

交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金
2014 年年度报告摘要
2014 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：二〇一五年三月三十一日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司(以下简称“中国农业银行”)根据本基金合同规定，于 2015 年 3 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2014 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	交银定期支付双息平衡混合
基金主代码	519732
交易代码	519732
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 9 月 4 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
报告期末基金份额总额	173,082,094.97 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金精选具有长期增长潜力和较好分红能力的股票，以及具有较高息票率的债券，力争实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金精选具有较好现金分红能力、长期增长潜力且估值水平合理的上市公司以及具有较高息票率的债券，通过在股票和债券等不同类别资产中的平衡配置，追求基金资产在风险可控前提下的持续增值，充分享受股票分红和债券利息的双重收益。
业绩比较基准	50%×中证红利指数收益率+50%×中债综合全价指数收益率
风险收益特征	本基金是一只混合型基金，在证券投资基金中属于较高风险的品种，其长期平均风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		交银施罗德基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙艳	林葛
	联系电话	021-61055050	010-66060069

	电子邮箱	xxpl@jysld.com, disclosure@jysld.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-700-5000, 021-61055000	95599
传真		021-61055054	010-68121816

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fund001.com, www.bocomschroder.com
基金年度报告备置地点	基金管理人的办公场所

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2014 年	2013 年 9 月 4 日（基金合同生效日）至 2013 年 12 月 31 日
本期已实现收益	30,699,795.90	12,068,178.98
本期利润	62,101,355.21	8,577,739.02
加权平均基金份额本期利润	0.2022	0.0139
本期基金份额净值增长率	28.13%	1.30%
3.1.2 期末数据和指标	2014 年末	2013 年末
期末可供分配基金份额利润	0.157	0.013
期末基金资产净值	224,702,971.64	518,180,259.31
期末基金份额净值	1.298	1.013

注：1、本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 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	份额净值 增长率①	份额净值 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	12.97%	1.38%	15.68%	0.73%	-2.71%	0.65%
过去六个月	25.41%	1.06%	26.06%	0.60%	-0.65%	0.46%
过去一年	28.13%	0.85%	27.64%	0.57%	0.49%	0.28%
自基金合 同生效起 至今	29.80%	0.74%	24.89%	0.59%	4.91%	0.15%

注：本基金的业绩比较基准为 $50\% \times \text{中证红利指数收益率} + 50\% \times \text{中债综合全价指数收益率}$ ，每日进行再平衡过程。

