

**交银施罗德精选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。

基金托管人中国农业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

<b>§1 重要提示及目录</b>	2
1.1 重要提示	2
<b>§2 基金简介</b>	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
<b>§4 管理人报告</b>	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
<b>§5 托管人报告</b>	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
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	14
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	14
<b>§6 审计报告</b>	14
<b>§7 年度财务报表</b>	15
7.1 资产负债表	15
7.2 利润表	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	18
7.4 报表附注	20
<b>§8 投资组合报告</b>	43
8.1 期末基金资产组合情况	43
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	44
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	44
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
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	50
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	50
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	50
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	50

8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	50
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	51
8.12	投资组合报告附注 .....	51
<b>§9</b>	<b>基金份额持有人信息 .....</b>	<b>52</b>
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	52
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	52
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 .....	52
<b>§10</b>	<b>开放式基金份额变动 .....</b>	<b>53</b>
<b>§11</b>	<b>重大事件揭示 .....</b>	<b>53</b>
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	53
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 .....	53
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	53
11.4	基金投资策略的改变 .....	53
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	54
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 .....	54
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	54
11.8	其他重大事件 .....	56
<b>§12</b>	<b>备查文件目录 .....</b>	<b>59</b>
12.1	备查文件目录 .....	59
12.2	存放地点 .....	60
12.3	查阅方式 .....	60

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	交银施罗德精选混合型证券投资基金	
基金简称	交银精选混合	
基金主代码	519688	
交易代码	519688(前端)	519689(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2005年9月29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	5,676,062,235.40 份	
基金合同存续期	不定期	

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将坚持并不断深化价值投资的基本理念，充分发挥专业研究与管理能力，自上而下配置资产，自下而上精选证券，有效控制风险，分享中国经济与资本市场高速成长的成果，谋求实现基金财产的长期稳定增长。
投资策略	自上而下配置资产，自下而上精选证券，有效控制下行风险。
业绩比较基准	75%×沪深 300 指数+25%×中证综合债券指数
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@	tgxxpl@abchina.com

	jysld.com	
客户服务电话	400-700-5000, 021-61055000	95599
传真	021-61055054	010-68121816
注册地址	上海市浦东新区银城中路188号交通银行大楼二层(裙)	北京市东城区建国门内大街69号
办公地址	上海市浦东新区世纪大道8号国金中心二期21-22楼	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码	200120	100031
法定代表人	于亚利	周慕冰

## 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	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市延安东路222号30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	406,205,325.41	1,889,996,497.32	284,046,140.43

本期利润	25,619,409.49	2,035,657,194.93	21,994,266.90
加权平均基金份额本期利润	0.0062	0.6081	0.0036
本期加权平均净值利润率	0.99%	60.91%	0.52%
本期基金份额净值增长率	0.84%	61.03%	1.85%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>2016 年末</b>	<b>2015 年末</b>	<b>2014 年末</b>
期末可供分配利润	709,014,464.64	1,408,549,244.54	372,469,117.78
期末可供分配基金份额利润	0.1249	0.5731	0.0738
期末基金资产净值	3,225,367,795.77	2,860,665,711.72	3,790,603,817.48
期末基金份额净值	0.5682	1.1640	0.7511
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>2016 年末</b>	<b>2015 年末</b>	<b>2014 年末</b>
基金份额累计净值增长率	472.24%	467.45%	252.39%

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	3.24%	0.81%	0.98%	0.54%	2.26%	0.27%
过去六个月	10.55%	0.84%	3.89%	0.57%	6.66%	0.27%
过去一年	0.84%	1.61%	-7.69%	1.05%	8.53%	0.56%
过去三年	65.39%	1.97%	38.81%	1.35%	26.58%	0.62%
过去五年	41.10%	1.61%	15.30%	1.18%	25.80%	0.43%
自基金合同生效起	472.24%	1.62%	219.12%	1.39%	253.12%	0.23%

至今

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+25%×中信全债指数”变更为“75%×沪深 300 指数+25%×中证综合债券指数”，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。

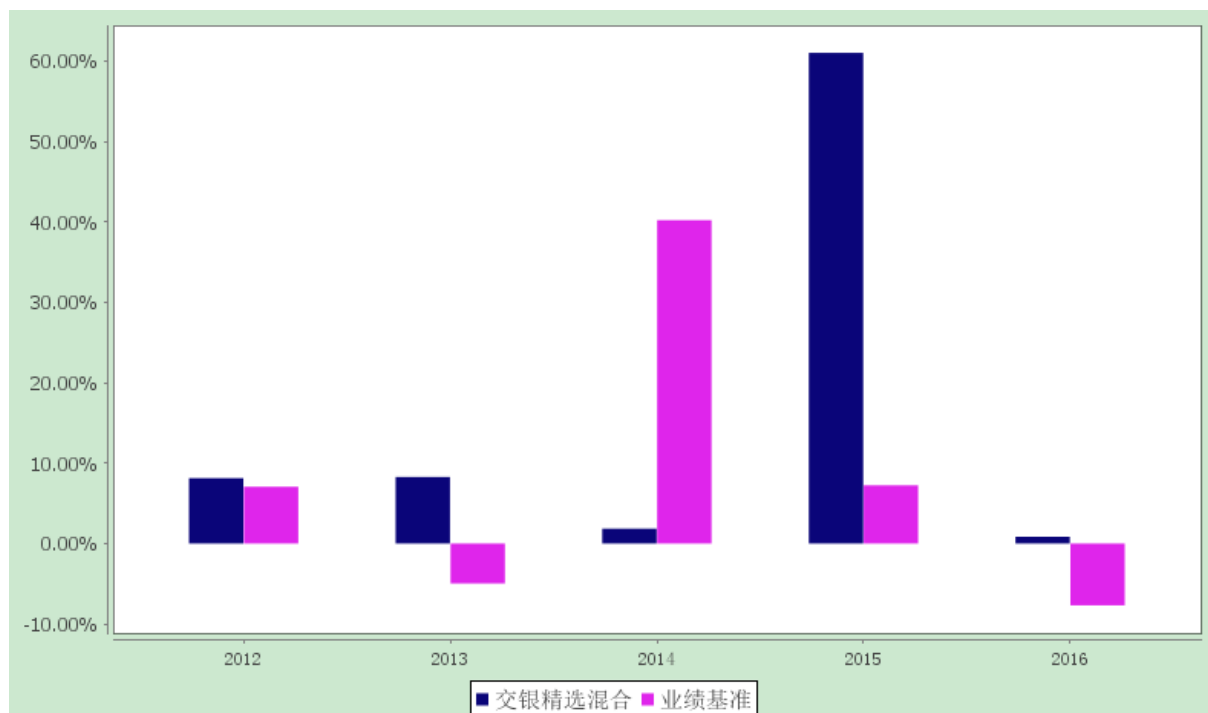
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



