交银施罗德先锋股票证券投资基金

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:中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业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	交银先锋股票	
基金主代码	519698	
交易代码	519698(前端)	519699(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009年4月10日	
报告期末基金份额总额	1,169,395,694.59份	
投资目标	本基金主要通过投资于经过严格的品质筛选且具有持续成长潜力企业的股票,特别是处于快速成长过程中的中型及小型企业股票,在适度控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求长期持续的资本增值。	
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势,在分析和判断宏观经济运行和行业景气变化,以及上市公司成长潜力的基础上,主要通过优选成长性好、成长具有可持续性、成长质量优良、定价相对合理的股票,特别是处于快速成长过程中的中型及小型企业股票进行投资,以谋求超额收益。	
业绩比较基准	75%×中证700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,以具有持续成长潜力企业的股票,特别是处于快速成长过程中的中型及小型企业为主要投资对象,属于证券投资基金中较高预期收益和较高风险的品种。	
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	

§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	16,376,032.50
2.本期利润	117,969,003.26
3.加权平均基金份额本期利润	0.0949
4.期末基金资产净值	1,413,046,954.97
5.期末基金份额净值	1.2084

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

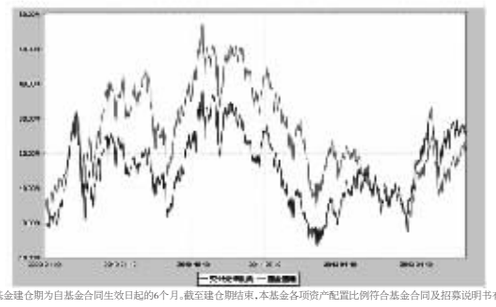
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	8.08%	1.23%	12.30%	1.04%	-4.22%	0.19%

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

交银施罗德先锋股票证券投资基金

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

(2009年4月10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		
王少成	本基金的基金经理、交银施罗德先进制造股票证券投资基金基金经理、交银施罗德成长30股票型证券投资基金基金经理	2013-5-29	-	9年	王少成先生,复旦大学硕士学历,历任上海融昌资产管理公司研究员、中原证券投资经理,信诚基金管理有限公司研究总监助理、东吴基金管理有限公司投资经理、基金经理、投资部副总经理。其中2010年9月至2012年10月担任东吴新创业股票型证券投资基金基金经理,2011年2月至2012年11月担任东吴中证新兴产业指数证券投资基金基金经理,2011年5月至2012年11月担任东吴价值成长双动力股票型证券投资基金基金经理,2012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,沪深300指数上涨9.47%,本基金的业绩比较基准上涨12.30%。本基金净值上涨8.08%,跑输沪深300指数和业绩比较基准。

三季度本基金保持中性偏高的仓位,三季度国内宏观经济阶段企稳,市场前期的悲观预期得到部分的修正,结构性行情依旧,其间具有鲜明主题特征的低估值板块具有巨大的涨幅。本基金在低估值板块配置虽然较高,但是地产、建筑装饰和白酒的行业配置对基金的表现有所影响。

四季度预计市场保持平稳,行业板块间巨大的涨幅差异会有所收窄。四季度国内宏观经济复苏势头明显趋缓,宏观经济进入触底不反弹的尴尬局面,流动性的内外部扰动都较多,偏紧的概率更大一些。我们认为A股市场的成长股投资预计依然是大的趋势,对于合理估值的要求,依然是组合风险控制的一个关键因素。流动性偏紧的背景下,四季度高估值板块的相对收益预计可能将会受到抑制。

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1.2084元,本报告期份额净值增长率为8.08%,同期业绩比较基准增长率为12.30%。

§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	1,225,546,187.22	86.48
	其中:股票	1,225,546,187.22	86.48
2	固定收益投资	49,665,000.00	3.50
	其中:债券	49,665,000.00	3.50
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	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	139,342,406.91	9.83
6	其他各项资产	2,618,737.92	0.18
7	合计	1,417,172,332.05	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	34,060,065.90	2.41
C	制造业	910,189,275.74	64.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	81,627,534.90	5.78
F	批发和零售业	34,707,228.16	2.46
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	-	-
J	金融业	21,025,086.60	1.49
K	房地产业	97,983,397.82	6.93
L	租赁和商务服务业	45,953,598.10	3.25
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	1,225,546,187.22	86.73

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	000100	TCL集团	52,570,445	119,860,614.60	8.48
2	600967	北方创业	6,719,058	99,710,820.72	7.06
3	300005	探路者	6,170,982	92,256,180.90	6.53
4	000423	东阿阿胶	2,227,956	90,031,701.96	6.37
5	002415	海康威视	3,374,098	89,076,187.20	6.30
6	600596	新安股份	5,527,645	73,794,060.75	5.22
7	600315	上海家化	1,633,121	70,893,782.61	5.02
8	000651	格力电器	2,440,136	64,810,012.16	4.59
9	002400	省广股份	1,046,779	45,953,598.10	3.25
10	002140	东华科技	2,272,262	44,786,284.02	3.17

