

交银施罗德数据产业灵活配置混合型证券投资基金

2017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:二〇一八年三月二十八日

§ 1 重要提示

1.1 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2018年3月27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,应阅读年度报告全文。

本报告期自2017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	交银数据产业灵活配置混合
基金代码	659773
交易代码	659773
基金合同成立日	2016年1月16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
报告期基金总资产	981,406,056.00元
基金合同的生效日期	不适用

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于数据产业相关的股票,在严格控制风险的前提下,力争实现超越业绩基准的收益。
投资策略	本基金将通过深入研究数据产业的行业特征,在严格控制风险的前提下,精选具有投资价值的股票进行投资。本基金将通过深入研究数据产业的行业特征,精选具有投资价值的股票进行投资。
投资目标	本基金2017年未能超越业绩比较基准表现,主要受创业板成长类股票的整体配置原因所拖累。
4.42 报告期内基金的业绩表现	截至2017年12月31日,本基金份额净值为0.767元,本报告期份额净值增长率为-19.55%,同期业绩比较基准增长率为12.81%。
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2018年,我们预计风格切换将较为困难,更多是个股间性价比的比较,看涨在于成长性和估值的匹配度。本基金过去一直致力选择成长性的股票,从结果来看,所选择的大多数公司还是表现出较高的成长性。但在当前普遍估值较低的市场环境下表现不如价值股亮眼。虽然我们所选择的大部分公司有所下行,但是这些公司的业绩数据相当靓丽,现在这些具备真正成长性的个股已经和价值股站在同一起跑线,未来如果继续表现出较高的成长性,将会有突显的性价比,值得关注。
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	4.6.1 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、估值核算部等人员和固定收益、权益及基金经理组成。
4.6.2 公司严格按照新会计准则、证监会相关法规和基金合同关于估值的约定,对本基金估值的公公平、合理,保持估值政策和程序的一致性。估值委员会成员按投资品种的不同性质、研究并参考市场价格普遍认可的做法,建议合理的估值模型,进行测算和认可,以确保各估值委员会成员从基金会计、风险、合规等方面一致同意后,报公司投资总监、总经理批准。	4.6.3 估值委员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变化后,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,基金管理人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环节不存在任何重大利益冲突,截至报告期末未有任何外部估值定价服务机构的说明。
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	4.7.1 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	4.8.1 本基金本报告期内无预警情形说明。
5.1 报告期内本基金托管人遵规、守信情况说明	5.1.1 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《证券投资基金托管协议》等有关法律法规及基金合同的约定,对本基金基金管理人一交银施罗德基金管理有限公司2017年1月1日至2017年12月31日基金的运作情况,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持有人利益的行为。
5.1.2 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	5.1.2.1 本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率×60%+中证债券指数收益率×40%,每日进行再平衡。
5.2 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	5.2.1 本基金合同生效以来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
5.2.2 本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	5.2.2.1 本基金合同生效以来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
5.3 基金净值表现	5.3.1 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
5.3.2 基金份额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	5.3.2.1 本基金合同生效以来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
5.4 管理人报告	5.4.1 基金管理人及其管理基金的经验
5.4.2 基金管理人及其管理基金的经	5.4.2.1 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,注册资本为6亿元人民币。其中,交通银行股份有限公司持有56%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。公司下设交银施罗德基金管理(香港)有限公司和交银施罗德资产管理有限公司。
