交银施罗德先进制造混合型证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015年12月31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

§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2016年1月20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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	交银先进制造混合	
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	453,576,306.10份	
投资目标	本基金通过重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%×中银万国装备制造指数收益率+25%×中证综合债券指数收益率	
风险收益特征	本基金是一只混合型基金,其风险和预期收益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	中国农业银行股份有限公司	

注:本基金业绩比较基准自2015年10月1日起,由"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"变更为"75%×申银万国装备制造指数收益率+25%×中证综合债券指数收益率",详情见本基金管理人于2015年9月28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并修改基金合同相关内容的公告》。

§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	233,798,630.65
2.本期利润	305,726,890.04
3.加权平均基金份额本期利润	0.7348
4.期末基金资产净值	1,197,137,426.51
5.期末基金份额净值	2.639

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	40.60%	1.86%	23.00%	1.61%	17.60%	0.25%

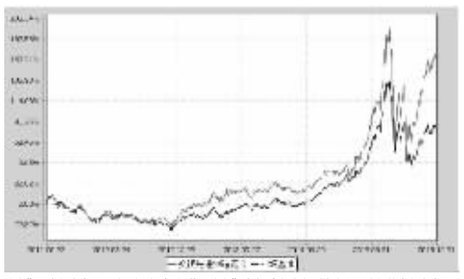
注:本基金业绩比较基准自2015年10月1日起,由"75%×申银万国装备制造指数收益率+25%×中信标普全债指数收益率"变更为"75%×申银万国装备制造指数收益率+25%×中证综合债券指数收益率",3.2.2同。详情见本基金管理人于2015年9月28日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金业绩比较基准变更并修改基金合同相关内容的公告》。

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混合型证券投资基金

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12月31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		
任相栋	交银先进制造混合的基金经理	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年四季度,国内经济先行指标出现了一些企稳迹象,美联储加息终于靴子落地,给全球风险资产带来了一段喘息之机。四季度国内证券市场精彩纷呈,国家的股市维稳意愿与大类资产配置的资产荒,共同推动了股指四季度明显的反弹行情,整体来看以创业板为代表的成长股涨幅明显高于传统行业蓝筹股。

本基金四季度业绩跑赢业绩比较基准,在9月底的市场底部,明显加仓了部分超跌的成长股,11月之后组合内股票的风格配置上做了些均衡,增加了部分高股息率个股的配置比例。

展望未来,2016年是十三五的开局之年,一些大的改革措施有望落地,GDP增速有望从前几年的明显下滑过渡到稳步寻底,部分新经济业态有望逐步走出初创阶段,这些经济生活的变化都会影响证券市场,因此我们有理由相信2016年的股票市场必定不会平淡,投资人需要做好的是去伪存真的工作。但同时需要注意的是,随着注册制的推进,2016年的股票供给可能会明显加大,经过一轮降息之后,预计国内边际上的货币宽松将会放缓,美国在2016年的加息幅度也使得全球流动性状况充满变数,这些因素都可能导致股票市场波动的加剧。本基金将继续致力于在控制好风险的情况下,努力为持有人赢得更高的回报。

4.5报告期内基金的业绩表现

截至2015年12月31日,本基金份额净值为2.639元,本报告期份额净值增长率为40.60%,同期业绩比较基准增长率23.00%。

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	1,121,514,960.85	86.52
	其中:股票	1,121,514,960.85	86.52
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	164,986,731.20	12.73
7	其他资产	9,734,550.76	0.75
8	合计	1,296,236,242.81	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	12,908,025.00	1.08
C	制造业	939,171,240.73	78.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	40,049,224.80	3.35
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	16,287,851.52	1.36
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	78,464,933.04	6.55
J	金融业	-	-
K	房地产业	13,306,085.76	1.11
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	21,327,600.00	1.78
S	综合	-	-
	合计	1,121,514,960.85	93.68

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	002456	欧菲光	3,073,526	95,340,776.52	7.96
2	000157	中联重科	11,017,278	58,942,437.30	4.92
3	600104	上汽集团	2,772,600	58,834,572.00	4.91
4	000768	中航飞机	2,311,900	57,265,763.00	4.78
5	002125	湘潭电化	2,445,751	57,108,285.85	4.77
6	600741	华域汽车	3,037,915	51,219,246.90	4.28
7	600389	江山股份	1,630,031	43,179,521.19	3.61
8	300322	硕贝德	2,075,566	40,473,537.00	3.38
9	300161	华中数控	935,958	34,368,377.76	2.87
10	300100	双林股份	1,095,001	34,295,431.32	2.86

