

交银施罗德策略回报灵活配置混合型证券投资基金
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：中信银行股份有限公司

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。

基金托管人中信银行股份有限公司(以下简称“中信银行”)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	交银策略回报灵活配置混合
基金主代码	519710
交易代码	519710
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6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	中信银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	269,257,920.78 份
基金合同存续期	不定期

注：交银施罗德荣安保本混合型证券投资基金从 2015 年 6 月 27 日起正式转型为交银施罗德策略回报灵活配置混合型证券投资基金，本表列示的基金合同生效日及本报告列示的转型生效日均指 2015 年 6 月 27 日。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金根据对宏观经济周期和市场环境的分析研究，自上而下配置资产，并通过对类属资产灵活运用多种投资策略，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金将通过“自上而下”的定性分析和定量分析相结合以实现大类资产的灵活配置。本基金首先利用经济周期理论，对宏观经济的经济周期进行预测，在此基础上形成对不同资产市场表现的预测和判断，确定基金资产在各类别资产间的分配比例，并随着各类证券风险收益特征的相对变化，动态调整组合中各类资产的比例，以规避或分散市场风险，提高基金收益率。
业绩比较基准	60%×沪深 300 指数收益率+40%×中证综合债券指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期收益和风险高于货币市场基金、债券型基金，而低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险品种。

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	4006800000
	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

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 6 月 27 日（基金转型生效日）至 2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	18,735,232.86	-57,744,758.37
本期利润	3,220,189.62	-45,388,578.53
加权平均基金份额本期利润	0.0167	-0.2206
本期基金份额净值增长率	4.00%	-10.78%
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	0.145	0.070
期末基金资产净值	308,434,294.46	191,549,869.97

期末基金份额净值	1.145	1.101
----------	-------	-------

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后的实际收益水平要低于所列数字；

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金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	-2.39%	0.83%	0.51%	0.44%	-2.90%	0.39%
过去六个月	2.14%	0.92%	3.24%	0.46%	-1.10%	0.46%
过去一年	4.00%	1.37%	-5.60%	0.84%	9.60%	0.53%
自基金转型生效日起至今	-7.21%	1.88%	-11.24%	1.18%	4.03%	0.70%

注：1、交银施罗德荣安保本混合型证券投资基金从 2015 年 6 月 27 日起正式转型为交银施罗德策略回报灵活配置混合型证券投资基金，本表列示的是基金转型后的基金净值表现，转型后基金的业绩比较基准为 60%×沪深 300 指数收益率+40%×中信标普全债指数收益率，每日进行再平衡。

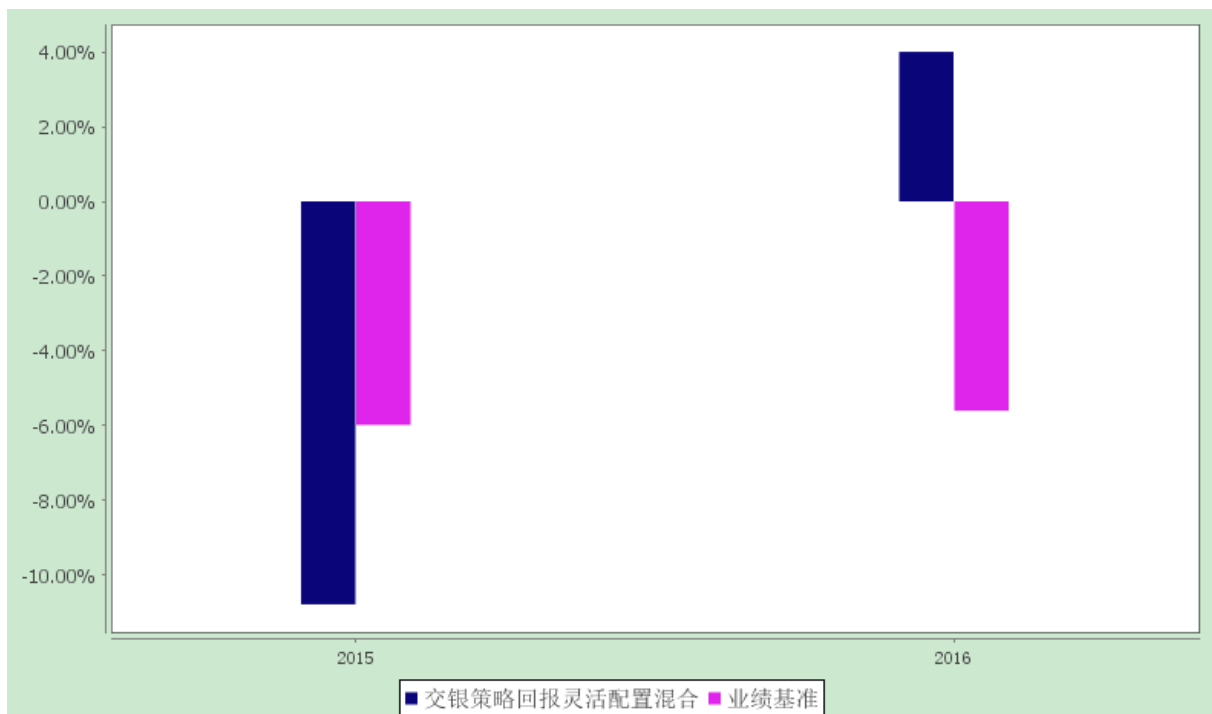
2、本基金业绩比较基准自 2015 年 10 月 1 日起，由“60%×沪深 300 指数收益率+40%×中信标普全债指数收益率”变更为“60%×沪深 300 指数收益率+40%×中证综合债券指数收益率”，3.2.2 同。详情见本基金管理人于 2015 年 9 月 28 日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金业绩比较基准变更并修改基金合同相关内容的公告》。每日进行再平衡过程。

