

信息披露 disclosure

交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金

2014 半年度报告摘要

6.4.8.2.1 基金管理费

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	单位:人民币元
当期发生的基金应支付的管理费	2,988,891.69	
其中:支付销售机构的客户维护费	1,439,425.86	
注:支付基金托管人交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金1.5%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: 日管理费=前一日基金资产净值×1.5%÷当年天数。		

6.4.8.2.2 基金托管费

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	单位:人民币元
当期发生的基金应支付的托管费	498,148.66	
注:支付基金托管人交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金0.25%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: 日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。		

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易
本基金本报告期未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况
6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
本报告期内未发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。
6.4.8.4.2 报告期末基金管理人及其关联方投资本基金的情况
本报告期末及报告期未发生关联方投资本基金的情况。
6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	单位:人民币元
中国农业银行股份有限公司	11,590,710.31	36,044.14
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。		

6.4.8.6 本基金在承销期间参与关联方承销证券的情况
本基金本报告期内未参与承销期间参与关联方承销证券。
6.4.8.7 其他关联方交易事项的说明
本基金本报告期无其他关联方交易事项。

6.4.9 期末(2014年6月30日)本基金持有的流通受限证券
6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

证券代码	证券名称	成功认购日期	可流通日期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002727	一心堂	2014-06-25	2014-07-02	新股申购	12.20	12.20	2,690.00	32,818.00	32,818.00	-

6.4.9.2 受限证券类别:股票
注:基金可使用基金名公开发行的股票申购,选择网上或者网下一种方式进行新股申购。基金作为个人投资者参与认购的新股,从新股发行日至新股上市日之前不能自由转让。

6.4.9.3 期末持有的处于转股期可转换债券的情况
本基金本报告期末未持有处于转股期可转换债券。
6.4.9.4 期末持有的流通受限的债券
截至本报告期末2014年6月30日,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额13,000,000.00元,于2014年7月7日(含)到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券,按证券交易所规定的利率质押库,不得作为融券交易的担保金。

7.1 期末基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	170,369,974.46	47.39
其中:股票	170,369,974.46	47.39	
2	固定收益投资	169,037,235.74	47.02
其中:债券	169,037,235.74	47.02	
3	贵金属投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
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	13,535,602.20	3.77
7	其他各资产	6,528,703.61	1.82
8	合计	359,471,516.01	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

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	7,378,000.00	2.15
C	制造业	141,965,302.67	41.37
D	电力、热力、燃气及生产和供应业	-	-
E	建筑业	7,462,000.00	2.17
F	批发和零售业	9,988,250.00	2.65
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	1,291,621.79	0.38
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,184,800.00	0.93
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		170,369,974.46	49.65

7.3 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

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	002008	大族激光	729,976	12,657,783.84	3.69
2	000423	东阿阿胶	370,000	12,328,400.00	3.59
3	002317	众生药业	543,204	10,847,783.88	3.16
4	600887	伊利股份	319,964	10,597,207.68	3.09
5	600150	中国船舶	400,000	8,424,000.00	2.46
6	602325	洪涛股份	910,000	7,462,000.00	2.17
7	600028	中国石化	1,400,000	7,378,000.00	2.13
8	000919	金鹰药业	500,000	6,960,000.00	2.05
9	002415	康瑞威	363,291	6,154,149.54	1.79
10	600872	中恒高新	550,000	5,868,500.00	1.71

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半年度报告正文。
7.4 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	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	000423	东阿阿胶	14,829,420.86	2.86
2	002008	大族激光	12,874,690.07	2.48
3	600887	伊利股份	11,504,096.34	2.22
4	000002	万科A	10,864,059.21	2.10
5	002317	众生药业	9,517,686.76	1.84
6	300145	南方泵业	9,327,885.11	1.80
7	000099	中信海直	8,383,257.51	1.60
8	600426	华鲁恒升	8,265,111.25	1.60
9	601318	中国平安	8,298,285.18	1.59
10	300207	欣信达	8,006,241.00	1.55
11	600739	辽宁成大	7,890,060.34	1.52
12	300168	万达信息	7,459,490.90	1.44
13	600018	人民网	7,407,881.92	1.43
14	600872	中恒高新	7,351,013.27	1.42
15	002514	宝馨科技	7,023,994.42	1.36
16	600704	物产中大	7,019,173.54	1.35
17	600000	中国石化	7,000,000.00	1.35
18	002589	国海医药	6,741,758.20	1.30
19	000919	金鹰药业	6,458,682.35	1.25
20	600729	重庆百货	6,293,915.49	1.21

注:“本期累计买入金额”按买入成交金额(成交价款减去成交费用)填列,不考虑相关交易费用。
7.4.2 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

