交银施罗德成长30股票型证券投资基金

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	交银成长30股票	
基金主代码	519727	
交易代码	519727(前端)	519728(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年6月5日	
报告期末基金份额总额	522,758,424.87份	
投资目标	本基金属于成长型股票基金,主要通过投资于不超过30只精选的成长型上市公司股票,在适度控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下,为基金份额持有人谋求长期、稳定的资本增值。	
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运行和行业景气变化以及上市公司成长潜力的基础上,精选业务聚焦型、在所属行业内数一数二的成长型上市公司股票,并通过持有不超过30只股票的集中持股策略,为基金资产谋求长期稳健增值。	
业绩比较基准	75%×富时中国A600成长指数收益率+25%×中信标普全债指数收益率	
风险收益特征	本基金是一只股票型基金,以成长型股票为主要投资对象,风险与预期收益高于混合基金、债券基金和货币市场基金。属于承担较高风险、预期收益较高的证券投资基金品种。	
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	17,725,390.79
2.本期利润	90,240,392.15
3.加权平均基金份额本期利润	0.1222
4.期末基金资产净值	571,710,221.28
5.期末基金份额净值	1.094

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	11.75%	0.92%	10.62%	0.67%	1.13%	0.25%

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

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		
管华雨	本基金、交银成长股票、交银趋势股票、交银新成长股票的基金经理,公司权益投资总监	2013-06-05	-	12年	管华雨先生,CFA,博士学历。历任申银万国证券股份有限公司投资部投资经理、高级投资经理,信诚基金管理有限公司分析师、基金经理助理和基金经理。其中2007年5月至2010年5月担任信诚四季红混合型证券投资基金基金经理。2010年加入交银施罗德基金管理有限公司,历任权益部总经理助理、副总经理、总经理,2010年12月22日至2012年3月12日担任交银施罗德趋势优先股票证券投资基金基金经理,2012年3月13日至2013年4月25日担任交银施罗德精选股票证券投资基金基金经理。
王少成	本基金、交银先锋股票、交银先进制造股票的基金经理,公司权益部副总经理	2013-07-02	-	10年	王少成先生,复旦大学硕士学历。历任上海融昌资产管理公司研究员,中银证券投资经理,信诚基金管理有限公司研究总监助理,东吴基金管理有限公司投资经理、基金经理、投资部副总经理。其中2010年9月至2012年10月担任东吴新创业股票型证券投资基金基金经理,2011年2月至2012年11月担任东吴中证新兴产业指数证券投资基金基金经理,2011年5月至2012年11月担任东吴价值成长双动力股票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。

注:2014年10月22日本基金管理人发布公告,经公司领导办公会议审议通过,管华雨先生不再担任本基金基金经理,王少成先生自公告日起单独管理本基金,详情请见相关公告。

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年三季度A股市场呈现单边上涨的态势。股市上涨初期主要反映了宏观政策放松的预期,在中后期尽管宏观刺激政策低于市场预期,宏观高频数据显示刺激效果乏力,指数阶段性回调,但在海外热钱和产业资本持续流入股市驱动下,股市依然明显保持强势。考虑到房地产可能已经处于长周期的价格拐点,企业、政府部门继续加杠杆的可能性在降低,在这个阶段宏观分析预测上存量分析的重要性应该高于流量分析。存量资产价格,存量资本配置方向,乃至存量热钱的流动方向所形成的合力对股市的运行趋势具有决定性的作用。需要注意的是,中美处于不同的经济周期,利率水平中期也处于不同变动方向,人民币对美元是否能保持稳定是个很大的挑战。

三季度本基金净值上涨11.75%,跑赢业绩比较基准。三季度A股市场的单边上涨,无法完全从中微观的基本面来解释。小市值、公司有动力等成为小小市值股票坐牛的共同驱动因素,也成为越来越多投资者选择相信的投资真谛。这个趋势何以发生,如何持续,是A股投资者无法回避的问题。泡沫本是资产价格一个存在状态,是市场交易的润滑剂,无所谓好坏。对基本面投资者来说,至今可能缺乏好的工具去理解和把握。对A股参与者来说,要么参与主动制造泡沫,要么考虑如何能火中取栗乐享其成,或者做中期可能更正确的事情,不参与泡沫。

四季度宏观经济仍处于缓慢寻底的过程,政府在宏观调控方面的适应性对冲,预计可能更多是减少痛苦而无法解决问题。在新常态的背景下,传统的分析框架的预测能力已经受限,但基于常识依然可以看到很多具有确定性的中期趋势,比如人口老龄化的加速带来银发经济,互联网大潮下带来的企业可能性边界的拓展积分工网络拓扑结构的突变等等。

