交银施罗德双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	378,194,051.46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,自下而上地精选个券。同时,本基金深度关注股票、权证一级市场和二级市场的运行状况与相应风险收益特征,在严格控制基金资产运作风险的基础上,把握投资机会,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。
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%
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,其长期平均的预期收益和风险高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。
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
下属两级基金的基金简称	交银双利债券A/B / 交银双利债券C
下属两级基金的交易代码	519683(前端),519684(后端) / 519685
报告期末下属两级基金的份额总额	273,801,471.61份 / 104,392,579.85份

注:本基金A类基金份额采用前端收费模式,B类基金份额采用后端收费模式,前端交易代码即为A类基金份额交易代码,后端交易代码即为B类基金份额交易代码。

§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)	
	交银双利债券A/B	交银双利债券C
1.本期已实现收益	7,894,889.42	4,360,717.82
2.本期利润	8,553,301.18	5,749,318.74
3.加权平均基金份额本期利润	0.0359	0.0443
4.期末基金资产净值	298,464,123.84	112,931,423.01
5.期末基金份额净值	1.090	1.082

注:1.本基金A/B类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	3.42%	0.61%	-0.78%	0.16%	4.20%	0.45%

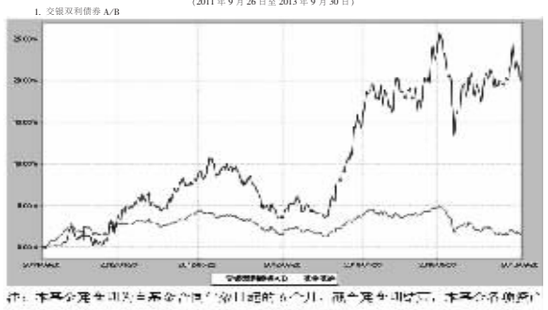
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

交银施罗德双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的历史走势对比图

(2011年9月26日至2013年9月30日)

1.交银双利债券A/B



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。

2.交银双利债券C

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		
李家春	本基金的基金经理、交银施罗德增利债券证券投资基金基金经理、交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金基金经理、公司固定收益部副总经理	2011-9-26	-	14年	李家春先生,香港大学MBA。历任长江证券有限责任公司投资经理,汉唐证券有限责任公司高级经理、投资主管,泰信基金管理有限公司高级研究员。2006年加入交银施罗德基金管理有限公司,2006年12月27日至2011年6月8日担任交银施罗德货币市场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,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,但环比仅有显著改善。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则在仍低区间出现反弹,8月PPI为-1.6%,货币政策在三季度保持稳定,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,但趋平偏紧。

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出三成,本基金由于权益降低了债券持仓,并维持了股票与可转债的持仓,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,转型之路预计仍将艰苦而持续,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,交银双利债券A/B份额净值为1.090元,本报告期份额净值增长率为3.42%,同期业绩比较基准增长率为-0.78%;交银双利债券C份额净值为1.082元,本报告期份额净值增长率为3.36%,同期业绩比较基准增长率为-0.78%。

§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	80,073,454.38	12.79
	其中:股票	80,073,454.38	12.79
2	固定收益投资	493,073,411.27	78.74
	其中:债券	493,073,411.27	78.74
	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	18,828,914.33	3.01
6	其他各项资产	34,209,260.52	5.46
7	合计	626,185,040.50	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	57,793,844.38	14.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	6,250,200.00	1.52
F	批发和零售业	-	-
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	867,000.00	0.21
J	金融业	10,429,000.00	2.54
K	房地产业	-	-
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	4,733,410.00	1.15
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	80,073,454.38	19.46

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	600703	三安光电	699,822	14,199,388.38	3.45
2	600085	同仁堂	399,000	8,821,890.00	2.14
3	600596	新安股份	500,000	6,675,000.00	1.62
4	600030	中信证券	500,000	6,145,000.00	1.49
5	000423	东阿阿胶	126,000	5,091,660.00	1.24
6	600389	江山股份	120,000	4,767,600.00	1.16
7	300070	碧水源	116,300	4,733,410.00	1.15
8	002079	苏州固锝	700,000	4,403,000.00	1.07
9	601318	中国平安	120,000	4,284,000.00	1.04
10	002310	东方园林	120,000	3,752,400.00	0.91

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	19,866,000.00	4.83
	其中:政策性金融债	19,866,000.00	4.83
4	企业债券	179,576,000.00	43.65
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	30,385,000.00	7.39
7	可转债	263,246,411.27	63.99
8	其他	-	-
9	合计	493,073,411.27	119.85

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	113003	重工转债	308,000	39,159,120.00	9.52
2	110015	石化转债	325,290	31,842,638.10	7.74
3	110023	民生转债	298,720	31,607,563.20	7.68
4	122266	13中信03	300,000	29,940,000.00	7.28
5	113002	工行转债	268,000	29,702,440.00	7.22

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	98,437.40
2	应收证券清算款	24,887,260.18
3	应收股利	-
4	应收利息	8,555,568.75
5	应收申购款	667,994.19
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	34,209,260.52

