# 交银施罗德成长混合型证券投资基金 2016年年度报告摘要

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

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2016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 | 交银成长混合 | |
| 基金主代码 | 519692 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2006年10月23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 | 868,765,926.06份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 交银成长混合A | 交银成长混合H |
| 下属分级基金的交易代码 | 519692(前端),519693(后端) | 960016 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 868,448,992.32份 | 316,933.74份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金属于成长型混合型基金,主要通过投资于经过严格的品质筛选且具有良好成长性的上市公司的股票,在适度控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下,为基金份额持有人谋求长期、稳定的资本增值。 |
| 投资策略 | 本基金充分发挥基金管理人的研究优势,将严谨、规范化的选股方法与积极主动的投资风格相结合,在分析和判断宏观经济运行和行业景气变化、以及上市公司成长潜力的基础上,通过优选成长性好、成长具有可持续性、成长质量优良、定价相对合理的股票进行投资,以谋求超额收益。 |
| 业绩比较基准 | 75%×富时中国A600成长指数+25%×富时中国国债指数 |
| 风险收益特征 | 本基金是一只混合型基金,以具有良好成长性的公司为主要投资对象,追求超额收益,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 | 林蔚 |
| | 联系电话 | (021)61055050 | 010-66060069 |
| | 电子邮箱 | xxpl@jyshd.com,disclosure@jyshd.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,www.bocomschroder.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 | 2016年 | | 2015年 | | 2014年 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 交银成长混合A | 交银成长混合H | 交银成长混合A | 交银成长混合H | 交银成长混合A | 交银成长混合H |
| 本期已实现收益 | 69,066,046.30 | 70,225.02 | 2,335,205,440.65 | - | 1,671,863,016.27 | - |
| 本期利润 | -246,666,089.50 | 883,055.20 | 2,556,935,045.43 | - | 304,827,993.55 | - |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.2760 | 0.8944 | 2.5415 | - | 0.1177 | - |
| 本期基金份额净值增长率 | -6.41% | 20.80% | 59.89% | - | 5.11% | - |
| 3.1.2期末数据和指标 | 2016年末 | | 2015年末 | | 2014年末 | |
| | 交银成长混合A | 交银成长混合H | 交银成长混合A | 交银成长混合H | 交银成长混合A | 交银成长混合H |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.3321 | 0.3567 | 0.9753 | - | 0.2246 | - |
| 期末基金资产净值 | 3,762,173,789.93 | 1,380,790.26 | 4,079,489,744.83 | - | 4,674,245,706.51 | - |
| 期末基金份额净值 | 4.3321 | 4.3567 | 4.9753 | - | 3.2246 | - |

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、本基金自2016年3月7日起,开始销售H类份额,当日投资者提交的申购申请于2016年3月8日被确认并将有效份额登记在册。

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

1. 交银成长混合A:

| 3.1.1期间数据和指标 | 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 | 2.37% | 0.93% | -2.15% | 0.56% | 4.52% | 0.37% |
| 过去六个月 | 9.55% | 0.88% | -1.08% | 0.62% | 10.63% | 0.26% |
| 过去一年 | -6.41% | 1.61% | -15.86% | 1.28% | 9.45% | 0.33% |
| 过去三年 | 57.29% | 1.94% | 17.05% | 1.44% | 40.24% | 0.50% |
| 过去五年 | 122.25% | 1.71% | 20.14% | 1.29% | 102.11% | 0.42% |
| 自基金合同生效起至今 | 455.57% | 1.71% | 70.35% | 1.46% | 385.22% | 0.25% |

注:本基金的业绩比较基准为75%×富时中国A600成长指数+25%×富时中国国债指数,每日进行再平衡过程。

2. 交银成长混合H:

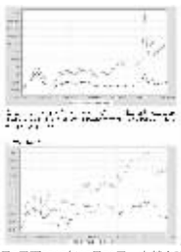
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 2.74% | 0.93% | -2.15% | 0.56% | 4.89% | 0.37% |
| 过去六个月 | 10.05% | 0.87% | -1.08% | 0.62% | 11.13% | 0.25% |
| 自基金类别首次确认起至今 | 20.80% | 1.11% | 1.98% | 0.84% | 18.82% | 0.27% |

