交银施罗德主题优选灵活配置混合型证券投资基金

2014 年度报告摘要

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：二〇一五年三月三十一日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司(以下简称"中国建设银行")根据本基金合同规定，于2015年3月30日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自2014年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	交银主题优选混合	
基金主代码	519700	
交易代码	519700(前端)	519701(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2010年6月30日	
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	
报告期末基金份额总额	1,257,018,227.06份	
基金合同存续期	不定期	

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金力图通过前瞻性的主题优选，积极把握行业和个股投资机会，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，在分析和判断宏观经济发展趋势、经济周期和市场环境变化趋势的基础上，动态调整投资组合比例，自上而下灵活配置资产；通过优选主题配置和挖掘预期具有良好增长前景的优势行业相结合的方式，精选个股，以谋求超额收益。
业绩比较基准	60%×沪深300指数收益率+40%×中信标普全债指数收益率
风险收益特征	本基金是一只灵活配置的混合型基金，属于基金中的中高风险品种，本基金的风险与预期收益介于股票型基金和债券型基金之间。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		交银施罗德基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙艳	田青
	联系电话	021-61055050	010-67595096
	电子邮箱	xxpl@jysld.com,disclosure@jysld.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-700-5000,021-61055000	010-67595096
传真		021-61055054	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fund001.com，www.bocomschroder.com
基金年度报告备置地点	基金管理人的办公场所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2014年	2013年	2012年
本期已实现收益	217,174,528.42	-81,038,241.09	-97,061,085.79
本期利润	359,442,291.97	-126,993,252.65	111,767,928.50
加权平均基金份额本期利润	0.5005	-0.1434	0.1005
本期基金份额净值增长率	59.49%	-15.77%	14.46%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末	2013年末	2012年末
期末可供分配基金份额利润	0.053	-0.220	-0.074
期末基金资产净值	1,563,810,309.17	589,845,561.55	1,020,886,557.77
期末基金份额净值	1.244	0.780	0.926

注：1、本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。

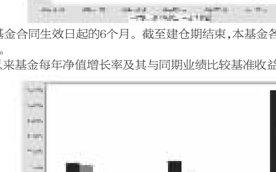
3.2 基金净值表现

3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	57.27%	1.95%	26.57%	1.03%	30.70%	0.92%
过去六个月	62.83%	1.47%	37.34%	0.82%	25.49%	0.65%
过去一年	59.49%	1.17%	33.63%	0.75%	25.86%	0.42%
过去三年	53.77%	1.26%	37.56%	0.79%	16.21%	0.47%
自基金合同生效起至今	26.13%	1.19%	32.18%	0.81%	-6.05%	0.38%

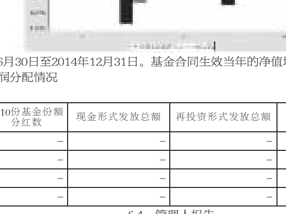
注：本基金的业绩比较基准为60%×沪深300指数收益率+40%×中信标普全债指数收益率，每日进行再平衡过程。@

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



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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：图示日期为2010年6月30日至2014年12月31日。基金合同生效当年的净值增长率按照当年实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2014年	–	–	–	–	–
2013年	–	–	–	–	–
2012年	–	–	–	–	–
合计	–	–	–	–	–

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

交银施罗德基金管理有限公司是经中国证监会证监基金字[2005]128号文批准，由交通银行股份有限公司、施罗德投资管理有限公司、中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司共同发起设立。公司成立于2005年8月4日，注册地在中国上海，注册资本金为2亿元人民币。其中，交通银行股份有限公司持有65%的股份，施罗德投资管理有限公司持有30%的股份，中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司持有5%的股份。公司并下设交银施罗德资产管理（香港）有限公司和交银施罗德资产管理有限公司。

截至报告期末，公司管理了包括货币型、债券型、保本混合型、普通混合型和股票型在内的37只基金，其中股票型涵盖普通指数型、交易型开放式（ETF）、QDII等不同类型基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李永兴	本基金、交银施罗德周期回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理	2012-03-20	–	8年	李永兴先生，经济学硕士。2006年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任投资研究部研究员、基金经理助理。

注：1、本表所列基金经理（助理）任职日期和离职日期均以基金合同生效日或公司作出决定并公告(如适用)之日为准；

2、本表所列基金经理（助理）证券从业年限中的"证券从业"的含义遵从中国证券业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定；

