5基金资产净值的

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:二〇一三年八月二十六日

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。本半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。 基金托管人中国建设银行股份有限公司(以下使用全称或其简称"中国建设银行")根据本基金合同规定,于2013年8月 23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

. 以一个日本企政有 里入返 啊。 其命管理人承诺以诚实信用、勒勒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

本半年度报告極要縮自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。本报告中财务资料未经审计。 本报告申财务资料未经审计。

	2 基金简介	
2.1 基金基本情况		
基金简称	交银理财	60天债券
基金主代码	519	721
基金运作方式	契约型	开放式
基金合同生效日	2013年3	3月13日
基金管理人	交银施罗德基金	会管理有限公司
基金托管人	中国建设银行	股份有限公司
报告期末基金份额总额	231,078,	904.18份
基金合同存续期	不知	定期
下属分级基金的基金简称	交银理财60天债券A	交银理财60天债券B

2.2 基金产品说明	
投资目标	本基金在追求本金安全、保持资产流动性的基础上,努力追求绝对收益,为基金份额持有人谋求资产的稳定增值。
投资策略	本基金在保持组合流动性的前提下,结合对国内外宏观经济运行、金融市场运行、资金流动格局、货币市场收益率曲线形态等各方面的分析,合理安排组合期限结构,积极选择投资工具,采取主动性的投资策略和精细化的操作手法。
业绩比较基准	人民币七天通知存款税后利率
风险收益特征	本基金属于短期理财债券型证券投资基金,长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金及普通债券型基金,高于货币市场型证券投资基金。

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	中国建设银行股份有限公司
	姓名	孙艳 田青	
信息披露负责人	联系电话	021-61055050	010-67595096
	电子邮箱	xxpl@jysld.com,disclosure@jysld.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-700-5000,021-61055000	010-67595096
传真		021-61055054	010-66275853

基金半年度报告备置地

3 主要财务指标和基金净值表现 3.1 主要会计数据和财务指标

	报告期(2013年3月13日(基金合同生效日)至2013年6月30日) 交银理財60天债券A 交银理財60天债券B	
3.1.1 期间数据和指标		
本期已实现收益	4,782,913.73	
本期利润	4,782,913.73	303,401.91
本期净值收益率	1.04%	0.63%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)	
3.1.2 州本奴皓和佰标	交银理财60天债券A	交银理财60天债券B
期末基金资产净值	201,078,904.18	30,000,000.00
期末基金份額净值	1.0000	1.0000

2.3 基金管理人和基金托管/

· (1-4) (1-

(18世) 经公益企业 (18世) 公司 (18世) (1

5.本基金合同生效日为2013年3月13日,基金合同生效日至本报告期期末,本基金运作时间未满半年。 3.2 基金净值表现

3.2.1基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值收 益率①	份額净值收 益率标准差 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
过去一个月	0.2826%	0.0021%	0.1110%	0.0000%	0.1716%	0.0021%
过去三个月	0.9325%	0.0105%	0.3366%	0.0000%	0.5959%	0.0105%
自基金合同生效起至 今	1.0407%	0.0097%	0.4068%	0.0000%	0.6339%	0.0097%
注.1 本丰净估阶兴率	粉炬庇的的其么	5元作 国相 为其	全人同止が口?	5.担於日的法作国制	H	

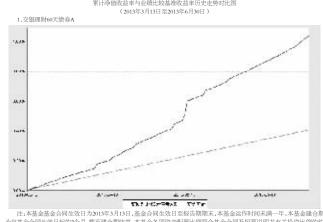
2、本基金每日计算当日收益并分配,并在运作期期末集中支付。 3、本基金的业绩比较基准为人民币七天通知存款税后利率。

	 交银埋财 	60大债券B:					
	阶段	份额净值收益 率①	份额净值收益 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
ſ	过去一个月	0.0720%	0.0055%	0.1110%	0.0000%	-0.0390%	0.0055%
ſ	过去三个月	0.5121%	0.0082%	0.3366%	0.0000%	0.1755%	0.0082%
	自基金合同生 效起至今	0.6342%	0.0075%	0.4068%	0.0000%	0.2274%	0.0075%

