

交银施罗德成长混合型证券投资基金

[2015] 第 四 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
基金管理人的董事会及高级管理人员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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同的约定，于2016年1月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等内容，确认本基金不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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未来表现。投资有风险，投资人应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。

本报告期内2015年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称：交银施罗德成长混合

基金主代码：619602

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2006年10月26日

报告期末基金份额总额：819,049,374份

投资目标：本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，主要投资于股票、债券以及货币市场工具，同时适当投资于权证、股指期货等金融衍生品种，在控制风险的前提下，力争为持有人谋求长期稳定的资本增值。

投资策略：本基金在充分把握宏观经济的研究成果，将宏观研究的选股方法与行业极点的投资风格相结合，在分析和判断宏观经济运行和行业景气变化，以及上市公司的成长性基础上，选择优质成长股，以获得可持续性、以及获取优厚的资本增值收益。

业绩比较基准：75%×沪深300指数+20%×上证综指+5%×银行存款利率（税后）

风险收益特征：本基金是一只股票型基金，以具有良好成长性的公司为主要投资对象，追求超越收益，其风险和预期收益高于货币市场基金和货币市场基金，低于股票型基金。

基金管理人：交银施罗德基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

§ 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10月1日-2015年12月31日)

1.本期已实现收益 124,900,293.47

2.本期利润 770,909,365.93

3.加权平均基金份额本期利润 0.09411

4.期末基金份额净值 4,079,489,444.83

5.期末基金份额净值 4,079,489,444.83

注：上述业绩表现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不计费用的收益水平。

2.本期利润即为本期收入加上公允价值变动收益。

3.2.1 本基金报告期内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 600000 中化国际 29,622,624 379,464,632.44 9.36

2 002180 汇源通信 9,681,207 256,467,657.63 6.29

3 002045 国电南瑞 9,365,226 176,719,252.60 4.33

4 002053 云南锗业 6,364,690 176,279,100.60 4.32

5 600673 通鼎光电 160,400,401.66 393.00

6 002280 联络互动 2,138,323 131,203,032.20 3.22

7 600029 南方航空 11,783,716 100,986,446.12 2.48

8 600201 春秋航空 1,983,744 96,008,380.00 2.37

9 600065 华联综超 2,224,367 94,134,788.24 2.31

5.4 本基金报告期内债券品种分类的证券投资组合

5.5 本基金报告期内股票品种分类的证券投资组合

5.6 本基金报告期内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 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 100000 国债 822,502,780.00

2 000000 国债 69,091,065.63

3 000000 国债 72,486,217.98

4 000000 国债 810,949,374.01

5.7 本基金报告期内公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资明细

序号 交易品种 交易价格(元/盎司) 数量(手) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 黄金 1290.00 1,000 1,290,000.00 0.03

2 银 14.50 1,000 14,500.00 0.00

3 铂 1,000.00 100 10,000.00 0.00

4 钯 1,000.00 100 10,000.00 0.00

5.8 本基金报告期内公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证及金融衍生品投资明细

序号 权证代码 交易品种 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

2 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

3 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

4 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

5 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

6 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

7 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

8 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

9 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

10 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

11 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

12 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

13 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

14 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

15 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

16 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

17 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

18 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

19 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

20 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

21 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

22 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

23 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

24 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

25 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

26 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

27 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

28 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

29 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

30 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

31 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

32 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

33 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

34 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

35 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

36 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

37 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

38 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

39 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

40 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

41 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

42 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

43 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

44 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

45 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

46 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

47 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

48 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

49 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

50 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

51 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

52 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

53 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

54 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

55 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

56 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

57 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

58 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

59 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

60 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

61 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

62 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

63 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

64 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

65 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

66 000000 权证 0 0.00 0.00 0.00

67 000000 权证 0 0.00