3、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

本报告期内，本基金管理人严格遵循《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。

本报告期内，本基金整体运作合规合法，无不当内幕交易和关联交易，基金投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的约定，未发生损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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所管理的所有资产组合投资运作的公平。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。制度中包含的主要控制方法如下：

（1）公司建立资源共享的投资研究信息平台，所有研究成果对所有投资组合公平开放，确保各投资组合在获得研究支持和实施投资决策方面享有公平的机会。

（2）公司将投资管理职能和交易执行职能相隔离，实行集中交易制度，建立了合理且可操作的公平交易分配机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。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。

（3）公司建立了清晰的投资授权制度，明确各层级投资决策主体的职责和权限划分，组合投资经理充分发挥专业判断能力，不受他人干预，在投权范围内独立行使投资决策权，维护公平的投资管理环境，维护所管理投资组合的合法利益，保证各投资组合交易决策的客观性和独立性，防范不公平及异常交易的发生。

（4）公司建立统一的投资对象备选库和交易对手备选库，制定明确的备选库建立、维护程序。在全公司适用股票、债券备选库的基础上，根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和关联交易限制等，按需要建立不同投资组合的投资对象风格库和交易对手备选库，组合经理在此基础上根据投资授权构建投资组合。

（5）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投资组合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。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合。通过投资交易监控、交易数据分析、专项稽核检查等，本基金管理人未发现任何违反公平交易制度的行为。

4.3.3 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

一季度股票市场呈现剧烈波动的走势，年初在互联网、新能源汽车、智能家居等主题投资的带动下，中小板和创业板都呈现较大涨幅，但是后续随着宏观经济数据的下滑，市场出现了较为明显的下跌，而蓝筹股在下跌过程中表现得较为抗跌。一季度市场表现的行业特征不是特别明显，即便在传统产业中只要能和"互联网"、"智能化"等主题挂钩的公司都有较大涨幅，而新兴产业中也不乏一些不贴近主题投资方向的公司甚至出现了较大跌幅。

二季度股票市场呈现小幅波动的走势。4月至5月中旬，由于经济下滑的压力较大，股票市场出现下跌，尤其是部分高估值的创业板公司跌幅较大。但是随着五月下旬经济在出口的带动下开始出现企稳回升迹象，股票市场也开始反弹，前期跌幅较大的中小板及创业板反弹幅度也更大。从行业上看，二季度计算机、传媒、电子等新兴行业表现出较大的弹性，无论在下跌过程中还是在反弹过程中波动幅度都比蓝筹板块更大，但市场跟前期相比并未明显出现新的投资主题。

三季度股票市场呈现全面上涨的走势。七月份在众多城市地产限购政策放松的刺激下，房地产行业率先开始上涨，随后逐渐扩散到其他各个行业。由于期间经济数据和货币信贷数据都较差，从基本面角度而言经济中的亮点并不多，因此三季度市场依然是主题投资盛行，军工、体育产业等投资主题涨幅较大。

四季度股票市场呈现严重的两极分化。蓝筹股大幅上涨，许多蓝筹股四季度股价翻倍，而另一方面创业板四季度甚至出现下跌。其中受益增量资金入市的证券行业以及受益"一带一路"主题的建筑行业涨幅较大，而医药、电子等行业则出现下跌。

本基金在2014年上半年积极参与了一些主题投资，虽然收益并不明显，但基金业绩也基本跟住了业绩比较基准。下半年本基金及时地调整了仓位和持仓结构，为持有人取得了超越业绩比较基准的收益。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2014年12月31日，本基金份额净值为1.244元，本报告期份额净值增长率为59.49%，同期业绩比较基准增长率为33.63%。

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2015年，牛市赚钱效应的基础已经形成，后续牛市持续的时间、幅度以及结构都要取决于是否仍有增量资金继续入市。本基金将根据增量资金的后续变化，对仓位和持仓结构做出相应调整。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序，经公司管理层批准后实行，并成立了估值委员会，估值委员会成员由研究部、基金运营部、风险管理部等人员和固定收益人员及基金经理组成。

