交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

2018年6月30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：二〇一八年八月二十五日

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。本半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2018年8月24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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年1月1日起至6月30日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	交银定期支付双息平衡混合
基金主代码	519732
交易代码	519732
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年9月4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	489,302,295.58份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金精选具有长期增长潜力和较好分红能力的股票，以及具有较高息票率的债券，力争实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金精选具有较好现金分红能力、长期增长潜力且估值水平合理的上市公司以及具有较高息票率的债券，通过在股票和债券等不同类别资产中的平衡配置，追求基金资产在风险可控前提下的持续增值，充分享受股票分红和债券利息的双重收益。
业绩比较基准	50%× 中证红利指数收益率+50%× 中债综合全价指数收益率
风险收益特征	本基金是一只混合型基金，在证券投资基金中属于较高风险的品种，其长期平均风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

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	王晓婷	贺倩
	联系电话	（021）61055050	010-66060069
	电子邮箱	xxpl@ysld.com, disclosure@ysld.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

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

3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2018年1月1日至2018年6月30日)
本期已实现收益	-17,495,200.79
本期利润	-11,609,787.07
加权平均基金份额本期利润	-0.0507
本期基金份额净值增长率	7.27%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	1.736
期末基金资产净值	1,444,661,748.84
期末基金份额净值	2.952

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
过去一个月	-3.47%	1.40%	-3.97%	0.59%	0.50%	0.81%
过去三个月	-5.32%	1.17%	-4.05%	0.52%	-1.27%	0.65%
过去六个月	7.27%	1.27%	-4.94%	0.54%	12.21%	0.73%
过去一年	34.49%	1.09%	-3.21%	0.43%	37.70%	0.66%
过去三年	58.37%	1.33%	-7.48%	0.78%	65.85%	0.55%
自基金合同生效起至今	195.20%	1.30%	42.76%	0.78%	152.44%	0.52%

注：本基金的业绩比较基准为50%× 中证红利指数收益率+50%× 中债综合全价指数收益率，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

交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2013年9月4日至2018年6月30日）

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。

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81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		
杨浩	交银定期支付双息平衡混合、交银新生活力灵活配置混合的基金经理	2015-08-15	-	8年	杨浩先生，北京邮电大学通信与信息系统专业硕士。2010年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任行业分析师。

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

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，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。

4.3.2 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

今年以来，宏观基本面较为复杂。我们一方面处于后金融地产周期，金融去杠杆对传统货币放水发展模式的肃清仍在进行中，另一方面遭遇与美国的贸易冲突，在新兴技术领域出现摩擦。复杂的宏观背景使得中观产业运行的轨迹出现超出市场预期的变化，中央对打破刚性兑付的态度较为坚决，对部分产业补贴收紧，信贷收紧，对僵尸企业、违规企业惩处严厉。经济不确定性的增强使得上半年资本市场出现大幅波动，沪深300指数下跌12.90%，创业板指数下跌8.33%，仅日常消费中的医药生物和食品饮料板块表现较好。

本基金上半年跑赢业绩比较基准，主要源于重仓股中的计算机、医药生物、垂直互联网中的龙头企业股价表现相对较好，整体仓位维持中性。

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 主要财务指标”及“3.2.1 本报告期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

我们关注下半年政策的微调组合，并据时做出相应应对，但从更长远的角度，我们更关注创新突围，从过去“从0到1”的主题口号式创新，到未来“从1到n”的创新工业持续性和规模化。我们也从行业投资的视角开始切换到不拘行业划分看真正意义上的创新工业化。消费的品牌积淀供应链优化、传媒的爱好者社区、专业软件的研发粘性、制造业的高精与规模化等都将可能是我们的长期投资方向。

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6月30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 托管人对本半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半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 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金

