

**交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金**  
**2016 年年度报告摘要**  
**2016 年 12 月 31 日**

基金管理人：交银施罗德基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司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	交银中证互联网金融指数分级		
场内简称	E 金融		
基金主代码	164907		
交易代码	164907		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015 年 6 月 26 日		
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司		
基金托管人	中国建设银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	151,834,196.99 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2015 年 7 月 8 日		
下属分级基金的基金简称	E 金融	E 金融 A	E 金融 B
下属分级基金的场内简称	E 金融	E 金融 A	E 金融 B
下属分级基金的交易代码	164907	150317	150318
报告期末下属分级基金的份额总额	141,626,408.99 份	5,103,894.00 份	5,103,894.00 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。本基金力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。		
投资策略	本基金为指数型基金，绝大部分资产采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数，即按照中证互联网金融指数中的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致成份股流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。		
业绩比较基准	中证互联网金融指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%		
风险收益特征	本基金是一只股票型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于承担较高预期风险、预期收益较高的证券投资基金品种。本基金采取了基金份额分级的结构设计，不同的基金份额具有不同的风险收益特征。本基金共有三类份额，其中交银互联网金融份额具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征；交银互联网金融 A 份额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征；交银互联网金融 B 份额具有高预期风险、高预期收益的特征。		
下属分级基金的风险收益特征	交银 E 金融份额具有与标的指数、以及标的指	交银 E 金融 A 份额具有低预期风险、预期收益	交银 E 金融 B 份额具有高预期风险、高预期收

	数所代表的股票市场相似的风险收益特征	相对稳定的特征	益的特征
--	--------------------	---------	------

### 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙艳	田青
	联系电话	(021) 61055050	010-67595096
	电子邮箱	xxpl@jysld.com, disclosure@jysld.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-700-5000, 021-61055000	010-67595096
传真		(021) 61055054	010-66275853

### 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告摘要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 6 月 26 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-21,311,267.06	-18,550,213.05
本期利润	-73,299,628.15	-18,039,993.89
加权平均基金份额本期利润	-0.3921	-0.0509
本期基金份额净值增长率	-24.72%	-8.70%
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	-0.485	-0.087
期末基金资产净值	161,653,634.64	301,357,003.80

期末基金份额净值	1.065	0.913
----------	-------	-------

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	-2.11%	0.98%	-2.12%	0.99%	0.01%	-0.01%
过去六个月	-6.99%	1.06%	-6.73%	1.07%	-0.26%	-0.01%
过去一年	-24.72%	2.11%	-24.30%	1.95%	-0.42%	0.16%
自基金合同生效起至今	-31.27%	2.47%	-40.55%	2.50%	9.28%	-0.03%

注：本基金业绩比较基准为中证互联网金融指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%，每日进行再平衡过程。

