
交银施罗德恒益灵活配置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	交银恒益灵活配置混合
基金主代码	004975
交易代码	004975
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 9 月 15 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	135,633,319.50 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在有效控制投资风险的前提下，通过积极主动的投资管理，力争获取超越业绩比较基准的投资收益，追求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，在分析和判断宏观经济周期和金融市场运行趋势的基础上，运用修正后的投资时钟分析框架，自上而下调整基金大类资产配置和股票行业配置策略，确定债券组合久期和债券类别配置；在严谨深入的股票和债券研究分析基础上，自下而上精选个券；在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力争获取投资组合的较高回报。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×40%+中证综合债券指数收益率×60%
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, 021-61055000	95599
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 9 月 15 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日
本期已实现收益	3,467,675.12	2,338,518.56
本期利润	-5,622,697.40	5,301,603.22
加权平均基金份额本期利润	-0.0319	0.0142
本期基金份额净值增长率	-6.69%	1.14%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0563	0.0071
期末基金资产净值	127,995,526.42	325,737,635.59
期末基金份额净值	0.9437	1.0114

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。

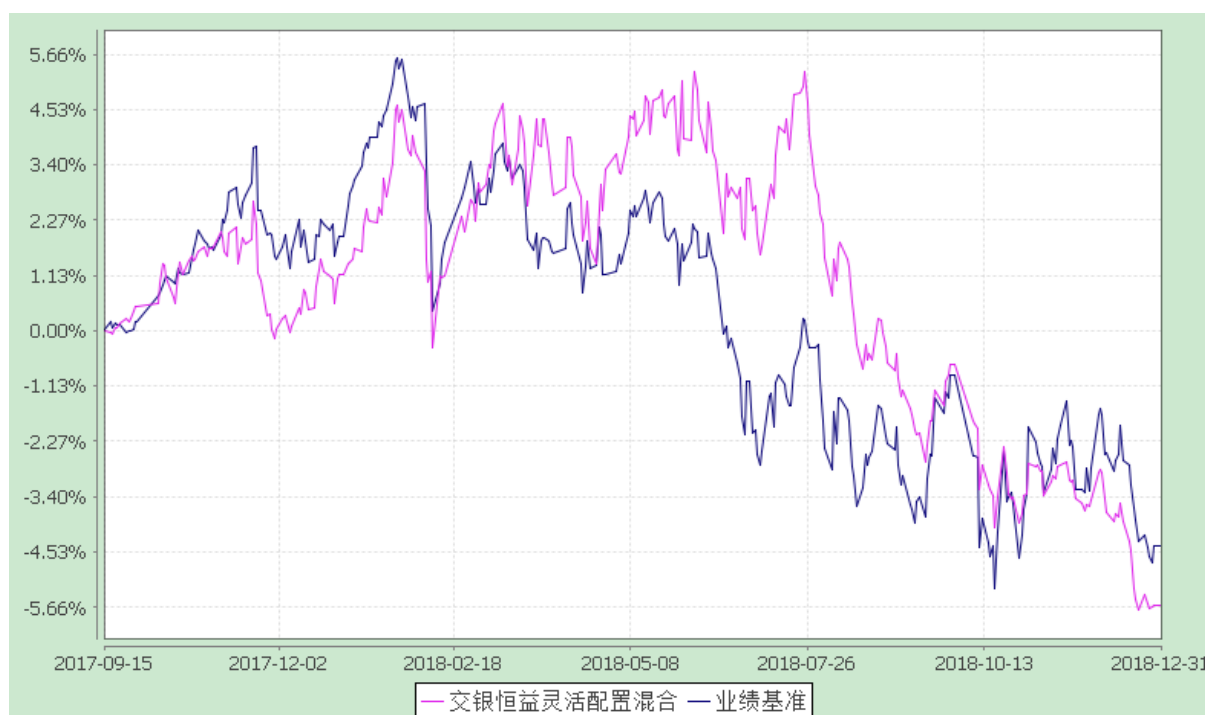
3.2 基金净值表现

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	-4.96%	0.40%	-3.53%	0.65%	-1.43%	-0.25%
过去六个月	-8.48%	0.43%	-3.43%	0.59%	-5.05%	-0.16%
过去一年	-6.69%	0.53%	-6.24%	0.53%	-0.45%	0.00%
自基金合同生效起至今	-5.63%	0.49%	-4.42%	0.49%	-1.21%	0.00%