报告截止日：2018年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	120,125,479.96	66,063,384.94
结算备付金		2,280,922.58	562,173.82
存出保证金		334,428.33	114,600.20
交易性金融资产	6.4.7.2	893,187,599.80	173,855,409.39
其中：股票投资		893,187,599.80	163,856,409.39
基金投资		-	-
债券投资		-	9,999,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	447,783,493.43	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	203,176.39	392,034.97
应收股利		-	-
应收申购款		4,317,142.47	495,017.27
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,468,232,242.96	241,482,620.59
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年6月30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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		12,927,376.33	629,483.79
应付赎回款		7,049,051.64	1,401,075.14
应付管理人报酬		1,637,008.70	289,733.54
应付托管费		272,834.79	48,288.90
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,499,805.81	199,779.00
应交税费		39,174.31	32,800.00
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	145,242.54	95,249.47
负债合计		23,570,494.12	2,696,409.84
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	489,302,295.58	86,768,456.33
未分配利润	6.4.7.10	955,359,453.26	152,017,754.42
所有者权益合计		1,444,661,748.84	238,786,210.75
负债和所有者权益总计		1,468,232,242.96	241,482,620.59

注：1、报告截止日2018年6月30日，基金份额净值2.952元，基金份额总额489,302,295.58份。

2、本摘要中资产负债表和利润表所列附注号为半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半年度报告正文。

6.2 利润表

会计主体：交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金

本报告期：2018年1月1日至2018年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入		-2,755,897.96	6,510,048.87
1.利息收入		1,223,308.67	281,221.03
其中：存款利息收入	6.4.7.11	888,723.59	90,323.39
债券利息收入		7,383.56	190,897.64
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		327,201.52	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-10,809,762.27	2,102,713.75
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-14,398,948.76	1,807,580.14
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-113,660.00	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	3,702,846.49	295,133.61
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	5,885,413.72	4,112,280.32
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	945,141.92	13,833.77
减：二、费用		8,853,889.11	1,375,910.44
1. 管理人报酬		4,999,186.71	720,209.11
2. 托管费		833,197.80	120,034.86
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	2,871,422.99	435,231.19
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		1,177.93	-
7. 其他费用	6.4.7.20	148,903.68	100,435.28
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-11,609,787.07	5,134,138.43
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-11,609,787.07	5,134,138.43

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金

本报告期：2018年1月1日至2018年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30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）	86,768,456.33	152,017,754.42	238,786,210.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-11,609,787.07	-11,609,787.07
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）	402,533,839.25	814,951,485.91	1,217,485,325.16
其中：1.基金申购款	596,244,753.08	1,200,113,396.04	1,796,358,149.12
2.基金赎回款	-193,710,913.83	-385,161,910.13	-578,872,823.96
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）	489,302,295.58	955,359,453.26	1,444,661,748.84
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30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）	44,481,269.20	47,897,311.34	92,378,580.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,134,138.43	5,134,138.43
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）	2,736,864.67	3,375,429.92	6,112,294.59
其中：1.基金申购款	11,556,343.64	13,364,697.56	24,921,041.20
2.基金赎回款	-8,819,478.97	-9,989,267.64	-18,808,746.61
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）	47,218,133.87	56,406,879.69	103,625,013.56

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4，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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

交银施罗德定期支付双息平衡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[2013]753号《关于核准交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金募集的批复》核准，由交银施罗德基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德定期支付双息平衡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，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币641,999,732.41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(2013)第550号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金基金合同》于2013年9月4日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为642,313,653.44份基金份额，其中认购资金利息折合313,921.03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《交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金基金合同》和《交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金每月定期按照约定的年化现金支付比率，以约定的定期支付基准日的基金份额净值为基础，计算当期基金份额持有人可获得支付的现金，并自动赎回基金份额持有人所持的对应金额的基金份额，以该自动赎回的资金向基金份额持有人进行现金支付。本基金当前的年化现金支付比率为6%。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德定期支付双息平衡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，包括国内依法上市的股票(含中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票)、债券、货币市场工具、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金投资于股票、权证等权益类资产占基金资产净值的30%-70%，其中权证的投资比例不超过基金资产净值的3%；债券、资产支持证券、货币市场工具、银行存款等固定收益类资产和现金不低于基金资产净值的30%，其中现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为50%× 中证红利指数收益率+50%× 中债综合全价指数收益率。

