



交银施罗德精选股票证券投资基金

2014 第三季度 报告

2014年9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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年十月二十四日

61 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法律责任。
基金管理人交银施罗德基金管理有限公司根据本基金合同约定,于2014年10月23日复核了本报告中的财务资料、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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,投资者投资于本基金存在相应风险。
基金合同及招募说明书约定基金管理人应当承担的义务或责任,投资者投资于本基金并不免除基金管理人按照基金合同及招募说明书所应承担的义务或责任。
本报告自2014年7月1日起至9月30日止。

基金简称	交银施罗德股票
基金代码	519088
交易代码	519088 (前端) / 519089 (后端)
基金运作方式	契约开放式
报告期末生效日	2009年9月29日
报告期末基金份额总额	5,732,229,372.56份
投资目标	本基金投资于具有良好成长价值的股票资产,充分发掘具有研究和管理能力、自下而上精选个股,力争通过主动选股,有效规避风险,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	自上而下资产配置,自下而上精选证券,有效控制下行风险。
业绩比较基准	75%*中证1000指数+25%*中信综合指数
风险收益特征	本基金是一只股票型基金,属于证券投资基金中的较高风险品种,本基金的风险收益特征高于混合型基金,本基金的风险收益特征高于债券型基金。
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

3.1 主要财务指标

单位:人民币元	
主要财务指标	报告期 (2014年7月1日至2014年9月30日)
1.本期已实现收益	42,725,434.57
2.本期利润	383,513,724.43
3.加权平均基金份额本期利润	0.0665
4.期末基金资产净值	4,191,133,441.64
5.期末基金份额净值	0.7312

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低于所列数字;
2.本期利润为本期基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用和税金后的余额,本期利润与本期已实现收益以上期公允价值变动损益。

单位:人民币元	
报告期 (2014年7月1日至2014年9月30日)	报告期 (2014年7月1日至2014年9月30日)
1.本期基金份额净值增长率	0.83%
2.本期基金份额净值增长率标准差	0.67%
3.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益差	-0.35%
4.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益差标准差	0.16%

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低于所列数字;
2.本期利润为本期基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用和税金后的余额,本期利润与本期已实现收益以上期公允价值变动损益。

单位:人民币元	
报告期 (2014年7月1日至2014年9月30日)	报告期 (2014年7月1日至2014年9月30日)
1.本期基金份额净值增长率	0.83%
2.本期基金份额净值增长率标准差	0.67%
3.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益差	-0.35%
4.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益差标准差	0.16%

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低于所列数字;
2.本期利润为本期基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用和税金后的余额,本期利润与本期已实现收益以上期公允价值变动损益。

单位:人民币元	
报告期 (2014年7月1日至2014年9月30日)	报告期 (2014年7月1日至2014年9月30日)
1.本期基金份额净值增长率	0.83%
2.本期基金份额净值增长率标准差	0.67%
3.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益差	-0.35%
4.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益差标准差	0.16%

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低于所列数字;
2.本期利润为本期基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用和税金后的余额,本期利润与本期已实现收益以上期公允价值变动损益。

单位:人民币元	
报告期 (2014年7月1日至2014年9月30日)	报告期 (2014年7月1日至2014年9月30日)
1.本期基金份额净值增长率	0.83%
2.本期基金份额净值增长率标准差	0.67%
3.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益差	-0.35%
4.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益差标准差	0.16%

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低于所列数字;
2.本期利润为本期基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用和税金后的余额,本期利润与本期已实现收益以上期公允价值变动损益。

单位:人民币元	
报告期 (2014年7月1日至2014年9月30日)	报告期 (2014年7月1日至2014年9月30日)
1.本期基金份额净值增长率	0.83%
2.本期基金份额净值增长率标准差	0.67%
3.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益差	-0.35%
4.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益差标准差	0.16%

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低于所列数字;
2.本期利润为本期基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用和税金后的余额,本期利润与本期已实现收益以上期公允价值变动损益。

单位:人民币元	
报告期 (2014年7月1日至2014年9月30日)	报告期 (2014年7月1日至2014年9月30日)
1.本期基金份额净值增长率	0.83%
2.本期基金份额净值增长率标准差	0.67%
3.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益差	-0.35%
4.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益差标准差	0.16%

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低于所列数字;
2.本期利润为本期基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用和税金后的余额,本期利润与本期已实现收益以上期公允价值变动损益。