3.2.2 自基金转型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：本基金由交银施罗德荣安保本混合型证券投资基金转型而来。基金转型日为2015年6月27日。本基金的投资转型期为交银施罗德荣安保本混合型证券投资基金保本周期到期选择期截止日次日（即2015年6月27日）起的3个月。截至投资转型期结束，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 自基金转型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6月27日至2016年12月31日，基金转型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	-	-	-	-	-
2015	-	-	-	-	-
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		
王少成	交银成长混合、交银策略回报灵活配置混合、交银成长 30 混合、交银荣和保本混合的基金经理，公司权益投资总监	2015-11-07	-	12 年	王少成先生，复旦大学硕士学历。历任上海融昌资产管理公司研究员，中原证券投资经理，信诚基金管理有限公司研究总监助理，东吴基金管理有限公司投资经理、基金经理、投资部副总经理。其中 2010 年 9 月至 2012 年 10 月担任东吴新创业股票型证券投资基金基金经理，2011 年 2 月至 2012 年 11 月担任东吴中证新兴产业指数证券投资基金基金经理，2011 年 5 月至 2012 年 11 月担任东吴价值成长双动力股票型证券投资基金基金经理。2012 年加入交银施罗德

					<p>基金管理有限公司，历任公司权益部副总经理。 2013年3月21日至2015年8月14日担任交银施罗德先进制造混合型证券投资基金（原交银施罗德先进制造股票证券投资基金）基金经理， 2013年5月29日至2015年8月14日担任交银施罗德先锋混合型证券投资基金（原交银施罗德先锋股票证券投资基金）基金经理。</p>
韩威俊	交银策略回报灵活配置混合的基金经理	2016-01-20	-	10年	<p>韩威俊先生，上海财经大学金融学硕士。历任申银万国证券研究所助理分析师、北京鼎天资产管理有限公司董事助理、申银万国证券研究所行业分析师、信诚基金管理有限公司投资分析师。 2013年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任行业分析师。</p>

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 年是相对比较纠结的一年，年初熔断导致全体市场处于“爬坑阶段”，年底国债利率大幅上升导致市场流动性紧张，收益率回撤也相对较高。回顾整个 2016 年，市场整体呈现出流动性相对充裕条件下的结构性震荡市，白马蓝筹、供给侧改革以及 PPP 等三个方向获得了比较明显的绝对收益和超额收益，而代表着经济转型方向的部分行业则出现了戴维斯双杀。

本基金全年获得 4%的绝对收益，主要得益于三次机会，即 2-3 月的供给侧改革、5-7 月的白酒白电以及 9-10 月的快递，其中，从年初开始持有的确定性成长股也获得了比较明显的绝对收益和超额收益。

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 1.145 元，本报告期份额净值增长率为 4.00%，同期业绩比较基准增长率为-5.60%。

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，整个市场的运行轨迹可能并不会发生太大变化，仍然呈现出流动性收紧的震荡格局。预计 2017 年上半年的整体机会仍然来自于确定性，包括基本面有边际变化的白马蓝筹、确定性成长的品种以及供需发生确定性变化的周期品。本基金后续配置上，计划对业绩确定性的消费白马蓝筹股将维持一定底仓不变，并且加大对 2017 年确定性增长公司的配置比例，周期品种上适当做一些轮动，但预计不会配置较高仓位。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序，经公司管理层批准后实行，并成立了估值委员会，估值委员会成员由研究部、基金运营部、风险管理部等人员和固定收益人员及基金经理组成。

公司严格按照新会计准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定进行估值，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。估值委员会的研究部成员按投资品种的不同性质，研究并参考市场普遍认同的做法，建议合理的估值模型，进行测算和认证，认可后交各估值委员会成员从基金会计、风险、合规等方面审批，一致同意后，报公司投资总监、总经理审批。

估值委员会会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及其适用性的情况后，及时召开临时会议进行研究，及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值委员会成员均具备相应的专业资格及工作经验。基金经理作为估值委员会成员，对本基金持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感，向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论。本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突，截止报告期末未有与任何外部估值定价服务机构签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

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，对交银施罗德策略回报灵活配置混合型证券投资基金 2016 年度基金的投资运作，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，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

本托管人认为，交银施罗德基金管理有限公司在交银施罗德策略回报灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、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交银施罗德策略回报灵活配置混合型证券投资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）对交银施罗德策略回报灵活配置混合型证券投资基金 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 20171 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：交银施罗德策略回报灵活配置混合型证券投资基金