注:1、本基金的业绩比较基准为75%×富时中国A600成长指数+25%×富时中国国债指数,每日进行再平衡过程。

2、本基金自2016年3月7日起,开始销售H类份额,当日投资者提交的申购申请于2016年3月8日被确认并将有效份额登记在册。

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

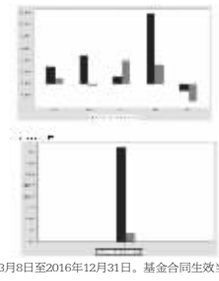
1、交银成长混合A



注:1、图示日期为2016年3月8日至2016年12月31日。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。

2、本基金自2016年3月7日起,开始销售H类份额,当日投资者提交的申购申请于2016年3月8日被确认并将有效份额登记在册。

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



注:图示日期为2016年3月8日至2016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

1、交银成长混合A:

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 | 2.850 | 83,544,415.52 | 150,650,899.15 | 234,195,314.67 | - |
| 2015年 | 1.160 | 59,809,969.85 | 94,047,212.39 | 153,857,172.24 | - |
| 2014年 | 1.600 | 281,421,768.41 | 236,308,301.06 | 517,730,069.47 | - |
| 合计 | 5.610 | 424,776,143.78 | 481,006,412.60 | 905,782,556.38 | - |

2、交银成长混合H:

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 | - | - | - | - | - |
| 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 | | |
| 王少成 | 交银成长混合、交银策略回报灵活配置混合、交银成长30混合、交银买和保本混合的基金经理,公司权益投资总监 | 2015-03-24 | - | 12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、中银证券投资经理、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、投资决策委员会委员、基金经理、其中2010年9月至2012年10月担任东吴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。 |

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

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

本报告期内,本基金整体运作合规合法,无不当内幕交易和关联交易,基金投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的约定,未发生损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本公司制定了严格的投资控制制度和公平交易监控制度来保证旗下所管理的所有资产组合投资运作的公平。旗下所管理的所有资产组合,包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均严格遵循制度进行公平交易。制度中包含的主要控制方法如下:

(1)公司建立资源共享的投资研究信息平台,所有研究成果对所有投资组合公平开放,确保各投资组合在获得研究支持和实施投资决策方面享有公平的机会。

(2)公司将投资管理职能和交易执行职能相隔离,实行集中交易制度,建立了合理且可操作的公平交易分配机制,确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于交易所公开竞价交易,遵循“时间优先、价格优先、比例分配”的原则,全部通过交易系统进行比例分配;对于非集中竞价交易、以公司名义进行的场外交易,遵循“价格优先、比例分配”的原则按事前独立确定的投资方案对交易结果进行分配。

(3)公司建立了清晰的投资授权制度,明确各层级投资决策主体的职责和权限划分,组合投资经理充分发挥专业判断能力,不受他人干预,在授权范围内独立行使投资决策权,维护公平的投资管理环境,维护所管理投资组合的合法利益,保证各投资组合交易决策的客观性和独立性,防范不公平及异常交易的发生。

(4)公司建立统一的投资对象备选库和交易对手备选库,制定明确的备选库建立、维护程序。在全公司适用股票、债券备选库的基础上,根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和关联交易限制等,按需要建立不同投资组合的投资对象风格库和交易对手备选库,组合经理在此基础上根据投资授权构建投资组合。

(5)公司中央交易室和风险管理部进行日常投资交易行为监控,风险管理部负责对各投资组合公平交易进行事后分析,于每季度和每年度分别对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析,通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内公司严格执行公平交易制度,公平对待旗下各投资组合。通过投资交易监控、交易数据分析、专项稽核检查等,本基金管理人未发现任何违反公平交易制度的行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内未发现异常交易行为。本报告期内,本公司管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量5%的情况有2次,是投资组合因投资策略或在合规范围内因被动超标调整需要而发生同日反向交易,未发现不公平交易和利益输送的情况。本基金与本公司管理的其他投资组合在不同时间窗下(如日内、3日内、5日内)同向交易的交易价差未发现异常。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1报告期内本基金投资策略和运作分析

2016年全球黑天鹅不断,虽然股市相对平静,但主要国家间的汇率波动明显加大。英国脱欧和特朗普上台,反映出贫富差距持续加大,驱动民众放弃经济问题,而求解于政治问题。全球无风险利率在三季度开始提升,伴随美元的持续走强,人民币的阶段性贬值持续加大压力。中期来看,类滞胀的经济困境不是美元的强势,而可能是人民币中期贬值的压力所在。金融和房地产部门长期逆周期扩张或是“滞”的根源,但加杠杆和加风险交易出来的投资收益率毕竟没法持续。实体部门的僵尸化或是“胀”的根源,环保和资产负债表压力使得胀的隐患短期难除。金融部门去杠杆是一个破局的方法,操作层面也需要勇气和智慧,既不能引发系统性风险,也不能引发持续的信用收缩。