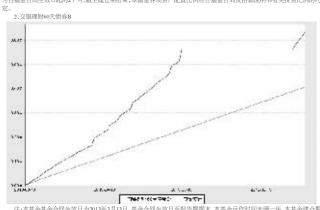
注:1、本表净值收益率数据所取的基金运作周期为基金合同生效日为起始日的运作周期。 2、本基金每日计算当日收益并分配,并在运作期期末集中支付。

3、本基金的业绩比较基准为人民币七天通知存款税后利率。 3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

交银施罗德理财60天债券型证券投资基金 累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



为自基金合同生效日起的2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



.基金合同生效日至报告期期 同生效日起的2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书

4 管理人报告

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

4 管理人报告
4.1 基金管理人及基金经理情况
4.1 基金管理人及其管理基金的经验
本基金的基金管理人为文银施罗德基金管理有限公司。交银施罗德基金管理有限公司是经中国证监会证监基字[2005]
128号文批他 - 7200年5月4日成立的合资基金管理公司。公司总部设于上海、注册资本为2亿元人民币、截止到2015年6月30日、公司已经发行并管理的基金共有二十八只,交银施罗德特选配票证券投资基金(基金合同生效日;2005年9月29日)。交银施罗德货币市场证券投资基金(基金合同生效日;2005年9月21日)、交银施罗德市基份工资金(基金合同生效日;2005年1月21日)、交银施罗德市基份联票证券投资基金(基金合同生效日)。发银振罗德市基份联票证券投资基金(基金合同生效日;2005年1月3日)、发银振罗德市基份表现金(基金合同生效日;2005年3月31日)。交银振罗德市基份表现金(基金合同生效日;2005年3月31日)。交银振罗德市基份表现金(基金合同生效日;2005年3月31日)。发银振罗德市基份表现金(基金合同生效日;2005年3月31日)。交银振罗德市基份表现金(基金合同生效日;2005年3月31日)。交银振罗德市经济企业,2015年3月3日)。

投资基金(基金合同生效日;2007年8月8日)、交粮旅罗德增特所缔争证券投资基金(基金合同生效日;2008年3月31日)、交粮旅 罗德环球精选价值证券投资基金(基金合同生效日;2008年8月22日)、交银旅罗德优势行业灵活配置混合型证券投资基金 (基金合同生效日;2009年1月21日)。交银版罗德先锋段策派券投资基金(基金合同生效日;2009年4月10日)、过证10公司治 理交惠更开放式指数证券投资基金(基金合同生效日;2009年9月25日)、交银版罗德上证180公司治理交惠更开放式指数证券 投资基金保益金(基金合同生效日;2019年1月22日)、交银版罗德生度及活品置混合型证券投资基金(基金合同生效日 日;2010年6月30日)、交银版罗德趋势优先股罪证券投资基金(基金合同生处日;2010年12月22日)。交银版罗德信用添利债 券证券投资基金(基金合同生效日;2011年1月27日)。交银版罗德完建制造股票证券投资基金(基金合同生效日;2011年6月 22日),深证2000价值交易型开放式指数证券投资基金(基金合同生效日;2011年9月22日)。交银版罗德汉利债券证券投资基金 金(基金合同生效日;2011年9月26日)。交银版罗德亚多投资基金(基金合同生效日;2011年9月 1;2011年9月28日)、交银版罗德全线自检索证券投资基金(基金合同生交日)。2011年9月21日)。交银版罗德亚券投资基金(基金合同生效日 至12011年9月28日)、交银版罗德亚券投资基金(基金合同生交日;2011年9月2日)。交银版罗德亚荣安保本混合 型证券投资基金(基金合同生效日;2012年6月20日)。交银版罗德阿尔克比核水及联票证券投资基金(基金合同生效日;2012年6月20日)。 重指数证券投资基金(基金合同生效日;2012年1月17日)。交银版罗德阿尔克特任月1月5日。交银版罗德尔尼的行业分目定 重指数证券投资基金(基金合同生效日;2012年11月7日)。交银版罗德尔尼的信券型发出式证券投资基金(基金合同生效日;2014年12月19日)。