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	5.250	876,075,154.01	862,412,971.40	1,738,488,125.41	-
2015年	0.290	63,005,987.53	79,189,638.82	142,195,626.35	-
2014年	0.460	140,095,760.12	159,550,069.70	299,645,829.82	-
合计	6.000	1,079,176,901.66	1,101,152,679.92	2,180,329,581.58	-

## § 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	2014-10-22	-	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 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 0.5682 元，本报告期份额净值增长率为 0.84%，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

根据相关法律法规和基金合同要求，本基金本报告期内对上一年度和本年度应分配的可分配利润分别进行了收益分配，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

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

德师报(审)字(17)第 P01123 号

交银施罗德精选混合型证券投资基金全体持有人：

我们审计了后附的交银施罗德精选混合型证券投资基金(以下简称“交银精选混合型证券投资基金”)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、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精选混合型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发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，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而导致的重大错报。

## 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，交银精选混合型基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了交银精选混合型基金 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。

德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

陶坚 汪芳

上海市延安东路 222 号 30 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：交银施罗德精选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
<b>资产：</b>		-	-
银行存款	7.4.7.1	78,489,354.22	213,659,492.90
结算备付金		12,945,528.24	10,591,595.65
存出保证金		3,038,631.62	4,802,573.34
交易性金融资产	7.4.7.2	2,857,551,275.21	2,580,148,609.52
其中：股票投资		2,687,820,275.21	2,449,612,609.52
基金投资		-	-
债券投资		169,731,000.00	130,536,000.00
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	299,507,809.26	100,000,270.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	3,098,276.34	1,952,512.92
应收股利		-	-
应收申购款		743,178.50	328,707.82
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>3,255,374,053.39</b>	<b>2,911,483,762.15</b>
<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		17,432,268.71	33,745,591.36
应付赎回款		1,637,568.97	7,138,544.42



应付管理人报酬		4,267,995.52	3,550,826.51
应付托管费		711,332.58	591,804.45
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	5,552,680.30	5,382,682.56
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	404,411.54	408,601.13
<b>负债合计</b>		<b>30,006,257.62</b>	<b>50,818,050.43</b>
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	7.4.7.9	2,516,353,331.13	1,089,471,734.03
未分配利润	7.4.7.10	709,014,464.64	1,771,193,977.69
<b>所有者权益合计</b>		<b>3,225,367,795.77</b>	<b>2,860,665,711.72</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>3,255,374,053.39</b>	<b>2,911,483,762.15</b>

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.5682 元，基金份额总额 5,676,062,235.40 份。

## 7.2 利润表

会计主体：交银施罗德精选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
<b>一、收入</b>		<b>100,282,855.25</b>	<b>2,135,674,702.92</b>
1.利息收入		6,888,173.78	9,047,544.32
其中：存款利息收入	7.4.7.11	3,160,457.20	2,577,897.02
债券利息收入		1,804,770.26	4,807,922.31
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,873,445.74	1,661,724.99
其他利息收入		49,500.58	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		472,847,007.74	1,980,401,187.76

其中：股票投资收益	7.4.7.12	462,410,480.87	1,968,693,082.73
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	52,160.00	5,272,180.88
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	10,384,366.87	6,435,924.15
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-380,585,915.92	145,660,697.61
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	1,133,589.65	565,273.23
<b>减：二、费用</b>		<b>74,663,445.76</b>	<b>100,017,507.99</b>
1. 管理人报酬		38,819,218.65	50,075,824.33
2. 托管费		6,469,869.78	8,345,970.78
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	28,880,106.81	41,098,482.86
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	494,250.52	497,230.02
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>25,619,409.49</b>	<b>2,035,657,194.93</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>25,619,409.49</b>	<b>2,035,657,194.93</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：交银施罗德精选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)	1,089,471,734.03	1,771,193,977.69	2,860,665,711.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	25,619,409.49	25,619,409.49
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)	1,426,881,597.10	650,689,202.87	2,077,570,799.97
其中：1.基金申购款	2,189,882,308.01	957,653,978.58	3,147,536,286.59
2.基金赎回款	-763,000,710.91	-306,964,775.71	-1,069,965,486.62
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)	-	-1,738,488,125.41	-1,738,488,125.41
五、期末所有者权益 (基金净值)	2,516,353,331.13	709,014,464.64	3,225,367,795.77
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)	2,237,412,509.34	1,553,191,308.14	3,790,603,817.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	2,035,657,194.93	2,035,657,194.93
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)	-1,147,940,775.31	-1,675,458,899.03	-2,823,399,674.34
其中：1.基金申购款	242,651,308.71	324,385,296.80	567,036,605.51
2.基金赎回款	-1,390,592,084.02	-1,999,844,195.83	-3,390,436,279.85
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)	-	-142,195,626.35	-142,195,626.35

五、期末所有者权益 (基金净值)	1,089,471,734.03	1,771,193,977.69	2,860,665,711.72
---------------------	------------------	------------------	------------------

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

交银施罗德精选混合型证券投资基金(原交银施罗德精选股票证券投资基金, 以下简称“本基金”)系由基金管理人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》、《交银施罗德精选股票证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规的规定, 经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)以证监基金字[2005]140 号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金, 存续期限不定, 首次设立募集基金份额为 4,874,882,643.01 份, 经德勤华永会计师事务所有限公司验证, 并出具了编号为德师报(验)字(05)第 0038 号验资报告。《交银施罗德精选股票证券投资基金基金合同》(以下简称“原基金合同”)于 2005 年 9 月 29 日正式生效。本基金的管理人为交银施罗德基金管理有限公司, 托管人为中国农业银行股份有限公司(以下简称“中国农业银行”)。

