

---

**交银施罗德精选混合型证券投资基金**  
**2018 年年度报告摘要**  
**2018 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：二〇一九年三月二十七日

## § 1 重要提示

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司(以下简称“中国农业银行”)根据本基金合同规定，于 2019 年 3 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	交银精选混合	
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	6,142,830,338.45 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	王晚婷	贺倩
	联系电话	(021) 61055050	010-66060069
	电子邮箱	xxpl@jysld.com, disclosure@jysld.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-700-5000, 021-	95599

	61055000	
传真	(021) 61055054	010-68121816

## 2.4 信息披露方式

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

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018 年	2017 年	2016 年
本期已实现收益	-149,627,277.87	303,855,021.75	406,205,325.41
本期利润	-616,754,875.82	491,482,273.45	25,619,409.49
加权平均基金份额本期利润	-0.1169	0.1053	0.0062
本期基金份额净值增长率	-16.28%	20.71%	0.84%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
期末可供分配基金份额利润	0.0998	0.2134	0.1249
期末基金资产净值	3,336,301,939.91	2,795,056,730.91	3,225,367,795.77
期末基金份额净值	0.5431	0.6859	0.5682

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	-9.30%	1.69%	-8.77%	1.23%	-0.53%	0.46%
过去六个月	-13.06%	1.62%	-9.78%	1.12%	-3.28%	0.50%
过去一年	-16.28%	1.50%	-17.72%	1.00%	1.44%	0.50%
过去三年	1.91%	1.34%	-11.81%	0.88%	13.72%	0.46%
过去五年	67.14%	1.70%	32.61%	1.15%	34.53%	0.55%
自基金合同生效起至今	478.31%	1.56%	204.87%	1.32%	273.44%	0.24%