证券投资基金(基金合同生效日;2013年4月18日),交银施罗德莱祥保本混合型证券投资基金(基金合同生效日;2013年4月 24日)和交银施罗德成长30股票型证券投资基金(基金合同生效日;2013年6月5日)。

姓名

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力

法)的相关规定。
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
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、本着被求信用、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、为基金特有人谋求最大利益。
本报告期内,本基金整体运作台规合法,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
法规及基金合同的扩定、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 公平交易制度的执行情况

交银施罗德理财60天债券型证券投资基金

2013 半年度 报告摘要

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公司在交易执行环节实子的平中交易制度。建立公平的交易分配制度。对于交易所公开委价交易,遵循"当间优先、价格优先、比例分配"的原则会全部通过交易系统进行比例分配。对于非集中变价交易。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虚控。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,通过分析评估的信息披露水加速的公平交易过程的建筑建筑和资金,从全方等通过分,是一个发展的发展的交易,提出则内本公司严格执行公平交易制度、公平对持旗下各投资组合,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返明
本报告别内,本公司管理的所有投资组合未发生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能超过该证

**3-2 开市义司17913年99000月 本报告期介,本公司管理的新程资组合未发生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超过该证 券当日总成交量5%的情形。本基金于本报告期内未出现异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析 2013年上半年债券市场跌宕起伏、冰火两重天。5月份末之前,受日本央行宽松政策及全球主流经济体降息影响,债券市 运对性充沛。受市场流动性充沛、经济弱复苏、通胀压力暂时不大、春节前债券发行量相对较小、以及银监会规范商业银行 场流动性充沛。受市场流动性充沛。经济领复苏、通鲜压力暂时不大、春节前债券发行量相对较小、以及假监会规范商业银行理财业务的8号文等多重因素影响,债券市场收益率快速下行,利率债与信用债里规普涨格局。长久期的信用债表现良好,信用利差收售。5月末之后,外部受美联储品出QE预期,内部受金融机均缴付存款储备金与财放缴款、以及6月末季节性等多因素影响,货币市场利率飙升,引发债券市场全面调整、债券收益率曲线股端受货币市场利率高企率响倒置明显。整体而言,债券收益率曲线产组企。等以从申帐债表现优于同年债,信用利差平均扩张10-308p。3年以上的信用债表现优于利率债,信用利差平均有5-158P的收缩。 另末之前,市场流动性充沛,杠杆策略有一定运用空间,本基金采用了造度杠杆操作。综合债券估值,供求变化及资金利率等因素分析,我们认为债券收益率进一步下行空间或将有限、采用了审慎的建仓策略,主要以贴及,期的信用产品为主。5月未观察到市场流动性的趋紧,采取了降杠杆、加强组合流动性管理的操作策略,部分把握了6月中下旬货币市场利率飙升带来的非投资相处。

本报告期内,交银理财60天债券A净值收益率为1.0407%,交银理财60天债券B净值收益率0.6342%,同期业绩比较基准增

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

债券市场宏观环境较好,长久期的利率债与高等级信用债投资机会值得关注。

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、基金营营部、风险管理部等人员和简单的企业。 研究部、基金营营部、风险管理部等人员和简定收益人员及基金宏理组成。 公司严格按照新会计准则、证监会相关规定构基金合同关于估值的实证进行估值、保证基金估值的公平、会理、保持估值 政策和程序的一贯性、估值委员会的研究部或员按收管品带的不同性重,研究并参考市场普遍认同的放击,建议合理的估值 模型,由量化投资部进行测算和认证。认同后交各估值委员会成员从基金会计、风险。台规等方面审批、一致同意后,报公司投

模型、由重化投资资源行;测界和八止、认可与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,及时缘订估值方法。以保证其特殊适用。估值委员会成员以具备相应的专业资格及工作经验,基金经理作为 估值委员会成了水本基金特色工势的交易情况。是每一个成功的工程,的信息或者所以表现,的信债要人会提供估值参考信息。参与 估值委员会成了水本基金特色工势的交易情况。

