

基金管理人：交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人：中信银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一四年十月二十四日

§ 1 重要提示
本基金的基金管理人和基金托管人承诺不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对本基金的真实性和准确性负责。
本基金托管人自基金合同生效之日起，持续监督基金管理人的投资运作，如果基金管理人违反了基金合同，基金托管人有责任及时提醒基金管理人并报告中国证监会。
基金管理人和基金托管人保证本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对本基金的财务指标、净值表现、收益分配情况等信息的真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据《基金合同》约定的原则管理运用基金资产的，基金管理人和基金托管人不保证基金一定盈利。
基金管理人和基金托管人承诺以诚实信用、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。
本基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资人应当认真阅读基金招募说明书、基金合同等信息披露文件，自主判断投资价值。

本基金合同于2014年3月1日起至2014年3月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金
基金代码	19729
交易代码	19729
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年10月25日
报告期末基金份额总额	243,504,998.55份
投资目标	本基金在追求在本期到期时基金本金的基础上，通过稳健资产与风险资产的动态配置和有效的组合管理，力求实现基金资产的稳定增长。
投资策略	本基金采用恒定比例保险策略(CPPI, Constant Proportion Portfolio Insurance)策略，即在资产配置中，将风险资产在基金总资产中的投资比例，根据投资者的风险承受能力，在不同市场环境下进行调整，从而在保证本金安全的前提下，获得超越基准的增值收益。
业绩比较基准	三年定期定存基准收益率+1%的年化收益率
风险收益特征	本基金是一只保本混合基金，在本基金投资组合中属于低风险品种。
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
基金代理人	中国建设银行股份有限公司
基金承销人	无
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	

3.1 主要财务指标

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	4,665,695.76
2.本期利润	8,522,855.15
3.加权平均基金份额本期利润	0.0344
4.期末基金份额净值	257,610,853.29
5.期末基金资产净值	1,058

注：1. 上述基金业业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后的实际收益水平要低于不计费用的数字；
2. 本期利润为截至报告期末按摊余成本计算的每份额可供分配的利润金额；不包含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润的具体构成项目见“利润构成表”；
3. 基金净值的表现形式为本报告期末资产净值除以本报告期初资产净值；
4. 期末基金资产净值=基金资产总值-应付赎回金额-其他负债。

3.2 日均基金利润表现

3.2.1 本期报告期末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 净值增长长率(①) 净值增长基准收益率(②) 收益差额(①-②)
过去三个月 3.42% 0.23% 1.09% -0.01% 2.33% 0.24%

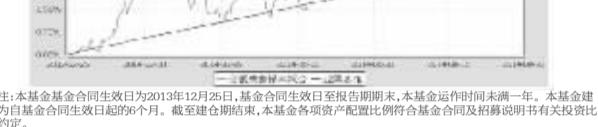
3.2.2 日均基金利润表现

3.2.2.1 本期报告期末本基金测算的平均管理费率和与同期业绩比较基准收益率变动的比较

交银施罗德荣泰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图对比如图

(2013年10月25日至2014年9月30日)



注：本基金合同生效日为2013年10月25日，基金合同生效日至报告期末，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之日起六个月内，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规定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

基金管理人：交银施罗德基金管理有限公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一四年十月二十四日

§ 5 重要提示

基金管理人的董事会及监事会对本基金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责任。
基金托管人和中信银行股份有限公司根据本基金合同的规定，于2014年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配政策和投资组合报告，确认不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人保证本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对本基金的财务指标、净值表现、收益分配政策和投资组合报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人和基金托管人保证本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人和基金托管人承诺以诚实信用、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。

基金管理人和基金托管人承诺以诚实信用、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。

本基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资人应当认真阅读基金招募说明书、基金合同等信息披露文件，自主判断投资价值。

本基金合同于2014年7月1日起至2014年9月30日止。

§ 6 报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.1 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.2 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.3 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.4 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.5 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.6 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.7 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.8 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.9 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.10 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.11 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.12 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.13 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.14 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.15 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.16 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.17 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.18 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.19 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.20 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.21 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.22 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.23 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.24 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.25 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.26 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.27 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.28 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.29 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.30 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.31 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.32 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.33 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.34 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.35 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.36 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.37 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.38 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.39 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.40 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.41 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.42 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.43 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.44 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.45 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.46 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.47 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.48 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.49 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.50 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.51 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.52 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.53 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.54 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.55 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.56 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.57 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.58 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.59 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.60 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.61 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.62 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.63 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.64 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.65 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.66 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.67 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.68 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.69 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.70 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.71 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.72 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.73 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.74 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.75 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.76 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.77 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.78 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.79 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.80 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.81 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.82 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.83 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.84 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.85 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.86 本报告期末按行业分类的股票投资组合

6.1.87 本报告期末按行业分类的股票投资组合