华泰柏瑞中国制造2025灵活配置混合型证券投资基金

【2015】第四季度报告

基金管理人:华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1月21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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至2015年12月31日止。

华泰柏瑞中国制造2025灵活配置混合型证券投资基金于2015年11月19日根据收费方式分不同,新增C类份额,C类相关指标从11月19日开始计算。

§2 基金产品概况

基金简称	华泰柏瑞中国制造
交易代码	001456
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年8月4日
报告期末基金份额总额	106,413,569.50份
投资目标	本基金通过在中国迈向制造强国的进程中,把握科技革命和产业变革的投资机会,投资于具有较高投资价值的主题相关企业,在有效控制风险的前提下,力争实现超越业绩比较基准的长期稳定收益。
投资策略	本基金为混合型基金,以股票投资为主,一般情况下本基金将保持配置的基本稳定,最高可达95%。当股票市场的整体估值水平严重偏离企业实际的盈利状况和预期成长率,出现明显的价值高估,如果不及时调整将可能给基金持有人带来潜在的资本损失时,本基金将进行大类资产配置调整,降低股票资产的比例(最低为0%),同时相应提高债券等其他资产的比例,以规避市场系统性风险。
业绩比较基准	申银万国制造业指数收益率×80%+中债综合全价指数收益率×20%
风险收益特征	基金为混合型基金,其预期风险与预期收益高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金。
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	华泰柏瑞中国制造2025A / 华泰柏瑞中国制造2025C
下属分级基金的交易代码	001456 / 002094
报告期末下属分级基金的份额总额	106,344,472.73份 / 69,096.77份

§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)	
	华泰柏瑞中国制造2025A	华泰柏瑞中国制造2025C
1. 本期已实现收益	18,518,485.77	1,830.26
2. 本期利润	28,233,181.95	-113.84
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1856	-0.0067
4. 期末基金资产净值	123,628,045.83	80,266.08
5. 期末基金份额净值	1.163	1.162

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

华泰柏瑞中国制造2025A

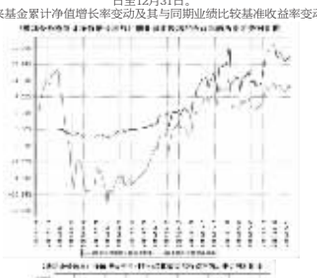
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	16.53%	1.79%	24.58%	1.73%	-8.05%	0.06%

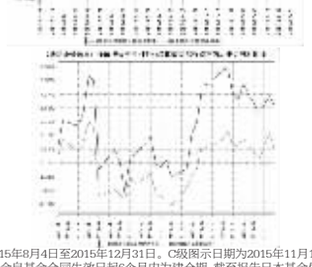
华泰柏瑞中国制造2025C

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	6.80%	1.98%	3.19%	1.48%	3.61%	0.50%

注:本基金于11月19日新增C类份额,上述A级指标计算日期为10月1日至12月31日,上述C级指标计算日期为11月19日至12月31日。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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





注:1. A级图示日期为2015年8月4日至2015年12月31日。C级图示日期为2015年11月19日至2015年12月31日。
2. 按基金合同规定,本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期,截至报告日本基金处于建仓期。

§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		
方纬	本基金的基金经理	2015年8月4日	-	12	2005年1月任上海金信研究所研究员;2006年1月至2007年2月任万家基金管理有限公司高级研究员;2007年2月加入华泰柏瑞基金管理有限公司,历任研究员、高级研究员、基金经理助理。2014年3月起任华泰柏瑞价值混合股票型证券投资基金的基金经理。2015年4月起任华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015年5月起任华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金的基金经理和华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015年8月起任华泰柏瑞中国制造2025灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
李灿	本基金的基金经理	2015年8月4日	-	5	北京大学西方经济学硕士。2010年7月加入华泰柏瑞基金管理有限公司,历任研究员、高级研究员、基金经理助理。2015年6月起任华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金的基金经理。2015年8月起任华泰柏瑞中国制造2025灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内本基金的运作符合相关法律、法规以及基金合同的约定,不存在损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求,通过科学完善的制度及流程,从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能的利益输送。首先投资部和研究部通过规范的决策流程来确保公平对待不同投资组合。其次集中交易室对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核,在交易过程中启用投资交易系统中的公平交易模块,确保公平交易的实施。同时,风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估。 本报告期内,上述公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本报告期内无下列情况: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成交量的5%。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年四季度,市场经历股灾之后大幅反弹,沪深300指数上涨16.49%,创业板指数反弹30.32%,中证500指数反弹24.4%,申银万国制造业指数上涨30.63%。8月中旬二次股灾之后,在管理层和央行的悉心呵护下,市场信心快速恢复,创业板领涨A股乃至全球市场。

