交银施罗德理财21天债券型证券投资基金

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	947,927,922.84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	44,451,391.98份	903,476,530.86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(2014年7月1日-2014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	723,616.03	9,310,021.57
2.本期利润	723,616.03	9,310,021.57
3.期末基金资产净值	44,451,391.98	903,476,530.86

注:1、自2013年1月9日起,本基金实行销售服务费分类收费方式,分设两类基金份额:A类基金份额和B类基金份额。A类基金份额与B类基金份额的管理费、托管费相同,A类基金份额按照0.30%的年费率计提销售服务费,B类基金份额按照0.01%的年费率计提销售服务费。在计算主要财务指标时,A类基金份额与分类前基金连续计算,B类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)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,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	1.4990%	0.0559%	0.3403%	0.0000%	1.1587%	0.0559%

注:1、本表净值收益率数据所取的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	0.7034%	0.0071%	0.3403%	0.0000%	0.3631%	0.0071%

注:1、本表净值收益率数据所取的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2014年9月30日)

注:图示日期为2012年11月5日至2014年9月30日。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

注:图示日期为2013年1月9日至2014年9月30日。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、交银信用添利债券(LOF)、交银纯债债券发起、交银现金宝货币的基金经理,公司固定收益部助理总经理	2012-11-05	-	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 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

本报告期内,经济增长动能总体仍显疲软的态势。7月份的金融数据极为异常,社会融资总量仅2731亿,新增贷款也仅为3852亿,较6月均出现大幅下降。7月工业增加值小幅下降至9.0%,8月工业却大幅滑落至6.9%。作为经济晴雨表的PMI表现相对稳定在51附近。从中观观层面观察,钢铁、水泥、煤炭的产量及价格都进一步下降,经济下滑的压力仍然比较大。政策层面,本报告期内,央行仍维持较为稳健的货币政策。从政策层面观察,政府对经济滑落的容忍力在提升,改革仍为未来政府工作重心。

本报告期内,债券市场受数据的扰动较为明显。在7月初由于对未来可能出现的宽信用的担忧,债券收益率在7月中上旬出现了大约30BP的上行;此后,随着7月金融数据的公布,加上8月份工业增加值大幅下降,债券市场呈现单边上涨态势,三季度中债总财富指数上涨1.62%,债券收益率无抵近前一路下行,与此同时,货币政策的微妙变化(公开市场上,正回购利率两次下调),打开了短端下行空间,长端收益率也进一步下行。

本基金在本报告期内继续增加企业短期融资券以及短期政策性金融债的配置,主要考虑因素为再投资风险。在本报告期内,本基金也较好地享受到了货币市场收益率下行带来的债券资本利得。另外,货币市场流动性在本报告期内保持了较为稳定宽松的情况,9月底并未出现季末流动性紧张的情况,反而呈现相对较为宽松的局面。

展望四季度,在稳增长的背景下,稳健的政策出现变化的可能性不大,货币市场大概率仍将保持较为充沛的流动性,因此,再投资风险需要在四季度继续保持关注,收益率较前期可能适度下降。在组合自身流动性可控的前提下,本基金在四季度仍将保持较高的债券持仓,力求保持收益和流动性的平稳。

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1.4990%,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0.7034%,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	742,973,376.00	62.85
	其中:债券	742,973,376.00	62.85
	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	416,377,070.68	35.22
4	其他资产	22,845,442.31	1.93
5	合计	1,182,195,888.99	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		15.86
	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	229,999,685.00	24.26
	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	117
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	214
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	10

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

序号	发生日期	平均剩余期限	原因	调整期
1	2014-07-15	150	2014年7月9日巨额赎回导致投资组合平均剩余期限被动超标。	已在10个工作日内完成调整。
2	2014-07-14	212		
3	2014-07-11	214		

注: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"。

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	13.35	24.26
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	47.50	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	29.72	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	31.74	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	122.31	24.26

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	100,126,311.00	10.56
	其中:政策性金融债	100,126,311.00	10.56
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	642,847,065.00	67.82
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	742,973,376.00	78.38
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序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	041454002	14川交投CP001	900,000	90,815,167.18	9.58
2	041456036	14武汉地铁CP001	700,000	70,167,768.91	7.40
3	041460007	14杭工投CP001	600,000	60,273,285.85	6.36
4	041355037	13徐工CP002	500,000	50,230,008.75	5.30
5	041358071	13龙盛CP001	500,000	50,142,417.14	5.29
6	140204	14国开04	500,000	50,115,061.14	5.29
7	041461039	14华信资产CP001	500,000	50,103,392.91	5.29
8	130331	13进出31	500,000	50,011,249.86	5.28
9	041460075	14晋国信CP001	500,000	50,000,131.10	5.27
10	041471003	14盐国投CP001	300,000	30,228,927.20	3.19

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	0.2207%
报告期内偏离度的最低值	-0.0046%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0611%

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	22,845,442.31
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	22,845,442.31

5.8.5 报告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	51,659,971.35	1,002,420,875.36
本报告期基金总申购份额	5,568,157.23	2,004,648,449.55
减:本报告期基金总赎回份额	12,776,736.60	2,103,592,794.05
本报告期期末基金份额总额	44,451,391.98	903,476,530.86

