# 交银施罗德先锋股票证券投资基金

## 【2015】第二季度报告

**基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司**
**基金托管人:中国农业银行股份有限公司**
**报告送出日期:二〇一五年七月十八日**

§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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年7月17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4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

| | | |
|---|---|---|
| 基金简称 | 交银先锋股票 | |
| 基金主代码 | 519698 | |
| 交易代码 | 519698(前端) | 519699(后端) |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2009年4月10日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 825,932,704.59份 | |
| 投资目标 | 本基金主要通过投资于经过严格的品质筛选且具有持续成长潜力企业的股票,特别是处于快速成长过程中的中型及小型企业股票,在适度控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求长期持续的资本增值。 | |
| 投资策略 | 本基金充分发挥基金管理人的研究优势,在分析和判断宏观经济运行和行业景气变化,以及上市公司成长潜力的基础上,主要通过优选成长性好、成长具有可持续性、成长质量优良、定价相对合理的股票,特别是处于快速成长过程中的中型及小型企业股票进行投资,以谋求超额收益。 | |
| 业绩比较基准 | 75%×中证700指数+25%×中信标普全债指数 | |
| 风险收益特征 | 本基金是一只股票型基金,以具有持续成长潜力企业的股票,特别是处于快速成长过程中的中型及小型企业为主要投资对象,属于证券投资基金中较高预期收益和较高风险的品种。 | |
| 基金管理人 | 交银施罗德基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国农业银行股份有限公司 | |

§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4月1日-2015年6月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 403,272,384.36 |
| 2.本期利润 | -33,543,798.67 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0690 |
| 4.期末基金资产净值 | 1,691,974,079.91 |
| 5.期末基金份额净值 | 2.0486 |

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

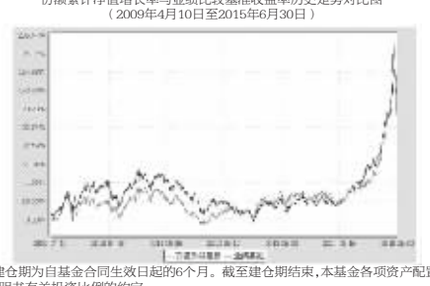
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 20.56% | 3.18% | 14.63% | 2.17% | 5.93% | 1.01% |

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

交银施罗德先锋股票证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2009年4月10日至2015年6月30日)



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。

§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 | | |
| 王少成 | 本基金、交银成长股票、交银先进制造股票、交银成长30股票的基金经理、公司权益投资总监 | 2013-05-29 | - | 11年 | 王少成先生,复旦大学硕士学历。历任上海融自资产管理公司研究员、中原证券投资经理、信诚基金管理有限公司研究总监助理、东吴基金管理有限公司投资经理、基金经理、投资部副总经理。其中2010年9月至2012年10月担任东吴新创业股票型证券投资基金基金经理,2011年2月至2012年11月担任东吴中证新兴产业指数证券投资基金基金经理,2011年5月至2012年11月担任东吴价值成长双动力股票型证券投资基金基金经理。2012年加入交银施罗德基金管理有限公司,历任公司权益部副总经理。 |
| 芮晨 | 本基金的基金经理 | 2015-05-18 | - | 8年 | 芮晨先生,内蒙古科技大学工学士。历任深圳尚诚资产管理有限公司研究员、研究副总监,国联安基金管理有限公司行业研究员、投资经理,2013年-2014年任浙商证券资产管理有限公司投资主办。2015年加入交银施罗德基金管理有限公司。 |

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所出现异常。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度,国内宏观经济继续低迷,PPI、CPI、工业增加值都在低位徘徊,政府加大了财政政策的力度。A股市场,四、五月份基本上延续了第一季度快速上涨的趋势;但是在六月份,迅速下跌。

本基金在2015年5月18号增聘芮晨先生担任本基金的基金经理。在随后的两周里,进行了较大幅度的调仓,现基金主要配置在互联网、医疗、军工、教育几个领域。二季度本基金净值跑赢业绩比较基准,主要缘于组合整体偏成长的风格。

展望未来一个季度,预计流动性仍处于宽松阶段,短期市场的大幅下跌缘于恐慌情绪的集中释放。我们认为中国在未来几年仍处于经济转型期,从基本面上看,新兴产业的需求和供给持续高度景气。市场的大幅下跌,恰恰给我们提供了一个以较便宜价格长期持有优质成长股的机会。在未来一个季度,甚至更长的时间里,我们的投资组合仍将偏于成长风格,并将坚持我们一贯的深入产业链调研,挖掘研究具有核心竞争力且长期成长空间大的优质个股;希望通过长期持有优质的个股来获得超额收益。本基金将继续努力为本基金份额持有人创造收益。

