

信息披露 Disclosure

交银施罗德先进制造股票证券投资基金

【2014】半年度报告摘要

各方之间不存在任何重大利益冲突,截止报告期末未有与任何外部估值定价服务机构签约。

4.7 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
本基金本报告期内未进行利润分配。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵守诚信原则,恪尽职守,按照有关法律法规及基金合同、托管协议的约定,对本基金管理人—交银施罗德基金管理有限公司有关基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵守法律、净值计算、利润分配等情况的说明
本托管人认为,交银施罗德基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金份额净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在有损基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为,交银施罗德基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告及报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:交银施罗德先进制造股票证券投资基金
报告截止日:2014年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本报告 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
资产:			
银行存款	6.4.7.1	87,883,178.07	50,356,882.44
结算备付金		1,750,000.00	160,774.04
存出保证金		95,089.92	121,910.29
交易性金融资产	6.4.7.2	607,798,033.57	533,217,416.83
其中:股票投资		607,798,033.57	533,217,416.83
基金投资		-	-
债券投资		-	19,998,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	204,180,767.37	148,625,443.30
应收证券清算款		4,479,143.73	-
应收利息	6.4.7.5	114,019.28	705,064.82
应收申购款		2,292,413.22	657,082.58
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		908,592,645.16	734,044,576.10
负债和所有者权益:			
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	7,164,594.36
应付赎回款		8,991,133.81	7,284,407.64
应付管理人报酬		1,101,801.61	894,604.36
应付托管费		183,633.59	149,100.72
应付销售服务费		-	-
应付利息	6.4.7.7	76,893.29	137,434.12
应付股利		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	203,294.59	382,314.33
负债合计		10,556,756.89	16,602,455.53
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	763,741,346.11	682,267,737.30
未分配利润	6.4.7.10	124,296,542.16	95,174,385.27
所有者权益合计		898,038,888.27	717,442,132.57
负债和所有者权益总计		908,592,645.16	734,044,576.10

注:1.报告截止日2014年6月30日,基金份额净值1.176元,基金份额总额763,741,346.11份。

2.本报告期末资产负债表和利润表所列附注号为半年度报告正文中对应的附注号,投资者欲了解相应附注的内容,应查阅登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

6.2 利润表

会计主体:交银施罗德先进制造股票证券投资基金
本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项目	附注号	本报告 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入		18,429,609.04	93,864,024.00
1.利息收入		1,740,241.79	837,371.02
其中:存款利息收入	6.4.7.11	870,013.59	601,717.33
债券利息收入		16,372.60	-
资产支持证券投资收入		-	-
买入返售金融资产收入		853,855.60	235,653.69
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.12	54,568,040.86	48,033,512.03
其中:股票投资收益		50,262,256.32	42,323,729.61
债券投资收益	6.4.7.13	-	46,640.00
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.16	3,859,144.54	2,709,782.42
4.2 公允价值变动收益(一)公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	-38,432,598.79	47,820,233.17
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.18	594,318.18	172,027.08
其中:一、费用		8,178,811.46	6,259,076.06
1.管理人报酬		6,434,705.39	4,610,949.53
2.托管费		1,057,294.92	768,491.61
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.19	593,387.30	683,718.30
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
二、其他	6.4.7.20	184,593.71	196,816.64
三、利息收入(净额填列,“-”号填列)		10,250,797.58	87,604,047.92
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		10,250,797.58	87,604,047.92

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:交银施罗德先进制造股票证券投资基金
本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项目	本报告 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	682,267,737.30	682,267,737.30
二、本期投资活动产生的基金净值变动(金额填列)	-	10,250,797.58
三、本期基金份额变动产生的基金净值变动(金额填列)	141,473,608.81	28,860,361.31
四、本期基金份额变动产生的基金净值变动(金额填列)	834,576,280.45	150,326,286.28
五、本期损益	-693,102,617.64	-121,460,633.97
六、本期基金份额变动产生的基金净值变动(金额填列)	763,741,346.11	134,296,542.16
七、期末所有者权益(基金净值)	1,342,944,576.10	898,038,888.27
八、本期基金份额变动产生的基金净值变动(金额填列)	682,267,737.30	682,267,737.30
九、本期基金份额变动产生的基金净值变动(金额填列)	10,250,797.58	10,250,797.58
十、本期基金份额变动产生的基金净值变动(金额填列)	834,576,280.45	150,326,286.28
十一、本期损益	-693,102,617.64	-121,460,633.97
十二、本期基金份额变动产生的基金净值变动(金额填列)	763,741,346.11	134,296,542.16
十三、期末基金份额净值	1.176	1.176

