

(上接B024版)

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	200924	招商局	990,964	41,173,095.10	5.17
2	000671	阳光城	3,499,919	33,074,234.55	4.15
3	002415	奥飞动漫	1,790,218	29,666,804.10	3.73
4	000625	长安汽车	2,999,903	28,709,071.71	3.61
5	002317	众泰汽车	1,518,710	28,086,947.00	3.53
6	002701	众泰新材	599,935	26,097,172.50	3.28
7	600875	东方电气	1,999,919	24,999,912.50	3.14
8	300334	津源科技	749,901	24,896,713.20	3.13
9	300626	红日药业	700,127	24,798,496.34	3.12
10	600535	天士力	601,168	23,439,543.32	2.94

4.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	--	--	--
2	央行票据	--	--	--
3	金融债券	--	--	--
其中:政策性金融债	--	--	--	--
4	企业债券	--	--	--
5	企业短期融资券	--	--	--
6	中期票据	--	--	--
7	其他债	22,427,949.82	2.82	
8	其他债	--	--	--
9	合计	22,427,949.82	2.82	

5.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113001	中行转债	209,276	19,657,488.90	2.47
2	110023	民生转债	24,820	2,196,818.20	0.28
3	128002	华泰转债	3,360	573,642.72	0.07

6.报告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。

7.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.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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9.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。

10.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。

11.投资组合报告附注

(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。

(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。

(3) 其他基金构成

序号	序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	--	542,140.21
2	应收证券清算款	--	--
3	应收股利	--	--
4	应收利息	--	215,949.08
5	应收申购款	--	10,990.48
6	其他应收款	--	--
7	待摊费用	--	--
8	其他	--	--
9	合计	--	769,089.77

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113001	中行转债	19,657,488.90	2.47
2	110023	民生转债	2,196,818.20	0.28
3	128002	华泰转债	573,642.72	0.07

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300334	津膜科技	24,896,713.20	3.13	重大事项

(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,分项之和与合计之间可能存在尾差。

十二、基金的业绩

基金业绩统计日为2014年3月31日,所载财务数据未经审计师审计。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不预示其未来业绩,投资有风险,投资者在做投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

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	净值增长率①	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3个月	-8.99%	1.31%	-5.57%	0.90%	-2.82%	0.41%
过去6个月	-6.99%	1.24%	-4.97%	1.05%	-10.66%	0.19%
过去12个月	0.80%	1.17%	7.66%	0.96%	-6.26%	0.21%
自基金成立至2014年12月31日	-25.22%	0.99%	-18.35%	0.98%	-6.87%	0.01%
自基金成立至2014年12月31日	0.30%	0.14%	-2.83%	1.01%	3.13%	-0.87%

2. 本基金合同生效以来基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益变动的比较



(上接B022版)

1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	586,093,366.62	99.71
其中:股票	586,093,366.62	99.71	
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	200,000,700.00	20.35
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	17,184,731.11	17.44
7	其他资产	24,634,159.08	2.51
8	合计	982,912,896.81	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	--	--
B	制造业	468,592,727.60	48.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	21,974,421.77	2.28
E	建筑业	--	--
F	批发和零售业	16,618,898.49	1.72
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	47,638,442.12	4.93
J	金融业	--	--
K	房地产业	1,245,374	0.13
L	租赁和商务服务业	--	--
M	科学研究和技术服务业	6,252,007	0.64
N	卫生、社会保障和社会福利业	--	--
O	居民服务、修理和其他服务业	--	--
P	教育	--	--
Q	卫生健康和社会工作	32,068,816.83	3.32
R	文化、体育和娱乐业	--	--
S	其他	--	--
9	合计	586,093,366.62	60.71

3. 报告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

代码	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600389	江山股份	2,010,046	79,041,359.52	8.18
2	600987	世纪股份	4,495,262	78,096,691.48	8.18
3	600223	瀚叶股份	1,266,236	33,849,044.83	3.51
4	300113	新润科技	629,108	32,226,210.00	3.34
5	600753	鲁商置业	782,739	32,028,818.83	3.32
6	601311	骆驼股份	2,648,520	29,901,790.80	3.10
7	600893	航发动力	1,245,374	25,953,573.32	2.69
8	300334	津源科技	799,717	25,232,680.48	2.61
9	601179	中国西药	6,252,007	23,262,604.10	2.43
10	300335	普联软件	1,577,489	21,974,421.77	2.28

4. 报告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。

5. 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

6. 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。

7. 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8. 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。

9. 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。

10. 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。

11. 投资组合报告附注

(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。

(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。

(3) 其他资产构成

序号	序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	--	132,144.80
2	应收证券清算款	--	--
3	应收股利	--	--
4	应收利息	--	17,256.16
5	应收申购款	--	24,330,758.12
6	其他应收款	--	--
7	待摊费用	--	--
8	其他	--	--
9	合计	--	24,634,159.08