根据 2007 年 1 月 23 日《交银施罗德基金管理有限公司关于对交银施罗德精选股票证券投资基金实施基金份额拆分和限量销售的公告》, 根据拆分前基金份额净值和公告的基金份额拆分比例计算公式, 基金份额拆分比例为 1:2.255776094(保留到小数点后 9 位), 拆分后的基金份额净值为 1.0000 元。本基金注册登记机构于 2007 年 1 月 29 日对基金份额持有人经重新计算的基金份额进行了变更登记。

2015 年 8 月, 本基金更名为交银施罗德精选混合型证券投资基金, 公告了《交银施罗德精选混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“修改后的基金合同”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、修改后的基金合同和定期更新的本基金招募说明书的有关规定, 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、资产支持证券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。基金的投资组合为: 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%。

本基金的业绩比较基准自 2015 年 10 月 1 日起, 由“75%×沪深 300 指数+25%×中信全债指数”变更为“75%×沪深 300 指数+25%×中证综合债券指数”。

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颁布的企业会计准则以及其他相关规定(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颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《交银施罗德精选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

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作有关规定的要求, 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。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度, 即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### 金融资产分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求, 本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和贷款及应收款项, 暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。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, 其他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。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等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分类为贷款及应收款项。

###### 金融负债分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求, 本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无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。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

#### 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

1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

-股票投资

股票投资成本于交易日按应付或实际支付的全部价款(不含应收股利)入账, 相关交易费用直接计入当期损益。

股票持有期间获得的股票股利(包括送红股和公积金转增股本), 于除权日按股权登记日持有的股数及送股或转增比例, 计算确定增加的股票数量。

卖出股票于交易日确认股票投资收益。卖出股票按移动加权平均法结转成本。

-债券投资

买入债券于交易日确认为债券投资。债券投资成本按债券的公允价值入账, 相关交易费用直接计入当期损益, 上述公允价值不包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息(作为应收利息单独核算)。

买入央行票据和零息债券视同到期一次还本付息的附息债券, 根据其发行价、到期价和发行期限推算内含利率后, 逐日确认债券利息收入。

卖出债券于交易日确认债券投资收益。卖出债券按移动加权平均法结转成本。

2) 贷款及应收款项

-买入返售金融资产

买入返售金融资产为本基金按照返售协议约定先买入再按固定价格返售证券等金融资产所融出的资金。

买入返售金融资产按交易日应支付或实际支付的全部价款入账, 相关交易费用计入初始成本。买入返售金融资产于返售日按账面余额结转。

3) 其他金融负债

-卖出回购金融资产款

卖出回购金融资产款为本基金按照回购协议先卖出再按固定价格买入票据、证券等金融资产所融入的资金。

卖出回购金融资产款于交易日按照应收或实际收到的金额入账, 相关交易费用计入初始成本。卖出回购金融资产款于回购日按账面余额结转。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

1) 对存在活跃市场的投资品种, 如估值日有市价的, 采用市价确定公允价值; 估值日无市价, 且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, 采用最近交易市价确定公允价值。

2) 对存在活跃市场的投资品种, 如估值日无市价, 且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件, 使潜在估值调整对前一

估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，应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，确定公允价值。

3) 当投资品种不再存在活跃市场，且其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，应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，确定投资品种的公允价值。

具体投资品种的估值方法如下：

#### -股票投资

交易所上市流通的股票以其估值日在证券交易所挂牌的收盘价为公允价值。

本基金对于长期停牌股票的期末估值参照证券监督管理委员会 2008 年 9 月 12 日发布的公告[2008]38 号文《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》规定，若长期停牌股票的潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，经基金管理人估值委员会同意，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素(如指数收益法)，调整最近交易市价，确定公允价值。

由于上市公司送股、转增股、配股和公开增发新股等形成的流通暂时受限制的股票投资，按交易所上市的同一股票的市场交易收盘价作为公允价值。

首次公开发行但未上市股票按采用估值技术确定的公允价值估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下按成本计量。首次公开发行有明确锁定期的股票，于同一股票上市后按交易所上市的同一股票的市场交易收盘价作为公允价值。

非公开发行有明确锁定期的股票，若在证券交易所上市的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票初始投资成本，以估值日证券交易所上市的同一股票的市场交易收盘价为公允价值；若在证券交易所上市的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票初始投资成本，按交易所上市的同一股票市场交易收盘价为基础进行估值确定其公允价值。

#### -债券投资

银行间市场交易的固定收益品种按照第三方估值机构提供估值确定公允价值；交易所上市交易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)按照第三方估值机构提供估值确定公允价值。

对于交易所市场上市交易的可转换债券，以每日收盘价作为估值全价。

未上市债券、交易所上市交易的资产支持证券及私募债，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下或相关利率没有发生大的变动的情况下，按成本进行后续计量。

如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法

定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及分红再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。基金份额拆分引起的基金份额变动于份额拆分日按拆分前的基金份额数及确定的拆分比例，计算并增加基金份额数量。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于年末全额转入利润分配(未分配利润)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### -利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除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，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含利率后，逐日确认债券利息收入。

资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额，确认资产支持证券利息收入。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息收入。

##### -投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

债券投资收益于交易日按卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

资产支持证券投资收益于交易日按卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。



衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

-公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产/负债的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产/负债卖出或到期时转出计入投资收益。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×1.5%的年费率逐日计提。

本基金的基金托管费按前一日基金资产净值×0.25%的年费率逐日计提。

交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小的，则采用合同利率计算确定利息支出。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

1)每年收益分配次数最多为6次，年度收益分配比例不低于基金年度已实现收益的50%；

2)收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。若基金份额持有人不选择，基金默认的收益分配方式是现金分红；分红方式最终以注册登记机构确认的分红方式为准；

3)基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；

4)基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；

5)在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益每年至少分配一次，但若基金合同生效不满3个月则不进行收益分配；

6)基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；

7)每一基金份额享有同等分配权；

8)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

## 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

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

### 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重大会计差错更正。

## 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[2015]125号《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、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) 对于内地投资者持有的基金类别，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。对于香港市场投资者通过基金互认持有的基金类别，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该内地基金分配利息时按照7%的税