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》；

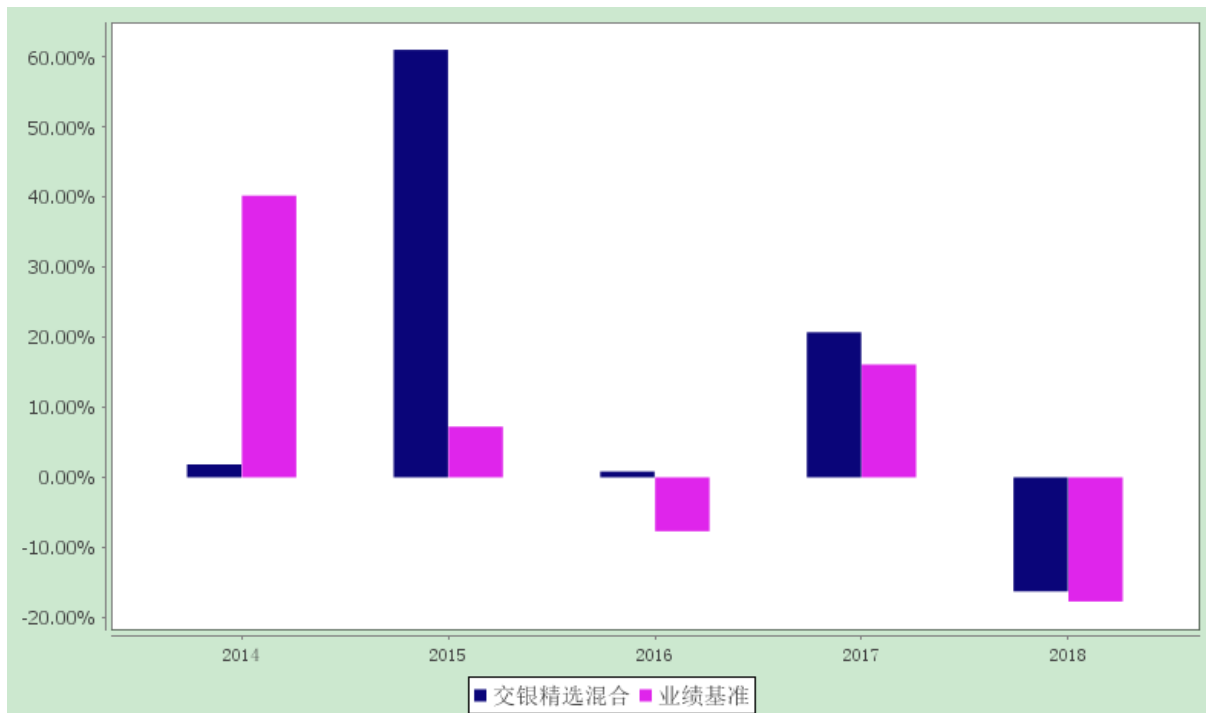
2、本基金业绩比较基准每日进行再平衡过程。

#### 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
2018 年	0.380	63,201,246.07	90,189,089.47	153,390,335.54	-
2017 年	-	-	-	-	-
2016 年	5.250	876,075,154.01	862,412,971.40	1,738,488,125.41	-
合计	5.630	939,276,400.08	952,602,060.87	1,891,878,460.95	-

## § 4 管理人报告

#### 4.1 基金管理人及基金经理情况

##### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

交银施罗德基金管理有限公司是经中国证监会证监基金字[2005]128 号文批准，由交通银行股份有限公司、施罗德投资管理有限公司、中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司共同发起设立。公司成立于 2005 年 8 月 4 日，注册地在中国上海，注册资本为 2 亿元人民币。其中，交通银行股份有限公司持有 65% 的股份，施罗德投资管理有限公司持有 30% 的股份，中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司持有 5% 的股份。公司并下设交银施罗德资产管理（香港）有限公司和交银施罗德资产管理有限公司。

截至报告期末，公司管理了包括货币型、债券型、保本混合型、普通混合型和股票型在内的 77 只基金，其中股票型涵盖普通指数型、交易型开放式（ETF）、QDII 等不同类型基金。

##### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王崇	交银精选混合、交银新成长混合的基金经理，公司权益投资副总监	2017-06-03	-	10 年	王崇先生，北京大学金融学博士。2008 年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任行业分析师、高级研究员。

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

在报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，基金投资管理符合有关法律法规和基金合同的规定，为基金持有人谋求最大利益。

### 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基金运作的公平，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。

公司建立资源共享的投资研究信息平台，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。公司在交易执行环节实行集中交易制度，建立公平的交易分配制度。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。

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



账户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。

报告期内本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，未发现任何违反公平交易的行为。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。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没有超过该证券当日总成交量 5% 的情形，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出现异常。

#### 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

2018 年国内经济增速继续放缓，经济周期从微滞胀进入微衰退。六月后中美贸易冲突加剧，A 股市场风险偏好持续下降，同时市场对企业盈利下调担忧加剧，A 股市场在二月初以后一路震荡下跌，几乎无反弹，主要指数全年跌幅甚至超过 2011 年。行业层面，几个主要的行业回报均为负，其中银行、非银以及食品饮料跌幅较小，电子、传媒等板块跌幅较大，市场预期非常悲观。

本基金 2018 年全年大部分时间保持中性略高仓位，行业均衡配置，个股向有把握的公司集中。行业层面减持新能源汽车、电子和传媒，增持医疗服务、房地产、计算机和公共事业。由于本基金持仓的个别重仓股全年跌幅较大，净值出现较大幅度回撤，但总体跑赢业绩比较基准。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金（各类）份额净值及业绩表现请见“3.1 主要会计数据和财务指标”及“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”部分披露。