5.4.3 基金管理人公司治理情况	5.4.3.1 截至报告期末,公司管理的基金资产总规模为1,000.36亿元,基金持有人数为1,000户。
5.4.4 基金管理人对报告期内基金运作的监督情况	5.4.4.1 截至报告期末,公司对管理的基金资产运作情况进行了监督,对基金资产的管理符合基金合同的约定,没有损害基金持有人利益的行为。
5.4.5 基金管理人对基金年度报告的披露情况	5.4.5.1 本基金年度报告披露情况符合基金合同和法律法规的规定,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
5.4.6 基金管理人对基金年度报告中“基金业绩表现”部分的说明	5.4.6.1 本基金本年度报告中“基金业绩表现”部分的说明符合基金合同和法律法规的规定,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
5.4.7 基金管理人对基金年度报告中“基金持有人数或基金资产净值预警情形”部分的说明	5.4.7.1 本基金本报告期内无预警情形说明。
5.4.8 基金管理人对基金年度报告中“基金利润分配情况”部分的说明	5.4.8.1 本基金本报告期内未进行利润分配。
5.4.9 基金管理人对基金年度报告中“基金净值表现”部分的说明	5.4.9.1 本基金本年度报告中“基金净值表现”部分的说明符合基金合同和法律法规的规定,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
5.4.10 基金管理人对基金年度报告中“基金费用”部分的说明	5.4.10.1 本基金本年度报告中“基金费用”部分的说明符合基金合同和法律法规的规定,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
5.4.11 基金管理人对基金年度报告中“基金收益”部分的说明	5.4.11.1 本基金本年度报告中“基金收益”部分的说明符合基金合同和法律法规的规定,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
5.4.12 基金管理人对基金年度报告中“基金投资组合报告”部分的说明	5.4.12.1 本基金本年度报告中“基金投资组合报告”部分的说明符合基金合同和法律法规的规定,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
5.4.13 基金管理人对基金年度报告中“基金业绩表现”部分的说明	5.4.13.1 本基金本年度报告中“基金业绩表现”部分的说明符合基金合同和法律法规的规定,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
5.4.14 基金管理人对基金年度报告中“基金持有人数或基金资产净值预警情形”部分的说明	5.4.14.1 本基金本年度报告中“基金持有人数或基金资产净值预警情形”部分的说明符合基金合同和法律法规的规定,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
5.4.15 基金管理人对基金年度报告中“基金利润分配情况”部分的说明	5.4.15.1 本基金本年度报告中“基金利润分配情况”部分的说明符合基金合同和法律法规的规定,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
5.4.16 基金管理人对基金年度报告中“基金净值表现”部分的说明	5.4.16.1 本基金本年度报告中“基金净值表现”部分的说明符合基金合同和法律法规的规定,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
5.4.17 基金管理人对基金年度报告中“基金费用”部分的说明	5.4.17.1 本基金本年度报告中“基金费用”部分的说明符合基金合同和法律法规的规定,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
5.4.18 基金管理人对基金年度报告中“基金收益”部分的说明	5.4.18.1 本基金本年度报告中“基金收益”部分的说明符合基金合同和法律法规的规定,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
5.4.19 基金管理人对基金年度报告中“基金投资组合报告”部分的说明	5.4.19.1 本基金本年度报告中“基金投资组合报告”部分的说明符合基金合同和法律法规的规定,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
5.4.20 基金管理人对基金年度报告中“基金业绩表现”部分的说明	5.4.20.1 本基金本年度报告中“基金业绩表现”部分的说明符合基金合同和法律法规的规定,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
5.4.21 基金管理人对基金年度报告中“基金持有人数或基金资产净值预警情形”部分的说明	5.4.21.1 本基金本年度报告中“基金持有人数或基金资产净值预警情形”部分的说明符合基金合同和法律法规的规定,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
5.4.22 基金管理人对基金年度报告中“基金利润分配情况”部分的说明	5.4.22.1 本基金本年度报告中“基金利润分配情况”部分的说明符合基金合同和法律法规的规定,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
5.4.23 基金管理人对基金年度报告中“基金净值表现”部分的说明	5.4.23.1 本基金本年度报告中“基金净值表现”部分的说明符合基金合同和法律法规的规定,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
5.4.24 基金管理人对基金年度报告中“基金费用”部分的说明	5.4.24.1 本基金本年度报告中“基金费用”部分的说明符合基金合同和法律法规的规定,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
