交银施罗德优势行业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:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商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	交银优势行业混合
基金主代码	519697
交易代码	519697
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年1月21日
报告期末基金份额总额	230,936,645.01份
投资目标	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,积极把握行业发展趋势和行业景气轮换中蕴含的投资机会,在控制风险并保持基金资产良好的流动性的前提下,力求实现基金资产的长期稳定增值。
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,在分析和判断宏观经济周期和市场环境变化趋势的基础上,动态调整投资组合比例,自上而下灵活配置资产;通过把握和判断行业发展趋势及行业景气程度变化,挖掘预期具有良好增长前景的优势行业,精选个股,以谋求超额收益。
业绩比较基准	60%×沪深300指数收益率+40%×中信标普全债指数收益率
风险收益特征	本基金是一只灵活配置的混合型基金,属于基金中的较高风险品种,风险与预期收益介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	中国工商银行股份有限公司

§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	7,397,600.73
2.本期利润	20,788,772.16
3.加权平均基金份额本期利润	0.0839
4.期末基金资产净值	258,434,393.78
5.期末基金份额净值	1.119

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。

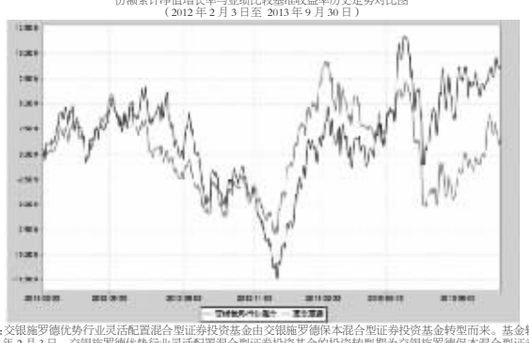
3.2 基金净值表现

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	7.61%	0.99%	5.90%	0.87%	1.71%	0.12%

3.2.2 自基金转型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

交银施罗德优势行业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
(2012年2月3日至2013年9月30日)



注:交银施罗德优势行业灵活配置混合型证券投资基金由交银施罗德保本混合型证券投资基金转型而来。基金转型日为2012年2月3日。交银施罗德优势行业灵活配置混合型证券投资基金的投资转型期为交银施罗德保本混合型证券投资基金保本周期到期选择期截止日次日(即2012年2月3日)起的3个月。截至投资转型期结束,交银施罗德优势行业灵活配置混合型证券投资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		
张迎军	本基金的基金经理、交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金基金经理,公司权益部副总经理	2009-1-21	-	13年	张迎军先生,经济学硕士。历任申银万国证券研究所市场研究部、策略研究部研究员,中国太平洋保险(集团)股份有限公司资金运用管理中心投资经理,太平洋资产管理有限公司组合管理部组合经理。2008年加入交银施罗德基金管理有限公司,历任固定收益部副总经理。2009年1月21日至2012年2月2日担任本基金转型前的交银施罗德保本混合型证券投资基金基金经理,2011年5月3日至2013年9月2日担任交银施罗德趋势优先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"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。

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年三季度沪深股市总体上走出探底回升走势,沪深300上涨9.47%,中小板指数上涨17.46%,创业板大涨35.21%。市场呈现出明显的结构性行情特征,信息技术、文化传媒等新兴产业相关股票股价屡创新高。三季度本基金主要操作是随着市场反弹逐步降低股票仓位,并对持仓进行结构调整。主要减持了涨幅较大的信息技术、通信传媒等行业相关股票,同时降低了地产、金融、建筑建材等行业配置比例,增持了医药、零售等行业配置比例。总体而言,三季度本基金净值表现好于业绩比较基准。

展望2013年四季度沪深股市,李总理关于经济运行"上限与下限"说以及"稳中有为"的政策基调为股票市场短期企稳提供了政策依据,8月份PMI等宏观经济数据继续回暖也为市场短期做多提供了条件。8月下旬以来自贸区主题概念股的强势表现延续并强化了2013年以来结构性牛市的市场特征。从公布的中报看,多数高估值的创业板及成长股并没有拿出与高估值相匹配的业绩表现。当流动性冲击再次出现时,创业板与成长股的股价表现分化或将难以避免。本基金将高度关注市场可能出现的投资机会与风险,及时调整基金组合,努力为基金投资人创造较好的业绩回报。

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1.119元,本报告期份额净值增长率为7.61%,同期业绩比较基准增长率为5.90%。

§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	130,854,928.09	47.19
	其中:股票	130,854,928.09	47.19
2	固定收益投资	110,597,687.56	39.88
	其中:债券	110,597,687.56	39.88
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	12,500,000.00	4.51
	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	3,158,404.56	1.14
6	其他各项资产	20,191,216.29	7.28
7	合计	277,302,236.50	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	91,918,647.74	35.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	11,219,421.30	4.34
F	批发和零售业	8,932,300.00	3.46
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	6,458,239.65	2.50
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	6,885,959.40	2.66
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,849,000.00	1.10
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	2,591,360.00	1.00
S	综合	-	-
	合计	130,854,928.09	50.63