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	1,790,615.26
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	36,424.94
5	应收申购款	7,907,510.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,734,550.76

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	600389	江山股份	43,179,521.19	3.61	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	385,263,007.06
本报告期期间基金总申购份额	137,817,231.02
减:本报告期期间基金总赎回份额	69,503,931.98
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	453,576,306.10

注:1、如果本报告期间发生转换人、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 影响投资者决策的其他重要信息

鉴于交银施罗德先进制造混合型证券投资基金的业绩比较基准的指数停止计算编制,本基金管理人根据基金合同的相关约定,经与基金托管人协商一致,并报中国证监会备案,决定自2015年10月1日起将交银施罗德先进制造混合型证券投资基金的业绩比较基准由原"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"变更为"75%×申银万国装备制造指数收益率+25%×中证综合债券指数收益率",并相应修改基金合同的有关内容。详情请见本基金管理人于2015年9月28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并修改基金合同相关内容的公告》。

§9 备查文件目录

9.1 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混合型证券投资基金基金合同》;

3、《交银施罗德先进制造混合型证券投资基金招募说明书》;

4、《交银施罗德先进制造混合型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混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

9.3 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。

交银施罗德先锋混合型证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015年12月31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

§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2016年1月20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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	交银先锋混合	
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	1,313,635,714.40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%×中证综合债券指数	
风险收益特征	本基金是一只混合型基金,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,追求超额收益,其风险和预期收益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	中国农业银行股份有限公司	

注:本基金业绩比较基准自2015年10月1日起,由"75%×中证700指数+25%×中信全债指数"变更为"75%×中证700指数+25%×中证综合债券指数",详情见本基金管理人于2015年9月28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并修改基金合同相关内容的公告》。

§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	94,819,343.69
2.本期利润	924,982,556.42
3.加权平均基金份额本期利润	0.7268
4.期末基金资产净值	2,832,050,950.98
5.期末基金份额净值	2.1559

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	52.01%	2.70%	17.36%	1.51%	34.65%	1.19%

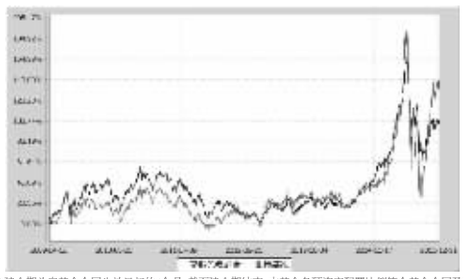
注:本基金业绩比较基准自2015年10月1日起,由"75%×中证700指数+25%×中信全债指数"变更为"75%×中证700指数+25%×中证综合债券指数",3.2.2同。详情见本基金管理人于2015年9月28日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金业绩比较基准变更并修改基金合同相关内容的公告》。

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

交银施罗德先锋混合型证券投资基金

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12月31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		
芮晨	交银先锋混合的基金经理	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年四季度,经济基本面方面仍延续前三季度的特征。传统经济继续下滑,PPI、工业增加值等总体经济指标继续回落。新兴经济仍然在持续创新进步中,同时不少传统产业厂家积极投身新兴产业,或转型,或基于自身优势向创新做延展、做渗透。市场层面,四季度市场涨幅较大,尤其是以新兴产业为代表的中小创。我们在2015年三季度曾提出坚定看好四季度,并认为在市场极大幅度的风险释放后,新兴产业的很多领导企业有了一个非常好的投资机会。市场印证了我们的看法。

四季度,本基金净值上涨幅度较大。原因在于:我们在市场大幅调整中,依然坚持一贯的投资策略没有动摇,依然坚守经过深入调研长期看好的公司。

对于2016年一季度,我们预计市场仍会持续向上,我们大概率将保持风格不变。

4.5报告期内基金的业绩表现

截至2015年12月31日,本基金份额净值为2.1559元,本报告期份额净值增长率为52.01%,同期业绩比较基准增长率为17.36%。

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	2,676,373,845.09	92.56
	其中:股票	2,676,373,845.09	92.56
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	200,531,667.75	6.94
7	其他资产	14,599,139.67	0.50
8	合计	2,891,504,652.51	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	1,784,637,870.66	63.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	117,408,954.99	4.15
F	批发和零售业	90,733,654.63	3.20
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	600,421,622.33	21.20
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	83,171,742.48	2.94
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,676,373,845.09	94.50

