

## 信息披露

## disclosure

## 交银施罗德货币市场证券投资基金

# 交银施罗德精选混合型证券投资基金

[illegible]

基金管理人：交银施罗德基金管理有限责任公司 基金托管人：中国农业银行股份有限公司 报告送出日期：二〇一六年一月二十一日				6.2 报告期末按行业分类的股票投资组合			
基金管理人	基金托管人	报告送出日期		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	1,233,349,885.56	43.11
				D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	--	--
				E	建筑业	185,825,193.06	6.50
				F	批发和零售业	126,529,913.14	4.42
				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	282,543,609.29	9.88
				J	金融业	--	--
				K	房地产业	52,759,630.40	1.85
				L	租赁和商务服务业	--	--
				M	科学技术服务业	--	--
				N	水利、环境和公共设施管理业	162,317,130.21	5.67
				O	居民服务、修理和其他服务业	--	--
				P	教育	--	--
				Q	卫生和社会工作	406,247,261.96	14.20
				R	文化、体育和娱乐业	--	--
				S	综合	--	--
				合计		2,449,612,609.52	85.63

  

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	300347	泰格医药	6,947,802	210,501,433.48	7.36
2	260073	通威股份	3,392,180	186,686,663.60	6.84
3	002717	岭南园林	3,000,000	131,700,000.00	4.60
4	002475	立讯精密	4,000,000	127,800,000.00	4.47
5	002020	京新药业	3,686,889	120,490,626.96	4.34
6	300111	汉仪技术	4,009,745	119,430,000.00	4.18
7	002388	太极股份	1,499,895	100,642,594.00	3.52
8	600276	恒瑞医药	2,000,000	98,240,000.00	3.43
9	002727	心家	1,347,705	72,154,780.15	2.52
10	600054	广弘济世	3,007,040	71,000,530.04	2.48

  

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券			--	--
2	央行票据			--	--
3	金融债			130,536,000.00	4.56
4	企业债			--	--
5	企业中期票据			130,536,000.00	4.56
6	中期票据			--	--
7	可转债(可交换债)			--	--
8	回购			--	--
9	其他			--	--
10	合计			130,536,000.00	4.56

  

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	150416	15农发16	1,000,000	100,230,000.00	3.50
2	110412	11农发12	300,000	30,306,000.00	1.06

# 交银施罗德蓝筹混合型证券投资基金

2015 第四季度报

交银施罗德基金

2015

第

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：二〇一六年一月二十一日

§1 重要提示

基金管理人的董事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。

基金托管人中国建设银行根据本基金合同约定的投资范围，于2016年1月20日定期复核了本报告期内财务指标、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。

基金管理人承诺不代表或不保证未来业绩。投资者有独立的投资决策权并自行承担其基金的风险与损失。

基金的过往业绩并不预示未来表现。投资者在作出投资决策前应当仔细阅读基金的全招募说明书。

本基金的申购费率按如下标准执行：  
本基金自2015年10月1日起至12月31日止。

§2 产品基本情况

基金简称	交银蓝筹混合
基金主代码	519694
交易代码	519694(前缀)                519694(后缀)
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年08月8日
报告期末基金份额总额	3,256,921,412.52份
投资目标	本基金为一只股票型组合型基金，主要通过投资于业绩优良、发展潜力大、并在行业内具有领先地位、中小市值的蓝筹、上市公司股票，在有效控制风险并持有资产良好流动性的前提下，追求在稳定分红的基础上实现基金资产的长期稳健增长。
投资策略	本基金充分发掘基金管理人的研究优势，将严格、规范化的选股方法与积极主动的资产配置相结合，通过动态调整性择股，发展蓝筹，在行权内占有优质成长性、分红稳定的蓝筹上市公司股票进行投资，以求基金资产的长期稳健增长。
业绩比较基准	75% × 中证红利指数 + 25% × 中证全指金融指数
风险收益特征	本基金是一只股票型基金，以蓝筹蓝筹股为主要投资对象，其风险和预期收益均高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金，属于承担较高风险、预期收益较高的证券投资基金品种。
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