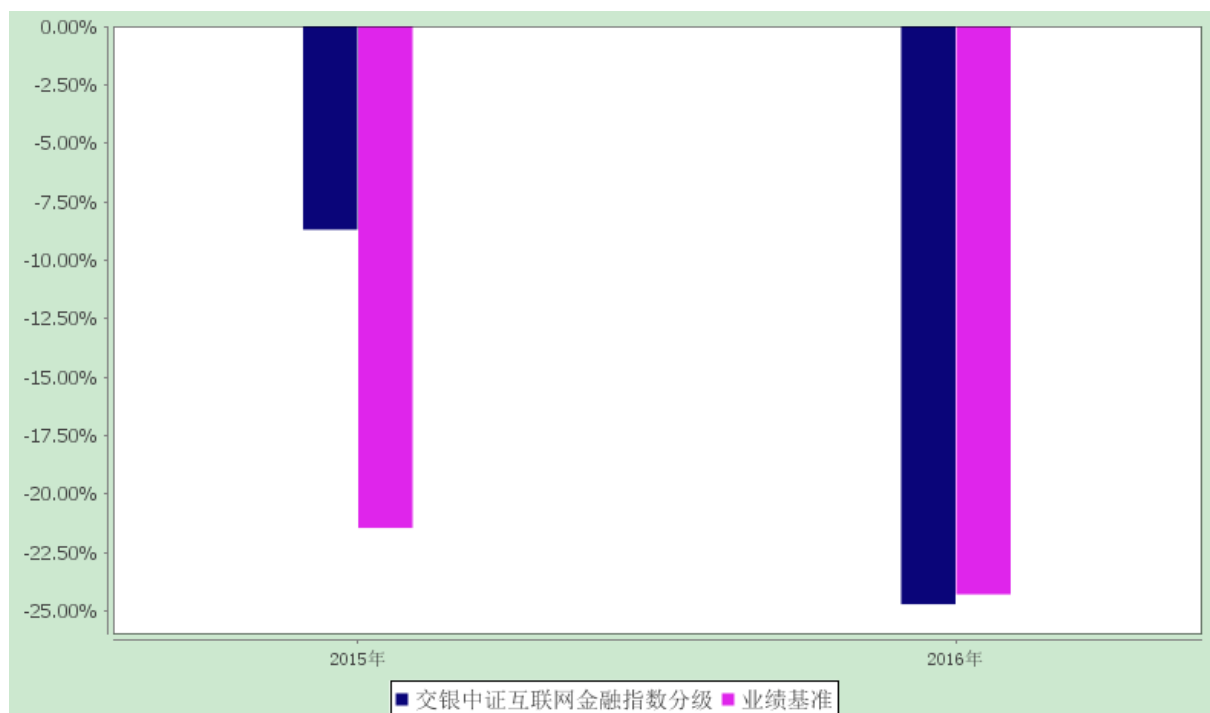
#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
 (2015年6月26日至2016年12月31日)



注：本基金建仓期为自基金合同生效日起的 6 个月。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

### 3.2.3 自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



注：图示日期为 2015 年 6 月 26 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
2016年	-	-	-	-	-
2015年	-	-	-	-	-
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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
蔡铮	交银环球精选混合(QDII)、交银上证180公司治理ETF及其联接、交银深证300价值ETF及其联接、交银全球资源混合(QDII)、交银	2015-06-26	-	7年	蔡铮先生，中国国籍，复旦大学电子工程硕士。历任瑞士银行香港分行分析员。2009年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任投资研究部数量分析师、基金经理助理、量化投资部助理总经理。2012年12月27日至2015年6月30日担任交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金基金经理。2015年8月13日至

	国证新能源指数分级、交银中证海外中国互联网指数（QDII-LOF）、交银中证互联网金融指数分级、交银中证环境治理指数（LOF）的基金经理，公司量化投资部副总经理			2016年7月18日担任交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金基金经理。
--	----------------------------------------------------------------------------------	--	--	----------------------------------------

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

2016 年国内经济增速仍呈现弱企稳的态势，内需疲软，面临一定的不确定性，经济基本面对资本市场的支持力度较为有限。A 股市场在上半年表现出大幅向下后盘整震荡的格局，1 月份市场在

熔断机制的磁吸效应的影响下、在人民币贬值风险的担忧中大幅快速下跌，此后 2、3 月份随着人民币汇率企稳、银行信贷投入加大、经济数据有所好转等利好因素，市场总体表现出震荡格局。4-6 月份随着美元加息预期的反复、英国脱欧事件以及国内局部流动性和信用违约等宏观风险的释放，整体市场的风险偏好有所修复。第三季度工业增加值和 PPI 继续回落，经济增长和企业盈利下行压力较大，同时货币政策延续宽松。随着监管层扩大清理配资范围以及人民币贬值影响，市场出现大幅下跌。进入到 10 月、11 月，市场整体表现较强，行至 12 月初房地产结构性调控政策、部分金融领域去杠杆引发了一定短期流动性风险，并对债券市场产生一定扰动，A 股市场随之出现一定程度的调整。作为跟踪中证互联网金融指数的指数基金，在 2016 年度总体呈现出快速下挫后震荡上行的走势。

