交银施罗德荣和保本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:中国民生银行股份有限公司

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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司(以下简称“民生银行”)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	交银荣和保本混合
基金主代码	519753
交易代码	519753
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年5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	中国民生银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,519,102,047.86份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在追求保本周期到期时本金安全的基础上,通过运用投资组合保险技术,力争实现组合资产的稳定增值。
投资策略	本基金运用恒定比例组合保险(CPPI,Constant Proportion Portfolio Insurance)原理,动态调整稳健资产与风险资产在基金组合中的投资比例,以确保本基金在保本周期到期时的本金安全,并实现基金资产在保本基础上的保值增值目的。
业绩比较基准	三年期银行定期存款税后收益率
风险收益特征	本基金是一只保本混合型基金,在证券投资基金中属于低风险品种。

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	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙艳	罗菲菲
	联系电话	(021)61055050	010-58560666
	电子邮箱	xxpl@jysld.com,disclosure@jysld.com	tgbfxjdzx@cmbc.com.cn
客户服务电话		400-700-5000,021-61055000	95568
传真		(021)61055054	010-58560798

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5月29日(基金合同生效日)至2015年12月31日
本期已实现收益	29,883,250.13	-66,601,317.80
本期利润	7,403,068.94	-53,210,065.32
加权平均基金份额本期利润	0.0043	-0.0274
本期基金份额净值增长率	0.31%	-2.60%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末	2015年末
期末可供分配基金份额利润	-0.023	-0.034
期末基金资产净值	1,483,825,231.53	1,833,047,176.67
期末基金份额净值	0.977	0.974

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。

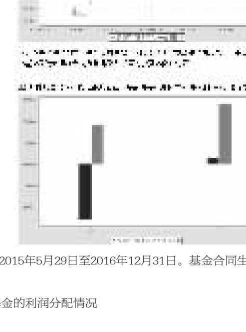
3.2 基金净值表现

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	-1.21%	0.12%	0.70%	0.01%	-1.91%	0.11%
过去六个月	-0.31%	0.10%	1.41%	0.01%	-1.72%	0.09%
过去一年	0.31%	0.09%	2.80%	0.01%	-2.49%	0.08%
自基金合同生效起至今	-2.30%	0.23%	4.64%	0.01%	-6.94%	0.22%

注:本基金的业绩比较基准为三年期银行定期存款税后收益率。

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:图示日期为2015年5月29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

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
2015	-	-	-	-	-
2016	-	-	-	-	-
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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
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、交银荣和保本混合的基金经理,公司权益投资总监	2015-11-07	-	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。
唐赟	交银信用添利债券(LOF)、交银双利债券、交银双轮动债券、交银荣和保本混合的基金经理	2015-11-07	-	4年	唐赟先生,香港城市大学电子工程硕士。历任渣打银行环球企业部助理客户经理、平安资产管理公司信用分析员。2012年加入交银施罗德基金管理有限公司,历任固定收益研究员、基金经理助理。
魏玉敏	交银信用添利债券(LOF)、交银双利债券、交银双轮动债券、交银荣和保本混合的基金经理助理	2016-12-20	-	4年	魏玉敏女士,厦门大学金融学硕士、学士。历任招商证券固定收益研究员,国信证券固定收益高级分析师。2016年加入交银施罗德基金管理有限公司。

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报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内,债券市场收益率在低位宽幅震荡,最终在2016年四季度受货币政策边际上收紧以及对金融去杠杆的担忧,债券长短端收益率都出现了明显的上行,全年来看收益率有较明显的上行。权益类资产则在经历2016年年初的大跌之后,呈现震荡格局。

本报告期内,本基金采取偏防御的策略,债券维持短久期底仓,并以长端利率波段操作收益增强。权益类资产维持在偏低仓位作为打新底仓,参与打新增强收益。

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0.977元,本报告期份额净值增长率为0.31%,同期业绩比较基准增长率为2.80%。

