交银施罗德趋势优先混合型证券投资基金
2016 年年度报告
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：中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司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。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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 8
2.1 基金基本情况 8
2.2 基金产品说明 8
2.3 基金管理人和基金托管人 8
2.4 信息披露方式 9
2.5 其他相关资料 9
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 9
3.1 主要会计数据和财务指标 9
3.2 基金净值表现 10
3.3 过去三年基金的利润分配情况 12
§4 管理人报告 12
4.1 基金管理人及基金经理情况 12
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 14
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 15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 16
4.9 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 16
§5 托管人报告 17
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 17
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 17
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 17
§6 审计报告 17
§7 年度财务报表 18
7.1 资产负债表 19
7.2 利润表 20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 21
7.4 报表附注 23
§8 投资组合报告 46
8.1 期末基金资产组合情况 46
8.2 期末按行业分类的股票投资组合 46
8.3 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 47
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 49
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 54
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 54
8.7 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 55
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 55
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 55

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 55
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 55
8.12 投资组合报告附注 55
§9 基金份额持有人信息 56
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 56
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 56
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 56
§10 开放式基金份额变动 56
§11 重大事件揭示 57
11.1 基金份额持有人大会决议 57
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 57
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 57
11.4 基金投资策略的改变 57
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 57
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 58
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 58
11.8 其他重大事件 59
§12 备查文件目录 62
12.1 备查文件目录 62
12.2 存放地点 62
12.3 查阅方式 63

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	交银施罗德趋势优先混合型证券投资基金	
基金简称	交银趋势混合	
基金主代码	519702	
交易代码	519702(前端)	519703(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2010 年 12 月 22 日	
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,308,473,200.53 份	
基金合同存续期	不定期	

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金力图通过把握中国人口变化的重大趋势，精选受益其中的优势行业和个股，在控制风险并保持基金资产良好的流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势，将严谨、规范化的选股方法与积极主动的投资风格相结合，在分析和判断未来人口趋势的重大转变对国民消费倾向、国家收入分配政策、产业升级和区域发展方向等战略决策的重要影响以及其中所蕴涵的行业投资机会的基础上，挖掘受益其中的优势行业，精选个股，以谋求超额收益。
业绩比较基准	75%×沪深 300 指数收益率+25%×中证综合债券指数收益率
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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙艳	郭明
	联系电话	（021）61055050	010-66105799
	电子邮箱	xxpl@jysld.com,disclosure@jysld.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-700-5000，021-61055000	95588
传真		（021）61055054	010-66105798
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）	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		上海浦东新区世纪大道8号国金中心二期21-22楼	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		于亚利	易会满

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙）	上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
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、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	107,565,669.37	315,059,384.13	140,954,411.52
本期利润	66,447,562.32	294,500,520.38	150,330,260.52
加权平均基金份额本期利润	0.1138	0.9177	0.1498
本期加权平均净值利润率	9.17%	69.45%	18.27%
本期基金份额净值增长率	5.13%	70.38%	21.28%
3.1.2 期末数据和指标	**2016 年末**	**2015 年末**	**2014 年末**
期末可供分配利润	255,153,549.15	119,584,066.25	-60,646,885.88
期末可供分配基金份额利润	0.195	0.651	-0.079
期末基金资产净值	1,563,626,749.68	303,262,354.52	744,119,502.77
期末基金份额净值	1.195	1.651	0.969
3.1.3 累计期末指标	**2016 年末**	**2015 年末**	**2014 年末**
基金份额累计净值增长率	73.57%	65.10%	-3.10%

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	3.46%	0.83%	0.98%	0.54%	2.48%	0.29%
过去六个月	10.56%	0.80%	3.89%	0.57%	6.67%	0.23%

过去一年	5.13%	1.58%	-7.69%	1.05%	12.82%	0.53%
过去三年	117.24%	1.97%	38.81%	1.35%	78.43%	0.62%
过去五年	131.43%	1.70%	41.22%	1.22%	90.21%	0.48%
自基金合同生效起至今	73.57%	1.60%	12.03%	1.18%	61.54%	0.42%

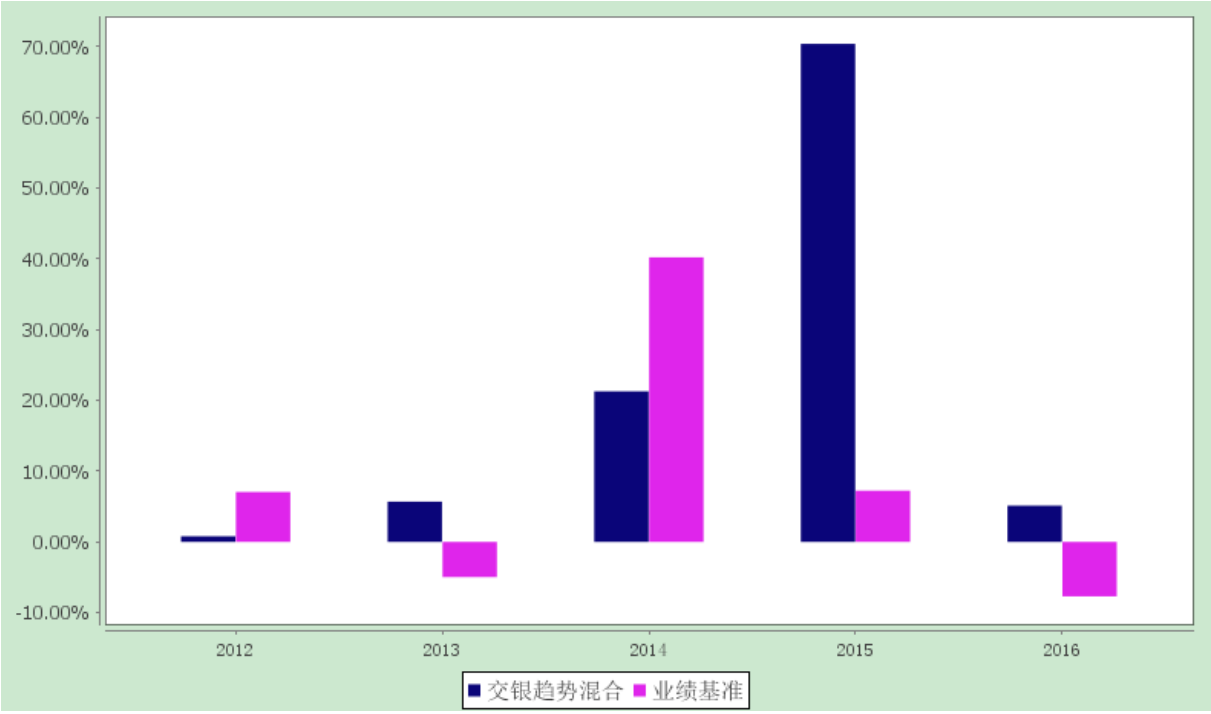
注：1、本基金业绩比较基准自 2015 年 10 月 1 日起，由“75%×沪深 300 指数收益率+25%×中信标普全债指数收益率”变更为“75%×沪深 300 指数收益率+25%×中证综合债券指数收益率”，3.2.2 和 3.2.3 同。详情见本基金管理人于 2015 年 9 月 28 日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金业绩比较基准变更并修改基金合同相关内容的公告》。