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	000423	东阿阿胶	313,587	12,672,050.67	4.90
2	002415	海康威视	360,000	9,504,000.00	3.68
3	600422	昆明制药	352,029	9,497,742.42	3.68
4	002081	金螳螂	363,796	7,974,408.32	3.09
5	300024	机器人	150,000	6,591,000.00	2.55
6	600406	国电南瑞	446,937	6,458,239.65	2.50
7	600519	贵州茅台	45,902	6,239,917.88	2.41
8	600276	恒瑞医药	160,500	5,837,385.00	2.26
9	600741	华域汽车	600,000	5,580,000.00	2.16
10	002353	杰瑞股份	77,000	5,396,160.00	2.09

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	29,878,000.00	11.56
	其中:政策性金融债	29,878,000.00	11.56
4	企业债券	65,359,920.90	25.29
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	15,359,766.66	5.94
8	其他	-	-
9	合计	110,597,687.56	42.80

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	098016	09南钢联债	300,000	30,171,000.00	11.67
2	122033	09富力债	263,440	26,844,536.00	10.39
3	110015	石化转债	140,000	13,704,600.00	5.30
4	130236	13国开36	100,000	9,987,000.00	3.86
5	130227	13国开27	100,000	9,955,000.00	3.85

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	149,935.60
2	应收证券清算款	17,030,873.89
3	应收股利	-
4	应收利息	2,989,928.54
5	应收申购款	20,478.26
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,191,216.29

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	110015	石化转债	13,704,600.00	5.30
2	110020	南山转债	1,513,500.00	0.59

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

本报告期期初基金份额总额	264,468,625.05
本报告期基金总申购份额	1,662,583.55
减:本报告期基金总赎回份额	35,194,563.59
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	230,936,645.01

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 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策影视(证券代码:300133)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31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保本混合型证券投资基金募集的文件;
2、《交银施罗德优势行业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;
3、《交银施罗德优势行业灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》;
4、《交银施罗德优势行业灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;
5、《交银施罗德保本混合型证券投资基金基金合同》;
6、《交银施罗德保本混合型证券投资基金招募说明书》;
7、《交银施罗德保本混合型证券投资基金托管协议》;
8、《交银施罗德保本混合型证券投资基金保函》;
9、上海源泰律师事务所出具的《关于申请募集交银施罗德保本混合型证券投资基金之法律意见书》;
10、上海市通力律师事务所出具的《关于交银施罗德保本混合型证券投资基金保本周期到期转型方案及基金合同修改的法律意见》;
11、基金管理人业务资格批件、营业执照;
12、基金托管人业务资格批件、营业执照;
13、报告期内交银施罗德优势行业灵活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@jyshd.com。

交银施罗德精选股票证券投资基金

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	交银精选股票	
基金主代码	519688	
交易代码	519688(前端)	519689(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2005年9月29日	
报告期末基金份额总额	6,799,109,800.98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,自上而下配置资产,自下而上精选证券,有效控制风险,分享中国经济与资本市场高速成长的成果,谋求实现基金财产的长期稳定增长。	
投资策略	自上而下配置资产,自下而上精选证券,有效控制下行风险。	
业绩比较基准	75%×沪深300指数+25%×中信标普全债指数	
风险收益特征	本基金是一只稳健型的股票基金,属于股票型基金中的中等风险品种,本基金的预期收益和风险都要高于混合型基金。本基金力争在严格控制风险的前提下谋求实现基金资产长期稳定增长。	
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	36,769,492.11
2.本期利润	602,832,179.30
3.加权平均基金份额本期利润	0.0867
4.期末基金资产净值	5,762,198,586.79
5.期末基金份额净值	0.8475

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。

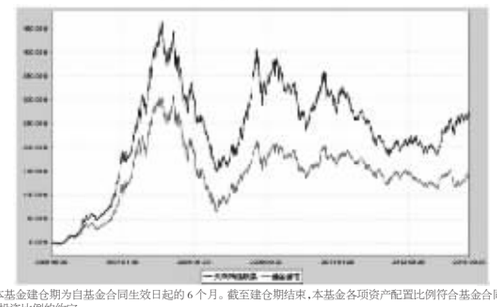
3.2 基金净值表现

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	11.38%	1.26%	7.25%	1.08%	4.13%	0.18%

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

交银施罗德精选股票证券投资基金
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
(2005年9月29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		
张鸿羽	本基金的基金经理	2012-4-20	-	13年	张鸿羽女士,上海财经大学硕士。历任广发证券股份有限公司高级研究员,上投摩根基金管理有限公司高级研究员。2007年加入交银施罗德基金管理有限公司,历任高级研究员、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

三季度A股市场在经济企稳,货币相对宽松的大背景下,走出了结构性牛市行情,特别是创业板涨幅居前。三季度经济基本面在补库存的驱动下,工业增加值、PMI都出现了持续回暖,但由于地产成交量等数据略低于季节性预期,使得市场对经济周期向上的弹性预期不高,因此传统周期股以企稳为主要特点;而依据投资时钟理论在经济企稳而货币相对宽松的环境下更适宜成长股和主题股的表现。