率代扣代缴所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，应由内地上市公司向该内地基金分配股息红利时按照 10% 的税率代扣代缴所得税。

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	78,489,354.22	213,659,492.90
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	78,489,354.22	213,659,492.90

##### 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	2,661,503,460.49	2,687,820,275.21	26,316,814.72	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	169,855,070.00	169,731,000.00	-124,070.00
	合计	169,855,070.00	169,731,000.00	-124,070.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	2,831,358,530.49	2,857,551,275.21	26,192,744.72	
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	2,043,342,608.88	2,449,612,609.52	406,270,000.64	

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	130,027,340.00	130,536,000.00	508,660.00
	合计	130,027,340.00	130,536,000.00	508,660.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		2,173,369,948.88	2,580,148,609.52	406,778,660.64

#### 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
银行间买入返售金融资产	299,507,809.26	-
合计	299,507,809.26	-
项目	上年度末 2015年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间买入返售金融资产	100,000,270.00	-
合计	100,000,270.00	-

##### 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	56,827.83	30,477.69
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	6,556.44	5,391.32
应收债券利息	2,968,342.47	1,908,098.37
应收买入返售证券利息	64,156.34	6,316.06
应收申购款利息	1,037.62	0.66
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	1,355.64	2,228.82
合计	3,098,276.34	1,952,512.92

#### 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	5,536,326.11	5,380,727.82
银行间市场应付交易费用	16,354.19	1,954.74
合计	5,552,680.30	5,382,682.56

#### 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	4,042.61	6,127.93
预提信息披露费	300,000.00	300,000.00
预提审计费	100,000.00	100,000.00
后端申购费	368.93	2,473.20
合计	404,411.54	408,601.13

#### 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	2,457,568,763.82	1,089,471,734.03
本期申购	4,939,606,055.28	2,189,882,308.01
本期赎回（以“-”号填列）	-1,721,112,583.70	-763,000,710.91
本期末	5,676,062,235.40	2,516,353,331.13

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	1,408,549,244.54	362,644,733.15	1,771,193,977.69
本期利润	406,205,325.41	-380,585,915.92	25,619,409.49
本期基金份额交易产生的变动数	709,299,199.13	-58,609,996.26	650,689,202.87
其中：基金申购款	1,031,475,736.55	-73,821,757.97	957,653,978.58
基金赎回款	-322,176,537.42	15,211,761.71	-306,964,775.71
本期已分配利润	-1,738,488,125.41	-	-1,738,488,125.41
本期末	785,565,643.67	-76,551,179.03	709,014,464.64

#### 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	2,960,725.50	2,355,189.53
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	149,995.52	177,793.70
其他	49,736.18	44,913.79
合计	3,160,457.20	2,577,897.02

#### 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	9,447,915,896.24	14,489,510,808.94
减：卖出股票成本总额	8,985,505,415.37	12,520,817,726.21
买卖股票差价收入	462,410,480.87	1,968,693,082.73

#### 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	133,460,450.82	262,329,423.44
减：卖出债券（债转股及债券到期兑 付）成本总额	130,027,340.00	249,457,470.00
减：应收利息总额	3,380,950.82	7,599,772.56
买卖债券差价收入	52,160.00	5,272,180.88

#### 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	上年度可比期间
----	----	---------

	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	10,384,366.87	6,435,924.15
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	10,384,366.87	6,435,924.15

#### 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31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
1.交易性金融资产	-380,585,915.92	145,660,697.61
——股票投资	-379,953,185.92	145,179,967.61
——债券投资	-632,730.00	480,730.00
——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	-380,585,915.92	145,660,697.61

#### 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	1,065,464.32	479,166.35
基金转换费收入	68,125.33	86,106.88
其他	-	-
合计	1,133,589.65	565,273.23

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	28,878,956.81	41,096,682.86
银行间市场交易费用	1,150.00	1,800.00
合计	28,880,106.81	41,098,482.86

#### 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	100,000.00	100,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
银行汇划费	56,690.52	60,220.02
债券账户维护费	37,200.00	36,650.00
其他	360.00	360.00
合计	494,250.52	497,230.02

### 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
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	38,819,218.65	50,075,824.33
其中：支付销售机构的客户维护费	4,124,522.46	6,248,201.66

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。

###### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	6,469,869.78	8,345,970.78

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 基金销售服务费

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

单位：人民币元

本期						
2016年1月1日至2016年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间						
2015年1月1日至2015年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
交通银行	-	-	29,700,000.00	2,444.57	-	-

#### 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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
报告期初持有的基金份额	95,457,385.41	91,996,189.89

报告期间申购/买入总份额	104,355,291.10	3,461,195.52
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	199,812,676.51	-
报告期末持有的基金份额	-	95,457,385.41
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	3.88%

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。

#### 7.4.10.4.2 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		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年12月31日		2015年1月1日至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	78,489,354.22	2,960,725.50	213,659,492.90	2,355,189.53

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	2016-01-13	2016-01-13	3.850	407,579,642.73	538,867,149.25	946,446,791.98	-

2	2016-11-10	2016-11-10	1.400	468,495,511.28	323,545,822.15	792,041,333.43	-
合计			5.250	876,075,154.01	862,412,971.40	1,738,488,125.41	-

注：本基金的基金管理人于资产负债表日后、报告批准报出日之前宣告的利润分配情况，请参见附注 7.4.8.2 资产负债表日后事项。

## 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	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	皖天燃气	2016-12-30	2017-01-10	新股网下	7.87	7.87	4,818	37,917.66	37,917.66	-

				申购						
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	2,397	7,358.79	7,358.79	-

#### 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	复牌开盘价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000829	天音控股	2016-09-29	重大事项	11.28	-	-	4,999,797	63,866,744.24	56,397,710.16	-
000821	京山轻机	2016-12-05	重大事项	15.34	-	-	4,999,875	76,926,757.68	76,698,082.50	-
002659	中泰桥梁	2016-11-03	重大事项	23.07	2017-01-06	19.60	4,975,442	95,153,841.61	114,783,446.94	-

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，无抵押债券。

### 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

本基金为混合型基金，本基金的运作涉及的金融工具主要包括股票投资、债券投资、权证投资等。与这些金融工具有关的风险，以及本基金管理人管理此类风险所采取的风险管理政策如下所述。