2、本基金的业绩比较基准每日进行再平衡过程。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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 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	5.000	1,656,750,131.87	26,500,954.19	1,683,251,086.06	-
2015 年	-	-	-	-	-
2014 年	-	-	-	-	-
合计	5.000	1,656,750,131.87	26,500,954.19	1,683,251,086.06	-

§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		
曹文俊	交银精选混合、交银趋势混合的基金经理	2013-08-08	-	11 年	曹文俊先生，硕士学位。历任申银万国证券研究所有限公司助理分析师，申万巴黎基金管理有限公司（现申万菱信基金管理有限公司）研究员。2010 年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任行业分析师、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 A 股市场整体弱势下行，年初年末都经历了较大幅度的调整，而中间有三个季度的时间市场相对平稳，存在较好的投资操作时间窗口。从风格表现来看，估值较低的周期股和稳定成长类股票表现相对较强，而高估值的中小盘和创业板跌幅居前。究其原因，市场整体风险偏好降低，对于景气度改善和业绩确定性的要求提升，而对于高估值板块整体受压，并购重组从严审核也是高估值板块受挫的重要原因之一。2016 年本基金取得正收益回报，自上而下对市场脉络把握准确，在后三个季度表现尤为突出，主要归功于行业配置和个股选择。

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 1.195 元，本报告期份额净值增长率为 5.13%，同期业绩比较基准增长率为-7.69%。

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,我们对 A 股市场持中性态度，认为全年窄幅震荡格局概率偏大，判断指数表现前低后高。首先，“去杠杆”政策基调已非常鲜明，因此全局性流动性环境可能不如 2016 年宽松；其次，我们判断房地产投资、基建投资和贸易顺差这三大块总需求指标均存在较大下行压力，经济增长压力仍然较大；最后，从大类资产比较角度来看，A 股市场相对于固收市场、地产市场和商品期货市场而言，估值泡沫相对最小，性价比较高，这也是 A 股市场整体下行空间有限的重要原因。选股方向上，我们倾向于选择与宏观经济关联度较低、行业内生增速相对较快的领域，相对更为关注医药、环保、通信、教育等行业。2017 年，选股标准将比之前更为严苛，对于自上而下大逻辑通顺、自下而上业绩增速与估值水平的匹配度等逐项条件均需审慎考虑，才有望获得理想的回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2016 年度，根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》等有关法规，本基金管理人诚实守信、勤勉尽责，依法履行基金管理人职责，落实风险控制，强化监察稽核职能，确保基金管理业务运作的安全、规范，保护基金投资人的合法权益。

本报告期内，本基金管理人为了确保公司业务的规范运作，主要做了以下工作：

（一）持续完善公司内部控制制度和业务流程，推动制度流程的及时更新。

公司持续以提升制度和业务流程的指导性和执行力为强化内部控制的重要抓手，

以内部管理制度的全面修订和公司主要业务流程的梳理为工作重点。梳理工作使公司制度的有效性、制度流程之间的匹配度得到明显提升。同时在梳理过程中，公司着重关注于公司的核心增值流程，通过对流程的研究、梳理、再造等过程实现管理上风险和回报的平衡。

（二）全面开展内部监督检查，强化公司内部控制。

公司审计部门坚持以法律法规和公司各项制度为依据，按照监管机构的要求对基金运作和公司经营所涉及的各个环节实施了严格的稽核监察。通过对基金投资、销售、运营等部门的内部控制关键点进行定期和不定期检查，促进公司内部控制制度规范、执行有效，风险管理水平不断提升。

（三）强化培训教育，持续提高全员风险合规意识。

公司积极推动各项新法规落实和风险合规教育工作。通过及时、有序和针对性的法律法规、制度规章、风险案例的研讨、培训和交流，提升了员工的风险合规意识，提高了员工内部控制、风险管理的技能和水平，公司内部控制和风险管理基础得到夯实和优化。

4.7 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内对本年度可供分配利润进行了收益分配，具体情况参见7.4.11 利润分配情况。

4.9 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

本报告期内，本基金托管人在对交银施罗德趋势优先混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，交银施罗德趋势优先混合型证券投资基金的管理人——交银施罗德基金管理有限公司在交银施罗德趋势优先混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，交银施罗德趋势优先混合型证券投资基金进行了 1 次利润分配，分配金额为 1,683,251,086.06 元。

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

本托管人依法对交银施罗德基金管理有限公司编制和披露的交银施罗德趋势优先混合型证券投资基金 2016 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

普华永道中天审字(2017)第 20156 号

交银施罗德趋势优先混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的交银施罗德趋势优先混合型证券投资基金(原交银施罗德趋势优先股票证券投资基金，以下简称“交银施罗德趋势优先基金”)的财务报表，包括 2016 年

12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

一、管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是交银施罗德趋势优先基金的基金管理人交银施罗德基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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财务报表，并使其实现公允反映；

(2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

二、注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

三、审计意见

我们认为，上述交银施罗德趋势优先基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中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，公允反映了交银施罗德趋势优先基金 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。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙） 中国注册会计师

