

交银施罗德中证海外中国互联网指数型证券投资基金  
(LOF)

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	交银中证海外中国互联网指数(QDII-LOF)
场内简称	中国互联
基金主代码	164906
交易代码	164906
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2015年5月27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	441,902,540.74 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳交易所
上市日期	2015年7月10日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。本基金力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 5%。
投资策略	本基金为指数型基金，原则上采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数，即按照中证海外中国互联网指数中的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。
业绩比较基准	中证海外中国互联网指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金是一只股票型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于承担较高风险、预期收益较高的证券投资基金品种。同时本基金为指数型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。

## 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 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	JPMorgan Chase Bank, National Association HONG KONG BRANCH
	中文	-	摩根大通银行香港分行
注册地址		-	One Island East, Floor 54, Quarry Bay, Hong Kong.
办公地址		-	One Island East, Floor 54, Quarry Bay, Hong Kong.
邮政编码		-	-

## 2.5 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 5 月 27 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	5,857,638.97	-27,810,753.90
本期利润	-13,570,589.47	-47,776,255.60
加权平均基金份额本期利润	-0.0252	-0.0677
本期基金份额净值增长率	-3.41%	-3.30%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.066	-0.036
期末基金资产净值	412,619,421.01	581,868,615.24
期末基金份额净值	0.934	0.967

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	-10.71%	1.19%	-13.70%	1.15%	2.99%	0.04%
过去六个月	8.10%	1.12%	4.36%	1.28%	3.74%	-0.16%
过去一年	-3.41%	1.32%	-8.19%	1.44%	4.78%	-0.12%
自基金合同生效起至今	-6.60%	1.55%	-15.17%	1.70%	8.57%	-0.15%

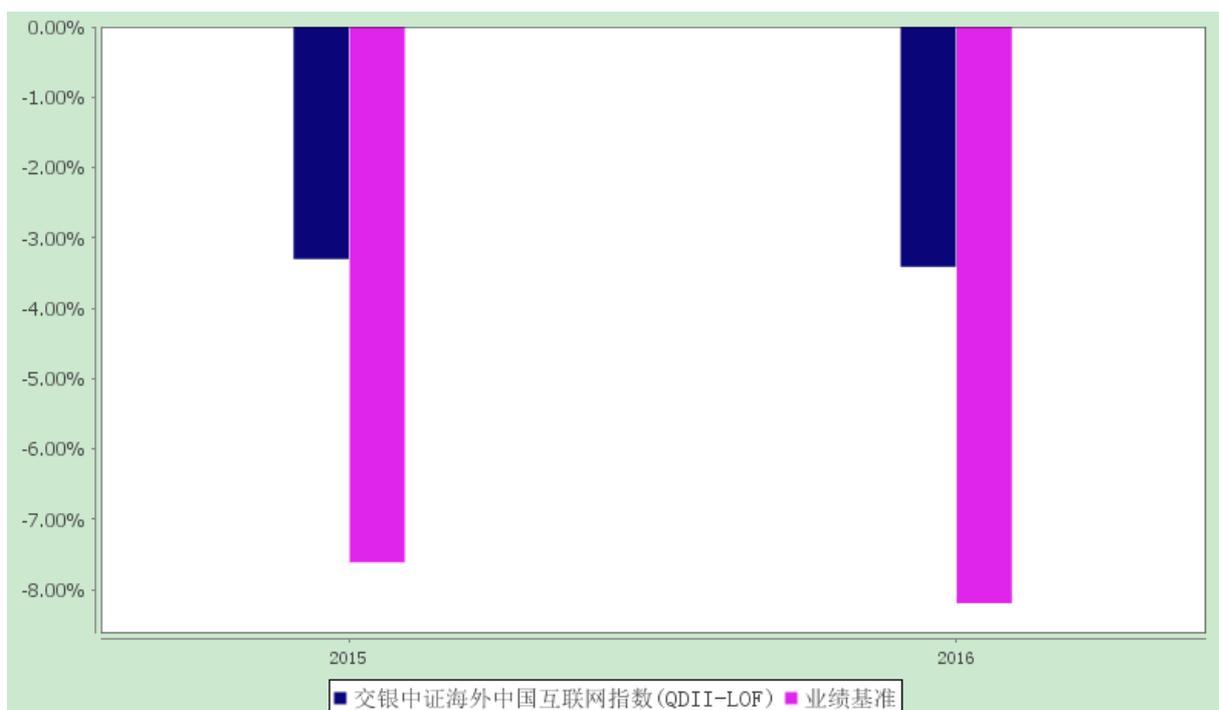
注：本基金的业绩比较基准为中证海外中国互联网指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%，每日进行再平衡过程。