本基金管理人从事风险管理的目标是使本基金在风险和收益之间取得适当的平衡，

将风险对本基金经营业绩的负面影响降低到最低水平，使基金持有人的利益最大化。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人风险管理的基本策略是识别和分析本基金运作时本基金面临的各种类型的风险，确定适当的风险容忍度，并及时可靠地对各种风险进行监督，将风险控制在限定的范围之内。本基金目前面临的主要风险包括：信用风险、流动性风险和市场风险。与本基金相关的市场风险主要包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

本基金的基金管理人建立了以全面、独立、相互制约以及定性和定量相结合为原则的，由董事会最终负责、业务部门进行风险评估和监控、风险管理部监察执行的，同时督察长行使独立监察权力的风险管理组织架构体系。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指金融工具的一方到期无法履行约定义务致使本基金遭受损失的风险。本基金的信用风险主要存在于银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资、买入返售金融资产、应收利息及其他。

本基金的银行存款存放于本基金的基金托管行-中国农业银行。本基金认为与中国农业银行相关的信用风险不重大。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

对于与债券投资等投资品种相关的信用风险，本基金管理人通过对投资品种的信用等级评估来选择适当的投资对象，并限制单个投资品种的持有比例来管理信用风险。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指没有足够资金以满足到期债务支付的风险。本基金流动性风险来源于开放式基金每日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险和因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。本基金所持大部分交易性金融资产在证券交易所上市，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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款，设计了非常情况下赎回资金的处理模式，控制因开放模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。日常流动性风险管理中，本基金管理人每日监控和预测本基金的流动性指标，通过对投资品种的流动性指标来持续地评估、选择、跟踪和控制基金投资的流动性风险。同时，本基金在需要时可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金，以缓解流动性风险。

## 7.4.13.4 市场风险

### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的利率敏感性资产主要是银行存款、债券投资与买入返售金融资产。基于本基金产品性质，生息资产占基金资产绝对比重较小，因此本基金并不存在重大的利率风险。本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，通过对短期利率水平的预测、收益率曲线分析、利率重定价日组合及类别品种配置、调整投资组合的久期、凸性等方法对上述利率风险进行管理。

#### 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个月以内	1-3个月	3个月-1年	1年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	78,489,354.22	-	-	-	-	78,489,354.22
结算备付金	12,945,528.24	-	-	-	-	12,945,528.24
存出保证金	3,038,631.62	-	-	-	-	3,038,631.62
交易性金融资产	-	-	169,731,000.00	-	2,687,820,275.21	2,857,551,275.21
买入返售金融资产	299,507,809.26	-	-	-	-	299,507,809.26
应收利息	-	-	-	-	3,098,276.34	3,098,276.34
应收申购款	10,139.17	-	-	-	733,039.33	743,178.50
资产总计	393,991,462.51	-	169,731,000.00	-	2,691,651,590.88	3,255,374,053.39
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	17,432,268.71	17,432,268.71
应付赎回款	-	-	-	-	1,637,568.97	1,637,568.97
应付管理人报酬	-	-	-	-	4,267,995.52	4,267,995.52
应付托管费	-	-	-	-	711,332.58	711,332.58
应付交易费用	-	-	-	-	5,552,680.30	5,552,680.30
其他负债	-	-	-	-	404,411.54	404,411.54
负债总计	-	-	-	-	30,006,257.62	30,006,257.62
利率敏感度缺口	393,991,462.51	-	169,731,000.00	-	2,661,645,333.26	3,225,367,795.77
上年度末 2015年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	213,659,492.90	-	-	-	-	213,659,492.90
结算备付金	10,591,595.65	-	-	-	-	10,591,595.65



存出保证金	4,802,573.34	-	-	-	4,802,573.34
交易性金融资产	-	-	130,536,000.00	2,449,612,609.52	2,580,148,609.52
买入返售金融资产	100,000,270.00	-	-	-	100,000,270.00
应收利息	-	-	-	1,952,512.92	1,952,512.92
应收申购款	-	-	-	328,707.82	328,707.82
资产总计	329,053,931.89	-	130,536,000.00	2,451,893,830.26	2,911,483,762.15
负债					
应付证券清算款	-	-	-	33,745,591.36	33,745,591.36
应付赎回款	-	-	-	7,138,544.42	7,138,544.42
应付管理人报酬	-	-	-	3,550,826.51	3,550,826.51
应付托管费	-	-	-	591,804.45	591,804.45
应付交易费用	-	-	-	5,382,682.56	5,382,682.56
其他负债	-	-	-	408,601.13	408,601.13
负债总计	-	-	-	50,818,050.43	50,818,050.43
利率敏感度缺口	329,053,931.89	-	130,536,000.00	2,401,075,779.83	2,860,665,711.72

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 5.26%(2015 年 12 月 31 日：4.56%)，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

其他价格风险是指金融工具的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。该风险可能与特定投资品种相关，也有可能与整体投资品种相关。本基金的金融资产以公允价值计量，所有其他价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金在购建资产配置和基金资产投资组合的基础上，通过建立事前和事后跟踪误差的方式，对基金资产的市场价格风险进行管理。

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%。于资产负债表日，本基金面临的其他价格风险列示如下：

#### 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	2,687,820,275.2 1	83.33	2,449,612,609.5 2	85.63
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	2,687,820,275.2 1	83.33	2,449,612,609.5 2	85.63

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1.除本基金业绩比较标准外的其他市场变量保持不变。		
	2.观察有效期设定为一年期间。		
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.业绩比较基准下降 5%	减少约 21,722	减少约 15,995
2.业绩比较基准上升 5%	增加约 21,722	增加约 15,995	

#### 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)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。

##### (b)以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层次的输入值确定公允价值计量层次。公允价值计量层次可分为：

第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值是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；

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

(ii) 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 2,439,515,089.88 元，属于第二层次的余额为 418,036,185.33 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 2,206,091,582.57 元，第二层次 374,057,026.95 元，无属于第三层次的余额)。

(iii) 公允价值所属层次间的重大变动

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

如本财务报告 7.4.5.2 部分所述，本基金交易所上市交易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除外)本期采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值，相关固定收益品种的公允价值层次归入第二层次。