薛竞 朱宏宇

上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

2017 年 3 月 24 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：交银施罗德趋势优先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	189,245,159.67	39,585,432.78
结算备付金		6,029,956.54	1,333,157.97
存出保证金		692,340.04	327,649.74
交易性金融资产	7.4.7.2	1,263,410,528.83	262,619,743.80
其中：股票投资		1,193,480,528.83	252,596,743.80
基金投资		-	-
债券投资		69,930,000.00	10,023,000.00
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	97,000,265.50	-
应收证券清算款		-	7,313,739.97
应收利息	7.4.7.5	1,376,416.61	135,311.87
应收股利		-	-
应收申购款		55,472,640.57	146,621.84
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		**1,613,227,307.76**	**311,461,657.97**
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		44,354,070.00	6,011,832.30
应付赎回款		641,322.48	636,783.06
应付管理人报酬		1,661,348.53	379,670.05
应付托管费		276,891.39	63,278.36
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	2,272,281.91	715,362.97
应交税费		32,000.00	32,000.00
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	362,643.77	360,376.71
负债合计		**49,600,558.08**	**8,199,303.45**
所有者权益：		**-**	**-**
实收基金	7.4.7.9	1,308,473,200.53	183,678,288.27
未分配利润	7.4.7.10	255,153,549.15	119,584,066.25
所有者权益合计		**1,563,626,749.68**	**303,262,354.52**
负债和所有者权益总计		**1,613,227,307.76**	**311,461,657.97**

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.195 元，基金份额总额 1,308,473,200.53 份。

7.2 利润表

会计主体：交银施罗德趋势优先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 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		**87,600,378.53**	**309,680,194.29**
1.利息收入		2,456,433.70	598,563.75
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,642,832.01	425,079.04

债券利息收入		288,161.59	171,790.05
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		525,440.10	1,694.66
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		122,405,646.90	329,491,927.50
其中：股票投资收益	7.4.7.12	120,891,976.85	326,947,645.78
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-6,100.00	1,683,328.38
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	1,519,770.05	860,953.34
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-41,118,107.05	-20,558,863.75
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	3,856,404.98	148,566.79
减：二、费用		**21,152,816.21**	**15,179,673.91**
1．管理人报酬		10,562,520.70	6,399,343.52
2．托管费		1,760,420.08	1,066,557.20
3．销售服务费		-	-
4．交易费用	7.4.7.19	8,444,479.30	7,333,727.19
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	385,396.13	380,046.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**66,447,562.32**	**294,500,520.38**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**66,447,562.32**	**294,500,520.38**

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：交银施罗德趋势优先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）	183,678,288.27	119,584,066.25	303,262,354.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	66,447,562.32	66,447,562.32
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）	1,124,794,912.26	1,752,373,006.64	2,877,167,918.90
其中：1.基金申购款	3,917,885,078.29	2,073,799,449.56	5,991,684,527.85
2.基金赎回款	-2,793,090,166.03	-321,426,442.92	-3,114,516,608.95
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）	-	-1,683,251,086.06	-1,683,251,086.06
五、期末所有者权益（基金净值）	1,308,473,200.53	255,153,549.15	1,563,626,749.68
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）	768,247,514.93	-24,128,012.16	744,119,502.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	294,500,520.38	294,500,520.38
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）	-584,569,226.66	-150,788,441.97	-735,357,668.63

其中：1.基金申购款	96,085,265.24	51,287,868.57	147,373,133.81
2.基金赎回款	-680,654,491.90	-202,076,310.54	-882,730,802.44
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）	183,678,288.27	119,584,066.25	303,262,354.52

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

交银施罗德趋势优先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[2010]第 1477 号《关于核准交银施罗德趋势优先股票证券投资基金募集的批复》核准，由交银施罗德基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德趋势优先股票证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 2,658,553,177.07 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(2010)第 406 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《交银施罗德趋势优先股票证券投资基金基金合同》于 2010 年 12 月 22 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,659,781,045.37 份基金份额，其中认购资金利息折合 1,227,868.30 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》及基金管理人于 2015 年 8 月 5 日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金变更基金类别及修改基金名称并相应修改基金合同和托管协议的公告》，交银施罗德趋势优先股票证券投资基金自 2015 年 8 月 8 日起更名为交银施罗德趋势优先混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德趋势优先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、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券和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 60%-95%；债券、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法

规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 5%-40%，其中基金持有的权证不超过基金资产净值的 3%，基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。自基金合同生效日至 2015 年 9 月 30 日，本基金的业绩比较基准为：75%×沪深 300 指数收益率＋25%×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：75%×沪深 300 指数收益率＋25%×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》、《交银施罗德趋势优先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 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 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。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 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(主要为股指期货投资)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。

7.4.4.4 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。

7.4.4.5 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、资产支持证券投资和衍生工具(主要为股指期货投资)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。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 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)。

7.4.4.9 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；于处置时，其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。

7.4.4.10 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。

7.4.4.11 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。

7.4.4.12 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。

7.4.4.13 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股票投资和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：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38 号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票，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》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3) 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。

(4)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、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司《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。

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 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	189,245,159.67	39,585,432.78
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	189,245,159.67	39,585,432.78

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2016 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		1,195,360,997.38	1,193,480,528.83	-1,880,468.55
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	69,905,570.00	69,930,000.00	24,430.00
	合计	69,905,570.00	69,930,000.00	24,430.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,265,266,567.38	1,263,410,528.83	-1,856,038.55
项目		上年度末 2015 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		213,351,575.30	252,596,743.80	39,245,168.50
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	10,006,100.00	10,023,000.00	16,900.00
	合计	10,006,100.00	10,023,000.00	16,900.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		223,357,675.30	262,619,743.80	39,262,068.50

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融工具。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所买入返售金融资产	-	-
银行间买入返售金融资产	97,000,265.50	-
合计	97,000,265.50	-
项目	上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所买入返售金融资产	-	-
银行间买入返售金融资产	-	-
合计	-	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	39,674.48	5,506.12
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	2,984.85	659.89
应收债券利息	1,308,750.68	128,983.61
应收买入返售证券利息	17,088.08	-
应收申购款利息	7,575.87	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-