2016年本基金保持中性仓位,继续降低创业板小票配置比重,增加蓝筹和通胀受益的行业和个股的配置。实体经济的通胀预期,债市的风险外溢,IPO的加速等因素,使得整体A股市场的流动性并不充裕。实体部门的通胀,金融部门的去杠杆,会引发过剩流动性在两部门的持续再配置。而金融部门内部,从债到股的趋势依然还在。所以,过剩流动性对股市的整体影响还需多维度的观察和跟踪。尽管整体市场的估值承压,但热点板块和主题依然不断涌现,我们在块递行业、国企改革,以及通胀预期等行业板块的配置和个股挖掘产生了明显的超额收益。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2016年12月31日,交银成长混合A份额净值为4.3321元,本报告期份额净值增长率为-6.41%,同期业绩比较基准增长率为-15.86%;交银成长混合H份额净值为4.3567 元,本报告期份额净值增长率为20.80%,同期业绩比较基准增长率为1.98%。

本基金自2016年3月7日起,开始销售H类份额,当日投资者提交的申购申请于2016年3月8日被确认并将有效份额登记在册。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们预计2017年在汇率和地产调控的风险阶段性地化解之后,A股市场有望重拾强势,我们对中国经济中长期增长格局依然乘持一分乐观。在未来G2博弈格局下,虽然有众多不确定性和挑战,但中国的资源集中和举国体制的主流特景下似乎更易转化为相对优势。在股票配置上,未来将继续关注通胀受益的板块和个股,聚焦即将风起云涌的国企改革浪潮。

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

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。

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本报告期基金的投资运作,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)对交银施罗德成长混合型证券投资基金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出具了标准无保留意见的审计报告【普华永道中天审字(2017)第20174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:交银施罗德成长混合型证券投资基金

报告截止日:2016年12月31日

单位:人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2016年12月31日 | 上年度末 2015年12月31日 |
|---|---|---|---|
| 资产: | | | |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 60,556,807.13 | 224,623,666.71 |
| 结算备付金 | | 706,481.98 | 4,965,550.90 |
| 存出保证金 | | 807,392.35 | 2,174,384.64 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 3,332,900,454.53 | 3,177,427,817.47 |
| 其中:股票投资 | | 3,132,900,454.53 | 3,177,427,817.47 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 200,000,000.00 | - |
| 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 | 399,981,999.97 | 711,964,515.94 |
| 应收证券清算款 | | - | - |
| 应收利息 | 7.4.7.5 | 5,053,819.16 | 233,559.60 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 1,989,820.54 | 1,078,863.49 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 7.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 3,801,995,775.66 | 4,122,468,358.75 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2016年12月31日 | 上年度末 2015年12月31日 |
| 负债: | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 7.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | 30,133,536.34 | - |
| 应付赎回款 | | 1,388,535.81 | 34,894,077.26 |
| 应付管理人报酬 | | 4,827,349.02 | 5,072,517.31 |
| 应付托管费 | | 804,558.19 | 845,419.57 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 7.4.7.7 | 861,219.91 | 1,714,210.02 |
| 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 | 425,996.20 | 452,389.76 |
| 负债合计 | | 38,441,195.47 | 42,978,613.92 |
| 所有者权益: | | | |
| 实收基金 | 7.4.7.9 | 868,765,926.06 | 819,949,374.41 |
| 未分配利润 | 7.4.7.10 | 2,894,788,654.13 | 3,259,540,370.42 |
| 所有者权益合计 | | 3,763,554,580.19 | 4,079,489,744.83 |
| 负债和所有者权益总计 | | 3,801,995,775.66 | 4,122,468,358.75 |

注:1、报告截止日2016年12月31日,A类基金份额净值4.3321元,H类基金份额净值4.3567元,基金份额总额868,765,926.06份,其中A类基金份额868,448,992.32份,H类基金份额316,933.74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:交银施罗德成长混合型证券投资基金