9毫到。 47 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 遵照法律法规及基金合同的约定,本报告期内交银理财60天A级,B级利润分配信息列示如下;

				单元:人民币元
份額級别	本报告期内 应分配金额	本报告期内 已分配金额	尚未分 配利润 金額	备注
交银理财60天 A级	4,782,913.73	4,782,913.73	-	毎日分配,按运作期结 转份額
交银理财60天 B級	303,401.91	303,401.91	-	毎日分配,按运作期结 转份額
合计	5,086,315.64	5,086,315.64	-	
		5. 托管 人报告		

3.1 据官到19年產业在自入型域下1亩16几平时 本限是朝,中国建设银币设设有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和 其他有关规定。不存在调查基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽贵地履行了基金托管人应尽的义务。 5.2 托管人对报告期内本基金投资应任遵职守信。净值计算、利润的企业研究的说明 本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定、对本基金的基金资产净值计算、基金费用

开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行

报告期内,本基金实施利润分配的金额为A级4,782,913.73元,B级303,401.91元。

53. 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、推确和完整发表意见 本托管人复核审查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。

6 半年度财务会计报告(未经审计)

会计主体:交银施罗德理财60天债券型证券投资基金 报告截止日:2013年6月30日

		平皿:八尺川
资产	附注号	本期末 2013年6月30日
资产:		
银行存款	6.4.7.1	84,857,185.6
结算备付金		3,319,874.7
存出保证金		420.4
交易性金融资产	6.4.7.2	74,908,338.8
其中:股票投资		-
基金投资		-
债券投资		74,908,338.8
资产支持证券投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买人返售金融资产	6.4.7.4	70,197,462.6
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	932,075.7
应收股利		· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·
应收申购款		
递延所得税资产		
其他资产	6.4.7.6	
资产总计		234,215,358.0
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013年6月30日
负 债:		
短期借款		
交易性金融负债		
衍生金融负债	6.4.7.3	
卖出回购金融资产款		
应付证券清算款		1,800,000.0
应付赎回款		
应付管理人报酬		45,251.5
应付托管费		13,407.8
应付销售服务费		49,326.0
应付交易费用	6.4.7.7	14,113.3
应交税费		
应付利息		
应付利润		1,063,924.7
递延所得税负债		
其他负债	6.4.7.8	150,430.3
负债合计		3,136,453.8
所有者权益:		
实收基金	6.4.7.9	231,078,904.1
未分配利润	6.4.7.10	
所有者权益合计		231,078,904.1
负债和所有者权益总计		234,215,358.0

2.本财务报表的实际编制期间为2013年3月15日(基金合同生效日)至2013年6月30日。 3.本摘要中资产负债表和利润表所列附注号为半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 3、本摘要中资产负债表和利润表所列附 登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

本报告期:2013年3月13日(基金合同生效日)至2013年6月30日

項 目	附注号	本期 2013年3月13日(基金合同生效日)至2013年6月30日
一、收人		6,532,175.00
1.利息收入		5,221,550.88
其中:存款利息收入	6.4.7.11	1,707,252.82
债券利息收入		2,066,860.60
资产支持证券利息收入		-
买人返售金融资产收人		1,447,437.46
其他利息收入		-
2.投资收益(损失以"-"填列)		1,310,624.12
其中:股票投资收益		_
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.12	1,310,624.12
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-
衍生工具收益		-
股利收益		-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	6.4.7.14	-
减:二、费用		1,445,859.36
1.管理人报酬		427,050.32
2.托管费		126,533.09
3.销售服务费		448,863.16
4.交易费用		-
5.利息支出		283,787.28
其中:卖出回购金融资产支出		283,787.28
6.其他费用	6.4.7.15	159,625.51
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		5,086,315.64
减:所得税费用		-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		5,086,315.64