(iv) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(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	2,687,820,275.21	82.57
	其中：股票	2,687,820,275.21	82.57
2	固定收益投资	169,731,000.00	5.21

	其中：债券	169,731,000.00	5.21
	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	299,507,809.26	9.20
	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	91,434,882.46	2.81
7	其他各项资产	6,880,086.46	0.21
8	合计	3,255,374,053.39	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	40,371,378.88	1.25
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,926,993,244.21	59.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	27,645,687.06	0.86
E	建筑业	114,799,039.17	3.56
F	批发和零售业	134,635,773.72	4.17
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	343,437,003.48	10.65
J	金融业	-	-
K	房地产业	5,393,663.00	0.17
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	94,535,027.01	2.93
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,687,820,275.21	83.33

### 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	15,003,466	225,051,990.00	6.98
2	002583	海能达	15,063,334	198,986,642.14	6.17
3	300279	和晶科技	4,500,797	195,784,669.50	6.07
4	300203	聚光科技	5,199,400	158,841,670.00	4.92
5	600486	扬农化工	4,010,081	151,861,767.47	4.71
6	000820	神雾节能	4,999,951	144,498,583.90	4.48
7	600867	通化东宝	5,999,398	131,566,798.14	4.08
8	002659	中泰桥梁	4,975,442	114,783,446.94	3.56
9	000661	长春高新	1,000,362	111,890,489.70	3.47
10	002045	国光电器	8,024,759	99,908,249.55	3.10
11	300347	泰格医药	3,500,001	94,535,027.01	2.93
12	000915	山大华特	2,200,030	92,687,263.90	2.87
13	300349	金卡股份	2,799,901	89,120,848.83	2.76
14	002672	东江环保	4,999,995	87,999,912.00	2.73
15	601607	上海医药	3,999,901	78,238,063.56	2.43
16	300115	长盈精密	3,000,309	78,188,052.54	2.42
17	000821	京山轻机	4,999,875	76,698,082.50	2.38
18	300278	华昌达	3,206,668	71,669,029.80	2.22
19	600500	中化国际	5,000,030	58,300,349.80	1.81
20	002773	康弘药业	1,000,751	56,832,649.29	1.76
21	000829	天音控股	4,999,797	56,397,710.16	1.75
22	300017	网宿科技	1,000,166	53,618,899.26	1.66
23	002281	光迅科技	588,849	46,224,646.50	1.43
24	603000	人民网	2,000,000	35,320,000.00	1.10
25	300064	豫金刚石	3,000,083	34,050,942.05	1.06
26	300310	宜通世纪	1,199,853	29,204,422.02	0.91
27	600856	中天能源	2,000,563	27,607,769.40	0.86
28	600276	恒瑞医药	500,057	22,752,593.50	0.71
29	000998	隆平高科	1,000,000	21,430,000.00	0.66

30	002041	登海种业	1,003,251	18,941,378.88	0.59
31	600055	万东医疗	999,997	18,119,945.64	0.56
32	600622	嘉宝集团	374,300	5,393,663.00	0.17
33	600996	贵广网络	12,500	234,875.00	0.01
34	603823	百合花	3,762	123,167.88	0.00
35	601375	中原证券	26,695	106,780.00	0.00
36	603298	杭叉集团	3,641	88,403.48	0.00
37	603228	景旺电子	3,491	80,851.56	0.00
38	002832	比音勒芬	1,158	70,290.60	0.00
39	603218	日月股份	1,652	68,805.80	0.00
40	603877	太平鸟	3,180	67,734.00	0.00
41	002826	易明医药	2,181	57,316.68	0.00
42	603416	信捷电气	1,076	53,886.08	0.00
43	002833	弘亚数控	2,743	48,331.66	0.00
44	603886	元祖股份	2,241	39,665.70	0.00
45	603689	皖天然气	4,818	37,917.66	0.00
46	300582	英飞特	1,359	35,157.33	0.00
47	603239	浙江仙通	924	29,059.80	0.00
48	002835	同为股份	1,126	24,220.26	0.00
49	603035	常熟汽饰	2,316	24,179.04	0.00
50	603266	天龙股份	1,562	22,852.06	0.00
51	300587	天铁股份	1,438	20,290.18	0.00
52	603929	亚翔集成	2,193	15,592.23	0.00
53	002840	华统股份	1,814	11,881.70	0.00
54	002838	道恩股份	681	10,405.68	0.00
55	603186	华正新材	1,874	10,063.38	0.00
56	603032	德新交运	1,628	9,458.68	0.00
57	300586	美联新材	1,006	9,355.80	0.00
58	300591	万里马	2,397	7,358.79	0.00
59	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	295,571,682.66	10.33
2	300203	聚光科技	284,193,920.60	9.93
3	300033	同花顺	282,162,629.60	9.86
4	000568	泸州老窖	219,643,822.73	7.68
5	300279	和晶科技	203,077,830.81	7.10

6	002583	海能达	201,512,830.40	7.04
7	002045	国光电器	195,647,363.01	6.84
8	601688	华泰证券	175,638,705.27	6.14
9	600887	伊利股份	174,826,140.49	6.11
10	000820	神雾节能	167,599,728.36	5.86
11	000651	格力电器	158,719,358.51	5.55
12	000858	五粮液	157,487,571.32	5.51
13	600486	扬农化工	152,557,629.90	5.33
14	002643	万润股份	152,423,421.12	5.33
15	000776	广发证券	148,064,710.55	5.18
16	601988	中国银行	141,998,722.00	4.96
17	000661	长春高新	141,502,130.75	4.95
18	002659	中泰桥梁	141,353,754.40	4.94
19	600867	通化东宝	139,732,300.38	4.88
20	600276	恒瑞医药	139,712,177.55	4.88
21	002120	新海股份	138,716,332.25	4.85
22	600115	东方航空	138,179,225.37	4.83
23	600233	圆通速递	136,162,439.15	4.76
24	603000	人民网	127,780,882.27	4.47
25	600500	中化国际	125,414,272.86	4.38
26	600674	川投能源	124,377,595.50	4.35
27	000671	阳光城	117,504,547.07	4.11
28	000333	美的集团	115,615,701.00	4.04
29	000915	山大华特	115,313,753.94	4.03
30	002672	东江环保	110,286,329.77	3.86
31	300278	华昌达	110,219,376.31	3.85
32	600315	上海家化	103,498,151.36	3.62
33	300115	长盈精密	100,653,000.58	3.52
34	300349	金卡股份	99,673,663.33	3.48
35	000630	铜陵有色	96,522,241.00	3.37
36	603885	吉祥航空	96,455,555.26	3.37
37	002456	欧菲光	92,801,452.88	3.24
38	300017	网宿科技	90,263,844.84	3.16
39	000829	天音控股	89,420,911.84	3.13
40	600362	江西铜业	87,357,443.44	3.05
41	300122	智飞生物	83,239,132.19	2.91
42	601607	上海医药	80,621,727.36	2.82
43	002281	光迅科技	80,121,623.46	2.80
44	002440	闰土股份	77,222,308.71	2.70
45	000821	京山轻机	76,926,757.68	2.69
46	600325	华发股份	75,974,785.47	2.66
47	600967	北方创业	75,647,229.76	2.64
48	300011	鼎汉技术	74,926,559.65	2.62
49	600999	招商证券	74,045,628.03	2.59