本报告期:2016年1月1日至2016年12月31日

单位:人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日 |
|---|---|---|---|
| 一、收入 | | -175,417,103.31 | 2,663,950,852.59 |
| 1.利息收入 | | 10,480,484.81 | 9,826,336.53 |
| 其中:存款利息收入 | 7.4.7.11 | 4,578,644.75 | 4,870,191.73 |
| 债券利息收入 | | 418,415.30 | 2,664,854.71 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 5,483,424.76 | 2,291,290.09 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益(损失以“-”填列) | | 128,380,010.99 | 2,429,867,883.04 |
| 其中:股票投资收益 | 7.4.7.12 | 112,599,582.86 | 2,409,826,330.15 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.13 | - | 876,503.91 |
| 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 | 15,780,428.13 | 19,165,048.98 |
| 3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列) | 7.4.7.17 | -314,919,305.62 | 221,729,596.78 |
| 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 | 641,706.51 | 2,527,036.24 |
| 减:二、费用 | | 70,365,930.99 | 107,015,807.16 |
| 1. 管理人报酬 | | 54,245,732.91 | 69,194,031.37 |
| 2. 托管费 | | 9,040,955.46 | 11,532,338.57 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 交易费用 | 7.4.7.19 | 6,518,246.85 | 25,782,737.19 |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 其他费用 | 7.4.7.20 | 560,995.77 | 506,700.03 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | | -245,783,034.30 | 2,556,935,045.43 |
| 减:所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | | -245,783,034.30 | 2,556,935,045.43 |

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:交银施罗德成长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) | 819,949,374.41 | 3,259,540,370.42 | 4,079,489,744.83 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | -245,783,034.30 | -245,783,034.30 |
| 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) | 48,816,551.65 | 115,226,632.68 | 164,043,184.33 |
| 其中:1.基金申购款 | 231,726,019.81 | 681,067,700.38 | 912,793,720.19 |
| 2.基金赎回款 | -182,909,468.16 | -565,841,067.70 | -748,750,535.86 |
| 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) | - | -234,195,314.67 | -234,195,314.67 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 868,765,926.06 | 2,894,788,654.13 | 3,763,554,580.19 |
| 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) | 1,449,579,345.41 | 3,224,666,360.10 | 4,674,245,705.51 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 2,556,935,045.43 | 2,556,935,045.43 |
| 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) | -629,629,971.00 | -2,368,203,862.87 | -2,997,833,833.87 |
| 其中:1.基金申购款 | 421,658,250.36 | 1,520,067,528.23 | 1,941,725,778.59 |
| 2.基金赎回款 | -1,051,288,221.36 | -3,888,271,391.10 | -4,939,559,612.46 |
| 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) | - | -153,857,172.24 | -153,857,172.24 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 819,949,374.41 | 3,259,540,370.42 | 4,079,489,744.83 |

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

交银施罗德成长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”)证监基金字[2006]第197号《关于同意交银施罗德成长股票证券投资基金募集的批复》核准,由交银施罗德基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德成长股票证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币6,935,911,418.73元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2006)第154号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《交银施罗德成长股票证券投资基金基金合同》于2006年10月23日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为6,936,363,979.00份基金份额,其中认购资金利息折合452,560.27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2014年中国证监会令第104号《公开募集证券投资基金运作管理办法》及基金管理人于2015年8月5日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金变更基金类别及修改基金名称并相应修改基金合同和托管协议的公告》,交银施罗德成长股票证券投资基金自2015年8月8日起更名为交银施罗德成长混合型证券投资基金。

根据《交银施罗德基金管理有限公司关于增加交银施罗德成长混合型证券投资基金H类基金份额类别及修改基金合同、托管协议的公告》,本基金自2015年11月17日起增加H类基金份额类别并对本基金的基金合同、托管协议作相应修改。本基金按照销售区域及费率标准的不同将本基金的基金份额分为A类和H类两类基金份额。在本基金的基金份额分类实施后,本基金的原有基金份额全部自动划归为本基金A类基金份额类别,A类基金份额仅在中国大陆地区销售;本基金新增加的H类基金份额类别,仅在中国香港地区销售。两类基金份额分设不同的基金代码,并分别公布基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德成长混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种。基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的60%-95%;债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的5%-40%,其中基金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为:75%×富时中国A600成长指数+25%×富时中国国债指数(根据2010年12月16日的《关于交银施罗德成长股票证券投资基金业绩比较基准更名的提示性公告》,因富时集团成为新华富时指数有限公司的全资股东,新华富时指数系列于2010年12月16日正式更改名称为富时中国指数系列)。

本财务报表由本基金的基金管理人交银施罗德基金管理有限公司于2017年3月24日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金协会(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》、《交银施罗德成长混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2016年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2016年12月31日的财务状况以及2016年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 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[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。

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 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 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