交银施罗德先进制造混合型证券投资基金

【2015】第四季度报告

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:二〇一六年一月二十一日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	交银先进制造混合	
基金主代码	519704	
交易代码	519704(前端)	519705(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011年6月22日	
报告期末基金份额总额	453,576,306.10份	
投资目标	本基金通过重点投资于与装备制造相关的优质企业,把握中国产业结构升级的投资机会,在控制风险并保持基金资产良好的流动性的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。	
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势,将严谨、规范化的选股方法与积极主动的投资风格相结合,自下而上挖掘与装备制造相关的上市公司投资机会,以谋求良好收益。	
业绩比较基准	75%×申银万国装备制造指数收益率+25%×中证综合债券指数收益率	
风险收益特征	本基金是一只混合型基金,其风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金,低于股票型基金。属于承担较高风险、预期收益较高的证券投资基金品种。	
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	

注:本基金业绩比较基准自2015年10月1日起,由"75%×申银万国装备制造指数收益率+25%×中信标普全债指数收益率"变更为"75%×申银万国装备制造指数收益率+25%×中证综合债券指数收益率",详情见本基金管理人于2015年9月28日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金业绩比较基准变更并修改基金合同相关内容的公告》。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年10月1日-2015年12月31日)
1.本期已实现收益	233,798,630.65
2.本期利润	305,726,890.04
3.加权平均基金份额本期利润	0.7348
4.期末基金资产净值	1,197,137,426.51
5.期末基金份额净值	2.639

注:1、上述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 本报告期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
过去三个月	40.60%	1.86%	23.00%	1.61%	17.60%	0.25%

注:本基金业绩比较基准自2015年10月1日起,由"75%×申银万国装备制造指数收益率+25%×中信标普全债指数收益率"变更为"75%×申银万国装备制造指数收益率+25%×中证综合债券指数收益率",3.2.2同。详情见本基金管理人于2015年9月28日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金业绩比较基准变更并修改基金合同相关内容的公告》。

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

交银施罗德先进制造混合型证券投资基金
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
(2011年6月22日至2015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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
任相栋	交银先进制造混合的基金经理	2015-01-21	-	5年	任相栋先生,上海交通大学金融学硕士。2010年加入交银施罗德基金管理有限公司,历任行业分析师。

注: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

在报告期内,本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同和其他相关法律法规的规定,并本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,基金投资管理符合有关法律法规和基金合同的规定,为基金持有人谋求最大利益。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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基金运作的公平,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。

公司建立资源共享的投资研究信息平台,确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。公司在交易执行环节实行集中交易制度,建立公平的交易分配制度。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。

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账户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。

报告期内本公司严格执行公平交易制度,公平对待旗下各投资组合,未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。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没有超过该证券当日总成交量5%的情形,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出现异常。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2015年四季度,国内经济先行指标出现了一些企稳迹象,美联储加息终于靴子落地,给全球风险资产带来了一段喘息之机。四季度国内证券市场精彩纷呈,国家的股市维稳意愿与大类资产配置的资产荒,共同推动了股指四季度明显的反弹行情,整体来看以创业板为代表的成长股涨幅明显高于传统行业蓝筹股。

本基金四季度业绩跑赢业绩比较基准,在9月底的市场底部,明显加仓了部分超跌的成长股,11月之后组合内股票的风格配置上做了些均衡,增加了部分高股息率个股的配置比例。

展望未来,2016年是十三五的开局之年,一些大的改革措施有望落地,GDP增速有望从前几年的明显下滑过渡到稳步寻底,部分新经济业态有望逐步走出初创阶段,这些经济生活的变化都会影响证券市场,因此我们有理由相信2016年的股票市场必定不会平淡,投资人需要做好的是去伪存真的工作。但同时需要注意的是,随着注册制的推进,2016年的股票供给可能会明显加大,经过一轮降息之后,预计国内边际上的货币宽松将会放缓,美国在2016年的加息幅度也使得全球流动性状况充满变数,这些因素都可能导致股票市场波动的加剧。本基金将继续致力于在控制好风险的情况下,努力为持有人赢得更高的回报。

4.5报告期内基金的业绩表现

截至2015年12月31日,本基金份额净值为2.639元,本报告期份额净值增长率为40.60%,同期业绩比较基准增长率23.00%。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内无需预警说明。