#### 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 2019 年，我们对 A 股市场持谨慎乐观的态度。经济下行、中美贸易冲突以及企业盈利可能下调等负面因素已经在预期中，目前沪深 300 指数在 3000 点附近对应静态 PB1.26 倍左右，处于历史底部区域，继续大幅下行的空间不大，从中期而言风险收益比很高。而货币政策已经明确转向，随着债券利率的持续下行，大类资产配置指针逐步转向权益，处于估值底部区域的 A 股配置时机已逐步显现。我们相信周期，我们相信价值只会迟到不会缺席，本基金 2019 年将维持中性略高仓位，继续看好医疗服务、房地产、计算机、公共事业以及传媒等成长领域投资机会。选股方面将更加严格，

精选具有竞争优势的优质龙头公司，规避中等质量公司，恪守安全边际，努力为基金持有人带来稳定回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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应分配的可分配利润进行了收益分配，具体情况参见年度报告正文7.4.11 利润分配情况。

本基金未对本报告期内利润进行分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内无需预警说明。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—交银施罗德基金管理有限公司 2018 年 1 月 1 日至 2018 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合规守信、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

德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）对交银施罗德精选混合型证券投资基金 2018 年 12 月 31 日的资产负债表，2018 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注出具了标准无保留意见的审计报告【德师报(审)字(19)第 P01164 号】。投资者可通过本基金年度报告正文查看该审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：交银施罗德精选混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日

<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	272,055,228.35	55,028,747.89
结算备付金		6,925,362.78	5,679,017.27
存出保证金		1,742,955.17	2,002,017.63
交易性金融资产	7.4.7.2	2,813,863,801.12	2,709,026,346.50
其中：股票投资		2,634,943,801.12	2,315,966,346.50
基金投资		-	-
债券投资		178,920,000.00	393,060,000.00
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	250,000,495.00	-
应收证券清算款		9,681,143.26	23,443,414.77
应收利息	7.4.7.5	737,225.48	8,101,693.49
应收股利		-	-
应收申购款		449,949.23	595,014.21
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		3,355,456,160.39	2,803,876,251.76
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2017 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		9,772,916.70	-
应付赎回款		563,158.09	1,858,270.06
应付管理人报酬		4,389,488.39	3,572,399.57
应付托管费		731,581.39	595,399.90
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	3,291,687.31	2,390,041.92

应交税费		7,404.54	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	397,984.06	403,409.40
负债合计		19,154,220.48	8,819,520.85
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	2,723,270,863.10	1,806,505,144.06
未分配利润	7.4.7.10	613,031,076.81	988,551,586.85
所有者权益合计		3,336,301,939.91	2,795,056,730.91
负债和所有者权益总计		3,355,456,160.39	2,803,876,251.76

注：1、报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.5431 元，基金份额总额 6,142,830,338.45 份。

2、本摘要中资产负债表和利润表所列附注号为年度报告正文中对应的附注号，投资者欲了解相应附注的内容，应阅读登载于基金管理人网站的年度报告正文。

## 7.2 利润表

会计主体：交银施罗德精选混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		<b>-535,991,032.20</b>	<b>559,601,183.69</b>
1.利息收入		9,636,743.64	16,188,264.54
其中：存款利息收入	7.4.7.11	2,819,352.85	2,470,675.24
债券利息收入		5,883,089.00	9,859,732.53
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		934,301.79	3,857,856.77
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-78,828,711.15	353,687,886.94
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-113,933,946.16	336,057,261.11

