交银施罗德主题优选灵活配置混合型证券投资基金

2014 第三季度 报告

2014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:二〇一四年十月二十四日

§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2014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2014年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	交银主题优选混合	
基金主代码	519700	
交易代码	519700(前端)	519701(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2010年6月30日	
报告期末基金份额总额	646,332,630.20份	
投资目标	本基金力图通过前瞻性的主题优选,积极把握行业和个股投资机会,在控制风险并保持基金资产良好的流动性的前提下,力争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发展趋势、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;通过优选主题配置和挖掘预期具有良好增长前景的优势行业相结合的方式,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,属于基金中的中高风险品种,本基金的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	中国建设银行股份有限公司	

§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(2014年7月1日-2014年9月30日)
1.本期已实现收益	11,462,599.98
2.本期利润	17,985,003.91
3.加权平均基金份额本期利润	0.0267
4.期末基金资产净值	511,430,151.97
5.期末基金份额净值	0.791

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	3.53%	0.63%	8.51%	0.55%	-4.98%	0.08%

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
(2010年6月30日至2014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		
李永兴	本基金、交银施罗德周期回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理	2012-03-20	-	8年	李永兴先生,经济学硕士,2006年加入交银施罗德基金管理有限公司,历任投资研究部研究员、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

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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内,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。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度股票市场呈现全面上涨的走势。七月份在众多城市地产限购政策放松的刺激下,房地产行业率先开始上涨,随后逐渐扩散到其他各个行业。由于期间经济数据和货币信贷数据都较差,从基本面角度而言经济中的亮点并不多,因此三季度市场依然是主题投资盛行,军工、体育产业等投资主题涨幅较大。

本基金在三季度中,虽然较大幅度地提升了股票仓位,但由于加仓时机和持仓结构因素影响,因此未能跑赢市场。

展望四季度,由于资金依然充裕,因此预计市场短期内可能仍将继续上涨。但经济下行的压力始终存在,市场仍时会对经济基本面做出反应仍有待观察。本基金将根据经济运行数据的变化,对仓位和持仓结构做出相应调整。

4.5报告期内基金的业绩表现

截至2014年9月30日,本基金份额净值为0.791元,本报告期份额净值增长率为3.53%,同期业绩比较基准增长率为8.51%。

§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	407,297,951.88	79.18
	其中:股票	407,297,951.88	79.18
2	固定收益投资	75,799,488.60	14.74
	其中:债券	75,799,488.60	14.74
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
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	30,750,210.24	5.98
7	其他资产	556,606.24	0.11
8	合计	514,404,256.96	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	112,428,807.25	21.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,760,406.64	1.13
E	建筑业	13,284,321.60	2.60
F	批发和零售业	22,364,586.50	4.37
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	4,987,260.00	0.98
I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,112,355.03	4.13
J	金融业	132,037,917.82	25.82
K	房地产业	75,912,976.69	14.84
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	10,146,683.96	1.98
R	文化、体育和娱乐业	9,262,636.39	1.81
S	综合	-	-
	合计	407,297,951.88	79.64

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	600030	中信证券	1,793,100	23,884,092.00	4.67
2	601318	中国平安	545,000	22,530,300.00	4.41
3	600837	海通证券	2,068,336	21,345,227.52	4.17
4	000024	招商地产	1,667,861	20,498,011.69	4.01
5	601555	东吴证券	1,649,781	16,992,744.30	3.32
6	603005	晶方科技	325,599	15,550,608.24	3.04
7	002353	杰瑞股份	391,326	15,253,887.48	2.98
8	000712	锦龙股份	797,600	14,109,544.00	2.76
9	600511	国药股份	506,910	13,661,224.50	2.67
10	000961	中南建设	1,509,582	13,284,321.60	2.60

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	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	19,998,000.00	3.91
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	55,801,488.60	10.91
8	其他	-	-
9	合计	75,799,488.60	14.82