### 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



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。

### 3.2.3 自基金合同生效以来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



注：图示日期为2015年5月27日至2016年12月31日。基金合同生效当年的净值增

长率按照当年实际存续期计算。

### 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	-	-	-	-	-
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	交银环球精选混合(QDII)、交	2015-05-27	-	7	蔡铮先生，中国国

铮	银上证 180 公司治理 ETF 及其联接、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			年	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年上半年，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。同期港股受到A股影响也大幅下挫后反弹，美股大致处于震荡向上区间，但中概股也因受到A股拖累而在年初下挫。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，A股市场出现大幅下跌。同期港股受到A股影响也大幅下挫，美股大致处于震荡区间。第四季度欧美市场风险偏好有所回升，欧美和香港市场表现出不同走势。10、11月份欧美市场总体震荡，美国大选明朗后，欧美股市普遍出现上涨，但随着人民币贬值压力加大，A股和港股市场出现了较大幅度回撤。作为跟踪中证海外中国互联网指数的指数基金，在本年度呈现出宽幅震荡的走势。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2016年12月31日，本基金份额净值为0.934元，本报告期份额净值增长率为-3.41%，同期业绩比较基准增长率为-8.19%。

#### 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，在海外整体经济没有稳步向上的环境下，海外市场的不确定性仍在，加上整体流动性最宽松阶段似乎已过，我们总体持较为谨慎的看法。

#### 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、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）对交银施罗德中证海外中国互联网指数型证券投资基金(LOF)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 20153 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：交银施罗德中证海外中国互联网指数型证券投资基金(LOF)

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	30,401,340.64	49,204,779.35
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	384,520,497.53	543,635,256.72
其中：股票投资		384,520,497.53	543,635,256.72
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		-	8,260,004.33
应收利息	7.4.7.5	1,929.83	3,427.23
应收股利		-	-

应收申购款		221,423.59	43,152.58
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		415,145,191.59	601,146,620.21
<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		202,544.93	-
应付赎回款		1,446,924.97	18,128,277.58
应付管理人报酬		431,802.99	613,576.57
应付托管费		89,958.97	127,828.45
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	-	-
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	354,538.72	408,322.37
负债合计		2,525,770.58	19,278,004.97
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	441,902,540.74	601,598,413.63
未分配利润	7.4.7.10	-29,283,119.73	-19,729,798.39
所有者权益合计		412,619,421.01	581,868,615.24
负债和所有者权益总计		415,145,191.59	601,146,620.21

注：1、报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.934 元，基金份额总额 441,902,540.74 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：交银施罗德中证海外中国互联网指数型证券投资基金(LOF)

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5月27日 (基金合同生效日) 至2015年12月 31日
<b>一、收入</b>		<b>-5,076,633.05</b>	<b>-40,253,248.54</b>
1.利息收入		106,602.86	255,511.79
其中：存款利息收入	7.4.7.11	106,602.86	255,511.79
债券利息收入		-	-
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）		12,391,875.87	-11,787,640.90
其中：股票投资收益	7.4.7.12	11,367,234.09	-12,349,212.76
基金投资收益	7.4.7.13	-	-
债券投资收益	7.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.15	-	-
贵金属投资收益			
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	1,024,641.78	561,571.86
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-19,428,228.44	-19,965,501.70
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		1,625,375.24	-9,014,479.42
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	227,741.42	258,861.69
<b>减：二、费用</b>		<b>8,493,956.42</b>	<b>7,523,007.06</b>
1. 管理人报酬		5,982,909.26	4,444,443.07
2. 托管费		1,246,439.41	925,925.60
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.20	496,198.71	1,680,990.80

5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.21	768,409.04	471,647.59
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-13,570,589.47</b>	<b>-47,776,255.60</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-13,570,589.47</b>	<b>-47,776,255.60</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：交银施罗德中证海外中国互联网指数型证券投资基金(LOF)

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）	601,598,413.63	-19,729,798.39	581,868,615.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-13,570,589.47	-13,570,589.47
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）	-159,695,872.89	4,017,268.13	-155,678,604.76
其中：1.基金申购款	139,493,214.52	1,261,376.53	140,754,591.05
2.基金赎回款	-299,189,087.41	2,755,891.60	-296,433,195.81
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）	441,902,540.74	-29,283,119.73	412,619,421.01

