交银施罗德全球自然资源证券投资基金

2015 第三季度 报告 明及善需养任。 基金任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日夏核了本报告中的财务指标,净值表现和投资组 括等内容。保证复核内容不存在偿据记载,误号矩阵逐或资重大造器。 基金管组人表证说法年间,最给更有的原则管理是由于基金管产。但不保证基金一位资利。 基金管组人表证说法年间,最终是有的原则管理是由其基金管产。但不保证基金一位资利。 基金的过程业储本不代表其来来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应任细阅读本基金的招募设明书。 士组申出财金公司中总部出计。

北例的约定。	\$4 管理人报告							
4.1 歩金	4.1 基金经理(或基金经理小组)简介							
姓名 职务		任本基金的記	L 企经理期限	证券从业年限	说明			
X2.75	U	嵩任日期						

		住駅日期	嵩任日期			
蔡铮	空银环球精 经股份公司 经股份	2015-04-22	-	6%	士银行施罗德 部数量 月27 罗德》	化生,复旦大学电子工程硕士。历任电容部准分行分析员。2009年加入交银 高基金管理等很公司。历任度设计实 日本2015年6月30日在1025年 日本2015年6月30日在1025年 展现 300 行业分层等权重指数证券扩 基金处理。
	投资顺问为本	至理小组)期后变动(如4 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	ŧ	说明
Simon Webber		投资主管、全球和	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			Simon Webber 先生,英国曼彻斯特 大学物理学学士,CFA。1999 年加 人施罗德投资管理有限公司,历任 全球技术团队分析员。

4.4 公平交易中期回明 4.4 公平交易制度的执行情况 本心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 全构物定客户保产管理中分制度。经验调制组度和公平交易 公司建立贸易共享的投资研究位置平台。确保多投资组合在程程投资信息、投资建议和主施投资决策为需要各处平价。积极, 公司在支 持持行军可工作事中交易制度。建立公平积交易与的超度。对于交易所分于竞价交易、通偿一价的在关 持行军可工作事中交易制度。建立公平积交易与的超度。对于公司不交进行的场外交易、通偿一价格优先、比例分配"的原则按事前独立确定的投 劳力案对交易转来进行分配。对于非常中变价交易,以公司名义进行的场外交易,通偿一价格优先、比例分配"的原则按事前独立确定的投 分字案对交易转来进行分配。对于非常中变价交易,以公司名义进行的场外交易,通偿一价格优先、比例分配"的原则按事的独立确定的投 为实验对交易转来进行分配。对于非常和企业分分投资。 公司中央交易宣和的管理规划行日本投资交易行为企业,从公司省及不同时间回口间内交易的交易分差, 报告期内公司一带按约不少互易制度、公平对待版下各投资组合。未发现任何进及公平支易的介为。 4.4.2 异常交易行为的专用论则

\$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滤假记载 误导性陈述或者重法遗嘱 容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。 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。 卡申收本物技术终审计 本报告期自 2015 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

基金简称	交银理财 60 天债券					
基金主代码	519721	519721				
基金运作方式	契约型开放式	契约型开放式				
基金合同生效日	2013年3月13日					
报告期末基金份額总額	64,484,801.46 {}					
投资目标	本基金在追求本金安全、保持资产资 资产的稳定增值。	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	局、货币市场收益率曲线形态等各方	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,采取主动性的投资领略和销售化的操作手法。				
业绩比较基准	人民币七天通知存款税后利率	人民币七天通知存款税后利率				
风险收益特征		本基金属于短期理财债券型证券投资基金,长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金及普通债券型基金,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	中国建设银行股份有限公司					
下属两级基金的基金简称	交银理财 60 天债券 A	交银理财 60 天债券 B				
下属两级基金的交易代码	519721	519722				
报告期末下属两级基金的份额总额	13,765,827.42 (7)	50,718,974.04 (/)				
3.1 主要财务指标	§3 主要财务指标和基金净值	查表现 单位:人民币				
主要财务指标	报告期	报告期(2015年7月1日-2015年9月30日)				
土架附分目标	☆伽珊県 60 工	か付加盟 CO 工作者 A か付加盟 CO 工作者 B				