50	000596	古井贡酒	71,753,196.61	2.51
51	600348	阳泉煤业	69,971,814.75	2.45
52	002477	雏鹰农牧	69,484,201.80	2.43
53	601336	新华保险	68,544,353.65	2.40
54	600521	华海药业	67,572,299.78	2.36
55	002717	岭南园林	66,411,381.12	2.32
56	300064	豫金刚石	65,702,911.72	2.30
57	002117	东港股份	64,709,207.49	2.26
58	601233	桐昆股份	62,576,617.68	2.19
59	601198	东兴证券	62,330,675.41	2.18
60	000066	长城电脑	61,531,710.18	2.15
61	300182	捷成股份	61,274,913.03	2.14
62	000063	中兴通讯	60,325,058.74	2.11
63	600352	浙江龙盛	58,559,106.31	2.05
64	600048	保利地产	57,555,807.04	2.01
65	002773	康弘药业	57,247,155.10	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	300033	同花顺	290,850,739.67	10.17
2	000568	泸州老窖	246,802,457.44	8.63
3	600233	圆通速递	221,179,257.12	7.73
4	600276	恒瑞医药	212,750,832.28	7.44
5	600887	伊利股份	195,027,490.15	6.82
6	002120	新海股份	185,810,563.05	6.50
7	002717	岭南园林	183,455,325.06	6.41
8	601688	华泰证券	181,157,806.37	6.33
9	000651	格力电器	175,342,264.20	6.13
10	000858	五粮液	170,090,642.71	5.95
11	002456	欧菲光	169,351,544.75	5.92
12	300011	鼎汉技术	167,229,241.82	5.85
13	002643	万润股份	153,567,973.86	5.37
14	000776	广发证券	152,923,624.09	5.35
15	600115	东方航空	145,995,520.93	5.10
16	300203	聚光科技	142,690,036.59	4.99
17	601988	中国银行	138,819,801.14	4.85
18	300347	泰格医药	137,933,820.78	4.82



19	000333	美的集团	136,509,117.21	4.77
20	600674	川投能源	127,141,766.28	4.44
21	600763	通策医疗	124,633,780.37	4.36
22	002475	立讯精密	117,991,237.11	4.12
23	002045	国光电器	111,304,395.86	3.89
24	000671	阳光城	111,026,334.49	3.88
25	603885	吉祥航空	103,367,623.90	3.61
26	300122	智飞生物	102,455,988.39	3.58
27	600315	上海家化	102,283,591.37	3.58
28	000630	铜陵有色	101,369,452.50	3.54
29	002020	京新药业	100,264,313.38	3.50
30	600362	江西铜业	98,516,723.99	3.44
31	600054	黄山旅游	95,823,710.01	3.35
32	603000	人民网	95,279,982.98	3.33
33	000727	华东科技	93,483,302.47	3.27
34	002477	雏鹰农牧	84,884,950.48	2.97
35	002662	京威股份	83,452,102.23	2.92
36	300166	东方国信	83,134,649.80	2.91
37	002368	太极股份	80,649,392.88	2.82
38	000596	古井贡酒	80,628,897.35	2.82
39	600967	北方创业	79,452,438.93	2.78
40	002672	东江环保	79,423,632.17	2.78
41	600500	中化国际	77,848,306.59	2.72
42	600521	华海药业	77,188,585.95	2.70
43	600999	招商证券	76,135,405.46	2.66
44	002440	闰土股份	75,457,896.36	2.64
45	300017	网宿科技	73,799,226.97	2.58
46	300262	巴安水务	69,651,987.12	2.43
47	300232	洲明科技	68,884,029.73	2.41
48	600348	阳泉煤业	67,396,235.23	2.36
49	000820	神雾节能	67,333,060.73	2.35
50	601336	新华保险	66,259,031.68	2.32
51	000066	长城电脑	65,791,176.58	2.30
52	002727	一心堂	64,769,804.51	2.26
53	000625	长安汽车	64,647,847.72	2.26
54	600325	华发股份	62,392,686.60	2.18
55	601233	桐昆股份	61,878,923.57	2.16
56	300161	华中数控	60,596,189.76	2.12
57	601198	东兴证券	60,447,185.57	2.11
58	000063	中兴通讯	59,245,401.05	2.07
59	600352	浙江龙盛	59,200,476.78	2.07
60	002117	东港股份	58,385,527.28	2.04
61	000599	青岛双星	57,946,812.43	2.03
62	600048	保利地产	57,883,275.67	2.02

63	002714	牧原股份	57,270,688.08	2.00
----	--------	------	---------------	------

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	9,603,666,266.98
卖出股票的收入（成交）总额	9,447,915,896.24

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 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	169,731,000.00	5.26
	其中：政策性金融债	169,731,000.00	5.26
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	169,731,000.00	5.26

#### 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	160414	16 农发 14	1,000,000	99,850,000.00	3.10
2	160211	16 国开 11	700,000	69,881,000.00	2.17