4.5报告期内基金的业绩表现

截至2015年6月30日,本基金份额净值为2.0486元,本报告期份额净值增长率为20.56%,同期业绩比较基准增长率为14.63%。

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 | 1,529,765,217.67 | 88.38 |
| | 其中:股票 | 1,529,765,217.67 | 88.38 |
| 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 | 100,679,334.79 | 5.82 |
| 7 | 其他资产 | 100,431,294.56 | 5.80 |
| 8 | 合计 | 1,730,875,847.02 | 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 | 1,067,907,937.55 | 63.12 |
| 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 | 14,469,663.00 | 0.86 |
| 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 | 412,336,354.72 | 24.37 |
| 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 | 35,051,262.40 | 2.07 |
| 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 | 1,529,765,217.67 | 90.41 |

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 | 300212 | 易华录 | 1,803,660 | 115,650,679.20 | 6.84 |
| 2 | 300365 | 恒华科技 | 2,983,109 | 102,111,821.07 | 6.04 |
| 3 | 300329 | 海伦钢琴 | 2,901,718 | 101,560,130.00 | 6.00 |
| 4 | 002390 | 信邦制药 | 4,522,658 | 80,865,125.04 | 4.78 |
| 5 | 600967 | 北方创业 | 3,642,334 | 76,015,510.58 | 4.49 |
| 6 | 300298 | 三诺生物 | 1,969,677 | 75,852,261.27 | 4.48 |
| 7 | 300101 | 振芯科技 | 1,300,220 | 72,292,232.00 | 4.27 |
| 8 | 300075 | 数字政通 | 1,914,637 | 72,162,668.53 | 4.26 |
| 9 | 002338 | 奥普光电 | 878,798 | 64,152,254.00 | 3.79 |
| 10 | 000768 | 中航飞机 | 1,415,800 | 61,700,564.00 | 3.65 |

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。

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 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 424,860.37 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 38,820.35 |
| 5 | 应收申购款 | 99,967,613.84 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 100,431,294.56 |

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 | 300212 | 易华录 | 115,650,679.20 | 6.84 | 重大事项 |
| 2 | 600967 | 北方创业 | 76,015,510.58 | 4.49 | 重大事项 |

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

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 466,181,899.82 |
| 本报告期期间基金总申购份额 | 560,205,424.39 |
| 减:本报告期期间基金总赎回份额 | 200,454,619.62 |
| 本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 | 825,932,704.59 |

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 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

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。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期内未进行本基金的申购、赎回、红利再投等。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会核准交银施罗德先锋股票证券投资基金募集的文件;

2、《交银施罗德先锋股票证券投资基金合同》;

3、《交银施罗德先锋股票证券投资基金招募说明书》;

4、《交银施罗德先锋股票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、关于申请募集交银施罗德先锋股票证券投资基金之法律意见书;

8、报告期内交银施罗德先锋股票证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

8.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

8.3 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。

# 交银施罗德先进制造股票证券投资基金

## 【2015】第二季度报告

**基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司**
**基金托管人:中国农业银行股份有限公司**
**报告送出日期:二〇一五年七月十八日**

§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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年7月17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4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

| | | |
|---|---|---|
| 基金简称 | 交银先进制造股票 | |
| 基金主代码 | 519704 | |
| 交易代码 | 519704(前端) | 519705(后端) |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2011年6月22日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 338,309,889.89份 | |
| 投资目标 | 本基金通过甄点投资于与装备制造相关的优质企业,把握中国产业结构升级的投资机会,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,自下而上挖掘与装备制造相关的上市公司投资机会,以谋求良好收益。 | |
| 业绩比较基准 | 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 | |
| 风险收益特征 | 本基金是一只股票型基金,属于基金中的高风险品种,本基金的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。 | |
| 基金管理人 | 交银施罗德基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国农业银行股份有限公司 | |

§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4月1日-2015年6月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 190,825,140.12 |
| 2.本期利润 | 86,316,852.73 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.2812 |
| 4.期末基金资产净值 | 778,631,598.54 |
| 5.期末基金份额净值 | 2.302 |