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	300365	恒华科技	6,134,651	264,403,458.10	9.34
2	300329	海伦钢琴	7,080,711	194,577,938.28	6.87
3	002117	东港股份	3,753,076	172,716,557.52	6.10
4	300212	易华录	3,147,195	145,305,993.15	5.13
5	300073	当升科技	3,596,151	139,638,543.33	4.93
6	300279	和晶科技	2,749,728	136,936,454.40	4.84
7	002098	浔兴股份	8,339,319	128,925,871.74	4.55
8	300161	华中数控	3,408,780	125,170,401.60	4.42
9	300262	巴安水务	6,322,507	117,408,954.99	4.15
10	002390	信邦制药	8,134,160	116,725,196.00	4.12

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	2,089,894.01
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	45,287.48
5	应收申购款	12,463,958.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,599,139.67

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	300365	恒华科技	264,403,458.10	9.34	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	1,296,259,783.23
本报告期期间基金总申购份额	593,678,403.65
减:本报告期期间基金总赎回份额	576,302,472.48
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	1,313,635,714.40

注:1、如果本报告期间发生转换人、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 影响投资者决策的其他重要信息

鉴于交银施罗德先锋混合型证券投资基金的业绩比较基准的指数停止计算编制,本基金管理人根据基金合同的相关约定,经与基金托管人协商一致,并报中国证监会备案,决定自2015年10月1日起将交银施罗德先锋混合型证券投资基金的业绩比较基准由原"75%×中证700指数+25%×中信全债指数"变更为"75%×中证700指数+25%×中证综合债券指数",并相应修改基金合同的有关内容。详情请见本基金管理人于2015年9月28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并修改基金合同相关内容的公告》。

§9 备查文件目录

9.1 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、《交银施罗德先锋混合型证券投资基金基金合同》;

3、《交银施罗德先锋混合型证券投资基金招募说明书》;

4、《交银施罗德先锋混合型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混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

9.3 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。

交银施罗德信用添利债券证券投资基金(LOF)

2015 第四季度 报告

2015年12月31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

§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2016年1月20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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	交银信用添利债券(LOF)	
场内简称	交银添利	
基金主代码	164902	
交易代码	164902(前端)	164903(后端)
基金运作方式	上市契约型开放式	
基金合同生效日	2011年1月27日	
报告期末基金份额总额	94,921,723.81份	
投资目标	本基金根据宏观经济运行状况和金融市场的运行趋势,自上而下进行宏观分析,自下而上精选个券,在控制信用风险、利率风险和流动性风险前提下,力求通过主动承担适度信用风险获得持续投资收益,谋求基金资产的长期稳定增长。	
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势,将规范化的基本面研究、严谨的信用分析与积极主动的投资风格相结合,在分析和判断宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上,动态调整大类金融资产比例,自上而下决定债券组合久期及债券类属配置;在严谨深入的信用分析基础上,综合考量信用债券的信用评级、以及各类债券的流动性、供求关系和收益率水平等,自下而上地精选个券。同时,本基金也会关注股票一级市场、权证一级市场等其它相关市场存在的投资机会,力争实现基金总体风险收益特征保持不变前提下的基金资产增值最大化。	
业绩比较基准	80%×中债企业债总全价指数收益率+20%×中债国债总全价指数收益率	
风险收益特征	本基金是一只债券型基金,属于证券投资基金中中等风险的品种,其长期平均的预期收益和风险高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。	
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	

注:根据本基金《基金合同》及《招募说明书》的相关规定,本基金在基金合同生效之日起三年(含三年)的期间内,采取封闭式运作,在深圳证券交易所上市交易,封闭期结束后转为上市开放式基金(LOF)。本基金封闭期自2011年1月27日(基金合同生效日)起至2014年1月27日止,自2014年1月28日起基金运作方式转为"上市契约型开放式",并于同日起开放本基金的申购、赎回业务。本基金在募集期仅开通前端基金份额的认购,转为上市开放式基金(LOF)后同时开通前端基金份额和后端基金份额的申购和赎回。

§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	1,480,185.57
2.本期利润	2,450,825.59
3.加权平均基金份额本期利润	0.0264
4.期末基金资产净值	125,855,460.74
5.期