本基金在四季度初仓位极低,在市场反弹过程中采用安全垫累积的逐级建仓策略,逐步提升仓位,建仓初期侧重配置业绩确定性高且具备安全边际的白马标的,随着行情的演绎,加大了高弹性成长股配置,先后重仓持有机器人、智能制造、军工、新能源汽车等中国制造2025的相关板块,同时结合市场情况择机配置了IP、教育体育、彩票等板块,取得了较好的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本基金A级份额净值为1.163元,上涨16.53%,同期本基金的业绩比较基准上涨24.58%,C级份额净值为1.162元,上涨6.8%,同期本基金的业绩比较基准上涨3.19%。

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2016年,美联储加息对全球经济产生滞后影响,人民币汇率压力加大,改革进入深水区,国内流动性宽松程度较2015年明显下降,由此引发市场风险偏好逐步下降,考虑到当前A股市场较高的估值水平,我们有必要放低2016年全年的期望收益率,无论是个股还是整体组合。进入2016年,本基金将维持成长股为主的配置方向,选股方向基于景气度和政策,重点看好物流自动化、IDC(CDN)、军工、先进制造、新能源汽车等领域。操作节奏上,规避有大小非减持压力的个股,仓位上灵活处理,力求在控制风险的基础上获取收益。

展望1-2年的投资周期,本基金持相对谨慎的态度。市场的中线趋势取决于经济与改革,经济仍处于转型换档之中,旧经济结构的下行压力依然较大,新增长引擎的成长需要时间,有待“中国制造2025”、“互联网+”和“供给侧改革”的落地和壮大。改革红利仍在不断释放,但市场期待更具标杆性的案例来进一步提升信心。汇率稳定与货币宽松之间的平衡使得宽松的边际受到约束,无风险利率下行和估值应有边界。当前市场的估值水平处于中高区域,短期内增量资金再次大规模入市亦难期待,市场尚未形成新的投资主线,市场更趋于存量博弈。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§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	98,918,538.64	77.81
	其中:股票	98,918,538.64	77.81
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	23,666,822.59	18.62
7	其他资产	4,548,004.54	3.58
8	合计	127,133,365.77	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	-	-
C	制造业	90,408,891.44	73.08
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	-	-
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	8,509,647.20	6.88
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	98,918,538.64	79.96

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	002229	鸿博股份	250,000	7,440,000.00	6.01
2	002519	银河电子	300,000	7,125,000.00	5.76
3	000971	高升控股	200,000	6,992,000.00	5.65
4	002594	比亚迪	100,000	6,440,000.00	5.21
5	600172	黄河旋风	250,000	6,327,500.00	5.11
6	002533	金杯电工	500,000	4,925,000.00	3.98
7	002612	朗姿股份	60,000	4,527,600.00	3.66
8	300046	台基股份	150,000	4,155,000.00	3.36
9	002094	青岛金王	125,361	3,904,995.15	3.16
10	603611	诺力股份	100,000	3,894,000.00	3.15

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
注: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
注: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
注: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
注: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
注: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
5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
注:本基金本报告期末未持有股指期货。
5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策
注: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
5.10.1 本期国债期货投资政策
注:本基金本报告期末未持有国债期货。
5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
注:本基金本报告期末未持有国债期货。
5.10.3 本期国债期货投资评价
注: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
报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的情形,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.11.2
基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情形。
5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	149,277.24
2	应收证券清算款	4,285,855.41
3	应收股利	-
4	应收利息	4,205.02
5	应收申购款	108,666.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,548,004.54

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注: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	002612	朗姿股份	4,527,600.00	3.66	临时停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	华泰柏瑞中国制造2025A	华泰柏瑞中国制造2025C
报告期期初基金份额总额	228,560,220.28	-
报告期期间基金总申购份额	22,279,559.61	69,367.77
减:报告期期间基金总赎回份额	144,495,307.16	271.00
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	106,344,472.73	69,096.77