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

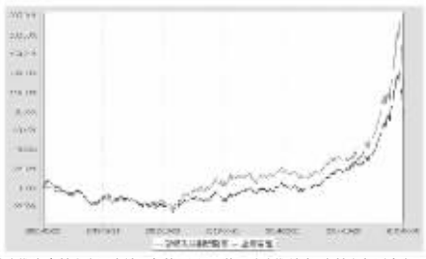
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 22.77% | 2.94% | 19.87% | 2.19% | 2.90% | 0.75% |

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

交银施罗德先进制造股票证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2011年6月22日至2015年6月30日)



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。

§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 | | |
| 王少成 | 本基金、交银成长股票、交银先锋股票、交银成长30股票的基金经理、公司权益投资总监 | 2013-03-21 | - | 11年 | 王少成先生,复旦大学硕士学历。历任上海融自资产管理公司研究员、中原证券投资经理、信诚基金管理有限公司研究总监助理、东吴基金管理有限公司投资经理、基金经理、投资部副总经理。其中2010年9月至2012年10月担任东吴新创业股票型证券投资基金基金经理,2011年2月至2012年11月担任东吴中证新兴产业指数证券投资基金基金经理,2011年5月至2012年11月担任东吴价值成长双动力股票型证券投资基金基金经理。2012年加入交银施罗德基金管理有限公司,历任公司权益部副总经理。 |
| 任相栋 | 本基金的基金经理 | 2015-01-21 | - | 5年 | 任相栋先生,上海交通大学金融学硕士。2010年加入交银施罗德基金管理有限公司,历任行业分析师。 |

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运作分析

2015年二季度,国内经济形势延续了低增长、低通胀的态势,美国经济部分经济指标走强,加息预期渐强。股票指数在二季度经历过山车,上证综指振幅达38.31%,创业板综指振幅更达到78.08%,市场巨大波动背后是投资者情绪的巨幅波动,股票市场流动性趋势性转向的预期和美国加息的预期。

本基金二季度配置均衡,从计算机、医疗设备等行业和个股中取得了一定超额收益。由于市场明显的泡沫化倾向,本基金6月中旬开始尝试降低股票配置比例,并对创业板股票进行着重减持,这点是领先于市场的。但由于对股市去杠杆冲击力的估计不足,在6月底减仓幅度仍然有限,本基金的收益率从6月中旬开始出现了明显的回调。

展望未来,从未来一个季度看,股票市场面临的不确定性因素仍然众多,这包括货币政策继续宽松的空间是否会低于投资者预期,美国加息对新兴市场国家的整体冲击等,眼前市场面临的投资者信心崩溃问题也亟待解决。但同时,我们必须看到,股指从6月以来的调整已演变为踩踏,泥沙俱下的市场在个股层面可能酝酿着新的机会。并且从更长远的眼光看,国内转型升级的进程仍然继续,居民增加金融配置的大趋势仍在,本基金希望能在控制好风险的情况下,在绝望中寻找新希望,为投资者创造更好的回报。

4.5报告期内基金的业绩表现

截至2015年6月30日,本基金份额净值为2.302元,本报告期份额净值增长率为22.77%,同期业绩比较基准增长率19.87%。

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 | 698,694,486.38 | 79.38 |
| | 其中:股票 | 698,694,486.38 | 79.38 |
| 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 | 179,704,539.23 | 20.42 |
| 7 | 其他资产 | 1,750,042.36 | 0.20 |
| 8 | 合计 | 880,149,067.97 | 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 | 17,291,520.00 | 2.22 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 514,427,518.75 | 66.07 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 16,265,413.00 | 2.09 |
| 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 | 96,869,601.90 | 12.44 |
| 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 | 15,659,374.95 | 2.01 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | 38,181,057.78 | 4.90 |
| | 合计 | 698,694,486.38 | 89.73 |

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 | 600389 | 江山股份 | 2,024,458 | 63,244,067.92 | 8.12 |
| 2 | 600967 | 北方创业 | 2,471,923 | 51,589,033.01 | 6.63 |
| 3 | 300166 | 东方国信 | 1,266,803 | 45,503,563.76 | 5.84 |
| 4 | 002169 | 智光电气 | 1,618,074 | 42,976,045.44 | 5.52 |
| 5 | 002053 | 云南盐化 | 1,331,309 | 38,221,881.39 | 4.91 |
| 6 | 600805 | 悦达投资 | 2,442,806 | 38,181,057.78 | 4.90 |
| 7 | 600707 | 彩虹股份 | 2,301,360 | 36,131,352.00 | 4.64 |
| 8 | 002180 | 艾派克 | 795,519 | 35,002,836.00 | 4.50 |
| 9 | 600835 | 上海机电 | 990,705 | 32,633,822.70 | 4.19 |
| 10 | 600418 | 江淮汽车 | 2,311,842 | 32,550,735.36 | 4.18 |