§5投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,121,514,960.85	86.52
	其中:股票	1,121,514,960.85	86.52
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	164,986,731.20	12.73
7	其他资产	9,734,550.76	0.75
8	合计	1,296,236,242.81	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	12,908,025.00	1.08
C	制造业	939,171,240.73	78.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	40,049,224.80	3.35
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	16,287,851.52	1.36
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	78,464,933.04	6.55
J	金融业	-	-
K	房地产业	13,306,085.76	1.11
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	21,327,600.00	1.78
S	综合	-	-
	合计	1,121,514,960.85	93.68

5.3 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

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	002456	欧菲光	3,073,526	95,340,776.52	7.96
2	000157	中联重科	11,017,278	58,942,437.30	4.92
3	600104	上汽集团	2,772,600	58,834,572.00	4.91
4	000768	中航飞机	2,311,900	57,265,763.00	4.78
5	002125	湘潭电化	2,445,751	57,108,285.85	4.77
6	600741	华域汽车	3,037,915	51,219,246.90	4.28
7	600389	江山股份	1,630,031	43,179,521.19	3.61
8	300322	硕贝德	2,075,566	40,473,537.00	3.38
9	300161	华中数控	935,958	34,368,377.76	2.87
10	300100	双林股份	1,095,001	34,295,431.32	2.86

5.4 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。

5.5 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。

5.6 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。

5.7 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。

5.8 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。

5.9 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。

5.10 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1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。

5.11.2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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,790,615.26
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	36,424.94
5	应收申购款	7,907,510.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,734,550.76

5.11.4 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。

5.11.5 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	600389	江山股份	43,179,521.19	3.61	重大事项

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	385,263,007.06
本报告期期间基金总申购份额	137,817,231.02
减:本报告期期间基金总赎回份额	69,503,931.98
本报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	453,576,306.10

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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内未发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期内未进行本基金的申购、赎回、红利再投等。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

鉴于交银施罗德先进制造混合型证券投资基金的业绩比较基准的指数停止计算编制,本基金管理人根据基金合同的相关约定,经与基金托管人协商一致,并报中国证监会备案,决定自2015年10月1日起将交银施罗德先进制造混合型证券投资基金的业绩比较基准由原"75%×申银万国装备制造指数收益率+25%×中信标普全债指数收益率"变更为"75%×申银万国装备制造指数收益率+25%×中证综合债券指数收益率",并相应修改基金合同的有关内容。详情请见本基金管理人于2015年9月28日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金业绩比较基准变更并修改基金合同相关内容的公告》。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会核准交银施罗德先进制造股票证券投资基金募集的文件;

2、《交银施罗德先进制造混合型证券投资基金基金合同》;

3、《交银施罗德先进制造混合型证券投资基金招募说明书》;

4、《交银施罗德先进制造混合型证券投资基金托管协议》;

5、关于募集交银施罗德先进制造股票证券投资基金之法律意见书;

6、基金管理人业务资格批件、营业执照;

7、基金托管人业务资格批件、营业执照;

8、报告期内交银施罗德先进制造混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

9.3 查阅方式

投资者可在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅备查文件,或者登录基金管理人的网站(www.fund001.com,www.bocomschroder.com)查阅。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人交银施罗德基金管理有限公司。本公司客户服务中心电话:400-700-5000(免长途话费),021-61055000,电子邮件:services@jysld.com。

交银施罗德现金宝货币市场基金

【2015】第四季度报告

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:二〇一六年一月二十一日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	交银现金宝货币
基金主代码	000710
交易代码	000710
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年9月12日
报告期末基金份额总额	2,275,151,589.11份
投资目标	在力求本金安全性和资产充分流动性的前提下,追求超过业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金在保持组合高度流动性的前提下,结合对国内外宏观经济运行、金融市场运行、资金流动格局、货币市场收益率曲线形态等各方面的分析,合理安排组合期限结构,积极选择投资工具,采取主动性的投资策略和精细化的操作手法。
业绩比较基准	活期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金属于货币市场基金,是证券投资基金中的低风险品种,长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年10月1日-2015年12月31日)
1.本期已实现收益	10,839,304.64
2.本期利润	10,839,304.64
3.期末基金资产净值	2,275,151,589.11

注:1、自合同生效日起,本基金按照0.25%的年费率计提销售服务费。

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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