§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
注:无。
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
注:无。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录
1、本基金的中国证监会批准募集文件
2、本基金的《基金合同》
3、本基金的《招募说明书》
4、本基金的《托管协议》
5、基金管理人业务资格批件、营业执照
6、本基金的公告
8.2 存放地点
上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼17层
8.3 查阅方式
投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件。 投资者对本报告如有疑问,可咨询基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司。 客户服务热线:400-888-0001(免长途费) 021-3878 4638 公司网址:www.huatai-pb.com

华泰柏瑞基金管理有限公司
2016年1月21日

交银施罗德国证新能源指数分级证券投资基金

【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	交银国证新能源指数分级
场内简称	交银新能
基金主代码	164905
交易代码	164905
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年3月26日
报告期末基金份额总额	1,086,969,413.44份
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,即按照国证新能源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	国证新能源指数收益率×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。本基金采取了基金分级分级的结构设计,不同的基金分级具有不同的风险收益特征。本基金其有三类份额,其中交银新能源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;交银新能源A份额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征;交银新能源B份额具有高预期风险、高预期收益的特征。
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
下属分级基金的基金简称	交银新能 / 新能源A / 新能源B
下属分级基金的场内简称	交银新能 / 新能源A / 新能源B
下属分级基金的交易代码	164905 / 150217 / 150218
报告期末下属分级基金的份额总额	809,754,873.44份 / 138,602,270.00份 / 138,602,270.00份
下属分级基金的风险收益特征	交银新能源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 / 交银新能源A份额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征 / 交银新能源B份额具有高预期风险、高预期收益的特征

§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	27,536,972.52
2.本期利润	299,431,518.16
3.加权平均基金份额本期利润	0.4035
4.期末基金资产净值	1,086,599,377.41
5.期末基金份额净值	1.000

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。

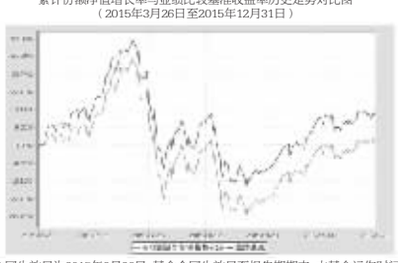
3.2 基金净值表现

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	41.35%	2.36%	32.17%	2.14%	9.18%	0.22%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计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

交银施罗德国证新能源指数分级证券投资基金
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015年3月26日至2015年12月31日)



注:本基金基金合同生效日为2015年3月26日,基金合同生效日至报告期期末,本基金运作时间未满一年。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		
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分级的基金经理、公司量化投资部助理总经理	2015-03-26	-	6年	蔡铮先生,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。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。

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业绩表现说明

2015年四季度,国内经济无行指标出现企稳,但经济增长和企业盈利下行压力依然较大。随着美联储加息,全球资产风险偏好暂获回升。货币政策延续宽松和国家对股市维稳意愿的加强进一步推动了资本市场的反弹行情。作为跟踪国证新能源指数的指数基金,在第四季度基金总体呈现出上涨走势。

展望2016年第一季度,宽松的货币政策环境有望持续,一些大的改革措施有望落地,整个经济环境因此有望从明显下滑过渡到稳步寻底回升,因此我们有理由对未来市场保持谨慎乐观的态度。

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1.000元,本报告期份额净值增长率为41.35%,同期业绩比较基准增长率为32.17%

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	1,028,549,082.64	92.92
	其中:股票	1,028,549,082.64	92.92
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	70,839,428.01	6.40
7	其他各项资产	7,541,671.95	0.68
8	合计	1,106,930,182.60	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.2.1 积极投资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。
5.2.2 指数投资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	33,436,135.83	3.08
C	制造业	844,995,799.09	77.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	76,920,900.57	7.08
E	建筑业	12,569,690.54	1.16
F	批发和零售业	19,743,051.06	1.82
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	25,203,419.79	2.32
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	-	-
S	综合	15,680,085.76	1.44
	合计	1,028,549,082.64	94.66

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股票投资明细
5.3.1报告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

