交银施罗德蓝筹股票证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013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:二〇一三年十月二十四日

§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2013年10月23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2013年7月1日起至2013年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	交银蓝筹股票	
基金主代码	519694	
交易代码	519694(前端)	519695(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2007年8月8日	
报告期末基金份额总额	10,656,117,988.56份	
投资目标	本基金为一只蓝筹股票基金,主要通过投资于业绩优良、发展稳定、在行业内占有支配性地位、分红稳定的蓝筹上市公司股票,在有效控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下,追求在稳定分红的基础上实现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,将严谨、规范化的选股方法与积极主动的投资风格相结合,通过优选业绩优良、发展稳定、在行业内占有支配性地位、分红稳定的蓝筹上市公司股票进行投资,以谋求基金资产的长期稳定增长。	
业绩比较基准	75%×中证100指数+25%×中信标普全债指数	
风险收益特征	本基金是一只股票型基金,以优质蓝筹股为主要投资对象,属于证券投资基金中较高预期收益和较高风险的品种,本基金的风险与预期收益都要高于混合型基金和债券型基金。	
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	

§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(2013年7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	131,467,258.86
2.本期利润	911,804,828.75
3.加权平均基金份额本期利润	0.0835
4.期末基金资产净值	8,438,661,813.05
5.期末基金份额净值	0.7919

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。

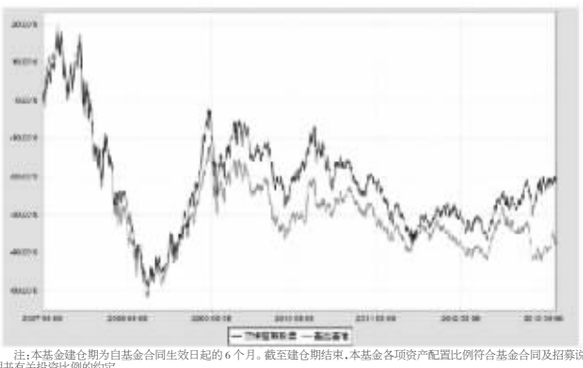
3.2 基金净值表现

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	11.71%	1.24%	5.80%	1.14%	5.91%	0.10%

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

交银施罗德蓝筹股票证券投资基金
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
(2007年8月8日至2013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,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		
张媚钗	本基金的基金经理	2010-6-4	-	11年	张媚钗女士,经济学硕士。历任申银万国证券研究所研究员。2005年加入交银施罗德基金管理有限公司,历任投资研究部研究员、基金经理助理和专户投资经理。

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

本报告期内,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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2013年三季度中国经济并没有延续二季度的下滑趋势,7、8月份规模以上工业增加值同比实际增长分别为9.7%和10.4%,较6月数据明显上升,也高于去年同期水平,明显超出市场预期。1-8月份全国固定资产投资同比名义增长20.3%,较1-6月数据有所反弹,但增速仍略低于去年全年水平。7、8月进出口同比增速也较6月有所回升,但环比没有显著改善。三季度PMI指数持续回升,9月已回升至51.1,其中原材料购进价格指数和新订单指数回升明显,但库存与生产指数变化不大。

三季度物价水平波动不大,8月CPI微幅回落到2.6%,PPI则在负值区间出现反弹,8月PPI为-1.6%。货币政策在二季度保持稳定,8月末,广义货币(M2)余额106万亿元,同比增长14.7%,分别比上月末和上年同期高0.2个和1.2个百分点。在经历了6月货币市场利率的大幅波动之后,央行持续进行逆回购,基本保持了货币市场利率的稳定,但趋中偏紧。

超预期的宏观经济和偏紧的资金面压制了债券市场的表现,三季度债券市场各类品种轮番下跌,7、8、9月中债全价总指数分别下跌了0.8%,1.46%和0.44%,整个三季度中债企业债全价指数下跌了1.44%。三季度股票市场表现突出,沪深300指数上涨了9.47%,创业板指数涨幅更是高达三成,本基金由于较早降低了债券持仓,并维持了可转债的持仓,净值表现明显好于业绩比较基准。

