交银施罗德环球精选价值证券投资基金

【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	交银环球精选股票(QDII)
基金主代码	519696
交易代码	519696
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年8月22日
报告期末基金份额总额	88,678,823.10份
投资目标	通过全球资产配置和灵活分散投资,在有效分散和控制风险的前提下,实现长期资本增值。
投资策略	自上而下配置资产,通过对全球宏观经济和各经济体的基本面分析,在不同区域间进行有效资产配置;自下而上精选证券,挖掘定价合理、具备持续竞争优势的上市公司股票进行投资,并有效控制下行风险。
业绩比较基准	70%×标准普尔全球大中盘指数(S&P Global LargeMidCap Index)+30%×恒生指数
风险收益特征	本基金以股票及股票基金为主要投资对象,属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种,其预期风险和收益水平高于混合型基金和债券型基金。此外,本基金在全球范围内进行投资,除了需要承担国际市场的市场波动风险之外,还面临汇率风险、国别风险、新兴市场风险等海外市场投资所面临的特别投资风险。
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
境外投资顾问英文名称	Schroder Investment Management Limited
境外投资顾问中文名称	施罗德投资管理有限公司
境外资产托管人英文名称	JPMorgan Chase Bank,National Association
境外资产托管人中文名称	摩根大通银行

§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	4,708,353.51
2.本期利润	-1,440,520.50
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0158
4.期末基金资产净值	143,839,534.28
5.期末基金份额净值	1.622

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。

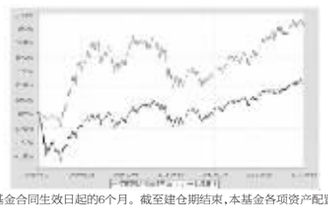
3.2 基金净值表现

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	-0.98%	0.51%	-2.22%	0.46%	1.24%	0.05%

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

交银施罗德环球精选价值证券投资基金
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
(2008年8月22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		
晏青	本基金、交银施罗德全球自然资源证券投资基金的基金经理	2012-04-09	-	8年	晏青先生,中国国籍,上海交通大学硕士。2006年加入交银施罗德基金管理有限公司,历任行业分析师、QDII高级分析师。

4.2 境外投资顾问为本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	说明
Simon Webber	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	15年	Simon Webber先生,英国曼彻斯特大学物理学学士,CFA。1999年加入施罗德投资管理有限公司,历任全球技术团队分析员。

4.3 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。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1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。

4.4.2 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。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

本季度全球主要市场表现严重分化,发达市场中日本涨幅较大,德国跌幅较大,新兴市场普涨,其中中国A股涨幅最大,俄罗斯因为地缘关系出现暴跌。美国QE按部就班地退出,长债利率保持稳定,短债利率有所上行,经济增长相对较好,美元指数大幅上升,这些因素继续提振美国股市表现。欧元区虽然实施宽松政策,欧元区国债收益率继续下降,但因为整体经济表现较弱,欧元下跌,股票市场表现不佳。香港市场先扬后抑,受中国经济企稳以及沪港通的影响,前两个月资金不断流入,股市涨势较好,但在9月份随着中国经济数据走弱,以及香港“占中”的不利影响,出现较大幅度调整,整个季度收跌。本基金在本季度继续坚持精选个股,寻找绝对收益的投资机会。

展望未来一个季度,美国经济继续增长的局面或将维持,欧洲短期难抬增长动能,中国经济虽然有所企稳,政府也不断出台房地产放松的政策,但是能否带来经济的强劲增长,依然需要观察。股票市场前期对一些积极因素已经有所反应,未来一段时间可能面临一定压力,但机会永远存在,我们将一如既往地精选个股,努力为投资人获取持续回报。

截至2014年9月30日,本基金份额净值为1.622元,本报告期份额净值增长率为-0.98%,同期业绩比较基准增长率为-2.22%。

§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(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	135,607,287.95	92.02
	其中:普通股	128,774,521.28	87.38
	存托凭证	6,832,766.67	4.64
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
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	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	9,987,432.29	6.78
8	其他资产	1,770,558.84	1.20
9	合计	147,365,279.08	100.00