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。

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 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 297,838.91 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 31,540.77 |
| 5 | 应收申购款 | 1,420,662.68 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,750,042.36 |

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 | 600967 | 北方创业 | 51,589,033.01 | 6.63 | 重大事项 |

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

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 320,477,738.35 |
| 本报告期期间基金总申购份额 | 215,363,215.67 |
| 减:本报告期期间基金总赎回份额 | 197,531,064.13 |
| 本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 | 338,309,889.89 |

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 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

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。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期内未进行本基金的申购、赎回、红利再投等。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会核准交银施罗德先进制造股票证券投资基金募集的文件;

2、《交银施罗德先进制造股票证券投资基金合同》;

3、《交银施罗德先进制造股票证券投资基金招募说明书》;

4、《交银施罗德先进制造股票证券投资基金托管协议》;

5、关于募集交银施罗德先进制造股票证券投资基金之法律意见书;

6、基金管理人业务资格批件、营业执照;

7、基金托管人业务资格批件、营业执照;

8、报告期内交银施罗德先进制造股票证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

8.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

8.3 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。

# 交银施罗德现金宝货币市场基金

## 【2015】第二季度报告

**基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司**
**基金托管人:中信银行股份有限公司**
**报告送出日期:二〇一五年七月十八日**

§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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年7月17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4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 交银现金宝货币 |
| 基金主代码 | 000710 |
| 交易代码 | 000710 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2014年9月12日 |
| 报告期末基金份额总额 | 682,966,098.48份 |
| 投资目标 | 在力求本金安全性和资产充分流动性的前提下,追求超过业绩比较基准的投资收益。 |
| 投资策略 | 本基金在保持组合高度流动性的前提下,结合对国内外宏观经济运行、金融市场运行、资金流动格局、货币市场收益率曲线形态等各方面的分析,合理安排组合期限结构,积极选择投资工具,采取主动性的投资策略和精细化的操作手法。 |
| 业绩比较基准 | 活期存款利率(税后) |
| 风险收益特征 | 本基金属于货币市场基金,是证券投资基金中的低风险品种,长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。 |
| 基金管理人 | 交银施罗德基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中信银行股份有限公司 |

§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4月1日-2015年6月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 6,079,617.46 |
| 2.本期利润 | 6,079,617.46 |
| 3.期末基金资产净值 | 682,966,098.48 |

注:1、自合同生效日起,本基金按照0.25%的年费率计提销售服务费。

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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 净值收益率① | 净值收益率标准差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 | 1.1087% | 0.0071% | 0.0873% | 0.0000% | 1.0214% | 0.0071% |

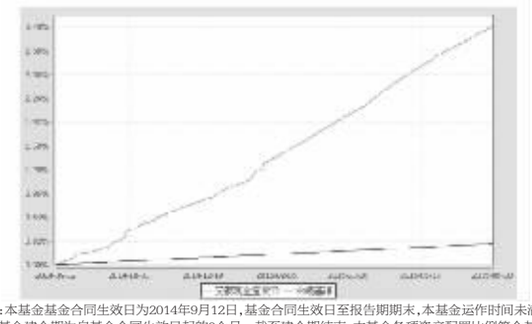
注:本基金收益分配按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

交银施罗德现金宝货币市场基金

累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2014年9月12日至2015年6月30日)



注:本基金基金合同生效日为2014年9月12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 | | |
| 林洪钧 | 本基金、交银货币、交银增利债券、交银信用添利债券(LOF)、交银理财21天债券、交银纯债债券发起的基金经理、公司固定收益部助理总经理 | 2014-09-12 | 2015-06-01 | 11年 | 林洪钧先生,复旦大学硕士。历任国泰君安证券股份有限公司上海分公司机构客户部客户经理、华安基金管理有限公司债券交易员、加拿大Financial Engineering Source Inc.金融研究员。2009年加入交银施罗德基金管理有限公司,历任专户投资部投资经理助理、专户投资经理、基金经理助理。2011年1月27日至2015年5月31日担任交银施罗德信用添利债券证券投资基金(LOF)基金经理;2011年6月9日至2015年5月31日担任交银施罗德货币市场证券投资基金基金经理,2012年11月5日至2015年5月31日担任交银施罗德理财21天债券型证券投资基金基金经理,2014年3月31日至2015年5月31日担任交银施