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
资产：		-	-
银行存款	7.4.7.1	51,379,556.77	13,844,157.23
结算备付金		2,631,136.46	1,011,915.88
存出保证金		484,438.82	568,091.81

交易性金融资产	7.4.7.2	255,329,313.65	176,740,409.53
其中：股票投资		245,337,322.75	129,086,809.53
基金投资		-	-
债券投资		9,991,990.90	47,653,600.00
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		9,804,883.43	-
应收利息	7.4.7.5	187,648.01	908,009.63
应收股利		-	-
应收申购款		1,513,009.86	993.32
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		321,329,987.00	193,073,577.40
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月 31日
负 债：		-	-
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		10,027,647.84	-
应付赎回款		570,960.37	515,553.13
应付管理人报酬		377,233.26	246,240.58
应付托管费		62,872.21	41,040.11
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,405,383.12	260,945.47
应交税费		289,798.60	289,798.60
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-

其他负债	7.4.7.8	161,797.14	170,129.54
负债合计		12,895,692.54	1,523,707.43
所有者权益：		-	-
实收基金	7.4.7.9	269,257,920.78	173,937,560.24
未分配利润	7.4.7.10	39,176,373.68	17,612,309.73
所有者权益合计		308,434,294.46	191,549,869.97
负债和所有者权益总计		321,329,987.00	193,073,577.40

注：1、报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.145 元，基金份额总额 269,257,920.78 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：交银施罗德策略回报灵活配置混合型证券投资基金

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 6 月 27 日 (转型生效日) 至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		12,092,011.45	-41,420,359.77
1.利息收入		832,927.81	1,650,125.93
其中：存款利息收入	7.4.7.11	333,426.86	109,145.29
债券利息收入		499,500.95	1,530,506.68
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	10,473.96
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		26,709,475.60	-55,445,250.15
其中：股票投资收益	7.4.7.12	23,065,194.89	-56,904,676.64
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	1,526,036.81	1,420,654.01
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	2,118,243.90	38,772.48
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-15,515,043.24	12,356,179.84
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	64,651.28	18,584.61
减：二、费用		8,871,821.83	3,968,218.76
1. 管理人报酬		3,181,166.16	1,619,675.30
2. 托管费		530,194.40	269,945.86
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	4,943,397.45	1,879,403.69
5. 利息支出		-	148,139.23
其中：卖出回购金融资产支出		-	148,139.23
6. 其他费用	7.4.7.20	217,063.82	51,054.68
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,220,189.62	-45,388,578.53
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,220,189.62	-45,388,578.53

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：交银施罗德策略回报灵活配置混合型证券投资基金

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）	173,937,560.24	17,612,309.73	191,549,869.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,220,189.62	3,220,189.62
三、本期基金份额	95,320,360.54	18,343,874.33	113,664,234.87

交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	190,749,244.88	30,684,102.49	221,433,347.37
2.基金赎回款	-95,428,884.34	-12,340,228.16	-107,769,112.50
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）	269,257,920.78	39,176,373.68	308,434,294.46
项目	上年度可比期间		
	2015年6月27日（转型生效日）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）	339,126,963.92	79,314,806.84	418,441,770.76
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-45,388,578.53	-45,388,578.53
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）	-165,189,403.68	-16,313,918.58	-181,503,322.26
其中：1.基金申购款	7,989,296.68	373,714.57	8,363,011.25
2.基金赎回款	-173,178,700.36	-16,687,633.15	-189,866,333.51
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）	173,937,560.24	17,612,309.73	191,549,869.97

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

交银施罗德策略回报灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)是由原交银施罗德荣安保本混合型证券投资基金(以下简称“交银施罗德荣安保本基金”)转型而来。交银施罗德荣安保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[2012]565号《关于核准交银施罗德荣安保本混合型证券投资基金募集的批复》核准，由交银施罗德基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德荣安保本混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。原基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,630,301,417.83 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第 222 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《交银施罗德荣安保本混合型证券投资基金基金合同》于 2012 年 6 月 20 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,631,624,464.77 份基金份额，其中认购资金利息折合 1,323,046.94 份基金份额。

根据原《交银施罗德荣安保本混合型证券投资基金基金合同》的约定，交银施罗德荣安保本基金的保本周期为三年。交银施罗德荣安保本基金第一个保本周期自本基金转型生效日起至三个公历年后对应日止(如该对应日为非工作日，保本周期到期日顺延至下一个工作日)。交银施罗德荣安保本基金保本周期届满时，在符合保本基金存续条件下，继续存续并转入下一保本周期。在不符合保本基金存续条件下，交银施罗德荣安保本基金变更为非保本的混合型基金，基金名称相应变更为“交银施罗德策略回报灵活配置混合型证券投资基金”。

根据《交银荣安保本保本周期到期安排及交银施罗德策略回报转型后运作相关业务规则的公告》，交银施罗德荣安保本基金因未能符合保本基金存续条件，自 2015 年 6 月 27 日起转型为交银施罗德策略回报灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)，并相应修改基金的投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等。原《交银施罗德荣安保本混合型证券投资基金基金合同》失效，《交银施罗德策略回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于同一日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。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《交银施罗德策略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，包括国内依法公开发行交易的债券、股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、货币市场工具、权证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。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 30%-80%；债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他