5.2 报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家(地区)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
美国	60,225,152.76	41.87
香港	41,587,633.23	28.91
英国	8,427,720.52	5.86
日本	7,350,212.99	5.11
瑞士	5,724,286.90	3.98
法国	5,249,055.34	3.65
芬兰	1,876,716.98	1.30
泰国	1,483,919.85	1.03
挪威	1,269,647.81	0.88
巴西	1,209,861.11	0.84
新加坡	1,203,080.46	0.84
合计	135,607,287.95	94.28

注:1、国家(地区)类别根据其所在的证券交易所确定;
2、ADR、GDR按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
信息技术	29,500,116.84	20.51
非必需消费品	21,391,094.58	14.87
保健	20,645,921.52	14.35
金融	19,227,567.97	13.37
工业	14,622,856.11	10.17
必需消费品	8,873,733.60	6.17
能源	8,829,158.08	6.14
材料	7,346,661.92	5.11
公共事业	3,445,150.21	2.40
电信服务	1,725,027.12	1.20
其他	0.00	0.00
合计	135,607,287.95	94.28

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

5.4 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及存托凭证投资明细

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯控股有限公司	700 HK	香港证券交易所	香港	60,000	5,490,770.32	3.82
2	APPLE INC	苹果公司	AAPL US	美国证券交易所	美国	6,000	3,719,186.25	2.59
3	BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	比亚迪电子(国际)有限公司	285 HK	香港证券交易所	香港	450,000	3,208,891.75	2.23
4	FUFENG GROUP LTD	阜丰集团有限公司	546 HK	香港证券交易所	香港	1,000,000	3,042,504.77	2.12
5	AMGEN INC	安进公司	AMGN US	美国证券交易所	美国	3,456	2,986,606.60	2.08
6	WISDOM HOLDINGS GROUP	智美控股集团	1661 HK	香港证券交易所	香港	700,000	2,756,477.63	1.92
7	CONSUN PHARMACEUTICAL GROUP	康臣药业集团有限公司	1681 HK	香港证券交易所	香港	500,000	2,693,884.43	1.87
8	BAIDU INC	百度公司	BIDU US	美国证券交易所	美国	2,000	2,685,320.15	1.87
9	XINCHEN CHINA POWER HOLDINGS	新晨中国动力控股有限公司	1148 HK	香港证券交易所	香港	800,000	2,611,483.26	1.82
10	SCHLUMBERGER LTD	斯伦贝谢公司	SLB US	美国证券交易所	美国	4,012	2,510,098.67	1.75

注:前十名股票及存托凭证的排名是按照上市公司不同的上市交易所合并计算排列所得。

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合
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五名债券投资明细
本基金本报告期末未持有债券。

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 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金融衍生品投资明细
本基金本报告期末未持有金融衍生品。

5.9 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基金投资明细
本基金本报告期末未持有基金。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1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。

5.10.2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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	916,242.13
3	应收股利	160,628.80
4	应收利息	178.50
5	应收申购款	43,723.46
6	其他应收款	649,785.95
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,770,558.84

5.10.4 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。

5.10.5 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的情况。

5.10.6 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	92,982,586.04
本报告期基金总申购份额	3,008,615.02
减:本报告期基金总赎回份额	7,312,377.96
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	88,678,823.10

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22,986,750.67份,占本基金期末总份额的25.92%。

§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环球精选价值证券投资基金募集的文件;
2、《交银施罗德环球精选价值证券投资基金基金合同》;
3、《交银施罗德环球精选价值证券投资基金招募说明书》;
4、《交银施罗德环球精选价值证券投资基金托管协议》;
5、关于申请募集交银施罗德环球精选价值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环球精选价值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。