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	113005	平安转债	227,880	24,941,466.00	4.88
2	110025	国金转债	166,800	20,604,804.00	4.03
3	1080077	10马建投债	200,000	19,998,000.00	3.91
4	113001	中行转债	49,680	5,144,860.80	1.01
5	113002	工行转债	46,940	5,110,357.80	1.00

5.6 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序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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未受到公开谴责和处罚。

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	147,595.86
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	340,271.21
5	应收申购款	68,739.17
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	556,606.24

5.11.4 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	113005	平安转债	24,941,466.00	4.88
2	113001	中行转债	5,144,860.80	1.01
3	113002	工行转债	5,110,357.80	1.00

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	692,636,132.02
本报告期基金总申购份额	3,200,443.50
减:本报告期基金总赎回份额	49,503,945.32
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	646,332,630.20

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基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

报告期期初管理人持有的本基金份额	202,878,105.88
本报告期买入申购总份额	-
本报告期卖出赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	202,878,105.88
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	31.39

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。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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。

§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先河环保(证券代码:300137)股票自2014年7月14日起按照指数收益法进行估值,并已于2014年8月18日起恢复按市场价格进行估值;本基金对其所持有的华策影视(证券代码:300133)股票自2014年8月21日起按照指数收益法进行估值,并已于2014年10月10日起恢复按市场价格进行估值;本基金对其所持有的东华软件(证券代码:002065)股票自2014年9月25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主题优选灵活配置混合型证券投资基金募集的文件;

2、《交银施罗德主题优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3、《交银施罗德主题优选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》;

4、《交银施罗德主题优选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

5、关于募集交银施罗德主题优选灵活配置混合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主题优选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。

交银施罗德信用添利债券证券投资基金(LOF)

2014 第三季度 报告

2014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:二〇一四年十月二十四日

§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2014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2014年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	交银信用添利债券(LOF)	
基金主代码	164902	
交易代码	164902(前端)	164903(后端)
基金运作方式	上市契约型开放式	
基金合同生效日	2011年1月27日	
报告期末基金份额总额	210,084,154.32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,在控制信用风险、利率风险和流动性风险前提下,力求通过主动承担适度信用风险获得持续投资收益,谋求基金资产的长期稳定增长。	
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、严谨的信用分析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,本基金也会关注股票一级市场、权证一级市场等其它相关市场存在的投资机会,力争实现基金总体风险收益特征保持不变前提下的基金资产增值最大化。	
业绩比较基准	80%×中债企业债总全价指数收益率+20%×中债国债总全价指数收益率	
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	中国农业银行股份有限公司	

注:1、本基金场内简称为“交银添利”。

2、根据本基金《基金合同》及《招募说明书》的相关规定,本基金在基金合同生效之日起三年(含三年)的期间内,采取封闭式运作,在深圳证券交易所上市交易,封闭期结束后转为上市开放式基金(LOF),本基金封闭期自2011年1月27日(基金合同生效日)起至2014年1月27日止,自2014年1月28日起基金运作方式转为“上市契约型开放式”,并于同日起开放本基金的申购、赎回业务。本基金在募集期仅开通前端基金份额的认购,转为上市开放式基金(LOF)后将同时开通前端基金份额和后端基金份额的申购和赎回。

§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(2014年7月1日-2014年9月30日)
1.本期已实现收益	7,486,036.29
2.本期利润	9,349,706.30
3.加权平均基金份额本期利润	0.0414
4.期末基金资产净值	225,919,395.40
5.期末基金份额净值	1.075

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	4.07%	0.14%	1.16%	0.06%	2.91%	0.08%

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

交银施罗德信用添利债券证券投资基金(LOF)
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1月27日至2014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		
林洪钧	本基金、交银货币、交银增利债券、交银理财21天债券、交银纯债债券发起式、交银现金宝货币的基金经理,公司固定收益部助理总经理	2011-01-27	-	10年	林洪钧先生,复旦大学硕士,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、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