其他	342.65	162.25
合计	1,376,416.61	135,311.87

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	2,271,391.41	715,362.97
银行间市场应付交易费用	890.50	-
合计	2,272,281.91	715,362.97

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	2,213.57	358.71
应付后端申购费	430.20	18.00
预提审计费	60,000.00	60,000.00
预提信息披露费	300,000.00	300,000.00
合计	362,643.77	360,376.71

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	183,678,288.27	183,678,288.27
本期申购	3,917,885,078.29	3,917,885,078.29
本期赎回（以“-”号填列）	-2,793,090,166.03	-2,793,090,166.03
本期末	1,308,473,200.53	1,308,473,200.53

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。

7.4.7.10 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
上年度末	140,631,517.93	-21,047,451.68	119,584,066.25
本期利润	107,565,669.37	-41,118,107.05	66,447,562.32
本期基金份额交易产生的变动数	2,032,958,308.12	-280,585,301.48	1,752,373,006.64
其中：基金申购款	3,064,624,237.65	-990,824,788.09	2,073,799,449.56
基金赎回款	-1,031,665,929.53	710,239,486.61	-321,426,442.92
本期已分配利润	-1,683,251,086.06	-	-1,683,251,086.06
本期末	597,904,409.36	-342,750,860.21	255,153,549.15

7.4.7.11 存款利息收入

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
活期存款利息收入	1,406,310.54	382,751.52
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	42,858.06	33,113.45
其他	193,663.41	9,214.07
合计	1,642,832.01	425,079.04

7.4.7.12 股票投资收益

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
卖出股票成交总额	2,489,309,695.79	2,631,028,713.91

减：卖出股票成本总额	2,368,417,718.94	2,304,081,068.13
买卖股票差价收入	120,891,976.85	326,947,645.78

7.4.7.13 债券投资收益

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
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	10,281,000.00	15,782,219.43
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	10,006,100.00	13,889,980.00
减：应收利息总额	281,000.00	208,911.05
买卖债券差价收入	-6,100.00	1,683,328.38

7.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

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
股票投资产生的股利收益	1,519,770.05	860,953.34
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,519,770.05	860,953.34

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年12月	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月

	31日	31日
1.交易性金融资产	-41,118,107.05	-20,558,863.75
——股票投资	-41,125,637.05	-19,646,006.15
——债券投资	7,530.00	-912,857.60
——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	-41,118,107.05	-20,558,863.75

7.4.7.18 其他收入

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
基金赎回费收入	3,723,083.03	101,233.94
基金转换费收入	133,321.95	47,332.85
合计	3,856,404.98	148,566.79

注：1、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。

2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的不低于赎回费的 25%归入转出基金的基金资产。

7.4.7.19 交易费用

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
交易所市场交易费用	8,444,154.30	7,333,202.19
银行间市场交易费用	325.00	525.00
合计	8,444,479.30	7,333,727.19

7.4.7.20 其他费用

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
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
银行汇划费	4,196.13	2,046.00
债券账户维护费	21,200.00	18,000.00
合计	385,396.13	380,046.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税[2016]140 号)，要求资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，自 2016 年 5 月 1 日起执行。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2 号)，2017 年 7 月 1 日(含)以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法，由国家税务总局另行制定。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

7.4.9 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
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	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
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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 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	10,562,520.70	6,399,343.52
其中：支付销售机构的客户维护费	1,306,751.44	1,916,380.80

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%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×1.50%÷当年天数。

7.4.10.2.2 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	1,760,420.08	1,066,557.20

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。

7.4.10.2.3 销售服务费

无。

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

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
报告期初持有的基金份额	20,001,800.00	20,001,800.00
报告期间申购/买入总份额	9,050,588.24	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	29,052,388.24	20,001,800.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.22%	10.89%

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、基金管理人投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	189,245,159.67	1,406,310.54	39,585,432.78	382,751.52

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。

7.4.10.6 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。

7.4.10.7 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。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	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	本期利润分配合计	备注
1	2016-07-14	2016-07-14	5.000	1,656,750,131.87	26,500,954.19	1,683,251,086.06	-
合计			5.000	1,656,750,131.87	26,500,954.19	1,683,251,086.06	-

7.4.12 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
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	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	-

				申购						
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	3,491	80,851.56	80,851.56	-
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	-
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	-
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	-
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	-
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	-

7.4.12.2 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(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000821	京山轻机	2016-12-05	重大事项	15.34	-	-	1,999,911	30,948,735.10	30,678,634.74	-
002659	中泰桥梁	2016-11-03	重大事项	23.07	2017-01-06	19.60	1,026,432	21,035,338.93	23,679,786.24	-
000829	天音控股	2016-09-29	重大事项	11.28	-	-	2,000,000	24,517,777.63	22,560,000.00	-

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。

7.4.12.3 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只混合型基金，力图通过把握中国人口变化的重大趋势，精选受益其中的优势行业和个股，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，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、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券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，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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。

7.4.13.2 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国工商银行，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。于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券(2015 年 12 月 31 日：无)。

7.4.13.3 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发行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 7.4.12 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 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约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，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	189,245,159.67	-	-	-	189,245,159.67
结算备付金	6,029,956.54	-	-	-	6,029,956.54
存出保证金	692,340.04	-	-	-	692,340.04
交易性金融资产	69,930,000.00	-	-	1,193,480,528.83	1,263,410,528.83
买入返售金融资产	97,000,265.50	-	-	-	97,000,265.50
应收利息	-	-	-	1,376,416.61	1,376,416.61
应收申购款	50,051,061.98	-	-	5,421,578.59	55,472,640.57
资产总计	412,948,783.73	-	-	1,200,278,524.03	1,613,227,307.76
负债					
应付证券清算款	-	-	-	44,354,070.00	44,354,070.00
应付赎回款	-	-	-	641,322.48	641,322.48
应付管理人报酬	-	-	-	1,661,348.53	1,661,348.53
应付托管费	-	-	-	276,891.39	276,891.39
应付交易费用	-	-	-	2,272,281.91	2,272,281.91
应交税费	-	-	-	32,000.00	32,000.00
其他负债	-	-	-	362,643.77	362,643.77
负债总计	-	-	-	49,600,558.08	49,600,558.08
利率敏感度缺口	412,948,783.73	-	-	1,150,677,965.95	1,563,626,749.68
上年度末	**1 年以内**	**1-5 年**	**5 年以上**	**不计息**	**合计**

