交银施罗德深证300价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2012 第三季度 报告

2012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：中国农业银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一二年十月二十六日

§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2012年10月25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2012年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金产品概况

基金简称	交银深证300价值ETF联接	
基金主代码	519706	
交易代码	519706（银端）	519707（后端）
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011年9月28日	
报告期末基金份额总额	104,975,356.40份	
投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。	
投资策略	本基金通过把全部或接近全部的基金资产投资于目标ETF、标的指数成份股和备选成份股进行被动式指数化投资，正常情况下投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%，其余资产可投资于标的指数成份股、备选成份股、新股、债券、回购、权证及中国证监会允许基金投资的其它金融工具，其目的是为了使本基金在应付申购赎回的前提下，更好地实现跟踪标的指数的投资目标。	
业绩比较基准	深证300价值价格指数收益率×95%+银行活期存款税后收益率×5%	
风险收益特征	本基金属ETF联接基金，风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，紧密跟踪标的指数，具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，相当于投资基金中风险较高，预期收益较高的品种。	
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	

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	深证300价值交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159913
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011年9月22日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011年10月25日
基金管理人名称	交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人名称	中国农业银行股份有限公司

2.1.2 目标基金产品概况

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金绝大部分资产采用完全复制法，跟踪深证300价值价格指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。
业绩比较基准	深证300价值价格指数
风险收益特征	本基金属于股票基金，风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。同时本基金为指数型基金，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

§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（2012年7月1日-2012年9月30日）
1.本期已实现收益	-468,488.60
2.本期利润	-10,555,834.14
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1012
4.期末基金资产净值	90,724,925.20
5.期末基金份额净值	0.864

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。

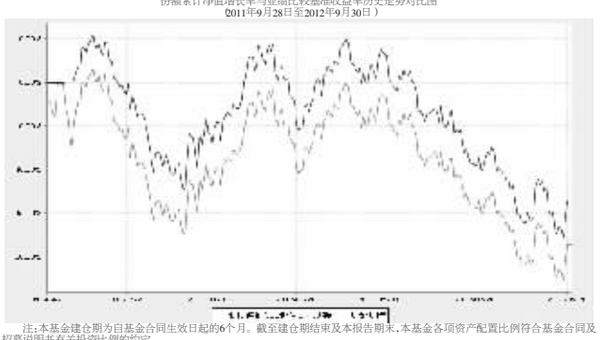
3.2 基金净值表现

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	-10.47%	1.30%	-10.85%	1.32%	0.38%	-0.02%

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

交银施罗德深证300价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金
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9月28日至2012年9月30日）



注：本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至建仓期结束及本报告期末，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		
屈乐伟	本基金及交银深证300价值ETF基金经理、交银上证180公司治理ETF及联接基金经理	2011-9-28	-	16年	屈乐伟先生，数理系硕士。历任广发证券北京业务总部研究部经理、投资部经理，华夏基金管理有限公司基金管理部分析师、市场部高级经理、风险控制评估小组成员以及上证50ETF基金经理助理。2006年加入交银施罗德基金管理有限公司。

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。

本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。本投资组合与公司旗下管理的不同投资组合的整体收益率、分投资类别（股票、债券）的收益率并未发现异常差异。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未发现异常交易行为。报告期内本投资组合未出现参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情形。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

市场在二季度启动了2012年上半年的触发，仍呈下跌态势，其间虽有反弹，但总体比较弱势。究其原因，首先在于上半年投资者对市场的担心在2012年三季度均有体现，比如经济下行是超预期的，上市公司业绩增速明显回落，中报业绩不太乐观，而政策被普遍认为低于预期或只能算是基本符合预期。更有甚者发生在三季度末，随着创业板解禁潮的临近，投资者对创业板的担忧急聚上升，创业板出现了较大跌幅，这也某种程度上严重影响了整个市场。在如此弱市下，仓位较重的指数基金的表现受到影响。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2012年9月30日，本基金份额净值为0.864元，本报告期份额净值增长率为-10.47%，同期业绩比较基准增长率为-10.85%。本报告期内本基金的日均跟踪偏离度为0.06%，跟踪误差为0.08%。

§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	544,810.11	0.60
	其中：股票	544,810.11	0.60
2	基金投资	84,022,747.20	92.03
3	固定收益投资	2,990,400.00	3.28
	其中：债券	2,990,400.00	3.28
	资产支持证券	-	-
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	2,900,517.68	3.18
7	其他各项资产	838,299.72	0.92
8	合计	91,296,774.71	100.00