6.4.2 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》、《交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018年上半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6月30日的财务状况以及2018年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计差错更正。

6.4.6 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。

(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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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(“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

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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,999,186.71	720,209.11
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	833,197.80	120,034.86

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝前一日基金资产净值× 0.25% ÷ 当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费

无。

6.4.8.3 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。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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。

6.4.8.4.2 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。

6.4.8.5 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6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30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	120,125,479.96	851,791.65	23,293,600.35	87,888.62

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。

6.4.8.6 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。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

6.4.8.7.1 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。

6.4.9 期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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

6.4.9.1.1 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
603105	芯能科技	2018-06-29	2018-07-09	新股未上市	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	-
603693	江苏新能	2018-06-25	2018-07-03	新股未上市	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	-
603706	东方环宇	2018-06-29	2018-07-09	新股未上市	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	-
002410	广联达	2018-03-22	2018-09-25	限售股	22.10	26.06	300,000	6,630,000.00	7,818,000.00	-

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。

6.4.9.2 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股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7 投资组合报告

7.1 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	893,187,599.80	60.83
	其中：股票	893,187,599.80	60.83
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	447,783,493.43	30.50
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	122,406,402.54	8.34
8	其他各项资产	4,854,747.19	0.33
9	合计	1,468,232,242.96	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	14,618,682.50	1.01
C	制造业	220,174,421.54	15.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,559.85	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	96,474,985.38	6.68
G	交通运输、仓储和邮政业	42,938,317.25	2.97
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	338,052,407.66	23.40
J	金融业	-	-
K	房地产业	26,858,409.00	1.86
L	租赁和商务服务业	17,085,895.20	1.18
M	科学研究和技术服务业	21,633,003.84	1.50
N	水利、环境和公共设施管理业	81,226.14	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	115,198,691.44	7.97
S	综合	-	-
	合计	893,187,599.80	61.83

7.2.2 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。

7.3 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	300413	快乐购	2,043,672	77,536,915.68	5.37
2	300170	汉得信息	4,736,900	76,927,256.00	5.32
3	300188	美亚柏科	3,837,495	70,226,158.50	4.86
4	300059	东方财富	4,874,673	64,248,190.14	4.45
5	000681	视觉中国	2,155,900	61,874,330.00	4.28
6	002475	立讯精密	1,821,800	41,063,372.00	2.84
7	603039	泛微网络	437,246	38,425,178.48	2.66
8	000661	长春高新	158,100	35,999,370.00	2.49
9	300182	捷成股份	3,870,468	29,338,147.44	2.03
10	600048	保利地产	2,181,345	26,612,409.00	1.84
11	002292	奥飞娱乐	2,979,937	26,610,837.41	1.84