2015 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	39,585,432.78	-	-	-	39,585,432.78
结算备付金	1,333,157.97	-	-	-	1,333,157.97
存出保证金	327,649.74	-	-	-	327,649.74
交易性金融资产	10,023,000.00	-	-	252,596,743.80	262,619,743.80
应收证券清算款	-	-	-	7,313,739.97	7,313,739.97
应收利息	-	-	-	135,311.87	135,311.87
应收申购款	-	-	-	146,621.84	146,621.84
资产总计	51,269,240.49	-	-	260,192,417.48	311,461,657.97
负债					
应付证券清算款	-	-	-	6,011,832.30	6,011,832.30
应付赎回款	-	-	-	636,783.06	636,783.06
应付管理人报酬	-	-	-	379,670.05	379,670.05
应付托管费	-	-	-	63,278.36	63,278.36
应付交易费用	-	-	-	715,362.97	715,362.97
应交税费	-	-	-	32,000.00	32,000.00
其他负债	-	-	-	360,376.71	360,376.71
负债总计	-	-	-	8,199,303.45	8,199,303.45
利率敏感度缺口	51,269,240.49	-	-	251,993,114.03	303,262,354.52

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 4.47%(2015 年 12 月 31 日：3.31%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2015 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的其他价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产占基金资产的 60%-95%；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 5%-40%，其中基金持有的权证不超过基金资产净值的 3%，基金保留的现金以及投资于一年期以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。此外，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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	1,193,480,528.83	76.33	252,596,743.80	83.29
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	1,193,480,528.83	76.33	252,596,743.80	83.29

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除“沪深 300”指数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12月31日	上年度末 2015年12月31日
	1.“沪深 300”指数上升 5%	增加约 7,747	增加约 1,293

	2.“沪深 300”指数下降 5%	减少约 7,747	减少约 1,293

7.4.14 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 1,116,136,165.19 元，属于第二层次的余额为 147,274,363.64 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 229,107,857.00 元，第二层次 33,511,886.80 元，无属于第三层次余额)。

(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	1,193,480,528.83	73.98
	其中：股票	1,193,480,528.83	73.98
2	固定收益投资	69,930,000.00	4.33
	其中：债券	69,930,000.00	4.33
	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	97,000,265.50	6.01
	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	195,275,116.21	12.10
7	其他各项资产	57,541,397.22	3.57
8	合计	1,613,227,307.76	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	20,153,907.02	1.29
B	采矿业	-	-
C	制造业	851,587,514.67	54.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,837,917.66	0.88
E	建筑业	23,695,378.47	1.52
F	批发和零售业	61,679,882.64	3.94
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	156,606,837.84	10.02
J	金融业	106,780.00	0.01
K	房地产业	17,193,522.06	1.10
L	租赁和商务服务业	-	-
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	48,609,329.79	3.11
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,193,480,528.83	76.33

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	002123	梦网荣信	6,999,912	104,998,680.00	6.72
2	002583	海能达	7,000,408	92,475,389.68	5.91
3	300279	和晶科技	2,000,020	87,000,870.00	5.56
4	000661	长春高新	600,948	67,216,033.80	4.30
5	600867	通化东宝	2,999,775	65,785,065.75	4.21
6	600486	扬农化工	1,704,485	64,548,846.95	4.13
7	300203	聚光科技	2,028,761	61,978,648.55	3.96
8	000820	神雾节能	1,999,925	57,797,832.50	3.70
9	300347	泰格医药	1,799,679	48,609,329.79	3.11
10	300349	金卡股份	1,342,500	42,731,775.00	2.73
11	601607	上海医药	1,999,994	39,119,882.64	2.50
12	300115	长盈精密	1,500,000	39,090,000.00	2.50
13	002045	国光电器	2,999,953	37,349,414.85	2.39
14	002672	东江环保	1,999,950	35,199,120.00	2.25
15	600500	中化国际	2,999,049	34,968,911.34	2.24
16	000915	山大华特	799,913	33,700,334.69	2.16
17	300278	华昌达	1,403,300	31,363,755.00	2.01
18	000821	京山轻机	1,999,911	30,678,634.74	1.96

19	002281	光迅科技	364,726	28,630,991.00	1.83
20	300017	网宿科技	500,600	26,837,166.00	1.72
21	002659	中泰桥梁	1,026,432	23,679,786.24	1.51
22	002773	康弘药业	399,822	22,705,891.38	1.45
23	000829	天音控股	2,000,000	22,560,000.00	1.44
24	600622	嘉宝集团	1,193,166	17,193,522.06	1.10
25	600856	中天能源	1,000,000	13,800,000.00	0.88
26	603000	人民网	699,967	12,361,417.22	0.79
27	300310	宜通世纪	499,913	12,167,882.42	0.78
28	300064	豫金刚石	999,963	11,349,580.05	0.73
29	000998	隆平高科	499,986	10,714,699.98	0.69
30	002041	登海种业	499,958	9,439,207.04	0.60
31	603808	歌力思	190,500	6,113,145.00	0.39
32	600996	贵广网络	12,500	234,875.00	0.02
33	603823	百合花	3,762	123,167.88	0.01
34	601375	中原证券	26,695	106,780.00	0.01
35	603298	杭叉集团	3,641	88,403.48	0.01
36	603228	景旺电子	3,491	80,851.56	0.01
37	002832	比音勒芬	1,158	70,290.60	0.00
38	603218	日月股份	1,652	68,805.80	0.00
39	603877	太平鸟	3,180	67,734.00	0.00
40	002826	易明医药	2,181	57,316.68	0.00
41	603416	信捷电气	1,076	53,886.08	0.00
42	002833	弘亚数控	2,743	48,331.66	0.00
43	603886	元祖股份	2,241	39,665.70	0.00
44	603689	皖天然气	4,818	37,917.66	0.00
45	300582	英飞特	1,359	35,157.33	0.00
46	603239	浙江仙通	924	29,059.80	0.00
47	002835	同为股份	1,126	24,220.26	0.00
48	603035	常熟汽饰	2,316	24,179.04	0.00
49	603266	天龙股份	1,562	22,852.06	0.00
50	300587	天铁股份	1,438	20,290.18	0.00
51	603929	亚翔集成	2,193	15,592.23	0.00
52	002840	华统股份	1,814	11,881.70	0.00
53	002838	道恩股份	681	10,405.68	0.00
54	603186	华正新材	1,874	10,063.38	0.00
55	603032	德新交运	1,628	9,458.68	0.00
56	300586	美联新材	1,006	9,355.80	0.00
57	300591	万里马	2,396	7,355.72	0.00
58	300588	熙菱信息	1,380	6,817.20	0.00