基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-353,815.89	2,453,199.69
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	35,459,050.90	15,177,426.14
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-467,127,597.95	187,627,251.70
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	328,533.26	2,097,780.51
<b>减：二、费用</b>		<b>80,763,843.62</b>	<b>68,118,910.24</b>
1. 管理人报酬		48,664,540.60	41,699,074.21
2. 托管费		8,110,756.70	6,949,845.62
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	23,517,573.78	18,988,214.48
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		6,350.53	-
7. 其他费用	7.4.7.20	464,622.01	481,775.93
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-616,754,875.82</b>	<b>491,482,273.45</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-616,754,875.82</b>	<b>491,482,273.45</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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	1,806,505,144.06	988,551,586.85	2,795,056,730.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-616,754,875.82	-616,754,875.82
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）	916,765,719.04	394,624,701.32	1,311,390,420.36
其中：1.基金申购款	1,208,928,933.89	520,257,167.91	1,729,186,101.80
2.基金赎回款	-292,163,214.85	-125,632,466.59	-417,795,681.44
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）	-	-153,390,335.54	-153,390,335.54
五、期末所有者权益（基金净值）	2,723,270,863.10	613,031,076.81	3,336,301,939.91
项目	上年度可比期间		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	2,516,353,331.13	709,014,464.64	3,225,367,795.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	491,482,273.45	491,482,273.45
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）	-709,848,187.07	-211,945,151.24	-921,793,338.31
其中：1.基金申购款	742,881,923.33	241,595,193.87	984,477,117.20
2.基金赎回款	-1,452,730,110.40	-453,540,345.11	-1,906,270,455.51
四、本期向基金份额持有人分配利润	-	-	-

产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	1,806,505,144.06	988,551,586.85	2,795,056,730.91

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：谢卫，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 2019 年 3 月 25 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》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 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金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[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、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[2014]48 号《关于实施全国中小企业股份转让系

统挂牌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]140号《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[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税；2018年1月1日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的其他增值税应税行为，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

2) 对证券投资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，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

4) 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

5) 对于基金从事A股买卖，出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。

#### 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
交银施罗德基金管理有限公司 (“交银施罗德基金公司”)	基金管理人、基金销售机构
中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。

**7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易**

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

**7.4.8.2 关联方报酬****7.4.8.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年 12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	48,664,540.60	41,699,074.21
其中：支付销售机构的客户维护 费	4,474,782.64	4,284,707.77

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： $\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.5\% \div \text{当年天数}$ 。

**7.4.8.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年 12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	8,110,756.70	6,949,845.62

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： $\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% \div \text{当年天数}$ 。

**7.4.8.2.3 销售服务费**

无。

**7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间未发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

##### 7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金。

##### 7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	272,055,228.35	2,638,702.41	55,028,747.89	2,337,227.15

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行同业利率计息。

##### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

##### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

#### 7.4.9 期末（2018年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.9.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	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
601860	紫金银行	2018-12-20	2019-01-03	新股未上市	3.14	3.14	15,970	50,145.80	50,145.80	-
002044	美年健康	2018-10-30	2019-04-30	限售股	12.27	14.12	240,000	2,944,800.00	3,388,800.00	-
002410	广联达	2018-07-04	2019-01-04	限售股	25.49	20.57	1,360,000	34,666,400.00	27,975,200.00	-
002410	广联达	2018-09-12	2019-03-12	限售股	26.03	19.88	850,000	22,125,500.00	16,898,000.00	-
002912	中新赛克	2018-11-27	2019-05-27	限售股	70.64	75.77	570,000	40,264,800.00	43,188,900.00	-

601138	工业富联	2018-05-28	2019-06-10	限售股	13.77	10.97	2,343,558	32,270,793.66	25,708,831.26	-
603108	润达医疗	2018-08-13	2019-02-13	限售股	9.65	6.92	2,590,500	24,998,325.00	17,926,260.00	-

注：1、基金可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过其持有该次非公开发行股份数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。此外，本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

2、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

#### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

#### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额，无抵押债券。

#### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 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 2018 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 2,499,807,664.06 元，属于第二层次的余额为 314,056,137.06 元，无属于第三层次的余额(2017 年 12 月 31 日：第一层次 1,907,449,981.86 元，第二层次 801,576,364.64 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 7.4.4.5 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	2,634,943,801.12	78.53
	其中：股票	2,634,943,801.12	78.53
2	固定收益投资	178,920,000.00	5.33
	其中：债券	178,920,000.00	5.33
	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	250,000,495.00	7.45
	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	278,980,591.13	8.31