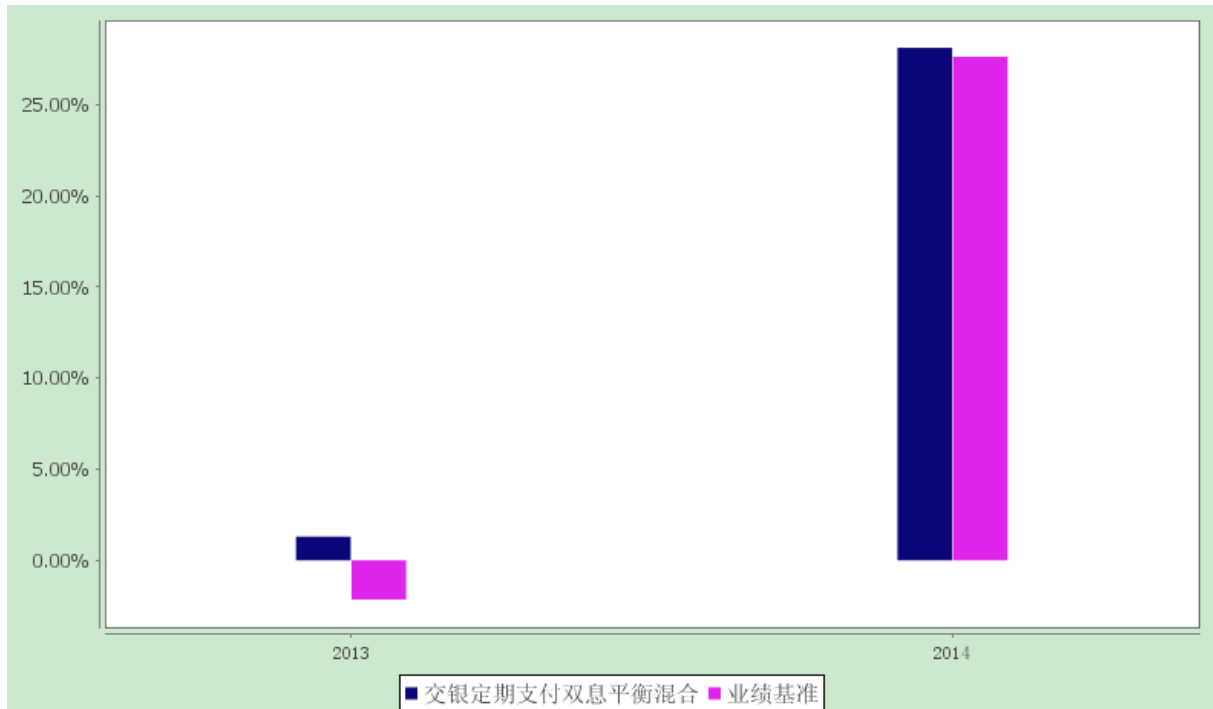
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：本基金基金合同生效日为2013年9月4日，截至报告期期末，本基金已完成建仓但报告期期末距建仓结束未满一年。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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：图示日期为 2013 年 9 月 4 日至 2014 年 12 月 31 日。基金合同生效当年的净值增长率按照当年实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2014 年	-	-	-	-	-
2013 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

交银施罗德基金管理有限公司是经中国证监会证监基金字[2005]128号文批准，由交通银行股份有限公司、施罗德投资管理有限公司、中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司共同发起设立。公司成立于2005年8月4日，注册地在中国上海，注册资本为2亿元人民币。其中，交通银行股份有限公司持有65%的股份，施罗德投资管理有限公司持有30%的股份，中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司持有5%的股份。公司并下设交银施罗德资产管理（香港）有限公司和交银施罗德资产管理有限公司。

截至报告期末，公司管理了包括货币型、债券型、保本混合型、普通混合型和股票型在内的37只基金，其中股票型涵盖普通指数型、交易型开放式（ETF）、QDII等不同类型基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
项廷锋	本基金、交银双利债券、交银荣安保本混合、交银荣祥保本混合、交银荣泰保本混合、交银周期回报灵活配置混合的基金经理，公司投资总监	2013-09-04	2014-12-19	15年	项廷锋先生，上海交通大学管理学博士。历任华安基金管理有限公司研究员、固定收益投资经理和基金经理。其中2003年12月至2007年5月担任华安现金富利投资基金基金经理。2007年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任固定收益部总经理。
张迎军	本基金、交银蓝筹股票、交银优势行业混合的基金经理，公司权益部副总经理	2013-09-04	-	14年	张迎军先生，经济学硕士。历任申银万国证券研究所市场研究部、策略研究部研究员，中国太平洋保险（集团）股份有限公司资金

					运用管理中心投资经理，太平洋资产管理有限公司组合管理部组合经理。 2008 年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任固定收益部副总经理。 2009 年 1 月 21 日至 2012 年 2 月 2 日担任交银施罗德优势行业灵活配置混合型证券投资基金转型前的交银施罗德保本混合型证券投资基金基金经理， 2011 年 5 月 3 日至 2013 年 9 月 2 日担任交银施罗德趋势优先股票证券投资基金基金经理。
李德亮	本基金、交银蓝筹股票、交银强化回报债券的基金经理	2013-09-04	-	8 年	李德亮先生，同济大学管理学学士，中国人民银行研究生部金融学硕士。 2006 年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任行业分析师、基金经理助理。