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	002123	梦网荣信	126,215,878.86	41.62
2	300203	聚光科技	106,199,810.11	35.02
3	300279	和晶科技	95,473,010.70	31.48
4	002583	海能达	93,260,657.07	30.75
5	002672	东江环保	87,390,859.37	28.82
6	600887	伊利股份	78,967,272.00	26.04
7	300033	同花顺	74,699,141.14	24.63
8	000661	长春高新	69,514,018.81	22.92
9	600867	通化东宝	68,924,027.76	22.73
10	600486	扬农化工	68,231,718.24	22.50
11	300347	泰格医药	67,927,781.45	22.40
12	000820	神雾节能	67,130,613.00	22.14
13	000651	格力电器	61,718,404.32	20.35
14	000568	泸州老窖	59,844,510.34	19.73
15	000858	五 粮 液	59,616,470.61	19.66
16	601988	中国银行	59,152,828.00	19.51
17	002120	新海股份	55,630,008.01	18.34
18	002281	光迅科技	52,627,698.81	17.35
19	600500	中化国际	51,394,027.52	16.95
20	002045	国光电器	49,699,705.74	16.39
21	000333	美的集团	47,497,355.62	15.66
22	002659	中泰桥梁	47,454,275.07	15.65
23	000776	广发证券	47,119,095.10	15.54
24	300349	金卡股份	47,070,494.80	15.52
25	600674	川投能源	47,063,320.20	15.52
26	300115	长盈精密	46,768,486.46	15.42
27	000915	山大华特	46,493,434.07	15.33
28	600276	恒瑞医药	46,073,352.00	15.19
29	300278	华昌达	45,915,082.44	15.14
30	601688	华泰证券	43,820,689.07	14.45
31	600233	圆通速递	41,356,819.90	13.64
32	603000	人民网	40,902,557.39	13.49
33	600999	招商证券	40,668,112.00	13.41
34	601607	上海医药	39,652,258.72	13.08
35	002643	万润股份	35,653,717.50	11.76
36	002117	东港股份	32,906,275.06	10.85

37	600521	华海药业	32,155,201.18	10.60
38	002343	慈文传媒	31,315,898.46	10.33
39	601336	新华保险	31,007,981.60	10.22
40	000821	京山轻机	30,948,735.10	10.21
41	300017	网宿科技	29,962,373.00	9.88
42	300011	鼎汉技术	29,405,101.42	9.70
43	601198	东兴证券	27,671,325.38	9.12
44	000550	江铃汽车	27,107,711.65	8.94
45	000829	天音控股	27,033,277.63	8.91
46	300064	豫金刚石	26,670,362.84	8.79
47	600362	江西铜业	26,330,203.00	8.68
48	000630	铜陵有色	25,303,001.00	8.34
49	000066	长城电脑	24,533,879.19	8.09
50	600315	上海家化	23,349,032.94	7.70
51	002773	康弘药业	22,731,270.12	7.50
52	002717	岭南园林	22,667,739.33	7.47
53	000596	古井贡酒	22,570,052.08	7.44
54	600166	福田汽车	22,425,866.00	7.39
55	600967	北方创业	22,213,995.45	7.33
56	603885	吉祥航空	22,076,022.42	7.28
57	600586	金晶科技	21,913,681.64	7.23
58	600856	中天能源	20,537,790.00	6.77
59	300182	捷成股份	19,376,711.55	6.39
60	000063	中兴通讯	18,095,032.83	5.97
61	000002	万　科A	17,865,480.84	5.89
62	600622	嘉宝集团	17,435,972.09	5.75
63	002041	登海种业	17,155,167.40	5.66
64	000599	青岛双星	16,455,135.59	5.43
65	601233	桐昆股份	14,701,045.41	4.85
66	600115	东方航空	14,539,635.00	4.79
67	000980	金马股份	14,498,829.98	4.78
68	600109	国金证券	14,414,218.00	4.75
69	000671	阳 光 城	13,958,620.00	4.60
70	600583	海油工程	13,682,615.00	4.51
71	002456	欧菲光	13,544,122.00	4.47
72	600635	大众公用	12,607,825.00	4.16
73	300310	宜通世纪	12,308,388.29	4.06
74	600816	安信信托	11,173,246.00	3.68
75	000426	兴业矿业	10,934,726.00	3.61
76	600348	阳泉煤业	10,511,750.76	3.47
77	600588	用友网络	10,487,178.66	3.46
78	000998	隆平高科	10,368,784.88	3.42
79	600325	华发股份	9,985,484.89	3.29
80	300545	联得装备	9,932,192.00	3.28

81	002325	洪涛股份	9,917,928.64	3.27
82	002440	闰土股份	9,803,674.00	3.23
83	603555	贵人鸟	9,594,019.41	3.16
84	600055	万东医疗	9,437,710.60	3.11
85	000727	华东科技	8,935,362.94	2.95
86	002380	科远股份	8,918,855.10	2.94
87	600297	广汇汽车	8,614,042.00	2.84
88	002390	信邦制药	8,493,671.79	2.80
89	300458	全志科技	8,419,366.00	2.78
90	002477	雏鹰农牧	8,100,451.48	2.67
91	002463	沪电股份	7,870,915.00	2.60
92	002662	京威股份	7,614,376.90	2.51
93	600352	浙江龙盛	7,408,454.58	2.44
94	600612	老凤祥	7,085,980.00	2.34
95	300122	智飞生物	6,633,043.95	2.19
96	601699	潞安环能	6,372,753.00	2.10
97	603808	歌力思	6,354,175.59	2.10
98	002657	中科金财	6,227,583.40	2.05