主要财务指标	报告期(2015年7月1日-2015年9月30日)				
主要则分担外	交银理财 60 天债券 A	交银理财 60 天債券 B			
1.本期已实现收益	82,853.53	310,663.			
2.本期利润	82,853.53	310,663.			
3.期末基金资产净值	13,765,827.42	50,718,974			
注:1、自合同生效日起,本基金实行销售服务费分类 类基金份额的管理费、托管费相同,A类基金份额按照 0 费。	30%的年费率计提销售服务费,B类基金(分额按照 0.01%的年费率计提销售服务			
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、 见收益加上本期公允价值变动收益,由于本基金采用推升					

	值表現 告期基金份額净值收益。 60 天债券 A:	F及其与同期业绩比	较基准收益率的比	校					
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	0.5409%	0.0033%	0.3403%	0.0000%	0.2006%	0.0033%			
2、本基金句	注:1.本表净值收益半数据所取的基金运作周期为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,并在运作期期未集中支付。 2.交级提供的 CF 機亦 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	0.6142%	0.0033%	0.3403%	0.0000%	0.2739%	0.0033%			

22—17 20000000 21.1未來學復改選申閱辦所說的最高級作用期別方施於申申提供力力認付日的近年期別 2.4本進金的日計學。15.2年 3.22日進金的司生或以未進金的報酬;學報度並奉史改及其与期期受難快起基礎故事要动的比較 交組辦學問題財務。25.2年 6.2年 6.24

序号		項目		金	順(人民币元)	占基金总资产的比例 (%)	
1	权益投资				23,041,816.94	70.41	
	其中:普通股				23,041,816.94	70.41	
	存托凭证				-	-	
	优先股				-	-	
	房地产信托				-	-	
2	基金投资				-	-	
3	固定收益投资				-	-	
	共中:债券				-	-	
	资产支持证券				-	-	
4	金融衍生品投资				-		
	共中:远期			-			
	期货	Bi -				-	
	期权	Z -				-	
	权证			-			
5	买人返售金融资产			-			
	其中:买断式回购的买	(人返售金融资)	pts	-			
6	货币市场工具			-			
7	银行存款和结算备付	金合计		9,641,770.11			
8	其他资产			40,291.21			
9	合计				32,723,878.26	100.00	
5.2 报台		.)证券市场的原	股票及存托凭证投资分布	-			
国家(地区) 公允价值(人民币					占基金资产净(
計准				23,041,816.94		70.8	
2 ADR	[家(地区)类别根据其所 GDR按照存托凭证本! 告期未按行业分类的股!	9挂牌的证券3	5所确定; 交易所确定。	23,041,816.94		70.87	
	行业类别		公允价值(人民币元)		占基金资产净值比例(%)		
共事业			7,277,930.36			22.39	
非必需消费品			-	4.794.402.47			

工业		3,721,709.89			3,721,709.89			
材料					2,872,663.56			8.84
金融					1,747,742.74			5.38
能源					1,655,550.65	0.65		
必需消费品					918,752.64			2.83
信息技术					53,064.63			0.16
合计					23,041,816.94			70.87
注:以上分类系	(用全球行业分割 安公允价值占基)	を标准(GICS)。 金密产净值比(別大小排序的	n前十名股:	票及存托凭证书	- 咨明细		
序号	公司名称(英 文)	公司名称(中 文)	证券代码	所在证券 市场	所属田家 (地区)	数量 (股)	公允价值(人 民币元)	占基金资产净值 比例(%)
1	Luk Fook Holdings (International) Limited	六福集团(国际)有限公司	590 HK	香港证券 交易所	香港	97,000	1,542,986.34	4.75
2	China Power International Development Limited	中国电力国际发展有限公司	2380 HK	香港证券 交易所	香港	320,000	1,323,783.88	4.07
3	China High Speed Transmission Equipment Group Co., Ltd.	中国高速传动设备集团有限公司		香港证券交易所	香港	214,000	1,320,894.67	4.06
4	Hong Kong Exchanges And Clearing Limited	香港交易及结 算所有限公司	388 HK	香港证券 交易所	香港	8,100	1,175,449.17	3.62
5	Xinyi Glass Holdings Ltd.	信义玻璃控股 有限公司	868 HK	香港证券 交易所	香港	402,000	1,141,665.10	3.51
6	Chow Sang Sang Holdings International Limited	周生生集团国际有限公司	116 HK	香港证券 交易所	香港	76,000	966,900.68	2.97
7	China Resources Power Holdings Company Limited	华润电力控股 有限公司	836 HK	香港证券交易所	香港	56,000	812,656.22	2.50
8	Zhuzhou Csr Times Electric Co., Ltd	株洲南车时代 电气股份有限 公司		香港证券 交易所	香港	16,500	772,638.18	2.38
9	Huaneng Power International, Inc.	华能国际电力 股份有限公司	902 HK	香港证券 交易所	香港	108,000	738,423.20	2.27
10	Huadian Power International	华电国际电力	1071 HV	否港证券	95.20	126 000	672 120 47	2.07

