交银施罗德理财21天债券型证券投资基金

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	交银理财21天债券	
基金主代码	519716	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年11月5日	
报告期末基金份额总额	377,977,610.88份	
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	七天通知存款税后利率	
风险收益特征	本基金属于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,高于货币市场型证券投资基金。	
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	交银理财21天债券A	交银理财21天债券B
下属两级基金的交易代码	519716	519717
报告期末下属两级基金的份额总额	133,444,111.16份	244,533,499.72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)	
	交银理财21天债券A	交银理财21天债券B
1.本期已实现收益	1,890,092.78	4,833,108.43
2.本期利润	1,890,092.78	4,833,108.43
3.期末基金资产净值	133,444,111.16	244,533,499.72

注:1、自2013年1月9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级基金份额按照0.30%的年费率计提销售服务费,B级基金份额按照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)减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,由于本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.交银理财21天债券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	1.1359%	0.0025%	0.3403%	0.0000%	0.7956%	0.0025%

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。

2.交银理财21天债券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	1.2100%	0.0025%	0.3403%	0.0000%	0.8697%	0.0025%

注:1、本表净值收益率数据所取的基金运作周期为基金分级日为起始日的运作周期。

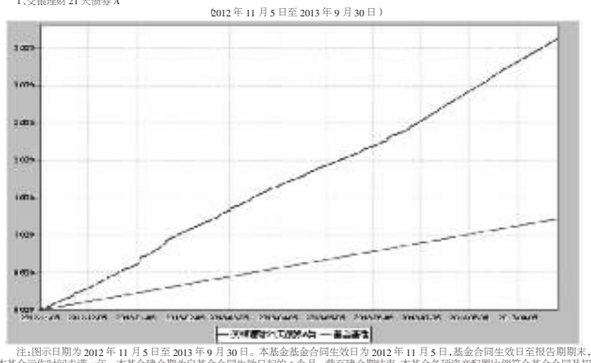
2、本基金每日计算当日收益并分配,并在运作期期末集中支付。

3.2.2 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21天债券型证券投资基金

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

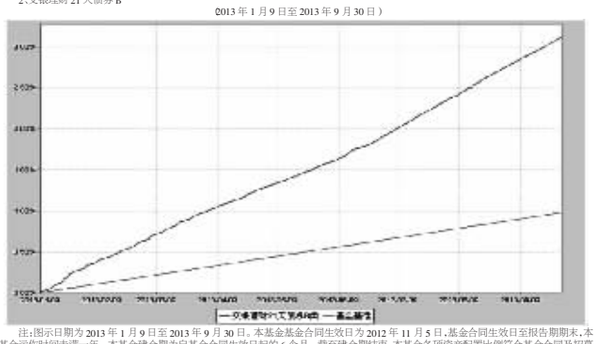
(2012年11月5日至2013年9月30日)



注:图示日期为2012年11月5日至2013年9月30日。本基金基金合同生效日为2012年11月5日,基金合同生效日至报告期期末,本基金运作时间未满一年。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.交银理财21天债券B

(2013年1月9日至2013年9月30日)



注:图示日期为2013年1月9日至2013年9月30日。本基金基金合同生效日为2012年11月5日,基金合同生效日至报告期期末,本基金运作时间未满一年。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		
林洪钧	本基金、交银货币、交银信用添利债券的基金经理,交银荣安保本混合、交银荣祥保本混合的基金经理助理,公司固定收益部助理总经理	2012-11-5	-	9年	林洪钧先生,复旦大学学士。历任国泰君安证券股份有限公司上海分公司机构客户部客户经理,华安基金管理有限公司债券交易员,加拿大Financial Engineering Source Inc.金融研究员。2009年加入交银施罗德基金管理有限公司,历任专户投资部投资经理助理,专户投资经理。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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

自今年6月钱荒之后,2013年三季度的债券市场经历了一波较大的跌幅。以10年期国债为代表的长期利率产品收益率从3.50%一路上行至4.15%,这期间伴随的是利率产品的一级招标结果不断推动二级市场的成交收益上行。同样,信用产品受利率产品影响收益曲线平坦上移,而信用利差相对保持稳定,依然处于近5年较低水平。