证券品种占基金资产的 20%-70%，其中基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。自转型生效日至 2015 年 9 月 30 日，本基金的业绩比较基准为： $60\% \times$ 沪深 300 指数收益率 $+40\% \times$ 中信标普全债指数收益率。根据本基金的基金管理人于 2015 年 9 月 28 日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金业绩比较基准变更并修改基金合同相关内容的公告》，自 2015 年 10 月 1 日起，本基金的业绩比较基准变更为： $60\% \times$ 沪深 300 指数收益率 $+40\% \times$ 中证综合债券指数收益率。

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》、《交银施罗德策略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 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、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
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

施罗德投资管理有限公司	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6月27日（转型 生效日）至2015年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,181,166.16	1,619,675.30
其中：支付销售机构的客户维护 费	1,108,851.69	2,099,535.04

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5%÷当年天数。

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6月27日（转型 生效日）至2015年12月 31日
当期发生的基金应支付的托管费	530,194.40	269,945.86

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

本基金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6月27日（转型生效日）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
中信银行	51,379,556.77	305,573.40	13,844,157.23	88,439.57

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

金额单位：人民币元

7.4.9.1.1 受限证券类别：股票										
证券	证券	成功	可流	流通受	认购	期末估	数量(单位)	期末	期末	备注

代码	名称	认购日	通日	限类型	价格	值单价	股)	成本总额	估值总额	
002838	道恩股份	2016-12-28	2017-01-06	新股网下申购	15.28	15.28	681	10,405.68	10,405.68	-
002840	华统股份	2016-12-29	2017-01-10	新股网下申购	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
601375	中原证券	2016-12-20	2017-01-03	新股网下申购	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-
603032	德新交运	2016-12-27	2017-01-05	新股网下申购	5.81	5.81	1,628	9,458.68	9,458.68	-
603035	常熟汽饰	2016-12-27	2017-01-05	新股网下申购	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	-
603186	华正新材	2016-12-26	2017-01-03	新股网下申购	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	-
603228	景旺电子	2016-12-28	2017-01-06	新股网下申购	23.16	23.16	1,257	29,112.12	29,112.12	-
603266	天龙股份	2016-12-30	2017-01-10	新股网下申购	14.63	14.63	1,562	22,852.06	22,852.06	-
603689	皖天然气	2016-12-30	2017-01-10	新股网下申购	7.87	7.87	4,818	37,917.66	37,917.66	-
603877	太平鸟	2016-12-29	2017-01-09	新股网下申购	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-
300586	美联新材	2016-12-26	2017-01-04	新股网下申购	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300587	天铁股份	2016-12-28	2017-01-05	新股网下申购	14.11	14.11	1,438	20,290.18	20,290.18	-
300588	熙菱信息	2016-12-27	2017-01-05	新股网下申购	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	-
300591	万里马	2016-12-30	2017-01-10	新股网下申购	3.07	3.07	2,396	7,355.72	7,355.72	-

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	复牌开盘价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000411	英特集团	2016-12-27	重大事项	22.10	2017-01-11	24.31	206,201	4,885,477.32	4,557,042.10	-
002659	中泰桥梁	2016-11-03	重大事项	23.07	2017-01-06	19.60	88	1,839.78	2,030.16	-

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资产中属于第一层次的余额为 240,404,047.27 元，属于第二层次的余额为 14,925,266.38 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 109,880,481.53 元，第二层次 64,950,488.00 元，第三层次 1,909,440.00 元)。

(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

	交易性金融资产 ——股票投资
2016 年 1 月 1 日	1,909,440.00
转入第三层次	-
转出第三层次	1,658,656.85
当期利得或损失总额	
——计入损益的利得或损失	-250,783.15
2016 年 12 月 31 日	-
	-

2016年12月31日仍持有的资产计入2016年度损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益

-
1,352,520.00
-
556,920.00
<u>1,909,440.00</u>

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动收益、投资收益等项目。

交易性金融资产——股票投资

2015年1月1日
 转入第三层次
 转出第三层次
 当期利得或损失总额——计入损益的利得或损失
 2015年12月31日

-
1,352,520.00
-
556,920.00
<u>1,909,440.00</u>

2015年12月31日仍持有的资产计入2015年度损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益

-578,375.80

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动收益、投资收益等项目。

使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值按照可比公司法确定。

(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	245,337,322.75	76.35
	其中：股票	245,337,322.75	76.35
2	固定收益投资	9,991,990.90	3.11
	其中：债券	9,991,990.90	3.11
	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	54,010,693.23	16.81
7	其他各项资产	11,989,980.12	3.73
8	合计	321,329,987.00	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	9,079,520.48	2.94
B	采矿业	35,485,359.11	11.50
C	制造业	148,941,083.22	48.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,917.66	0.01
E	建筑业	6,388,024.39	2.07
F	批发和零售业	23,163,599.33	7.51
G	交通运输、仓储和邮政业	9,458.68	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	222,113.02	0.07
J	金融业	18,930,382.96	6.14