项目	上年度可比期间		
	2015年5月27日（基金合同生效日）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）	788,924,486.89	-	788,924,486.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-47,776,255.60	-47,776,255.60
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）	-187,326,073.26	28,046,457.21	-159,279,616.05
其中：1.基金申购款	52,969,650.38	-5,166,411.38	47,803,239.00
2.基金赎回款	-240,295,723.64	33,212,868.59	-207,082,855.05
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）	601,598,413.63	-19,729,798.39	581,868,615.24

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

交银施罗德中证海外中国互联网指数型证券投资基金(LOF)(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]429号《关于准予交银施罗德中证海外中国互联网指数型证券投资基金(LOF)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《交银施罗德中证海外中国互联网指数型证券投资基金(LOF)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

788,520,371.25 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(2015)第 589 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《交银施罗德中证海外中国互联网指数型证券投资基金(LOF)基金合同》于 2015 年 5 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 788,924,486.89 份基金份额，其中认购资金利息折合 404,115.64 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，境外资产托管人为摩根大通银行香港分行(JPMorgan & Chase Bank, N.A.)。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2015]第 335 号文审核同意，本基金 8,069,763.00 份基金份额于 2015 年 7 月 10 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《交银施罗德中证海外中国互联网指数型证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定，本基金投资于具有良好流动性的金融工具，以中证海外中国互联网指数成份股、备选成份股、与中证海外中国互联网指数相关的公募基金（包括上市交易型基金）为主要投资对象；本基金还可投资全球证券市场中具有良好流动性的其他金融工具，包括已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的其它普通股、优先股等，在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的其它公募基金，结构性投资产品，远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品，政府债券(短期政府债券除外)、公司债券、可转换债券等固定收益类证券，银行存款、短期政府债券等货币市场工具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)。如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。本基金的投资组合比例为：对中证海外中国互联网指数成份股、备选成份股、与中证海外中国互联网指数相关的公募基金（包括上市交易型基金）的投资比例不低于基金资产的 90%，基金保留的现金或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：中证海外中国互联网指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

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》、《交银施罗德中证海外中国互联网指数型证券投资基金(LOF)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[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》及其他相关境内外税务法规和实务操作，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。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内不予征收营业税(于 2016 年 5 月 1 日前)或增值税(自 2016 年 5 月 1 日起)且暂不征收企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

#### 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、基金销售机构
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
摩根大通银行(JPMorgan & Chase Bank, N.A.)	境外资产托管人
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5月27日（基金合同 生效日）至2015年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	5,982,909.26	4,444,443.07
其中：支付销售机构的客户维护费	2,586,498.13	1,911,061.33

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.2%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：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.2%÷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5月27日（基金合同 生效日）至2015年12月 31日
当期发生的基金应支付的 托管费	1,246,439.41	925,925.60

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。

#### 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

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。

#### 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 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年5月27日（基金合同生效日）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	5,536,414.22	105,425.30	8,775,475.76	255,100.07
摩根大通银行	24,864,926.42	-	40,429,303.59	384.39

注：本基金的银行存款分别由基金境内托管人和境外资产托管人保管，按适用利率或约定利率计息。

#### 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

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 7.4.9.3 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。

#### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 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384,520,497.53元，无属于第二层次和第三层次的余额（2015年12月31日：第一层次543,635,256.72元，无属于第二层次和第三层次的余额）。

##### (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，本基金不会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还是第三层次。

(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：同)。

(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。

(2) 除公允价值外，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	384,520,497.53	92.62
	其中：普通股	99,458,352.02	23.96
	存托凭证	285,062,145.51	68.67
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
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	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	30,401,340.64	7.32
8	其他各项资产	223,353.42	0.05
9	合计	415,145,191.59	100.00

注：本基金本报告期末未持有通过沪港通投资的股票。

## 8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
美国	306,915,591.95	74.38
香港	77,604,905.58	18.81
合计	384,520,497.53	93.19

注：1、国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定；  
2、ADR、GDR 按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

## 8.3 期末按行业分类的权益投资组合

### 8.3.1 期末指数投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
信息技术	264,598,805.15	64.13
非必需消费品	111,755,352.06	27.08
工业	8,166,340.32	1.98
合计	384,520,497.53	93.19

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 8.3.2 期末积极投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票及存托凭证。

## 8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名 称(英)	公司名 称(中文)	证券代码	所在证 券市场	所属国 家(地区)	数量 (股)	公允价值	占基金 资产净
----	-------------	--------------	------	------------	--------------	-----------	------	------------