5.4.25 基金管理人对基金年度报告中“基金收益”部分的说明	5.4.25.1 本基金本年度报告中“基金收益”部分的说明符合基金合同和法律法规的规定,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
5.4.26 基金管理人对基金年度报告中“基金投资组合报告”部分的说明	5.4.26.1 本基金本年度报告中“基金投资组合报告”部分的说明符合基金合同和法律法规的规定,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
5.4.27 基金管理人对基金年度报告中“基金业绩表现”部分的说明	5.4.27.1 本基金本年度报告中“基金业绩表现”部分的说明符合基金合同和法律法规的规定,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
5.4.28 基金管理人对基金年度报告中“基金持有人数或基金资产净值预警情形”部分的说明	5.4.28.1 本基金本年度报告中“基金持有人数或基金资产净值预警情形”部分的说明符合基金合同和法律法规的规定,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
5.4.29 基金管理人对基金年度报告中“基金利润分配情况”部分的说明	5.4.29.1 本基金本年度报告中“基金利润分配情况”部分的说明符合基金合同和法律法规的规定,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
5.4.30 基金管理人对基金年度报告中“基金净值表现”部分的说明	5.4.30.1 本基金本年度报告中“基金净值表现”部分的说明符合基金合同和法律法规的规定,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
5.4.31 基金管理人对基金年度报告中“基金费用”部分的说明	5.4.31.1 本基金本年度报告中“基金费用”部分的说明符合基金合同和法律法规的规定,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
5.4.32 基金管理人对基金年度报告中“基金收益”部分的说明	5.4.32.1 本基金本年度报告中“基金收益”部分的说明符合基金合同和法律法规的规定,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
5.4.33 基金管理人对基金年度报告中“基金投资组合报告”部分的说明	5.4.33.1 本基金本年度报告中“基金投资组合报告”部分的说明符合基金合同和法律法规的规定,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
5.4.34 基金管理人对基金年度报告中“基金业绩表现”部分的说明	5.4.34.1 本基金本年度报告中“基金业绩表现”部分的说明符合基金合同和法律法规的规定,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
5.4.35 基金管理人对基金年度报告中“基金持有人数或基金资产净值预警情形”部分的说明	5.4.35.1 本基金本年度报告中“基金持有人数或基金资产净值预警情形”部分的说明符合基金合同和法律法规的规定,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
5.4.36 基金管理人对基金年度报告中“基金利润分配情况”部分的说明	5.4.36.1 本基金本年度报告中“基金利润分配情况”部分的说明符合基金合同和法律法规的规定,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
5.4.37 基金管理人对基金年度报告中“基金净值表现”部分的说明	5.4.37.1 本基金本年度报告中“基金净值表现”部分的说明符合基金合同和法律法规的规定,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
5.4.38 基金管理人对基金年度报告中“基金费用”部分的说明	5.4.38.1 本基金本年度报告中“基金费用”部分的说明符合基金合同和法律法规的规定,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
5.4.39 基金管理人对基金年度报告中“基金收益”部分的说明	5.4.39.1 本基金本年度报告中“基金收益”部分的说明符合基金合同和法律法规的规定,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
5.4.40 基金管理人对基金年度报告中“基金投资组合报告”部分的说明	5.4.40.1 本基金本年度报告中“基金投资组合报告”部分的说明符合基金合同和法律法规的规定,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
5.4.41 基金管理人对基金年度报告中“基金业绩表现”部分的说明	5.4.41.1 本基金本年度报告中“基金业绩表现”部分的说明符合基金合同和法律法规的规定,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
5.4.42 基金管理人对基金年度报告中“基金持有人数或基金资产净值预警情形”部分的说明	5.4.42.1 本基金本年度报告中“基金持有人数或基金资产净值预警情形”部分的说明符合基金合同和法律法规的规定,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
5.4.43 基金管理人对基金年度报告中“基金利润分配情况”部分的说明	5.4.43.1 本基金本年度报告中“基金利润分配情况”部分的说明符合基金合同和法律法规的规定,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