注：本基金最近披露时间为2015年10月31日，其中“75%×中证红利指数+25%×中证全指金融指数”变更为“75%×中证100指数+25%×中证红利指数”，并适用基金管理人于2015年10月31日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金业绩比较基准变更的公告》。

§3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期 (2015年10月1日至2015年12月31日)	单位:人民币元
1.本期已实现收益	226,911,665.63	
2.本期公允价值变动损益	659,581,592.14	
3.加权平均基金本期净利润	0.1968	
4.期末基金资产净值	3,140,145,988.07	
5.期末基金份额净值	0.9644	

注：上述基金净值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率水平要低于下列数字）；

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（不含公允价值变动损益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本基金实现的利润总额扣除公允价值变动损益。

§2 基金净值表现

3.1 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 率①	业绩比较基准 率②	业绩比较基准差 率③=①-②	①-③	②-④	
过去三个月	25.10%	1.79%	11.35%	1.19%	13.75%	0.60%

注：本基金最近披露时间为2015年10月31日，其中“75%×中证100指数+25%×中证红利指数”变更为“75%×中证100指数+25%×中证红利指数”，并适用基金管理人于2015年10月31日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金业绩比较基准变更的公告》。

3.2 自基金合同生效以来基金的各项主要指标及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

交银施罗德蓝筹混合证券投资基金基金合同生效后前六个月至本报告期末期间基金份额净值增长率及其与业绩比较基准收益率对比图  
(2007年08月8日至2015年12月31日)

比例约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经营（或基金经理组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
陈茂辉	交银施罗德的基金 投研、公司研究助理兼基金经理	2014-10-22	-	7年	张庆华先生，清华大学材料科学与工程师。2008年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任行业分析员、高级研究员。

注：基金经理（或基金经理组）简历公告（如有）请见关于基金经理人发布的公开信息。

4.2 管理人对报告期内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守了《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，并未有损害基金份额持有人利益的行为。

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限制制度和公平交易流程来保证旗下基金运作的公平，旗下所管理的所有资产组合，包括证券投资基金资产管理业务均严格执行风险控制制度并实行公平交易。

公司建立股票交易系统研究信息平台，确保各投资组合经理投资授权、投资建议以及投资决策方案均有公平的机会，公司同时建立了公平交易控制机制，建立公平的交易分配机制，对于交易所公开竞价交易，遵循“价格优先、时间优先、比例分摊”的原则，通过交易系统集中执行指令；对于非集中竞价交易，以公司在交易中的最优交易，遵循“价格优先、时间优先”的原则由系统自动执行交易指令并实时进行分配。

公司中央交易室和执行风险管理部作为日常交易部门为监控，风险管理部负责应对不同客户公平交易进行事前审查，并于每季度和每年例行对公司管理的不设投资限制的账户和基金账户，分别就类别别的数据差异及在不同时间段内同类型的交易的价差进行分析，通过评估报告反馈给基金经理和公司交易管理部门核查。

报告期内公司严格执行公平交易管理制度，未发生任何违反公平交易的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于报告期内不存在异常交易行为。本报告期内，本公司管理的有投资组合参与参与的交易所公开竞价同日反向交易成交的异常交易没有超过规定当日已成交金额的千分之五，本基金与本公司管理的其他投资组合不存在不同时间段（如日内、日间、5日内）向同一交易对手方大额买卖证券情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年四季度市场环境在大厦下跌整体承压后，随着三季报发布利好刺激以及国家宽松的货币政策，四季度风格偏好明显转变，各板块个股出现明显的分化。虽然市场波动性风险有所显现，但在对审慎的审视下，资金流入的幅度与速度之难以想象到15年上半年末的水平，市场资金在各方向的分化下，中小市值个股依然成为市场反弹的首选，继续成为市场的主角。在整体行情波动加大的背景下，本基金保持持仓仓位，同时在风格配置上适当向成长型倾斜，整体维持积极策略。