三季度制度红利驱动的主题行情表现尤为突出,以上海自贸区、土地改革、国有企业改革等主题最为市场关注。无论是成长股还是主题投资背后,其深层次的驱动因素都是市场对新一轮经济增长引擎只能是结构升级和技术创新方向的认同。

本基金在三季度保持了中性仓位,行业配置向新兴产业以及稳定消费类行业适当倾斜。

四季度经济有望继续保持稳健,本基金将继续在新盈利模式、消费升级等领域挖掘投资机会。

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0.8475元,本报告期份额净值增长率为11.38%,同期业绩比较基准增长率为7.25%。

§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	4,716,904,459.86	81.07
	其中:股票	4,716,904,459.86	81.07
2	固定收益投资	148,656,000.00	2.56
	其中:债券	148,656,000.00	2.56
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	639,400,329.10	10.99
	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	213,422,309.47	3.67
6	其他各项资产	99,641,460.14	1.71
7	合计	5,818,024,558.57	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	3,148,044,034.22	54.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	165,947,087.05	2.88
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	196,433,004.63	3.41
J	金融业	158,289,477.62	2.75
K	房地产业	114,953,298.75	1.99
L	租赁和商务服务业	195,113,870.20	3.39
M	科学研究和技术服务业	31,102,668.75	0.54
N	水利、环境和公共设施管理业	307,209,460.80	5.33
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	63,362,262.73	1.10
R	文化、体育和娱乐业	336,449,295.11	5.84
S	综合	-	-
	合计	4,716,904,459.86	81.86

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	600535	天士力	8,104,696	364,873,413.92	6.33
2	600887	伊利股份	7,587,920	339,028,265.60	5.88
3	300070	碧水源	7,548,144	307,209,460.80	5.33
4	002415	海康威视	11,398,625	300,923,700.00	5.22
5	600315	上海家化	6,315,290	274,146,738.90	4.76
6	600422	昆明制药	7,224,204	194,909,023.92	3.38
7	300251	光线传媒	2,974,896	192,594,767.04	3.34
8	002148	北纬通信	2,673,333	179,113,311.00	3.11
9	000538	云南白药	1,484,061	173,724,180.66	3.01
10	002570	贝因美	3,969,921	165,148,713.60	2.87

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	148,656,000.00	2.58
	其中:政策性金融债	148,656,000.00	2.58
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	148,656,000.00	2.58

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	700,000	69,825,000.00	1.21
2	130410	13农发10	500,000	49,080,000.00	0.85
3	110412	11农发12	300,000	29,751,000.00	0.52

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	2,271,731.26
2	应收证券清算款	94,568,009.03
3	应收股利	-
4	应收利息	2,598,155.50
5	应收申购款	203,564.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	99,641,460.14

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

本报告期期初基金份额总额	6,871,914,838.41
本报告期基金总申购份额	286,712,172.16
减:本报告期基金总赎回份额	359,517,209.59
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	6,799,109,800.98

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86,529,422.37份,占本基金期末总份额的1.27%。

§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策影视(证券代码:300133)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31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精选股票证券投资基金募集的文件;
2、《交银施罗德精选股票证券投资基金基金合同》;
3、《交银施罗德精选股票证券投资基金招募说明书》;
4、《交银施罗德精选股票证券投资基金托管协议》;
5、关于募集交银施罗德精选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精选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@jyshd.com。

交银施罗德环球精选价值证券投资基金

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	交银环球精选股票(QDII)
基金主代码	519696
交易代码	519696
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年8月22日
报告期末基金份额总额	107,376,554.80份
投资目标	通过全球资产配置和灵活分散投资,在有效分散和控制风险的前提下,实现长期资本增值。
投资策略	自上而下配置资产,通过对全球宏观经济和各经济体的基本面分析,在不同区域间进行有效资产配置,自下而上精选证券,挖掘定价合理、具备持续竞争优势的上市公司股票进行投资,并有效控制下行风险。
业绩比较基准	70%×标准普尔全球大中盘指数(S&P Global LargeMidCap Index)+30%×恒生指数
风险收益特征	本基金以股票及股票基金为主要投资对象,属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种,其预期风险和收益水平高于混合型基金和债券型基金。此外,本基金在全球范围内进行投资,除了需要承担国际市场的市场波动风险之外,还面临汇率风险、国别风险、新兴市场风险等海外市场投资所面临的特别投资风险。
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
境外投资顾问英文名称	Schroder Investment Management Limited
境外投资顾问中文名称	施罗德投资管理有限公司
境外资产托管人英文名称	JPMorgan Chase Bank,National Association
境外资产托管人中文名称	摩根大通银行

§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	5,235,794.96
2.本期利润	15,693,962.12
3.加权平均基金份额本期利润	0.1401
4.期末基金资产净值	158,157,010.10
5.期末基金份额净值	1.473

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