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,短期内经济及通胀在一季度有望继续反弹,叠加金融去杠杆及稳定汇率的需求,预计中短期货币政策转向继续放松的可能性不大,债券市场将受到基本面的压力。虽然经过2016年四季度的上行后,利率债收益率从长期来看已体现一定的配置价值,但短期内出现明显下行的概率不大。但略长期来看,货币政策的边际收紧将对实体经济产生影响,未来如果经济基本面下行风险再次出现,货币政策大概率将继续转向宽松,届时债券资产的机会有望再次出现。而未来主要的风险点在于PPI上涨向CPI传导,使得CPI中枢超出市场预期,以及去杠杆过程中可能的政策冲击。另外,虽然2016年四季度信用债的利差有一定上行,但仍处于历史地位,尤其是低等级信用债利差未能充分反应未来的信用风险。在信用利差有明显回升之前,我们对于低等级信用债仍然保持谨慎态度。

对于权益资产,我们认为目前市场仍未走出震荡盘整的态势,短期内依靠权益类资产为组合净值带来明显贡献的机会较小。但长期来看,我们看好未来在汇率和地产调控的风险阶段性地化解之后,权益类资产有望重拾强势。

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

本报告期内,本基金托管人在对交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定,依法安全保管了基金财产,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内,按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定,本托管人对本基金管理人—交银施罗德基金管理有限公司在交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金的投资运作方面进行了监督,对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金未进行利润分配。

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

由交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金管理人—交银施罗德基金管理有限公司编制,并经本托管人复核审查的本年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)对交银施罗德荣和保本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20193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:交银施罗德荣和保本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	46,599,531.38	5,522,872.14
结算备付金		5,123,440.06	4,723,445.22
存出保证金		70,522.99	722,976.25
交易性金融资产	7.4.7.2	2,107,643,479.51	1,748,982,684.27
其中:股票投资		37,272,479.51	29,091,200.27
基金投资		-	-
债券投资		2,070,371,000.00	1,719,891,484.00
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	-	44,900,000.00
应收证券清算款		-	17,660.19
应收利息	7.4.7.5	38,437,951.21	31,241,406.79
应收股利		-	-
应收申购款		-	223,806.93
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	300.00	-
资产总计		2,197,875,225.15	1,836,334,851.79
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		667,048,589.92	-
应付证券清算款		44,284,778.45	-
应付赎回款		184,847.79	465,319.60
应付管理人报酬		1,527,338.09	1,867,095.88
应付托管费		254,556.33	311,182.63
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	157,780.47	312,323.31
应交税费		-	-
应付利息		261,756.98	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	330,345.59	331,753.70
负债合计		714,049,993.62	3,287,675.12
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	1,519,102,047.86	1,882,548,970.48
未分配利润	7.4.7.10	-35,276,816.33	-49,501,793.81
所有者权益合计		1,483,825,231.53	1,833,047,176.67
负债和所有者权益总计		2,197,875,225.15	1,836,334,851.79

注:1、报告截止日2016年12月31日,基金份额净值0.977元,基金份额总额1,519,102,047.86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:交银施罗德荣和保本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5月29日(基金合同生效日)至2015年12月31日
一、收入		34,526,062.35	-33,526,867.48
1.利息收入		58,376,375.58	26,251,554.53
其中:存款利息收入	7.4.7.11	245,638.52	3,584,981.00
债券利息收入		52,111,092.20	18,674,713.05
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		6,019,644.86	3,991,860.48
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		-1,690,233.28	-73,391,787.23
其中:股票投资收益	7.4.7.12	20,478,133.21	-80,777,024.97
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-22,986,216.49	6,982,670.74
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	817,850.00	402,567.00
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.17	-22,480,181.19	13,391,252.48
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	320,101.24	222,112.74
减:二、费用		27,122,993.41	19,683,197.84
1. 管理人报酬		20,351,652.60	13,340,686.91
2. 托管费		3,391,942.03	2,223,447.72
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	649,269.81	3,062,406.79
5. 利息支出		2,353,307.24	716,276.72
其中:卖出回购金融资产支出		2,353,307.24	716,276.72
6. 其他费用	7.4.7.20	376,821.73	340,379.70
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		7,403,068.94	-53,210,065.32
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		7,403,068.94	-53,210,065.32

