交银施罗德增利债券证券投资基金

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	交银增利债券	
基金主代码	519680	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008 年 3 月 31 日	
报告期末基金份额总额	962,854,306.90 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、流动性风险前提下,主要通过投资承担一定信用风险、具有较高息票率的债券,实现基金资产的长期稳定增长。	
投资策略	本基金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、期限结构配置及债券类别配置,自下而上地配置债券类属和精选个券。	
业绩比较基准	中债企业债总指数	
风险收益特征	本基金是一只债券型基金,在证券投资基金中属于中等风险的品种,其长期平均风险和预期收益高于货币市场基金,低于股票型基金。	
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	交银增利债券 A/B	交银增利债券 C
下属两级基金的交易代码	519680 (前端),519681 (后端)	519682
报告期末下属两级基金的份额总额	692,638,578.10 份	270,215,728.80 份

注:本基金 A 类基金份额采用前端收费模式,B 类基金份额采用后端收费模式,前端交易代码即为 A 类基金份额交易代码,后端交易代码即为 B 类基金份额交易代码。

§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)	
	交银增利债券 A/B	交银增利债券 C
1.本期已实现收益	21,663,026.58	6,330,666.31
2.本期利润	33,760,979.01	9,913,233.60
3.加权平均基金份额本期利润	0.0397	0.0392
4.期末基金资产净值	747,420,755.88	289,198,383.71
5.期末基金份额净值	1.0791	1.0702

注:1、本基金 A/B 类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

1、交银增利债券 A/B:

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	4.09%	0.17%	1.38%	0.05%	2.71%	0.12%

2、交银增利债券 C:

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	3.97%	0.17%	1.38%	0.05%	2.59%	0.12%

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

交银施罗德增利债券证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2008 年 3 月 31 日至 2014 年 9 月 30 日)

1.交银增利债券 A/B

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		
李家春	本基金、交银双利债券、交银定期支付月月丰债券的基金经理,公司固定收益部副总经理	2008-03-31	2014-08-21	15年	李家春先生,香港大学 MBA。历任长江证券有限责任公司投资经理,民族证券有限责任公司高级经理、投资主管,泰信基金管理有限公司高级研究员。2006 年加入交银施罗德基金管理有限公司,2006 年 12 月 27 日至 2011 年 6 月 8 日担任交银施罗德货币市场证券投资基金基金经理,2011 年 9 月 26 日至 2014 年 9 月 20 日担任交银施罗德双利债券证券投资基金基金经理,2013 年 8 月 13 日至 2014 年 8 月 20 日担任交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金基金经理。
林洪钧	本基金、交银货币、交银信用添利债券 (LOF)、交银理财 21 天债券、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	2014-08-04	-	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

本报告期内,经济增长动能总体仍显较疲软的态势。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。从中微观层面观察,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,在报告期内,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%,债券收益率无抵抗地一路下行。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保持了较高的债券仓位,业绩贡献主要来自于组合在报告期内较高的纯债仓位以及三季度权益类可转债的持仓。

展望四季度,受房地产政策放开的影响,经济下滑的压力或将有所缓解,货币政策大概率仍将保持较为稳健的态度,而降低社会融资成本的脚步仍将不断继续。体现在债券市场上,短端仍有较大幅度的下行空间,带动中长端收益也会有一定机会。同时,受到国庆期间《国务院关于加强地方政府性债务管理的意见》出台的影响,城投债尽管仍存在小部分信用风险暴露的问题,但整体存量城投可能会有更好的表现。因此,在 2014 年最后一个季度,债券市场可能仍将继续慢牛行情。值得注意的是,随着收益率进一步下降,债券市场资本利得的空间也随之变小,而若展望明年,利率市场化仍将是值得长期关注的重要事件。总体说来,本基金对四季度债券市场的中短端较为乐观。组合管理方面,保持一定的杠杆,同时降低组合的久期,以期获取短端下行的收益。另一方面,适当提高可转债的持仓,以期待权益类资产的超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2014 年 9 月 30 日,交银增利债券 A/B 份额净值为 1.0791 元,本报告期份额净值增长率为 4.09%,同期业绩比较基准增长率为 1.38%;交银增利债券 C 份额净值为 1.0702 元,本报告期份额净值增长率为 3.97%,同期业绩比较基准增长率为 1.38%。