公司严格按照新会计准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定进行估值，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。估值委员会的研究部成员按投资品种的不同性质，研究并参考市场普遍认同的做法，建议合理的估值模型，进行测算和认证，认可后交各估值委员会成员从基金会计、风险、合规等方面审批，一致同意后，报公司投资总监、总经理审批。

估值委员会会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后，及时召开临时会议进行研究，及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值委员会成员均具备相应的专业资格及工作经验。基金经理作为估值委员会的成员，对本基金持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感，向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论。本基金管理人参与估值流程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。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内无需预警说明。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

§6 审计报告

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）对交银施罗德主题优选灵活配置混合型证券投资基金2014年12月31日的资产负债表，2014年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注出具了标准无保留意见的审计报告【普华永道中天审字(2015)第21511号】。投资者可通过本基金年度报告正文查看该审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：交银施罗德主题优选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2014年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	139,452,925.42	182,927,063.00
结算备付金		2,148,418.12	788,201.85
存出保证金		242,125.64	216,605.14
交易性金融资产	7.4.7.2	945,839,984.92	331,754,776.85
其中：股票投资		872,224,431.21	312,304,776.85
基金投资		–	–
债券投资		73,615,553.71	19,450,000.00
资产支持证券投资		–	–
贵金属投资		–	–
衍生金融资产	7.4.7.3	–	–
买入返售金融资产	7.4.7.4	498,596,707.90	94,450,421.63
应收证券清算款		–	–
应收利息	7.4.7.5	265,586.83	465,893.77
应收股利		–	–
应收申购款		21,547,351.72	102,226.47
递延所得税资产		–	–
其他资产	7.4.7.6	–	–
资产总计		1,608,093,100.55	610,705,188.71
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
负 债：			
短期借款		–	–
交易性金融负债		–	–
衍生金融负债	7.4.7.3	–	–
卖出回购金融资产款		–	–
应付证券清算款		–	17,598,721.30
应付赎回款		40,710,482.48	495,168.82
应付管理人报酬		1,470,514.12	755,793.61
应付托管费		245,085.70	125,965.59
应付销售服务费		–	–
应付交易费用	7.4.7.7	1,350,281.07	696,896.93
应交税费		–	805,300.00
应付利息		–	–
应付利润		–	–
递延所得税负债		–	–
其他负债	7.4.7.8	506,428.01	381,780.91
负债合计		44,282,791.38	20,859,627.16
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	1,257,018,227.06	756,457,043.77
未分配利润	7.4.7.10	306,792,082.11	-166,611,482.22
所有者权益合计		1,563,810,309.17	589,845,561.55
负债和所有者权益总计		1,608,093,100.55	610,705,188.71

注：1、报告截止日2014年12月31日，基金份额净值1.244元，基金份额总额1，257，018，227.06份。

2、本摘要中资产负债表和利润表所列附注号为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，应阅读登载于基金管理人网站的年度报告正文。

7.2 利润表

会计主体：交银施罗德主题优选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2014年1月1日至2014年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
一、收入		374,870,410.66	-108,597,379.69
1.利息收入		4,854,455.18	2,965,925.59
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,089,083.66	783,330.39
债券利息收入		2,510,147.62	1,629,334.23
资产支持证券利息收入		–	–
买入返售金融资产收入		1,255,223.90	553,260.97
其他利息收入		–	–
2.投资收益(损失以"-"填列)		227,380,613.17	-65,870,850.16
其中：股票投资收益	7.4.7.12	193,351,631.72	-75,176,959.24
基金投资收益		–	–
债券投资收益	7.4.7.13	32,530,678.33	818,121.34
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	–	–
贵金属投资收益		–	–
衍生工具收益	7.4.7.15	–	–
股利收益	7.4.7.16	1,498,303.12	8,487,987.74
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	7.4.7.17	142,267,763.55	-45,955,011.56
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		–	–
5.其他收入(损失以"-"号填列)	7.4.7.18	367,578.76	262,556.44
减：二、费用		15,428,118.69	18,395,872.96
1.管理人报酬		8,871,660.86	11,344,859.46
2.托管费		1,478,610.27	1,890,809.88
3.销售服务费		–	–
4.交易费用	7.4.7.19	4,679,965.51	4,739,307.67
5.利息支出		–	17,051.10
其中：卖出回购金融资产支出		–	17,051.10
6.其他费用	7.4.7.20	397,882.05	403,844.85
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		359,442,291.97	-126,993,252.65
减：所得税费用		–	–
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		359,442,291.97	-126,993,252.65