注: 本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率×40%+中证综合债券指数收益率×60%, 每日进行再平衡过程。

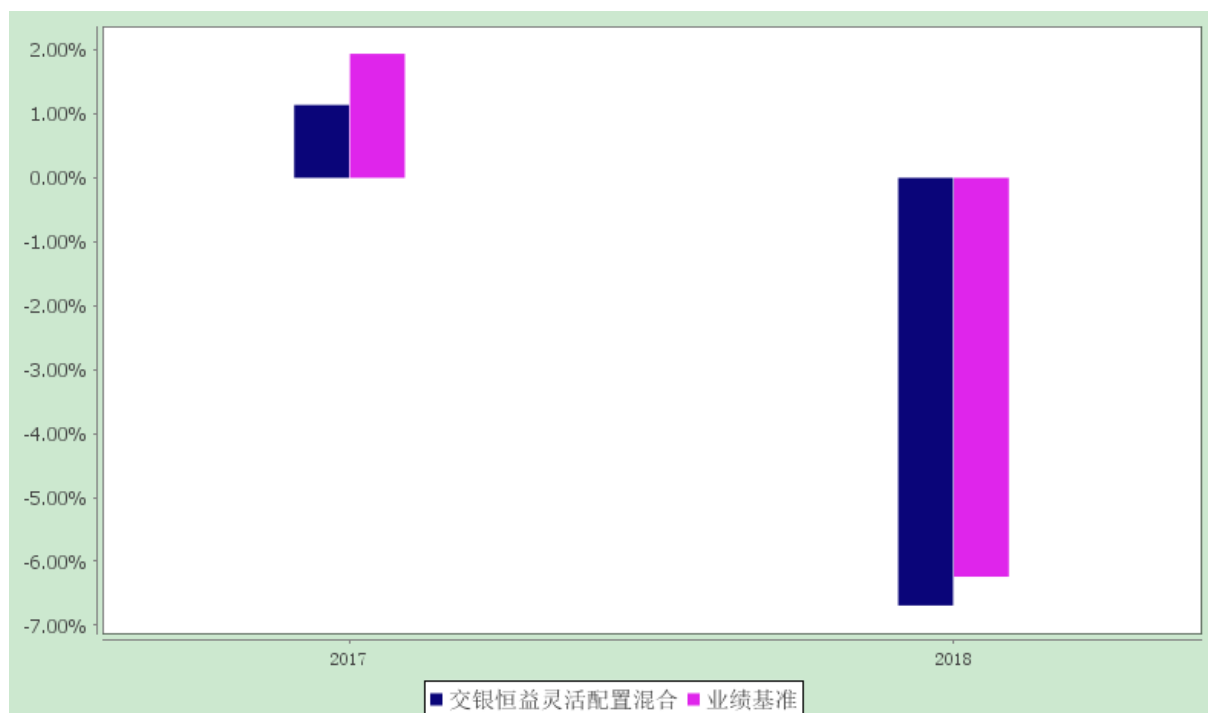
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注: 本基金建仓期为自基金合同生效日起的 6 个月。截至建仓期结束, 本基金各项资