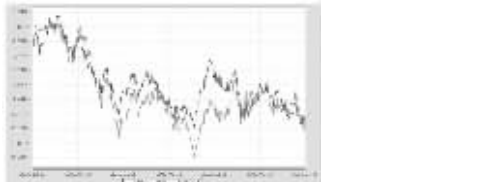
(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

2	300334	津源科技	25,222,604.40	2.61	重大事項
---	--------	------	---------------	------	------

交银施罗德优势先严股票证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2010年12月22日至2014年3月31日)



注:本基金建仓期为自基金合同生效日起96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。

十三、基金的费用与税收

(一) 基金费用的种类

1. 基金管理人的管理费;

2. 基金托管人的托管费;

3. (基金合同)生效后与基金相关的信息披露费用;

4. 基金合同生效后与基金相关的会计师事务所、律师费和诉讼费;

5. 基金合同生效后与基金相关的信息披露费用;

6. 基金的销售费用;

7. 基金的交易费用;

8. 按照国家有关规定和(基金合同)约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时发生费用,按实际支出从基金财产中列支扣除。

(二) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1. 本基金运作有关的费用

(1) 基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×年管理费率÷当年天数

H为每日应计提的管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

(2) 基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×年托管费率÷当年天数

H为每日应计提的托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

(3) 上述一、基金费用的种类中第2-3项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

2. 与基金销售有关的费用

(1) 申购费用

本基金提供两种申购费用的支付方式。投资者可以选择前端收费模式,即在申购时支付申购费用;也可以选择后端收费模式,即在赎回时才支付相应的申购费用,该费用随基金份额的持有时间递减。场外申购可以采取前端收费模式,场内申购目前只支持后端收费模式。

本基金的申购费用由基金申购人承担,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等费用。

投资者可以选择前端收费模式,申购费率按每笔申购申请单独计算。

本基金的申购费率如下:

申购金额(含申购费)	前端申购费率
100万元以下	1.8%
100万元(含)至500万元	1.0%
500万元(含)至1,000万元	0.6%
1,000万元以上(含1,000万元)	每笔交易1,000元

申购费率(前端)

持有期限	赎回费率
3天以内(含)	1.8%
3天-3个月(含)	1.2%
3个月-6个月(含)	0.6%
6个月以上	0

申购费率(后端)

因红利自动再投资而产生的基金份额,不收取相应的申购费用。

本基金自2014年4月1日起,对通过本公司直销柜台申购本基金前端基金份额的养老金客户给予本养老金客户特有的费率优惠,具体费率优惠如下:

养老金客户指基本养老金客户与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老金客户,具体包括全国社会保障基金,可以投资基金的地方社会保障基金,企业年金计划以及合格境外机构投资者经中国证监会认可的养老金客户。养老金客户,本公司将发布函件将其纳入养老金客户范围,并按规定向中国证监会备案。

通过本公司直销柜台申购本基金前端基金份额的养老金客户特定申购费率如下表:

特定申购费率	申购金额(含申购费)	前端特定申购费率
100万元以下	--	0.60%
100万元(含)至500万元	--	0.40%
500万元(含)至1,000万元	--	0.20%
1,000万元以上(含1,000万元)	--	每笔交易1,000元

特定申购费率(养老金客户)

有关养老金客户特定申购费率的具体规定以及活动范围如有变化,敬请投资者留意本公司发布的相关公告。

(2) 申购费用的计算

场内申购可以采取前端收费模式和后端收费模式,场内申购目前只支持后端收费模式。

前端收费模式:

申购总金额=申购总金额÷(1+申购费率)

净申购金额=申购总金额-申购费用

(注:对于适用固定金额申购费用的申购,净申购金额=申购总金额-固定申购费用)

场内申购的基金份额=净申购金额/ T日基金份额净值

场内申购金额的有效份额保留至小数点后两位,余额部分计入申购资金退还投资者。

对延迟退还申购金额=申购总金额-取整数值后确认的申购份额×T日基金份额净值

(3) 赎回费用

本基金提供两种赎回费用的支付方式。投资者可以选择前端收费模式,即在赎回时支付赎回费用;也可以选择后端收费模式,即在赎回时才支付相应的赎回费用,该费用随基金份额的持有时间递减。场外赎回可以采取前端收费模式,场内赎回目前只支持后端收费模式。

本基金的赎回费用由基金赎回人承担,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等费用。

投资者可以选择前端收费模式,赎回费率按每笔赎回申请单独计算。

本基金的赎回费率如下:

申购金额(含申购费)	前端赎回费率
50万元以下	1.8%
50万元(含)至100万元	1.2%
100万元(含)至500万元	0.6%
500万元(含)至1,000万元	0.2%
1,000万元以上(含1,000万元)	每笔交易1,000元

赎回费率(前端)

持有