5.4.44 基金管理人对基金年度报告中“基金净值表现”部分的说明	5.4.44.1 本基金本年度报告中“基金净值表现”部分的说明符合基金合同和法律法规的规定,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
5.4.45 基金管理人对基金年度报告中“基金费用”部分的说明	5.4.45.1 本基金本年度报告中“基金费用”部分的说明符合基金合同和法律法规的规定,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
5.4.46 基金管理人对基金年度报告中“基金收益”部分的说明	5.4.46.1 本基金本年度报告中“基金收益”部分的说明符合基金合同和法律法规的规定,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
5.4.47 基金管理人对基金年度报告中“基金投资组合报告”部分的说明	5.4.47.1 本基金本年度报告中“基金投资组合报告”部分的说明符合基金合同和法律法规的规定,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
5.4.48 基金管理人对基金年度报告中“基金业绩表现”部分的说明	5.4.48.1 本基金本年度报告中“基金业绩表现”部分的说明符合基金合同和法律法规的规定,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
5.4.49 基金管理人对基金年度报告中“基金持有人数或基金资产净值预警情形”部分的说明	5.4.49.1 本基金本年度报告中“基金持有人数或基金资产净值预警情形”部分的说明符合基金合同和法律法规的规定,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
5.4.50 基金管理人对基金年度报告中“基金利润分配情况”部分的说明	5.4.50.1 本基金本年度报告中“基金利润分配情况”部分的说明符合基金合同和法律法规的规定,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
5.4.51 基金管理人对基金年度报告中“基金净值表现”部分的说明	5.4.51.1 本基金本年度报告中“基金净值表现”部分的说明符合基金合同和法律法规的规定,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
5.4.52 基金管理人对基金年度报告中“基金费用”部分的说明	5.4.52.1 本基金本年度报告中“基金费用”部分的说明符合基金合同和法律法规的规定,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
5.4.53 基金管理人对基金年度报告中“基金收益”部分的说明	5.4.53.1 本基金本年度报告中“基金收益”部分的说明符合基金合同和法律法规的规定,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
5.4.54 基金管理人对基金年度报告中“基金投资组合报告”部分的说明	5.4.54.1 本基金本年度报告中“基金投资组合报告”部分的说明符合基金合同和法律法规的规定,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
5.4.55 基金管理人对基金年度报告中“基金业绩表现”部分的说明	5.4.55.1 本基金本年度报告中“基金业绩表现”部分的说明符合基金合同和法律法规的规定,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
5.4.56 基金管理人对基金年度报告中“基金持有人数或基金资产净值预警情形”部分的说明	5.4.56.1 本基金本年度报告中“基金持有人数或基金资产净值预警情形”部分的说明符合基金合同和法律法规的规定,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
5.4.57 基金管理人对基金年度报告中“基金利润分配情况”部分的说明	5.4.57.1 本基金本年度报告中“基金利润分配情况”部分的说明符合基金合同和法律法规的规定,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
5.4.58 基金管理人对基金年度报告中“基金净值表现”部分的说明	5.4.58.1 本基金本年度报告中“基金净值表现”部分的说明符合基金合同和法律法规的规定,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
5.4.59 基金管理人对基金年度报告中“基金费用”部分的说明	5.4.59.1 本基金本年度报告中“基金费用”部分的说明符合基金合同和法律法规的规定,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
5.4.60 基金管理人对基金年度报告中“基金收益”部分的说明	5.4.60.1 本基金本年度报告中“基金收益”部分的说明符合基金合同和法律法规的规定,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
5.4.61 基金管理人对基金年度报告中“基金投资组合报告”部分的说明	5.4.61.1 本基金本年度报告中“基金投资组合报告”部分的说明符合基金合同和法律法规的规定,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
5.4.62 基金管理人对基金年度报告中“基金业绩表现”部分的说明	5.4.62.1 本基金本年度报告中“基金业绩表现”部分的说明符合基金合同和法律法规的规定,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
5.4.63 基金管理人对基金年度报告中“基金持有人数或基金资产净值预警情形”部分的说明	5.4.63.1 本基金本年度报告中“基金持有人数或基金资产净值预警情形”部分的说明符合基金合同和法律法规的规定,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。</