产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：图示日期为 2017 年 09 月 15 日至 2018 年 12 月 31 日。基金合同生效当年的净值增长率按照当年实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份 额分 红数	现金形式发放 总额	再投资形式发 放总额	年度利润分配 合计	备注
2018 年	-	-	-	-	-
2017 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至报告期末，公司管理了包括货币型、债券型、保本混合型、普通混合型和股票型在内的 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		
王少成	交银成长混合、交银蓝筹混合、交银成长 30 混合、交银恒益灵活配置混合的基金经理，公司权益投资总监	2018-08-24	-	14 年	王少成先生，复旦大学硕士学历。历任上海融昌资产管理公司研究员，中原证券投资经理，信诚基金管理有限公司研究总监助理，东吴基金管理有限公司投资经理、基金经理、投资部副总经理。其中 2010 年 9 月至 2012 年 10 月担任东吴创新创业股票型证券投资基金基金经理，2011 年 2 月至 2012 年 11 月担任东吴中证新兴产业指数证券投资基金基金经理，2011 年 5 月至 2012 年 11 月担

					<p>任东吴价值成长双动力股票型证券投资基金基金经理。2012 年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任公司权益部副总经理。2013 年 3 月 21 日至 2015 年 8 月 14 日担任交银施罗德先进制造混合型证券投资基金（原交银施罗德先进制造股票证券投资基金）基金经理，2013 年 5 月 29 日至 2015 年 8 月 14 日担任交银施罗德先锋混合型证券投资基金（原交银施罗德先锋股票证券投资基金）基金经理，2015 年 11 月 7 日至 2018 年 5 月 15 日担任交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 11 月 7 日至 2018 年 6 月 7 日担任交银施罗德策略回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。</p>
盖婷婷	交银消费新驱动股票、交银医药创新股票、交银恒益灵活	2017-09-15	2018-09-22	12 年	<p>盖婷婷女士，上海交通大学硕士。历任信诚基金管理有限公司分析师、研究总监助</p>

	配置混合的 基金经理			理。2011 年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任行业分析师。2015 年 7 月 1 日至 2018 年 9 月 5 日担任交银施罗德消费新驱动股票型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月 23 日至 2018 年 9 月 21 日担任交银施罗德医药创新股票型证券投资基金的基金经理。2017 年 9 月 15 日至 2018 年 9 月 21 日担任交银施罗德恒益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
--	---------------	--	--	---

注：1、本表所列基金经理（助理）任职日期和离职日期均以基金合同生效日或公司作出决定并公告（如适用）之日为准。

2、本表所列基金经理（助理）证券从业年限中的“证券从业”的含义遵从中国证券业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、基金经理（或基金经理小组）期后变动（如有）敬请关注基金管理人发布的相关公告。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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 年中国宏观经济增速持续下行。去杠杆引致的持续信用收缩，使得中国宏观经济增速回落的压力持续加大，加上中美贸易战的不断演化，虽然货币政策持续宽松，但是经济增长前景依然暗淡，宽货币无法转化为宽信用。海外风险除了中美贸易战，主要集中在美国经济放缓的程度。由于本轮经济周期美国的非金融企业杠杆加在金融市场内部，并未积累过多实物资产，也未大量投资新兴市场，一旦周期顶部来临，去杠杆对实体经济冲击相对有限，更接近 2001 年科网泡沫破灭之后，对大宗商品和新兴市场股市冲击较弱。

基金整体仓位保持在中性水平。国内宏观政策基调已经明显将稳预期和稳增长放在更加重要的位置，国内宏观经济可能已经经历了增速放缓最快时期，在信用收缩得到逐步缓解的情况下，经济增速见底的预期会逐步成为共识。一般而言，大宗原材料价格下行 18 个月之后新兴亚洲景气度一般会提升，作为全球主要中间品的制造业中心，原材料价格下行有利于企业毛利率的维持和产能的扩张，中国 2018 年以来制造业投资上升的趋势应该会继续维持。中国经济增速进入见底企稳的阶段，而发达国家经济增速进入放缓阶段，这种经济增速的相对强弱变化，更加有利于中国为首的新兴市场国家的配置。近期人民币的显著升值已经在逐步验证这个交易趋势。