三季度的经济数据相对较好,7、8月份的PMI数据逐渐好转,生产和需求都在复苏;而8月工业10.4%也超乎此前市场预期的9.7%;8月通胀2.6%弱于市场此前预期。在经济整体温和复苏背景下,债券市场曲线结构的大幅上行从基本面角度不能完全解释。而考虑到本轮债券的下跌主要是由于利率产品为主导的利率中枢的上移,三季度货币政策偏谨慎,市场资金仍处较紧张状态,市场流动性的变化及机构对央行政策的预期导致了债券需求的疲弱。在经历了6月钱荒事件之后,银行、保险、券商、基金等机构对央行未来货币政策放松的预期不断减弱,对流动性的问题更加谨慎,而以7天回购利率为代表的银行间货币市场利率也长期保持在4%左右高位。因此三季度债券市场收益的大幅上行可能主要因素仍来自于对流动性极弱的预期。

本基金在三季度保持较大比例的银行协议存款以增加组合收益的平稳性。展望四季度,流动性可能逐渐修复,组合将考虑适当增加债券配置,适当增加组合久期,争取为基金持有人带来稳健的收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,交银理财21天债券A净值收益率为1.1359%,同期业绩比较基准增长率为0.3403%;交银理财21天债券B净值收益率1.2100%,同期业绩比较基准增长率为0.3403%。

§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	固定收益投资	99,839,803.03	26.33
	其中:债券	99,839,803.03	26.33
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	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	277,192,803.31	73.10
4	其他各项资产	2,151,224.35	0.57
5	合计	379,183,830.69	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	3.71
	其中:买断式回购融资	-

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个银行间市场交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购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间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,本基金未发生超标情况。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	86
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	125
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	51

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本基金合同约定:“本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过141天”。本报告期内,本基金未发生超标情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	28.36	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	44.98	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	21.11	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	5.30	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	99.75	-

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	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	19,802,195.22	5.24
2	央行票据	-	-
3	金融债券	9,966,835.20	2.64
	其中:政策性金融债	9,966,835.20	2.64
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	70,070,772.61	18.54
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	99,839,803.03	26.41
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	041351007	13八钢CP001	300,000	30,012,789.98	7.94
2	041353049	13福耀CP002	200,000	20,038,767.67	5.30
3	041354009	13国建工CP001	200,000	20,019,214.96	5.30
4	139901	13姑苏国债01	200,000	19,802,195.22	5.24
5	130201	13国开01	100,000	9,966,835.20	2.64

5.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0次
报告期内偏离度的最高值	0.3710%
报告期内偏离度的最低值	-0.1629%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0469%

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 投资组合报告附注

5.8.1 基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内按照实际利率和摊余成本逐日摊销计算损益。

5.8.2 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金资产净值的20%。

5.8.3 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。

5.8.4 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	1,890,224.35
4	应收申购款	261,000.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	2,151,224.35

5.8.5 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	交银理财21天债券A	交银理财21天债券B
本报告期期初基金份额总额	210,935,380.56	662,413,576.02
本报告期基金总申购份额	103,193,641.05	316,544,235.93
减:本报告期基金总赎回份额	180,684,910.45	734,424,312.23
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	133,444,111.16	244,533,499.72

注:1、如果本报告期间发生转换入、份额级别调整、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、份额级别调整业务,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、中国证监会批准交银施罗德理财21天债券型证券投资基金募集的文件;

2、《交银施罗德理财21天债券型证券投资基金基金合同》;

3、《交银施罗德理财21天债券型证券投资基金招募说明书》;

4、《交银施罗德理财21天债券型证券投资基金托管协议》;

5、关于募集交银施罗德理财21天债券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理财21天债券型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。

交银施罗德理财60天债券型证券投资基金

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	交银理财60天债券	
基金主代码	519721	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年3月13日	
报告期末基金份额总额	84,076,308.35份	
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。	
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	交银理财60天债券A	交银理财60天债券B
下属两级基金的交易代码	519721	519722
报告期末下属两级基金的份额总额	53,850,961.72份	30,225,346.63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)	
	交银理财60天债券A	交银理财60天债券B
1.本期已实现收益	907,016.86	583,838.70
2.本期利润	907,016.86	583,838.70
3.期末基金资产净值	53,850,961.72	30,225,346.63

注:1、自合同生效日起,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级基金份额按照0.30%的年费率计提销售服务费,B级基金份额按照0.01%的年费率计提销售服务费。

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)减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,由于本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.交银理财60天债券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	0.8834%	0.0048%	0.3403%	0.0000%	0.5431%	0.0048%

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。

2.交银理财60天债券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	0.9593%	0.0048%	0.3403%	0.0000%	0.6190%	0.0048%

