

交银施罗德领先回报灵活配置混合型证券投资基金

2016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:招商银行股份有限公司

报告送出日期:二〇一七年三月二十九日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、董事会秘书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,并对其真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。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。

基金托管人招银银行股份有限公司以下简称“招银银行”),根据本基金合同规定,于2017年3月29日核对了本基金中的财务数据、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,保证复核结果不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人的董事、董事会秘书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,并对其真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。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。

基金托管人招银银行股份有限公司以下简称“招银银行”),根据本基金合同规定,于2017年3月29日核对了本基金中的财务数据、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,保证复核结果不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人保证以诚实信用、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。

基金管理人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。

本年度报告摘要摘录了年度报告正文,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9月13日起至2016年12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	交银施罗德领先回报灵活配置混合型证券投资基金
基金主代码	619781
交易代码	619781
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年09月13日
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人	招银银行股份有限公司
报告期基金资产净值	549,374,594.97
基金资产净值单位	人民币/份
基金资产净值单位净值	1.00

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金结合基金管理人对宏观经济和金融市场运行趋势的判断,在股票和债券资产之间合理配置,通过投资组合操作,力争在风险调整后收益上超越业绩基准。
投资策略	本基金将结合宏观经济、政策环境、证券市场整体运行情况,评估宏观经济形势,分析股票、债券等资产的预期收益和风险,在股票、债券资产之间进行配置。股票方面,本基金将结合宏观经济形势,分析股票的预期收益和风险,在股票、债券资产之间进行配置。债券方面,本基金将结合宏观经济形势,分析债券的预期收益和风险,在股票、债券资产之间进行配置。
业绩比较基准	100%×沪深300指数收益率+50%×中债综合全价指数收益率
风险收益特征	本基金是一只债券型基金,其风险和预期收益水平低于股票型基金,高于货币市场基金,属于中低风险收益的证券投资基金。
基金管理人和基金托管人	基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司;基金托管人:招商银行股份有限公司。

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	招银银行股份有限公司
姓名	孙晓燕 张勇	
信息披露义务人	(021)60590650 0706-63199994	
电子邮箱	exp@jzsf.com.cn dianxiao@jzsf.com.cn	yu_yang@cbocn.com
客户服务电话	400-700-53600 0706-63199994	95566
传真	(021)60590654	0706-63192021

2.4 信息披露方式

基金管理人通过基金业协会指定的互联网网站 www.hfund.com, www.jzsf.com.cn

基金管理人通过基金业协会指定的互联网网站 www.jzsf.com.cn

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

单位:人民币元

主要财务指标	2016年9月13日(基金合同生效日)至2016年12月31日
1.1 基金利润	1,277,099.00
1.2 本期利润	-813,817.12
1.3 本期基金份额净值增长	-0.0022
1.4 期末基金份额净值	0.00%
1.5 本期利润	2016年末
1.6 期末可供分配基金份额净值	0.0000
1.7 期末基金资产净值	649,374,594.97
1.8 期末可供分配基金份额净值	1.00

注:1.上述基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计价用后的实际收益水平要低于该列数字。

2.本年度报告所列示的正文中管理人对基金利润的本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益;

3.本基金合同生效日为2016年9月13日,基金合同生效日至本报告期末,本基金运作时间未满一年。

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

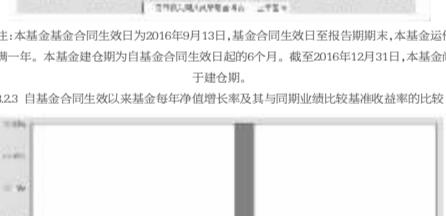


注:本基金的业绩比较基准为60%×沪深300指数收益率+50%×中债综合全价指数收益率。

每日进行再平衡计算。①

3.2.2 自基金合同生效以来基金每年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

单位:人民币元



注:本基金合同生效日为2016年9月13日,基金合同生效日至报告期末,本基金运作时间未满一年。本基金净值变动率为基金合同生效日起的9个月。截至2016年12月31日,本基金净值变动率为-0.21%。

3.3 主要会计数据和财务指标

单位:人民币元

项目	2016年9月13日(基金合同生效日)至2016年12月31日
1.1 本期利润	1,277,099.00
1.2 本期利润	-813,817.12
1.3 本期基金份额净值增长	-0.0022
1.4 期末基金份额净值	0.00%
1.5 本期利润	2016年末
1.6 期末可供分配基金份额净值	0.0000
1.7 期末基金资产净值	649,374,594.97
1.8 期末可供分配基金份额净值	1.00

注:1.本基金的业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计价用后的实际收益水平要低于该列数字。

2.本年度报告所列示的正文中管理人对基金利润的本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益;

3.本基金合同生效日为2016年9月13日,基金合同生效日至本报告期末,本基金运作时间未满一年。

3.4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理的情况

交银施罗德基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2008]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2006年8月14日,注册资本为人民币1亿元,其中,交通银行股份有限公司持有90%的股份,施罗德投资管理有限公司持有5%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,本公司管理人包括货币型、债券型、混合型、股票型、QDII等不同类型的基金。