交银施罗德精选股票证券投资基金

【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	交银精选股票	
基金主代码	519688	
交易代码	519688(前端)	519689(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2005年9月29日	
报告期末基金份额总额	5,732,229,372.56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,自上而下配置资产,自下而上精选证券,有效控制风险,分享中国经济与资本市场高速成长的成果,谋求实现基金财产的长期稳定增长。	
投资策略	自上而下配置资产,自下而上精选证券,有效控制下行风险。	
业绩比较基准	75%×沪深300指数+25%×中信标普金债指数	
风险收益特征	本基金是一只稳健型的股票基金,属于股票型基金中的中等风险品种,本基金的预期收益和风险都要高于混合型基金。本基金力争在严格控制风险的前提下谋求实现基金资产长期稳定增长。	
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	42,725,434.57
2.本期利润	383,513,724.43
3.加权平均基金份额本期利润	0.0645
4.期末基金资产净值	4,191,333,841.64
5.期末基金份额净值	0.7312

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。

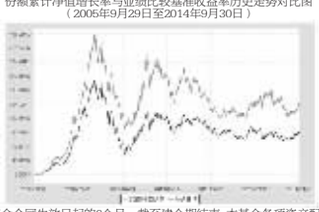
3.2 基金净值表现

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	9.91%	0.83%	10.26%	0.67%	-0.35%	0.16%

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

交银施罗德精选股票证券投资基金
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
(2005年9月29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		
张鸿羽	本基金的基金经理	2012-04-20	-	14年	张鸿羽女士,上海财经大学硕士。历任广发证券股份有限公司高级研究员,上投摩根基金管理有限公司高级研究员。2007年加入交银施罗德基金管理有限公司,历任高级研究员、专户投资经理。

注:2014年10月22日本基金管理人发布公告,经公司领导办公会议审议通过,张鸿羽女士不再担任本基金基金经理,曹文俊先生自公告日起单独管理本基金,详情请见相关公告。

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。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

海外股票市场本季度表现出现分化,发达市场内部欧美走势迥异,日本受益于日元贬值,表现最好,美国表现优于欧洲,新兴市场除了俄罗斯暴跌,普遍走势强劲,A股涨幅最为抢眼。大宗商品未能延续上半年的强劲表现,普遍出现较大幅度下跌,MSCI全球能源分类指数跌幅超过材料指数。本基金重点投资了香港市场精选的个股,一定程度规避了这种大幅度的下挫。

展望未来一个季度,影响资源类股票的主要因素依然是全球宏观经济基本面和货币政策,我们会持续关注这两大因素的变化。考虑到目前只有美国经济增长势头较好,中国经济在放松的政策背景下出现企稳态势,但是增幅依然不高,大宗商品价格有可能继续承压,但因为能源价格跌幅较大,不排除会出现一定程度的反弹。我们将坚持一贯的精选个股原则,努力为投资人获取持续回报。

截至2014年9月30日,本基金份额净值为1.211元,本报告期份额净值增长率为0.33%,同期业绩比较基准增长率为-8.19%。

§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(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	7,708,679.37	93.08
	其中:普通股	7,575,785.37	91.47
	存托凭证	132,894.00	1.60
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
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	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	478,672.98	5.78
8	其他资产	94,759.08	1.14
9	合计	8,282,111.43	100.00

5.2 报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家(地区)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
香港	5,651,912.15	69.19
美国	2,056,767.22	25.18
合计	7,708,679.37	94.37

注:1、国家(地区)类别根据其所在的证券交易所确定;
2、ADR、GDR按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
材料	2,549,927.79	31.22
能源	1,320,220.68	16.16
工业	1,067,253.63	13.07
信息技术	898,948.37	11.01
公共事业	653,663.13	8.00
非必需消费品	535,766.07	6.56
金融	397,189.49	4.86
保健	285,710.21	3.50
合计	7,708,679.37	94.37

