交银施罗德国证新能源指数分级证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015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:二〇一五年十月二十七日

§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2015年10月26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2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	交银国证新能源指数分级
场内简称	交银新能
基金主代码	164905
交易代码	164905
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年3月26日
报告期末基金份额总额	698,261,927.25份
投资目标	本基金采用指数化投资,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。本基金力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%。
投资策略	本基金为指数型基金,绝大部分资产采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数,即按照国证新能源指数中的成份股组成及其权重构建股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致成份股流动性不足时,或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。
业绩比较基准	国证新能源指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金是一只股票型基金,其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金,属于承担较高预期风险、预期收益较高的证券投资基金品种。本基金采取了基金份额分级的结构设计,不同的基金份额具有不同的风险收益特征。本基金共有三类份额,其中交银新能源份额具有与标的指数,以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征;交银新能源A份额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征;交银新能源B份额具有高预期风险、高预期收益的特征。
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
下属分级基金的基金简称	交银新能 / 新能源A / 新能源B
下属分级基金的场内简称	交银新能 / 新能源A / 新能源B
下属分级基金的交易代码	164905 / 150217 / 150218
报告期末下属分级基金的份额总额	545,166,867.25份 / 76,547,530.00份 / 76,547,530.00份
下属分级基金的风险收益特征	交银新能源份额具有与标的指数,以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征 / 交银新能源A份额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征 / 交银新能源B份额具有高预期风险、高预期收益的特征

§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(2015年7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-164,987,937.21
2.本期利润	-543,194,031.51
3.加权平均基金份额本期利润	-0.3981
4.期末基金资产净值	742,800,297.84
5.期末基金份额净值	1.064

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

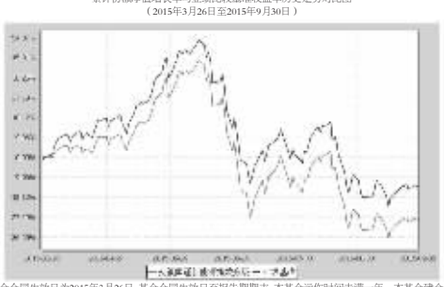
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-33.09%	4.83%	-26.28%	3.92%	-6.81%	0.91%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计份额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

交银施罗德国证新能源指数分级证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2015年3月26日至2015年9月30日)



注:本基金基金合同生效日为2015年3月26日,基金合同生效日至报告期期末,本基金运作时间未满一年。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		
蔡铮	交银环球精选混合(QDII)、交银上证180公司治理ETF及其联接、交银深证300价值ETF及其联接、交银全球资源混合(QDII)、交银国证新能源指数分级、交银中证海外中国互联网指数(QDII-LOF)、交银中证互联网金融指数分级、交银中证环境治理指数分级的基金经理、公司量化投资部副理总经理	2015-03-26	-	6年	蔡铮先生,复旦大学电子工程硕士。历任瑞士银行香港分行分析员。2009年加入交银施罗德基金管理有限公司,历任投资研究部数量分析师、基金经理助理。2012年12月27日至2015年4月30日担任交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金基金经理。

注:基金经理(或基金经理小组)期后变动(如有)敬请关注基金管理人发布的相关公告。

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口(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

2015年第三季度,国内经济增速弱企稳,内需疲软,经济基本面对资本市场的支持力度较为有限。工业增加值和PPI继续回落,经济增长和企业盈利下行压力较大,同时货币政策延续宽松。随着监管层扩大清理配资范围以及人民币贬值影响,市场出现大幅下跌。作为跟踪国证新能源指数的指数基金,在第三季度基金业绩呈现出下跌走势。

展望第四季度,宽松的货币政策环境有望持续,但经过此轮调整,市场风险偏好会急剧下降。总体而言,预计产业创新的发展思路不会改变,负面因素逐渐被市场所消化反应,因此对A股市场保持谨慎乐观的态度。

4.5报告期内基金的业绩表现

截至2015年9月30日,本基金份额净值为1.064元,本报告期份额净值增长率为-33.09%,同期业绩比较基准增长率为-26.28%。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内无需预警说明。