	文)							值比例 (%)
1	Tencent Holding s Limited	腾讯控 股有 限公 司	700 HK	香 港 证 券 交 易 所	香 港	239,600	40,664,415.94	9.86
2	Alibaba Group Hold ing Lim ited	阿 里 巴 巴 集 团 控 股 有 限 公 司	BABA US	美 国 证 券 交 易 所	美 国	57,945	35,296,499.67	8.55
3	Baidu Inc.	百 度 股 份 有 限 公 司	BIDU US	美 国 证 券 交 易 所	美 国	28,190	32,151,038.07	7.79
4	Jd.Com Inc.	京 东 集 团	JD US	美 国 证 券 交 易 所	美 国	160,260	28,282,248.89	6.85
5	Ctrip.Co m Intern ati onal, Ltd.	携 程 旅 行 网	CTRP US	美 国 证 券 交 易 所	美 国	80,758	22,408,729.84	5.43
6	Vipshop Hold ing s Ltd.	唯 品 会 控 股 有 限 公 司	VIPS US	美 国 证 券 交 易 所	美 国	202,102	15,435,817.13	3.74
7	TAL Educa tion Group	好 未 来 教 育 集 团	TAL US	美 国 证 券 交 易 所	美 国	31,611	15,382,878.32	3.73
8	Kingsoft Corp Lim ited	金 山 软 件	3888 HK	香 港 证 券 交 易 所	香 港	1,056,000	15,021,781.37	3.64
9	Netease. Com Inc.	网 易 公 司	NTES US	美 国 证 券 交 易 所	美 国	10,055	15,020,295.55	3.64
10	58.Com Inc.	58 同 城 网	WUBA US	美 国 证 券 交 易 所	美 国	74,695	14,508,458.02	3.52

2、投资者欲了解本报告期末基金投资的所有权益明细，应阅读登载于基金管理人网站的年度报告正文。

#### 8.4.2 积极投资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益投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票及存托凭证。

## 8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

### 8.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	Qunar Cayman Islands Limited	QUNR US	9,104,835.59	1.56
2	Jd.Com Inc.	JD US	8,024,931.68	1.38
3	Ctrip.Com International, Ltd.	CTRP US	7,740,922.41	1.33
4	Netease.Com Inc.	NTES US	7,714,161.62	1.33
5	58.Com Inc.	WUBA US	6,534,912.68	1.12
6	Autohome Inc.	ATHM US	5,406,555.47	0.93
7	Weibo Corp	WB US	5,327,672.18	0.92
8	Momo Inc.	MOMO US	3,919,442.58	0.67
9	Kingsoft Corp Limited	3888 HK	3,766,600.28	0.65
10	Cogobuy Group	400 HK	3,630,111.96	0.62
11	Vipshop Holdings Ltd.	VIPS US	3,626,188.02	0.62
12	Alibaba Group Holding Limited	BABA US	3,561,428.64	0.61
13	SouFun Holdings Limited	SFUN US	3,138,567.71	0.54
14	Sohu.com Inc.	SOHU US	2,694,002.42	0.46
15	Yirendai Ltd.	YRD US	2,054,223.26	0.35
16	YY Inc.	YY US	2,016,801.89	0.35
17	TAL Education Group	TAL US	1,890,987.42	0.32
18	Tian Ge Interactive Holdings Limited	1980 HK	1,745,542.31	0.30
19	NetDragon Websoft Inc.	777 HK	1,677,361.85	0.29
20	Changyou.com Limited	CYOU US	1,468,032.48	0.25

注：1. “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；

2. 此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

### 8.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例
----	----------	------	----------	-------------

				(%)
1	Tencent Holdings Limited	700 HK	30,230,965.82	5.20
2	Qihoo 360 Technology Co Ltd.	QIHU US	24,172,919.80	4.15
3	Netease.Com Inc.	NTES US	23,653,855.53	4.07
4	Alibaba Group Holding Limited	BABA US	22,870,844.79	3.93
5	Youku Tudou Inc.	YOKU US	22,344,363.03	3.84
6	Ctrip.Com International, Ltd.	CTRP US	15,407,767.77	2.65
7	SINA Corp/China	SINA US	14,534,883.60	2.50
8	Jd.Com Inc.	JD US	9,827,187.60	1.69
9	Weibo Corp	WB US	7,419,223.41	1.28
10	TAL Education Group	XRS US	7,037,191.11	1.21
11	Baidu Inc.	BIDU US	6,171,993.52	1.06
12	Vipshop Holdings Ltd.	VIPS US	5,045,170.57	0.87
13	Momo Inc.	MOMO US	4,654,814.59	0.80
14	YY Inc.	YY US	3,821,179.83	0.66
15	58.Com Inc.	WUBA US	3,646,945.14	0.63
16	Kingsoft Corp Limited	3888 HK	3,568,279.15	0.61
17	E-Commerce China Dangdang, Inc.	DANG US	3,099,750.74	0.53
18	Sohu.com Inc.	SOHU US	2,764,713.55	0.48
19	iDreamsky Technology Limited	DSKY US	2,549,889.92	0.44
20	Autohome Inc.	ATHM US	2,217,642.05	0.38