### 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除中泰桥梁（证券代码：002659）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中泰桥梁（证券代码：002659）于 2016 年 10 月 20 日公告，公司控股子公司北京文凯兴教育投资有限责任公司因违反了《北京市城乡规划条例》收到北京市规划和国土资源管理委员会于 2016 年 10 月 18 日出具的《行政处罚决定书》。据此，北京市规划和国土资源管理委员会决定对北京文凯兴教育投资有限责任公司处以罚款 14,284,788.1 元。

本基金管理人对该证券投资决策程序的说明如下：本基金管理人对证券投资特别是重仓股的投资有严格的投资决策流程控制。本基金在对该证券的投资也严格执行投资决策流程。在对该证券的选择上，严格执行公司股票池审核流程进入公司核心股票池。在对该证券的持有过程中公司研究员密切关注上市公司动向。在上述事件发生时及时分析其对投资决策的影响，经过分析认为上述事件对上市公司财务状况、经营成果和现金流量未产生重大的实质性影响，所以不影响对该公司基本面和公司治理的投资判断。

**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	3,038,631.62
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,098,276.34
5	应收申购款	743,178.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,880,086.46

#### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002659	中泰桥梁	114,783,446.94	3.56	重大事项

#### 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

92,696	61,233.09	1,834,669,655.34	32.32%	3,841,392,580.06	67.68%
--------	-----------	------------------	--------	------------------	--------

## 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	85,954.53	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

基金合同生效日(2005年9月29日)基金份额总额	4,874,882,643.01
本报告期期初基金份额总额	2,457,568,763.82
本报告期基金总申购份额	4,939,606,055.28
减：本报告期基金总赎回份额	1,721,112,583.70
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	5,676,062,235.40

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德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）。报告年度支付给德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）的审计费 100,000.00 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	佣金	占当期佣金总量的	

			额的比例		比例	
华泰证券股份 有限公司	1	967,753,527.40	5.08%	901,269.24	5.08%	-
招商证券股份 有限公司	1	941,341,647.73	4.94%	876,676.51	4.94%	-
兴业证券股份 有限公司	1	881,192,142.30	4.63%	820,649.37	4.63%	-
天风证券股份 有限公司	1	862,626,421.66	4.53%	803,366.41	4.53%	-
中国国际金融 有限公司	2	857,643,430.90	4.50%	798,724.37	4.50%	-
中银国际证券 有限责任公司	1	539,867,354.02	2.83%	502,777.49	2.83%	-
海通证券股份 有限公司	1	460,139,626.65	2.42%	428,525.84	2.42%	-
光大证券股份 有限公司	2	416,513,627.55	2.19%	387,899.12	2.19%	-
瑞银证券有限 责任公司	1	402,076,726.09	2.11%	374,453.31	2.11%	-
中国银河证券 股份有限公司	1	399,153,060.10	2.10%	371,734.59	2.10%	-
国金证券股份 有限公司	2	3,470,757,371.62	18.22%	3,232,315.59	18.22%	-
华创证券有限 责任公司	1	245,511,254.20	1.29%	228,645.36	1.29%	-
英大证券有限 责任公司	1	234,517,645.68	1.23%	218,406.33	1.23%	-
长城证券有限 责任公司	1	225,151,847.47	1.18%	209,689.09	1.18%	-
中信证券股份 有限公司	1	1,618,525,628.47	8.50%	1,507,335.38	8.50%	-
申万宏源证券 有限公司	3	1,398,643,664.55	7.34%	1,302,556.77	7.34%	-
华西证券股份 有限公司	1	136,965,323.18	0.72%	127,555.87	0.72%	-
东北证券股份 有限公司	2	1,346,309,193.22	7.07%	1,253,819.05	7.07%	-
安信证券股份 有限公司	2	131,289,673.11	0.69%	122,270.85	0.69%	-
国海证券股份 有限公司	1	1,181,572,125.59	6.20%	1,100,400.52	6.20%	-
国泰君安证券 股份有限公司	1	1,167,998,176.90	6.13%	1,087,746.24	6.13%	-
弘则弥道（上	1	1,164,326,355.41	6.11%	1,084,338.87	6.11%	-

海) 投资咨询 有限公司						
中国中投证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股份 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
海通证券股份 有限公司	-	-	200,000,000.00	44.44%	-	-
国金证券股份 有限公司	-	-	250,000,000.00	55.56%	-	-

注：1、报告期内，本基金新增加交易单元为东北证券股份有限公司、弘则弥道（上海）投资咨询有限公司和天风证券股份有限公司，终止交易单元为华泰证券有限责任公司，其它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（财务状况和经营状况）、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。

### 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交银施罗德精选混合型证券投资基金暂停大	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-01-06



	额申购（转换转入、定期定额投资）的公告		
4	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德精选混合型证券投资基金分红的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-01-11
5	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
6	交银施罗德精选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
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	2016-01-22
8	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德精选混合型证券投资基金恢复大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-01-23
9	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
10	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
11	交银施罗德精选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
12	交银施罗德精选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
13	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
14	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
15	交银施罗德精选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	2016-05-13
16	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
17	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调整公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-05-20
18	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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-06-29

	金网上银行、手机银行前端申购费率优惠活动的公告		
19	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
20	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
21	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
22	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
23	交银施罗德精选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
24	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
25	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
26	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
27	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
28	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
29	交银施罗德精选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
30	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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-09-20

	业务) 费率优惠活动的公告		
31	交银施罗德精选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
32	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
33	交银施罗德基金管理有限公司关于增加北京唐鼎耀华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	2016-10-28
34	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
35	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德精选混合型证券投资基金分红的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-11-07
36	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	2016-11-09
37	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
38	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
39	交银施罗德精选混合型证券投资基金(更新)招募说明书摘要(2016 年第 2 号)	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-11-12
40	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
41	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
42	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
43	交银施罗德基金管理有限公司关于增加	中国证券报、上海	2016-12-14

	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	证券报、证券时报	
44	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
45	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、中国证监会批准交银施罗德精选股票证券投资基金募集的文件；
- 2、《交银施罗德精选混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《交银施罗德精选混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《交银施罗德精选混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、关于募集交银施罗德精选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精选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](http://www.fund001.com), [www.bocomschroder.com](http://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](mailto: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