单位:人民币元	
报告期 (2014年7月1日至2014年9月30日)	报告期 (2014年7月1日至2014年9月30日)
1.本期基金份额净值增长率	0.83%
2.本期基金份额净值增长率标准差	0.67%
3.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益差	-0.35%
4.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益差标准差	0.16%

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低于所列数字;
2.本期利润为本期基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用和税金后的余额,本期利润与本期已实现收益以上期公允价值变动损益。

单位:人民币元	
报告期 (2014年7月1日至2014年9月30日)	报告期 (2014年7月1日至2014年9月30日)
1.本期基金份额净值增长率	0.83%
2.本期基金份额净值增长率标准差	0.67%
3.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益差	-0.35%
4.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益差标准差	0.16%

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低于所列数字;
2.本期利润为本期基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用和税金后的余额,本期利润与本期已实现收益以上期公允价值变动损益。

单位:人民币元	
报告期 (2014年7月1日至2014年9月30日)	报告期 (2014年7月1日至2014年9月30日)
1.本期基金份额净值增长率	0.83%
2.本期基金份额净值增长率标准差	0.67%
3.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益差	-0.35%
4.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益差标准差	0.16%

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低于所列数字;
2.本期利润为本期基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用和税金后的余额,本期利润与本期已实现收益以上期公允价值变动损益。

单位:人民币元	
报告期 (2014年7月1日至2014年9月30日)	报告期 (2014年7月1日至2014年9月30日)
1.本期基金份额净值增长率	0.83%
2.本期基金份额净值增长率标准差	0.67%
3.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益差	-0.35%
4.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益差标准差	0.16%

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低于所列数字;
2.本期利润为本期基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用和税金后的余额,本期利润与本期已实现收益以上期公允价值变动损益。

单位:人民币元	
报告期 (2014年7月1日至2014年9月30日)	报告期 (2014年7月1日至2014年9月30日)
1.本期基金份额净值增长率	0.83%
2.本期基金份额净值增长率标准差	0.67%
3.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益差	-0.35%
4.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益差标准差	0.16%

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低于所列数字;
2.本期利润为本期基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用和税金后的余额,本期利润与本期已实现收益以上期公允价值变动损益。

单位:人民币元	
报告期 (2014年7月1日至2014年9月30日)	报告期 (2014年7月1日至2014年9月30日)
1.本期基金份额净值增长率	0.83%
2.本期基金份额净值增长率标准差	0.67%
3.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益差	-0.35%
4.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益差标准差	0.16%

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低于所列数字;
2.本期利润为本期基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用和税金后的余额,本期利润与本期已实现收益以上期公允价值变动损益。

单位:人民币元	
报告期 (2014年7月1日至2014年9月30日)	报告期 (2014年7月1日至2014年9月30日)
1.本期基金份额净值增长率	0.83%
2.本期基金份额净值增长率标准差	0.67%
3.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益差	-0.35%
4.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益差标准差	0.16%

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低于所列数字;
2.本期利润为本期基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用和税金后的余额,本期利润与本期已实现收益以上期公允价值变动损益。

单位:人民币元	
报告期 (2014年7月1日至2014年9月30日)	报告期 (2014年7月1日至2014年9月30日)
1.本期基金份额净值增长率	0.83%
2.本期基金份额净值增长率标准差	0.67%
3.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益差	-0.35%
4.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益差标准差	0.16%

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低于所列数字;
2.本期利润为本期基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用和税金后的余额,本期利润与本期已实现收益以上期公允价值变动损益。

单位:人民币元	
报告期 (2014年7月1日至2014年9月30日)	报告期 (2014年7月1日至2014年9月30日)
1.本期基金份额净值增长率	0.83%
2.本期基金份额净值增长率标准差	0.67%
3.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益差	-0.35%
4.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益差标准差	0.16%

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低于所列数字;
2.本期利润为本期基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用和税金后的余额,本期利润与本期已实现收益以上期公允价值变动损益。

单位:人民币元	
报告期 (2014年7月1日至2014年9月30日)	报告期 (2014年7月1日至2014年9月30日)
1.本期基金份额净值增长率	0.83%
2.本期基金份额净值增长率标准差	0.67%
3.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益差	-0.35%
4.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益差标准差	0.16%

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低于所列数字;
2.本期利润为本期基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用和税金后的余额,本期利润与本期已实现收益以上期公允价值变动损益。

