

交银施罗德主题优选灵活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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年九月二十四日

5.1 重要提示

基金管理人及基金托管人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。

基金管理人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定,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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,投资者参与基金投资可能承担投资风险。

基金的投资业绩并不预示其未来业绩表现,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。

5.2 基金基本情况

| | |
|------------|--|
| 基金名称 | 交银施罗德主题优选混合 |
| 基金代码 | 519060 |
| 交易代码 | 519060(前端) 519060(后端) |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2009年6月29日 |
| 报告期末基金份额总额 | 810,517,176.00份 |
| 投资目标 | 本基金力图通过前瞻性的主题优选,和积极践行行业个股投资机会,在控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金充分发掘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研风格相结合,在分析和判断宏观经济趋势、行业周期和个股基本面变化的基础上,通过前瞻性的主题优选,自上而下优选配置个股,通过自上而下主题和个股相结合具有良好长期成长性的优势行业相配合的方式,精选个股,以谋求长期增值。 |
| 业绩比较基准 | 60%×沪深300指数收益率+40%×中证主题优选指数收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金是一只灵活配置型混合基金,属于基金中的中高风险品种,本基金的风险与预期收益高于股票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 | 中国银行股份有限公司 |

5.3 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日至2013年9月30日) | | |
| 1.本期已实现收益 | -70,093,113.63 | | |
| 2.本期利润 | 28,021,845.37 | | |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0335 | | |
| 4.期末基金份额净值 | 636,779,387.17 | | |
| 5.期末基金份额净值 | 0.786 | | |

注:1.上述基金净值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低于所列数字;

2.本期利润=本期收益-基金管理人收取的基金管理费、托管费、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。

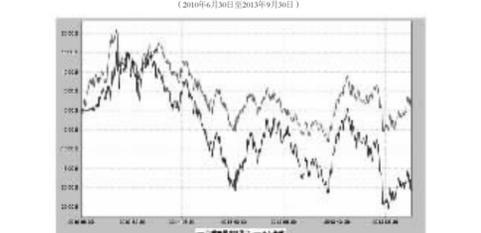
3.2 基金净值表现

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 | 净值增长率比较基准② | 业绩比较基准收益差③ | ①-③ | ②-③ | |
|-------|--------|------------|------------|-------|--------|-------|
| 过去三个月 | 4.38% | 1.27% | 3.06% | 0.87% | -1.82% | 0.46% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩比较基准收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

交银施罗德主题优选灵活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
(2009年6月30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规定。

5.4 管理人报告

4.1 基金运作(或基金治理小组)简介

| 姓名 | 职务 | 在本基金的基金经理任期 | 证券从业资格 | 说明 |
|-----|----------|-------------|--------|---|
| 李永兴 | 本基金的基金经理 | 2011-3-20 | 7年 | 李永兴先生,经济学博士,2006年加入交银施罗德基金管理有限公司,历任研究员、基金经理助理、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
报告期内,本基金管理人严格遵守了《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,并未有损害投资人、基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明
本基金建立了严格的投资控制制度和公平交易控制制度来保证基金运作的公平,旗下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同一投资流程。

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4.7%,本基金净值上涨3.98%,跟踪偏离度下降300个基点,跑赢业绩比较基准。

4.5 报告期内基金的业绩表现
本基金本报告期期末基金份额净值为0.786元,本报告期基金份额净值为0.786元,本报告期基金份额净值为0.786元。

5.5 投资组合报告

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|----|------------------|----------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 478,475,167.91 | 74.77 |
| | 其中:股票 | 478,475,167.91 | 74.77 |
| 2 | 固定收益投资 | 84,524,853.70 | 13.21 |
| | 其中:债券 | 84,524,853.70 | 13.21 |
| 3 | 资产支持证券投资 | - | - |
| 4 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中:买入返售的买入返售金融资产 | - | - |
| 5 | 银行存款和结算备付金合计 | 76,393,759.91 | 11.94 |
| 6 | 其他各项资产 | 56,114.06 | 0.09 |
| 7 | 合计 | 639,954,896.44 | 100.00 |