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	600887	伊利股份	79,977,034.60	26.37
2	002120	新海股份	75,969,684.25	25.05
3	300033	同花顺	75,815,988.64	25.00
4	000651	格力电器	67,379,305.39	22.22
5	600233	圆通速递	67,368,452.83	22.21
6	000568	泸州老窖	64,326,307.75	21.21
7	000858	五 粮 液	58,832,108.35	19.40
8	002672	东江环保	58,506,253.62	19.29
9	601988	中国银行	57,828,535.00	19.07
10	000333	美的集团	49,310,204.25	16.26
11	000776	广发证券	48,500,177.37	15.99
12	600674	川投能源	47,869,054.42	15.78
13	300203	聚光科技	47,192,647.02	15.56
14	600276	恒瑞医药	46,470,683.24	15.32
15	601688	华泰证券	45,759,356.62	15.09
16	600999	招商证券	41,392,621.43	13.65

17	300011	鼎汉技术	39,905,713.62	13.16
18	300347	泰格医药	37,706,625.01	12.43
19	002717	岭南园林	35,665,356.80	11.76
20	600521	华海药业	35,334,619.24	11.65
21	002643	万润股份	34,106,263.69	11.25
22	601336	新华保险	31,094,385.92	10.25
23	002343	慈文传媒	30,335,952.26	10.00
24	600362	江西铜业	30,152,957.49	9.94
25	603000	人民网	29,791,445.00	9.82
26	000550	江铃汽车	29,693,560.71	9.79
27	002117	东港股份	29,366,244.11	9.68
28	000820	神雾节能	28,070,650.82	9.26
29	002659	中泰桥梁	27,128,751.92	8.95
30	601198	东兴证券	27,009,340.30	8.91
31	000630	铜陵有色	26,600,500.00	8.77
32	000066	长城电脑	25,563,823.76	8.43
33	002281	光迅科技	25,483,382.60	8.40
34	000596	古井贡酒	23,639,452.50	7.80
35	603885	吉祥航空	23,393,378.80	7.71
36	600967	北方创业	23,200,921.60	7.65
37	600315	上海家化	22,905,496.90	7.55
38	600500	中化国际	22,375,414.00	7.38
39	002456	欧菲光	22,353,323.76	7.37
40	600586	金晶科技	22,308,839.34	7.36
41	600166	福田汽车	22,171,278.00	7.31
42	000002	万　科A	20,271,458.80	6.68
43	300278	华昌达	20,061,339.07	6.62
44	300182	捷成股份	19,044,537.04	6.28
45	000599	青岛双星	17,798,114.64	5.87
46	000063	中兴通讯	17,778,540.75	5.86
47	000980	金马股份	17,204,760.00	5.67
48	300064	豫金刚石	16,850,978.26	5.56
49	600115	东方航空	15,273,701.25	5.04
50	601233	桐昆股份	14,783,759.04	4.87
51	600109	国金证券	14,405,513.00	4.75
52	000727	华东科技	13,680,798.85	4.51
53	002475	立讯精密	13,675,768.69	4.51
54	002045	国光电器	13,553,198.07	4.47
55	000671	阳 光 城	13,478,949.64	4.44
56	600583	海油工程	13,446,400.00	4.43
57	600486	扬农化工	12,938,363.12	4.27
58	600635	大众公用	12,576,435.28	4.15
59	300115	长盈精密	12,059,284.80	3.98
60	000426	兴业矿业	12,053,596.00	3.97

61	002662	京威股份	11,900,996.32	3.92
62	600816	安信信托	11,669,864.00	3.85
63	600588	用友网络	11,173,445.90	3.68
64	002123	梦网荣信	10,905,342.49	3.60
65	600763	通策医疗	10,347,089.36	3.41
66	002477	雏鹰农牧	10,228,004.21	3.37
67	603555	贵人鸟	10,180,037.69	3.36
68	600348	阳泉煤业	10,147,164.87	3.35
69	300545	联得装备	10,138,822.00	3.34
70	600054	黄山旅游	9,940,626.80	3.28
71	300279	和晶科技	9,909,393.18	3.27
72	300458	全志科技	9,823,263.00	3.24
73	002440	闰土股份	9,651,140.92	3.18
74	300161	华中数控	9,579,478.00	3.16
75	002325	洪涛股份	9,546,426.40	3.15
76	300166	东方国信	9,366,192.37	3.09
77	300232	洲明科技	9,338,899.62	3.08
78	002727	一心堂	9,235,513.54	3.05
79	002380	科远股份	9,216,586.52	3.04
80	300262	巴安水务	9,082,825.53	3.00
81	002368	太极股份	8,975,269.76	2.96
82	600055	万东医疗	8,838,007.40	2.91
83	000786	北新建材	8,823,425.24	2.91
84	600297	广汇汽车	8,640,933.18	2.85
85	600325	华发股份	8,571,757.70	2.83
86	000915	山大华特	8,536,083.55	2.81
87	002041	登海种业	8,506,808.59	2.81
88	300122	智飞生物	8,479,417.74	2.80
89	002463	沪电股份	8,280,304.37	2.73
90	002020	京新药业	7,937,401.64	2.62
91	002390	信邦制药	7,853,203.45	2.59
92	600856	中天能源	7,608,340.00	2.51
93	600352	浙江龙盛	7,509,912.74	2.48
94	601699	潞安环能	7,427,040.40	2.45
95	300322	硕贝德	7,231,114.16	2.38
96	002425	凯撒文化	7,221,396.78	2.38
97	600612	老凤祥	6,784,027.00	2.24
98	000625	长安汽车	6,621,507.62	2.18
99	600038	中直股份	6,578,834.30	2.17
100	002191	劲嘉股份	6,538,150.50	2.16
101	000656	金科股份	6,446,894.51	2.13
102	002371	七星电子	6,391,779.48	2.11
103	600585	海螺水泥	6,289,023.20	2.07
104	600809	山西汾酒	6,117,944.00	2.02

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。

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	3,350,427,141.02
卖出股票的收入（成交）总额	2,489,309,695.79

