交银施罗德成长股票证券投资基金

【2014】第三季度报告

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	交银成长股票	
基金主代码	519692	
交易代码	519692(前端)	519693(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2006年10月23日	
报告期末基金份额总额	2,439,429,623.70份	
投资目标	本基金属于成长型股票基金,主要通过投资于经过严格的品质筛选且具有良好成长性的上市公司的股票,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,通过快选成长性好、成长具有可持续性、成长质量优良、定价相对合理的股票进行投资,以谋求超额收益。	
业绩比较基准	75%×富时中国A600成长指数+25%×富时中国国债指数	
风险收益特征	本基金是一只股票型基金,以具有良好成长性的公司为主要投资对象,追求超额收益,属于证券投资基金中较高预期收益和较高风险的品种。	
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	

§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	417,259,871.95
2.本期利润	770,543,217.69
3.加权平均基金份额本期利润	0.2985
4.期末基金资产净值	7,770,460,019.27
5.期末基金份额净值	3.1854

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。

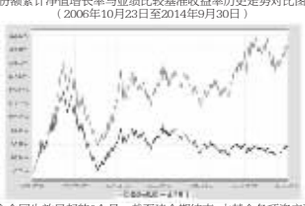
3.2 基金净值表现

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	10.48%	0.86%	10.48%	0.67%	0.00%	0.19%

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

交银施罗德成长股票证券投资基金
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10月23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		
管华雨	本基金、交银趋势股票、交银成长30股票、交银新成长股票的基金经理,公司权益投资总监	2010-10-08	-	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。

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,货币政策的实质性放松,A股后续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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	4,295,728,231.66	55.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	173,753,652.62	2.24
E	建筑业	392,688,058.86	5.05
F	批发和零售业	177,848,801.20	2.29
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	780,471,954.35	10.04
J	金融业	334,048,000.00	4.30
K	房地产业	163,796,661.00	2.11
L	租赁和商务服务业	119,706,448.02	1.54
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	42,990,000.00	0.55
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	383,547,410.19	4.94
R	文化、体育和娱乐业	406,072,647.82	5.23
S	综合	-	-
	合计	7,270,651,865.72	93.57

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	002008	大族激光	20,999,901	410,548,064.55	5.28
2	600109	国金证券	14,300,000	334,048,000.00	4.30
3	002353	杰瑞股份	6,999,634	272,845,733.32	3.51
4	002081	金螳螂	13,909,678	269,430,462.86	3.47
5	002223	鱼跃医疗	9,000,000	261,000,000.00	3.36
6	000869	张裕A	8,009,270	247,166,072.20	3.18
7	300347	泰格医药	7,202,641	245,538,031.69	3.16
8	300026	红日药业	7,941,838	232,934,108.54	3.00
9	300291	华录百纳	5,505,404	219,115,079.20	2.82
10	002065	东华软件	10,045,582	210,053,119.62	2.70

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	250,580,000.00	3.22
	其中:政策性金融债	250,580,000.00	3.22
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	1,959,355.20	0.03
8	其他	-	-
9	合计	252,539,355.20	3.25

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	2,000,000	200,460,000.00	2.58
2	140204	14国开04	500,000	50,120,000.00	0.65
3	113001	中行转债	18,920	1,959,355.20	0.03

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

交银施罗德货币市场证券投资基金

【2014】第三季度报告

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	1,315,386,853.94份	6,629,974,530.76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(2014年7月1日-2014年9月30日)	
	交银货币A	交银货币B
1.本期已实现收益	15,505,452.35	93,962,599.38
2.本期利润	15,505,452.35	93,962,599.38
3.期末基金资产净值	1,315,386,853.94	6,629,974,530.76

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	0.9895%	0.0014%	0.7058%	0.0000%	0.2837%	0.0014%

注:本基金收益分配按月结转份额。

2、交银货币B:

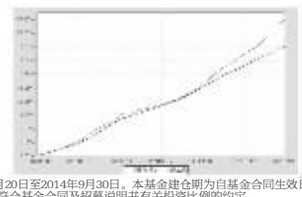
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.0505%	0.0014%	0.7058%	0.0000%	0.3447%	0.0014%

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

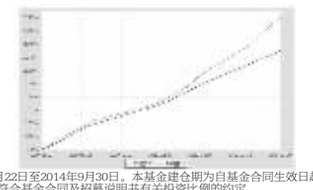
交银施罗德货币市场证券投资基金
份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2006年1月20日至2014年9月30日)

1、交银货币A



注:图示日期为2006年1月20日至2014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2014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		
林洪钧	本基金、交银增利债券、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	2011-06-09	-	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,历任专户投资部投资经理助理、专户投资经理、基金经理助理。

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继续增加企业短期融资券以及短期政策性金融债的配置,主要考虑因素为再投资风险。在本报告期内,本基金也较好地享受到了货币市场收益率下行带来的债券资本利得。另外,货币市场流动性在本报告期内保持了较为稳定宽松的情况,9月底开未出现季末流动性紧张的情况,反而呈现相对较为宽松的局面。

展望四季度,在稳增长的背景下,稳健的政策出现变化的可能性不大,货币市场大概率仍将保持较为充沛的流动性,因此,再投资风险需要在四季度继续保持关注,收益率较前期可能适度下降。在组合自身流动性可控的前提下,本基金在四季度仍将关注债券配置,力求保持收益和流动性的平稳。

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0.9895%,同期业绩比较基准增长率为0.7058%;交银货币B净值收益率为1.0505%,同期业绩比较基准增长率为0.7058%。

§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	5,115,775,578.25	58.49
	其中:债券	5,115,775,578.25	58.49
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	3,460,239,530.91	39.56
4	其他资产	170,747,248.58	1.95
5	合计	8,746,762,357.74	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	5.77
	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	769,999,415.00	9.69
	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	118
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	134
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	77

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	21.71	9.69
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.50	-
2	30天(含)-60天	20.15	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	7.94	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	31.32	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	26.82	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		107.94	9.69

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	1,142,319,067.88	14.38
	其中:政策性金融债	1,142,319,067.88	14.38
4	企业债券	39,778,202.65	0.50
5	企业短期融资券	3,933,678,307.72	49.51
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	5,115,775,578.25	64.39
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	39,778,202.65	0.50

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	140204	14国开04	5,500,000	551,182,111.56	6.94
2	140207	14国开07	2,100,000	210,445,454.68	2.65
3	140320	14进出20	2,000,000	200,484,997.95	2.52
4	041459013	14海淀国资CP001	2,000,000	200,334,099.88	2.52
5	041452007	14联合水泥CP001	2,000,000	200,002,879.24	2.52
6	041470002	14吴华CP001	2,000,000	200,000,079.85	2.52
7	011490002	14苏交通SCP002	1,900,000	190,394,361.70	2.40
8	011473005	14鲁高速SCP005	1,500,000	150,107,772.49	1.89
9	041462039	14陆家嘴CP001	1,500,000	149,756,092.86	1.88
10	140429	14农发29	1,300,000	130,324,040.18	1.64

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	3次
报告期内偏离度的最高值	0.2659%
报告期内偏离度的最低值	0.1195%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1761%

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	148,604,261.21
4	应收申购款	21,942,987.37
5	其他应收款	200,000.00
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	170,747,248.58

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

	交银货币A	交银货币B
本报告期期初基金份额总额	1,440,735,563.35	5,292,370,434.17
本报告期基金总申购份额	2,776,093,293.19	17,821,779,725.37
减:本报告期基金总赎回份额	2,901,442,002.60	16,484,175,628.78
本报告期期末基金份额总额	1,315,386,853.94	6,629,974,530.76

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
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0.00份,占本基金期末总份额的0.00%。

§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@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

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