注：1. “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；

2. 此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

### 8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	100,624,873.09
卖出收入（成交）总额	251,698,780.94

注：“买入成本”或“卖出收入”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。

## 8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

## 8.8 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。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

## 8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

## 8.11 投资组合报告附注

**8.11.1** 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体除京东（证券代码：JD US）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一京东（证券代码：JD US）的孙公司北京京东世纪信息技术有限公司在 2015 年 7 月 28 日至 2016 年 4 月 8 日期间，发生 89 次存在利用虚假的或者使人误解的价格手段，诱骗消费者或者其他经营者与其进行交易的价格违法行为。鉴于上述行为违反了《中华人民共和国价格法》，2016 年 5 月 25 日北京发改委以京发改价格处罚[2016]19 号《行政处罚决定书》对北京京东世纪信息技术有限公司作出警告和罚款 500,000 元的行政处罚。

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。

**8.11.2** 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。

## 8.11.3 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	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,929.83
5	应收申购款	221,423.59
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	223,353.42

#### 8.11.4 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。

#### 8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 8.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

##### 8.11.5.2 报告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。

#### 8.11.6 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	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
14,444	30,594.19	4,177,275.44	0.95%	437,725,265.30	99.05%

## 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	安东	4,711,592.84	14.57%
2	徐春荣	2,995,766.98	9.26%
3	刘志宏	2,993,913.92	9.26%
4	深圳市万杉资本管理有限公司— 万杉丰和 8 期证券投资基金	2,034,544.00	6.29%
5	施斐	2,027,044.30	6.27%
6	常张敏	1,993,561.88	6.17%
7	樊翠兰	1,969,260.06	6.09%
8	梁健铭	1,716,296.32	5.31%
9	陈亮	1,494,833.90	4.62%
10	陈凯	1,472,983.76	4.56%

注：持有人为场内持有人。

## 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	110,248.98	0.02%

## 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(2015年5月27日)基金份额总额	788,924,486.89
本报告期期初基金份额总额	601,598,413.63
本报告期基金总申购份额	139,493,214.52

减：本报告期基金总赎回份额	299,189,087.41
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	441,902,540.74

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。

## § 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），本期审计费为 60,000 元。自本基金合同生效以来，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	
China Merchants Securities(HK) Co.Ltd.	-	46,565,392.66	13.22%	46,565.43	10.86%	-
Credit Suisse(Hong Kong) Ltd.	-	243,845,278.54	69.21%	365,768.83	85.27%	-
Instinet Pacific Limited	-	4,518,382.77	1.28%	6,777.57	1.58%	-
UOB Kay Hian(Hong Kong) Limited	-	8,192,274.06	2.33%	9,830.72	2.29%	-
虚拟券商	-	49,202,325.93	13.97%	-	-	-
BOCI Securities Limited	-	-	-	-	-	-
CCB International Securities Limited	-	-	-	-	-	-
CICC Hong Kong Securities Limited	-	-	-	-	-	-
Shenyin Wanguo Securities(H.K.	-	-	-	-	-	-

)Ltd						
------	--	--	--	--	--	--

注：1、本公司从事境外投资业务时，将需要委托境外券商代理或协助进行交易操作。公司作为基金管理人将勤勉尽责地承担受信责任，挑选、委托合适的境外券商以取得有益于基金持有人利益的最佳执行；

2、本公司投资海外市场，遵循公平分配、最佳执行的原则。公司挑选券商并开户均主要遵循以下原则：券商基本面评价，包括财务状况和经营状况；券商研究及服务质量，包括其研究报告质量、数量和及时性，包括券商在股票配售等公司行为发生时所提供的服务；券商的交易执行能力，即是否对投资指令进行了有效的执行以及能否取得较高质量的成交结果。衡量券商交易执行能力的指标主要有：是否完成交易、成交的及时性、成交价格、对市场价格及流动性的影响等。能够及时准确高效地提供结算等后台业务支持。

#### 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

无。

交银施罗德基金管理有限公司  
二〇一七年三月二十九日