K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,079,863.90	1.00
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	245,337,322.75	79.54

8.2.2 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。

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

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	603808	歌力思	497,283	15,957,811.47	5.17
2	600104	上汽集团	606,100	14,213,045.00	4.61
3	600519	贵州茅台	39,800	13,299,170.00	4.31
4	000651	格力电器	527,800	12,994,436.00	4.21
5	000333	美的集团	417,900	11,772,243.00	3.82
6	601607	上海医药	505,031	9,878,406.36	3.20
7	000858	五粮液	267,700	9,230,296.00	2.99
8	600809	山西汾酒	365,400	9,142,308.00	2.96
9	600298	安琪酵母	381,100	6,791,202.00	2.20
10	000423	东阿阿胶	124,500	6,706,815.00	2.17

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。

8.4 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	000983	西山煤电	48,040,176.02	25.08
2	601699	潞安环能	42,786,727.42	22.34
3	000858	五粮液	41,445,330.60	21.64
4	002468	申通快递	40,225,646.05	21.00
5	600519	贵州茅台	37,176,518.77	19.41
6	603808	歌力思	35,407,983.23	18.48
7	002120	新海股份	32,749,978.80	17.10
8	000423	东阿阿胶	31,567,674.50	16.48
9	000333	美的集团	30,563,365.07	15.96
10	600887	伊利股份	29,368,042.56	15.33
11	002582	好想你	26,251,809.86	13.70
12	600489	中金黄金	24,464,732.84	12.77
13	000568	泸州老窖	24,177,313.50	12.62
14	600547	山东黄金	22,816,110.00	11.91
15	600028	中国石化	20,489,472.35	10.70
16	000786	北新建材	18,760,164.00	9.79
17	601118	海南橡胶	18,203,496.70	9.50
18	600362	江西铜业	17,085,805.68	8.92
19	000937	冀中能源	16,994,059.08	8.87
20	601766	中国中车	16,735,052.62	8.74
21	600486	扬农化工	15,973,858.09	8.34
22	601607	上海医药	15,864,524.00	8.28
23	000411	英特集团	14,792,297.62	7.72
24	601166	兴业银行	14,391,266.45	7.51
25	600559	老白干酒	14,381,034.23	7.51
26	002511	中顺洁柔	14,322,325.71	7.48
27	600497	驰宏锌锗	14,265,277.10	7.45
28	600104	上汽集团	14,022,395.24	7.32
29	300347	泰格医药	13,845,844.35	7.23
30	000581	威孚高科	13,784,454.72	7.20
31	603816	顾家家居	13,446,540.60	7.02
32	600233	圆通速递	13,386,517.65	6.99
33	000651	格力电器	12,893,091.00	6.73
34	001696	宗申动力	11,948,170.00	6.24
35	000596	古井贡酒	11,941,471.47	6.23
36	002659	中泰桥梁	11,877,046.34	6.20
37	300106	西部矿业	11,208,168.05	5.85
38	002714	牧原股份	10,901,913.00	5.69
39	603589	口子窖	10,633,695.81	5.55
40	002624	完美世界	10,405,884.80	5.43
41	002304	洋河股份	10,243,877.22	5.35

42	600338	西藏珠峰	9,927,853.00	5.18
43	600348	阳泉煤业	9,859,065.35	5.15
44	601939	建设银行	9,817,940.00	5.13
45	000878	云南铜业	9,787,205.40	5.11
46	600000	浦发银行	9,718,403.20	5.07
47	000921	海信科龙	9,607,979.65	5.02
48	601899	紫金矿业	9,492,136.00	4.96
49	002155	湖南黄金	8,899,450.80	4.65
50	000911	南宁糖业	8,712,117.00	4.55
51	000688	建新矿业	8,644,193.24	4.51
52	600754	锦江股份	8,619,693.30	4.50
53	001979	招商蛇口	8,590,226.37	4.48
54	600201	生物股份	8,581,532.00	4.48
55	600688	上海石化	8,572,607.00	4.48
56	600809	山西汾酒	8,548,903.00	4.46
57	300498	温氏股份	8,542,299.00	4.46
58	600108	亚盛集团	7,955,091.00	4.15
59	000930	中粮生化	7,879,896.00	4.11
60	600598	北大荒	7,796,088.00	4.07
61	600109	国金证券	7,663,049.57	4.00
62	601377	兴业证券	7,662,010.00	4.00
63	600958	东方证券	7,661,467.00	4.00
64	600123	兰花科创	7,644,711.92	3.99
65	600737	中粮屯河	7,586,986.48	3.96
66	601989	中国重工	7,368,309.00	3.85
67	600150	中国船舶	7,316,652.00	3.82
68	002078	太阳纸业	7,307,313.00	3.81
69	002152	广电运通	7,262,325.89	3.79
70	002149	西部材料	7,172,211.00	3.74
71	300038	梅泰诺	7,139,592.07	3.73
72	600521	华海药业	7,047,798.70	3.68
73	002775	文科园林	7,038,008.00	3.67
74	002551	尚荣医疗	7,000,093.94	3.65
75	603658	安图生物	6,895,272.40	3.60
76	600300	维维股份	6,833,997.00	3.57
77	000898	鞍钢股份	6,790,571.00	3.55
78	002332	仙琚制药	6,708,356.00	3.50
79	600298	安琪酵母	6,677,948.45	3.49
80	600295	鄂尔多斯	6,612,182.02	3.45
81	600019	宝钢股份	6,518,710.32	3.40
82	600352	浙江龙盛	6,422,640.54	3.35
83	000928	中钢国际	6,383,628.03	3.33
84	000959	首钢股份	6,360,244.00	3.32
85	002081	金螳螂	6,295,391.35	3.29