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内,本公司管理的所有投资组合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没有超过该证券当日总成交量5%的情形,本基金与本公司管理的其他投资组合在不同时间窗下(如日内、3日内、5日内)同向交易的交易价差未出现异常。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2014年第三季度,国内经济增速整体企稳,流动性宽松,各项改革出现加速迹象。在这种经济环境下,资本市场中无论是周期蓝筹股还是中小市值股均一定程度上受益,总体反应积极。本基金为跟踪基准指数的指数基金,在本季度内获得较为可喜的上涨。

展望未来,在衰弱脆的经济政策背景下,预计货币政策仍将保持相对稳定,经济增速较为平稳,股市在温和的外部环境下预计整体风险不大,在整体政策着力于改革与结构调整的大趋势下,市场或将进入良性可持续的发展阶段。

4.5报告期内基金的业绩表现

截至2014年9月30日,本基金份额净值为1.075元,本报告期份额净值增长率为4.07%,同期业绩比较基准增长率为1.16%。

§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	6,090,000.00	1.37
	其中:股票	6,090,000.00	1.37
2	固定收益投资	409,633,813.53	92.28
	其中:债券	409,633,813.53	92.28
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
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	15,600,408.33	3.51
7	其他资产	12,555,346.57	2.83
8	合计	443,879,568.43	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	6,090,000.00	2.70
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	-	-
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	-	-
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	-	-
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	6,090,000.00	2.70

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	600085	同仁堂	250,000	4,735,000.00	2.10
2	000887	中鼎股份	100,000	1,355,000.00	0.60

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	70,010,000.00	30.99
	其中:政策性金融债	20,010,000.00	8.86
4	企业债券	176,514,599.83	78.13
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	120,301,000.00	53.25
7	可转债	42,808,213.70	18.95
8	其他	-	-
9	合计	409,633,813.53	181.32

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	120000A	12光大永明次级债务	500,000	50,000,000.00	22.13
2	101460001	14闽电信MTN001	300,000	30,957,000.00	13.70
3	1282248	12盈德MTN1	300,000	29,502,000.00	13.06
4	124274	13歌南翔	227,290	22,138,046.00	9.80
5	124517	14怀化02	200,000	20,900,000.00	9.25

注:因“T2光大永明次级债”暂无市场代码,上表中债券代码“T20000A”为系统虚拟代码。

5.6 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序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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未受到公开谴责和处罚。

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	79,163.38
2	应收证券清算款	903,236.78
3	应收股利	-
4	应收利息	11,488,168.36
5	应收申购款	69,654.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	15,123.20
8	其他	-
9	合计	12,555,346.57

5.11.4 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	113005	平安转债	10,507,200.00	4.65
2	110024	隧道转债	7,881,600.00	3.49
3	113003	重工转债	6,842,000.00	3.03
4	113006	深燃转债	5,480,513.70	2.43
5	110015	石化转债	5,451,500.00	2.41
6	113002	工行转债	5,443,500.00	2.41

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	245,260,248.45
本报告期基金总申购份额	5,429,098.46
减:本报告期基金总赎回份额	40,605,192.59
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	210,084,154.32

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基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内未发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.2 基金管理人运用超有资金投资本基金交易明细

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。

§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信用添利债券证券投资基金募集的文件;

2、《交银施罗德信用添利债券证券投资基金基金合同》;

3、《交银施罗德信用添利债券证券投资基金招募说明书》;

4、《交银施罗德信用添利债券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信用添利债券证券投资基金之法律意见书;

8、报告期内交银施罗德信用添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@jyshd.com。

交银施罗德上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2014 第三季度 报告

2014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:二〇一四年十月二十四日

§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2014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2014年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

2.1基金基本情况

基金简称	交银上证180公司治理ETF联接	
基金主代码	519686	
交易代码	519686(前端)	519687(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009年9月29日	
报告期末基金份额总额	2,420,780,602.83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的比例不低于基金资产净值的90%。	
业绩比较基准	上证180公司治理指数×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	

2.1.1目标基金基本情况

基金名称	上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	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
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2009年12月15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

注:本表所列的基金主代码510010为目标基金的二级市场交易代码,目标基金的一级市场申购赎回代码为510011。

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