注：1、本表所列基金经理（助理）任职日期和离职日期均以基金合同生效日或公司作出决定并公告(如适用)之日为准。

2、本表所列基金经理（助理）证券从业年限中的“证券从业”的含义遵从中国证券业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。

本报告期内，本基金整体运作合规合法，无不当内幕交易和关联交易，基金投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的约定，未发生损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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所管理的所有资产组合投资运作的公平。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。制度中包含的主要控制方法如下：

(1) 公司建立资源共享的投资研究信息平台，所有研究成果对所有投资组合公平开放，确保各投资组合在获得研究支持和实施投资决策方面享有公平的机会。

(2) 公司将投资管理职能和交易执行职能相隔离，实行集中交易制度，建立了合理且可操作的公平交易分配机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。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。

(3) 公司建立了清晰的投资授权制度，明确各层级投资决策主体的职责和权限划分，组合投资经理充分发挥专业判断能力,不受他人干预,在授权范围内独立行使投资决策权，维护公平的投资管理环境，维护所管理投资组合的合法利益,保证各投资组合交易决策的客观性和独立性，防范不公平及异常交易的发生。

(4) 公司建立统一的投资对象备选库和交易对手备选库，制定明确的备选库建立、维护程序。在全公司适用股票、债券备选库的基础上，根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和关联交易限制等，按需要建立不同投资组合的投资对象风格库和交易对手备选库，组合经理在此基础上根据投资授权构建投资组合。

(5) 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投资组合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。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合。通过投资交易监控、交易数据分析、专项稽核检查等，本基金管理人未发现任何违反公平交易制

度的行为。

4.3.3 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014 年经济增速呈现趋势性下行的格局,企业的盈利增长面临着较大的压力,这也是上半年股市表现偏弱的主要原因。随着政府稳增长政策的出台,流动性呈现较为宽松的格局,市场无风险利率不断下行,在大类资产配置中股票市场的投资价值愈发明显。结构性牛市累积的赚钱效应和居民大类资产配置的拐点性变化造成增量资金不断进入股票市场,四季度的降息更是极大点燃了市场的做多热情。此外,简政放权、反腐、国企改革等诸多改革举措使市场对新一届政府的改革预期强烈,市场风险偏好不断提升,成为牛市行情的又一推手。

从全年来看,虽然牛市行情毋庸置疑,但行情的演绎上依然呈现较强的结构性特征。具体来看,前三季度中小盘股票的表现可谓精彩纷呈并逐步出现估值的泡沫化趋势,四季度市场风格逐步切换到低估值蓝筹为主的大盘股上,其上涨速度之快、涨幅之大着实大幅超出市场预期,市场一度呈现二八格局,中小盘个股出现大幅调整。

本基金在前三季度较好的把握了市场的运行节奏,在市场阶段性调整时较好的控制了仓位,有效控制了净值的回撤幅度,同时在前三季度中小盘股票的结构性价市中,自下而上配置了市场表现较好的一些细分行业和个股,基金净值表现远好于业绩比较基准。从四季度开始,虽然本基金也预见到了低估值大盘蓝筹的投资机会,但对其上涨幅度和速度预计不足,组合配置的调整不够及时,导致四季度净值表现未能跑赢业绩比较基准。综合全年来看,本基金净值整体表现好于业绩比较基准。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2014 年 12 月 31 日,本基金份额净值为 1.298 元,本报告期份额净值增长率为 28.13%,同期业绩比较基准增长率为 27.64%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2015 年,经济预计仍将低迷,盈利层面对市场的支持力度有限,可能的超预期来自于产能出清和总需求叠加促成的企业盈利能力提升。因此,主导市场运行的主逻辑依然是无风险利率的下行预期和居民大类资产配置向股票市场的趋势性转移。与