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

2019 年受益于经济增速企稳和中期增长蓄势受益的行业板块预计有明显的超额收益。A 股的估值水平已经非常有吸引力，市场过度悲观的预期很大程度上反映的是尾部风险。随着中美贸易摩擦逐步从失控到可控，国内信用收缩负面影响逐步缓解，A 股中受益于经济增速企稳和中期增长蓄势受益的行业板块预计有明显的超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内无需预警说明。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，交银施罗德基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，交银施罗德基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 审计报告

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）对交银施罗德恒益灵活配置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【普华永道中天审字(2019)第 21550 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：交银施罗德恒益灵活配置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
资产：			
银行存款	7.4.7.1	87,600,634.44	101,307,935.41
结算备付金		-	2,652,008.07

存出保证金		14,298.88	74,753.04
交易性金融资产	7.4.7.2	40,672,850.24	90,012,222.31
其中：股票投资		23,665,891.88	90,012,222.31
基金投资		-	-
债券投资		17,006,958.36	-
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	-	173,440,491.58
应收证券清算款		-	9,751,887.12
应收利息	7.4.7.5	46,847.10	74,478.89
应收股利		-	-
应收申购款		698.95	496.28
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		128,335,329.61	377,314,272.70
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 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		-	50,000,000.00
应付赎回款		971.46	720,508.23
应付管理人报酬		166,056.96	421,733.87
应付托管费		27,676.16	70,288.96
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	15,798.00	182,295.80
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	129,300.61	181,810.25
负债合计		339,803.19	51,576,637.11
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	135,633,319.50	322,057,015.26
未分配利润	7.4.7.10	-7,637,793.08	3,680,620.33
所有者权益合计		127,995,526.42	325,737,635.59
负债和所有者权益总计		128,335,329.61	377,314,272.70

注：1、报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9437 元，基金份额总额 135,633,319.50 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：交银施罗德恒益灵活配置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 9 月 15 日 (基金合同生效日) 至 2017 年 12 月 31 日
一、收入		-2,012,709.08	7,798,342.84
1.利息收入		1,544,188.74	1,766,945.10
其中：存款利息收入	7.4.7.11	719,214.03	858,516.78
债券利息收入		633,224.12	192.09
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		191,750.59	908,236.23
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		5,155,330.62	2,672,161.03
其中：股票投资收益	7.4.7.12	5,055,143.28	2,312,060.72
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-468,745.76	360,100.31
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	568,933.10	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-9,090,372.52	2,963,084.66
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	378,144.08	396,152.05
减：二、费用		3,609,988.32	2,496,739.62
1. 管理人报酬		2,683,976.05	1,674,783.05
2. 托管费		447,329.35	279,130.41
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	306,101.89	358,314.96
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		154.64	-
7. 其他费用	7.4.7.20	172,426.39	184,511.20
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-5,622,697.40	5,301,603.22
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-5,622,697.40	5,301,603.22

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：交银施罗德恒益灵活配置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）	322,057,015.26	3,680,620.33	325,737,635.59
二、本期经营活动产生的基金净值变	-	-5,622,697.40	-5,622,697.40

动数（本期利润）			
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）	-186,423,695.76	-5,695,716.01	-192,119,411.77
其中：1.基金申购款	3,246,337.78	61,438.16	3,307,775.94
2.基金赎回款	-189,670,033.54	-5,757,154.17	-195,427,187.71
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）	135,633,319.50	-7,637,793.08	127,995,526.42
项目	上年度可比期间		
	2017 年 9 月 15 日（基金合同生效日）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）	426,824,248.14	-	426,824,248.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,301,603.22	5,301,603.22
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）	-104,767,232.88	-1,620,982.89	-106,388,215.77
其中：1.基金申购款	3,614,317.08	52,310.84	3,666,627.92
2.基金赎回款	-108,381,549.96	-1,673,293.73	-110,054,843.69
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	322,057,015.26	3,680,620.33	325,737,635.59