#### 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 1.065 元，本报告期份额净值增长率为-24.72%，同期业绩比较基准增长率为-24.30%。

#### 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，国内经济已有所企稳，处于阶段性弱复苏期间，预计将继续维持温和增长的态势。我们对经历了调整后的 A 股市场总体维持乐观的看法。

#### 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其适用性的情况后，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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 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

本托管人复核审查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。

### §6 审计报告

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）对交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金 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 20146 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：交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	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	9,192,088.84	18,962,620.60
结算备付金	-	288,646.96
存出保证金	6,529.05	200,469.19
交易性金融资产	153,275,517.86	285,149,374.40
其中：股票投资	153,275,517.86	285,149,374.40
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	2,393.77	4,117.16
应收股利	-	-
应收申购款	6,462.26	48,247.49
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
<b>资产总计</b>	<b>162,482,991.78</b>	<b>304,653,475.80</b>
负债和所有者权益	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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	436,444.20	2,203,930.13
应付管理人报酬	143,792.79	277,151.30
应付托管费	31,634.43	60,973.26
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	46,476.24	446,111.04
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	171,009.48	308,306.27
<b>负债合计</b>	<b>829,357.14</b>	<b>3,296,472.00</b>
<b>所有者权益：</b>	-	-
实收基金	235,239,773.02	330,206,889.63
未分配利润	-73,586,138.38	-28,849,885.83
<b>所有者权益合计</b>	<b>161,653,634.64</b>	<b>301,357,003.80</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>162,482,991.78</b>	<b>304,653,475.80</b>

注：1、报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额总额 151,834,196.99 份，其中交银互联网金融份额净值 1.065 元，基金份额 141,626,408.99 份；交银互联网金融 A 份额参考净值 1.051 元，基金份额 5,103,894.00 份；交银互联网金融 B 份额参考净值 1.079 元，基金份额 5,103,894.00 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：交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金

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	上年度可比期间 2015 年 6 月 26 日（基金合 同生效日）至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	<b>-70,289,770.30</b>	<b>-14,578,632.87</b>
1.利息收入	87,558.87	297,260.05
其中：存款利息收入	87,558.87	297,260.05
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-18,508,372.95	-15,955,956.98
其中：股票投资收益	-20,175,476.47	-16,075,415.38
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	1,667,103.52	119,458.40
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-51,988,361.09	510,219.16
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	119,404.87	569,844.90
<b>减：二、费用</b>	<b>3,009,857.85</b>	<b>3,461,361.02</b>
1. 管理人报酬	1,962,693.55	1,586,691.07
2. 托管费	431,792.64	349,072.09
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	232,419.36	1,109,413.13
5. 利息支出	-	-

其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	382,952.30	416,184.73
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>-73,299,628.15</b>	<b>-18,039,993.89</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>-73,299,628.15</b>	<b>-18,039,993.89</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金

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）	330,206,889.63	-28,849,885.83	301,357,003.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-73,299,628.15	-73,299,628.15
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）	-94,967,116.61	28,563,375.60	-66,403,741.01
其中：1.基金申购款	55,033,872.51	-15,492,322.63	39,541,549.88
2.基金赎回款	-150,000,989.12	44,055,698.23	-105,945,290.89
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）	235,239,773.02	-73,586,138.38	161,653,634.64

项目	上年度可比期间		
	2015 年 6 月 26 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）	441,570,114.09	-	441,570,114.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-18,039,993.89	-18,039,993.89
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）	-111,363,224.46	-10,809,891.94	-122,173,116.40
其中：1.基金申购款	375,369,501.41	-54,420,190.89	320,949,310.52
2.基金赎回款	-486,732,725.87	43,610,298.95	-443,122,426.92
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）	330,206,889.63	-28,849,885.83	301,357,003.80