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。

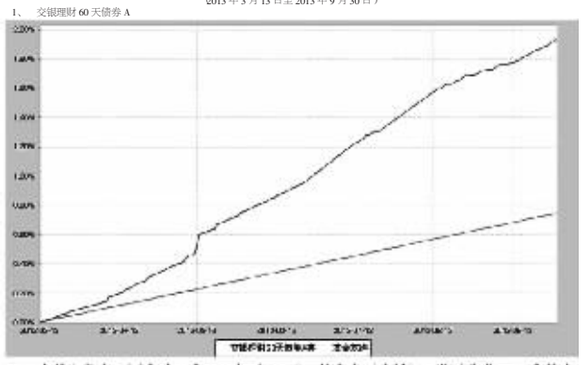
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

交银施罗德理财60天债券型证券投资基金

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

(2013年3月13日至2013年9月30日)

1、 交银理财60天债券A



注:本基金基金合同生效日为2013年3月13日,基金合同生效日至报告期期末,本基金运作时间未满一年。本基金建仓期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		
胡军华	本基金的基金经理、交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金基金经理、交银施罗德双粘动债券型证券投资基金基金经理、公司固定收益部总经理	2013-3-13	-	21年	胡军华女士,中国人民大学经济学硕士。历任中国经济开发信托投资公司证券业务总部研究部副总经理,华鑫证券有限公司深圳营业部副总经理,原南方证券有限公司债券业务总部投资经理,招商基金管理有限公司固定收益部总监,基金经理,福银证券资产管理部/财富管理部董事,高级投资组合经理。其中2005年5月至2006年5月担任招商现金增值开放式证券投资基金基金经理,2005年8月至2008年12月担任招商安泰系列证券投资基金基金经理,2006年7月至2008年12月担任招商安本增利债券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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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,本基金份额净值为1.122元,本报告期份额净值增长率为12.65%,同期业绩比较基准增长率为12.67%。本报告期内本基金的日均跟踪偏离度为0.04%,跟踪误差为0.05%。

§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	26,594,611.22	93.40
	其中:股票	26,594,611.22	93.40
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	1,863,350.67	6.54
6	其他各项资产	14,715.62	0.05
7	合计	28,472,677.51	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	597,313.42	2.13
B	采矿业	2,944,284.06	10.48
C	制造业	12,459,440.65	44.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,707,132.50	9.63
E	建筑业	727,561.31	2.59
F	批发和零售业	1,369,453.34	4.87
G	交通运输、仓储和邮政业	516,159.72	1.84
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,324,301.00	4.71
J	金融业	1,958,549.81	6.97
K	房地产业	730,381.27	2.60
L	租赁和商务服务业	416,273.00	1.48
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	216,812.52	0.77
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	373,740.56	1.33
S	综合	253,208.06	0.90
	合计	26,594,611.22	94.64

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	600804	鹏博士	16,577	307,337.58	1.09
2	600718	东软集团	22,219	286,180.72	1.02
3	002415	海康威视	10,115	267,036.00	0.95
4	600588	用友软件	19,277	265,251.52	0.94
5	600271	航天信息	13,702	251,020.64	0.89
6	000063	中兴通讯	14,954	248,236.40	0.88
7	600886	国投电力	64,145	236,695.05	0.84
8	002236	大华股份	4,909	223,752.22	0.80
9	002241	歌尔声学	5,259	222,350.52	0.79
10	600674	川投能源	19,392	218,353.92	0.78

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	9,811.20
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	2,058.37
4	应收利息	470.04
5	应收申购款	2,376.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,715.62

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

项目	交银理财60天债券A	交银理财60天债券B
本报告期期初基金份额总额	201,078,904.18	30,000,000.00
本报告期基金总申购份额	1,812,948.67	50,226,346.63
减:本报告期基金总赎回份额	149,040,891.13	50,001,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	53,850,961.72	30,225,346.63

注:1、如果本报告期间发生转换入、份额级别调整、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、中国证监会批准交银施罗德理财60天债券型证券投资基金募集的文件;

2、《交银施罗德理财60天债券型证券投资基金基金合同》;

3、《交银施罗德理财60天债券型证券投资基金招募说明书》;

4、《交银施罗德理财60天债券型证券投资基金托管协议》;

5、关于募集交银施罗德理财60天债券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理财60天债券型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。

交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金

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	交银沪深300分层等权指数	
基金主代码	519714	
交易代码	519714(前端)	519715(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年11月7日	
报告期末基金份额总额	25,050,028.84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	本基金为指数型基金,绝大部分资产采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数,即按照成份股在沪深300行业分层等权重指数中的成份股组成及其权重构建股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。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,或因某些持