益（基金净值）			
---------	--	--	--

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

交银施罗德恒益灵活配置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[2017]1179 号文《关于准予交银施罗德恒益灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准，由交银施罗德基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德恒益灵活配置混合型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，存续期限不定期，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 426,657,795.78 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第 876 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《交银施罗德恒益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 9 月 15 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 426,824,248.14 份基金份额，其中认购资金利息折合 166,452.36 份基金份额。本基金的基金管理人为交银施罗德基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德恒益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(含国债、央行票据、金融债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、企业债券、公司债券、可转换债券(含可分离交易可转换债券)、可交换公司债券、次级债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、货币市场工具、债券回购、同业存单、银行存款(含协议存款、定期存款及其他银行存款)、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 0%-95%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或者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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率×40%+中证综合债券指数收益率×60%。

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》、《交银施罗德恒益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 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 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等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须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[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》、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]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 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。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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(“交银施罗德资管”)	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9月15日（基金 合同生效日）至2017年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,683,976.05	1,674,783.05
其中：支付销售机构的客户维护 费	1,181,186.13	761,202.46

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9月15日（基金 合同生效日）至2017年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	447,329.35	279,130.41

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9月15日（基金合同生效日） 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	87,600,634.44	712,539.60	101,307,935.41	419,498.80

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须作说明的其他关联交易事项。

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

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 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资产中属于第一层次的余额为 30,732,850.24 元，属于第二层次的余额为 9,940,000.00 元，无属于第三层次的余额(2017 年 12 月 31 日：第一层次 75,536,614.66 元，第二层次 14,475,607.65 元，无第三层次)。

(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 2018 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(2017 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	23,665,891.88	18.44
	其中：股票	23,665,891.88	18.44
2	固定收益投资	17,006,958.36	13.25
	其中：债券	17,006,958.36	13.25
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	87,600,634.44	68.26
7	其他各项资产	61,844.93	0.05
8	合计	128,335,329.61	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	5,585,705.60	4.36
C	制造业	7,079,768.70	5.53
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	5,453,430.00	4.26
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	5,440,112.58	4.25
K	房地产业	-	-
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	106,875.00	0.08
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	23,665,891.88	18.49

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	600256	广汇能源	1,485,560	5,585,705.60	4.36
2	601607	上海医药	320,790	5,453,430.00	4.26
3	600036	招商银行	211,300	5,324,760.00	4.16

4	000538	云南白药	57,570	4,257,877.20	3.33
5	300146	汤臣倍健	124,904	2,122,118.96	1.66
6	300760	迈瑞医疗	6,407	699,772.54	0.55
7	601319	中国人保	21,441	115,352.58	0.09
8	300347	泰格医药	2,500	106,875.00	0.08

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	002027	分众传媒	17,142,697.00	5.26
2	300170	汉得信息	8,044,528.35	2.47
3	000538	云南白药	7,052,224.00	2.17
4	600256	广汇能源	6,871,072.60	2.11
5	600036	招商银行	6,130,484.52	1.88
6	000661	长春高新	4,556,493.26	1.40
7	603108	润达医疗	4,421,314.24	1.36
8	300146	汤臣倍健	2,635,956.30	0.81
9	300347	泰格医药	1,194,862.00	0.37
10	300760	迈瑞医疗	312,661.60	0.10
11	601828	美凯龙	95,855.10	0.03
12	601838	成都银行	89,465.01	0.03
13	601319	中国人保	71,612.94	0.02
14	603056	德邦股份	20,066.64	0.01
15	603516	淳中科技	16,458.32	0.01
16	603356	华菱精工	12,650.19	0.00

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	300347	泰格医药	17,089,913.98	5.25
2	601939	建设银行	16,982,406.68	5.21
3	002027	分众传媒	13,926,961.96	4.28
4	002304	洋河股份	13,152,564.16	4.04
5	603108	润达医疗	10,675,982.24	3.28
6	603986	兆易创新	8,200,930.00	2.52
7	600132	重庆啤酒	8,136,583.44	2.50
8	300170	汉得信息	7,118,076.02	2.19
9	000725	京东方 A	6,324,789.00	1.94
10	600559	老白干酒	5,795,448.00	1.78
11	000661	长春高新	4,940,535.82	1.52
12	603883	老百姓	3,523,618.00	1.08
13	601607	上海医药	3,155,216.94	0.97
14	000538	云南白药	1,719,781.00	0.53
15	601828	美凯龙	213,468.00	0.07
16	601838	成都银行	194,200.01	0.06
17	603056	德邦股份	103,268.40	0.03
18	603080	新疆火炬	62,278.02	0.02
19	603283	赛腾股份	46,540.50	0.01
20	603161	科华控股	40,444.96	0.01

