

## 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

## 2017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：中信银行股份有限公司  
报告送出日期：二〇一八年三月二十八日  
§ 重要提示

1.1 重要提示  
基金管理人的董事会、董事对本基金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。  
基金托管人中信银行股份有限公司以下简称“中信银行”根据基金合同规定，于2018年3月20日复函了本报告中的财务数据、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内，保证该报告内不存在虚假记载、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。  
基金经理过往业绩并不代表其未来表现。投资者有风险，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。

本年度报告摘要须自年度报告正文发布之日起，投资者欲详细了解内容，阅读年度报告全文。

本基金报告自2017年1月1日起至2017年12月31日。

§ 2 基金简介

基金名称	交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金
基金代码	619762
交易代码	619762
基金管理方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年1月1日
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	632,896,560.97份
基金合同的延续期	不定期
下属分级基金的基金简称	交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金
下属分级基金的交易代码	619762
报告期末下属分级基金的份额总额	632,896,417,99份
报告期末下属分级基金的份额总额	137,90份

2.1 基金基本情况

基金名称：交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

基金代码：619762

交易代码：619762

基金管理方式：契约型开放式

基金合同生效日：2015年1月1日

基金管理人：交银施罗德基金管理有限公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

报告期末基金份额总额：632,896,560.97份

基金合同的延续期：不定期

下属分级基金的基金简称：交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

下属分级基金的交易代码：619762

报告期末下属分级基金的份额总额：632,896,417,99份

报告期末下属分级基金的份额总额：137,90份

2.2 基金产品说明

本基金结合基金管理人对宏观经济周期和金融市场运行趋势的判断，目前，下而通过深入分析、自上而下地精选个股，通过行业配置、风格选择、个股精选、仓位控制等环节，力争实现超越基准的收益。

本基金主要投资于股票资产，投资比例不低于基金资产的80%，并保持不低于总资产5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券的流动性资产，以备支付基金赎回款。

业绩比较基准：50%×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：本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和货币市场基金，属于承销较高风险、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 中信银行股份有限公司

姓名 王鸿婷 陈修旗

信息披露负责人 联系电话 (021)61060050 4008800000

电子邮件 xxpl@jztc.com, dianxue00@jztc.com

客户服务电话 400-700-5000, 021-61060000 966988

传真 (021)61060054 010-85230024

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告的管理人互联网网址 www.fund001.com, www.jztcshareholder.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	2017年		2016年		2015年(基金成立日至2016年12月31日)	
	本期	本年期间	本期	本年期间	本期	本年期间
本期已实现收入	33,437.71	7,10	78,596.44	48,070.13	131,718.27	57,336.00
本期利润	67,790.18	18,04	47,095.86	86,900.00	156,374.77	8,161,242.00
期末可供分配利润	0.0971	0.0912	0.0215	0.0260	0.0242	0.0064
本年期间的基金净值增长率	9.75%	9.68%	13.04%	6.07%	20.09%	0.59%
本年期间的净利润	712,760.65	16,520.00	993,196.44	41,421.00	5,042,082.26	282,285.00
本年期间的净资本	1,126.10	1,110.00	1,012.00	1,026.00	1,026.00	1,026.00

注：1.本基金业绩指标不包括任何认购人或交易基金的其他费用，计入费用后的实际收益水平要低于不计费用的净值。

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

3.2.2 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.3 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.4 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.5 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.6 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.7 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.8 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.9 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.10 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.11 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.12 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.13 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.14 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.15 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.16 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.17 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.18 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.19 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.20 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.21 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.22 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.23 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.24 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.25 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.26 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.27 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.28 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.29 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.30 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.31 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.32 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.33 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.34 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.35 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.36 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.37 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.38 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.39 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.40 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.41 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.42 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.43 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.44 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.45 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.46 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.47 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.48 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.49 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.50 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.51 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.52 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.53 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.54 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.55 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.56 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.57 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.58 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.59 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.60 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.61 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.62 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.63 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.64 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.65 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.66 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.67 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金

3.2.68 交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金