5.2 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	采掘业	32,506.89	0.04
C	制造业	300,036.16	0.33
C0	食品、饮料	30,118.70	0.03
C1	纺织、服装、皮毛	2,044.59	0.00
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	8,952.51	0.01
C4	石油、化学、塑胶、塑料	25,603.81	0.03
C5	电子	12,928.52	0.01
C6	金属、非金属	42,275.04	0.05
C7	机械、设备、仪表	152,103.95	0.17
C8	医药、生物制品	26,009.04	0.03
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	15,754.41	0.02
E	建筑业	1,568.91	0.00
F	交通运输、仓储业	8,309.15	0.01
G	信息技术业	16,660.92	0.02
H	批发和零售贸易	30,076.96	0.03
I	金融、保险业	31,328.08	0.03
J	房地产业	89,915.39	0.10
K	社会服务业	16,956.72	0.02
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	1,696.52	0.00
	合计	544,810.11	0.60

5.4 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	000002	万 科A	6,058	51,068.94	0.06
2	000651	格力电器	1,586	33,908.68	0.04
3	000157	中联重科	2,877	24,799.74	0.03
4	000001	平安银行	1,841	24,172.33	0.03
5	000527	美的电器	2,400	22,032.00	0.02
6	002024	苏宁电器	3,019	20,951.86	0.02
7	000568	泸州老窖	489	18,826.50	0.02
8	000063	中兴通讯	1,307	14,586.12	0.02
9	000983	西山煤电	1,083	14,512.20	0.02
10	000069	华侨城A	2,313	12,952.80	0.01

5.5 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	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,990,400.00	3.30
	其中：政策性金融债	2,990,400.00	3.30
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	2,990,400.00	3.30

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

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	120228	12国开28	30,000	2,990,400.00	3.30

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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 投资组合报告附注

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	750,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	21,140.08
5	应收申购款	64,415.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	2,744.36
9	合计	838,299.72

5.9.4 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。

5.9.5 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	000527	美的电器	22,032.00	0.02	重大资产重组事项

5.9.6 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

本报告期期初基金份额总额	106,689,695.79
本报告期基金总申购份额	10,144,028.59
减：本报告期基金总赎回份额	11,858,367.98
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	104,975,356.40

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。

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会核准交银施罗德深证300价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金募集的文件；

2、《交银施罗德深证300价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金合同》；

3、《交银施罗德深证300价值交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；

4、《交银施罗德深证300价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》；

5、关于申请募集交银施罗德深证300价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金之法律意见书；

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深证300价值交易型开放式指数证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

7.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

7.3 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.jyfund.com、www.jysld.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。

交银施罗德全球自然资源证券投资基金

2012 第三季度 报告

2012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：中国建设银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一二年十月二十六日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2012年10月25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2012年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	交银全球资源股票（QDII）
基金主代码	519709
交易代码	519709
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年5月22日
报告期末基金份额总额	47,300,049.14份
投资目标	在全球范围内精选自然资源相关行业的上市公司，通过积极主动的资产配置和组合管理，在有效控制组合下行风险的前提下力争实现资本的长期保值增值。
投资策略	通过对全球宏观经济、大宗商品价格和自然资源相关行业上市公司基本面的分析，根据宏观经济运行特点对不同自然资源类别相关资产价格或其所对应的大宗商品（如能源、贵金属、基本金属、农产品等）价格所产生的不同影响，利用基金管理人在大宗商品、自然资源及其相关产业等领域的专业研究，自上而下的选择明显受益于宏观经济运行特征的自然资源类别进行投资，同时在该资源类别内自下而上精选证券，挖掘定价合理、具备持续竞争优势、明显受益于相关资源价格上涨的上市公司股票进行投资，在有效控制下行风险的前提下，优化组合收益，构建具有长期投资价值的投资组合，实现资产的保值增值。
业绩比较基准	MSCI全球原材料总收益指数收益率×65%+MSCI全球能源总收益指数收益率×35%	
风险收益特征	本基金为主要投资全球范围内自然资源相关行业上市公司的主动股票型基金，基金所投之标的与全球经济景气度、大宗商品市场表现及各相关产业联动性相对较高，波动性较大，风险与预期收益高于混合基金和债券基金，在股票基金中亦属于承担较高风险、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	中国建设银行股份有限公司	
境外投资顾问英文名称	Schroder Investment Management Limited	
境外投资顾问中文名称	施罗德投资管理有限公司	
境外资产托管人英文名称	JPMorgan Chase Bank, National Association	
境外资产托管人中文名称	摩根大通银行	