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:交银施罗德荣和保本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)	1,882,548,970.48	-49,501,793.81	1,833,047,176.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	7,403,068.94	7,403,068.94
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)	-363,446,922.62	6,821,908.54	-356,625,014.08
其中:1.基金申购款	20,656,739.41	-560,291.80	20,096,447.61
2.基金赎回款	-384,103,662.03	7,382,200.34	-376,721,461.69
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、期末所有者权益(基金净值)	1,519,102,047.86	-35,276,816.33	1,483,825,231.53
项目	上年度可比期间 2015年5月29日(基金合同生效日)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)	1,971,186,670.30	-	1,971,186,670.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-53,210,065.32	-53,210,065.32
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)	-88,637,699.82	3,708,271.51	-84,929,428.31
其中:1.基金申购款	18,151,312.51	-906,808.46	17,244,504.05
2.基金赎回款	-106,789,012.33	4,615,079.97	-102,173,932.36
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)	1,882,548,970.48	-49,501,793.81	1,833,047,176.67

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

交银施罗德荣和保本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[2015]879号文《关于准予交银施罗德荣和保本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《交银施罗德荣和保本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1,971,015,696.61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(2015)第637号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金基金合同》于2015年5月29日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,971,186,670.30份基金份额,其中认购资金利息折合170,973.69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,基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

根据《交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金基金合同》的有关约定,本基金的保本周期为三年。本基金第一个保本周期自本基金基金合同生效日起至三个公历年后对应日止。如该对应日为非工作日,保本周期到期日顺延至下一个工作日。本基金保本周期届满时,在符合保本基金存续条件下,本基金继续存续并转入下一保本周期。在不符合保本基金存续条件下,本基金将转型为“交银施罗德安心收益债券型证券投资基金”。本基金第一个保本周期由中国投融资担保有限公司作为担保人,为本基金第一个保本周期的保本提供不可撤销的连带责任保证。

本基金目前处于第一个保本周期,根据《交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,在本基金募集期内认购本基金的基金份额持有人持有本基金至当期保本周期到期的,如可赎回金额加上保本周期内的累计分红金额低于其认购金额(即认购保本金额,包括该等基金份额的净认购金额、认购费用以及募集期间的认购利息),基金管理人或保本义务人应补足该差额。但上述基金份额持有人未持有到期而赎回或转换出本基金的,赎回或转换出部分不适用保本条款;基金份额持有人在保本周期内申购或转换入的基金份额也不适用保本条款。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德荣和保本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、中期票据、货币市场工具、银行存款、权证、资产支持证券、股指期货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)。本基金将按照恒定比例组合保险机制将资产配置于稳健资产和风险资产。本基金的基金资产包括稳健资产和风险资产,稳健资产为国内依法发行交易的债券、货币市场工具和银行存款等,其中债券包括国债、金融债、央行票据、地方政府债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、可转换公司债券(含分离交易的可转换公司债券)、资产支持证券、债券回购等。风险资产为股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、股指期货等。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:债券、货币市场工具等稳健资产占基金资产的比例不低于60%,其中基金应保留不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券;股票、权证、股指期货等风险资产占基金资产的比例不高于40%,其中,基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%。本基金的业绩比较基准为三年期银行定期存款税后收益率。

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》、《交银施罗德荣和保本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需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[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。

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
中国民生银行股份有限公司(“中国民生银行”)	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5月29日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	20,351,652.60	13,340,686.91
其中:支付销售机构的客户维护费	9,647,897.37	6,331,944.26

注:支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值1.20%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×1.20%÷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5月29日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,391,942.03	2,223,447.72

注:支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.20%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×0.20%÷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 2016年1月1日至2016年12月31日 期末余额	当期利息收入	上年度可比期间 2015年5月29日(基金合同生效日)至2015年12月31日 期末余额	当期利息收入
中国民生银行	46,599,531.38	167,670.19	5,522,872.14	1,372,636.19