回券。 5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 8产支持证券。 5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 有金融衍生品。 直占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 对基金 元170。 们十名股票中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票

11.15	石砂	型器(人民用元)
1	存出保证金	=
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	37,449.69
4	应收利息	1,754.57
5	应收申购款	1,086.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	40,291.21
本基金本持 5.10.5 报行 本基金本持 5.10.6 投行	告期末持有的处于转股期的可转换债券明细 供告期末未持有处于转股期的可转换债券。 告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明 报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况 竞组合报告附注的其他文字描述部分 五人的原因,分项之和与合计项之间可能存在身	

由于四舍五人的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。 86 开放式基金	A 俗類 亦 zh
80 /100.2003	单位:(
B 告期期初基金份額总额	79,777,348.28
B 告期期间基金总申购份额	3,239,717.89
t:报告期期间基金总赎回份额	54,579,141.99
B告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
B告期期末基金份額总额	28,437,924.18
注:1、如果本报告期间发生转换人、红利再投业务,则总申购份额中付 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	•

限方式 香布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.fumd001.com,www.bocomschroder. 在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得上还文件的复制件或复印件。 查对本报告专加有疑问,可含加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 1055000,电子带手:**erises@jskdter.

交银施罗德趋势优先混合型证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015年9月30日

基金托管人:中国工商银行股份有限; 报告送出日期:二〇一五年十月二十一	5日	81 重要提示			
角性和完整性承担个别及连带责任。	司根据: 內容不存 們的原则 。投资有	资料不存在虚假记载,误导性陈 本基金合同规定,于 2015 年 10 4 在虚假记载,误导性陈述或者重 6 管理和运用基金资产,但不保证 7 风险,投资者在作出投资决策前	基金一定盈利。		
7,000,000,000	. 50 1	§2 基金产品概况			
基金简称	交银趋势)混合			
基金主代码	519702				
交易代码	519702(前端)	519703(后端)		
基金运作方式	契约型开放式				
基金合同生效日	2010年1	2月22日			
报告期末基金份額总額	199,476	,968.38 份			
投资目标	本基金力图通过把握中国人口变化的重大趋势,精造受益其中的优势行业和个股,在控制风险 并保持基金资产良好的流动性的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。				
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。在分析和判断未来人口趋势的重大转变对团民消费倾向。团家收入分配政策、产业升级和区域设施方向等战略污染的重要等地以及其中所蕴涵的行业投资机会的基础上,挖烟受益其中的优势行业,推着全限。以谋求超额收益。				
业绩比较基准	75%x沪i	军300 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 金。属于	一只混合型基金,其风险和預期收益/ 承担较高风险、预期收益较高的证券投	6于债券型基金和货币市场基金,低于股票型基 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	中国工商银行股份有限公司				
3.1 主要财务指标	§3 ±	三要财务指标和基金净值表现	单位:人民币元		
主要财务指标			报告期 1日-2015年9月30日)		

基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司

	1 11.7 (1941)
主要财务指标	报告期 (2015年7月1日-2015年9月30日)
本期已实现收益	-32,103,503.89
本期利润	-62,292,790.17
加权平均基金份額本期利润	-0.2998
期末基金资产净值	252,175,355.74
期末基金份额净值	1.264
	.交易基金的各项费用,计人费用后的实际收益水平要低于所列数字; F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 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