§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	701,830,894.14	92.62
	其中:股票	701,830,894.14	92.62
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	-	-
	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	36,104,919.74	4.76
7	其他各项资产	19,827,833.18	2.62
8	合计	757,763,647.06	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

5.2.2指数投资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	16,846,383.50	2.27
C	制造业	594,877,966.40	80.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	51,618,238.13	6.95
E	建筑业	7,661,754.57	1.03
F	批发和零售业	22,554,109.50	3.04
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	8,272,442.04	1.11
	合计	701,830,894.14	94.48

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股票投资明细

5.3.1报告期末指数投资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	300316	晶盛机电	1,581,000	23,193,270.00	3.12
2	002091	江苏国泰	1,478,958	22,554,109.50	3.04
3	002070	众和股份	1,638,251	18,807,121.48	2.53
4	300207	欣旺达	682,278	17,043,304.44	2.29
5	002594	比亚迪	262,262	15,738,342.62	2.12
6	002353	杰瑞股份	691,428	15,612,444.24	2.10
7	600525	长园集团	986,449	14,796,735.00	1.99
8	002466	天齐锂业	207,581	13,168,938.64	1.77
9	002460	赣锋锂业	518,239	13,049,258.02	1.76
10	300004	南风股份	666,332	12,440,418.44	1.67

5.3.2报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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。

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期货指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有期货指期货。

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南风股份(证券代码:300004)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南风股份(证券代码:300004)于2015年2月13日公告,公司因违反《民用核安全设备监督管理条例》于近日收到国家核安全局《核安全行政处罚决定书》。据此,国家核安全局责令公司停止民用核安全设备设计、制造活动,限期6个月进行整改,并处50万元罚款。

本基金遵循指数化投资理念,绝大部分资产采用完全复制法跟踪指数,以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则,进行被动式指数化投资。本基金对该证券的投资遵守本基金管理人基金投资管理相关制度及被动式指数化投资策略。

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其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,770,361.81
2	应收证券清算款	17,759,810.76
3	应收股利	-
4	应收利息	16,617.79
5	应收申购款	256,344.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	24,698.77
8	其他	-
9	合计	19,827,833.18

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报告期末投资的股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1报告期末指数投资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	300316	晶盛机电	23,193,270.00	3.12	重大事项
2	002091	江苏国泰	22,554,109.50	3.04	重大事项
3	002070	众和股份	18,807,121.48	2.53	重大事项
4	600525	长园集团	14,796,735.00	1.99	重大事项

5.11.5.2报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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	交银新能	新能源A	新能源B
本报告期期初基金份额总额	791,067,773.77	475,997,036.00	475,997,037.00
本报告期基金总申购份额	654,193,428.45	-	-
减:本报告期基金总赎回份额	1,297,192,850.19	-	-
本报告期基金拆分变动份额	397,098,515.22	-399,449,506.00	-399,449,507.00
本报告期期末基金份额总额	545,166,867.25	76,547,530.00	76,547,530.00

注:拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额及基金折算后调整份额。

§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	20,000,800.00
本报告期期间买入/申购总份额	-
本报告期期间卖出/赎回总份额	6,472,616.46
报告期期末管理人持有的本基金份额	13,528,183.54
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	1.94

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	份额拆算调减	2015-09-17	6,472,616.46	-	-
合计			6,472,616.46	-	

§8 影响投资者决策的其他重要信息

根据本基金基金合同中关于不定期份额折算的相关约定,当本基金之交银新能源B份额(场内简称:新能源B,代码:150218)的基金份额参考净值小于或等于0.250元时,本基金将进行不定期份额折算。截至2015年9月15日,本基金交银新能源B份额的基金份额参考净值为0.230元,达到基金合同约定的不定期份额折算条件。根据本基金基金合同以及深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定,本基金管理人以2015年9月16日为不定期份额折算基准日办理了不定期份额折算业务,相关事宜详情请见本基金管理人于2015年9月16日、9月17日、9月18日发布的系列公告。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会准予交银施罗德国证新能源指数分级证券投资基金募集注册的文件;

