674.80	0.54
6	600153	建发股份	3,101,495.50	0.46
7	600085	同仁堂	2,751,426.50	0.41
8	601390	中国中铁	2,702,568.00	0.40
9	600497	驰宏锌锗	2,512,704.00	0.37
10	601186	中国铁建	2,187,294.35	0.32
11	601398	工商银行	2,068,813.00	0.31
12	600737	中粮屯河	2,038,156.00	0.30
13	600037	歌华有线	1,991,535.84	0.30
14	600704	物产中大	1,990,277.00	0.30
15	600645	中源协和	1,948,399.00	0.29
16	600549	厦门钨业	1,839,246.00	0.27
17	601699	潞安环能	1,769,979.00	0.26

18	600435	北方导航	1,683,612.18	0.25
19	600094	大名城	1,628,588.00	0.24
20	600325	华发股份	1,571,324.00	0.23

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。

#### 8.4.2 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	600030	中信证券	23,348,223.73	3.47
2	600837	海通证券	22,593,157.88	3.35
3	601688	华泰证券	10,637,910.32	1.58
4	600016	民生银行	10,555,144.00	1.57
5	601377	兴业证券	7,759,878.65	1.15
6	600000	浦发银行	5,784,577.00	0.86
7	600011	华能国际	5,096,516.55	0.76
8	600705	中航资本	4,499,579.36	0.67
9	600309	万华化学	3,281,542.30	0.49
10	601333	广深铁路	2,699,072.00	0.40
11	600583	海油工程	2,661,484.15	0.40
12	600256	广汇能源	2,400,653.44	0.36
13	600875	东方电气	2,119,279.46	0.31
14	600027	华电国际	2,058,629.00	0.31
15	601117	中国化学	2,056,533.99	0.31
16	601398	工商银行	1,922,532.00	0.29
17	600999	招商证券	1,910,149.00	0.28
18	600266	北京城建	1,904,871.00	0.28
19	601898	中煤能源	1,783,825.00	0.26
20	600435	北方导航	1,756,991.55	0.26

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。

#### 8.4.3 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	152,915,259.24
卖出股票的收入（成交）总额	139,244,648.16

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。

#### **8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合**

本基金本报告期末未持有债券。

#### **8.6 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**

本基金本报告期末未持有债券。

#### **8.7 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。

#### **8.8 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。

#### **8.9 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。

#### **8.10 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。

#### **8.11 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。

#### **8.12 投资组合报告附注**

**8.12.1** 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体除国泰君安（证券代码：601211）外，未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

报告期内本基金投资的前十名证券之一国泰君安（证券代码：601211）于2016年3月1日公告，公司因违反了《中国证监会关于进一步推进全国中小企业股份转让系统发展的若干意见》、《证券公司内部控制指引》等相关规定，于2016年2月26日收到中国证券监督管理委员会上海监管局《关于对国泰君安证券股份有限公司采取限制新增做市业务等监管措施的决定》（沪证监决[2016]15号）。据此，中国证券监督管理委员会上海监管局决定：（一）限制公司新增新三板做市业务，期限自2016年2月29日至2016年5月29日止。（二）责令公司在2016年3月1日至2016年9月30日期间，每3个月对做市业务部门开展一次内部合规检查，并在每次检查后10个工作日

内，向中国证券监督管理委员会上海监管局书面报送合规检查报告。（三）责令公司在收到本决定书之日起 10 个工作日内，根据公司内部制度规定，对场外市场部做市部门负责人王仕宏做出处分的决定，并在作出决定之日起 3 个工作日内向中国证券监督管理委员会上海监管局书面报告。

本基金遵循指数化投资理念，绝大部分资产采用完全复制法跟踪指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。本基金对该证券的投资遵守本基金管理人基金投资管理相关制度及被动式指数化投资策略。

**8.12.2** 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。

### 8.12.3 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	6,617.23
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	975.92
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,593.15

### 8.12.4 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。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

### 8.12.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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		交银施罗德上证 180 公司治理交易型 开放式指数证券投资 基金联接基金	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
2,796	186,167.5 1	10,927,618. 00	2.10%	30,172,045. 00	5.80%	479,424,69 9.00	92.10%

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中国农业银行—交银施罗德上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金	607,424,699.00	92.10%
2	潮域投资咨询（上海）有限公司	7,431,266.00	1.41%
3	金念球	3,448,000.00	0.66%
4	国信证券股份有限公司	2,106,400.00	0.53%
5	袁义军	1,880,200.00	0.34%
6	严天一	1,113,193.00	0.21%
7	王佳音	1,035,100.00	0.20%
8	李玉英	876,500.00	0.17%
9	国信证券股份有限公司融券专用证券账户	674,282.00	0.13%
10	张苏娇	632,800.00	0.13%

### 9.3 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	-	-

### 9.4 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
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2009年9月25日)基金份额总额	1,009,284,164
本报告期期初基金份额总额	651,524,362
本报告期基金总申购份额	174,000,000
减：本报告期基金总赎回份额	305,000,000
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	520,524,362

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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。经公司第四届董事会第十四次会议审议通过，印皓女士担任公司副总经理。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。

### 11.3 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。

### 11.4 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。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），本期审计费用为 80,000.00 元。自本基金基金合同生效以来，本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

### 11.6 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

公司于 2016 年 1 月和 10 月接受来自上海证监局和中国证监会的现场检查，并于报告期内收到监管部门对公司相关负责人的警示。公司已认真落实整改要求，加强制度和风控措施，进一步提升了公司内部控制和风险管理能力，并向监管部门进行了报告。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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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	
中信证券股份有限公司	2	291,148,132.96	100.00%	271,146.33	100.00%	-

#### 11.7.2 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
中信证券股份有限公司	376,772.40	100.00%	-	-	-	-

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。

交银施罗德基金管理有限公司  
 二〇一七年三月二十九日