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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

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
000411	英特集团	2016-12-27	重大事项	22.10	2017-01-11	24.31	411,637	10,054,125.16	9,097,177.70	-
002659	中泰桥梁	2016-11-03	重大事项	23.07	2017-03-06	19.60	220,000	4,564,549.00	5,075,400.00	-
603986	兆易创新	2016-09-19	重大事项	177.97	2017-03-13	195.77	1,133	26,353.58	201,640.01	-

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

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2016年12月31日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额540,048,589.92元,是以如下债券作为抵押:

金额单位:人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
150309	15进出09	2017-01-09	100.63	1,500,000	150,945,000.00
150418	15农发18	2017-01-09	100.01	1,200,000	120,012,000.00
150306	15进出06	2017-01-09	101.39	700,000	70,973,000.00
111681340	16郑州银行CD130	2017-01-04	95.92	600,000	57,552,000.00
111681345	16江苏江南农村商业银行CD160	2017-01-04	95.88	600,000	57,528,000.00
140202	14国开02	2017-01-09	104.07	500,000	52,035,000.00
150406	15农发06	2017-01-09	100.38	300,000	30,114,000.00
111680970	16厦门银行CD168	2017-01-04	97.89	275,000	26,919,750.00
160208	16国开08	2017-01-09	98.36	245,000	24,098,200.00
合计				5,920,000	590,176,950.00

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2016年12月31日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额127,000,000.00元,于2017年1月3日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

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资产中属于第一层次的余额为22,898,261.80元,属于第二层次的余额为2,084,745,217.71元,无属于第三层次的余额。(2015年12月31日:第一层次23,203,600.27元,第二层次1,725,779,084.00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2016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(2015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	37,272,479.51	1.70
	其中:股票	37,272,479.51	1.70
2	固定收益投资	2,070,371,000.00	94.20
	其中:债券	2,070,371,000.00	94.20
	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	51,722,971.44	2.35
7	其他各项资产	38,508,774.20	1.75
8	合计	2,197,875,225.15	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	-	-
C	制造业	8,522,238.49	0.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	5,075,400.00	0.34
F	批发和零售业	9,097,177.70	0.61
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	5,126,000.00	0.35
J	金融业	-	-
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	9,451,663.32	0.64
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	37,272,479.51	2.51

8.2.2报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过沪港通投资的股票。

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	300347	泰格医药	349,932	9,451,663.32	0.64
2	000411	英特集团	411,637	9,097,177.70	0.61
3	002065	东华软件	220,000	5,126,000.00	0.35
4	002659	中泰桥梁	220,000	5,075,400.00	0.34
5	000423	东阿阿胶	85,983	4,631,904.21	0.31
6	001696	宗申动力	380,000	3,572,000.00	0.24
7	603986	兆易创新	1,133	201,640.01	0.01
8	002826	易明医药	2,181	57,316.68	0.00
9	300582	英飞特	1,359	35,157.33	0.00
10	002835	同为股份	1,126	24,220.26	0.00

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	600887	伊利股份	14,907,372.64	0.81
2	000786	北新建材	14,782,601.60	0.81
3	000423	东阿阿胶	14,108,276.30	0.77
4	000858	五 粮 液	12,373,577.00	0.68
5	000411	英特集团	10,054,125.16	0.55
6	601607	上海医药	10,028,083.34	0.55
7	600598	北大荒	9,411,369.00	0.51
8	300347	泰格医药	9,364,283.15	0.51
9	002582	好想你	9,017,633.00	0.49
10	002152	广电运通	8,549,051.33	0.47
11	603589	口子窖	8,453,922.25	0.46
12	600257	大湖股份	8,313,079.22	0.45
13	001696	宗申动力	7,741,565.99	0.42
14	000921	海信科龙	7,529,818.12	0.41
15	603808	歌力思	7,170,741.00	0.39
16	000333	美的集团	6,893,929.17	0.38
17	600519	贵州茅台	6,263,607.91	0.34
18	002065	东华软件	5,079,510.00	0.28
19	601939	建设银行	5,079,500.00	0.28
20	002659	中泰桥梁	4,564,549.00	0.25