展望四季度,本基金预期经济基本面出现持续走强的概率偏小,转型之路预计仍将痛苦而持续。债券和股票市场也将面临利率市场化等诸多因素的考验,风险与机会并存。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2013年9月30日,本基金份额净值为0.7919元,本报告期份额净值增长率为11.71%,同期业绩比较基准增长率为5.80%。

§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	6,590,228,207.53	77.54
	其中:股票	6,590,228,207.53	77.54
2	固定收益投资	250,972,774.99	2.95
	其中:债券	250,972,774.99	2.95
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	868,474,962.71	10.22
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	781,525,474.88	9.20
6	其他各项资产	7,512,618.18	0.09
7	合计	8,498,714,038.29	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	120,701,362.00	1.43
B	采矿业	16,696,862.84	0.20
C	制造业	4,343,344,073.45	51.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	29,520,000.00	0.35
E	建筑业	305,926,063.47	3.63
F	批发和零售业	151,291,902.26	1.79
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	671,504,125.62	7.96
J	金融业	95,737,953.36	1.13
K	房地产业	268,166,744.00	3.18
L	租赁和商务服务业	274,358,019.50	3.25
M	科学研究和技术服务业	29,366,182.50	0.35
N	水利、环境和公共设施管理业	271,471,279.20	3.22
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	12,143,639.33	0.14
S	综合	-	-
	合计	6,590,228,207.53	78.10

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	002415	海康威视	21,160,008	558,624,211.20	6.62
2	600887	伊利股份	11,000,000	491,480,000.00	5.82
3	600535	天士力	8,700,000	391,674,000.00	4.64
4	300070	碧水源	6,670,056	271,471,279.20	3.22
5	000423	东阿阿胶	6,700,000	270,747,000.00	3.21
6	600703	三安光电	12,011,966	243,722,790.14	2.89
7	000024	招商地产	9,310,281	223,446,744.00	2.65
8	002148	北纬通信	2,822,564	189,111,788.00	2.24
9	300058	蓝色光标	2,743,395	183,807,465.00	2.18
10	002223	鱼跃医疗	7,013,937	179,276,229.72	2.12

5.4 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	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	209,267,000.00	2.48
	其中:政策性金融债	209,267,000.00	2.48
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	41,705,774.99	0.49
8	其他	-	-
9	合计	250,972,774.99	2.97

5.5 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	100227	10国开27	800,000	79,928,000.00	0.95
2	130218	13国开18	800,000	79,464,000.00	0.94
3	130201	13国开01	500,000	49,875,000.00	0.59
4	113001	中行转债	274,700	27,478,241.00	0.33
5	110023	民生转债	84,080	8,896,504.80	0.11

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。

5.8 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。

5.9 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。

5.10 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(元)
1	存出保证金	1,968,602.51
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,468,551.79
5	应收申购款	75,463.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,512,618.18

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113001	中行转债	27,478,241.00	0.33
2	110023	民生转债	8,896,504.80	0.11
3	125887	中鼎转债	3,530,122.84	0.04

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在在流通受限的情况。

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	11,110,276,765.50
本报告期基金总申购份额	8,695,792.90
减:本报告期基金总赎回份额	462,854,569.84
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	10,656,117,988.56

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 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

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;本基金管理人本报告期末持有本基金份额19,034,797.82份,占本基金期末总份额的0.18%。

§8 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华谊兄弟(证券代码:300027)股票自2013年7月22日起按照指数收益法进行估值,并已于2013年7月26日起恢复按市场价格进行估值;本基金对其所持有的省广股份(证券代码:002400)股票自2013年9月18日起按照指数收益法进行估值。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录
1、中国证监会批准交银施罗德蓝筹股票证券投资基金募集的文件;
2、《交银施罗德蓝筹股票证券投资基金基金合同》;
3、《交银施罗德蓝筹股票证券投资基金招募说明书》;
4、《交银施罗德蓝筹股票证券投资基金托管协议》;
5、关于募集交银施罗德蓝筹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蓝筹股票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。

交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013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:二〇一三年十月二十四日