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

交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金(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]941 号文《关于准予交银施罗德中证互联网金融指数分级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《交银施罗德中证互联网金融指数分级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 441,524,789.06 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 750 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金基金合同》于 2015 年 6 月 26 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 441,570,114.09 份基金份额，其中认购资金利息折合 45,325.03 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金基金合同》的相关规定，本基金的基金份额包括交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金之基础份额(以下简称“交银互联网金融份额”)、稳健收益类份额(以下简称“交银互联网金融 A 份额”)与积极收益类份额(以下简称“交银互联网金融 B 份额”)。本基金通过场外、场内两种方式公开发售交银互联网金融份额。投资人场外认购所得的交银互联网金融份额，不进行自动分离或分拆。投资人场内认购所得的交银互联网金融份额，将按 1:1 的基金份额配比自动分离为交银互联网金融 A 份额和交银互联网金融 B 份额。交银互联网金融 A 份额和交银互联网金融 B 份额的数量保持 1:1 的比例不变。基金合同生效后，交银互联网金融份额将根据基金合同约定分别开放场外和场内申购、赎回，但是不进行上市交易。在满足上市条件的情况下，交银互联网金融 A 份额和交银互联网金融 B 份额将申请上市交易但是不开放申购和赎回等业务。场内交银互联网金融份额与交银互联网金融 A 份额和交银互联网金融 B 份额之间可以按照约定的规则进行场内份额的配对转换，包括分拆与合并。分拆指基金份额持有人将其持有的每 2 份场内交银互联网金融份额按照 1:1 的份额配比转换成 1 份交银互联网金融 A 份额与 1 份交银互联网金融 B 份额的行为。合并指基金份额持有人将其持有的每 1 份交银互联网金融 A 份额与 1 份交银互联网金融 B 份额按照 1:1 的基金份额配比转换成 2 份场内交银互联网金融份额的行为。

基金份额的净值按如下原则计算：交银互联网金融份额的基金份额净值为净值计算日的基金资产净值除以基金份额总数，其中基金份额总数为交银互联网金融份额、交银互联网金融 A 份额和交银互联网金融 B 份额数量的总和。本基金每份交银互联网金融 A 份额与每份交银互联网金融 B 份额构成一对份额组合，该份额组合的基金份额参考净值之和等于 2 份交银互联网金融份额的基金份额净值之和。交银互联网金融 A 份额的约定收益率为同期中国人民银行公布的金融机构人民币一年期定期存款利率(税后)+4%，交银互联网金融 A 份额的份额参考净值每日按该约定收益率逐日计算，计算出交银互联网金融 A 份额的基金份额参考净值后，根据交银互联网金融份额的基金份额净值与交银互联网金融 A 份额、交银互联网金融 B 份额之间的基金份额参考净值关系，可以计算出交银互联网金融 B 份额的基金份额参考净值。

本基金进行定期份额折算。在本基金存续期内每个会计年度(除基金合同生效日所在会计年度外)的第一个工作日,本基金将进行基金的定期份额折算:定期份额折算后交银互联网金融 A 份额的基金份额参考净值调整为 1.000 元,基金份额折算基准日折算前交银互联网金融 A 份额的基金份额参考净值超出 1.000 元的部分将折算为场内交银互联网金融份额分配给交银互联网金融 A 份额持有人。交银互联网金融份额持有人持有的每 2 份交银互联网金融份额将按 1 份交银互联网金融 A 份额获得新增交银互联网金融份额的分配。持有场外交银互联网金融份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外交银互联网金融份额的分配;持有场内交银互联网金融份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内交银互联网金融份额的分配。经过上述份额折算后,交银互联网金融份额的基金份额净值将相应调整。在基金份额折算前与折算后,交银互联网金融 A 份额和交银互联网金融 B 份额的份额配比保持 1:1 的比例。交银互联网金融 B 份额不参与定期份额折算,每次定期份额折算不改变交银互联网金融 B 份额的基金份额参考净值及其份额数。

