

信息披露 Disclosure

交银施罗德精选股票证券投资基金

2013年度报告摘要

注:“本期累计买入金额”指买入成交金额(成交前乘以佣金)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.2 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

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	600685	海康电器	534,880,581.82	10.13
2	000065	格力电器	453,933,022.23	8.63
3	000016	民生证券	354,044,119.99	6.78
4	600000	浦发银行	309,697,591.53	5.94
5	002081	金 刚	269,360,121.13	5.10
6	600671	阳光城	248,104,721.41	4.70
7	000023	泰禾集团	245,466,276.46	4.65
8	000088	海航控股	242,282,279.26	4.59
9	603118	中国平安	233,629,756.56	4.39
10	000205	长汽汽车	228,098,445.29	4.33
11	002148	北汽控股	228,456,999.97	4.32
12	000900	TCL 集团	208,076,925.53	3.94
13	002218	华成股份	198,271,726.66	3.73
14	002106	蒙发科技	185,689,659.69	3.51
15	002016	贵州茅台	184,239,584.44	3.49
16	300251	联德股份	182,632,322.71	3.46
17	601311	交通银行	181,197,027.63	3.43
18	002285	北京君正	166,288,109.91	3.16
19	000423	华发股份	162,497,892.83	3.08
20	600532	浙 农 丰	159,361,125.20	3.02
21	002264	洋河股份	158,184,548.30	3.00
22	601608	中信银行	157,147,026.57	2.97
23	601166	兴业银行	156,433,776.36	2.94
24	600048	保利地产	152,609,959.53	2.89
25	600185	上海医药	152,607,081.91	2.89
26	002241	歌力思学	150,707,830.06	2.85
27	002553	尚品宅配	137,606,479.73	2.61
28	000827	鲁商置业	132,801,471.89	2.52
29	002230	科大讯飞	132,586,671.21	2.51
30	002570	贝因美	129,533,146.67	2.46
31	000049	德隆股份	126,179,334.40	2.39
32	002586	康 缘 堂	125,203,000.00	2.36
33	300070	世纪华通	116,263,287.27	2.21
34	603269	康发股份	116,058,549.48	2.20
35	002192	大平股份	115,973,248.48	2.19
36	601117	华信证券	108,728,472.21	2.06
37	000024	招商局	108,233,000.00	2.03

注:“本期累计买入金额”指买入成交金额(成交前乘以佣金)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票成本总额及卖出股票的收入总额

项目	金额(人民币元)
买入股票的成本(成交金额)	31,908,820,425.25
卖出股票的收入(成交金额)	12,210,218,262.20

注:“买入股票成本”或“卖出股票收入”指买入或卖出成交金额(成交前乘以佣金)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

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国债债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	148,676,000.00	2.90
4	企业债券	148,676,000.00	2.90
5	资产支持证券	—	—
6	可转债	—	—
7	中期票据	—	—
8	其他	—	—
9	合计	148,676,000.00	2.90

注:“买入股票成本”或“卖出股票收入”指买入或卖出成交金额(成交前乘以佣金)填列,不考虑相关交易费用。

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

序号	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	13国债(1)	13,070,000	69,993,000.00	1.37
2	13国债(3)	30,000,000	49,655,000.00	0.97
3	13国债(12)	30,000,000	29,028,000.00	0.57

注:“买入股票成本”或“卖出股票收入”指买入或卖出成交金额(成交前乘以佣金)填列,不考虑相关交易费用。

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

序号	资产支持证券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	—	—	—
2	—	—	—
3	—	—	—
4	—	—	—
5	—	—	—
6	—	—	—
7	—	—	—
8	—	—	—
9	—	—	—
10	—	—	—

注:“买入股票成本”或“卖出股票收入”指买入或卖出成交金额(成交前乘以佣金)填列,不考虑相关交易费用。

8.8 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

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,没有属于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

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,622,166.45
2	应收证券清算款	188,871,581.04
3	应收利息	—
4	应收股利	4,241,958.40
5	应收申购款	333,085.91
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	196,068,791.80

注:“买入股票成本”或“卖出股票收入”指买入或卖出成交金额(成交前乘以佣金)填列,不考虑相关交易费用。

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000025	广晟有色	170,968,368.50	3.34	股票公告

注:“买入股票成本”或“卖出股票收入”指买入或卖出成交金额(成交前乘以佣金)填列,不考虑相关交易费用。

8.12.6 投资组合报告附注

8.12.6.1 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

未受到公开谴责和处罚。

8.12.6.2 本基金投资的前十名股票中,没有属于基金合同规定的备选股票库之外的股票。

8.12.6.3 期末其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,622,166.45
2	应收证券清算款	188,871,581.04
3	应收利息	—
4	应收股利	4,241,958.40
5	应收申购款	333,085.91
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	196,068,791.80

注:“买入股票成本”或“卖出股票收入”指买入或卖出成交金额(成交前乘以佣金)填列,不考虑相关交易费用。

8.12.6.4 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。

8.12.6.5 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	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000025	广晟有色	170,968,368.50	3.34	股票公告