4.2 基金经理的姓名及期间任职情况

本基金报告期内,基金管理人严格按照《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、法规的规定,勤勉尽责地履行自己的职责,并履行基金资产的管理职责。

4.3 管理人对报告期内公平交易制度和控制方法的专项说明

本公司建立了严格的投资决策和交易流程,保证不同投资组合在交易机会、交易定价、交易时机等方面获得平等对待,在公司内部严格实行公平交易制度。

4.4 管理人对报告期内内幕交易的专项说明

本公司在交易过程中,不存在内幕交易、利益输送或操纵市场等违法违规行为。

4.5 管理人对报告期内公平交易制度和控制方法的专项说明

本公司严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售行为规范》、《证券投资基金销售适用性管理办法》、《证券投资基金评价办法》等法律法规的规定,在投资决策、交易执行、业绩评估等环节,通过建立科学、严谨、有效的内部控制制度,加强内部控制,防范道德风险,保证公平交易。

4.6 管理人对报告期内合规经营情况的专项说明

本公司严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金销售行为规范》、《证券投资基金销售适用性管理办法》、《证券投资基金评价办法》等法律法规的规定,在投资决策、交易执行、业绩评估等环节,通过建立科学、严谨、有效的内部控制制度,加强内部控制,防范道德风险,保证公平交易。

4.7 管理人对报告期内风险管理情况的专项说明

本公司严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金销售行为规范》、《证券投资基金销售适用性管理办法》、《证券投资基金评价办法》等法律法规的规定,在投资决策、交易执行、业绩评估等环节,通过建立科学、严谨、有效的内部控制制度,加强内部控制,防范道德风险,保证公平交易。

4.8 管理人对报告期内合规管理情况的专项说明

本公司严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金销售行为规范》、《证券投资基金销售适用性管理办法》、《证券投资基金评价办法》等法律法规的规定,在投资决策、交易执行、业绩评估等环节,通过建立科学、严谨、有效的内部控制制度,加强内部控制,防范道德风险,保证公平交易。

4.9 管理人对报告期内公平交易制度和控制方法的专项说明

本公司严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金销售行为规范》、《证券投资基金销售适用性管理办法》、《证券投资基金评价办法》等法律法规的规定,在投资决策、交易执行、业绩评估等环节,通过建立科学、严谨、有效的内部控制制度,加强内部控制,防范道德风险,保证公平交易。

4.10 管理人对报告期内合规管理情况的专项说明

本公司严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金销售行为规范》、《证券投资基金销售适用性管理办法》、《证券投资基金评价办法》等法律法规的规定,在投资决策、交易执行、业绩评估等环节,通过建立科学、严谨、有效的内部控制制度,加强内部控制,防范道德风险,保证公平交易。

4.11 管理人对报告期内公平交易制度和控制方法的专项说明

本公司严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金销售行为规范》、《证券投资基金销售适用性管理办法》、《证券投资基金评价办法》等法律法规的规定,在投资决策、交易执行、业绩评估等环节,通过建立科学、严谨、有效的内部控制制度,加强内部控制,防范道德风险,保证公平交易。

4.12 管理人对报告期内内幕交易的专项说明

本公司严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金销售行为规范》、《证券投资基金销售适用性管理办法》、《证券投资基金评价办法》等法律法规的规定,在投资决策、交易执行、业绩评估等环节,通过建立科学、严谨、有效的内部控制制度,加强内部控制,防范道德风险,保证公平交易。

4.13 管理人对报告期内公平交易制度和控制方法的专项说明

本公司严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金销售行为规范》、《证券投资基金销售适用性管理办法》、《证券投资基金评价办法》等法律法规的规定,在投资决策、交易执行、业绩评估等环节,通过建立科学、严谨、有效的内部控制制度,加强内部控制,防范道德风险,保证公平交易。

4.14 管理人对报告期内风险管理情况的专项说明

本公司严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金销售行为规范》、《证券投资基金销售适用性管理办法》、《证券投资基金评价办法》等法律法规的规定,在投资决策、交易执行、业绩评估等环节,通过建立科学、严谨、有效的内部控制制度,加强内部控制,防范道德风险,保证公平交易。

4.15 管理人对报告期内公平交易制度和控制方法的专项说明

本公司严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金销售行为规范》、《证券投资基金销售适用性管理办法》、《证券投资基金评价办法》等法律法规的规定,在投资决策、交易执行、业绩评估等环节,通过建立科学、严谨、有效的内部控制制度,加强内部控制,防范道德风险,保证公平交易。

4.16 管理人对报告期内公平交易制度和控制方法的专项说明

本公司严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金销售行为规范》、《证券投资基金销售适用性管理办法》、《证券投资基金评价办法》等法律法规的规定,在投资决策、交易执行、业绩评估等环节,通过建立科学、严谨、有效的内部控制制度,加强内部控制,防范道德风险,保证公平交易。

4.17 管理人对报告期内公平交易制度和控制方法的专项说明

本公司严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金销售行为规范》、《证券投资基金销售适用性管理办法》、《证券投资基金评价办法》等法律法规的规定,在投资决策、交易执行、业绩评估等环节,通过建立科学、严谨、有效的内部控制制度,加强内部控制,防范道德风险,保证公平交易。