除以上的定期份额折算外,当交银互联网金融份额的基金份额净值大于或等于 1.500 元时,或当交银互联网金融 B 份额的基金份额参考净值小于或等于 0.250 元时,基金管理人可根据市场情况确定不定期折算基准日,进行不定期份额折算:份额折算后本基金将确保交银互联网金融 A 份额和交银互联网金融 B 份额的比例为 1:1,份额折算后交银互联网金融 A 份额的基金份额参考净值、交银互联网金融 B 份额的基金份额参考净值和交银互联网金融份额的基金份额净值均调整为 1.000 元。当交银互联网金融份额的基金份额净值大于或等于 1.500 元时,基金份额折算基准日折算前交银互联网金融份额的基金份额净值及交银互联网金融 A 份额、交银互联网金融 B 份额的基金份额参考净值超出 1.000 元的部分均将折算为交银互联网金融份额分别分配给交银互联网金融份额、交银互联网金融 A 份额和交银互联网金融 B 份额的持有人。当交银互联网金融 B 份额的基金份额参考净值小于或等于 0.250 元时,交银互联网金融份额、交银互联网金融 A 份额和交银互联网金融 B 份额的份额数将相应缩减。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2015]第 331 号文审核同意,本基金交银互联网金融 A 份额(150317)59,000,681.00 份基金份额和交银互联网金融 B 份额(150318) 59,000,681.00 份基金份额于 2015 年 7 月 8 日在深交所挂牌交易。对于托管在场内的交银互联网金融份额,基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下,将其分拆为交银互联网金融 A 份额和交银互联网金融 B 份额即可上市流通;对于托管在场外的交银互联网金融份额,基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下,将其跨系统转托管至深圳证券交易所场内后分拆为交银互联网金融 A 份额和交银互联网金融 B 份额即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基

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，以中证互联网金融指数的成份股及其备选成份股(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准的上市股票)为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于其他股票(非标的指数成份股及其备选成份股)、债券、中期票据、货币市场工具、债券回购、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)。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：股票资产投资比例不低于基金资产的 90%，本基金投资于中证互联网金融指数的成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 90%，投资于权证的比例不得超过基金资产净值的 3%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金以后，持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为中证互联网金融指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

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》、《交银施罗德中证互联网金融指数分级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

中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	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6月26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	1,962,693.55	1,586,691.07
其中：支付销售机构的客户维护费	770,899.26	581,636.41

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00% 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 × 1.00% ÷ 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6月26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	431,792.64	349,072.09

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.22% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.22\% \div \text{当年天数。}$$

#### 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		上年度可比期间 2015年6月26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	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	9,192,088.84	85,791.08	18,962,620.60	289,784.49

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	复牌开盘单盘价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300104	乐视网	2016-12-07	重大事项	35.80	2017-01-16	36.88	89,562	4,941,897.89	3,206,319.60	

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。

#### 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 150,069,198.26 元，属于第二层次的余额为 3,206,319.60 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 256,676,706.28 元，第二层次 28,472,668.12 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	153,275,517.86	94.33
	其中:股票	153,275,517.86	94.33
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	9,192,088.84	5.66



7	其他各项资产	15,385.08	0.01
8	合计	162,482,991.78	100.00

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

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	31,299,016.30	19.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	4,883,425.00	3.02
G	交通运输、仓储和邮政业	853,200.00	0.53
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	55,346,798.35	34.24
J	金融业	44,534,683.31	27.55
K	房地产业	8,049,999.20	4.98
L	租赁和商务服务业	8,308,395.70	5.14
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	153,275,517.86	94.82