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。

姓名 职务	任本基金的記	& 金经理期限	证券从业年限	逆明	
XII-63	84.95	任职日期	1期 富任日期 证券从业年限		15093
曹文俊	交银精选混 合、交银趋 势混合的基 金经理	2013-08-08	-	10年	曹文俊先生,硕士学位。历任申银万国证券研究所有限公司助理分析师,申万巴聚基金管理有限公司、现申万定信基金管理有限公司,可完全信基金管理有限公司,研究员。2010年加入交银施罗德基金管理有限公司,历任行业分析师、基金经理助理。
		金经理小组)期后变动		全管理人发布的相关	长公告。

注,基金经理(成基金经理外组)即后蒙动(如有)验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管作道理守信情况的说明
在用帮助用,基金管理人产的整理人产的整理人发布的相关公告。
4.2 管理人对报告期内本基金管作道理守信情况的说明
在用帮助用,基金管理人产的整理人产的整理人产的基础一个非常是有人。
基金包肉和其他相关法律法规的规定,并
本着诚实信用。勤起尽贵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
谋求被人利益。
4.3 公平交易专项说明
4.31 公平交易电视设制的股份控制制度和公平交易监控制度来保证放下基金运作的公平,放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下格遵循制度进行公平交易。
公司在交易共存方式产生行争中之等格遵理的度,建立公平的交易分配制度,对于交易所公开变价少多,通衡时间优先,价格优先、比例分配"的原则,全部通过交易系统进行任例分配。对于非事年完成为是,以公司名义进行的场外交易,通衡一价格优先、比例分配"的原则,全部通过交易系统进行比例分配。对于非事年完成为是,以公司名义进行的场外交易,通衡一价依优先、比例分配"的原则按非确验立确定的投资方案对交易结果进行产税。
公司由交易查和风险管理超进行日保险投资是对分重定。风险管理部负责效多账户公平交易进行部后分析,严重季度和每年报分别对公司管理的不同投资组合的废依收益率差异,分投资条则的收益单差异以及不同时间窗口间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的数率是对人不要人制度的有关。
4.3 等常交易行力的专项原则
《4.3 等常交易行力的专项原则
《4.4 报告期内基金的投资报价产分为。
4.3 等常交易行为的专项原则。公司专业的交易派公司产业的发展的交易被分有通过企业分别,这分是有通过企业分别,是可以各种公人可用的交易或分有超过企业分别。
《4.4 报告期内基金的投资策略和运产行价。
1.4 报告期内基金的投资策略和定任的关于组合人对,由对外市场的企业企业分量,由发展的条件,可以是对价值和失。
第2 使用用的一种下联系的、使用等不成,或用用度多与投资,有利于加速或性更加全角度表现的原则,一方面,从绝对估值水平来看,部分优别或长股份价值已经是每一定吸引力,选股方的企业至重生或物的现在已经是每一定吸引力,选股方的未经还有一个方面,从绝对估值水平来看,部分优别或系统经在产税选业服务险分的产品,是股份的企业是一个方面,从绝对估值水平来看,部分优别或系统及合于税选的服务险分,约定的成是使,一定更引力,选股对的成是股,一定更引力,选股对的自业的企业的,选股的加速,选股的价值已经是每一定则引力。是股市的成法股份,每一定更为的原则的重要的重要。

5.1 报告期末基金资产组合情况

119	90.11	22. TH (/ L)	L1 186 32 (20 DC) H2 FG D3 (76)
1	权益投资	207,157,929.99	81.68
	其中:股票	207,157,929.99	81.68
2	固定收益投资	10,003,000.00	3.94
	其中:债券	10,003,000.00	3.94
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	=	=
5	买人返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买人返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	35,500,055.53	14.00
7	其他资产	968,658.79	0.38
8	合计	253,629,644.31	100.00

