交银施罗德精选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	交银精选混合	
基金主代码	519688	
交易代码	519688(前端)	519688(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2006年9月29日	
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	5,676,062,235.40份	
基金合同存续期	不定期	

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将坚持并不断深化价值投资的基本理念,充分发挥专业研究与管理能力,自上而下配置资产,自下而上精选证券,有效控制风险,分享中国经济与资本市场高速成长的成果,谋求实现基金财产的长期稳定增长。
投资策略	自上而下配置资产,自下而上精选证券,有效控制下行风险。
业绩比较基准	75%×沪深300指数+25%×中证综合债券指数
风险收益特征	本基金是一只混合型基金,其风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金,低于股票型基金。属于承担较高风险、预期收益较高的证券投资基金品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		交银施罗德基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙艳	林蕊
	联系电话	021-61055050	010-66060069
	电子邮箱	xcp1@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
本期已实现收益	406,206,325.41	1,889,996,497.32	284,046,140.43
本期利润	25,619,409.49	2,035,657,194.93	21,994,266.90
加权平均基金份额本期利润	0.0062	0.6081	0.0036
本期基金份额净值增长率	0.84%	61.03%	1.85%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末	2015年末	2014年末
期末可供分配基金份额利润	0.1249	0.5731	0.0738
期末基金资产净值	3,225,367,795.77	2,860,665,711.72	3,790,603,817.48
期末基金份额净值	0.5682	1.1640	0.7511

注:1、本基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后的实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.24%	0.81%	0.98%	0.54%	2.26%	0.27%
过去六个月	10.55%	0.94%	3.89%	0.57%	6.66%	0.27%
过去一年	0.84%	1.61%	-7.69%	1.05%	8.53%	0.56%
过去三年	65.39%	1.97%	38.81%	1.35%	26.58%	0.62%
过去五年	41.10%	1.61%	15.30%	1.18%	25.80%	0.43%
自基金合同生效起至今	472.24%	1.62%	219.12%	1.39%	253.12%	0.23%

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

跌幅居前。究其原因,市场整体风险偏好降低,对于景气度改善和业绩确定性的要求提升,而对于高估值板块整体受压,并购重组从严审核也是高估值板块受挫的重要原因之一。2016年本基金取得正收益回报,自上而下对市场脉络把握准确,在后三个季度表现尤为突出,主要归功于行业配置和个股选择。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2016年12月31日,本基金份额净值为0.5682元,本报告期份额净值增长率为0.84%,同期业绩比较基准增长率为-7.69%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2017年,我们对A股市场持中性态度,认为全年窄幅震荡格局概率偏大,判断指数表现前低后高。首先,“去杠杆”政策基调已非常鲜明,因此全局性流动性环境可能不如2016年宽松;其次,我们判断房地产投资、基建投资和贸易顺差这三大块总需求指标均存在较大下行压力,经济增长压力仍然较大;最后,从大类资产比较角度来看,A股市场相对于固收市场、地产市场和商品期货市场而言,估值泡沫相对最小,性价比较高,这也是A股市场整体下行空间有限的重要原因。选股方向上,我们倾向于选择与宏观经济关联度较低、行业内生增速相对较快的领域,相对更为关注医药、环保、通信、教育等行业。2017年,选股标准将比之前更为严苛,对于自上而下大逻辑通顺、自下而上业绩增速与估值水平的匹配度等逐项条件均需审慎考虑,才有望获得理想的回报。

4.6 管理人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和本年度应分配的可分配利润分别进行了收益分配,具体情况参见年度报告正文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2016年1月1日至2016年12月31日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 审计报告

