

# 交银施罗德荣安保本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

**1.1 重要提示**  
基金管理人及基金托管人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,也不保证基金份额持有人的本金安全,并自行承担基金资产在运作过程中产生的投资风险,投资者有自行承担投资风险的责任。  
本报告期内基金未发生涉及诉讼的事项。  
本报告期内基金未发生涉及诉讼的事项。  
本报告期内基金未发生涉及诉讼的事项。

代码	行业名称	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	145,682,083.7	17.05
D	电力、热力、燃气生产和供应业	8,560,753.00	1.00
E	建筑业	7,941,700.00	0.93
F	批发和零售业	4,732,160.00	0.56
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	41,302,234.74	4.83
J	金融业	3,090,000.00	0.36
K	房地产业	14,163,000.00	1.66
L	租赁和商务服务业	2,550,000.00	0.30
M	科学研究和技术服务业	20,527.20	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	1,536,114.62	0.18
O	教育服务、健康和休闲服务业	-	-
P	教育	10,008,317.29	1.17
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	14,349,500.00	1.67
S	综合	-	-
合计		254,114,575.61	29.74

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	002008	大禹节水	1,025,050	20,937,275.50	2.34
2	300074	华谊集团	900,840	16,764,632.40	1.96
3	600584	长电科技	1,193,046	14,244,969.24	1.67
4	300307	联讯	423,425	13,949,175.25	1.63
5	300137	先河环保	871,624	13,536,303.72	1.58
6	600064	铜业集团	800,000	13,456,000.00	1.57
7	002065	振华节能	287,409	12,646,919.77	1.47
8	002075	京东方A	299,546	9,823,215.56	1.15
9	000017	广汇集团	1,999,199	9,605,678.65	1.13
10	000020	TCL集团	3,116,800	8,550,560.00	1.00

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	140332	14债总32	800,000	81,224,000.00	9.30
2	140318	14债总18	600,000	61,292,000.00	7.23
3	140310	14债总10	500,000	50,000,000.00	5.86
4	110418	11债总18	500,000	49,570,000.00	5.85
5	140422	14债总22	400,000	40,996,000.00	4.80

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	140332	14债总32	800,000	81,224,000.00	9.30
2	140318	14债总18	600,000	61,292,000.00	7.23
3	140310	14债总10	500,000	50,000,000.00	5.86
4	110418	11债总18	500,000	49,570,000.00	5.85
5	140422	14债总22	400,000	40,996,000.00	4.80

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	140332	14债总32	800,000	81,224,000.00	9.30
2	140318	14债总18	600,000	61,292,000.00	7.23
3	140310	14债总10	500,000	50,000,000.00	5.86
4	110418	11债总18	500,000	49,570,000.00	5.85
5	140422	14债总22	400,000	40,996,000.00	4.80

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	140332	14债总32	800,000	81,224,000.00	9.30
2	140318	14债总18	600,000	61,292,000.00	7.23
3	140310	14债总10	500,000	50,000,000.00	5.86
4	110418	11债总18	500,000	49,570,000.00	5.85
5	140422	14债总22	400,000	40,996,000.00	4.80

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	140332	14债总32	800,000	81,224,000.00	9.30
2	140318	14债总18	600,000	61,292,000.00	7.23
3	140310	14债总10	500,000	50,000,000.00	5.86
4	110418	11债总18	500,000	49,570,000.00	5.85
5	140422	14债总22	400,000	40,996,000.00	4.80

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	140332	14债总32	800,000	81,224,000.00	9.30
2	140318	14债总18	600,000	61,292,000.00	7.23
3	140310	14债总10	500,000	50,000,000.00	5.86
4	110418	11债总18	500,000	49,570,000.00	5.85
5	140422	14债总22	400,000	40,996,000.00	4.80

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	140332	14债总32	800,000	81,224,000.00	9.30
2	140318	14债总18	600,000	61,292,000.00	7.23
3	140310	14债总10	500,000	50,000,000.00	5.86
4	110418	11债总18	500,000	49,570,000.00	5.85
5	140422	14债总22	400,000	40,996,000.00	4.80

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	140332	14债总32	800,000	81,224,000.00	9.30
2	140318	14债总18	600,000	61,292,000.00	7.23
3	140310	14债总10	500,000	50,000,000.00	5.86
4	110418	11债总18	500,000	49,570,000.00	5.85
5	140422	14债总22	400,000	40,996,000.00	4.80