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	1736.500			LOUDI III (70)		-
В	采矿业					_	_
С	制造业			138,607,460.66			54.96
D	电力、热力、燃气及水	牛产和供应业			2,906,468.7	_	1.15
E	確告ル				20,584,702.2	_	8.16
F	批发和零售业				6,178,450.6	_	2.45
G	交通运输、仓储和邮票	fr ille			0,178,400.0	-	2343
Н	住宿和餐饮业	A.M.				-	_
1	信息传输、软件和信息	1 技术服务业			12,553,502.4		4.98
J	全路业	X1X/15/00/30 3E			12,000,0020	-	-
K	海搬产业					_	_
L	租赁和商务服务业					-	_
M	科学研究和技术服务	N/v					_
N	水利、环境和公共设施				5,351,108.0		2.12
0	居民服务、修理和其代				313311100.0	_	
P	教育	E0K 29 3E				_	
0	卫生和社会工作				20,976,237.3	5	8.32
R	文化、体育和娱乐业				2013701237.3	_	-
S	综合					_	_
	合计				207, 157, 929.9	0	82.15
5.3 报告	期末按公允价值占	基金资产净值比例大小	非序的	的十名股票	投资明细	ـــــــــــــــــــــــــــــــــــ	02.13
序号	股票代码	股票名称		数量(股)	公允价值(元)	占基金	验资产净值比例(%)
1	000902	新洋丰		803,700	17,882,325.0	0	7.09
2	002415	海康威视		450,162	14,666,277.9	5	5.82
3	002020	京新药业		529,258	14,025,337.0)	5.56
4	600763	通策医疗		179,971	13,272,861.2	5	5.26
5	002475	立讯精密	400,172		11,833,086.0	4	4.69
6	300262	巴安水务		799,117	10,907,947.0	5	4.33
7	002717	岭南园林		644,258	9,676,755.1	5	3.84
8	600276	恒瑞医药		200,000	9,238,000.0	0	3.66
9	002169	智光电气		499,950	8,864,113.5)	3.52
10	600074	保干里		699,930	8,504,149.50)	3.37
		·类的债券投资组合					
序号		债券品种		2	·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				10,003,000.00		3.97
	其中:政策性金融债				10,003,000.00		3.97
4	企业债券				-		-
5	企业短期融资券				-		
6	中期票据				-		-
7	可转债				-	—	-
8	同业存单				-	—	-
9	其他				-		
10	台计	# A 36 - 4: 14: 16: 11: 16: 1.	HF size As	h abr エカ (株)体	10,003,000.00	L	3.97
		i基金资产净值比例大小:	FIF /IP H	引削五石顶牙	1文页明期		占基金资产净值比
序号	债券代码	债券名称		数量(张) 公允价			例(%)
1	150416	15次发 16		100,000 10,003,000.00			3.97
本基金告本基金本 5.7 基级金基级金数 5.8 基级金数金数 5.10 基级金数 5.11 数 5.11	报告期末未持有追求未持有追求来未持有追求 期末告期公未未价持有追求 期末的期末来免价持有追求 期末本期末去,我持有资料,报告本基未未投持有资料。 一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个	基金资产净值比例大小: 景金属。 基金资产净值比例大小: 又证。 股上期货交易情况说明 设指期货交易情况说明 设指期货交易情况说明 设据期货交易情况说明 最低期货	排序的排序的	的前五名贵金 的前五名权证	属投资明细 投资明细		
证券的发 5.11.2 本	行主体未受到公开				案调查,在本报告编制日 厚库之外的股票。	則一牛	四平盘亚投货的肌
	1035 / 179HA	夕 欲			金額(元)		

股票代码

7.1 集立日注八四日平重立四	HR 32 40 IR 06	单位
报告期期初管理人持有的本基金份額		20,001,800.0
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額		20,001,800.00
报告期期末持有的本基金份额占基金	总份额比例(%)	10.0
	换入、红利再投业务,则总申购份额中包 引业务,则总赎回份额中包含该业务。	含该业务。

9) 备查文件目录
1,中国证监会核准交银施罗德趋势优先股票证券投资基金票集的文件;
2,(交银施罗施趋势优先混合型证券投资基金基金合同);
3,(交银施罗施趋势优先混合型证券投资基金基金合同);
4,(交银施罗施趋势优先混合型证券投资基金指常设明节);
4,(交银施罗施趋势优先混合型证券投资基金指常设明节);
4,(交银施罗施趋势优先混合型证券投资基金注价增加支);
6,(克克尼克人业务资格批件;营业执照;
8,报告期内交银施罗德施罗德劫传优聚率。