德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【德师报(审)字(17)第P01123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: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	78,489,354.22	213,659,492.90
结算备付金		12,945,528.24	10,591,595.65
存出保证金		3,038,631.62	4,802,573.34
交易性金融资产	7.4.7.2	2,857,551,275.21	2,580,148,609.52
其中:股票投资		2,687,820,275.21	2,449,612,609.52
基金投资		-	-
债券投资		169,731,000.00	130,536,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	299,507,809.26	100,000,270.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	3,098,276.34	1,952,512.92
应收股利		-	-
应收申购款		743,178.50	328,707.82
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		3,255,374,053.39	2,911,483,762.15
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		17,432,268.71	33,745,591.36
应付赎回款		1,637,568.97	7,138,544.42
应付管理人报酬		4,267,995.52	3,560,826.51
应付托管费		711,332.58	591,804.45
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	5,552,680.30	5,382,682.56
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	404,411.54	408,601.13
负债合计		30,006,257.62	50,818,050.43
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	2,516,353,331.13	1,089,471,734.03
未分配利润	7.4.7.10	709,014,464.64	1,771,193,977.69
所有者权益合计		3,225,367,795.77	2,860,665,711.72
负债和所有者权益总计		3,255,374,053.39	2,911,483,762.15

注:1、报告截止日2016年12月31日,基金份额净值0.5682元,基金份额总额5,676,062,235.40份。

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: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		100,282,855.25	2,135,674,702.92
1.利息收入		6,888,173.78	9,047,544.32
其中:存款利息收入	7.4.7.11	3,160,457.20	2,577,897.02
债券利息收入		1,804,770.26	4,807,922.31
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,873,445.74	1,661,724.99
其他利息收入		49,500.58	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		472,847,007.74	1,980,401,187.76
其中:股票投资收益	7.4.7.12	462,410,480.87	1,968,693,082.73
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	52,160.00	5,272,180.88
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	10,384,366.87	6,435,924.15
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.17	-380,585,915.92	145,660,697.61
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.18	1,133,589.65	565,273.23
减:二、费用		74,663,445.76	100,017,507.99
1. 管理人报酬		38,819,218.65	50,075,824.33
2. 托管费		6,469,869.78	8,345,970.78
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	28,880,106.81	41,098,482.86
5. 利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	494,250.52	497,230.02
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		25,619,409.49	2,035,657,194.93
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		25,619,409.49	2,035,657,194.93

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:交银施罗德精选混合型证券投资基金

本报告期:2016年1月1日至2016年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,089,471,734.03	1,771,193,977.69	2,860,665,711.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	25,619,409.49	25,619,409.49
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	1,426,881,597.10	650,689,202.87	2,077,570,799.97
其中:1.基金申购款	2,189,882,308.01	967,653,978.58	3,147,536,286.59
2.基金赎回款	-763,000,710.91	-306,964,775.71	-1,069,965,486.62
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-1,738,488,125.41	-1,738,488,125.41
五、期末所有者权益(基金净值)	2,516,353,331.13	709,014,464.64	3,225,367,795.77
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	2,237,412,509.34	1,553,191,308.14	3,790,603,817.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,035,657,194.93	2,035,657,194.93
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-1,147,940,775.31	-1,675,458,899.03	-2,823,399,674.34
其中:1.基金申购款	242,651,308.71	324,385,296.60	567,036,605.51
2.基金赎回款	-1,390,592,084.02	-1,999,844,195.63	-3,390,436,279.85
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-142,195,626.35	-142,195,626.35
五、期末所有者权益(基金净值)	1,089,471,734.03	1,771,193,977.69	2,860,665,711.72

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码(序号)从7.1至7.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人:阮红,主管会计工作负责人:夏华龙,会计机构负责人:单江

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

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

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

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、修改后的基金合同和定期更新的本基金招募说明书的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。基金的投资组合为:股票资产占基金资产的60%-95%,债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的5%-40%,其中,基金保留的现金以及投资于一年期以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。

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

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

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《交银施罗德精选混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金2016年12月31日的财务状况以及2016年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 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需说明的重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]125号《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

1)于2016年5月1日前,以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起,金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股票的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

3)对于内地投资者持有的基金类别,对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。对于香港市场投资者通过基金互认持有的基金类别,对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向该内地基金分配利息时按照7%的税率代扣代缴所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,应由内地上市公司向该内地基金分配股息红利时按照10%的税率代扣代缴所得税。