5.6 报告期末基金资产组合情况
截至2013年9月30日,本基金资产组合为796元,本报告期申购净申购率为54.38%,赎回基金份额净增长率为5.96%。

5.7 报告期末基金资产组合情况
截至2013年9月30日,本基金资产组合为796元,本报告期申购净申购率为54.38%,赎回基金份额净增长率为5.96%。

5.8 报告期末基金资产组合情况
截至2013年9月30日,本基金资产组合为796元,本报告期申购净申购率为54.38%,赎回基金份额净增长率为5.96%。

5.9 报告期末基金资产组合情况
截至2013年9月30日,本基金资产组合为796元,本报告期申购净申购率为54.38%,赎回基金份额净增长率为5.96%。

5.10 报告期末基金资产组合情况
截至2013年9月30日,本基金资产组合为796元,本报告期申购净申购率为54.38%,赎回基金份额净增长率为5.96%。

5.11 报告期末基金资产组合情况
截至2013年9月30日,本基金资产组合为796元,本报告期申购净申购率为54.38%,赎回基金份额净增长率为5.96%。

5.12 报告期末基金资产组合情况
截至2013年9月30日,本基金资产组合为796元,本报告期申购净申购率为54.38%,赎回基金份额净增长率为5.96%。

5.13 报告期末基金资产组合情况
截至2013年9月30日,本基金资产组合为796元,本报告期申购净申购率为54.38%,赎回基金份额净增长率为5.96%。

5.14 报告期末基金资产组合情况
截至2013年9月30日,本基金资产组合为796元,本报告期申购净申购率为54.38%,赎回基金份额净增长率为5.96%。

5.15 报告期末基金资产组合情况
截至2013年9月30日,本基金资产组合为796元,本报告期申购净申购率为54.38%,赎回基金份额净增长率为5.96%。

5.16 报告期末基金资产组合情况
截至2013年9月30日,本基金资产组合为796元,本报告期申购净申购率为54.38%,赎回基金份额净增长率为5.96%。

5.17 报告期末基金资产组合情况
截至2013年9月30日,本基金资产组合为796元,本报告期申购净申购率为54.38%,赎回基金份额净增长率为5.96%。

5.18 报告期末基金资产组合情况
截至2013年9月30日,本基金资产组合为796元,本报告期申购净申购率为54.38%,赎回基金份额净增长率为5.96%。

5.19 报告期末基金资产组合情况
截至2013年9月30日,本基金资产组合为796元,本报告期申购净申购率为54.38%,赎回基金份额净增长率为5.96%。

5.20 报告期末基金资产组合情况
截至2013年9月30日,本基金资产组合为796元,本报告期申购净申购率为54.38%,赎回基金份额净增长率为5.96%。

5.21 报告期末基金资产组合情况
截至2013年9月30日,本基金资产组合为796元,本报告期申购净申购率为54.38%,赎回基金份额净增长率为5.96%。

5.22 报告期末基金资产组合情况
截至2013年9月30日,本基金资产组合为796元,本报告期申购净申购率为54.38%,赎回基金份额净增长率为5.96%。

5.23 报告期末基金资产组合情况
截至2013年9月30日,本基金资产组合为796元,本报告期申购净申购率为54.38%,赎回基金份额净增长率为5.96%。

5.24 报告期末基金资产组合情况
截至2013年9月30日,本基金资产组合为796元,本报告期申购净申购率为54.38%,赎回基金份额净增长率为5.96%。

5.25 报告期末基金资产组合情况
截至2013年9月30日,本基金资产组合为796元,本报告期申购净申购率为54.38%,赎回基金份额净增长率为5.96%。

5.26 报告期末基金资产组合情况
截至2013年9月30日,本基金资产组合为796元,本报告期申购净申购率为54.38%,赎回基金份额净增长率为5.96%。

5.27 报告期末基金资产组合情况
截至2013年9月30日,本基金资产组合为796元,本报告期申购净申购率为54.38%,赎回基金份额净增长率为5.96%。

5.28 报告期末基金资产组合情况
截至2013年9月30日,本基金资产组合为796元,本报告期申购净申购率为54.38%,赎回基金份额净增长率为5.96%。

5.29 报告期末基金资产组合情况
截至2013年9月30日,本基金资产组合为796元,本报告期申购净申购率为54.38%,赎回基金份额净增长率为5.96%。

5.30 报告期末基金资产组合情况
截至2013年9月30日,本基金资产组合为796元,本报告期申购净申购率为54.38%,赎回基金份额净增长率为5.96%。

5.31 报告期末基金资产组合情况
截至2013年9月30日,本基金资产组合为796元,本报告期申购净申购率为54.38%,赎回基金份额净增长率为5.96%。

5.32 报告期末基金资产组合情况
截至2013年9月30日,本基金资产组合为796元,本报告期申购净申购率为54.38%,赎回基金份额净增长率为5.96%。

5.33 报告期末基金资产组合情况
截至2013年9月30日,本基金资产组合为796元,本报告期申购净申购率为54.38%,赎回基金份额净增长率为5.96%。

5.34 报告期末基金资产组合情况
截至2013年9月30日,本基金资产组合为796元,本报告期申购净申购率为54.38%,赎回基金份额净增长率为5.96%。