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：交银施罗德主题优选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2014年1月1日至2014年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	756,457,043.77	-166,611,482.22	589,845,561.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	359,442,291.97	359,442,291.97
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以"-"号填列）	500,561,183.29	113,961,272.36	614,522,455.65
其中：1.基金申购款	991,686,346.63	137,305,856.87	1,128,992,203.50
2.基金赎回款	-491,125,163.34	-23,344,584.51	-514,469,747.85
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	–	–	–
五、期末所有者权益(基金净值)	1,257,018,227.06	306,792,082.11	1,563,810,309.17

项目	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,102,996,113.03	-82,109,555.26	1,020,886,557.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	-126,993,252.65	-126,993,252.65
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以"-"号填列）	-346,539,069.26	42,491,325.69	-304,047,743.57
其中：1.基金申购款	75,087,359.49	-8,657,984.04	66,429,375.45
2.基金赎回款	-421,626,428.75	51,149,309.73	-370,477,119.02
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	–	–	–
五、期末所有者权益(基金净值)	756,457,043.77	-166,611,482.22	589,845,561.55

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从7.1至7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：苏奋（代任），主管会计工作负责人：许珊燕，会计机构负责人：朱鸣

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

交银施罗德主题优选灵活配置混合型证券投资基金（以下简称"本基金"）经中国证券监督管理委员会（以下简称"中国证监会"）证监许可[2010]第624号《关于核准交银施罗德主题优选灵活配置混合型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依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德主题优选灵活配置混合型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资金利息共募集人民币3，234，778，164.71元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字（2010）第166号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《交银施罗德主题优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2010年6月30日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为3，235，642，950.36份基金份额，其中认购资金利息折合864，785.65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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德主题优选灵活配置混合型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、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。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为30%-80%，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证券品种占基金资产的20%-70%，其中基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为：60%×沪深300指数收益率+40%×中信标普全债指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人交银施罗德基金管理有限公司于2015年3月25日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《交银施罗德主题优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2014年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2014年12月31日的财务状况以及2014年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告不一致，所采用的会计估计与最近一期年度报告一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2014年颁布《企业会计准则第39号——公允价值计量》、《企业会计准则第40号——合营安排》、《企业会计准则第41号——在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第2号——长期股权投资》、《企业会计准则第9号——职工薪酬》、《企业会计准则第30号——财务报表列报》、《企业会计准则第33号——合并财务报表》以及《企业会计准则第37号——金融工具列报》，要求除《企业会计准则第37号——金融工具列报》自2014年度财务报表起施行外，其他准则自2014年7月1日起施行。上述准则对本基金本报告期无重大影响。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 关联方关系

项目	与本基金的关系
交银施罗德基金管理有限公司("交银施罗德基金公司")	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司("中国建设银行")	基金托管人、基金销售机构
交通银行股份有限公司("交通银行")	基金管理人的股东、基金销售机构
施罗德投资管理有限公司	基金管理人的股东
中国国际海运集装箱(集团)股份有限公司	基金管理人的股东
交银施罗德资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	8,871,660.86	11,344,859.46
其中：支付销售机构的客户维护费	2,226,630.67	2,678,902.15

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值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：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值×1.5%÷当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,478,610.27	1,890,809.88

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值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。

7.4.8.2.3 销售服务费

无。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
报告期初持有的基金份额	202,878,105.88	202,878,105.88
报告期间申购/买入总份额	–	–
报告期间因拆分变动份额	–	–
减：报告期间赎回/卖出总份额	–	–
报告期末持有的基金份额	202,878,105.88	202,878,105.88
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	16.14%	26.82%

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。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	139,452,925.42	1,067,197.58	182,927,063.00	759,301.51

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。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.9 期末（2014年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.9.1.1 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
110030	格力转债	2014-12-30	2015-01-13	新债网下申购	100.00	100.00	22,210	2,221,000.00	2,221,000.00	–

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600584	长电科技	2014-11-03	重大事项	11.13	2015-01-14	12.24	447,202	5,132,068.50	4,977,358.26	–
600754	锦江股份	2014-11-10	重大事项	25.11	2015-01-19	27.00	242,100	5,126,476.53	6,079,131.00	–

