



Disclosure 信息披露

2016年 3 月 5 日 星期一
zqsb@stcn.com (0755)83501750

B58

(上接B57版)

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	234,099,335.62	74.93
其中:股票	234,099,335.62	74.93	
2	固定收益投资	10,029,000.00	3.21
其中:债券	10,029,000.00	3.21	
3	货币资金	-	-
其中:银行存款	-	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
其中:买入返售金融资产	-	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	67,046,784.20	21.46
7	其他资产	1,276,101.50	0.41
合计	312,491,231.32	100.00	

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	-	-
B	医药	-	-
C	制造业	141,210,639.30	47.47
D	电力、热力、燃气及水利生产和供应业	-	-
E	建筑业	7,412,605.47	2.49
F	批发和零售业	9,908,012.00	2.33
G	交通运输、仓储和邮政业	7,129,883.32	2.40
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	43,748,013.85	14.71
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	27,670,162.68	9.30
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		234,099,335.62	78.69

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	占基金资产净值比例(%)
1	600545	黄山旅游	1,149,473	27,139,957.53	9.12
2	300171	伟创力	516,738	15,491,865.24	5.21
3	300161	华中数控	331,564	12,175,038.08	4.09
4	300352	北方新	194,809	12,135,081.60	4.09
5	002095	生意宝	145,908	10,737,369.72	3.61
6	002094	普洛康	302,560	9,422,875.00	3.17
7	002667	顺鑫股份	123,700	9,252,760.00	3.11
8	002390	信邦股份	643,800	9,238,530.00	3.11
9	300137	华信国际	425,900	8,886,705.00	2.99
10	600730	中航地产	986,730	8,712,561.00	2.93

4.报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	10,029,000.00	3.37
4	其他信用债	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	资产支持证券	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,029,000.00	3.37

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

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	150211	15国债11	100,000	10,029,000.00	3.37

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。

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。

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。

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。

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。

11.投资组合报告附注

(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发行主体未受到公开谴责和处罚。

(2) 本基金投资的前十名证券中,没有超出基金合同约定的备选股票库之外的股票。

(3) 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	398,508.07
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收股利	-
5	其他应收款	219,512.68
6	其他	658,026.75
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,276,101.50

(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) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

(6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于报告期内,分派之和与合计数项之间可能存在尾差。

本基金的投资范围、投资策略和与合计数项之间可能存在尾差。

最低投资:基金的投资业绩并不代表其未来表现。投资者在进行投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

下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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

1.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

(1) 交银施罗德先锋行业灵活配置混合型证券投资基金业绩比较基准

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③	业绩比较基准收益标准差④	①-③	②-④
过去三个月	34.18%	1.67%	10.87%	1.00%	23.31%	0.67%
2015年度	81.94%	2.22%	7.75%	1.50%	47.19%	0.12%
2014年度	38.06%	0.96%	33.63%	0.75%	4.43%	0.21%
2013年度	10.97%	1.01%	-3.46%	0.84%	14.43%	0.17%
基金合同自2012年2月3日起	-2.41%	0.76%	2.71%	0.72%	-5.12%	0.04%

注:交银施罗德保本混合型证券投资基金自2012年2月3日起正式转型为交银施罗德先锋行业灵活配置混合型证券投资基金,本报告列示的基金业绩指标自转型日起适用。转型后基金业绩指标较转型前交银施罗德保本混合型证券投资基金业绩指标发生变动及其与同期业绩比较基准变动+40%×沪深300指数收益率+40%×中信标普全债指数收益率+60%×沪深300指数收益率+40%×中证综合债指数收益率,详见本基金管理人于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条款的公告》。

(2) 交银施罗德保本混合型证券投资基金业绩比较基准

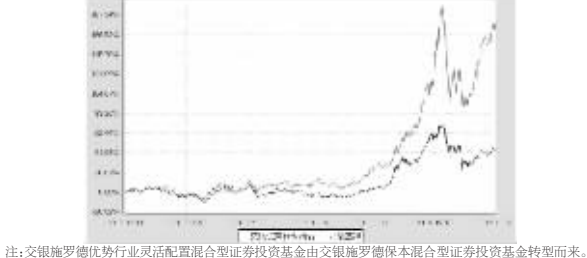
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益③	业绩比较基准收益标准差④	①-③	②-④
2012年1月1日至2012年2月21日	0.37%	0.04%	0.41%	0.03%	-0.04%	0.01%
2013年度	-0.74%	0.28%	4.54%	0.01%	-5.28%	0.27%
2014年度	4.33%	0.38%	3.38%	0.01%	0.95%	0.37%
2015年度	7.50%	0.25%	3.19%	0.01%	4.31%	0.24%