§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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	1,415,115,887.55	93.69
	其中:债券	1,415,115,887.55	93.69
	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	64,818,021.52	4.29
7	其他资产	30,421,284.48	2.01
8	合计	1,510,355,193.55	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	60,144,000.00	5.80
	其中:政策性金融债	60,144,000.00	5.80
4	企业债券	875,898,393.35	84.50
5	企业短期融资券	50,148,000.00	4.84
6	中期票据	161,387,000.00	15.57
7	可转债	267,538,494.20	25.81
8	其他	-	-
9	合计	1,415,115,887.55	136.51

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	1480265	14象山债	600,000	62,754,000.00	6.05
2	140204	14国开 04	600,000	60,144,000.00	5.80
3	124818	14常德原	600,000	59,982,904.11	5.79
4	113005	平安转债	545,000	59,650,250.00	5.75
5	1280122	12荆州城投债	500,000	52,505,000.00	5.07

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	100,352.50
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	30,169,702.49
5	应收申购款	151,229.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	30,421,284.48

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	59,650,250.00	5.75
2	113003	重工转债	41,052,000.00	3.96
3	110024	隧道转债	37,625,444.80	3.63
4	110015	石化转债	27,257,500.00	2.63
5	110018	国电转债	23,544,000.00	2.27
6	113002	工行转债	21,774,000.00	2.10

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

项目	交银增利债券 A/B	交银增利债券 C
本报告期期初基金份额总额	1,242,022,460.13	361,360,790.91
本报告期基金总申购份额	61,392,597.72	104,812,768.35
减:本报告期基金总赎回份额	610,776,479.75	195,957,830.46
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	692,638,578.10	270,215,728.80

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 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增利债券证券投资基金募集的文件;

2、《交银施罗德增利债券证券投资基金基金合同》;

3、《交银施罗德增利债券证券投资基金招募说明书》;

4、《交银施罗德增利债券证券投资基金托管协议》;

5、关于募集交银施罗德增利债券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增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

基金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基金文件,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。

交银施罗德稳健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	交银稳健配置混合
基金主代码	519690
交易代码	519690 (前端) 519691 (后端)
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年 6 月 14 日
报告期末基金份额总额	2,549,765,883.50 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,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,自下而上精选证券,有效分散风险,谋求实现基金财产的长期稳定增长。
投资策略	把握宏观经济和投资市场的变化趋势,根据经济周期理论动态调整投资组合比例,自上而下配置资产,自下而上精选证券,有效分散风险。
业绩比较基准	65%×MSCI 中国 A 股指数+35%×中信标普全债指数
风险收益特征	本基金是一只混合型基金,属于证券投资基金产品中的中等风险品种,本基金的风险与预期收益处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	66,422,114.04
2.本期利润	340,346,894.31
3.加权平均基金份额本期利润	0.1280
4.期末基金资产净值	2,971,949,901.03
5.期末基金份额净值	1.1656

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	12.44%	0.90%	9.93%	0.58%	2.51%	0.32%

注:本基金业绩比较基准自 2013 年 7 月 1 日起,由“65%×MSCI 中国 A 股指数+35%×新华巴克莱资本中国全债指数”变更为“65%×MSCI 中国 A 股指数+35%×中信标普全债指数”,3.2.2 同。详情见本基金管理人于 2013 年 6 月 26 日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于变更交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金业绩比较基准并修改基金合同相关内容的公告》。

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

交银施罗德稳健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

(2006 年 6 月 14 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		
唐倩	本基金的基金经理,公司权益部副总经理	2013-12-12	-	14年	唐倩女士,CPA,华东师范大学金融学硕士。历任申银万国证券研究所分析师,中银国际有限公司分析师,香港雷曼兄弟证券公司研究员,上投摩根基金管理有限公司研究部总监、基金经理。其中 2011 年 4 月 28 日至 2013 年 7 月 8 日担任上投摩根成长先锋基金经理。2013 年加入交银施罗德基金管理有限公司。