注：本基金截至2014年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2014年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为932，562，495.66元，属于第二层次的余额为13，277，489.26元，无属于第三层次的余额(2013年12月31日：第一层次310，969，210.15元，第二层次20，785，566.70元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2014年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2013年12月31日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	872,224,431.21	54.24
	其中：股票	872,224,431.21	54.24
2	固定收益投资	73,615,553.71	4.58
	其中：债券	73,615,553.71	4.58
	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	498,596,707.90	31.01
	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	141,601,343.54	8.81
7	其他各项资产	22,055,064.19	1.37
8	合计	1,608,093,100.55	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

序号	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	139,450,277.49	8.92
C	制造业	308,033,526.97	19.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	33,219,863.28	2.12
F	批发和零售业	6,516,177.46	0.42
G	交通运输、仓储和邮政业	–	–
H	住宿和餐饮业	6,079,131.00	0.39
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,866,292.00	0.69
J	金融业	308,886,593.01	19.75
K	房地产业	35,884,002.00	2.29
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	23,288,568.00	1.49
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	872,224,431.21	55.78

8.3 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

金额单位：人民币元

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	601166	兴业银行	4,515,500	74,505,750.00	4.76
2	601318	中国平安	991,555	74,079,074.05	4.74
3	000001	平安银行	3,546,700	56,179,728.00	3.59
4	600000	浦发银行	3,033,200	47,590,908.00	3.04
5	000528	柳　工	3,642,800	45,826,424.00	2.93
6	000425	徐工机械	2,830,421	42,371,402.37	2.71
7	000157	中联重科	5,542,200	39,127,932.00	2.50
8	600720	祁连山	3,489,513	38,279,957.61	2.45
9	600395	盘江股份	3,170,543	37,792,872.56	2.42
10	600158	中体产业	2,026,200	35,884,002.00	2.29

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年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	94,202,119.55	15.97
2	601166	兴业银行	58,211,580.00	9.87
3	600720	祁连山	50,014,948.45	8.48
4	000001	平安银行	42,539,308.37	7.21
5	600348	阳泉煤业	34,999,410.54	5.93
6	000157	中联重科	33,798,602.39	5.73
7	600000	浦发银行	33,461,293.14	5.67
8	601699	潞安环能	33,101,205.30	5.61
9	000528	柳　工	32,863,785.31	5.57
10	002051	中工国际	32,850,276.81	5.57
11	000937	冀中能源	30,752,625.74	5.21
12	600395	盘江股份	30,510,123.40	5.17
13	600158	中体产业	30,386,894.74	5.15
14	000425	徐工机械	30,321,210.59	5.14
15	600585	海螺水泥	28,709,567.97	4.87
16	600015	华夏银行	26,859,936.64	4.55
17	600837	海通证券	25,056,658.77	4.25
18	600030	中信证券	23,758,198.04	4.03
19	000024	招商地产	22,825,127.04	3.87
20	002573	国电清新	22,741,508.87	3.86
21	300104	乐视网	22,489,689.25	3.81
22	000401	冀东水泥	22,345,763.73	3.79
23	601998	中信银行	21,956,152.14	3.72
24	600999	招商证券	21,463,890.42	3.64
25	600511	国药股份	21,444,373.87	3.64
26	000712	锦龙股份	19,269,586.10	3.27
27	601933	永辉超市	19,123,265.37	3.24
28	300137	先河环保	18,283,290.32	3.10
29	002353	杰瑞股份	18,024,490.87	3.06
30	002081	金 螳 螂	16,942,269.10	2.87
31	002363	隆基机械	16,591,154.23	2.81
32	600109	国金证券	16,494,884.34	2.80
33	002317	众生药业	16,173,451.09	2.74
34	300005	探路者	16,132,294.31	2.74
35	002344	海宁皮城	15,555,117.64	2.64
36	601601	中国太保	15,350,228.70	2.60
37	601555	东吴证券	15,134,152.39	2.57
38	000783	长江证券	14,616,387.12	2.48
39	600016	民生银行	14,532,644.60	2.46
40	600389	江山股份	14,309,461.49	2.43
41	601901	方正证券	14,037,029.00	2.38
42	002514	宝馨科技	13,797,915.19	2.34
43	603005	晶方科技	13,472,481.98	2.28
44	600276	恒瑞医药	13,317,587.89	2.26
45	000961	中南建设	12,684,940.17	2.15
46	601628	中国人寿	11,870,754.84	2.01