§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2013年10月23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2013年7月1日起至2013年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	交银稳健配置混合	
基金主代码	519690	
交易代码	519690(前端)	519691(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2006年6月14日	
报告期末基金份额总额	3,107,783,277.66份	
投资目标	本基金将坚持并不断深化价值投资的基本理念,充分发挥专业研究与管理能力,根据宏观经济周期和市场环境的变化,自上而下灵活配置资产,自下而上精选证券,有效分散风险,谋求实现基金财产的长期稳定增长。	
投资策略	把握宏观经济和投资市场的变化趋势,根据经济周期理论动态调整投资组合比例,自上而下配置资产,自下而上精选证券,有效分散风险。	
业绩比较基准	65%×MSCI中国A股指数+35%×中信标普全债指数	
风险收益特征	本基金是一只混合型基金,属于证券投资基金产品中的中等风险品种,本基金的风险与预期收益处于股票型基金和债券型基金之间。	
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	

注:本基金业绩比较基准自2013年7月1日起,由"65%×MSCI中国A股指数+35%×新华巴克莱资本中国全债指数"变更为"65%×MSCI中国A股指数+35%×中信标普全债指数",详情见本基金管理人于2013年6月26日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于变更交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金业绩比较基准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(2013年7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	-189,940,731.54
2.本期利润	235,431,198.76
3.加权平均基金份额本期利润	0.0730
4.期末基金资产净值	3,722,077,500.50
5.期末基金份额净值	1.1977

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

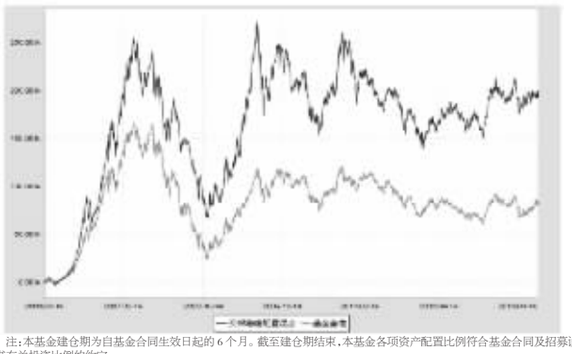
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	6.42%	0.99%	7.39%	0.90%	-0.97%	0.09%

注:本基金业绩比较基准自2013年7月1日起,由"65%×MSCI中国A股指数+35%×新华巴克莱资本中国全债指数"变更为"65%×MSCI中国A股指数+35%×中信标普全债指数",3.2.2同。详情见本基金管理人于2013年6月26日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于变更交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金业绩比较基准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

交银施罗德稳健配置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
(2006年6月14日至2013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,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		
张科兵	本基金的基金经理、公司研究总监、监事	2011-7-19	-	10年	张科兵先生,上海交通大学学士。历任安达信(上海)企业咨询有限公司审计部高级审计师,普华永道会计师事务所审计部项目经理,第一证券有限责任公司投资部投资经理,申万巴黎基金管理有限公司(现申万菱信基金管理有限公司)投资管理部高级研究员、2007年加入交银施罗德基金管理有限公司,历任高级研究员、研究部副总经理、研究部总经理,2012年3月13日至2013年4月25日担任交银施罗德先进制造股票证券投资基金基金经理。

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

本报告期内,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量超过该证券当日总成交量5%的情形。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2013年三季度中国经济并没有延续二季度的下滑趋势,7、8月份规模以上工业增加值同比实际增长分别为9.7%和10.4%,较6月数据明显上升,也高于去年同期水平,明显超出市场预期。1-8月份全国固定资产投资同比名义增长20.3%,较1-6月数据有所反弹,但增速仍略低于去年全年水平。7、8月进出口同比增速也较6月有所回升,但环比没有显著改善。三季度PMI指数持续回升,9月已回升至51.1,其中原材料购进价格指数和新订单指数回升明显,但库存与生产指数变化不大。

三季度物价水平波动不大,8月CPI微幅回落到2.6%,PPI则在负值区间出现反弹,8月PPI为-1.6%。货币政策在二季度保持稳定,8月末,广义货币(M2)余额106万亿元,同比增长14.7%,分别比上月末和上年同期高0.2个和1.2个百分点。在经历了6月货币市场利率的大幅波动之后,央行持续进行逆回购,基本保持了货币市场利率的稳定,但趋中偏紧。

超预期的宏观经济和偏紧的资金面压制了债券市场的表现,三季度债券市场各类品种轮番下跌,7、8、9月中债全价总指数分别下跌了0.8%,1.46%和0.44%,整个三季度中债企业债全价指数下跌了1.44%。三季度股票市场表现突出,沪深300指数上涨了9.47%,创业板指数涨幅更是高达三成,本基金由于较早降低了债券持仓,并维持了可转债的持仓,净值表现明显好于业绩比较基准。