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半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	300170	汉得信息	68,714,332.98	28.78
2	300188	美亚柏科	64,648,266.52	27.07
3	300059	东方财富	64,420,203.11	26.98
4	300413	快乐购	58,597,111.25	24.54
5	000681	视觉中国	57,828,044.08	24.22
6	002292	奥飞娱乐	51,371,588.06	21.51
7	600115	东方航空	48,926,140.90	20.49
8	600048	保利地产	42,953,386.31	17.99
9	002475	立讯精密	41,774,480.00	17.49
10	300182	捷成股份	38,964,385.04	16.32
11	601933	永辉超市	33,345,508.00	13.96
12	002050	三花智控	32,756,394.58	13.72
13	002456	欧菲科技	31,324,646.64	13.12
14	000002	万科A	31,139,823.88	13.04
15	600029	南方航空	30,925,243.00	12.95
16	000661	长春高新	30,505,832.76	12.78
17	601012	隆基股份	30,096,825.71	12.60
18	603885	吉祥航空	29,723,176.70	12.45
19	300078	思创医惠	25,736,845.60	10.78
20	603108	润达医疗	25,602,399.09	10.72
21	300253	卫宁健康	23,924,540.36	10.02
22	603039	泛微网络	23,045,305.64	9.65
23	300365	恒华科技	23,009,934.40	9.64
24	000963	华东医药	22,936,428.50	9.61
25	002027	分众传媒	21,858,892.12	9.15
26	600030	中信证券	21,854,959.00	9.15
27	600779	水井坊	21,647,577.00	9.07
28	000807	云铝股份	20,682,683.20	8.66
29	300532	今天国际	20,504,213.30	8.59
30	300014	亿纬锂能	19,443,897.00	8.14
31	300012	华测检测	16,945,880.12	7.10
32	601877	正泰电器	16,767,464.42	7.02
33	002415	海康威视	15,665,829.19	6.56
34	600028	中国石化	14,597,544.00	6.11
35	600256	广汇能源	14,198,358.10	5.95
36	002690	美亚光电	14,171,406.58	5.93
37	002465	海格通信	13,278,221.25	5.56
38	601111	中国国航	13,116,138.50	5.49
39	002410	广联达	12,940,171.60	5.42
40	000333	美的集团	12,700,773.80	5.32
41	000960	锡业股份	11,881,349.00	4.98
42	600188	兖州煤业	11,877,780.36	4.97
43	600986	科达股份	11,263,858.44	4.72
44	300616	尚品宅配	11,249,400.52	4.71
45	600570	恒生电子	10,557,650.88	4.42
46	603026	石大胜华	10,390,542.00	4.35
47	002769	普路通	10,359,066.57	4.34
48	603043	广州酒家	10,183,558.80	4.26
49	601100	恒立液压	9,872,661.25	4.13
50	300251	光线传媒	8,931,111.98	3.74
51	300602	飞荣达	8,545,747.00	3.58
52	002912	中新赛克	8,406,175.00	3.52
53	600690	青岛海尔	8,346,402.00	3.50
54	000932	华菱钢铁	7,665,071.00	3.21
55	300529	健帆生物	7,641,102.00	3.20
56	601166	兴业银行	7,070,020.00	2.96
57	600271	航天信息	6,733,617.84	2.82
58	603096	新经典	6,484,977.00	2.72
59	002697	红旗连锁	5,589,721.00	2.34
60	300124	汇川技术	5,521,905.00	2.31
61	000725	京东方A	5,295,345.00	2.22
62	300523	辰安科技	5,074,165.48	2.12
63	600066	宇通客车	4,787,649.00	2.00