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

三季度以来,市场走出了近年以来较为少见的持续上扬,特别是大小市值的股票普遍上涨。推动市场强势的主要原因主要是无风险收益率的下行。随着类债券的非标产品势头减缓,在前期良好的 A 股走势带动下,以及后续改革红利、沪港通的预期,货币政策的宽松性放松,A 股经济得到持续的可能性较大。

本基金组合的配置相对比较均衡,蓝筹和成长性的个股均有一定配置,仓位也比较高。短期来看,后续市场表现会比较分散,各种主题、概念和板块出现轮动的可能性较大。因此,均衡配置可能是比较好的对策。

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 1.1656 元,本报告期份额净值增长率为 12.44%,同期业绩比较基准增长率为 9.93%。

§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	2,754,164,833.86	92.12
	其中:股票	2,754,164,833.86	92.12
2	固定收益投资	82,945,874.00	2.77
	其中:债券	82,945,874.00	2.77
	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	10,000,135.00	0.33
	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	139,803,934.13	4.68
7	其他资产	2,728,631.90	0.09
8	合计	2,989,643,408.89	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	786,894.28	0.03
B	采矿业	56,794.11	-
C	制造业	1,280,788,843.49	43.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	330,118.89	0.01
E	建筑业	8,956,983.00	0.30
F	批发和零售业	21,355,993.99	0.72
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	6,180,000.00	0.21
I	信息传输、软件和信息技术服务业	575,181,465.58	19.35
J	金融业	167,520,462.08	5.64
K	房地产业	307,317,519.69	10.34
L	租赁和商务服务业	95,993,977.92	3.23
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	31,434,059.25	1.06
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	132,468,107.25	4.46
R	文化、体育和娱乐业	125,793,614.33	4.23
S	综合	-	-
	合计	2,754,164,833.86	92.67

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	600690	青岛海尔	11,248,540	177,726,932.00	5.98
2	600109	国金证券	6,730,328	157,220,462.08	5.29
3	000671	阳 光 城	11,568,597	145,764,322.20	4.90
4	300226	上海钢联	2,660,428	138,794,528.76	4.67
5	600763	通策医疗	2,745,453	132,468,107.25	4.46
6	000768	中航飞机	7,282,025	114,983,174.75	3.87
7	300104	乐视网	2,728,421	102,015,661.19	3.43
8	000550	江铃汽车	3,301,070	96,193,179.80	3.24
9	600138	中青旅	5,832,928	95,893,336.32	3.23
10	601012	隆基股份	4,457,300	92,488,975.00	3.11

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	59,994,000.00	2.02
	其中:政策性金融债	59,994,000.00	2.02
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	22,951,874.00	0.77
8	其他	-	-
9	合计	82,945,874.00	2.79

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	140207	14国开 07	300,000	30,069,000.00	1.01
2	120204	12国开 04	300,000	29,925,000.00	1.01
3	110025	国金转债	185,800	22,951,874.00	0.77

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	754,826.58
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,438,465.71
5	应收申购款	535,339.61
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,728,631.90

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

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	000768	中航飞机	114,983,174.75	3.87	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	2,742,122,099.83
本报告期基金总申购份额	19,330,639.41
减:本报告期基金总赎回份额	211,686,855.74
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,549,765,883.50

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

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	86,161,914.71
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	86,161,914.71
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	3.38

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,并自于 2014 年 10 月 10 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稳健配置混合型证券投资基金募集的文件;

2、《交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金基金合同》;

3、《交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金招募说明书》;

4、《交银施罗德稳健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稳健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稳健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

基金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基金文件,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。

交银施罗德货币市场证券投资基金

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	交银货币	
基金主代码	519588	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2006年 1 月 20 日	
报告期末基金份额总额	7,945,361,384.70 份	
投资目标	本基金属于货币市场基金,投资目标是在力求本金稳妥和资产充分流动性的前提下,追求超过业绩比较基准的投资收益。	
投资策略	本基金在保持组合高度流动性的前提下,结合对国内外宏观经济运行、金融市