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	300014	亿纬锂能	717,539	23,549,629.98	2.17
2	002070	众和股份	1,040,751	22,730,001.84	2.09
3	300207	欣旺达	762,478	21,425,631.80	1.97
4	000762	西藏矿业	775,073	20,384,419.90	1.88
5	600884	杉杉股份	516,806	20,279,467.44	1.87
6	002460	赣锋锂业	319,039	20,077,124.27	1.85
7	002176	江特电机	1,129,094	19,872,054.40	1.83
8	300004	南风股份	744,742	19,802,689.78	1.82
9	002091	江苏国泰	743,058	19,743,051.06	1.82
10	002466	天齐锂业	137,981	19,420,825.75	1.79

5.3.2报告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。
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除南风股份(证券代码:300004)外,未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
报告期内本基金投资的前十名证券之一南风股份(证券代码:300004)于2015年2月13日公告,公司因违反《民用核安全设备监督管理条例》于近日收到国家核安全局《核安全行政处罚决定书》。据此,国家核安全局责令公司停止民用核安全设备设计、制造活动,限期6 个月进行整改,并处50万元罚款。
本基金遵循指数化投资理念,绝大部分资产采用完全复制法跟踪指数,以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则,进行被动式指数化投资。本基金对该证券的投资遵守本基金管理人基金投资管理相关制度及被动式指数化投资策略。
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 其他各项资产构成

代码	名称	金额(元)
1	存出保证金	758,483.86
2	应收证券清算款	5,381,392.50
3	应收股利	-
4	应收利息	17,576.29
5	应收申购款	1,384,219.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,541,671.95

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 报告期末投资的股票中存在流通受限情况的说明
5.11.5.1 报告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。
5.11.5.2 报告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。
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

项目	交银新能	新能源A	新能源B
本报告期期初基金份额总额	545,166,867.25	76,547,530.00	76,547,530.00
本报告期期间基金总申购份额	299,259,557.20	-	-
减:本报告期期间基金总赎回份额	261,229,817.98	-	-
本报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	226,558,266.97	62,054,740.00	62,054,740.00
本报告期期末基金份额总额	809,754,873.44	138,602,270.00	138,602,270.00

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。

§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

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	13,528,183.54
本报告期期间买入/申购总份额	6,824,410.34
本报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	20,352,593.88
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	1.87

7.2 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	份额折算调增	2015-12-21	6,824,410.34	-	-
合计			6,824,410.34	-	

§8 影响投资者决策的其他重要信息

1.根据本基金基金合同中关于不定期份额折算的相关规定,当交银新能源份额的基金份额净值大于或等于1.500元时,本基金将进行不定期份额折算。截至2015年12月17日,交银新能源份额的基金份额净值为1.511元,达到基金合同规定的不定期份额折算条件。根据本基金基金合同以及深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定,本基金管理人以2015年12月18日为不定期份额折算基准日办理了不定期份额折算业务,相关事宜详情请见本基金管理人于2015年12月18日、12月21日、12月22日发布的系列公告。

2.根据本基金基金合同中关于定期份额折算的相关规定,由于本基金以2015年12月18日为不定期份额折算基准日办理了不定期份额折算业务,距2016年的第一个工作日(即2016年1月4日)不足3个月,因此,本基金决定于2016年的第一个工作日不进行定期份额折算,交银新能源A份额的约定年基准收益率亦相应不予调整,仍沿用2015年的约定年基准收益率,即基金合同生效日(2015年3月26日)中国人民银行公布的金融机构人民币一年期存款基准利率(税后)+3%,相关事宜详情请见本基金管理人于2015年12月28日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德国证新能源指数分级证券投资基金不进行定期份额折算的提示性公告》。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录
1、中国证监会准予交银施罗德国证新能源指数分级证券投资基金募集注册的文件;
2、《交银施罗德国证新能源指数分级证券投资基金合同》;
3、《交银施罗德国证新能源指数分级证券投资基金招募说明书》;
4、《交银施罗德国证新能源指数分级证券投资基金托管协议》;
5、基金管理人业务资格批件、营业执照;
6、基金托管人业务资格批件、营业执照;
7、关于申请募集注册交银施罗德国证新能源指数分级证券投资基金的法律意见书;
8、报告期内交银施罗德国证新能源指数分级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。

交银施罗德环球精选价值证券投资基金

【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