5.35 报告期末基金资产组合情况
截至2013年9月30日,本基金资产组合为796元,本报告期申购净申购率为54.38%,赎回基金份额净增长率为5.96%。

5.36 报告期末基金资产组合情况
截至2013年9月30日,本基金资产组合为796元,本报告期申购净申购率为54.38%,赎回基金份额净增长率为5.96%。

5.37 报告期末基金资产组合情况
截至2013年9月30日,本基金资产组合为796元,本报告期申购净申购率为54.38%,赎回基金份额净增长率为5.96%。

5.38 报告期末基金资产组合情况
截至2013年9月30日,本基金资产组合为796元,本报告期申购净申购率为54.38%,赎回基金份额净增长率为5.96%。

5.39 报告期末基金资产组合情况
截至2013年9月30日,本基金资产组合为796元,本报告期申购净申购率为54.38%,赎回基金份额净增长率为5.96%。

5.40 报告期末基金资产组合情况
截至2013年9月30日,本基金资产组合为796元,本报告期申购净申购率为54.38%,赎回基金份额净增长率为5.96%。

5.41 报告期末基金资产组合情况
截至2013年9月30日,本基金资产组合为796元,本报告期申购净申购率为54.38%,赎回基金份额净增长率为5.96%。

5.42 报告期末基金资产组合情况
截至2013年9月30日,本基金资产组合为796元,本报告期申购净申购率为54.38%,赎回基金份额净增长率为5.96%。

5.43 报告期末基金资产组合情况
截至2013年9月30日,本基金资产组合为796元,本报告期申购净申购率为54.38%,赎回基金份额净增长率为5.96%。

5.44 报告期末基金资产组合情况
截至2013年9月30日,本基金资产组合为796元,本报告期申购净申购率为54.38%,赎回基金份额净增长率为5.96%。

5.45 报告期末基金资产组合情况
截至2013年9月30日,本基金资产组合为796元,本报告期申购净申购率为54.38%,赎回基金份额净增长率为5.96%。

5.46 报告期末基金资产组合情况
截至2013年9月30日,本基金资产组合为796元,本报告期申购净申购率为54.38%,赎回基金份额净增长率为5.96%。

5.47 报告期末基金资产组合情况
截至2013年9月30日,本基金资产组合为796元,本报告期申购净申购率为54.38%,赎回基金份额净增长率为5.96%。

5.48 报告期末基金资产组合情况
截至2013年9月30日,本基金资产组合为796元,本报告期申购净申购率为54.38%,赎回基金份额净增长率为5.96%。

5.49 报告期末基金资产组合情况
截至2013年9月30日,本基金资产组合为796元,本报告期申购净申购率为54.38%,赎回基金份额净增长率为5.96%。

5.50 报告期末基金资产组合情况
截至2013年9月30日,本基金资产组合为796元,本报告期申购净申购率为54.38%,赎回基金份额净增长率为5.96%。

5.51 报告期末基金资产组合情况
截至2013年9月30日,本基金资产组合为796元,本报告期申购净申购率为54.38%,赎回基金份额净增长率为5.96%。

5.52 报告期末基金资产组合情况
截至2013年9月30日,本基金资产组合为796元,本报告期申购净申购率为54.38%,赎回基金份额净增长率为5.96%。

5.53 报告期末基金资产组合情况
截至2013年9月30日,本基金资产组合为796元,本报告期申购净申购率为54.38%,赎回基金份额净增长率为5.96%。

5.54 报告期末基金资产组合情况
截至2013年9月30日,本基金资产组合为796元,本报告期申购净申购率为54.38%,赎回基金份额净增长率为5.96%。

5.55 报告期末基金资产组合情况
截至2013年9月30日,本基金资产组合为796元,本报告期申购净申购率为54.38%,赎回基金份额净增长率为5.96%。

5.56 报告期末基金资产组合情况
截至2013年9月30日,本基金资产组合为796元,本报告期申购净申购率为54.38%,赎回基金份额净增长率为5.96%。

5.57 报告期末基金资产组合情况
截至2013年9月30日,本基金资产组合为796元,本报告期申购净申购率为54.38%,赎回基金份额净增长率为5.96%。

5.58 报告期末基金资产组合情况
截至2013年9月30日,本基金资产组合为796元,本报告期申购净申购率为54.38%,赎回基金份额净增长率为5.96%。

5.59 报告期末基金资产组合情况
截至2013年9月30日,本基金资产组合为796元,本报告期申购净申购率为54.38%,赎回基金份额净增长率为5.96%。

5.60 报告期末基金资产组合情况
截至2013年9月30日,本基金资产组合为796元,本报告期申购净申购率为54.38%,赎回基金份额净增长率为5.96%。

交银施罗德信用添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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年九月二十四日

5.1 重要提示

基金管理人及基金托管人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。