	合计		
7	其他各项资产	12,611,273.14	0.38
8	合计	3,355,456,160.39	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	239,638,894.19	7.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	204,668,227.20	6.13
G	交通运输、仓储和邮政业	25,150,621.27	0.75
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	349,038,925.08	10.46
J	金融业	399,503,248.80	11.97
K	房地产业	524,402,436.64	15.72
L	租赁和商务服务业	2,060,735.56	0.06
M	科学研究和技术服务业	172,965,686.25	5.18
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	563,007,689.85	16.88
R	文化、体育和娱乐业	154,507,336.28	4.63
S	综合	-	-
	合计	2,634,943,801.12	78.98

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	002044	美年健康	19,823,512	296,162,304.40	8.88
2	600048	保利地产	24,688,346	291,075,599.34	8.72
3	601155	新城控股	9,849,170	233,326,837.30	6.99
4	300012	华测检测	26,406,975	172,965,686.25	5.18
5	000001	平安银行	17,826,757	167,214,980.66	5.01
6	601009	南京银行	25,841,414	166,935,534.44	5.00
7	000681	视觉中国	6,625,529	154,507,336.28	4.63
8	600763	通策医疗	3,233,660	153,501,840.20	4.60
9	601933	永辉超市	18,972,900	149,316,723.00	4.48
10	601100	恒立液压	7,211,607	142,861,934.67	4.28

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站的年度报告正文。

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600048	保利地产	557,824,767.87	19.96
2	002044	美年健康	436,974,839.72	15.63
3	601155	新城控股	432,264,344.51	15.47



4	002027	分众传媒	327,890,548.01	11.73
5	300347	泰格医药	313,720,878.07	11.22
6	002456	欧菲科技	268,444,527.87	9.60
7	601318	中国平安	266,520,155.19	9.54
8	000002	万科 A	259,802,548.11	9.30
9	601009	南京银行	240,682,239.32	8.61
10	300059	东方财富	218,139,451.06	7.80
11	601877	正泰电器	213,500,316.43	7.64
12	601933	永辉超市	211,582,366.97	7.57
13	000725	京东方 A	200,378,069.40	7.17
14	000681	视觉中国	193,776,930.17	6.93
15	002410	广联达	190,298,522.73	6.81
16	000001	平安银行	185,675,914.18	6.64
17	601012	隆基股份	175,357,044.74	6.27
18	600763	通策医疗	170,412,228.16	6.10
19	600066	宇通客车	166,160,742.02	5.94
20	002142	宁波银行	165,888,286.39	5.94
21	300253	卫宁健康	163,995,695.57	5.87
22	300146	汤臣倍健	161,416,526.55	5.78
23	300003	乐普医疗	156,084,703.25	5.58
24	300012	华测检测	126,576,899.64	4.53
25	600256	广汇能源	121,172,241.32	4.34
26	600030	中信证券	119,137,107.89	4.26
27	300559	佳发教育	118,425,902.97	4.24
28	603108	润达医疗	115,628,373.15	4.14
29	601166	兴业银行	112,867,621.29	4.04
30	600856	中天能源	111,898,629.00	4.00
31	300170	汉得信息	111,085,004.85	3.97
32	601398	工商银行	106,411,258.18	3.81
33	600887	伊利股份	101,293,205.96	3.62
34	002383	合众思壮	94,473,894.42	3.38
35	603686	龙马环卫	91,501,304.60	3.27
36	002821	凯莱英	90,272,665.88	3.23
37	600519	贵州茅台	88,029,186.00	3.15
38	601100	恒立液压	84,842,911.32	3.04
39	002912	中新赛克	80,604,680.14	2.88
40	600885	宏发股份	76,626,153.00	2.74
41	000661	长春高新	73,876,984.24	2.64
42	002465	海格通信	73,485,007.36	2.63
43	300747	锐科激光	71,734,219.73	2.57
44	603939	益丰药房	66,737,608.10	2.39