4)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日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	38,819,218.65	50,075,824.33
其中:支付销售机构的客户维护费	4,124,522.46	6,248,201.66

注:支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5%÷当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

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

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

7.4.8.2.3 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

单位:人民币元

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

7.4.8.4 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

份额单位:份

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
报告期初持有的基金份额	95,457,385.41	91,996,189.89
报告期间申购/买入总份额	104,355,291.10	3,461,195.52
报告期间因拆分变动份额	-	-
减:报告期间赎回/卖出总份额	199,812,676.51	-
报告期末持有的基金份额	-	95,457,385.41
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	3.28%

注:1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务,则总申购份额中包含该业务;

2、如果本报告期间发生转换出业务,则总赎回份额中包含该业务。

7.4.8.4.2 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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	78,489,354.22	2,960,725.50	213,659,492.90	2,355,189.53

注:本基金的银行存款由基金托管人保管,按银行同业利率计息。

7.4.8.6 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(2016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
002838	道恩股份	2016-1-2-29	2017-0-1-06	新股网下申购	15.28	15.28	681	10,406.68	10,406.68	-
002840	华统股份	2016-1-2-29	2017-0-1-10	新股网下申购	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
601375	中原证券	2016-1-2-20	2017-0-1-03	新股网下申购	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-
603032	德新交运	2016-1-2-27	2017-0-1-05	新股网下申购	5.81	5.81	1,628	9,458.68	9,458.68	-
603035	常熟汽饰	2016-1-2-27	2017-0-1-05	新股网下申购	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	-
603186	华正新材	2016-1-2-26	2017-0-1-03	新股网下申购	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	-
603228	景旺电子	2016-1-2-28	2017-0-1-06	新股网下申购	23.16	23.16	3,491	80,851.56	80,851.56	-
603266	天龙股份	2016-1-2-30	2017-0-1-10	新股网下申购	14.63	14.63	1,562	22,852.06	22,852.06	-
603689	皖天然气	2016-1-2-30	2017-0-1-10	新股网下申购	7.87	7.87	4,818	37,917.66	37,917.66	-
603877	太平鸟	2016-1-2-29	2017-0-1-09	新股网下申购	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-
300586	美联新材	2016-1-2-29	2017-0-1-04	新股网下申购	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300587	天铁股份	2016-1-2-28	2017-0-1-05	新股网下申购	14.11	14.11	1,438	20,290.18	20,290.18	-
300588	熙菱信息	2016-1-2-27	2017-0-1-05	新股网下申购	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	-
300691	万里马	2016-1-2-30	2017-0-1-10	新股网下申购	3.07	3.07	2,397	7,358.79	7,358.79	-

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000829	天音控股	2016-09-29	重大事项	11.28	-	-	4,999,797	63,866,744.24	56,397,710.16	-
000921	京山轻机	2016-12-05	重大事项	15.34	-	-	4,999,875	76,926,757.68	76,698,082.50	-
002659	中泰桥梁	2016-11-03	重大事项	23.07	2017-01-06	19.60	4,975,442	95,153,841.61	114,783,446.94	-

注:本基金截至2016年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

7.4.9.3 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2016年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层次的余额为2,439,515,089.88元,属于第二层次的余额为418,036,185.33元,无属于第三层次的余额(2015年12月31日:第一层次2,206,091,582.57元,第二层次374,057,026.95元,无属于第三层次的余额)。

(iii)公允价值所属层次间的重大变动

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

如本财务报告7.4.5.2 部分所述,本基金交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债除外)本期采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值,相关固定收益品种的公允价值层次归入第二层次。

(iv) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(2) 除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,687,820,275.21	82.57
	其中:股票	2,687,820,275.21	82.57
2	固定收益投资	169,731,000.00	5.21
	其中:债券	169,731,000.00	5.21
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	299,507,809.26	9.20
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	91,434,882.46	2.81
7	其他各项资产	6,880,086.46	0.21
8	合计	3,255,374,053.39	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	40,371,378.88	1.25