注："本期累计买入金额"按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 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

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	600030	中信证券	54,004,351.90	9.16
2	600837	海通证券	51,161,634.01	8.67
3	300005	探路者	48,279,842.23	8.19
4	600999	招商证券	42,797,663.88	7.26
5	601318	中国平安	42,223,098.41	7.16
6	601901	方正证券	38,831,603.98	6.58
7	601555	东吴证券	33,563,870.97	5.69
8	002223	鱼跃医疗	32,919,759.17	5.58
9	601933	永辉超市	32,243,969.66	5.47
10	300137	先河环保	32,041,352.86	5.43
11	000783	长江证券	30,964,165.11	5.25
12	600511	国药股份	29,373,367.34	4.98
13	600015	华夏银行	27,738,055.70	4.70
14	000712	锦龙股份	27,552,930.64	4.67
15	000024	招商地产	27,011,719.50	4.58
16	600585	海螺水泥	25,255,773.91	4.28
17	600600	青岛啤酒	22,569,095.26	3.83
18	600688	上海石化	21,002,442.58	3.56
19	600309	万华化学	20,359,303.63	3.45
20	300104	乐视网	19,827,937.39	3.36
21	601601	中国太保	19,275,555.89	3.27
22	002008	大族激光	18,504,784.69	3.14
23	601628	中国人寿	18,272,156.85	3.10
24	600109	国金证券	17,972,370.70	3.05
25	600389	江山股份	17,944,208.28	3.04
26	000789	万年青	16,694,855.73	2.83
27	002353	杰瑞股份	16,529,407.65	2.80
28	002317	众生药业	16,213,576.45	2.75
29	000550	江铃汽车	16,136,421.83	2.74
30	600566	洪城股份	15,915,884.56	2.70
31	600801	华新水泥	15,884,309.13	2.69
32	002081	金 螳 螂	15,848,840.29	2.69
33	600690	青岛海尔	15,448,690.21	2.62
34	600720	祁连山	15,394,209.97	2.61
35	600276	恒瑞医药	15,326,511.76	2.60
36	000423	东阿阿胶	15,295,783.34	2.59
37	002514	宝馨科技	15,172,596.00	2.57
38	000961	中南建设	13,878,110.78	2.35
39	000729	燕京啤酒	12,965,382.14	2.20
40	600596	新安股份	12,832,606.95	2.18
41	002344	海宁皮城	12,799,415.63	2.17
42	601377	兴业证券	12,682,866.67	2.15

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。

8.4.3 买入股票的成本总额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)总额	1,701,281,655.52
卖出股票的收入(成交)总额	1,463,341,511.91

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	–	–
	其中：政策性金融债	–	–
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债	73,615,553.71	4.71
8	其他	–	–
9	合计	73,615,553.71	4.71

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	127002	徐工转债	399,285	71,394,553.71	4.57
2	110030	格力转债	22,210	2,221,000.00	0.14

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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。

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。

8.12.2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。

8.12.3 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	242,125.64
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	265,586.83
5	应收申购款	21,547,351.72
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	22,055,064.19

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	127002	徐工转债	71,394,553.71	4.57

8.12.5 期末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的情况。

8.12.6 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尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		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
33,577	37,436.88	268,493,387.45	21.36%	988,524,839.61	78.64%

9.2 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	1,381,322.22	0.11%

9.3期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2010年6月30日)基金份额总额	3,235,642,950.36
本报告期期初基金份额总额	756,457,043.77
本报告期基金总申购份额	991,686,346.63
减：本报告期基金总赎回份额	491,125,163.34
本报告期基金拆分变动份额	–
本报告期期末基金份额总额	1,257,018,227.06

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。

§11 重大事件揭示

11.1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。

11.2 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、基金管理人的重大人事变动：2014年12月31日本基金管理人发布公告，经公司第三届董事会第三十二次会议审议通过，同意战龙先生辞去公司总经理职务，并决定由公司董事长钱文挥先生代为履行公司总经理职务，代为履行总经理职务的期限不超过90日。期后变动（如有）敬请关注基金管理人发布的相关公告。