86	601225	陕西煤业	6,266,695.00	3.27
87	601088	中国神华	6,215,862.32	3.25
88	600691	阳煤化工	6,202,290.00	3.24
89	600455	博通股份	5,956,506.50	3.11
90	600919	江苏银行	5,954,528.00	3.11
91	002013	中航机电	5,931,045.00	3.10
92	600299	安迪苏	5,918,865.01	3.09
93	603708	家家悦	5,904,611.18	3.08
94	600873	梅花生物	5,898,282.00	3.08
95	600713	南京医药	5,896,587.61	3.08
96	300232	洲明科技	5,878,201.00	3.07
97	600199	金种子酒	5,851,581.63	3.05
98	000799	酒鬼酒	5,850,597.43	3.05
99	002564	天沃科技	5,792,394.00	3.02
100	600702	沱牌舍得	5,784,620.00	3.02
101	600197	伊力特	5,738,861.08	3.00
102	002421	达实智能	5,715,267.00	2.98
103	000018	神州长城	5,710,583.00	2.98
104	000887	中鼎股份	5,663,828.17	2.96
105	603678	火炬电子	5,656,455.00	2.95
106	300405	科隆精化	5,594,739.30	2.92
107	600867	通化东宝	5,564,120.00	2.90
108	603021	山东华鹏	5,540,215.00	2.89
109	600062	华润双鹤	5,516,769.00	2.88
110	002035	华帝股份	5,364,201.59	2.80
111	002707	众信旅游	5,228,203.62	2.73
112	002041	登海种业	5,220,447.84	2.73
113	000338	潍柴动力	5,212,754.00	2.72
114	000951	中国重汽	5,212,259.15	2.72
115	600195	中牧股份	5,208,334.00	2.72
116	002568	百润股份	5,195,452.00	2.71
117	002586	围海股份	5,126,929.00	2.68
118	600755	厦门国贸	5,113,781.99	2.67
119	000796	凯撒旅游	5,080,990.00	2.65
120	002640	跨境通	5,076,793.90	2.65
121	000521	美菱电器	5,051,433.00	2.64
122	002717	岭南园林	4,954,653.00	2.59
123	002386	天原集团	4,909,856.00	2.56
124	600031	三一重工	4,861,714.00	2.54
125	002110	三钢闽光	4,757,630.98	2.48
126	600479	千金药业	4,751,585.15	2.48
127	000932	华菱钢铁	4,713,124.00	2.46
128	002024	苏宁云商	4,685,377.00	2.45
129	600228	昌九生化	4,634,585.18	2.42

130	002188	巴士在线	4,514,631.01	2.36
131	600376	首开股份	4,507,293.00	2.35
132	002440	闰土股份	4,505,479.00	2.35
133	600257	大湖股份	4,498,526.28	2.35
134	600079	人福医药	4,495,795.90	2.35
135	002508	老板电器	4,352,387.47	2.27
136	002171	楚江新材	4,345,098.41	2.27
137	000402	金融街	4,321,928.34	2.26
138	600595	中孚实业	4,306,244.76	2.25
139	000807	云铝股份	4,294,364.00	2.24
140	000630	铜陵有色	4,272,005.75	2.23
141	600110	诺德股份	4,253,729.00	2.22
142	603008	喜临门	4,189,561.00	2.19
143	000759	中百集团	4,112,598.00	2.15
144	300005	探路者	4,089,778.00	2.14
145	600661	新南洋	4,031,902.00	2.10
146	601689	拓普集团	4,026,181.00	2.10
147	600500	中化国际	3,988,851.00	2.08
148	002572	索菲亚	3,980,255.00	2.08
149	300407	凯发电气	3,965,411.00	2.07
150	000060	中金岭南	3,941,670.99	2.06
151	600213	亚星客车	3,895,789.78	2.03
152	600720	祁连山	3,852,906.00	2.01
153	600449	宁夏建材	3,851,814.70	2.01
154	603555	贵人鸟	3,850,226.32	2.01
155	603066	音飞储存	3,839,527.00	2.00

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	000983	西山煤电	42,785,288.70	22.34
2	601699	潞安环能	37,519,363.24	19.59
3	002468	申通快递	35,714,139.12	18.64
4	002582	好想你	35,498,406.28	18.53
5	000858	五粮液	34,484,081.56	18.00
6	600887	伊利股份	31,795,825.52	16.60
7	002120	新海股份	30,084,422.50	15.71