会计主体:交银施罗德理财60天债券型证券投资基金

	B	☆合同牛效日)至2013年6月30	本报告期:2013年3月13日(基金
单位:人民币			
3年6月30日	本期 3日(基金合同生效日)至2013	2013年3月1	項目
所有者权益合计	未分配利润	实收基金	
777,917,201.14	-	777,917,201.14	、期初所有者权益(基金净值)
5,086,315.64	5,086,315.64	-	、本期经营活动产生的基金净 1变动数(本期利润)
-546,838,296.96	-	-546,838,296.96	₹、本期基金份額交易产生的基 注净值变动数(净值减少以"-" 填列)
75,621,465.59	-	75,621,465.59	中:1.基金申购款
-622,459,762.55	_	-622,459,762.55	基金赎回款
-5,086,315.64	-5,086,315.64	_	1、本期向基金份额持有人分配 间产生的基金净值变动(净值 《少以"-"号填列)
231,078,904.18	-	231,078,904.18	[、期末所有者权益(基金净值)

本报告6.1至6.4、财务报表由下列负责人签署; 基金管理人负责人:战龙,主管会计工作负责人;许珊燕,会计机构负责人;朱鸣

0.4.1 查查第中167. 交银滤管理则构工质特型证券投资基金(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[2012]第1768号《关于核准交银施罗德理龄60天债券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《交银施罗德理财60天债券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777,735,040.55元,业经普华永道中天会 起公英学29至7成76、任务病院不足,自仅623条米不包括0.例97度/中息大券米入尺川///.533/903501。建全省卡尔迪甲人克 州神事务所特殊普通合伙曾生成迪市天陆宇全司公第第13号整场程序于以脸证。经为申中国证签会备案、《交粮施罗德理640天 萧拳聖证券投资基金基金合同》于2013年3月13日正式生欢、基金合同生效日的基金份额总额为777,917.201.14份基金份额,其 中认购资金利息折合182,160.59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,基金托管人为中国建设

银行股份有限公司。 根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德理财60天债券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能动性的金融工具,包括现金,通知存款,一年以内(含一年)的银行定期存款和大额存单,剩余期限 (或回售期限)在 307天以内(含 307天)的债券,资产支持证券和中期票据,期限在一年以内(含一年)的债券回购,期限 一年以内(含一年)的中央银行服据和短期搬货券,以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他固定收益类金融工具 及相关衍生工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种,基金管理人在履行 可以将其纳人投资范围,其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。本基金的业绩比较基准为:人民币七天

业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(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》、《交银施罗德理财60天债券型证券投资基金基金合同》和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

6-4.3 連續企业会計會與政權有关級定的時期 本基金2013年3月13日(基金合同生效日)至2013年6月30日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实,完整地反映 才基金2013年3月13日(基金合同生效日)至2013年6月30日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实,完整地反映 方本基金2013年6月30日此期间的经营成果和基金净值变 动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2013年3月13日(基金合同生效日)至

6.4.4.2 记账本位币 本基金的记账本位币为人民币。 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融

资产及持有至到期投资。 本基金目前持有的债券投资分类为以公允价值计量日其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量日其公允价值

本基金目前持有的佛界投资分类为以允允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值 安却计人超达的金融资产在资产价值表申以支贴性金融资产列示。 本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活 股市场中没有报价。回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。 ()金融负债的分类 金融负债于初始确认对分类为;以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金。

融负债分类为以公允价值计量且其变动计人当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认 2.4747 建原以 1745年以间1767年以北京村 建水平上地区 2.486以 1745年 2.486的以 1745年 2.4

交易费用计人初始确认金额。 债券投资采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量,即债券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息,按实际利

率法在其剩余期限内摊销其买人时的溢价或折价;同时于每一计价日计算影子价格,以避免债券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。 金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认;(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2)该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转人方;或者(3)该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没

本無金符金細設产所有以上几乎所有即风险机取酬转移指转入方。或者(3)该金細资产已转移。虽然本基金就没有转移也没有保留金融资产所有以及几乎所有的风险时期,但是成产了对该金融资产控制。 金融资产终上确认时,其账面价值与收到的对价的差额;计入当期损益。 当金融负债的到时又务全部或部分已经解除时,终上确认该金融负债或又务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与 支付的对价之间的差额;计入当期损益。 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则。