2、《交银施罗德国证新能源指数分级证券投资基金基金合同》;

3、《交银施罗德国证新能源指数分级证券投资基金招募说明书》;

4、《交银施罗德国证新能源指数分级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、关于申请募集注册交银施罗德国证新能源指数分级证券投资基金的法律意见书;

8、报告期内交银施罗德国证新能源指数分级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

2015 第三季度 报告

2015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:二〇一五年十月二十七日

§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2015年10月26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2015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	20,079,514,371.26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	六个月银行定期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金是具有较低风险、中低收益、流动性强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	中国农业银行股份有限公司
下属两级基金的基金简称	交银货币A / 交银货币B
下属两级基金的交易代码	519588 / 519589
报告期末下属两级基金的份额总额	986,162,632.42份 / 19,093,351,738.84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(2015年7月1日-2015年9月30日)	
	交银货币A	交银货币B
1. 本期已实现收益	5,926,894.43	99,771,659.12
2. 本期利润	5,926,894.43	99,771,659.12
3. 期末基金资产净值	986,162,632.42	19,093,351,738.84

注:1、自2007年6月22日起,本基金实行销售服务费分级收费方式,分设两级基金份额:A级基金份额和B级基金份额。A级基金份额与B级基金份额的管理费、托管费相同,A级基金份额按照0.25%的年费率计提销售服务费,B级基金份额按照0.01%的年费率计提销售服务费。在计算主要财务指标时,A级基金份额与分级前基金连续计算,B级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,由于货币市场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. 交银货币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	0.6333%	0.0019%	0.4290%	0.0003%	0.2043%	0.0016%

注:本基金收益分配按月结转份额。

2. 交银货币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	0.6941%	0.0019%	0.4290%	0.0003%	0.2651%	0.0016%

注:本基金收益分配按月结转份额。

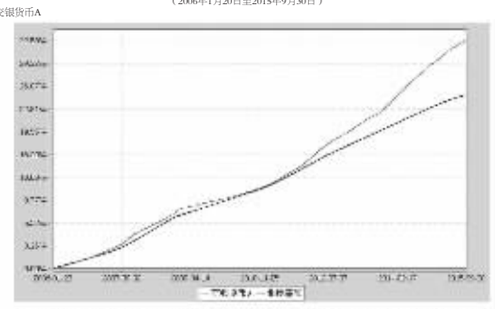
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

交银施罗德货币市场证券投资基金

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

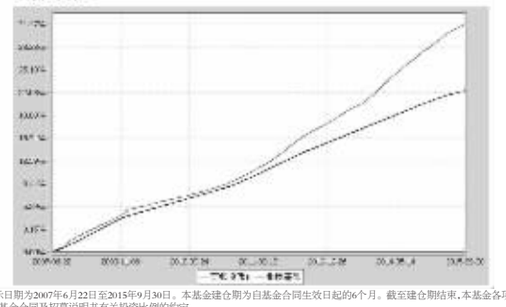
(2006年1月20日至2015年9月30日)

1、 交银货币A



注:图示日期为2007年6月22日至2015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、交银货币B



注:图示日期为2007年6月22日至2015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		
黄莹洁	交银货币、交银理财21天债券、交银现金宝货币、交银丰润收益债券、交银丰泽收益债券的基金经理	2015-05-27	-	7年	黄莹洁女士,香港大学工商管理硕士,北京大学经济学、管理学双学士。历任中海基金管理有限公司交易员。2012年加入交银施罗德基金管理有限公司,历任中央交易室交易员。

注:基金经理(或基金经理小组)期后变动(如有)敬请关注基金管理人发布的相关公告。

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,经济增长低迷,央行继续维持宽松的货币政策,除降准、降息以外,同时使用各类货币政策工具对中短期流动性进行调节,带动货币市场利率继续下行。随着权益市场的大幅调整以及IPO暂停的局面,大量配资、两融、打新资金需要重新配置,从而推动债券市场收益率大幅下行。同时资金回流债市后对高收益信用债的大力配置,将信用利差压缩到历史低位。