单位:人民币元	
报告期 (2014年7月1日至2014年9月30日)	报告期 (2014年7月1日至2014年9月30日)
1.本期基金份额净值增长率	0.83%
2.本期基金份额净值增长率标准差	0.67%
3.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益差	-0.35%
4.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益差标准差	0.16%

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低于所列数字;
2.本期利润为本期基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用和税金后的余额,本期利润与本期已实现收益以上期公允价值变动损益。

单位:人民币元	
报告期 (2014年7月1日至2014年9月30日)	报告期 (2014年7月1日至2014年9月30日)
1.本期基金份额净值增长率	0.83%
2.本期基金份额净值增长率标准差	0.67%
3.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益差	-0.35%
4.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益差标准差	0.16%

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低于所列数字;
2.本期利润为本期基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用和税金后的余额,本期利润与本期已实现收益以上期公允价值变动损益。

单位:人民币元	
报告期 (2014年7月1日至2014年9月30日)	报告期 (2014年7月1日至2014年9月30日)
1.本期基金份额净值增长率	0.83%
2.本期基金份额净值增长率标准差	0.67%
3.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益差	-0.35%
4.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益差标准差	0.16%

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低于所列数字;
2.本期利润为本期基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用和税金后的余额,本期利润与本期已实现收益以上期公允价值变动损益。

单位:人民币元	
报告期 (2014年7月1日至2014年9月30日)	报告期 (2014年7月1日至2014年9月30日)
1.本期基金份额净值增长率	0.83%
2.本期基金份额净值增长率标准差	0.67%
3.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益差	-0.35%
4.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益差标准差	0.16%

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低于所列数字;
2.本期利润为本期基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用和税金后的余额,本期利润与本期已实现收益以上期公允价值变动损益。

单位:人民币元	
报告期 (2014年7月1日至2014年9月30日)	报告期 (2014年7月1日至2014年9月30日)
1.本期基金份额净值增长率	0.83%
2.本期基金份额净值增长率标准差	0.67%
3.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益差	-0.35%
4.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益差标准差	0.16%

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低于所列数字;
2.本期利润为本期基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用和税金后的余额,本期利润与本期已实现收益以上期公允价值变动损益。

单位:人民币元	
报告期 (2014年7月1日至2014年9月30日)	报告期 (2014年7月1日至2014年9月30日)
1.本期基金份额净值增长率	0.83%
2.本期基金份额净值增长率标准差	0.67%
3.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益差	-0.35%
4.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益差标准差	0.16%

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低于所列数字;
2.本期利润为本期基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用和税金后的余额,本期利润与本期已实现收益以上期公允价值变动损益。

单位:人民币元	
报告期 (2014年7月1日至2014年9月30日)	报告期 (2014年7月1日至2014年9月30日)
1.本期基金份额净值增长率	0.83%
2.本期基金份额净值增长率标准差	0.67%
3.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益差	-0.35%
4.本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益差标准差	0.16%

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低于所列数字;
2.本期利润为本期基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用和税金后的余额,本期利润与本期已实现收益以上期公允价值变动损益。

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	2,212,127,531.76	52.78
D	电力、热力、燃气及生产供应业	54,592,689.28	0.59
E	建筑业	129,304,428.88	3.09
F	批发和零售业	295,979,402.66	7.06
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	309,561,654.99	7.39
J	金融业	-	-
K	房地产业	219,440,727.24	5.24
L	租赁和商务服务业	33,835,348.88	0.81
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施服务业	-	-
O	国防服务业、体育和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社公工作	239,631,548.48	5.72
R	文化、体育和娱乐业	169,302,927.77	3.82
S	综合	3,625,530,762.94	86.50

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	000768	中航飞机	13,763,109	171,320,912.21	5.19
2	002454	松发股份	10,281,549	164,009,522.04	3.92
3	300026	红日药业	4,466,451	136,200,407.83	3.25
4	002362	慕思股份	5,606,537	133,043,123.01	3.17
5	002881	金耀华	6,679,424	129,240,428.88	3.09
6	600763	通威股份	2,636,421	127,207,313.25	3.04
7	600848	长信科技	10,445,045	124,713,837.30	2.98
8	002475	弘业股份	3,560,188	116,903,571.60	2.78
9	300113	华测检测	3,388,427	116,276,643.37	2.77
10	000027	华力创通	23,572,070	114,324,559.50	2.73

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	140212	招商局12	800,000	80,088,000.00	1.91
2	140209	招商局9	298,760	35,253,680.00	0.84
3	140207	招商局7	300,000	30	