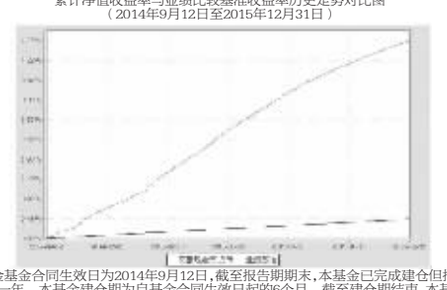
3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.6356%	0.0023%	0.0882%	0.0000%	0.5474%	0.0023%

注:本基金收益分配按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

交银施罗德现金宝货币市场基金
累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2014年9月12日至2015年12月31日)



注:本基金基金合同生效日为2014年9月12日,截至报告期期末,本基金已完成建仓但报告期期末距建仓结束未满一年。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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
黄莹洁	交银货币、交银财21天债券、交银现金宝货币、交银丰享收益债券、交银丰泽收益债券、交银裕通纯债债券的基金经理	2015-05-27	-	7年	黄莹洁女士,香港大学工商管理硕士,北京大学经济学、管理学双学士,历任中海基金管理有限公司交易员。2012年加入交银施罗德基金管理有限公司,历任中央交易室交易员。
连端清	交银货币、交银理财60天债券、交银丰盈收益债券、交银现金宝货币、交银丰润收益债券的基金经理	2015-08-04	-	4年	连端清先生,复旦大学经济学博士,历任交通银行总行金融市场部、湘财证券研究所研究员、中航信托资产管理部投资经理。2015年加入交银施罗德基金管理有限公司。

注: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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

在报告期内,本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同和其他相关法律法规的规定,并本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,基金投资管理符合有关法律法规和基金合同的规定,为基金持有人谋求最大利益。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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基金运作的公平,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。

公司建立资源共享的投资研究信息平台,确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。公司在交易执行环节实行集中交易制度,建立公平的交易分配制度。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。

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账户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。

报告期内本公司严格执行公平交易制度,公平对待旗下各投资组合,未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。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没有超过该证券当日总成交量5%的情形,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出现异常。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2015年四季度,国内经济整体上依旧有下行压力,CPI低位运行。尽管受稳增长影响,部分指标如工业增加值及制造业投资有企稳好转迹象,但是房地产投资依旧处于下行通道,传统制造业去产能及房地产行业去库存的挑战依旧。

货币政策上,央行货币政策维持宽松操作思路。鉴于国内经济下行压力,央行赶在美联储加息前,于10月下旬再次降准降息。美联储在12月份如期加息,中美央行的货币政策再度分化。受央行宽松货币政策影响,四季度资金面宽裕,银行间市场回购利率维持低位。但是先后受到10月份央行双降、11月IPO重启及12月资金面整体宽松下配置增强等影响,四季度债市经历先涨、后回调、再涨的行情,波动较大,行情腾挪跌宕,整体上较三季度继续大涨。

基金操作方面,报告期内本基金回笼资金满足客户的赎回需求,在资产类别配置上以存款及同业存单为主,择机配置了部分债券,适当拉长了组合久期,享受了债券利率下行带来的资本利得,增加了组合收益。

展望2016年一季度,考虑短期内依然面临传统制造业去产能及房地产行业去库存等问题,房地产投资增速仍有继续下滑的可能,国内经济整体上依然有下行压力。央行预计整体上将维持宽松的货币政策,但流动性边际改善的幅度可能不及2015年。预计一季度将更多以定向工具及公开市场操作为主来维持较宽裕的流动性,不排除降准降息的可能性,但全面降准降息的频率较2015年可能下降。组合管理方面,本基金将密切关注经济走势与央行货币政策操作动态,在保持较好流动性的同时紧抓市场机会,控制信用风险,努力为基金份额持有人创造稳健的回报。

4.5报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金净值收益率为0.6356%,同期业绩比较基准收益率为0.0882%。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内无需预警说明。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	943,577,311.30	38.81
	其中:债券	943,577,311.30	38.81
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	1,267,442,152.84	52.13
4	其他资产	220,366,961.73	9.06
5	合计	2,431,386,425.87	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	5.62	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	154,999,242.50	6.81
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个银行间市场交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值的比例(%)	原因	调整期
1	2015-12-15	24.87	巨额赎回	2个交易日
2	2015-12-16	20.10	巨额赎回	2个交易日

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	107
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	117
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	75

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本基金合同约定:"本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天"。本报告期内,本基金未发生超标情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	16.58	6.81
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	20.22	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	17.53	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	23.65	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	19.20	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		97.18	6.81