注：“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	58,668,402.07
卖出股票的收入（成交）总额	121,576,162.60

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	9,940,000.00	7.77
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）	7,066,958.36	5.52
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	17,006,958.36	13.29

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	100,000	9,940,000.00	7.77
2	128024	宁行转债	66,682	7,066,958.36	5.52

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

8.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	14,298.88
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	46,847.10
5	应收申购款	698.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	61,844.93

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	128024	宁行转债	7,066,958.36	5.52

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

- 1、本基金本报告期末未持有处于交换期的可交换债券。
- 2、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	持有人结构	
		机构投资者	个人投资者

	额	持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
2,425	55,931.27	-	-	135,633,319.50	100.00 %

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	26,292.42	0.02%

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(2017年9月15日)基金份额总额	426,824,248.14
本报告期期初基金份额总额	322,057,015.26
本报告期基金总申购份额	3,246,337.78
减：本报告期基金总赎回份额	189,670,033.54
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	135,633,319.50

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普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），本期审计费用为 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

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	
国信证券股份有限公司	2	8,270,128.13	4.60%	7,701.95	4.60%	-
招商证券股份有限公司	1	8,018,926.30	4.46%	7,467.86	4.46%	-
西南证券股份有限公司	1	5,503,519.01	3.06%	5,125.48	3.06%	-
东兴证券股份有限公司	1	4,940,535.82	2.75%	4,601.12	2.75%	-
长江证券股份有限公司	2	45,394,981.90	25.27%	42,276.37	25.27%	-
申万宏源证券有限公司	2	3,642,279.75	2.03%	3,391.95	2.03%	-
川财证券有限责任公司	1	2,854,800.00	1.59%	2,658.63	1.59%	-
华泰证券股份有限公司	1	2,610,933.27	1.45%	2,431.56	1.45%	-
西部证券股份有限公司	1	24,731,822.16	13.77%	23,032.73	13.77%	-
天风证券股份有限公司	1	20,502,914.85	11.41%	19,094.26	11.41%	-
海通证券股份有限公司	1	18,809,875.30	10.47%	17,517.72	10.47%	-
广发证券股份有限公司	1	17,671,910.84	9.84%	16,457.43	9.84%	-
瑞银证券有限责任公司	1	1,665,588.24	0.93%	1,551.06	0.93%	-
光大证券股份有限公司	1	15,007,579.30	8.35%	13,976.55	8.35%	-
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

渤海证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
东方证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
民生证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
华西证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
上海华信证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
东北证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
国联证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
宏信证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
东海证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
平安证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
方正证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
九州证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
北京高华证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
华宝证券有限 责任公司	2	-	-	-	-	-
国融证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
新时代证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
信达证券股份 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	成交金额	占当期回 购成交总	成交金额	占当期权 证成交总

		额的比例		额的比例		额的比例
招商证券股份 有限公司	-	-	70,000,00 0.00	22.22%	-	-
西南证券股份 有限公司	2,378,595.70	11.86%	-	-	-	-
长江证券股份 有限公司	7,226,411.62	36.02%	-	-	-	-
西部证券股份 有限公司	3,791,515.89	18.90%	-	-	-	-
天风证券股份 有限公司	2,050,295.50	10.22%	-	-	-	-
广发证券股份 有限公司	-	-	245,000,0 00.00	77.78%	-	-
光大证券股份 有限公司	4,613,565.09	23.00%	-	-	-	-

注：1、报告期内，本基金新增加交易单元为中信证券股份有限公司和西部证券股份有限公司，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、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。

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