注:1、如果本报告期间发生转换入、份额类别调整、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、份额类别调整业务,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;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。

交银施罗德荣祥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	交银荣祥保本混合
基金主代码	519726
交易代码	519726
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年4月24日
报告期末基金份额总额	323,705,877.27份
投资目标	本基金在严格控制风险和追求本金安全的前提下,力争实现基金资产在保本周期内的稳定增值。
投资策略	本基金运用恒定比例组合保险(CPPI,Constant Proportion Portfolio Insurance)原理,动态调整稳健资产与风险资产在基金组合中的投资比例,以确保本基金在保本周期到期时的本金安全,并实现基金资产在保本基础上的保值增值目的。
业绩比较基准	三年期银行定期存款税后收益率
风险收益特征	本基金是一只保本混合型基金,在证券投资基金中属于低风险品种。
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
基金保证人	中国投融资担保有限公司

§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	6,089,218.68
2.本期利润	14,061,448.76
3.加权平均基金份额本期利润	0.0413
4.期末基金资产净值	343,639,417.22
5.期末基金份额净值	1.062

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

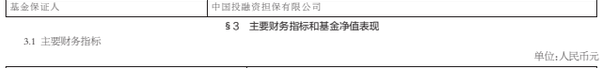
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	4.12%	0.28%	1.09%	0.01%	3.03%	0.27%

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

交银施罗德荣祥保本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

(2013年4月24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		
项廷锋	本基金、交银双利债券、交银荣安保本混合、交银定期支付双息平衡混合、交银荣泰保本混合、交银周期回报灵活配置混合的基金经理,公司投资总监	2013-04-24	-	15年	项廷锋先生,上海交通大学管理学博士。历任华安基金管理有限公司研究员、固定收益投资经理和基金经理。其中2003年12月至2007年5月担任华安现金富利投资基金基金经理,2007年加入交银施罗德基金管理有限公司,历任固定收益部总经理。

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年第二季度,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,总体呈应积极、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,在微刺激的经济政策背景下,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1.165元,本报告期份额净值增长率为17.80%,同期业绩比较基准增长率为17.93%。本报告期内本基金的日均跟踪偏离度为0.05%,跟踪误差为0.06%。

§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	113,575,676.46	32.47
	其中:股票	113,575,676.46	32.47
2	固定收益投资	194,426,100.00	55.58
	其中:债券	194,426,100.00	55.58
	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	36,436,102.65	10.42
7	其他资产	5,386,621.38	1.54
8	合计	349,824,500.49	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	72,214,839.19	21.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,196,684.58	1.22
E	建筑业	1,937,000.00	0.56
F	批发和零售业	3,406,000.00	0.99
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	13,025,711.93	3.79
J	金融业	1,236,000.00	0.36
K	房地产业	7,630,200.00	2.22
L	租赁和商务服务业	1,275,000.00	0.37
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	496,849.76	0.14
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,153,100.00	1.21
R	文化、体育和娱乐业	4,004,291.00	1.17
S	综合	-	-
	合计	113,575,676.46	33.05

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	002008	大族激光	800,000	15,640,000.00	4.55
2	000100	TCL集团	2,275,000	6,142,500.00	1.79
3	600584	长电科技	499,908	5,968,901.52	1.74
4	002665	首航节能	120,000	5,283,600.00	1.54
5	600804	鹏博士	300,000	5,046,000.00	1.47
6	300137	先河环保	320,069	4,970,671.57	1.45
7	000927	一汽夏利	999,208	4,846,158.80	1.41
8	300207	欣旺达	120,000	3,951,600.00	1.15
9	601989	中国重工	600,000	3,936,000.00	1.15
10	300074	华平股份	186,113	3,463,562.93	1.01

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	10,235,000.00	2.98
2	央行票据	-	-
3	金融债券	162,201,000.00	47.20
	其中:政策性金融债	162,201,000.00	47.20
4	企业债券	11,045,100.00	3.21
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	10,945,000.00	3.19
8	其他	-	-
9	合计	194,426,100.00	56.58

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	140407	14农发07	500,000	50,825,000.00	14.79
2	140424	14农发24	500,000	50,770,000.00	14.77
3	130434	13农发34	200,000	20,616,000.00	6.00
4	110411	11农发11	200,000	20,002,000.00	5.82
5	110418	11农发18	200,000	19,988,000.00	5.82

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	85,769.25
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,248,058.95
5	应收申购款	52,793.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,386,621.38

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	10,945,000.00	3.19

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300074	华平股份	3,463,562.93	1.01	重大事项
2	300207	欣旺达	3,951,600.00	1.15	重大事项

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	355,644,303.87
本报告期基金总申购份额	767,024.53
减:本报告期基金总赎回份额	32,705,451.13
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	323,705,877.27

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TCL集团(证券代码:000100)股票自2014年8月5日起按照指数收益法进行估值,并已于2014年8月15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、中国证监会核准交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金募集的文件;

2、《交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金基金合同》;

3、《交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金招募说明书》;

4、《交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金托管协议》;

5、关于申请募集交银施罗德沪深300行业分层等权重指数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沪深300行业分层等权重指数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@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

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