2014 年市场的快牛行情不同，2015 年的市场预计可能将呈现慢牛格局，波动幅度也将加大。

从市场风格上看，经过 2014 年 4 季度低估值蓝筹股的上涨和中小盘个股的调整，估值差距在不断收敛，因此均衡配置将是比较现实的选择，两种风格都存在精选个股的结构性机会。具体来看，预计上半年市场将更倾向于低估值蓝筹板块，如果 3、4 月份旺季的经济数据能够企稳回升，低估值蓝筹股或将再次迎来一波大幅度的上涨。从二季度中后期开始，无论经济企稳最终被证实或者证伪，预计市场风格或都将发生一次转换，成长类为主的中小盘个股有望在下半年跑出超额收益。

考虑到资本市场参与主体逐渐多元化，资本市场投资工具逐渐丰富，本基金管理人将更加勤勉地深入研究投资标的基本面，高度关注资本市场可能出现的投资机会与风险，及时调整基金组合，努力为基金投资人创造较好的业绩回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序，经公司管理层批准后实行，并成立了估值委员会，估值委员会成员由研究部、基金运营部、风险管理部等人员和固定收益人员及基金经理组成。

公司严格按照新会计准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定进行估值，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。估值委员会的研究部成员按投资品种的不同性质，研究并参考市场普遍认同的做法，建议合理的估值模型，进行测算和认证，认可后交各估值委员会成员从基金会计、风险、合规等方面审批，一致同意后，报公司投资总监、总经理审批。

估值委员会会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后，及时召开临时会议进行研究，及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值委员会成员均具备相应的专业资格及工作经验。基金经理作为估值委员会成员，对本基金持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感，向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论。本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突，截止报告期末未有与任何外部估值定价服务机构签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内无需预警说明。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—交银施罗德基金管理有限公司本报告期基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，交银施罗德基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，交银施罗德基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 审计报告

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)对交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金 2014 年 12 月 31 日的资产负债表，2014 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注出具了标准无保留意见的审计报告【普华永道中天审字(2015)第 21493 号】。投资者可通过本基金年度报告正文查看该审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金

报告截止日：2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	6,487,393.91	152,515,177.89
结算备付金		1,774,694.37	1,442,280.20
存出保证金		133,411.94	67,596.19
交易性金融资产	7.4.7.2	217,030,277.16	350,560,765.27
其中：股票投资		152,435,215.16	108,297,482.99
基金投资		-	-
债券投资		64,595,062.00	242,263,282.28
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	55,564,483.35
应收证券清算款		5,402,982.30	2,993,538.51
应收利息	7.4.7.5	411,603.04	4,220,780.07
应收股利		-	-
应收申购款		971,146.53	100,591.42
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		232,211,509.25	567,465,212.90
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	44,999,850.00

应付证券清算款		3,444,238.43	-
应付赎回款		3,075,020.38	3,008,493.71
应付管理人报酬		286,371.70	706,356.73
应付托管费		47,728.64	117,726.12
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	364,354.83	243,099.81
应交税费		32,800.00	-
应付利息		-	23,088.73
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	258,023.63	186,338.49
负债合计		7,508,537.61	49,284,953.59
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	173,082,094.97	511,343,232.12
未分配利润	7.4.7.10	51,620,876.67	6,837,027.19
所有者权益合计		224,702,971.64	518,180,259.31
负债和所有者权益总计		232,211,509.25	567,465,212.90

注：1、报告截止日 2014 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.298 元，基金份额总额 173,082,094.97 份。

2、本摘要中资产负债表和利润表所列附注号为年度报告正文中对应的附注号，投资者欲了解相应附注的内容，应阅读登载于基金管理人网站的年度报告正文。

7.2 利润表

会计主体：交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013 年 9 月 4 日 (基金合同生效日) 至 2013 年 12 月 31 日
一、收入		71,406,606.68	12,930,013.60