本基金的债券投资等金融资产,均以实际利率法计算的推余成本估算公允价值。在本基金存续期间,基金管理人定期计 算本基金投资组合摊余成本与其他可参考公允价值指标之间的偏离程度,并定期测试其他可参考公允价值指标确定方法的 有效性。投资组合的摊余成本与其他可参考公允价值指标产生重大偏离的,按其他公允价值指标对组合的账面价值进行调 整,调整差额确认为"公允价值变动损益",并按其他公允价值指标进行后续计量。如基金份额净值恢复至1元,恢复使用摊余

版本估算公允价值。 版本估算公允价值,现在一个工作, 如有确凿证据录明按上述方法不能客观反映交易性金融工具的公允价值,基金管理人将根据具体情况与基金托管人商 定品确定是能反映公允价值的价格。 6.44.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种 法定权利现在是可执行的;且2) 交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示

0.3-17-25-25-33-33 实收基金为对外发行基金份额所对应的金额,每份基金份额而值为人民币1.00元。由于申购,赎回及分红再投资等引起的 实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。上述申购和赎回分别包括因类别调整而引起的A.B级基金份额之间的转换 所产生的实现基金变动。 64.48 收入/债失)的确认和计量

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

基金持有的附息债券、贴现券按摊余成本和实际利率计算确定利息收入 产支持证券利息收入在持有期内,按摊余成本和实际收益率计算确认利息收入

买人返售金融资产收人按买人返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提

天八公百並贈取 "水八以天八公百並應成」可如此原本中任公百期的以大時中年伝達日的應。 一投環稅益 债券投资收益于交易日按卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。 资产支持证券投资收益于交易日按卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券摊余成本与应收利 比与运动的途径的 本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。 6.4.4.10 基金的收益分配政策

6.4.4.10 基金的吹运分产业收乘 本基金A.B哪姓基金单独计算各级基金份额的每万份收益和基金七日年化收益率。 1)基金收益分配原则遵循国家有关法律规定并符合基金合同的有关规定; 2)本基金根据每日基金收益情况、以基金净收益均蒸准,为投资人每日计算当日收益并分配,并在运作期期末集中支付; 3)同一级别词一基金份额享有同等分配权; 4)当日申购的基金份额自下一个工作日起享有基金的分配权益。当日赎回的基金份额自下一个工作日起不享有基金的分

5)基金收益分配方式为红利再投资; 6)法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

9位注针在规则益暂约4元为有规定的,次共规定。 64.411 分部报告 本基金以内部组织结构,管理要求,内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信 息. 总营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分。(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用;(2)本基金的 基金管理人能够定期评价(涂组成部分的经验成果,以决定向其配置资源、评价主业绩;(3)本基金能够取得该组成部分的财务 状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征,并且满足一定条件的,则合并为

本基金目前以一个单一的经营分部运作,不需要进行分部报告的披露 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策和会计估计变更以及差 6.4.5.1 会计政策变更的说明 本基金本报告期未发生会计政策变更。 6.4.5.2 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。

本基金在本报告期间无需说明的会计差错更正。 6.4.6 税项

揭掘财政部 国家税条总局财税[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收回题的通知》财税[2004]78号文《关 工作规则成本记录的无效的例析[2004][26-52 代 1 / 成人证的文页基础有关的处理的通知/ "则优益的16-52 大 正常转投资基金的收收货的通知》,财税(2008)[号(财政》 国家税务总局关产业所得税差干优惠政策的通知)、国税函 [2008]870号(关于做好证券市场个人投资者证券交易结算资金利息所得免证个人所得税工作的通知)及其他相关税务法规和实务操作。主要税项则未加下; 2)对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖债券的差价收入,债券的利息收入及其他收入,暂不缴纳企业所得