9.2 存成现积 各查文件存款于基金管理人的办公场所。
9.3 查阅方法,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问站(www.fund001.com, www.bocomschroder.com)查阅。在文付工本费后,投资者可在分理时间内取得上这文件的复制件或复印件,投资者对本报告中如有提问。可各省本基金管理人发报等增基金管理有限公司。本公司客户服务中心电话,400-700-5000(免长途活费),021-61055000,电子邮件;services@jysld.com。

交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金

2015 第三季度 报告

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2015年9月30日

	1	固定收益投资	38,035,218.72	54.63
	序号	项目	金額(元)	占基金总资产的比例(%)
	5.1 报告期	末基金资产组合情况		
		§5	投资组合报告	
		内基金持有人数或基金资产净值预警说明 告期内无需预警说明。		
0.0		續比较基准收益率为 0.3403%。		
		, 交银理财 60 天债券 A 净值收益率为 0.5409%	, 同期业绩比较基准收益率为 0.3403%; 交银	理財 60 天债券 B 净值收益率
		内基金的业绩表现		
遊	金紧张的时点	配置高收益的现券资产和存款资产。		
也	值得密切关注	。我们也将密切关注中央经济工作会议所传达的	新信号。本基金保持对低等级信用债的警惕,四	季度将保持灵活仓位,力求在
		仍在。整个经济面临困境时,动员地方政府重新;		
		际改善对债市预期的变化以及投资者风险偏好		
		行,有望维持比较宽松的货币政策,年内再次降		
		债券绝对收益率下降会倒逼银行理财的收益率		
		为也趋于稳定,这都有利于中长期利率下行。信用		
66		8百姓的母员亚比自由不依然独然,成亲市场是 8置换已过大半,再加上利率债等也已经度过三:		
		(尼亚) 指权任二字及上献 1.3%。平益並均衡配 1 银行理财等资金配置需求依然强烈,股票市场处:		表杂或仍然且有妙真的配置价
71		(总值)指数在三季度上涨 1.3%。本基金均衡配置		
		一度对人民币贬值预期加强,并引发了全球资产本管制,目前汇率已经基本稳定,经济基本面依		行加大外礼市助的官制力度,
76		度债券市场走势呈震荡上行走势,6月份股灾之		
		Control of the Contro	and the sale of the control of the sale of	for min side on 10 feb also that also mile from the