注：“本期累计买入金额”按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 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	002456	欧菲科技	31,584,184.51	13.23
2	601933	永辉超市	29,419,835.38	12.32
3	000002	万科A	27,879,601.00	11.68
4	600029	南方航空	25,911,687.16	10.85
5	600030	中信证券	24,502,410.87	10.26
6	300253	卫宁健康	24,475,006.15	10.25
7	601012	隆基股份	24,238,477.20	10.15
8	000963	华东医药	24,197,176.69	10.13
9	300251	光线传媒	22,354,376.93	9.36
10	600115	东方航空	20,804,871.75	8.71
11	000807	云铝股份	19,131,016.80	8.01
12	002050	三花智控	17,548,706.32	7.35
13	600028	中国石化	14,545,472.50	6.09
14	002465	海格通信	14,511,781.17	6.08
15	300308	中际旭创	14,247,615.52	5.97
16	002415	海康威视	14,216,949.52	5.95
17	601111	中国国航	13,511,416.00	5.66
18	603986	兆易创新	13,497,997.95	5.65
19	002081	金螳螂	13,104,306.64	5.49
20	601877	正泰电器	13,029,993.40	5.46
21	600048	保利地产	12,649,662.00	5.30
22	002027	分众传媒	12,553,480.42	5.26
23	000333	美的集团	12,114,341.00	5.07
24	600188	兖州煤业	12,026,945.52	5.04
25	600570	恒生电子	10,794,371.20	4.52
26	002292	奥飞娱乐	10,697,768.23	4.48
27	000960	锡业股份	10,319,052.40	4.32
28	300616	尚品宅配	9,886,381.40	4.14
29	002769	普路通	9,630,827.54	4.03
30	603026	石大胜华	9,541,257.10	4.00
31	300078	思创医惠	9,304,099.54	3.90
32	300529	健帆生物	8,480,003.81	3.55
33	002008	大族激光	8,263,797.36	3.46
34	300532	今天国际	7,868,683.94	3.30
35	000932	华菱钢铁	7,701,722.00	3.23
36	002430	杭氧股份	7,299,041.51	3.06
37	600271	航天信息	7,188,965.62	3.01
38	600690	青岛海尔	7,166,088.39	3.00
39	601166	兴业银行	6,794,704.00	2.85
40	300602	飞荣达	6,624,947.44	2.77
41	600183	生益科技	5,616,868.92	2.35
42	002410	广联达	5,497,767.89	2.30
43	300124	汇川技术	5,478,524.00	2.29
44	002697	红旗连锁	5,425,575.00	2.27
45	300015	爱尔眼科	4,915,256.15	2.06
46	600066	宇通客车	4,846,297.00	2.03

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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	1,435,517,118.16
卖出股票的收入（成交）总额	697,557,732.71

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	334,428.33
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	203,176.39
5	应收申购款	4,317,142.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,854,747.19

7.12.4 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。

7.12.5 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。

7.12.6 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。

8 基金份额持有人信息

8.1 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
109,597	4,464.56	179,993,614.94	36.79%	309,308,680.64	63.21%

8.2 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	78,740.73	0.02%

8.3 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

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013年9月4日）基金份额总额	642,313,653.44
本报告期期初基金份额总额	86,768,456.33
本报告期基金总申购份额	596,244,753.08
减：本报告期基金总赎回份额	193,710,913.83
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	489,302,295.58

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。

10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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：2018年6月30日本基金管理人发布公告，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，并决定由公司总经理阮红女士代为履行公司督察长职务。期后变动(如有)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。

10.3 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。

10.4 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。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务。

10.7 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。

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 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	
中信建投证券股份有限公司	1	74,718,846.16	3.51%	69,584.74	3.51%	-
中国国际金融股份有限公司	2	73,945,911.72	3.47%	68,865.69	3.47%	-
招商证券股份有限公司	1	58,252,205.99	2.73%	54,249.86	2.73%	-
东北证券股份有限公司	2	329,770,348.05	15.47%	307,115.49	15.47%	-
华西证券股份有限公司	1	31,474,936.15	1.48%	29,312.64	1.48%	-
兴业证券股份有限公司	1	261,345,516.41	12.26%	243,391.83	12.26%	-
华泰证券股份有限公司	2	260,385,699.67	12.22%	242,497.44	12.22%	-
天风证券股份有限公司	1	256,789,163.89	12.05%	239,148.33	12.05%	-
光大证券股份有限公司	2	216,681,871.35	10.17%	201,796.32	10.17%	-
西部证券股份有限公司	2	171,310,534.48	8.04%	159,541.92	8.04%	-
申万宏源证券有限公司	3	156,527,844.31	7.34%	145,871.16	7.35%	-
中信证券股份有限公司	1	125,159,584.84	5.87%	116,561.40	5.87%	-
国海证券股份有限公司	1	114,894,584.00	5.39%	107,001.27	5.39%	-
安信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
九州证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中银国际股份有限公司	1	-	-	-	-	-
英大证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中国中投证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-

注：1、报告期内，本基金新增加交易单元为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、租用证券公司交易单元的程序：首先根据租用证券公司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交易单元。研究部提交方案，并上报公司批准。

10.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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。