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	69,930,000.00	4.47
	其中：政策性金融债	69,930,000.00	4.47
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	69,930,000.00	4.47

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	160209	16 国开09	700,000	69,930,000.00	4.47

8.7 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。

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	692,340.04
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,376,416.61
5	应收申购款	55,472,640.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	57,541,397.22

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
9,056	144,486.88	1,046,627,380.40	79.99%	261,845,820.13	20.01%

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	492,394.32	0.04%

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	10~50
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(2010 年 12 月 22 日)基金份额总额	2,659,781,045.37
本报告期期初基金份额总额	183,678,288.27
本报告期基金总申购份额	3,917,885,078.29
减：本报告期基金总赎回份额	2,793,090,166.03
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,308,473,200.53

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 60,000.00 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	
长江证券股份有限公司	1	804,671,030.19	13.78%	749,390.94	13.78%	-
东方证券股份有限公司	1	692,691,846.09	11.87%	645,102.68	11.87%	-
中泰证券股份有限公司	2	54,142,344.71	0.93%	50,422.57	0.93%	-
国开证券有限责任公司	1	470,503,152.66	8.06%	438,176.62	8.06%	-
瑞银证券有限责任公司	1	285,648,822.99	4.89%	266,024.65	4.89%	-
民生证券股份有限公司	2	230,042,523.46	3.94%	214,238.36	3.94%	-
广发证券股份有限公司	1	1,598,227,736.45	27.38%	1,488,430.80	27.38%	-
华创证券有限责任公司	3	1,552,749,775.09	26.60%	1,446,077.77	26.60%	-
北京高华证券有限责任公司	1	149,353,268.82	2.56%	139,092.19	2.56%	-

东吴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

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
东方证券股份有限公司	-	-	77,000,000.00	71.96%	-	-
华创证券有限责任公司	-	-	30,000,000.00	28.04%	-	-

注：1、报告期内，本基金新增加交易单元为西藏东方财富证券股份有限公司，其它交易单元未发生变化；

2、租用证券公司专用席位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、租用证券公司专用席位的程序：首先根据租用证券公司专用席位的选择标准进行综合评价，然后根据评价选择基金专用席位。研究部提交方案，并上报公司批准。

11.8 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	2016-01-05
2	交银施罗德基金管理有限公司关于旗下基金在指数熔断期间调整开放时间的补充公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-01-06
3	交银施罗德基金管理有限公司关于增加大泰金石投资管理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	2016-01-15
4	交银施罗德趋势优先混合型证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-01-21
5	交银施罗德基金管理有限公司关于旗下	中国证券报、上海	2016-01-22

	基金所持停牌股票估值调整的公告	证券报、证券时报	
6	交银施罗德趋势优先混合型证券投资基金（更新）招募说明书摘要（2015 年第 2 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-02-05
7	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	2016-02-26
8	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
9	交银施罗德趋势优先混合型证券投资基金 2015 年年度报告摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-03-29
10	交银施罗德趋势优先混合型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-04-20
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	2016-04-21
12	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
13	交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国民生银行股份有限公司直销银行“基金通”平台销售系统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	2016-05-16
14	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
15	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
16	交银施罗德基金管理有限公司关于增加北京恒天明泽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	2016-07-01
17	交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金在上海陆金所资产管理有限公司开通定期定额投资业务并参与其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	2016-07-01
18	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	2016-07-08
19	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德趋势优先混合型证券投资基金分	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-07-12

	红的公告		
20	交银施罗德趋势优先混合型证券投资基金 2016 年第 2 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-07-21
21	交银施罗德基金管理有限公司关于增加北京广源达信投资管理有限公司为旗下部分基金的场外销售机构并参与其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	2016-07-22
22	交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金参与江苏常熟农村商业银行股份有限公司网上交易平台、手机交易平台基金申购费率、定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-08-03
23	交银施罗德基金管理有限公司关于增加奕丰金融服务（深圳）有限公司为旗下部分基金的场外销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-08-05
24	交银施罗德趋势优先混合型证券投资基金（更新）招募说明书摘要（2016 年第 1 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-08-06
25	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	2016-08-18
26	交银施罗德基金管理有限公司关于增加浙江金观诚财富管理有限公司为旗下部分基金的场外销售机构并参与基金前端申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-08-19
27	交银施罗德趋势优先混合型证券投资基金 2016 年半年度报告摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-08-27
28	交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司手机银行基金前端申购（含定期定额投资业务）费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-09-20
29	交银施罗德趋势优先混合型证券投资基金 2016 年第 3 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-10-25
30	交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金参加招商证券股份有限公司基金前端申购（含定期定额投资业务）费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-10-26
31	交银施罗德基金管理有限公司关于增加北京创金启富投资管理有限公司为旗下部分基金的场外销售机构并参与其基金前端申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-11-02
32	交银施罗德基金管理有限公司关于增加日发资产管理（上海）有限公司为旗下	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-11-09

	部分基金的场外销售机构的公告		
33	交银施罗德基金管理有限公司关于增加上海云湾投资管理有限公司为旗下部分基金的场外销售机构并参与其基金前端申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-11-11
34	交银施罗德基金管理有限公司关于增加中证金牛（北京）投资咨询有限公司为旗下部分基金的场外销售机构并参与其基金前端申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-11-11
35	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	2016-11-15
36	交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司手机银行基金前端申购（含定期定额投资业务）费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-11-29
37	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	2016-12-13
38	交银施罗德基金管理有限公司关于增加乾道金融信息服务（北京）有限公司为旗下部分基金的场外销售机构并参与其基金前端（含定期定额投资）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	2016-12-14
39	交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司手机银行基金前端申购（含定期定额投资业务）费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-12-22
40	交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国农业银行股份有限公司基金交易费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-12-30

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中国证监会核准交银施罗德趋势优先股票证券投资基金募集的文件；

2、《交银施罗德趋势优先混合型证券投资基金基金合同》；

3、《交银施罗德趋势优先混合型证券投资基金招募说明书》；

4、《交银施罗德趋势优先混合型证券投资基金托管协议》；

5、关于申请募集交银施罗德趋势优先股票证券投资基金之法律意见书；

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趋势优先混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

12.3 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。

交银施罗德基金管理有限公司
二〇一七年三月二十九日