边交易最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)同向交易的参考中期更多

						J.1 1K 🗆 9	1 /N- THE SEC (PE) SHE CO INI DE														
						序号	项目	金額(元)	占基金总资产的比例(%)												
	建仓期为自基金合同生效	日起的2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	1	固定收益投资	38,035,218.72	54.6												
的约定。		e	4 管理人报告				其中:债券	38,035,218.72	54.6												
4.1 基金经	里(或基金经理小组)简介	8	# BEARD				资产支持证券	-													
		任本基金的	基金经理期限			2	买人返售金融资产	-													
姓名	职务	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明		其中:买断式回购的买人返售金融资产	-													
					赵凌琦女士,10年金融投资经验,财政	3	银行存款和结算备付金合计	31,292,169.79	44.5												
					部財政科研所经济学硕士。历任中国 航空集团财务公司投资经理,中国人 寿资产管理有限公司投资经理。2013	4	其他资产	298,178.26	i 0.												
						5	合计	69,625,566.77	7 100.												
					年加入交银施罗德基金管理有限公司。2013年9月3日至2015年8月	5.2 报告期	l债券回购融资情况	-													
					15 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,	15 日担任交银施罗德定期支付月月	序号	项目	占基金资产净值比例(%)											
	交银增利债券、交银信用								2014年1月28日至2015年8月15	2014年1月28日至2015年8月15	2014年1月28日至2015年8月15	2014年1月28日至2015年8月15	2014年1月28日至2015年8月15 报告期内债券回购融	报告期内债券回购融资余额		9.					
	添利债券(LOF)、交银理 财 60 天债券、交银双轮				日担任交银施罗德强化回报债券型证券投资基金基金经理,2014年3月31	1	其中:买断式回购融资														
赵凌琦	动债券、交银定期支付月 月丰债券、交银强化回报	2014-03-31	2015-08-15	2年	日至2015年8月15日担任交银施罗	日至 2015 年 8 月 15 日担任交银施罗 復理財 60 天债券型证券投资基金基	序号	项目	金額(元)	占基金资产净值的比例(%)											
	债券,交银丰盈收益债券					会经理。2014年3月31日至2015年		报告期末债券回购融资余额	4,899,872.65	7.											
	的基金经理,公司固定收 恭部副总经理											Į.						8月28日担任交银施罗德双轮动债券型证券投资基金基金经理,2014年8	2	其中:买断式回购融资	_
					月11日至2015年8月28日担任交银施罗德丰盈收益债券型证券投资基金基金处理。2015年5月9日至2015年8月28日担任交银施罗德信用添到债券证券投资基金化户法金经理。2015年5月9日至2015年8月28日担任交银施罗德增利债券证券投资基金基金经理。	债券正回则 本基金合同 生超标情况。 5.3 基金担	的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明 同约定:"本基金进入全国银行间同业市场进行(资组合平均剩余期限 组合平均剩余期限基本情况	报告期内每个银行间市场交易日邀资余额占资产 费券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 4													
	交银增利债券、交银纯债						项目	天数													
	债券发起、交银理财 60 天债券、交银双轮动债				孙韶先生, 美国哥伦比亚大学经济学		E组合平均剩余期限		11												
孙超	券、交银定期支付月月丰 债券, 交银强化回报债	2011 00 25		4年	硕士。历任中信建投证券股份有限公		8组合平均剩余期限最高值		14												
577.800	券、交银丰润收益债券、	2014-08-26	-	47	司资产管理部经理、高级经理。2013年加入交银施罗德基金管理有限公		8组合平均剩余期限最低值														
	交银丰享收益债券、交银 丰泽收益债券的基金经 理				司,历任基金经理助理。	本基金本技	投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明 设告期内投资组合平均剩余期限未超过 180 天。														

	交银丰享收益债券、交银 丰泽收益债券的基金经 理				可,历任基金经理助理。	本基金本	接資组合平均剩余期限超过180天情况说明 接告期内投资组合平均剩余期限未超过180天。 告期末投资组合平均剩余期限分布比例		
4.	:基金经理(或基金经理小组)期后 2 报告期内本基金运作遵规守信信	记说明				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b (%)
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。						1 1983	30天以内	48.53	
	43 公平交易专项回归 4.33 公平交易制度的执行特况 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推下基金运作的公平,推下所管理的所有资产组合,但括证券投资基金和转让安中债产需要专户抽产帐户编制制度有公平交易。						其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	=	
						2	30天(含)-60天	7.75	
						2 711	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	=	
	(可定名): 與「自建マ): 如 性原則的原因自公下之前。 公司建立资源共享的投资研究信息平仓,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						60天(含)-90天	15.50	
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							其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	
	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。						90天(含)-180天	=	
	初30年以上7月6。 公司中央交易查和风险管理都进行日常投资交易行为监控。风险管理都负责对各联户公平交易进行事后分析。于每季度和每年度分别对公司需要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间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。 报告期内本公司严险执行公平交易制度。公平对持旗下各投资组合。未发现任何进反公平交易的行为。					l)对	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	
						1信 5	180天(含)-397天(含)	35.73	
							其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	=	
	3.2 异常交易行为的专项说明	MBC, ZI I AJIN BA I TIK	DOMEST AND SECURIOR	AA I AMINI	3730		合计	107.51	
4	基金于本报告期内不存在异常交易	易行为。本报告期内,本公	公司管理的所有投资组	合参与的交易用	听公开竞价同日反向交易成交较少的	5.4 报告	期末按债券品种分类的债券投资组合		