3)对基金取得的债券利息收入,由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税,暂不缴纳企业

647 关联方关系 6-4.7 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况 本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。 6-4.72 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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 中国建设银行股份有限公司("中国建设银行" 交通银行股份有限公司("交通银行") 注,下述关联交易均在正常业多劳用内按一船商业条款。

在:「定天收火物學」」在正好完团的對於 版同显示。 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易 本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.2.1 基金管理费

注:支付基金管理人交银施罗德基金公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.27%的年费率计提,逐日累计至3 月月底,按月支付。其计算公式为,日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.27%;当年天数

6.4.8.2.2基金托管费 2013年3月13日(基金合同生效日)至2013年6月30日 当期发生的基金应支付的托管费

注:支付基金托管人中国建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.08%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: 日基金托管费=前一日基金资产净值×0.08%÷当年天数

2013年3月13日(基金合同生效日)至2013年6月30日 获得销售服务费的各关联方名称 277,304.50 277,816.0

445,996.43 在:本卷盒头行间自服券效分级収货力式,分设A.B网验盘盒分额;A效基盒按前一日盘盒货产单值0.30%的干货率是日 挂编售服务房。B级基金按询一日基金资产命值0.01%的干费率逐日计量。ED 累计至每月月底,按月支付给交银施罗德基 金公司,再由交银施罗德基金公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为; A级基金日销售服务费=前一日A级基金份额对应的资产净值×0.01%-当年天数; B级基金日销售服务费=前一日B级基金份额对应的资产净值×0.01%-当年天数。 6-8.3 与关联方进行银行间回业市场的债券合回购分易 本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券合回购交易。

6.4.8.4各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况 本基金本报告期內未发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。 64.84.2 报告期末效生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况 本报告期末龄基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况 本报告期末龄基金管理人之外的其他关联方未将本基金。 64.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

本期 2013年3月13日(基金合同生效日)至2013年6月30日 国建设银行-活! 1,857,185. 67,017.

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销证券 6.4.8.7其他关联交易事项的说明 本基金本报告期内无其他关联交易事项。 小磁速中枢区到7月、34世之秋火の中水泥。 6.4.9 期末(2013年6月30日)本选业特有的流通受限证券 6.4.9 团从购ຫ"发力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团以购财及/增发证券而流通受限的证券。 6.4.9 2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票

6.4.9.3 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 7 投资组合报告

报告期内债券回购融资余额

其中:买断式回购融资

7.1 期末基金资产组合情况

序号 項目 金額				金额甲位:人民市:
其中,债券 74,908,338.81 31.98	序号	项目	金額	
資产支持证券 - - 2 买人返售金融资产 70,197,462.60 29,97 其中、买断式回购的买入返售金融资产 - - 3 银行存款和结算备付金合计 88,177,060.45 37.65 4 其他各项资产 932,496.17 0.40	1	固定收益投资	74,908,338.81	31.98
2 买人返售金融资产 70,197,462.60 29,97 其中、买新式回购的买人返售金融资产 - - 3 银行存款和结算备付金合计 88,177,060.45 37,65 4 其他各项资产 932,496.17 0.40		其中:债券	74,908,338.81	31.98
其中,买断式回购的买人返售金融		资产支持证券		_
资产 - 3 银行存款和结算备付金合计 88,177,060.45 37.65 4 其他各项资产 932,496.17 0.40	2	买人返售金融资产	70,197,462.60	29.97
4 其他各项资产 932,496.17 0.40			-	-
	3	银行存款和结算备付金合计	88,177,060.45	37.65
5 合计 234,215,358.03 100.00	4	其他各项资产	932,496.17	0.40
	5	合计	234,215,358.03	100.00

內融资余额占基金资产净值的比例为报告期

2013-05-17

2013-05-15

序号

[海平下沙国]。 债券正回期的资金余额超过基金资产净值的20%的说明 本基金合同约定: "本基金进入全国银行闰同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%"。本报告期 内,本基金米史起标情况。 7.3 基金投资组合平均剩余期限 7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况 期内投资组合平均剩余期限最低值