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	113003	重工转债	39,159,120.00	9.52
2	110015	石化转债	31,842,638.10	7.74
3	110023	民生转债	31,607,563.20	7.68
4	113002	工行转债	29,702,440.00	7.22
5	110018	国电转债	27,215,000.00	6.62
6	110020	南山转债	26,234,000.00	6.38
7	113001	中行转债	21,806,540.00	5.30
8	110016	川投转债	16,194,698.00	3.94
9	125089	深机转债	11,252,533.39	2.74
10	110012	海运转债	10,068,450.00	2.45
11	110017	中海转债	7,452,294.60	1.81
12	110011	歌华转债	5,035,500.00	1.22
13	127001	海直转债	3,530,580.00	0.86
14	110019	恒丰转债	1,061,043.20	0.26
15	125887	中鼎转债	832,987.40	0.20

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

项目	交银双利债券A/B	交银双利债券C
本报告期期初基金份额总额	179,959,712.30	132,271,487.31
本报告期基金总申购份额	117,895,964.93	81,961,000.08
减:本报告期基金总赎回份额	24,054,205.62	109,839,907.54
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	273,801,471.61	104,392,579.85

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

单位:份

序号	交易方式	交易日期	交易金额	适用费率
1	红利再投	2013-08-28	1,284,577.51	0.0000
合计			1,284,577.51	

注:本基金管理人本报告期末持有本基金份额21,571,883.27份,占本基金期末总份额的5.70%。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1.中国证监会批准交银施罗德双利债券证券投资基金募集的文件;

2.《交银施罗德双利债券证券投资基金基金合同》;

3.《交银施罗德双利债券证券投资基金招募说明书》;

4.《交银施罗德双利债券证券投资基金托管协议》;

5.关于申请募集交银施罗德双利债券证券投资基金基金之法律意见书;

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双利债券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。

交银施罗德深证300价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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

2.1 基金基本情况

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(前端)	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	61,307,263.58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,相当于股票基金中风险较高、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 目标基金产品说明

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(2013年7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	-221,873.49
2.本期利润	5,740,707.11
3.加权平均基金份额本期利润	0.0898
4.期末基金资产净值	57,250,625.59
5.期末基金份额净值	0.934

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

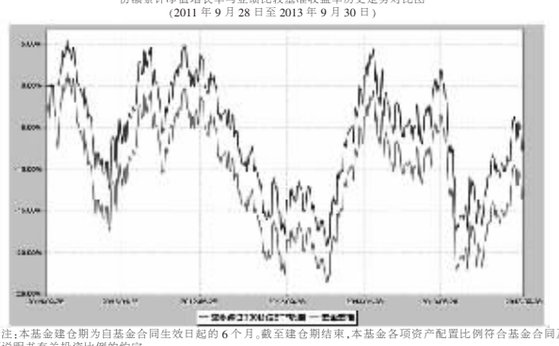
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	10.66%	1.41%	10.23%	1.41%	0.43%	0.00%

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

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。

4.1 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	本基金及深证300价值ETF、交银上证180公司治理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,经济有望维续保持稳健增长,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,且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,本基金份额净值为0.934元,本报告期份额净值增长率为10.66%,同期业绩比较基准增长率为10.23%,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	578,956.01	1.01
	其中:股票	578,956.01	1.01
2	基金投资	53,564,757.50	93.08
3	固定收益投资	1,955,800.00	3.40
	其中:债券	1,955,800.00	3.40
	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	1,396,865.78	2.43
7	其他各项资产	52,392.92	0.09
8	合计	57,548,772.21	100.00

5.2 期末投资目标基金明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	深证300价值交易型开放式指数证券投资基金	股票型	交易型开放式	交银施罗德基金管理有限公司	53,564,757.50	93.56

5.3 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	18,325.39	0.03
C	制造业	327,208.88	0.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	19,274.61	0.03
E	建筑业	1,757.80	0.00
F	批发和零售业	44,999.96	0.08
G	交通运输、仓储和邮政业	9,430.29	0.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,354.00	0.01
J	金融业	37,861.02	0.07
K	房地产业	102,790.26	0.18
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	11,953.80	0.02
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	578,956.01	1.01

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	5,356	48,900.28	0.09
2	000651	格力电器	1,399	37,157.44	0.06
3	002024	苏宁云商	2,595	33,345.75	0.06
4	000001	平安银行	2,603	30,923.64	0.05
5	000858	五粮液	1,111	19,998.00	0.03
6	000333	美的集团	445	19,241.80	0.03
7	000157	中联重科	2,623	14,793.72	0.03
8	000581	威孚高科	533	12,573.47	0.02
9	000069	华侨城A	2,061	11,953.80	0.02
10	000338	潍柴动力	591	11,441.76	0.02

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	1,955,800.00	3.42
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
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	1,955,800.00	3.42

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	139901	13陆现国债01	20,000	1,955,800.00	3.42

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 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。

5.10 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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除五粮液(证券代码:000858)外,未受到公开谴责和处罚。

报告期内本基金投资的前十名证券之一五粮液(证券代码:000858)于2013年2月23日公告,公司于2013年2月22日收到四川省发展和改革委员会《行政处罚决定书》,据此,四川省发展和改革委员会决定对五粮液处以2012年度销售额百分之一的罚款二亿零二百万元。公司已于2013年2月23日披露处罚公告,并于规定时间内按照处罚决定上交罚款。

本基金遵循指数化投资理念,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。本基金对该证券的投资遵守本基金管理人基金投资管理相关制度及被动式指数化投资策略。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	10,723.69
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	24,871.84
5	应收申购款	16,797.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	52,392.92

5.11.4 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。

5.11.5 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。

5.11.6 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	64,328,082.87
本报告期基金总申购份额	4,575,958.10
减:本报告期基金总赎回份额	7,596,777.39
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	61,307,263.58

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联接基金招募说明书》;

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