8	000568	泸州老窖	25,860,894.02	13.50
9	000423	东阿阿胶	25,312,392.76	13.21
10	600519	贵州茅台	25,124,074.48	13.12
11	000333	美的集团	20,837,276.74	10.88
12	600028	中国石化	20,782,757.67	10.85
13	603808	歌力思	20,185,033.35	10.54
14	600489	中金黄金	19,476,771.78	10.17
15	000786	北新建材	18,636,963.40	9.73
16	600547	山东黄金	18,556,991.44	9.69
17	002714	牧原股份	15,719,894.98	8.21
18	601766	中国中车	15,707,020.25	8.20
19	600233	圆通速递	15,361,333.41	8.02
20	600559	老白干酒	15,239,891.90	7.96
21	002659	中泰桥梁	14,626,067.27	7.64
22	603816	顾家家居	14,481,677.65	7.56
23	601118	海南橡胶	14,313,776.52	7.47
24	000581	威孚高科	14,156,436.91	7.39
25	300347	泰格医药	13,417,444.52	7.00
26	000937	冀中能源	13,180,852.28	6.88
27	600497	驰宏锌锗	12,847,341.64	6.71
28	000596	古井贡酒	12,334,626.22	6.44
29	001696	宗申动力	12,216,199.84	6.38
30	002511	中顺洁柔	11,334,712.48	5.92
31	600348	阳泉煤业	10,405,092.85	5.43
32	002304	洋河股份	10,314,513.74	5.38
33	600661	新南洋	10,145,703.24	5.30
34	002624	完美世界	10,043,005.29	5.24
35	000411	英特集团	10,038,282.03	5.24
36	603589	口子窖	9,897,608.51	5.17
37	600362	江西铜业	9,834,142.44	5.13
38	600486	扬农化工	9,769,259.46	5.10
39	002458	益生股份	9,519,017.61	4.97
40	000921	海信科龙	9,391,298.14	4.90
41	600201	生物股份	9,013,895.92	4.71
42	300498	温氏股份	8,653,234.42	4.52
43	002234	民和股份	8,517,965.59	4.45
44	002155	湖南黄金	8,459,515.92	4.42
45	600688	上海石化	8,358,210.65	4.36
46	600108	亚盛集团	8,086,895.73	4.22
47	600150	中国船舶	7,908,667.45	4.13
48	600109	国金证券	7,722,014.06	4.03
49	601377	兴业证券	7,704,064.25	4.02
50	600598	北大荒	7,675,629.74	4.01
51	600958	东方证券	7,654,831.96	4.00

52	002078	太阳纸业	7,599,387.42	3.97
53	600123	兰花科创	7,566,179.02	3.95
54	601166	兴业银行	7,562,028.38	3.95
55	001979	招商蛇口	7,552,800.60	3.94
56	601989	中国重工	7,528,761.69	3.93
57	300038	梅泰诺	7,515,105.78	3.92
58	600754	锦江股份	7,491,256.69	3.91
59	600521	华海药业	7,399,650.40	3.86
60	603658	安图生物	7,164,656.42	3.74
61	002152	广电运通	7,033,662.33	3.67
62	002332	仙琚制药	7,026,991.68	3.67
63	002551	尚荣医疗	6,969,084.83	3.64
64	002775	文科园林	6,908,685.60	3.61
65	600352	浙江龙盛	6,897,500.44	3.60
66	002149	西部材料	6,893,086.08	3.60
67	000959	首钢股份	6,884,899.34	3.59
68	600300	维维股份	6,859,327.08	3.58
69	300359	全通教育	6,796,644.00	3.55
70	600019	宝钢股份	6,644,831.56	3.47
71	600197	伊力特	6,596,369.70	3.44
72	603021	山东华鹏	6,521,026.26	3.40
73	600500	中化国际	6,478,446.69	3.38
74	601088	中国神华	6,467,968.80	3.38
75	600455	博通股份	6,453,022.96	3.37
76	002081	金螳螂	6,375,789.56	3.33
77	000898	鞍钢股份	6,356,299.26	3.32
78	600295	鄂尔多斯	6,345,710.66	3.31
79	300106	西部矿业	6,336,764.51	3.31
80	000887	中鼎股份	6,104,556.38	3.19
81	601225	陕西煤业	6,093,026.42	3.18
82	600873	梅花生物	5,974,324.50	3.12
83	000951	中国重汽	5,964,431.65	3.11
84	300405	科隆精化	5,950,096.82	3.11
85	002013	中航机电	5,949,465.76	3.11
86	600062	华润双鹤	5,939,571.72	3.10
87	601607	上海医药	5,899,193.41	3.08
88	600299	安迪苏	5,893,292.10	3.08
89	600919	江苏银行	5,869,106.00	3.06
90	603678	火炬电子	5,844,892.01	3.05
91	002640	跨境通	5,802,732.50	3.03
92	002564	天沃科技	5,792,859.60	3.02
93	002508	老板电器	5,749,489.11	3.00
94	600199	金种子酒	5,711,251.96	2.98
95	300336	新文化	5,695,299.49	2.97