2013-05-22 巳在10个工作日内完成 调整

平均剩余期限 其中:剩余存续期超过397天 动利率债 其中:剩余存续期超过397天 动利率债

成本 占基金资产净值比例(%)	推余成本	债券品种	序号
-		国家债券	1
		央行票据	2
		金融债券	3
		其中:政策性金融债	
4,877,546.20 2.11	4,877,54	企业债券	4
70,030,792.61 30.31	70,030,79	企业短期融资券	5
		中期票据	6
		其他	7
74,908,338.81 32.42	74,908,33	合计	8
		剩余存续期超过397天的浮动利率债券	9

					1911 (%)
1	041360019	13 / ⊞CP001	100,000	10,020,429.04	4.34
2	041369018	13京粮CP001	100,000	10,008,047.18	4.33
3	041366008	13苏沙钢CP001	100,000	10,007,038.40	4.33
4	041358016	13成商CP001	100,000	10,003,021.18	4.33
5	041358015	13美邦CP001	100,000	10,001,048.72	4.33
6	041369015	13星马汽车CP001	100,000	10,000,761.86	4.33
7	011340003	13港中旅SCP003	100,000	9,990,446.23	4.32
8	126013	08青啤债	49,960	4,877,546.20	2.11
7.6 ":	影子定价"与"摊余	成本法"确定的基金资产净	值的偏离		
		項目	伯 家情 况		

债券数量(张)

报告期内偏离度的最高值 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值

7.7 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 本报告期末本基金未持有资产支持证券。

78.1 金基尼贝门尼亚 电对象 在某一个人,即计价对象以买人成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买人时的溢价与折价,在其余期限内按照实际利率和摊余成本逐日摊销计算损益。 7.8.2 本基金报告期每日持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本均未超过当日基

7.8.3 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 7.8.4期末其他各项资产构成

420.46

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

均持有的基金 130,996. 10,055,107. 191,023,797. 30,000,000 30,000,000. 8.2 期末基金 占基金总份额比例 8金管理人所有从业人员 持有本基金 交银理财60天债券B

注: 本基金官埋人的局级官埋人员、基金	投資和研究部 」	埋木狩有本基金。					
单位:							
项目	交银理财60天债券A	交银理财60天债券B					
基金合同生效日(2013年3月13日)基金 份额总额	756,744,683.05	21,172,518.09					
基金合同生效日起至报告期期末基金 总申购份额	10,782,462.27	64,839,003.32					
减:基金合同生效日起至报告期期末基 金总赎回份额	566,448,241.14	56,011,521.41					
基金合同生效日起至报告期期末基金 拆分变动份额	-	-					
本报告期期末基金份额总额	201 078 904 18	30,000,000,00					

注:1、如果本报告期间发生转换人、红利再投、份额级别调整业务,则总申则 额中包含该业务; 2、如果本报告期间发生转换出、价额级别调整业务,则总则 中包含该业务。

10 重大事件揭示 10.1 基金份额持有人大会决议

10.1 基金价额持有人大会决议 本基金和报告则未召开基金价额持有人大会。 10.2 基金管理人基金代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。本基金管理人本报告期内未发生重大人事变动。 2.基金托管人的基金托管部门即重大人事变动。本基金托管(人的基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。 10.3 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。

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

本基金中版日初的政政规则公正以及。 10.5 报告别为公债会计师事务所经况 本基金自基金合同生效日起聘请普华永进中天会计师事务所、榜殊普通合伙为本基金提供审计服务。 10.6 管理人、托舍人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况 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。 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 10.7.1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

					金额早日	1:人民市		
		股票交易		应支付该券商的佣金		备注		
券商名称	交易单元数量	成交金額	占当期股票 成交总额的 比例	佣金	占当期佣金 总量的比例			
中信建投证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-		
申银万国证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-		
40月8世众和田江华八司六日益二世仁世庙江华机次始建河								

成交金额 交总额! 比例 成交金额 成交金额 1,142,202,000.00 35.58% 注:1、报告期内,本基金交易单元均为新增交易单元

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

单位:人民币元

交银施罗德基金管理有限公司 二〇一三年八月二十六日