第四季度的第一周，国内宏观经济数据令人担忧，一方面在预期的推出，股市市场的企稳和维稳功能的弱化会对市场的经济前景造成一定的压力，另一方面国内通胀率上升，而国内CPI通胀率下降，因此市场预期通胀率下降，通胀率下降会带动利率下降，从而带动股市上涨，但随后在美联储加息的预期下，国内经济前景不容乐观，在预期下进一步加剧的环境下，我们倾向于认为一季度仍然有债市布局与参与的预期，股市在年初与年末的大面积分化，使得进一步发展与回调并存。在上述复杂的环境下，本基金将根据以“稳中求进”和“回归现金”为主，更加重视流动性并与市场保持密切的联系，同时结合宏观政策的配置调整，持续提高基金资产市场可变现能力与风险控制基础。

4.5 报告期内基金的投资表现和基金业绩

截至2015年12月31日，本基金的净值为 0.9644 元，本报告期净值增长率为25.10%，同期业绩比较基准增长率为11.35%。4季度报告期末基金份额持有人数量及基金资产净值列明

本基金本报告期内无需特别说明。

§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	2,605,576,883.66	80.83
	其中：股票	2,605,576,883.66	80.83
2	固定收益投资	166,290,000.00	5.16
	其中：债券	166,290,000.00	5.16
	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	199,750,439.88	6.20
	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	247,126,841.85	7.67
7	其他资产	4,940,478.80	0.15
8	合计	3,222,596,641.19	100.00

合型证券投资基金

四 季 度 报 告

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	150416	15农发16	1,400,000	140,322,000.00	4.47
2	110021	航信转债	200,000	25,968,000.00	0.83

5.6 报告期末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

本报告期末前十名未持有资产支持证券。

5.7 报告期末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中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。

5.12 股指期货投资

序号	名称	金额(元)
1	存在保证金	2,239,573.97
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,924,779.60
5	应收申购款	676,122.23
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,840,475.80

5.12.4 报告期末持有的境外股指期货合约投资明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110031	航信转债	25,968,000.00	0.83

5.13.1 报告期末前十名股票中存在受争议情况的说明

5.13.2 本报告组合投资于其他证券的公允价值表述部分

由于销售人员的疏忽,分类之和与合计项之间可能存在误差。

§ 6 开放式基金份额变动

报告期初前基金总份额	3,428,591,285.04
本报告期间赎回基金总申购份额	33,990,271.18
减:本报告期间赎回基金总赎回份额	208,660,144.60
本报告期间净基金新发行变动的份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期末前基金总份额	3,255,921,412.62

注:1、如本报告期间发生转入、红利再投资业务,则总申购份额中包含该业务;  
2、如本报告期间发生转出业务,则总赎回份额中包含该业务。

7.1 基金管理人持有本基金基金份额变动情况

报告期初前基金持有人持有的本基金份额	23,710,503.49
本报告期间买入/申购总份额	-
本报告期间卖出/赎回总份额	-
报告期末前基金持有人持有的本基金份额	23,710,503.49
报告期末未持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.73

注:1、如本报告期间发生转入、红利再投资业务,则总申购份额中包含该业务;  
2、如本报告期间发生转出业务,则总赎回份额中包含该业务。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.13 投资组合报告附注

5.13.1 报告期内本基金投资的前十名证券中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。

5.13.2 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。

序号	股票名称	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	603665	鼎胜电子	5,000,000	158,435,000.00	5.08
2	600054	黄山旅游	6,000,000	141,660,000.00	4.51
3	002450	康得新	3,222,830	122,789,823.00	3.91
4	002555	顺发三七	2,500,000	122,150,000.00	3.89
5	002131	利欧股份	5,307,653	103,489,233.50	3.30
6	002456	欧菲光	2,989,984	93,068,382.60	2.96
7	600000	长江电力	6,779,915	91,935,647.40	2.93
8	600104	上汽集团	4,009,972	85,091,605.84	2.71
9	002508	老板电器	1,800,000	80,910,000.00	2.58
10	002081	金 蝶 蝶	4,699,982	76,587,663.76	2.44

5.4 报告期末按券种和分级的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	140,322,000.00	4.47
其中:政策性金融债	140,322,000.00	4.47	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转换债(可交换债)	25,968,000.00	0.83
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	166,290,000.00	5.30