2、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动：本基金托管人2014年2月7日发布任免通知，解聘尹东中国建设银行投资托管业务部总经理助理职务，并于2014年11月3日发布公告，聘任赵观甫为中国建设银行投资托管业务部总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内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。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

11.5为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），本期审计费为60，000.00元。自本基金合同生效以来，本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

11.6 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本报告期内未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
上海华信证券有限责任公司	1	8,189,083.10	0.26%	7,455.39	0.26%	–
华创证券有限责任公司	1	59,933,368.11	1.91%	54,563.48	1.91%	–
申银万国证券股份有限公司	1	586,992,276.32	18.73%	534,397.94	18.73%	–
川财证券有限责任公司	1	56,286,450.89	1.80%	51,243.39	1.80%	–
招商证券股份有限公司	1	497,690,171.80	15.88%	453,097.68	15.88%	–
北京高华证券有限责任公司	1	38,373,683.67	1.22%	34,936.02	1.22%	–
中信建投证券股份有限公司	2	375,449,208.00	11.98%	341,808.85	11.98%	–
东方证券股份有限公司	2	330,101,320.42	10.53%	300,523.61	10.53%	–
兴业证券股份有限公司	1	327,816,839.03	10.46%	298,444.73	10.46%	–
国金证券股份有限公司	1	271,204,741.49	8.65%	246,905.41	8.65%	–
瑞银证券有限责任公司	1	162,329,677.95	5.18%	147,783.75	5.18%	–
长城证券有限责任公司	1	146,269,200.84	4.67%	133,163.94	4.67%	–
中信证券股份有限公司	1	139,868,057.76	4.46%	127,335.56	4.46%	–
中国银河证券股份有限公司	2	122,534,737.70	3.91%	111,555.62	3.91%	–
齐鲁证券有限公司	2	11,382,424.96	0.36%	10,362.76	0.36%	–
国联证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
国信证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
国泰君安证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
第一创业证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
华融证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
中国国际金融有限公司	1	–	–	–	–	–

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
申银万国证券股份有限公司	56,843,855.00	17.45%	–	–	–	–
川财证券有限责任公司	10,039,200.00	3.08%	–	–	–	–
招商证券股份有限公司	18,589,610.50	5.71%	–	–	–	–
中信建投证券股份有限公司	104,325,283.73	32.03%	–	–	–	–
东方证券股份有限公司	19,082,321.30	5.86%	–	–	–	–
兴业证券股份有限公司	8,558,272.84	2.63%	–	–	–	–
国金证券股份有限公司	71,917,775.80	22.08%	170,000,000.00	100.00%	–	–
瑞银证券有限责任公司	26,967,346.80	8.28%	–	–	–	–
中信证券股份有限公司	9,355,451.00	2.87%	–	–	–	–

注：1、报告期内，本基金新增交易单元为华创证券有限责任公司，终止交易单位为红塔证券股份有限公司，其它交易单元未发生变化；

2、租用证券公司专用交易单元的选择标准主要包括：券商基本面评价（财务状况和经营状况）、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）、券商每日信息评价（及时性和有效性）和券商协作表现评价等四个方面；

3、租用证券公司专用交易单元的程序：首先根据租用证券公司专用交易单元的选择标准进行综合评价，然后根据评价选择基金专用交易单元。研究部提交方案，并上报公司批准。

§12 影响投资者决策的其他重要信息

依据中国证监会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》（证监会公告[2008]38号）的有关规定和《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》的指导意见，经与基金托管人协商一致，本基金对其所持有的鱼跃医疗（证券代码：002223）股票自2014年3月28日起按照指数收益法进行估值，并已于2014年4月24日起恢复按市场价格进行估值；本基金对其所持有的先河环保（证券代码：300137）股票自2014年7月14日起按照指数收益法进行估值，并已于2014年8月18日起恢复按市场价格进行估值；本基金对其所持有的华策影视（证券代码：300133）股票自2014年8月21日起按照指数收益法进行估值，并已于2014年10月10日起恢复按市场价格进行估值；本基金对其所持有的东华软件（证券代码：002065）股票自2014年9月25日起按照指数收益法进行估值，并已于2014年11月19日恢复按市场价格进行估值。

交银施罗德基金管理有限公司

二〇一五年三月三十一日