### 8.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

### 8.2.3 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

### 8.3.1 期末指数投资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	000712	锦龙股份	216,500	5,074,760.00	3.14
2	601318	中国平安	137,900	4,885,797.00	3.02
3	002024	苏宁云商	426,500	4,883,425.00	3.02
4	601555	东吴证券	363,023	4,817,315.21	2.98
5	000001	平安银行	528,400	4,808,440.00	2.97
6	600109	国金证券	368,158	4,797,098.74	2.97
7	601166	兴业银行	295,600	4,770,984.00	2.95
8	600177	雅戈尔	341,200	4,769,976.00	2.95
9	601998	中信银行	743,846	4,768,052.86	2.95
10	000627	天茂集团	616,110	4,713,241.50	2.92

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。

### 8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

## 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	000609	绵石投资	5,048,396.05	1.68

2	600599	熊猫金控	4,613,105.00	1.53
3	002797	第一创业	4,573,274.00	1.52
4	002285	世联行	3,636,193.70	1.21
5	000712	锦龙股份	2,785,443.02	0.92
6	600870	厦华电子	2,367,821.00	0.79
7	000627	天茂集团	2,366,084.44	0.79
8	300178	腾邦国际	2,325,469.30	0.77
9	300059	东方财富	1,301,484.00	0.43
10	300377	赢时胜	1,091,893.00	0.36
11	002261	拓维信息	806,606.00	0.27
12	600588	用友网络	616,514.06	0.20
13	600271	航天信息	601,049.00	0.20
14	600570	恒生电子	576,918.00	0.19
15	002657	中科金财	483,868.00	0.16
16	601998	中信银行	482,803.00	0.16
17	002183	怡亚通	457,641.00	0.15
18	600177	雅戈尔	285,175.00	0.09
19	300295	三六五网	248,718.00	0.08
20	002095	生意宝	232,346.00	0.08

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	000609	绵石投资	7,953,764.08	2.64
2	300104	乐视网	7,096,103.92	2.35
3	600599	熊猫金控	4,759,838.00	1.58
4	002385	大北农	3,792,682.45	1.26
5	601166	兴业银行	3,524,293.65	1.17
6	601318	中国平安	3,457,942.00	1.15
7	600570	恒生电子	2,877,860.52	0.95
8	600177	雅戈尔	2,813,192.41	0.93
9	601998	中信银行	2,783,513.00	0.92
10	000001	平安银行	2,717,738.00	0.90
11	002285	世联行	2,691,738.36	0.89
12	601555	东吴证券	2,477,542.39	0.82
13	300136	信维通信	2,423,113.99	0.80
14	600109	国金证券	2,328,471.00	0.77
15	000712	锦龙股份	2,253,179.98	0.75

16	002024	苏宁云商	2,045,361.00	0.68
17	300079	数码视讯	2,012,626.00	0.67
18	300033	同花顺	2,004,295.92	0.67
19	600271	航天信息	1,719,217.82	0.57
20	600180	瑞茂通	1,681,217.00	0.56

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	36,774,559.57
卖出股票的收入（成交）总额	96,484,578.55

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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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	6,529.05
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,393.77
5	应收申购款	6,462.26
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,385.08

### 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

#### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

### 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

份额级别	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		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
E 金融	4,249	33,331.70	1.00	0.00%	141,626,407.99	100.00%
E 金融 A	122	41,835.20	3,789,503.00	74.25%	1,314,391.00	25.75%
E 金融 B	568	8,985.73	398,119.00	7.80%	4,705,775.00	92.20%
合计	4,939	30,741.89	4,187,623.00	2.76%	147,646,573.99	97.24%

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

#### E金融A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	上海明沘投资管理有限公司—明沘 CTA 一号基金	1,809,796.00	35.77%
2	海通资管—民生—海通年年升集合资产管理计划	1,499,995.00	29.64%
3	江淼	473,653.00	9.36%
4	海通资管—上海银行—海通赢家系列—年年鑫集合资产管理计划	322,032.00	6.36%
5	王继伟	300,000.00	5.93%
6	上海明沘投资管理有限公司—明沘多策略对冲 1 号基金	81,330.00	1.61%
7	上海千象资产管理有限公司—千象子基金 8 号	43,400.00	0.86%
8	李怡名	30,450.00	0.60%
9	马红涛	30,000.00	0.59%