展望四季度,本基金预期经济基本面出现持续走强的概率偏小,转型之路预计仍将痛苦而持续。债券和股票市场也将面临利率市场化等诸多因素的考验,风险与机会并存。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2013年9月30日,交银稳健配置混合型证券投资基金份额净值为1.1977元,本报告期份额净值增长率为6.42%,同期业绩比较基准增长率为7.39%。

§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	3,194,406,156.58	84.83
	其中:股票	3,194,406,156.58	84.83
2	固定收益投资	49,875,000.00	1.32
	其中:债券	49,875,000.00	1.32
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	102,096,824.46	2.71
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	53,896,392.16	1.43
5	银行存款和结算备付金合计	416,331,986.50	11.06
6	其他各项资产	2,938,779.38	0.08
7	合计	3,765,648,746.92	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	2,647,225,497.99	71.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	24,260,070.24	0.65
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	83,746,347.20	2.25
G	交通运输、仓储和邮政业	21,812,151.00	0.59
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	49,713,475.24	1.34
J	金融业	30,270,000.00	0.81
K	房地产业	72,180,187.00	1.94
L	租赁和商务服务业	151,589,959.80	4.07
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	83,061,903.10	2.23
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	30,546,565.01	0.82
S	综合	-	-
	合计	3,194,406,156.58	85.82

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	002415	海康威视	10,183,532	268,845,244.80	7.22
2	600315	上海家化	5,326,218	231,211,123.38	6.21
3	002570	贝因美	4,575,775	190,352,240.00	5.11
4	600887	伊利股份	3,982,272	177,927,912.96	4.78
5	600585	海螺水泥	10,075,279	150,524,668.26	4.04
6	000538	云南白药	1,223,709	143,247,375.54	3.85
7	600352	浙江龙盛	9,905,381	121,340,917.25	3.26
8	600535	天士力	2,679,740	120,641,894.80	3.24
9	002344	海宁皮城	4,975,944	107,977,984.80	2.90
10	000625	长安汽车	9,764,574	100,575,112.20	2.70

5.4 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	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	49,875,000.00	1.34
	其中:政策性金融债	49,875,000.00	1.34
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	49,875,000.00	1.34

5.5 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	130201	13国开01	500,000	49,875,000.00	1.34

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。

5.8 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。

5.9 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。

5.10 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(元)
1	存出保证金	1,336,943.08
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,363,576.47
5	应收申购款	238,259.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,938,779.38

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在在流通受限的情况。

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	3,311,807,063.19
本报告期基金总申购份额	28,398,952.88
减:本报告期基金总赎回份额	232,422,738.41
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	3,107,783,277.66

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 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

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;本基金管理人本报告期末持有本基金份额86,161,914.71份,占本基金期末总份额的2.77%。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

为提高本基金的业绩与业绩比较基准的可比性和增强本基金业绩评价的适用性,本基金管理人根据基金合同的相关规定,经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案后,决定自2013年7月1日起,本基金的业绩比较基准由"65%×MSCI中国A股指数+35%×新华巴克莱资本中国全债指数",变更为"65%×MSCI中国A股指数+35%×中信标普全债指数",并相应修改基金合同的相关内容。

上述变更事项不涉及基金份额持有人权利义务关系的变化,对本基金投资及基金份额持有人利益无不利影响。

详情请见本基金管理人于2013年6月26日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于变更交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金业绩比较基准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、中国证监会批准交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金募集的文件;
2、《交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金基金合同》;
3、《交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金招募说明书》;
4、《交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金托管协议》;
5、关于募集交银施罗德稳健配置混合型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稳健配置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。

交银施罗德增利债券证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013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:二〇一三年十月二十四日

§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2013年10月23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2013年7月1日起至2013年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	交银增利债券	
基金主代码	519680	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008年3月31日	
报告期末基金份额总额	1,884,514,627.03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、流动性风险前提下,主要通过投资承担一定信用风险、具有较高息票率的债券,实现基金资产的长期稳定增长。	
投资策略	本基金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