基金管理人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定,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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,投资者参与基金投资可能承担投资风险。

基金的投资业绩并不预示其未来业绩表现,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。

5.2 基金基本情况

| | |
|------------|--|
| 基金名称 | 交银施罗德信用添利 |
| 基金代码 | 164902 |
| 交易代码 | 164902 |
| 基金运作方式 | 契约型 |
| 基金合同生效日 | 2011年11月27日 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,895,085,749.23份 |
| 投资目标 | 本基金在严格控制信用风险和利率风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金充分发掘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研风格相结合,在分析和判断宏观经济趋势、行业周期和个股基本面变化的基础上,通过前瞻性的主题优选,自上而下优选配置个股,通过自上而下主题和个股相结合具有良好长期成长性的优势行业相配合的方式,精选个股,以谋求长期增值。 |
| 业绩比较基准 | 80%×中证全债指数收益率+20%×中证国债总回报指数收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金是一只债券型基金,属于证券投资基金中中等风险的品种,其长期平均的风险收益特征低于股票型基金和混合型基金。 |
| 基金管理人 | 交银施罗德基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国银行股份有限公司 |

注:本基金名称简称为“交银添利”。

3.1 主要财务指标

| 3.1 主要财务指标 | | 报告期(2013年7月1日至2013年9月30日) | |
|----------------|---------------------------|---------------------------|--|
| 主要财务指标 | 报告期(2013年7月1日至2013年9月30日) | | |
| 1.本期已实现收益 | 9,049,330.10 | | |
| 2.本期利润 | 23,522,483.22 | | |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0124 | | |
| 4.期末基金份额净值 | 2,048,509,964.44 | | |
| 5.期末基金份额净值 | 1.077 | | |

注:1.上述基金净值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低于所列数字;

2.本期利润=本期收益-基金管理人收取的基金管理费、托管费、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。

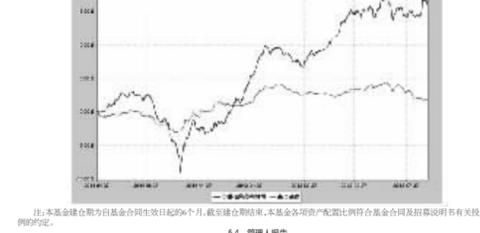
3.2 基金净值表现

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 | 净值增长率比较基准② | 业绩比较基准收益差③ | ①-③ | ②-③ | |
|-------|--------|------------|------------|-------|-------|-------|
| 过去三个月 | 1.22% | 0.26% | -1.79% | 0.08% | 3.01% | 0.21% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩比较基准收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

交银施罗德信用添利债券证券投资基金
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
(2011年11月27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规定。

5.10.2 基金合同生效以来基金业绩比较基准收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

交银施罗德信用添利债券证券投资基金
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
(2011年11月27日至2013年9月30日)

交银施罗德信用添利债券证券投资基金
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
(2011年11月27日至2013年9月30日)