96	000799	酒鬼酒	5,614,308.17	2.93
97	300232	洲明科技	5,596,768.50	2.92
98	002477	雏鹰农牧	5,584,933.20	2.92
99	002035	华帝股份	5,583,078.59	2.91
100	600702	沱牌舍得	5,534,000.20	2.89
101	002421	达实智能	5,527,274.38	2.89
102	002041	登海种业	5,460,866.61	2.85
103	000018	神州长城	5,404,801.72	2.82
104	002325	洪涛股份	5,345,260.68	2.79
105	600867	通化东宝	5,335,055.26	2.79
106	002572	索菲亚	5,331,603.66	2.78
107	600195	中牧股份	5,319,743.88	2.78
108	600595	中孚实业	5,281,779.35	2.76
109	600228	昌九生化	5,280,449.45	2.76
110	002586	围海股份	5,239,029.00	2.74
111	600713	南京医药	5,237,807.05	2.73
112	600755	厦门国贸	5,230,685.09	2.73
113	603555	贵人鸟	5,225,029.06	2.73
114	000338	潍柴动力	5,211,926.85	2.72
115	002188	巴士在线	5,154,600.00	2.69
116	002707	众信旅游	5,150,076.50	2.69
117	600257	大湖股份	5,017,647.92	2.62
118	002568	百润股份	5,008,932.00	2.61
119	600479	千金药业	4,993,499.80	2.61
120	002440	闰土股份	4,940,175.00	2.58
121	002368	太极股份	4,880,948.76	2.55
122	000932	华菱钢铁	4,856,843.01	2.54
123	002386	天原集团	4,844,074.80	2.53
124	600376	首开股份	4,816,412.00	2.51
125	601899	紫金矿业	4,800,313.06	2.51
126	000521	美菱电器	4,795,178.42	2.50
127	600737	中粮屯河	4,767,540.98	2.49
128	000930	中粮生化	4,766,214.75	2.49
129	000796	凯撒旅游	4,679,398.42	2.44
130	600079	人福医药	4,674,521.38	2.44
131	603008	喜临门	4,625,881.31	2.41
132	000807	云铝股份	4,604,125.74	2.40
133	600031	三一重工	4,570,706.00	2.39
134	600654	中安消	4,554,392.20	2.38
135	002024	苏宁云商	4,500,123.30	2.35
136	000060	中金岭南	4,463,525.95	2.33
137	002717	岭南园林	4,458,899.00	2.33
138	002174	游族网络	4,449,019.72	2.32
139	000402	金融街	4,403,547.80	2.30

140	002110	三钢闽光	4,363,332.66	2.28
141	600585	海螺水泥	4,309,312.82	2.25
142	600110	诺德股份	4,253,470.02	2.22
143	300005	探路者	4,230,699.10	2.21
144	002171	楚江新材	4,203,646.94	2.19
145	002788	鹭燕医药	4,134,796.00	2.16
146	600213	亚星客车	4,065,218.65	2.12
147	603066	音飞储存	4,030,917.00	2.10
148	000998	隆平高科	3,944,522.89	2.06
149	000630	铜陵有色	3,878,002.90	2.02
150	300407	凯发电气	3,873,251.76	2.02
151	300067	安诺其	3,864,595.50	2.02
152	601888	中国国旅	3,854,295.79	2.01
153	002124	天邦股份	3,849,700.67	2.01

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	1,698,806,497.32
卖出股票的收入（成交）总额	1,590,922,503.98

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

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	6,990.90	0.00
2	央行票据	-	-
3	金融债券	9,985,000.00	3.24
	其中：政策性金融债	9,985,000.00	3.24
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	9,991,990.90	3.24

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	160304	16 进出 04	100,000	9,985,000.00	3.24
2	019539	16 国债 11	70	6,990.90	0.00

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。

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	484,438.82
2	应收证券清算款	9,804,883.43
3	应收股利	-
4	应收利息	187,648.01
5	应收申购款	1,513,009.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,989,980.12

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
6,256	43,039.95	123,672,576.66	45.93%	145,585,344.12	54.07%

9.2 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	10,106.89	0.00%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	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

基金转型生效日(2015年6月27日)基金份额总额	339,126,963.92
本报告期期初基金份额总额	173,937,560.24
本报告期基金总申购份额	190,749,244.88
减：本报告期基金总赎回份额	95,428,884.34
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	269,257,920.78

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：本报告期内，经中信银行股份有限公司董事会会议审议通过以下事项：任命李庆萍女士为本行董事长，任命孙德顺先生为本行行长，以上任职资格于2016年7月20日获中国银监会批复核准。

2016年8月6日，中信银行股份有限公司发布变更法定代表人的公告：“中信银行股份有限公司（“本行”）收到北京市工商行政管理局重新核发的《营业执照》，本行已完成法定代表人变更的工商登记手续，自2016年8月1日起，本行法定代表人由常振明先生变更为李庆萍女士。”

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50,000.00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	
安信证券股份有限公司	2	3,286,166,415.75	100.00%	3,060,407.68	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
安信证券股份有限公司	92,314,837.59	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。

交银施罗德基金管理有限公司

二〇一七年三月二十九日