注:交银施罗德保本混合型证券投资基金自2012年2月3日起正式转型为交银施罗德先锋行业灵活配置混合型证券投资基金,本报告列示的基金业绩指标自转型日起适用。转型后基金业绩指标较转型前交银施罗德保本混合型证券投资基金业绩指标发生变动及其与同期业绩比较基准变动+40%×沪深300指数收益率+40%×中证综合债指数收益率,详见本基金管理人于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条款的公告》。

2.基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

(1) 自基金合同生效以来基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

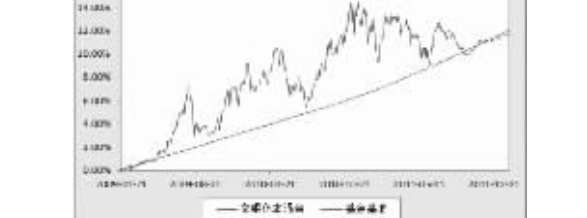
交银施罗德先锋行业灵活配置混合型证券投资基金业绩比较基准历史走势图(2012年2月3日至2015年12月31日)



注:交银施罗德先锋行业灵活配置混合型证券投资基金由交银施罗德保本混合型证券投资基金转型而来。基金合同自2012年2月3日起,交银施罗德先锋行业灵活配置混合型证券投资基金的投资组合与交银施罗德保本混合型证券投资基金的投资组合一致。截至本报告期末,交银施罗德先锋行业灵活配置混合型证券投资基金的投资组合与交银施罗德保本混合型证券投资基金的投资组合一致。

(2) 自基金合同生效以来基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

交银施罗德保本混合型证券投资基金业绩比较基准历史走势图(2012年2月3日至2015年12月31日)



注:交银施罗德保本混合型证券投资基金的建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至建仓期结束,其各项资产配置比例符合基金合同约定的投资比例。

十三、基金的费用与税收

(一) 基金费用的种类

1. 基金管理人报酬

2. 基金托管人报酬

3. 基金合同生效后与基金相关的信息披露费用

4. 基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费

5. 基金份额持有人大会费用

6. 基金的证券交易费用

7. 基金的银行汇兑费用

8. 基金的其他费用

9. 基金终止清算时发生费用,按实际支出从基金财产中列支

(二) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1. 基金管理人报酬

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%的年费率计提。管理费的计算方法如下:

本基金管理费按季计提,逐日累计至每月月末,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,基金托管人复核后于次月2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

(2) 基金托管人的报酬

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

本基金托管费按季计提,逐日累计至每月月末,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,基金托管人复核后于次月2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

上述(一)基金费用的种类中第3—8项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金管理人承担,并从基金财产中支付。

(三) 基金销售费用

1. 申购费用

本基金申购费由申购人承担,即在申购时支付申购费用;日后本基金将择机开通后端收费模式,即在赎回时才支付相应的申购费用,该费用按基金份额的持有时间摊销。

申购人申购费用由基金管理人承担,不列入基金财产,主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

投资者可以多次申购本基金,申购费率按每笔申购申请单独计算。

本基金的申购费率如下:

申购金额(含申购费)	申购费率
100元以下	1.5%
100元(含)至500元	1.0%
500元(含)至1,000元	0.8%
1,000元(含)以上	0.6%

注:申购费用由申购人承担,不列入基金财产,主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

赎回费用

本基金的赎回费用由赎回人承担,赎回费率按每笔赎回申请单独计算。

本基金的赎回费率如下:

持有时间	赎回费率
7天以内	1.5%
7天至30天	1.0%
30天至90天	0.8%
90天至180天	0.6%
180天以上	0.4%

注:赎回费用由赎回人承担,不列入基金财产,主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

基金管理人可以根据法律法规及基金合同的有关规定调整上述收费方式和费率,并应在调整后的收费方式和费率实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

(四) 基金转换费用

本基金转换费用由申购人承担,即在申购时支付申购费用;日后本基金将择机开通后端收费模式,即在赎回时才支付相应的申购费用,该费用按基金份额的持有时间摊销。

申购人申购费用由基金管理人承担,不列入基金财产,主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

投资者可以多次申购本基金,申购费率按每笔申购申请单独计算。

本基金的申购费率如下:

申购金额(含申购费)	申购费率
100元以下	1.5%
100元(含)至500元	1.0%
500元(含)至1,000元	0.8%
1,000元(含)以上	0.6%

注:申购费用由申购人承担,不列入基金财产,主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

赎回费用

本基金的赎回费用由赎回人承担,赎回费率按每笔赎回申请单独计算。

本基金的赎回费率如下:

持有时间	赎回费率
7天以内	1.5%
7天至30天	1.0%
30天至90天	0.8%
90天至180天	0.6%
180天以上	0.4%

注:赎回费用由赎回人承担,不列入基金财产,主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

基金管理人可以根据法律法规及基金合同的有关规定调整上述收费方式和费率,并应在调整后的收费方式和费率实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

(五) 基金转换费用

本基金转换费用由申购人承担,即在申购时支付申购费用;日后本基金将择机开通后端收费模式,即在赎回时才支付相应的申购费用,该费用按基金份额的持有时间摊销。

申购人申购费用由基金管理人承担,不列入基金财产,主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

投资者可以多次申购本基金,申购费率按每笔申购申请单独计算。

本基金的申购费率如下:

申购金额(含申购费)	申购费率
100元以下	1.5%
100元(含)至500元	1.0%
500元(含)至1,000元	0.8%
1,000元(含)以上	0.6%

注:申购费用由申购人承担,不列入基金财产,主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

赎回费用

本基金的赎回费用由赎回人承担,赎回费率按每笔赎回申请单独计算。

本基金的赎回费率如下:

持有时间	赎回费率
7天以内	1.5%
7天至30天	1.0%
30天至90天	0.8%
90天至180天	0.6%
180天以上	0.4%

注:赎回费用由赎回人承担,不列入基金财产,主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

基金管理人可以根据法律法规及基金合同的有关规定调整上述收费方式和费率,并应在调整后的收费方式和费率实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

(六) 基金转换费用

本基金转换费用由申购人承担,即在申购时支付申购费用;日后本基金将择机开通后端收费模式,即在赎回时才支付相应的申购费用,该费用按基金份额的持有时间摊销。

申购人申购费用由基金管理人承担,不列入基金财产,主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

投资者可以多次申购本基金,申购费率按每笔申购申请单独计算。

本基金的申购费率如下:

申购金额(含申购费)	申购费率
100元以下	1.5%
100元(含)至500元	1.0%
500元(含)至1,000元	0.8%
1,000元(含)以上	0.6%

注:申购费用由申购人承担,不列入基金财产,主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

赎回费用

本基金的赎回费用由赎回人承担,赎回费率按每笔赎回申请单独计算。

本基金的赎回费率如下:

持有时间	赎回费率
7天以内	1.5%
7天至30天	1.0%
30天至90天	0.8%
90天至180天	0.6%
180天以上	0.4%

注:赎回费用由赎回人承担,不列入基金财产,主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

基金管理人可以根据法律法规及基金合同的有关规定调整上述收费方式和费率,并应在调整后的收费方式和费率实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

(七) 基金转换费用

本基金转换费用由申购人承担,即在申购时支付申购费用;日后本基金将择机开通后端收费模式,即在赎回时才支付相应的申购费用,该费用按基金份额的持有时间摊销。

申购人申购费用由基金管理人承担,不列入基金财产,主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

投资者可以多次申购本基金,申购费率按每笔申购申请单独计算。

本基金的申购费率如下:

申购金额(含申购费)	申购费率
100元以下	1.5%
100元(含)至500元	1.0%
500元(含)至1,000元	0.8%
1,000元(含)以上	0.6%

注:申购费用由申购人承担,不列入基金财产,主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

赎回费用

本基金的赎回费用由赎回人承担,赎回费率按每笔赎回申请单独计算。

本基金的赎回费率如下:

持有时间	赎回费率
7天以内	1.5%
7天至30天	1.0%
30天至90天	0.8%
90天至180天	0.6%
180天以上	0.4%

注:赎回费用由赎回人承担,不列入基金财产,主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

基金管理人可以根据法律法规及基金合同的有关规定调整上述收费方式和费率,并应在调整后的收费方式和费率实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

(八) 基金转换费用

本基金转换费用由申购人承担,即在申购时支付申购费用;日后本基金将择机开通后端收费模式,即在赎回时才支付相应的申购费用,该费用按基金份额的持有时间摊销。

申购人申购费用由基金管理人承担,不列入基金财产,主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

投资者可以多次申购本基金,申购费率按每笔申购申请单独计算。

本基金的申购费率如下:

申购金额(含申购费)	申购费率
100元以下	1.5%
100元(含)至500元	1.0%
500元(含)至1,000元	0.8%
1,000元(含)以上	0.6%

注:申购费用由申购人承担,不列入基金财产,主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

赎回费用

本基金的赎回费用由赎回人承担,赎回费率按每笔赎回申请单独计算。

本基金的赎回费率如下:

持有时间	赎回费率
7天以内	