注:“买入股票成本”或“卖出股票收入”指买入或卖出成交金额(成交前乘以佣金)填列,不考虑相关交易费用。

8.12.6.6 投资组合报告附注

8.12.6.6.1 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

未受到公开谴责和处罚。

8.12.6.6.2 本基金投资的前十名股票中,没有属于基金合同规定的备选股票库之外的股票。

8.12.6.6.3 期末其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,622,166.45
2	应收证券清算款	188,871,581.04
3	应收利息	—
4	应收股利	4,241,958.40
5	应收申购款	333,085.91
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	196,068,791.80

注:“买入股票成本”或“卖出股票收入”指买入或卖出成交金额(成交前乘以佣金)填列,不考虑相关交易费用。

8.12.6.6.4 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。

8.12.6.6.5 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	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000025	广晟有色	170,968,368.50	3.34	股票公告

注:“买入股票成本”或“卖出股票收入”指买入或卖出成交金额(成交前乘以佣金)填列,不考虑相关交易费用。

8.12.6.6.6 投资组合报告附注

8.12.6.6.6.1 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

未受到公开谴责和处罚。

8.12.6.6.6.2 本基金投资的前十名股票中,没有属于基金合同规定的备选股票库之外的股票。

8.12.6.6.6.3 期末其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,622,166.45
2	应收证券清算款	188,871,581.04
3	应收利息	—
4	应收股利	4,241,958.40
5	应收申购款	333,085.91
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	196,068,791.80

注:“买入股票成本”或“卖出股票收入”指买入或卖出成交金额(成交前乘以佣金)填列,不考虑相关交易费用。

8.12.6.6.6.4 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。

8.12.6.6.6.5 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	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000025	广晟有色	170,968,368.50	3.34	股票公告

注:“买入股票成本”或“卖出股票收入”指买入或卖出成交金额(成交前乘以佣金)填列,不考虑相关交易费用。

8.12.6.6.6.6 投资组合报告附注

8.12.6.6.6.6.1 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

未受到公开谴责和处罚。

8.12.6.6.6.6.2 本基金投资的前十名股票中,没有属于基金合同规定的备选股票库之外的股票。

8.12.6.6.6.6.3 期末其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,622,166.45
2	应收证券清算款	188,871,581.04
3	应收利息	—
4	应收股利	4,241,958.40
5	应收申购款	333,085.91
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	196,068,791.80

注:“买入股票成本”或“卖出股票收入”指买入或卖出成交金额(成交前乘以佣金)填列,不考虑相关交易费用。

8.12.6.6.6.6.4 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。

8.12.6.6.6.6.5 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	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000025	广晟有色	170,968,368.50	3.34	股票公告

注:“买入股票成本”或“卖出股票收入”指买入或卖出成交金额(成交前乘以佣金)填列,不考虑相关交易费用。

8.12.6.6.6.6.6 投资组合报告附注

8.12.6.6.6.6.6.1 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

未受到公开谴责和处罚。

8.12.6.6.6.6.6.2 本基金投资的前十名股票中,没有属于基金合同规定的备选股票库之外的股票。

8.12.6.6.6.6.6.3 期末其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,622,166.45
2	应收证券清算款	188,871,581.04
3	应收利息	—
4	应收股利	4,241,958.40
5	应收申购款	333,085.91
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	196,068,791.80

注:“买入股票成本”或“卖出股票收入”指买入或卖出成交金额(成交前乘以佣金)填列,不考虑相关交易费用。

8.12.6.6.6.6.6.4 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。

8.12.6.6.6.6.6.5 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	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000025	广晟有色	170,968,368.50	3.34	股票公告

注:“买入股票成本”或“卖出股票收入”指买入或卖出成交金额(成交前乘以佣金)填列,不考虑相关交易费用。

8.12.6.6.6.6.6.6 投资组合报告附注

8.12.6.6.6.6.6.6.1 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

未受到公开谴责和处罚。

8.12.6.6.6.6.6.6.2 本基金投资的前十名股票中,没有属于基金合同规定的备选股票库之外的股票。

8.12.6.6.6.6.6.6.3 期末其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,622,166.45
2	应收证券清算款	188,871,581.04
3	应收利息	—
4	应收股利	4,241,958.40
5	应收申购款	333,085.91
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	196,068,791.80

注:“买入股票成本”或“卖出股票收入”指买入或卖出成交金额(成交前乘以佣金)填列,不考虑相关交易费用。

8.12.6.6.6.6.6.6.4 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。

8.12.6.6.6.6.6.6.5 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	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000025	广晟有色	170,968,368.50	3.34	股票公告

注:“买入股票成本”或“卖出股票收入”指买入或卖出成交金额(成交前乘以佣金)填列,不考虑相关交易费用。

8.12.6.6.6.6.6.6.6 投资组合报告附注

8.12.6.6.6.6.6.6.6.1 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

未受到公开谴责和处罚。

8.12.6.6.6.6.6.6.6.2 本基金投资的前十名股票中,没有属于基金合同规定的备选股票库之外的股票。

8.12.6.6.6.6.6.6.6.3 期末其他各项资产构成