1.利息收入		6,823,427.66	9,157,206.49
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,311,010.42	7,220,262.98
债券利息收入		4,966,652.79	1,085,785.93
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		545,764.45	851,157.58
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		32,709,260.46	7,096,537.52
其中：股票投资收益	7.4.7.12	19,163,858.38	6,940,678.67
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	11,728,431.21	155,858.85
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	1,816,970.87	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	31,401,559.31	-3,490,439.96
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	472,359.25	166,709.55
减：二、费用		9,305,251.47	4,352,274.58
1. 管理人报酬		4,851,136.57	3,018,226.79
2. 托管费		808,522.92	503,037.79
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	2,045,061.41	447,336.85
5. 利息支出		1,302,914.48	205,218.63
其中：卖出回购金融资产支出		1,302,914.48	205,218.63
6. 其他费用	7.4.7.20	297,616.09	178,454.52
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		62,101,355.21	8,577,739.02
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		62,101,355.21	8,577,739.02

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	511,343,232.12	6,837,027.19	518,180,259.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	62,101,355.21	62,101,355.21
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-338,261,137.15	-17,317,505.73	-355,578,642.88
其中：1.基金申购款	95,989,150.74	13,664,124.00	109,653,274.74
2.基金赎回款	-434,250,287.89	-30,981,629.73	-465,231,917.62
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	173,082,094.97	51,620,876.67	224,702,971.64
项目	上年度可比期间 2013 年 9 月 4 日（基金合同生效日）至 2013 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	642,313,653.44	-	642,313,653.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	8,577,739.02	8,577,739.02
三、本期基金份额交易产生的基金净	-130,970,421.32	-1,740,711.83	-132,711,133.15

值变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	644,853.95	9,193.35	654,047.30
2.基金赎回款	-131,615,275.27	-1,749,905.18	-133,365,180.45
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	511,343,232.12	6,837,027.19	518,180,259.31

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：苏奋（代任），主管会计工作负责人：许珊燕，会计机构负责人：朱鸣

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]753 号《关于核准交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金募集的批复》核准，由交银施罗德基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 641,999,732.41 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2013)第 550 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金基金合同》于 2013 年 9 月 4 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 642,313,653.44 份基金份额，其中认购资金利息折合 313,921.03 份基金份额。本基金的基金管理人为交银施罗德基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金基金合同》和《交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金每月定期按照约定的年化现金支付比率，以约定的定期支付基准日的基金份额净值为基础，计算当期基金份额持有人可获得支付的现金，并自动赎回基金份额持有人所持的对应金额的基金份额，以该自动赎回的资金向基金份额持有人进行现金支付。本基金当前的年化现金支付比率为 6%。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法上市的股票(含中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票)、债券、货币市场工具、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金投资于股票、权证等权益类资产占基金资产净值的 30%-70%，其中权证的投资比例不超过基金资产净值的 3%；债券、资产支持证券、货币市场工具、银行存款等固定收益类资产和现金不低于基金资产净值的 30%，其中现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为 $50\% \times \text{中证红利指数收益率} + 50\% \times \text{中债综合全价指数收益率}$ 。

本财务报表由本基金的基金管理人交银施罗德基金管理有限公司于 2015 年 3 月 25 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2014 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2014 年 12 月 31 日的财务状况以及 2014 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告不一致，所采用的会计估计与最近一期年度报告一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2014 年颁布《企业会计准则第 39 号——公允价值计量》、《企业会计准则第 40 号——合营安排》、《企业会计准则第 41 号——在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第 2 号——长期股权投资》、《企业会计准则第 9 号——职工薪酬》、《企业会计准则第 30 号——财务报表列报》、《企业会计准则第 33 号

——合并财务报表》以及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》，要求除《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》自 2014 年度财务报表起施行外，其他准则自 2014 年 7 月 1 日起施行。上述准则对本基金本报告期无重大影响。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
交银施罗德基金管理有限公司(“交银施罗德基金公司”)	基金管理人、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	基金托管人、基金销售机构
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	基金管理人的股东、基金销售机构