§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（2012年7月1日-2012年9月30日）
1.本期已实现收益	2,910,651.26
2.本期利润	4,099,378.61
3.加权平均基金份额本期利润	0.0601
4.期末基金资产净值	50,672,951.37
5.期末基金份额净值	1.071

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。

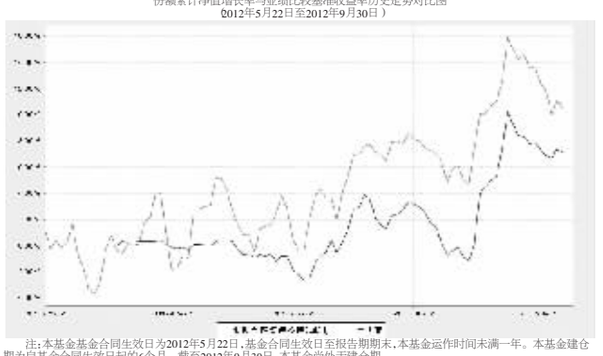
3.2 基金净值表现

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	6.99%	0.88%	7.52%	1.13%	-0.53%	-0.25%

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

交银施罗德全球自然资源证券投资基金
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
（2012年5月22日至2012年9月30日）



注：本基金基金合同生效日为2012年5月22日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间未满一年。本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至2012年9月30日，本基金尚处于建仓期。

§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		
郑伟辉	本基金的基金经理，交银施罗德环球精选价值证券投资基金基金经理	2012-5-22	-	35年	郑伟辉先生，中国国籍。大专学历。曾任施罗德投资管理（香港）有限公司独立投资基金主管，负责管理香港机构客户、大型退休基金、慈善基金及私人客户基金。2007年加入交银施罗德基金管理有限公司。
饶超	本基金的基金经理，交银施罗德环球精选价值证券投资基金基金经理	2012-7-27	-	5年	饶超先生，北京邮电大学硕士，美国马里兰大学MBA。历任美国Truffle Hound Capital, LLC高级研究员，2009年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任行业分析师、QDII高级分析师。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

姓名	在境外投资顾问所任职务	证券从业年限	说明
Virginie Maisonneuve	施罗德集团多区域（全球及国际）股票投资主管	25年	Virginie Maisonneuve女士，法国高等商业管理学院工商管理硕士，CFA。历任苏格兰Martin Currie资产管理公司欧洲大陆股票基金基金经理，波士顿Batterymarch时务管理公司基金经理，纽约Clay Finlay公司投资总监、董事、管理委员会及投资策略委员会委员。2004年加入施罗德投资管理有限公司。

4.3 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

本公司制定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。

本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。本投资组合与公司旗下管理的不同投资组合的整体收益率、分投资类别（股票、债券）的收益率并未发现异常差异。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未发现异常交易行为。报告期内本投资组合未出现参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情形。

4.5 报告期内基金的投资策略和运作分析

2012年三季度海外市场震荡上行。欧洲市场方面，6月希腊大选结果使希腊退出欧元区风险暂时解除。但为应对债务危机进一步扩散，欧央行行长德拉吉发表了“强势稳定欧元言论并随后出台了直接债券购买计划，欧债系统性风险被大幅拉低，市场风险偏好也显著攀升。美国市场方面，制造业、地产和消费等经济数据在三季度呈现弱复苏格局，但在这样的经济背景下，美联储依然推出了不定期限和总量的量化宽松政策。除欧美外，日本和英国也延续了前期的量化宽松政策。海外市场宽松政策的叠加效应可能是推动海外市场上行的重要原因，本基金投资的资源与资源相关类周期性投资标的也受益跟随上涨。

本基金在三季度仍处在建仓期，基于对海外政策方向、市场风险偏好和自然资源供需基本面的判断，本基金重点并及时配置了黄金、白银金等贵金属投资标的，石油、天然气等能源和能源服务投资标的，以及部分底部特征明显的基本面材料投资标的。在区域配置上，重点配置在发达市场上市的投资标的。以上的资源和市场配置使本基金较充分地参与了三季度的市场上涨。