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(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	120,044,359.16	5.28
	其中:政策性金融债	120,044,359.16	5.28
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	230,560,892.30	10.13
6	中期票据	-	-
7	同业存单	592,972,059.84	26.06
8	其他	-	-
9	合计	943,577,311.30	41.47
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.5 报告期末按摊余成本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	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111519061	15恒丰银行CD061	1,500,000	148,791,125.95	6.54
2	111593457	15徽商银行CD145	1,000,000	97,668,975.05	4.29
3	150413	15农发13	500,000	49,984,935.43	2.20
4	111509245	15浦发CD245	500,000	49,918,624.23	2.19
5	111592194	15九台农村商业银行CD011	500,000	49,878,226.61	2.19
6	111591940	15西安银行CD006	500,000	49,557,353.93	2.18
7	111592182	15吉林银行CD021	500,000	49,448,477.27	2.17
8	111592961	15宁波银行CD144	500,000	49,290,114.18	2.17
9	111593089	15汉口银行CD018	500,000	49,236,843.98	2.16
10	111593391	15桂林银行CD023	500,000	49,182,318.64	2.16

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0次
报告期内偏离度的最高值	0.0531%
报告期内偏离度的最低值	0.0041%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0266%

5.7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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内按照实际利率和摊余成本逐日摊销计算损益。

5.8.2本基金报告期每日持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本均未超过当日基金资产净值的20%。

5.8.3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。

5.8.4其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	10,904,680.04
4	应收申购款	209,462,281.69
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	220,366,961.73

5.8.5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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	1,384,090,521.11
本报告期期间基金总申购份额	11,962,009,887.58
本报告期期间基金总赎回份额	11,070,948,819.58
报告期期末基金份额总额	2,275,151,589.11

注:1、如果本报告期间发生转换入、份额级别调整、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、份额级别调整业务,则总赎回份额中包含该业务。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	申购	2015-12-16	200,000,000.00	200,000,000.00	-
2	红利再投	2015-12-31	788,415.78	788,415.78	-
合计			200,788,415.78	200,788,415.78	

注:1、本基金管理人本报告期末持有本基金份额292,440,329.52份,占本基金期末总份额的12.85%。

2、本基金收益分配按日结转份额。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会准予交银施罗德现金宝货币市场基金募集注册的文件;

2、《交银施罗德现金宝货币市场基金基金合同》;

3、《交银施罗德现金宝货币市场基金招募说明书》;

4、《交银施罗德现金宝货币市场基金托管协议》;

5、关于申请募集交银施罗德现金宝货币市场基金的法律意见书;

6、基金管理人业务资格批件、营业执照;

7、基金托管人业务资格批件、营业执照;

8、报告期内交银施罗德现金宝货币市场基金在指定报刊上各项公告的原稿。

8.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

8.3 查阅方式

投资者可在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅备查文件,或者登录基金管理人的网站(www.fund001.com,www.bocomschroder.com)查阅。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人交银施罗德基金管理有限公司。本公司客户服务中心电话:400-700-5000(免长途话费),021-61055000,电子邮件:services@jysld.com。

交银施罗德消费新驱动股票型证券投资基金

【2015】第四季度报告

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:二〇一六年一月二十一日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2016年1月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	交银消费新驱动股票	
基金主代码	519714	
交易代码	519714(前端)	519715(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年7月1日	
报告期末基金份额总额	37,216,246.75份	
投资目标	本基金通过重点投资于与消费服务相关的优质企业,把握经济转型背景下中国消费升级蕴含的投资机会,在控制风险并保持基金资产良好的流动性的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。	
投资策略	本基金充分发挥基金管理人研究优势,将严谨、规范化的选股方法与积极主动的投资风格相结合,在经济转型大背景下,深入研究消费服务行业的发展趋势,积极挖掘不同子行业和子行业景气度新变化下的个股投资机会,通过团队对个股深入的基本面研究和细致的实地调研,精选个股,以谋求超额收益。	
业绩比较基准	85%×中证内地消费主题指数+15%×中证综合债券指数	
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。	
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	

注:本基金业绩比较基准自2015年10月1日起,由"85%×中证内地消费主题指数+15%×中信标普全债指数"变更为"85%×中证内地消费主题指数+15%×中证综合债券指数",详情见本基金管理人于2015年9月28日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金业绩比较基准变