基金操作方面,本基金通过合理有效的久期管理,保障了组合充足的流动性;同时保持中性的债券仓位,分享了债券收益率下行带来的估值收益。由于期限利差的收窄,本基金适当降低了组合杠杆,总体投资业绩平稳。

展望四季度,经济基本面依旧疲弱,央行仍将保持宽松货币政策,但需要密切关注政府政策大力刺激下,经济边际改善的可能性,以及风险资产回暖对债市的表现抑制。组合管理方面,本基金将注意跟踪流动性变化趋势并有针对性的作出资金安排,尽力保障流动性充裕和资金安全;同时密切关注经济走势和政策变化,审时度势选择合适的投资品种,努力为持有人创造稳健的收益。

4.5报告期内基金的业绩表现

本报告期内,交银货币A净值收益率为0.6333%,同期业绩比较基准收益率为0.4290%;交银货币B净值收益率为0.6941%,同期业绩比较基准收益率为0.4290%。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内无需预警说明。

§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	6,678,116,976.05	33.19
	其中:债券	6,678,116,976.05	33.19
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,799,591,340.92	8.94
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	52,452,220.21	0.26
3	银行存款和结算备付金合计	11,551,443,596.79	57.41
4	其他资产	93,541,038.95	0.46
5	合计	20,122,692,952.71	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	1.19
	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	- / -
	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

本基金本报告期内债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

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	85
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	94
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	63

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余期限未超过180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	26.68	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	26.74	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	19.76	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	8.17	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	18.40	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		99.75	-

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	1,027,790,340.65	5.12
	其中:政策性金融债	1,027,790,340.65	5.12
4	企业债券	39,916,821.96	0.20
5	企业短期融资券	4,575,413,329.09	22.79
6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,034,996,484.35	5.15
8	其他	-	-
9	合计	6,678,116,976.05	33.26
10	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	111591940	15西安银行CD006	4,500,000	441,935,153.28	2.20
2	150403	15农发03	3,500,000	351,249,365.68	1.75
3	011507003	15闽电SCP003	3,000,000	300,000,079.99	1.49
4	150411	15农发11	2,250,000	225,695,694.33	1.12
5	150211	15国开11	2,000,000	200,672,345.56	1.00
6	011586006	15光明SCP006	2,000,000	199,983,274.39	1.00
7	041555013	15陕延油CP001	2,000,000	199,950,900.89	1.00
8	041562020	15沪世茂CP002	2,000,000	199,943,609.66	1.00
9	011517015	15华电SCP015	2,000,000	199,929,429.91	1.00
10	111519062	15恒丰银行CD062	2,000,000	198,547,901.78	0.99

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	0.1690%
报告期内偏离度的最低值	0.0769%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1171%

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	77,544,032.31
4	应收申购款	15,997,006.64
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	93,541,038.95

5.8.5 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	交银货币A	交银货币B
报告期期初基金份额总额	934,989,538.65	6,461,749,225.62
报告期期间基金总申购份额	1,825,575,523.84	22,712,652,939.79
报告期期间基金总赎回份额	1,774,402,430.07	10,081,050,426.57
报告期期末基金份额总额	986,162,632.42	19,093,351,738.84

注:1、如果本报告期间发生转换入、份额级别调整、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、份额级别调整业务,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

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	红利再投	2015-09-30	438,692.03	438,692.03	-
合计			438,692.03	438,692.03	

注:1、本基金管理人本报告期末持有本基金份额60,443,996.05份,占本基金期末总份额的0.30%;

2、本基金收益分配按月结转份额。

§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货币市场证券投资基金募集的文件;

2、《交银施罗德货币市场证券投资基金基金合同》;

3、《交银施罗德货币市场证券投资基金招募说明书》;

4、《交银施罗德货币市场证券投资基金托管协议》;

5、关于募集交银施罗德货币市场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货币市场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