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1.094元,本报告期份额净值增长率为11.75%,同期业绩比较基准增长率为10.62%。

§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	539,525,598.90	93.39
	其中:股票	539,525,598.90	93.39
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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[注]	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产[注]	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	38,046,696.25	6.59
7	其他资产[注]	115,092.11	0.02
8	合计	577,687,387.26	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	447,433,648.86	78.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	18,484,063.08	3.23
F	批发和零售业	30,830,787.96	5.39
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	42,777,099.00	7.48
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	539,525,598.90	94.37

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	600315	上海家化	1,510,798	54,237,648.20	9.49
2	600389	江山股份	1,665,110	53,516,635.40	9.36
3	600887	伊利股份	1,946,297	50,409,092.30	8.82
4	300005	探路者	2,874,691	50,307,092.50	8.80
5	000423	东阿阿胶	1,407,252	49,042,732.20	8.58
6	600967	北方创业	3,027,191	48,253,424.54	8.44
7	000100	TCL集团	16,580,419	44,767,131.30	7.83
8	600763	通策医疗	886,572	42,777,099.00	7.48
9	601933	永辉超市	3,917,508	30,830,787.96	5.39
10	002223	鱼跃医疗	822,361	23,848,469.00	4.17

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序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除上海家化(证券代码:600315)外,未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

报告期内本基金投资的前十名证券之一上海家化(证券代码:600315)于2013年11月21日公告,公司于2013年11月20日收到中国证券监督管理委员会《调查通知书》及上海证监局《行政监管措施决定书》,拟此上海家化已于2013年12月18日公告,按照上海证监局要求对关联交易进行了相关信息披露。

本基金管理人对该证券投资决策程序的说明如下:本基金管理人对证券投资特别是重仓股的投资有严格的投资决策流程控制。本基金在对该证券的投资也严格执行投资决策流程。在对该证券的选择上,严格执行公司股票池审核流程进入公司核心股票池。在对该证券的持有过程中公司研究员密切关注上市公司动向。在上述事件发生时及时分析其对投资决策的影响,经过分析认为此事件对上市公司财务状况、经营成果和现金流量未产生重大的实质性影响,所以不影响对该公司基本面和公司治理的投资判断。

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	97,125.38
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	10,350.29
5	应收申购款	7,616.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	115,092.11

5.11.4 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。

5.11.5 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	859,468,090.14
本报告期基金总申购份额	24,291,544.10
减:本报告期基金总赎回份额	361,001,209.37
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	522,758,424.87

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 基金管理人运用期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。

§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成长30股票型证券投资基金募集的文件;
2、《交银施罗德成长30股票型证券投资基金基金合同》;
3、《交银施罗德成长30股票型证券投资基金招募说明书》;
4、《交银施罗德成长30股票型证券投资基金托管协议》;
5、关于募集交银施罗德成长30股票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成长30股票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@ysld.com。

交银施罗德环球精选价值证券投资基金

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	88,678,823.10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(2014年7月1日-2014年9月30日)
1.本期已实现收益	4,708,353.51
2.本期利润	-1,440,520.50
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0158
4.期末基金资产净值	143,839,534.28
5.期末基金份额净值	1.622

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	-0.98%	0.51%	-2.22%	0.46%	1.24%	0.05%

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

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		
晏青	本基金、交银施罗德全球自然资源证券投资基金的基金经理	2012-04-09	-	8年	晏青先生,中国国籍。上海交通大学硕士。2006年加入交银施罗德基金管理有限公司,历任行业分析师、QDII高级分析师。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

姓名	在境外投资顾问所任职务	证券从业年限	说明
Simon Webber	施罗德集团多区域(全球及国际)股票投资主管、全球和国际股票基金经理、全球气候变化股票基金经理	15年	Simon Webber先生,英国曼彻斯特大学物理学学士,CFA。1999年加入施罗德投资管理有限公司,历任全球技术团队分析员。

4.3 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。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 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。

4.4.2 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。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

本季度全球主要市场表现严重分化,发达市场中日本涨幅较大,德国跌幅较大,新兴市场普涨,其中中国A股涨幅最大,俄罗斯因为地缘关系出现暴跌。美国QE按部就班地退出,长债利率保持稳定,短债利率有所上升,经济增长相对较好,美元指数大幅上升,这也因素继续提振美国股市表现。欧元区因类似地缘变数波动,欧元区国债收益率继续下降,但因为整体经济表现较弱,欧元下跌,股票市场表现不佳。香港市场先扬后抑,受中国经济企稳以及沪港通的影响,前两个月资金不断流入,股市涨势较好,但在9月份随着中国经济数据走弱,以及香港"占中"的不利影响,出现较大幅度调整,整个季度收跌。本基金在本季度继续坚持精选个股,寻找绝对收益的投资机会。