施罗德投资管理有限公司	基金管理人的股东
中国国际海运集装箱(集团)股份有限公司	基金管理人的股东
交银施罗德资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年 12月31日	上年度可比期间 2013年9月4日（基金合 同生效日）至2013年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	4,851,136.57	3,018,226.79
其中：支付销售机构的客户维护 费	2,376,882.01	1,458,095.48

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5%÷ 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年 12月31日	上年度可比期间 2013年9月4日（基金合 同生效日）至2013年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	808,522.92	503,037.79

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷ 当年天数。

7.4.8.2.3 销售服务费

无。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年9月4日（基金合同生效日）至 2013年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	6,487,393.91	79,976.60	2,515,177.89	67,535.86

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.9 期末（2014年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002170	芭田股份	2014-12-25	重大事项	9.00	2015-01-05	9.38	300,000	2,508,412.36	2,700,000.00	-
300347	泰格医药	2014-12-10	重大事项	29.40	2015-01-22	33.24	125,000	4,298,222.24	3,675,000.00	-

注：本基金截至 2014 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于 2014 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层次的余额为 200,655,277.16 元，属于第二层次的余额为 16,375,000.00 元，无属于第三层次的余额(2013 年 12 月 31 日：第一层次 221,125,765.27 元，第二层次 129,435,000.00 元，无第三层次)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；

并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2014 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产 (2013 年 12 月 31 日：同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	152,435,215.16	65.64
	其中：股票	152,435,215.16	65.64
2	固定收益投资	64,595,062.00	27.82
	其中：债券	64,595,062.00	27.82
	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	8,262,088.28	3.56
7	其他各项资产	6,919,143.81	2.98
8	合计	232,211,509.25	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	35,790,154.50	15.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,557,500.00	2.47
E	建筑业	16,416,100.00	7.31
F	批发和零售业	-	-
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	16,263,600.00	7.24
J	金融业	55,481,100.00	24.69
K	房地产业	9,857,050.00	4.39
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	4,950,000.00	2.20
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,675,000.00	1.64
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	4,444,710.66	1.98
	合计	152,435,215.16	67.84

8.3 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

金额单位：人民币元

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	601318	中国平安	260,000	19,424,600.00	8.64
2	601336	新华保险	250,000	12,390,000.00	5.51
3	600376	首开股份	800,000	8,064,000.00	3.59
4	601668	中国建筑	950,000	6,916,000.00	3.08

5	300166	东方国信	230,000	6,453,800.00	2.87
6	600000	浦发银行	400,000	6,276,000.00	2.79
7	601818	光大银行	1,200,000	5,856,000.00	2.61
8	000685	中山公用	250,000	5,557,500.00	2.47
9	600804	鹏博士	280,000	5,034,400.00	2.24
10	000069	华侨城 A	600,000	4,950,000.00	2.20
10	601166	兴业银行	300,000	4,950,000.00	2.20

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	29,463,464.98	5.69
2	000423	东阿阿胶	14,829,420.86	2.86
3	600887	伊利股份	13,737,452.41	2.65
4	002008	大族激光	12,874,690.07	2.48
5	002317	众生药业	11,611,973.77	2.24
6	000002	万科 A	10,864,059.21	2.10
7	601336	新华保险	10,486,223.03	2.02
8	600000	浦发银行	9,958,412.00	1.92
9	002375	亚厦股份	9,517,860.13	1.84
10	300145	南方泵业	9,327,885.11	1.80
11	600048	保利地产	9,239,544.00	1.78
12	601006	大秦铁路	8,526,772.00	1.65
13	600267	海正药业	8,325,256.74	1.61
14	000099	中信海直	8,283,257.51	1.60
15	600426	华鲁恒升	8,265,110.25	1.60
16	601668	中国建筑	8,223,944.00	1.59
17	600054	黄山旅游	8,133,742.77	1.57
18	300207	欣旺达	8,006,241.00	1.55
19	600739	辽宁成大	7,890,060.34	1.52
20	600067	冠城大通	7,819,293.48	1.51