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	002375	夏新股份	12,123,297.50	2.94
2	000002	万科A	11,692,044.23	2.26
3	002008	大族激光	10,976,297.33	2.12
4	000709	河北钢铁	10,155,500.00	1.96
5	601311	鹏盛股份	9,719,611.38	1.88
6	000099	中信海直	8,478,559.87	1.64
7	300168	万达信息	8,400,665.00	1.62
8	600739	辽宁成大	8,080,682.27	1.56
9	601318	中国平安	7,905,200.85	1.53
10	300207	欣信达	7,764,381.38	1.50
11	600426	华鲁恒升	7,719,063.34	1.49
12	002415	康瑞威	7,369,236.76	1.42
13	600867	通化东宝	6,956,087.77	1.34
14	002589	国海医药	6,663,809.24	1.29
15	603000	人民同庆	6,112,893.63	1.18
16	000584	友利控股	6,081,679.84	1.17
17	601555	东吴证券	6,040,152.20	1.17
18	600352	浙江龙盛	6,006,875.60	1.16
19	002054	新华都	5,784,358.65	1.12
20	600827	友发股份	5,604,978.59	1.08

注:“本期累计卖出金额”按卖出成交金额(成交价款减去成交费用)填列,不考虑相关交易费用。
7.4.3 买入股票的成本(或公允价值)占基金资产净值的比例

项目	单位:人民币元
买入股票的成本(或公允价值)	39,672,839.00
卖出股票的成本(或公允价值)	246,108,088.11
注:“买入股票成本”按“卖出股票收入”均按卖出成交金额(成交价款减去成交费用)填列,不考虑相关交易费用。	

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

项目	单位:人民币元
买入股票的成本(或公允价值)	39,672,839.00
卖出股票的成本(或公允价值)	246,108,088.11
注:“买入股票成本”按“卖出股票收入”均按卖出成交金额(成交价款减去成交费用)填列,不考虑相关交易费用。	

7.6 期末按债券品种分类的债券投资组合

项目	单位:人民币元
买入股票的成本(或公允价值)	39,672,839.00
卖出股票的成本(或公允价值)	246,108,088.11
注:“买入股票成本”按“卖出股票收入”均按卖出成交金额(成交价款减去成交费用)填列,不考虑相关交易费用。	

7.7 期末按债券品种分类的债券投资组合

项目	单位:人民币元
买入股票的成本(或公允价值)	39,672,839.00
卖出股票的成本(或公允价值)	246,108,088.11
注:“买入股票成本”按“卖出股票收入”均按卖出成交金额(成交价款减去成交费用)填列,不考虑相关交易费用。	

7.8 期末按债券品种分类的债券投资组合

项目	单位:人民币元
买入股票的成本(或公允价值)	39,672,839.00
卖出股票的成本(或公允价值)	246,108,088.11
注:“买入股票成本”按“卖出股票收入”均按卖出成交金额(成交价款减去成交费用)填列,不考虑相关交易费用。	

7.9 期末按债券品种分类的债券投资组合

项目	单位:人民币元
买入股票的成本(或公允价值)	39,672,839.00
卖出股票的成本(或公允价值)	246,108,088.11
注:“买入股票成本”按“卖出股票收入”均按卖出成交金额(成交价款减去成交费用)填列,不考虑相关交易费用。	

7.10 期末按债券品种分类的债券投资组合

项目	单位:人民币元
买入股票的成本(或公允价值)	39,672,839.00
卖出股票的成本(或公允价值)	246,108,088.11
注:“买入股票成本”按“卖出股票收入”均按卖出成交金额(成交价款减去成交费用)填列,不考虑相关交易费用。	

7.11 期末按债券品种分类的债券投资组合

项目	单位:人民币元
买入股票的成本(或公允价值)	39,672,839.00
卖出股票的成本(或公允价值)	246,108,088.11
注:“买入股票成本”按“卖出股票收入”均按卖出成交金额(成交价款减去成交费用)填列,不考虑相关交易费用。	

7.12 期末按债券品种分类的债券投资组合

项目	单位:人民币元
买入股票的成本(或公允价值)	39,672,839.00
卖出股票的成本(或公允价值)	246,108,088.11
注:“买入股票成本”按“卖出股票收入”均按卖出成交金额(成交价款减去成交费用)填列,不考虑相关交易费用。	

7.13 期末按债券品种分类的债券投资组合

项目	单位:人民币元
买入股票的成本(或公允价值)	39,672,839.00
卖出股票的成本(或公允价值)	246,108,088.11
注:“买入股票成本”按“卖出股票收入”均按卖出成交金额(成交价款减去成交费用)填列,不考虑相关交易费用。	