报表附注为财务报表的重要组成部分。
本报告6.1至6.4,财务报表由下列负责人签署:
基金管理人负责人:姚光,主管会计工作负责人:许瑞燕,会计机构负责人:宋鸣

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

交银施罗德先进制造股票证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2011]第639号《关于核准交银施罗德先进制造股票证券投资基金募集的批复》核准,由交银施罗德基金管理有限公司(以下简称“交银施罗德”)和(交银施罗德先进制造股票证券投资基金基金合同)负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购基金利息共募集人民币1,917,255,974.30元,业经普华永道中天会计师事务所(以下简称“普华永道”)于2011年6月22日出具验资报告,并经中国证监会备案。《交银施罗德先进制造股票证券投资基金基金合同》于2011年6月23日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,917,686,091.76份基金份额,其中认购基金利息折合304,117.38份基金份额。本基金的基金管理人为交银施罗德基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德先进制造股票证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括创业板、创业板及本基金经中国证监会核准上市的其他股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的90%-95%,其中,投资于大装备制造类行业上市公司股票的投资比例不低于股票资产的90%;债券、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他品种占基金资产的4%-10%,其中基金持有的权证市值不超过基金资产净值的3%,基金保留的现金以及投资于期限在一年以内的政府债券占基金资产净值不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为: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。

6.4.2 会计政策的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则,其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”),中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号—年度报告和半年度报告》、中国证券业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《交银施罗德先进制造股票证券投资基金基金合同》和中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他相关规定的说明

本基金2014年上半年度财务报告符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2014年6月30日的财务状况以及2014年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与前一会计期间所采用的会计政策、会计估计保持一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

7.4.2 累计卖出金额超过期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300024	机器人	28,537,266.17	3.98
2	300005	探路者	25,571,397.19	3.56
3	600967	北方创业	25,187,569.95	3.51
4	300070	碧水源	17,079,911.89	2.38
5	600596	新安股份	14,337,228.63	2.00
6	600570	恒信证券	12,292,144.54	1.71
7	601111	诺德股份	10,839,897.45	1.51
8	600703	三安光电	8,814,528.30	1.23
9	600893	紫光股份	8,146,928.61	1.14
10	600880	博瑞传播	5,182,241.00	0.72
11	601877	正海磁材	3,932,839.72	0.55
12	002415	海康威视	3,931,484.50	0.55
13	300113	顺网科技	3,485,585.12	0.49

注:“本期累计卖出金额”按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票的成本(成交金额)	250,011,799.09
卖出股票的收入(成交金额)	167,307,692.28

注:“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)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

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1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。

7.12.2 本基金投资的前十名股票中,有未超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	95,089.92
2	应收证券清算款	4,479,143.73
3	应收利息	-
4	应收股利	-
5	应收申购款	2,292,413.22
6	待摊费用	-
7	预付款项	-
8	其他	-
9	合计	6,906,646.15

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

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	600038	哈飞股份	1,842,482.65	0.21	非公开发行股票

7.12.6 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误差。

8 基金业绩持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有户(户)	户均持有的基金份额	机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
20,133	37,934.80	218,428,268.66	28.60%	545,313,077.45	71.40%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	725,538.93	0.09%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金开放式基金份额总量的情况

本基金管理人持有本基金开放式基金份额总量的情况:本基金基金经理未持有本基金。

9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2011年6月22日)基金份额总额	1,917,686,091.76
本报告期初基金份额总额	622,267,737.30
本报告期基金申购份额	834,576,280.45
减:本报告期基金赎回份额	693,102,617.64
本报告期基金净申购份额	—
本报告期末基金份额总额	763,741,346.11

注:1.如果本报告期间发生转入、红利再投资,则总申购份额中包含该业务;

2.如果本报告期间发生转出业务,则总赎回份额中包含该业务。

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1.基金管理人发生重大人事变动:本基金管理人报告期内未发生重大人事变动。

2.基金托管人的基金托管部门发生重大人事变动:本基金托管人的基金托管部门报告期内未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期间未发生涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期间投资策略未发生变更。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况
本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况
本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员报告期内未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资和佣金支付情况

金额单位:人民币元

				金额单位:人民币		
券商名称	交易单元数量	股票交易		应付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交金额的比例	佣金	占当期佣金总额的比例	
方正证券股份有限公司	1	9,781,558.00	2.35%	8,965.24	2.35%	-
广发证券股份有限公司	1	85,152,346.46	20.48%	77,523.06	20.48%	-
财富里昂证券有限责任公司	1	8,438,741.77	2.04%	7,682.67	2.03%	-