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	600887	伊利股份	16,281,746.83	0.89
2	000786	北新建材	14,615,426.65	0.80
3	000858	五 粮 液	13,267,822.22	0.72
4	000568	泸州老窖	12,669,090.50	0.69
5	002582	好想你	9,988,046.60	0.54
6	601607	上海医药	9,744,844.06	0.53
7	000423	东阿阿胶	9,516,013.24	0.52
8	600598	北大荒	9,231,841.96	0.50
9	002152	广电运通	8,864,269.66	0.48
10	603589	口子窖	8,792,409.14	0.48
11	600257	大湖股份	8,759,872.00	0.48
12	000921	海信科龙	7,123,683.68	0.39
13	000333	美的集团	6,731,221.50	0.37
14	603808	歌力思	6,370,185.50	0.35
15	600519	贵州茅台	6,005,138.00	0.33
16	601939	建设银行	5,044,500.00	0.28
17	600067	冠城大通	4,333,684.00	0.24
18	600755	厦门国贸	4,288,671.33	0.23
19	001696	宗申动力	3,886,642.00	0.21
20	600565	迪马股份	3,870,000.00	0.21

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	195,426,090.73
卖出股票的收入(成交)总额	206,015,259.09

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	89,883,000.00	6.06
2	央行票据	-	-
3	金融债券	453,587,000.00	30.57
	其中:政策性金融债	453,587,000.00	30.57
4	企业债券	315,755,000.00	21.28
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	619,213,000.00	41.73
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	591,933,000.00	39.89
9	其他	-	-
10	合计	2,070,371,000.00	139.53

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	150309	15进出09	1,500,000	150,945,000.00	10.17
2	1180093	11丰国资债	1,300,000	132,964,000.00	8.96
3	150418	15农发18	1,200,000	120,012,000.00	8.09
4	101576002	15义国资运MTN001	1,000,000	101,160,000.00	6.82
5	111619193	16恒丰银行CD193	1,000,000	97,990,000.00	6.60

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	70,522.99
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	38,437,951.21
5	应收申购款	-
6	其他应收款	300.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	38,508,774.20

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000411	英特集团	9,097,177.70	0.61	重大事项
2	002659	中泰桥梁	5,075,400.00	0.34	重大事项
3	603986	兆易创新	201,640.01	0.01	重大事项

8.12.6 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。

§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)	户均持有的基金份额	持有人结构 机构投资者 持有份额	占总份额比例	个人投资者 持有份额	占总份额比例
8,332	182,321.42	-	-	1,519,102,047.86	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	4,926.56	0.00%

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(2015年5月29日)基金份额总额	1,971,186,670.30
本报告期期初基金份额总额	1,882,548,970.48
本报告期基金总申购份额	20,656,739.41
减:本报告期基金总赎回份额	384,103,662.03
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,519,102,047.86

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:本报告期内,经公司第四届董事会第九次会议审议通过,乔宏军先生不再担任公司副总经理职务。经公司第四届董事会第十四次会议审议通过,印皓女士担任公司副总经理。基金管理人就上述重大人事变动已按照相关规定向监管部门报告并履行了必要的信息披露程序。

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。

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90,000.00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

公司于2016年1月和10月接受来自上海证监局和中国证监会的现场检查,并于报告期内收到监管部门对公司相关负责人的警示。公司已认真落实整改要求,加强制度和风控措施,进一步提升了公司内部控制和风险管理能力,并向监管部门进行了报告。除上述情况外,报告期内管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
长江证券股份有限公司	2	401,441,349.82	100.00%	373,862.76	100.00%	-

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 成交金额	占当期债券成交总额的比例	回购交易 成交金额	占当期回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	占当期权证成交总额的比例
长江证券股份有限公司	219,390,153.52	100.00%	10,711,500,000.00	100.00%	-	-

注:1、报告期内,本基金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。

交银施罗德基金管理有限公司

二〇一七年三月二十九日