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	49,665,000.00	3.51
	其中:政策性金融债	49,665,000.00	3.51
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	49,665,000.00	3.51

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	130218	13国开18	500,000	49,665,000.00	3.51

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	543,956.22
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	771,699.74
5	应收申购款	1,303,081.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,618,737.92

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

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	002400	省广股份	45,953,598.10	3.25	重大事项停牌

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	1,303,684,932.95
本报告期基金总申购份额	22,879,302.96
减:本报告期基金总赎回份额	157,168,541.32
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,169,395,694.59

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、红利再投资;本基金管理人本报告期末持有本基金份额31,383,498.04份,占本基金期末总份额的2.68%。

§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、中国证监会核准交银施罗德先锋股票证券投资基金募集的文件;

2、《交银施罗德先锋股票证券投资基金基金合同》;

3、《交银施罗德先锋股票证券投资基金招募说明书》;

4、《交银施罗德先锋股票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先锋股票证券投资基金之法律意见书;

8、报告期内交银施罗德先锋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。

上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金

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:中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业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	交银上证180公司治理ETF
基金主代码	510010
交易代码	510010
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2009年9月25日
报告期末基金份额总额	3,549,524,362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	本基金采用完全复制法,跟踪上证180公司治理指数,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,但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。
业绩比较基准	上证180公司治理指数
风险收益特征	本基金属股票基金,风险与收益高于混合基金、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,属于证券投资基金中风险较高、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

注:1、本表所列的基金主代码510010为本基金二级市场交易代码,本基金一级市场申购赎回代码为510011。

2、本基金场内简称为“治理ETF”。

§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	-164,354,452.10
2.本期利润	245,864,040.31
3.加权平均基金份额本期利润	0.0574
4.期末基金资产净值	2,307,898,994.14
5.期末基金份额净值	0.650

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

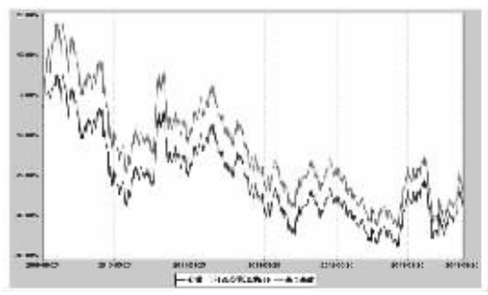
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	9.80%	1.58%	8.56%	1.58%	1.24%	0.00%

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

上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金

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

(2009年9月25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3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		
蔡铮	本基金及其联接基金、交银深证300价值ETF及其联接基金、交银沪深300分层等权指数基金基金经理	2012-12-27	-	4年	蔡铮先生,复旦大学电子工程硕士,历任瑞士银行香港分行分析员,2009年加入交银施罗德基金管理有限公司,历任投资研究部数量分析师、基金经理助理。

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年三季度国内宏观经济处于总体平稳态势,一方面资金面情况经历了六月中下旬的高度紧张后,进入到第三季度已恢复到相对平稳水平,使得市场参与者的情绪逐步从谨慎转变为偏向乐观;另一方面国内经济增长持续温和复苏,通胀压力可控,政府对经济的维稳决心给予市场参与者以经济稳定增长的预期。

在平稳增长的宏观经济环境下,本季度市场整体表现为震荡上扬态势,作为紧密跟踪指数的指数基金,本基金的净值表现也呈现上行趋势。本季度市场表现出显著的结构性特征,以改革、转型为主题的中小市值股票表现明显强于传统大市值周期股。

展望四季度,经济有望继续保持稳健增长,政府持续、坚决地推进改革及转型,或能增强投资者对中长期经济的信心。资本市场已给予改革、转型相关行业较高溢价,印证了对当前宏观经济抱有较高期许,资本市场或可延续第三季度的走势,良性可持续地逐步回暖。

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0.650元,本报告期份额净值增长率为9.80%,同期业绩比较基准增长率为8.56%。本报告期内本基金的日均跟踪偏离度为0.07%,跟踪误差为0.09%。

§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	2,303,559,914.22	99.73
	其中:股票	2,303,559,914.22	99.73
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	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	5,714,717.94	0.25
6	其他各项资产	511,150.46	0.02
7	合计	2,309,785,782.62	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

5.2.2 指数投资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	8,250,262.66	0.36
B	采矿业	184,900,460.18	8.01
C	制造业	469,809,298.93	20.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	81,915,757.77	3.55
E	建筑业	88,306,858.11	3.83
F	批发和零售业	43,762,281.07	1.90
G	交通运输、仓储和邮政业	60,059,913.31	2.60
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	56,804,201.07	2.46
J	金融业	1,187,274,784.58	51.44
K	房地产业	86,602,562.44	3.75
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	-	-
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	9,406,162.42	0.41
S	综合	26,467,371.68	1.15
	合计	2,303,559,914.22	99.81