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	140332	14债总32	800,000	81,224,000.00	9.30
2	140318	14债总18	600,000	61,292,000.00	7.23
3	140310	14债总10	500,000	50,000,000.00	5.86
4	110418	11债总18	500,000	49,570,000.00	5.85
5	140422	14债总22	400,000	40,996,000.00	4.80

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	140332	14债总32	800,000	81,224,000.00	9.30
2	140318	14债总18	600,000	61,292,000.00	7.23
3	140310	14债总10	500,000	50,000,000.00	5.86
4	110418	11债总18	500,000	49,570,000.00	5.85
5	140422	14债总22	400,000	40,996,000.00	4.80

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	140332	14债总32	800,000	81,224,000.00	9.30
2	140318	14债总18	600,000	61,292,000.00	7.23
3	140310	14债总10	500,000	50,000,000.00	5.86
4	110418	11债总18	500,000	49,570,000.00	5.85
5	140422	14债总22	400,000	40,996,000.00	4.80

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	140332	14债总32	800,000	81,224,000.00	9.30
2	140318	14债总18	600,000	61,292,000.00	7.23
3	140310	14债总10	500,000	50,000,000.00	5.86
4	110418	11债总18	500,000	49,570,000.00	5.85
5	140422	14债总22	400,000	40,996,000.00	4.80

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	140332	14债总32	800,000	81,224,000.00	9.30
2	140318	14债总18	600,000	61,292,000.00	7.23
3	140310	14债总10	500,000	50,000,000.00	5.86
4	110418	11债总18	500,000	49,570,000.00	5.85
5	140422	14债总22	400,000	40,996,000.00	4.80

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	140332	14债总32	800,000	81,224,000.00	9.30
2	140318	14债总18	600,000	61,292,000.00	7.23
3	140310	14债总10	500,000	50,000,000.00	5.86
4	110418	11债总18	500,000	49,570,000.00	5.85
5	140422	14债总22	400,000	40,996,000.00	4.80

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	140332	14债总32	800,000	81,224,000.00	9.30
2	140318	14债总18	600,000	61,292,000.00	7.23
3	140310	14债总10	500,000	50,000,000.00	5.86
4	110418	11债总18	500,000	49,570,000.00	5.85
5	140422	14债总22	400,000	40,996,000.00	4.80

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	140332	14债总32	800,000	81,224,000.00	9.30
2	140318	14债总18	600,000	61,292,000.00	7.23
3	140310	14债总10	500,000	50,000,000.00	5.86
4	110418	11债总18	500,000	49,570,000.00	5.85
5	140422	14债总22	400,000	40,996,000.00	4.80

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	140332	14债总32	800,000	81,224,000.00	9.30
2	140318	14债总18	600,000	61,292,000.00	7.23
3	140310	14债总10	500,000	50,000,000.00	5.86
4	110418	11债总18	500,000	49,570,000.00	5.85
5	140422	14债总22	400,000	40,996,000.00	4.80

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	140332	14债总32	800,000	81,224,000.00	9.30
2	140318	14债总18	600,000	61,292,000.00	7.23
3	140310	14债总10	500,000	50,000,000.00	5.86
4	110418	11债总18	500,000	49,570,000.00	5.85
5	140422	14债总22	400,000	40,996,000.00	4.80

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	140332	14债总32	800,000	81,224,000.00	9.30
2	140318	14债总18	600,000	61,292,000.00	7.23
3	140310	14债总10	500,000	50,000,000.00	5.86
4	110418	11债总18	500,000	49,570,000.00	5.85
5	140422	14债总22	400,000	40,996,000.00	4.80

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	140332	14债总32	800,000	81,224,000.00	9.30
2	140318	14债总18	600,000	61,292,000.00	7.23
3	140310	14债总10	500,000	50,000,000.00	5.86
4	110418	11债总18	500,000	49,570,000.00	5.85
5	140422	14债总22	400,000	40,996,000.00	4.80

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	140332	14债总32	800,000	81,224,000.00	9.30
2	140318	14债总18	600,000	61,292,000.00	7.23
3	140310	14债总10	500,000	50,000,000.00	5.86
4	110418	11债总18	500,000	49,570,000.00	5.85
5	140422	14债总22	400,000	40,996,000.00	4.80

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	140332	14债总32	800,000	81,224,000.00	9.30