注：“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002008	大族激光	14,577,896.57	2.81
2	002415	海康威视	14,269,348.91	2.75
3	002317	众生药业	13,686,224.75	2.64
4	000423	东阿阿胶	13,415,165.66	2.59
5	002375	亚厦股份	13,077,297.50	2.52
6	601318	中国平安	12,595,154.51	2.43
7	000002	万科A	11,692,041.23	2.26
8	300207	欣旺达	11,147,604.78	2.15
9	002038	双鹭药业	10,976,297.33	2.12
10	000709	河北钢铁	10,155,500.00	1.96
11	600089	特变电工	10,095,932.49	1.95
12	600887	伊利股份	9,938,645.94	1.92
13	601311	骆驼股份	9,719,611.38	1.88
14	600054	黄山旅游	9,465,371.67	1.83
15	300145	南方泵业	9,375,030.95	1.81
16	600267	海正药业	9,317,940.20	1.80
17	002665	首航节能	9,271,675.33	1.79
18	600150	中国船舶	9,268,106.34	1.79
19	600048	保利地产	9,116,842.35	1.76
20	002325	洪涛股份	9,070,705.55	1.75

注：“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	676,109,804.43
卖出股票的收入（成交）总额	666,774,155.89

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比
----	------	------	----------

			例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,000,000.00	4.45
	其中：政策性金融债	10,000,000.00	4.45
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	54,595,062.00	24.30
8	其他	-	-
9	合计	64,595,062.00	28.75

8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
1	110020	南山转债	115,000	16,055,150.00	7.15
2	113007	吉视转债	91,900	11,466,363.00	5.10
3	113001	中行转债	71,930	11,263,518.70	5.01
4	140213	14 国开 13	100,000	10,000,000.00	4.45
5	110023	民生转债	38,890	5,377,320.30	2.39

8.7 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。

8.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	133,411.94
2	应收证券清算款	5,402,982.30
3	应收股利	-
4	应收利息	411,603.04
5	应收申购款	971,146.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,919,143.81

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110020	南山转债	16,055,150.00	7.15
2	113001	中行转债	11,263,518.70	5.01
3	110023	民生转债	5,377,320.30	2.39

8.12.5 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的情况。

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份 额比例
2,368	73,092.10	-	-	173,082,094.97	100.00%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	92,830.40	0.05%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2013年9月4日)基金份额总额	642,313,653.44
本报告期期初基金份额总额	511,343,232.12
本报告期基金总申购份额	95,989,150.74

减：本报告期基金总赎回份额	434,250,287.89
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	173,082,094.97

注：1、如果本报告期间发生转换入、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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人的重大人事变动：2014 年 12 月 31 日本基金管理人发布公告，经公司第三届董事会第三十二次会议审议通过，同意战龙先生辞去公司总经理职务，并决定由公司董事长钱文挥先生代为履行公司总经理职务，代为履行总经理职务的期限不超过 90 日。期后变动（如有）敬请关注基金管理人发布的相关公告。

2、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动：因中国农业银行股份有限公司（以下简称“中国农业银行”）工作需要，任命余晓晨先生主持中国农业银行托管业务部/养老金管理中心工作。余晓晨先生的基金行业高级管理人员任职资格已在中国基金业协会备案。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），本期审计费用为 60,000.00 元。自本基金基金合同生效以来，本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员本报告期内未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券股份有限公司	1	9,614,645.68	0.72%	8,753.07	0.72%	-
海通证券股份有限公司	1	84,448,906.17	6.29%	76,882.46	6.29%	-
华泰证券股份有限公司	2	84,135,646.33	6.27%	76,597.40	6.27%	-
中国国际金融有限公司	2	6,088,848.84	0.45%	5,543.29	0.45%	-
国海证券股份有限公司	1	59,055,974.65	4.40%	53,764.33	4.40%	-
安信证券股份有限公司	2	43,777,395.32	3.26%	39,855.06	3.26%	-
中银国际证券有限责任公司	1	40,999,065.63	3.06%	37,325.55	3.06%	-
国金证券股份有限公司	2	393,522,953.72	29.33%	358,262.90	29.33%	-
国信证券股份有限公司	1	33,651,251.31	2.51%	30,635.89	2.51%	-
国泰君安证券股份有限公司	1	32,221,441.76	2.40%	29,334.35	2.40%	-
中国银河证券股份有限公司	1	25,883,159.92	1.93%	23,563.94	1.93%	-
中信建投证券股份有限公司	1	24,550,606.05	1.83%	22,350.52	1.83%	-
中国中投证券有限责任公司	1	24,248,381.15	1.81%	22,075.43	1.81%	-
兴业证券股份有限公司	1	22,691,608.58	1.69%	20,658.45	1.69%	-
中信证券股份有限公司	1	188,654,458.16	14.06%	171,750.88	14.06%	-