序号	债金	多品种	推余	成本(元)	占据	金资产净值比例(%)	
1	国家债券			-		=	
2	央行票据			-		-	
3	金融债券			13,041,764.61		20.22	
	其中:政策性金融债			13,041,764.61	20.22		
4	企业债券			-		-	
5	企业短期融资券			24,993,454.11		38.76	
6	中期票据			-		-	
7	同业存单			-		-	
8	其他			-		-	
9	合计			38,035,218.72	3.72 5		
10	剩余存续期超过 397 天	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券					
5.5 报告	胡末按摊余成本占基金	资产净值比例大小排序的					
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	150211	15国开 11	100,000	10,031,	505.89	15.56	
2	011590008	15苏交通 SCP008	50,000	4,999,	830.83	7.75	
3	071533006	15年融证券 CP006	50,000	4,999,	069.07	7.75	
4	071517003	15东北证券 CP003	50,000	4,999,	020.17	7.75	
5	041553073	15深茂业 CP003	50,000	4,997,	776.53	7.75	
6	041567005	15烟打捞 CP002	50,000	4,997,	757.51	7.75	
7	150411	15次发 11	30,000	3,010,	258.72	4.67	
		确定的基金资产净值的偏	遊				
	定价"与"摊余成本法"	HISAL HOME ALLOW 1 - 2 INCHOUNT	, m				
5.6 "影子		项目			偏离情?	R	
5.6 "影子	定价"与"摊余成本法" 离度的绝对值在 0.25(含	项目	ien.		伯高情?	_	
5.6 "影子报告期内偏		项目			偏离情?	0次	
5.6 "影子 报告期内偏 报告期内偏	离度的绝对值在 0.25(含	项目			偏离情	见 0次 0.0475% -0.0507%	

3.8 以发化证证权时化 5.8.I 基金计约方法规则 本基金采用增余成本法计价。即计价对象以买人成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买人时的滥价与折价,在其剩余期限内按照 药制率和缔金余款定用转销计量相益。 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掩余成本均未超过当日基金资产净值的 AUTE:
58.3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 主体未受得公开遗费和处罚。

序号	名称	金額(元)
1	存出保证金	
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	288,178.26
4	应收申购款	10,000.00
5	其他应收款	-
6	待推费用	=
7	其他	-
8	合计	298,178.26

由于四舍五人的原因,分项之和与合计项之间可能?	写在尾差。 \$6 开放式基金份额变动	
	90 月放八點並別報支切	单位:
項目	交银理财 60 天债券 A	交银理财 60 天债券 B
报告期期初基金份额总额	16,702,018.25	50,503,318.96
报告期期间基金总申购份额	383,748.53	226,255.08
报告期期间基金总赎回份额	3,319,939.36	10,600.00
报告期期末基金份额总额	13,765,827.42	50,718,974.04
注:1、如果本报告期间发生转换人、份额类别调整、约 2、如果本报告期间发生转换出业务,则总赎回份额。		

报告期期间基金总申购份额	383,748.53	226,255.08
报告期期间基金总赎回份额	3,319,939.36	10,600.00
报告期期末基金份额总额	13,765,827.42	50,718,974.04
注:1、如果本报告期间发生转换人、份额类别调整、红和 2、如果本报告期间发生转换出业务,则总赎回份额中代 87 其余等再		•
本基金管理人本报告期內未进行本基金的申购、赎回、 额的 0.00%。		持有本基金份额 0.00 份,占本基金期末总统
	88 条查文件目录	

81 备查文件目录 1.中国证金社推交银施罗德理财60天债券型还券投资基金条集的文件; 2.(交银施罗德理财60天债券型还券投资基金金合用); 3.(交银施罗德理财60天债券型还券投资基金招募设明号); 4.(交银施罗德理财60天债券型还券投资基金招募设明号); 5.关于募集交银施罗德理财60天债券型运券投资基金记益律室见书; 6.基金管限上金券收据任,查收款同。

。基本证据人至分核他批片,是业风赋; 混合前则之资籍等港推销,客业规则; 混合前则之资籍等港推销的公共债务型证券投资基金在指定银刊上各项公告的原稿。 2 在收集点 2 在收集点 3 强度引火的工品金管理人的办公场所。 3 强度引火。

备查文件存货干基金管理人房办公助所。 8.3 旅时大步时间内紧重金管理人的办公局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) 查明。在专订工业费的,现货者可允合是时间内设路上述文件的复始件或复印件。 投资者对本层也等的或有疑问,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:service-@jyskl.com。

注,本基金建仓期为日基金合同生效日起的 2 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亚。 2、受期限财 60 天债券目