7.14 期末按债券品种分类的债券投资组合

项目	单位:人民币元
买入股票的成本(或公允价值)	39,672,839.00
卖出股票的成本(或公允价值)	246,108,088.11
注:“买入股票成本”按“卖出股票收入”均按卖出成交金额(成交价款减去成交费用)填列,不考虑相关交易费用。	

7.15 期末按债券品种分类的债券投资组合

项目	单位:人民币元
买入股票的成本(或公允价值)	39,672,839.00
卖出股票的成本(或公允价值)	246,108,088.11
注:“买入股票成本”按“卖出股票收入”均按卖出成交金额(成交价款减去成交费用)填列,不考虑相关交易费用。	

7.16 期末按债券品种分类的债券投资组合

项目	单位:人民币元
买入股票的成本(或公允价值)	39,672,839.00
卖出股票的成本(或公允价值)	246,108,088.11
注:“买入股票成本”按“卖出股票收入”均按卖出成交金额(成交价款减去成交费用)填列,不考虑相关交易费用。	

7.17 期末按债券品种分类的债券投资组合

项目	单位:人民币元
买入股票的成本(或公允价值)	39,672,839.00
卖出股票的成本(或公允价值)	246,108,088.11
注:“买入股票成本”按“卖出股票收入”均按卖出成交金额(成交价款减去成交费用)填列,不考虑相关交易费用。	

7.18 期末按债券品种分类的债券投资组合

项目	单位:人民币元
买入股票的成本(或公允价值)	39,672,839.00
卖出股票的成本(或公允价值)	246,108,088.11
注:“买入股票成本”按“卖出股票收入”均按卖出成交金额(成交价款减去成交费用)填列,不考虑相关交易费用。	

7.19 期末按债券品种分类的债券投资组合

项目	单位:人民币元
买入股票的成本(或公允价值)	39,672,839.00
卖出股票的成本(或公允价值)	246,108,088.11
注:“买入股票成本”按“卖出股票收入”均按卖出成交金额(成交价款减去成交费用)填列,不考虑相关交易费用。	

7.20 期末按债券品种分类的债券投资组合

项目	单位:人民币元
买入股票的成本(或公允价值)	39,672,839.00
卖出股票的成本(或公允价值)	246,108,088.11
注:“买入股票成本”按“卖出股票收入”均按卖出成交金额(成交价款减去成交费用)填列,不考虑相关交易费用。	

7.21 期末按债券品种分类的债券投资组合

项目	单位:人民币元
买入股票的成本(或公允价值)	39,672,839.00
卖出股票的成本(或公允价值)	246,108,088.11
注:“买入股票成本”按“卖出股票收入”均按卖出成交金额(成交价款减去成交费用)填列,不考虑相关交易费用。	

7.22 期末按债券品种分类的债券投资组合

项目	单位:人民币元
买入股票的成本(或公允价值)	39,672,839.00
卖出股票的成本(或公允价值)	246,108,088.11
注:“买入股票成本”按“卖出股票收入”均按卖出成交金额(成交价款减去成交费用)填列,不考虑相关交易费用。	

7.23 期末按债券品种分类的债券投资组合

项目	单位:人民币元
买入股票的成本(或公允价值)	39,672,839.00
卖出股票的成本(或公允价值)	246,108,088.11
注:“买入股票成本”按“卖出股票收入”均按卖出成交金额(成交价款减去成交费用)填列,不考虑相关交易费用。	

7.24 期末按债券品种分类的债券投资组合

项目	单位:人民币元
买入股票的成本(或公允价值)	39,672,839.00
卖出股票的成本(或公允价值)	246,108,088.11
注:“买入股票成本”按“卖出股票收入”均按卖出成交金额(成交价款减去成交费用)填列,不考虑相关交易费用。	

7.25 期末按债券品种分类的债券投资组合

项目	单位:人民币元
买入股票的成本(或公允价值)	39,672,839.00
卖出股票的成本(或公允价值)	246,108,088.11
注:“买入股票成本”按“卖出股票收入”均按卖出成交金额(成交价款减去成交费用)填列,不考虑相关交易费用。	

7.26 期末按债券品种分类的债券投资组合

项目	单位:人民币元
买入股票的成本(或公允价值)	39,672,839.00
卖出股票的成本(或公允价值)	246,108,088.11
注:“买入股票成本”按“卖出股票收入”均按卖出成交金额(成交价款减去成交费用)填列,不考虑相关交易费用。	

7.27 期末按债券品种分类的债券投资组合

项目	单位:人民币元
买入股票的成本(或公允价值)	39,672,839.00
卖出股票的成本(或公允价值)	246,108,088.11
注:“买入股票成本”按“卖出股票收入”均按卖出成交金额(成交价款减去成交费用)填列,不考虑相关交易费用。	

7.28 期末按债券品种分类的债券投资组合

项目	单位:人民币元
买入股票的成本(或公允价值)	39,672,839.00