申银万国证券股份有限公司	2	148,158,013.66	11.04%	134,882.45	11.04%	-
华创证券有限责任公司	1	1,385,979.93	0.10%	1,261.78	0.10%	-
长城证券有限责任公司	1	11,586,941.53	0.86%	10,549.03	0.86%	-
瑞银证券有限责任公司	1	107,074,347.27	7.98%	97,480.17	7.98%	-
光大证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
宏源证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
招商证券股份有限公司	18,043,490.80	7.18%	113,800,000.00	4.46%	-	-
海通证券股份有限公司	36,570,533.79	14.56%	325,700,000.00	12.78%	-	-
华泰证券股份有限公司	1,139,684.20	0.45%	-	-	-	-
国海证券股份有限公司	7,900,697.84	3.15%	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	22,670,991.30	9.03%	35,000,000.00	1.37%	-	-
中银国际证券有限责任公司	17,661,493.10	7.03%	24,000,000.00	0.94%	-	-
国金证券股份有限公司	34,736,220.11	13.83%	840,200,000.00	32.96%	-	-
国信证券股份有限公司	2,500,956.00	1.00%	47,000,000.00	1.84%	-	-
国泰君安证券股份有限公司	3,483,388.60	1.39%	172,000,000.00	6.75%	-	-
中国银河证券股份有限公司	1,835,946.00	0.73%	31,000,000.00	1.22%	-	-
中信建投证券	3,752,036.30	1.49%	138,000,000.00	5.41%	-	-

股份有限公司			00.00			
中国中投证券 有限责任公司	13,151,953.2 0	5.24%	111,000,0 00.00	4.35%	-	-
兴业证券股份 有限公司	8,981,945.60	3.58%	170,000,0 00.00	6.67%	-	-
中信证券股份 有限公司	5,027,238.67	2.00%	-	-	-	-
申银万国证券 股份有限公司	73,711,845.1 4	29.35%	503,600,0 00.00	19.75%	-	-
长城证券有限 责任公司	-	-	38,000,00 0.00	1.49%	-	-

注：1、报告期内，本基金新增加交易单元为华创证券有限责任公司；终止交易单元为天源证券股份有限公司，其它交易单元未发生变化；

2、租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：券商基本面评价（财务状况、经营状况）、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）、券商每日信息评价（及时性和有效性）和券商协作表现评价等四个方面；

3、租用证券公司交易单元的程序：首先根据租用证券公司交易单元的选择标准进行综合评价，然后根据评价选择基金交易单元。研究部提交方案，并上报公司批准。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

依据中国证监会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》（证监会公告[2008]38号）的有关规定和《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》的指导意见，经与基金托管人协商一致，本基金对其所持有的中航飞机（证券代码：000768）股票自2014年10月8日起按照指数收益法进行估值，并已于2014年10月17日起恢复按市场价格进行估值；本基金对其所持有的泰格医药（证券代码：300347）股票自2014年12月15日起按照指数收益法进行估值，并已于2015年1月23日起恢复按市场价格进行估值。

二〇一五年三月三十一日