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小的股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资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	600016	民生银行	20,082,400	191,987,744.00	8.32
2	600036	招商银行	14,677,755	160,281,084.60	6.94
3	601166	兴业银行	10,162,388	113,513,873.96	4.92
4	601318	中国平安	2,982,318	106,468,752.60	4.61
5	600000	浦发银行	9,952,602	100,421,754.18	4.35
6	600837	海通证券	7,197,825	90,044,790.75	3.90
7	600030	中信证券	6,126,074	75,289,449.46	3.26
8	601398	工商银行	13,834,281	53,400,324.66	2.31
9	601601	中国太保	2,794,171	49,093,584.47	2.13
10	601088	中国神华	2,934,783	48,922,832.61	2.12

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

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	38,895.66
2	应收证券清算款	1,778.00
3	应收股利	468,950.25
4	应收利息	1,526.55
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	511,150.46

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末投资的股票存在流通受限情况的说明

5.10.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.10.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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	4,917,524,362
本报告期基金总申购份额	192,000,000
减:本报告期基金总赎回份额	1,560,000,000
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,549,524,362

§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、红利再投资;本基金管理人本报告期末持有本基金份额0.00份,占本基金期末总份额的0.00%。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会核准上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金募集的文件;

2、《上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金基金合同》;

3、《上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》;

4、《上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金托管协议》;

5、关于申请募集上证180公司治理交易型开放式指数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、报告期内上证180公司治理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。

8.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

8.3 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。

交银施罗德货币市场证券投资基金

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:中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业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	交银货币	
基金主代码	519588	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2006年1月20日	
报告期末基金份额总额	3,430,432,376.25份	
投资目标	本基金属于货币市场基金,投资目标是在力求本金稳妥和资产充分流动性的前提下,追求超过业绩比较基准的投资收益。	
投资策略	本基金在保持组合高度流动性的前提下,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	六个月银行定期存款利率(税后)	
风险收益特征	本基金是具有较低风险、中低收益、流动性强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	中国农业银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	交银货币A	交银货币B
下属两级基金的交易代码	519588	519589
报告期末下属两级基金的份额总额	317,979,791.07份	3,112,452,585.18份

§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)	
	交银货币A	交银货币B
1. 本期已实现收益	2,266,972.91	27,105,029.80
2. 本期利润	2,266,972.91	27,105,029.80
3. 期末基金资产净值	317,979,791.07	3,112,452,585.18

注:1、自2007年6月22日起,本基金实行销售服务费分级收费方式,分设两级基金份额:A级基金份额和B级基金份额。A级基金份额与B级基金份额的管理费、托管费相同,A级基金份额按0.25%的年费率计提销售服务费,B级基金份额按0.01%的年费率计提销售服务费。在计算主要财务指标时,A级基金份额与分级前基金连续计算,B级基金份额按新设基金计算;

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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

1. 交银货币A:

阶段	净值收益率①	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
过去三个月	0.7145%	0.0041%	0.7058%	0.0000%	0.0087%	0.0041%

注:本基金收益分配按月结转份额。

2. 交银货币B:

阶段	净值收益率①	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
过去三个月	0.7754%	0.0041%	0.7058%	0.0000%	0.0696%	0.0041%

注:本基金收益分配按月结转份额。

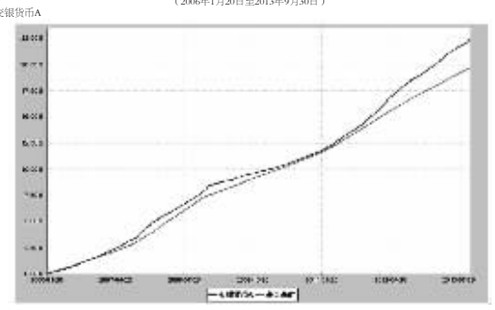
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

交银施罗德货币市场证券投资基金

份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

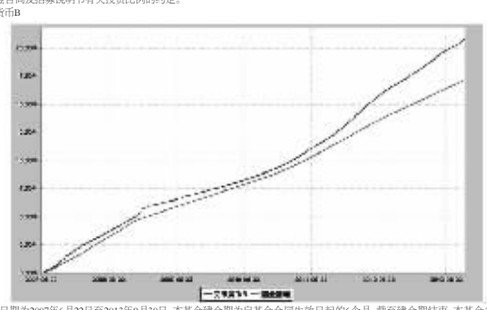
(2006年1月20日至2013年9月30日)

1、 交银货币A



注:图示日期为2006年1月20日至2013年9月30日。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。

2、交银货币B



注:图示日期为2007年6月22日至2013年9月30日。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 |