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	300347	泰格医药	467,654,871.00	16.73
2	002027	分众传媒	439,995,196.97	15.74
3	002456	欧菲科技	312,396,476.39	11.18
4	603986	兆易创新	307,747,133.99	11.01
5	000002	万科 A	278,106,516.48	9.95
6	601318	中国平安	267,868,936.52	9.58
7	600066	宇通客车	260,549,182.43	9.32
8	000725	京东方 A	260,198,633.89	9.31
9	601166	兴业银行	259,137,499.13	9.27
10	600048	保利地产	212,810,314.67	7.61
11	300059	东方财富	198,096,240.79	7.09
12	601877	正泰电器	187,742,947.80	6.72
13	002821	凯莱英	177,755,613.70	6.36
14	300146	汤臣倍健	166,089,943.28	5.94
15	002142	宁波银行	164,050,964.65	5.87
16	600856	中天能源	157,086,070.73	5.62
17	601398	工商银行	145,917,510.60	5.22
18	601155	新城控股	134,754,228.64	4.82
19	600256	广汇能源	130,009,313.15	4.65
20	300253	卫宁健康	127,003,593.34	4.54
21	300003	乐普医疗	123,143,334.79	4.41
22	002304	洋河股份	121,192,411.43	4.34
23	601012	隆基股份	118,220,066.53	4.23
24	002410	广联达	113,056,335.02	4.04
25	002709	天赐材料	108,928,820.35	3.90
26	600285	羚锐制药	107,020,694.36	3.83
27	600030	中信证券	101,918,057.56	3.65
28	300170	汉得信息	96,553,144.81	3.45
29	600519	贵州茅台	92,030,966.03	3.29
30	300365	恒华科技	91,647,409.54	3.28
31	600887	伊利股份	88,823,958.16	3.18
32	002583	海能达	87,696,475.50	3.14
33	600056	中国医药	83,470,935.63	2.99
34	300559	佳发教育	77,574,672.78	2.78
35	000998	隆平高科	75,524,138.85	2.70
36	002383	合众思壮	75,034,569.93	2.68

37	300308	中际旭创	74,917,303.45	2.68
38	600885	宏发股份	73,694,700.23	2.64
39	603939	益丰药房	71,093,519.96	2.54
40	603686	龙马环卫	68,573,756.59	2.45
41	002044	美年健康	67,120,845.41	2.40
42	000661	长春高新	64,951,664.61	2.32
43	002465	海格通信	64,305,881.40	2.30
44	300747	锐科激光	62,315,957.52	2.23
45	601933	永辉超市	61,299,685.89	2.19

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	8,351,491,672.09
卖出股票的收入（成交）总额	7,450,919,723.36

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	178,920,000.00	5.36
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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	178,920,000.00	5.36

**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	189953	18 贴现国债 53	1,800,000	178,920,000. 00	5.36

**8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细**

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

本基金本报告期末未持有贵金属。

**8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

本基金本报告期末未持有权证。

**8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

本基金本报告期末未持有股指期货。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

本基金本报告期末未持有国债期货。

**8.12 投资组合报告附注**

**8.12.1** 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体除南京银行（证券代码：601009）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南京银行（证券代码：601009）于 2018 年 1 月 30 日公告，公司收到中国银行业监督管理委员会江苏监管局行政处罚决定书（苏银监罚决字【2018】1 号），对镇江分行违规办理票据业务违反审慎经营原则的行为罚款 3230 万元人民币。

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	1,742,955.17
2	应收证券清算款	9,681,143.26
3	应收股利	-
4	应收利息	737,225.48
5	应收申购款	449,949.23
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,611,273.14