截至2012年9月30日，本基金份额净值为1.071元，本报告期份额净值增长率为6.99%，同期业绩比较基准增长率为7.52%。

§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）	占基金资产净值比例（%）
1	权益投资	32,690,706.01	46.89
	其中：普通股	31,713,557.91	45.49
	存托凭证	977,148.10	1.40
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	6,978,971.81	10.01
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
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	29,030,434.66	41.64
7	其他各项资产	1,015,778.09	1.46
8	合计	69,715,890.57	100.00

5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
美国	24,378,654.89	48.11
香港	8,312,051.12	16.40
合计	32,690,706.01	64.51

注：1、国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定；

2、ADR、GDR按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
能源	15,090,758.80	29.78
材料	12,211,920.87	24.10
工业	2,877,606.80	5.68
公共事业	1,362,476.61	2.69
必需消费品	1,147,942.93	2.27
合计	32,690,706.01	64.51

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

5.4 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及存托凭证投资明细

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	SUNCOR ENERGY INC.	森科能源公司	SU US	纽约证券交易所	美国	10,000	2,083,018.50	4.11
2	DEVON ENERGY CORPORATION	戴文能源公司	DVN US	纽约证券交易所	美国	5,000	1,918,152.50	3.79
3	KUNLUN ENERGY CO.LTD.	昆仑能源有限公司	135 HK	香港证券交易所	香港	170,000	1,888,116.63	3.73
4	FREEPORT-MCMORAN COPPER & GOLD,INC.	自由港麦克莫兰铜业公司	FCX US	纽约证券交易所	美国	7,000	1,756,837.46	3.47
5	ALLEGHENY TECHNOLOGIES INCORPORATED	阿勒格尼技术公司	ATI US	纽约证券交易所	美国	8,000	1,618,223.20	3.19
6	JIANGXI COPPER CO.LTD.	江西铜业股份有限公司	358 HK	香港证券交易所	香港	100,000	1,606,281.32	3.17
7	NATIONAL OILWELL VARCO,INC.	美国国民油井华高公司	NOV US	纽约证券交易所	美国	3,000	1,523,932.53	3.01
8	APACHE CORPORATION	阿帕奇公司	APA US	纽约证券交易所	美国	2,700	1,480,426.93	2.92
9	GOLDCORP INC.	-	GG US	纽约证券交易所	美国	5,000	1,453,674.25	2.87
10	NEWMONT MINING CORPORATION	纽蒙特矿业公司	NEM US	纽约证券交易所	美国	4,000	1,420,764.46	2.80

注：前十名股票及存托凭证的排名是按照上市公司不同的上市交易所合并计算排列所得。

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合
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名的前五名债券投资明细
本基金本报告期末未持有债券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细
本基金本报告期末未持有金融衍生品。

5.9 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基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	ISHARES SILVER TRUST	ETF基金	开放式	Barclays Global Investors NA	3,284,229.64	6.48
2	MARKET VECTORS GOLD MINERS ETF	ETF基金	开放式	Van Eck Associates Corp	2,553,362.17	5.04
3	IPATH S&P 500 VIX SHORT-TERM FUTURES ETN	ETN基金	开放式	Barclays Capital Inc.	1,141,380.00	2.25

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	15,006.93
4	应收利息	1,008.95
5	应收申购款	999,762.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,015,778.09

5.10.4 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。

5.10.5 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的情况。

5.10.6 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

本报告期期初基金份额总额	86,537,078.86
本报告期基金总申购份额	20,909,471.84
减：本报告期基金总赎回份额	60,146,501.56
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	47,300,049.14

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。

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会批准交银施罗德全球自然资源证券投资基金募集的文件；

2、《交银施罗德全球自然资源证券投资基金基金合同》；

3、《交银施罗德全球自然资源证券投资基金招募说明书》；

4、《交银施罗德全球自然资源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全球自然资源证券投资基金之法律意见书；

8、报告期内交银施罗德全球自然资源证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

7.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

7.3 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.jyfund.com、www.jysld.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。

交银施罗德双利债券证券投资基金

2012 第三季度 报告

2012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：中国建设银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一二年十月二十六日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2012年10月25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2012年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	交银双利债券
基金主代码	519683
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年9月26日
报告期末基金份额总额	466,394,492.96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，在严格控制基金资产运作风险的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为投资者提供高于业绩比较基准的长期稳定投资回报。
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