展望未来一个季度,美国经济继续增长的局面或将维持,欧洲短期难抬增长动能,中国经济虽然有所企稳,政府也不断出台房地产放松的政策,但是能否带来经济的强劲增长,依然需要观察。股票市场能期对一些积极因素已经有所反应,未来一段时间可能面临一定压力,但机会永远在在,我们将一如既往地精选个股,努力为投资人获取持续回报。

截至2014年9月30日,本基金份额净值为1.622元,本报告期份额净值增长率为-0.98%,同期业绩比较基准增长率为-2.22%。

§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(人民币元)	占基金资产的比例(%)
1	权益投资	135,607,287.95	92.02
	其中:普通股	128,774,521.28	87.38
	优先股	6,832,766.67	4.64
	房地产信托	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产[注]	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产[注]	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	9,987,432.29	6.78
8	其他资产[注]	1,770,558.84	1.20
9	合计	147,365,279.08	100.00

5.2 报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家(地区)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
美国	60,225,152.76	41.87
香港	41,587,633.23	28.91
英国	8,427,720.52	5.86
日本	7,350,212.99	5.11
瑞士	5,724,286.90	3.98
法国	5,249,055.34	3.65
芬兰	1,876,716.98	1.30
泰国	1,483,919.85	1.03
挪威	1,269,647.81	0.88
巴西	1,209,861.11	0.84
新加坡	1,203,080.46	0.84
合计	135,607,287.95	94.28

注:1、国家(地区)类别根据其所在的证券交易所确定;
2、ADR、GDR按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
信息技术	29,500,116.84	20.51
非必需消费品	21,391,094.58	14.87
保健	20,645,921.52	14.35
金融	19,227,567.97	13.37
工业	14,622,856.11	10.17
必需消费品	8,873,733.60	6.17
能源	8,829,158.08	6.14
材料	7,346,661.92	5.11
公共事业	3,445,150.21	2.40
电信服务	1,725,027.12	1.20
其他	0.00	0.00
合计	135,607,287.95	94.28

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

5.4 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及存托凭证投资明细

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯控股有限公司	700 HK	香港证券交易所	香港	60,000	5,490,770.32	3.82
2	APPLE INC	苹果公司	AAPL US	美国证券交易所	美国	6,000	3,719,186.25	2.59
3	BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	比亚迪电子(国际)有限公司	285 HK	香港证券交易所	香港	450,000	3,208,891.75	2.23
4	FUFENG GROUP LTD	阜丰集团有限公司	546 HK	香港证券交易所	香港	1,000,000	3,042,504.77	2.12
5	AMGEN INC	安进公司	AMGN US	美国证券交易所	美国	3,456	2,986,606.60	2.08
6	WISDOM HOLDINGS GROUP	智美控股集团	1661 HK	香港证券交易所	香港	700,000	2,756,477.63	1.92
7	CONSUNPHARMA-CEUTICAL GROUP	康臣药业集团有限公司	1681 HK	香港证券交易所	香港	500,000	2,693,884.43	1.87
8	BAIDU INC	百度公司	BIDU US	美国证券交易所	美国	2,000	2,685,320.15	1.87
9	XINCHENCHINA POWER HOLDINGS	新晨中国动力控股有限公司	1148 HK	香港证券交易所	香港	800,000	2,611,483.26	1.82
10	SCHLUMBERGER LTD	斯伦贝谢公司	SLB US	美国证券交易所	美国	4,012	2,510,098.67	1.75

注:前十名股票及存托凭证的排名是按照上市公司不同的上市交易所合并计算排列所得。

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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 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金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

5.9 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基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

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(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	916,242.13
3	应收股利	160,628.80
4	应收利息	178.50
5	应收申购款	43,723.46
6	其他应收款	649,785.95
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,770,558.84

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	92,982,586.04
本报告期基金总申购份额	3,008,615.02
减:本报告期基金总赎回份额	7,312,377.96
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	88,678,823.10

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22,986,750.67份,占本基金期末总份额的25.92%。

§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环球精选价值证券投资基金募集的文件;
2、《交银施罗德环球精选价值证券投资基金基金合同》;
3、《交银施罗德环球精选价值证券投资基金招募说明书》;
4、《交银施罗德环球精选价值证券投资基金托管协议》;
5、关于申请募集交银施罗德环球精选价值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环球精选价值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@ysld.com。

交银施罗德定期支付月月丰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	交银定期支付月月丰债券		
基金主代码	519730		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2013年8月13日		
报告期末基金份额总额	57,043,786.74份		
投资目标	本基金精选具有较高息票率的债券,以获取稳定的债息收入,并通过适当参与股票市场,力争实现基金资产的长期增值。		
投资策略	本