**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	002044	美年健康	3,388,800.00	0.10	限售股

**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
85,485	71,858.58	2,468,629,244.64	40.19%	3,674,201,093.81	59.81%

### 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	137,524.69	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	4,074,869,909.50
本报告期基金总申购份额	2,726,987,503.25
减：本报告期基金总赎回份额	659,027,074.30
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	6,142,830,338.45

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：

(1) 本基金管理人于 2018 年 6 月 30 日发布公告，经公司第四届董事会第三十二次会议审议通过，同意苏奋先生辞去公司督察长职务，并于 2018 年 9 月 28 日发布公告，经公司第四届董事会第三十三次会议审议通过，同意余川女士担任公司督察长职务；

(2) 本基金管理人于 2018 年 10 月 20 日发布公告，经公司第五届董事会第一次会议审议通过，选举阮红女士担任公司董事长（法定代表人），并于 2019 年 2 月 28 日发布公告，经公司第五届董事会第五次会议审议通过，选举谢卫先生担任公司总经理，阮红女士不再担任公司总经理。期后变动敬请关注基金管理人发布的相关公告。

2、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动：本报告期内，本行总行聘任刘琳同志、李智同志为本行托管业务部高级专家。

### 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 88,000.00 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

基金管理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。

#### 2、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金托管人及其高级管理人员本报告期内未受监管部门稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中国国际金融股份有限公司	2	954,634,783.53	6.06%	890,828.31	6.07%	-
西部证券股份有限公司	2	940,282,148.68	5.97%	875,684.53	5.97%	-
国泰君安证券股份有限公司	1	79,709,105.60	0.51%	74,232.47	0.51%	-
招商证券股份有限公司	1	777,415,851.84	4.94%	724,009.53	4.93%	-
华泰证券股份有限公司	1	732,962,534.98	4.65%	682,609.41	4.65%	-
华创证券有限责任公司	1	627,806,699.92	3.99%	584,677.19	3.98%	-
中信证券股份有限公司	1	624,761,092.55	3.97%	581,840.92	3.96%	-
国海证券股份有限公司	1	545,387,559.29	3.46%	507,921.23	3.46%	-
中信建投证券股份有限公司	1	433,064,289.39	2.75%	403,312.45	2.75%	-
中泰证券股份有限公司	1	401,512,659.02	2.55%	373,927.44	2.55%	-
华西证券股份有限公司	1	321,473,883.23	2.04%	299,389.40	2.04%	-
海通证券股份有限公司	1	263,062,336.23	1.67%	244,991.34	1.67%	-
东北证券股份有限公司	2	2,265,793,382.10	14.38%	2,110,135.70	14.38%	-
兴业证券股份有限公司	1	1,959,072,087.13	12.44%	1,824,479.25	12.43%	-



光大证券股份有限公司	2	1,702,424,916.39	10.81%	1,585,470.02	10.80%	-
天风证券股份有限公司	1	1,690,040,305.60	10.73%	1,573,934.62	10.73%	-
申万宏源证券有限公司	3	1,432,618,761.03	9.09%	1,337,271.37	9.11%	-
中国银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
英大证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中银国际证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

注：1、报告期内，本基金新增加交易单元为中泰证券股份有限公司，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。

## 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

## 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 影响投资者决策的其他重要信息

1、本基金管理人依据国家税收法律、法规、规章及税收规范性文件的规定，对管理的基金产品运营过程中产生的应税收入，计提及缴纳增值税及附加税费，该部分税费由基金资产承担。详情

请见有关公告。

2、根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》的有关规定及相关监管要求，经与基金托管人协商一致并报监管机构备案，基金管理人对本基金基金合同等法律文件作相应修改。请投资者关注基金合同中“对持续持有期少于 7 日的基金份额持有人收取不低于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产”的条款已于 2018 年 3 月 31 日起正式实施。欲知详情请查阅本基金管理人于 2018 年 3 月 22 日发布的有关公告及法律文件。

交银施罗德基金管理有限公司  
二〇一九年三月二十七日