10	张昕	29,579.00	0.58%
----	----	-----------	-------

注：以上数据由中国证券登记结算有限责任公司提供。

#### E金融B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	熊波	300,000.00	5.93%
2	徐淑萍	300,000.00	5.93%
3	黄次良	260,000.00	5.14%
4	李庆虹	205,200.00	4.06%
5	杨海锋	150,385.00	2.97%
6	上海明沚投资管理有限公司—明沚 CTA 二号基金	137,400.00	2.72%
7	银河期货有限公司—银河期货瑞安华丰 1 号资产管理计划	136,300.00	2.69%
8	胡朝松	124,000.00	2.45%
9	周宗庚	117,917.00	2.33%
10	上海明沚投资管理有限公司—明沚多策略对冲 1 号基金	99,500.00	1.97%

注：以上数据由中国证券登记结算有限责任公司提供。

#### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	E 金融	-	-
	E 金融 A	-	-
	E 金融 B	-	-
	合计	-	-

#### 9.4 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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	E 金融	0
	E 金融 A	0
	E 金融 B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	E 金融	0
	E 金融 A	0
	E 金融 B	0
	合计	0

**§10 开放式基金份额变动**

单位：份

项目	E 金融	E 金融 A	E 金融 B
基金合同生效日（2015 年 6 月 26 日）基金份额总额	323,568,752.09	59,000,681.00	59,000,681.00
本报告期期初基金份额总额	262,822,479.63	33,692,205.00	33,692,205.00
本报告期基金总申购份额	37,851,704.01	-	-
减：本报告期基金总赎回份额	98,437,404.71	-	-
本报告期基金拆分变动份额	-60,610,369.94	-28,588,311.00	-28,588,311.00
本报告期期末基金份额总额	141,626,408.99	5,103,894.00	5,103,894.00

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额及基金折算后调整份额。

**§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)，本期审计费为 50,000.00 元。自本基金基金合同生效以来，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		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中国中投证券有限责任公司	1	992,259.00	0.74%	924.12	0.74%	-
方正证券股份有限公司	1	8,317,169.78	6.24%	7,745.80	6.24%	-
申万宏源证券有限公司	2	773,767.00	0.58%	720.59	0.58%	-
西藏东方财富证券	1	562,311.00	0.42%	523.69	0.42%	-
东吴证券股份有限公司	1	3,341,568.00	2.51%	3,111.76	2.51%	-
中国国际金融有限公司	1	29,874,683.38	22.42%	27,822.35	22.42%	-
中泰证券股份有限公司	1	26,833,230.52	20.14%	24,989.84	20.14%	-
中国银河证券股份有限公司	1	1,995,979.00	1.50%	1,858.97	1.50%	-
长江证券股份有限公司	2	19,788,051.20	14.85%	18,428.89	14.85%	-
中信证券股份有限公司	2	1,722,693.00	1.29%	1,604.61	1.29%	-
东方证券股份有限公司	1	1,569,041.00	1.18%	1,461.26	1.18%	-
北京高华证券有限责任公司	1	13,313,173.90	9.99%	12,398.87	9.99%	-
平安证券有限	1	1,214,910.69	0.91%	1,131.41	0.91%	-

责任公司						
华泰证券股份 有限公司	2	11,857,365.25	8.90%	11,042.21	8.90%	-
安信证券股份 有限公司	2	11,102,935.40	8.33%	10,340.23	8.33%	-
东兴证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
华安证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证券 股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中银国际证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
信达证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-

注：1、报告期内，本基金新增加交易单元为西藏东方财富证券，终止交易单元为中信证券股份有限公司、海通证券股份有限公司，德邦证券股份有限公司、广发证券股份有限公司，其他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。

#### 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

无。

交银施罗德基金管理有限公司

二〇一七年三月二十九日