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

5.4 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及存托凭证投资明细

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	FUFENG GROUP LTD	阜丰集团有限公司	546 HK	香港证券交易所	香港	180,000	547,650.86	6.70
2	PHILLIPS 66	-	PSX US	美国证券交易所	美国	1,000	500,259.78	6.12
3	DONGJIANG ENVIRONMENTAL COMPANY LIMITED	东江环保股份有限公司	895 HK	香港证券交易所	香港	20,000	499,160.94	6.11
4	CHINA SANJIANG FINE CHEMICALS COMPANY LIMITED	中国三江精细化工有限公司	2198 HK	香港证券交易所	香港	140,000	444,807.86	5.45
5	SOUTHWESTERN ENERGY COMPANY	-	SWN US	美国证券交易所	美国	2,000	430,059.75	5.26
6	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL COMPANY LIMITED	中国石化上海石油化工股份有限公司	338 HK	香港证券交易所	香港	200,000	405,667.30	4.97
7	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	3,000	397,189.49	4.86
8	EOG RESOURCES INC	-	EOG US	美国证券交易所	美国	640	389,901.15	4.77
9	DA MING INTERNATIONAL HOLDINGS LIMITED	大明国际控股有限公司	1090 HK	香港证券交易所	香港	150,000	336,339.39	4.12
10	BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LIMITED	北控水务集团有限公司	371 HK	香港证券交易所	香港	80,000	332,773.96	4.07

注:前十名股票及存托凭证的排名是按照上市公司不同的上市交易所合并计算排列所得。

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合
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五名债券投资明细
本基金本报告期末未持有债券。

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 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金融衍生品投资明细
本基金本报告期末未持有金融衍生品。

5.9 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基金投资明细
本基金本报告期末未持有基金。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1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。

5.10.2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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	84,747.00
3	应收股利	4,278.52
4	应收利息	29.98
5	应收申购款	3,802.01
6	其他应收款	1,901.57
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	94,759.08

5.10.4 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。

5.10.5 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的情况。

5.10.6 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	7,756,745.11
本报告期基金总申购份额	286,436.87
减:本报告期基金总赎回份额	1,296,871.39
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	6,746,310.59

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全球自然资源证券投资基金募集的文件;
2、《交银施罗德全球自然资源证券投资基金基金合同》;
3、《交银施罗德全球自然资源证券投资基金招募说明书》;
4、《交银施罗德全球自然资源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、关于申请募集交银施罗德全球自然资源证券投资基金之法律意见书;
8、报告期内交银施罗德全球自然资源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。

交银施罗德全球自然资源证券投资基金

【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	交银全球资源股票(QDII)
基金主代码	519709
交易代码	519709
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年5月22日
报告期末基金份额总额	6,746,310.59份
投资目标	在全球范围内精选自然资源相关行业的上市公司,通过积极主动的资产配置和组合管理,在有效控制组合下行风险的前提下力争实现资本的长期保值增值。
投资策略	通过对全球宏观经济、大宗商品价格和自然资源相关行业上市公司基本面的分析,根据宏观经济运行特点对不同自然资源类别相关资产价格或其所对应的大宗商品(如能源、贵金属、基本金属、农产品等)价格所产生的不同影响,利用基金管理人在大宗商品、自然资源及其相关产业等领域的专业研究,自上而下的选择明显受益于宏观经济运行特征的自然资源类别进行投资,同时在该资源类别内自下而上精选证券,挖掘定价合理、具备持续竞争优势、明显受益于相关资源价格上涨的上市公司股票进行投资,在有效控制下行风险的前提下,优化组合收益,构建具有长期投资价值的投资组合,实现资产的保值增值。
业绩比较基准	MSCI全球原材料总收益指数收益率×65%+MSCI全球能源总收益指数收益率×35%
风险收益特征	本基金为主要投资全球范围内自然资源相关行业上市公司的主动股票型基金,基金所投之标的与全球经济景气度、大宗商品市场表现及各相关产业联动性相对较高,波动性较大,风险与预期收益高于混合基金和债券基金,在股票基金中亦属于较相较高风险、预期收益较高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	中国建设银行股份有限公司
境外投资顾问英文名称	Schroder Investment Management Limited
境外投资顾问中文名称	施罗德投资管理有限公司
境外资产托管人英文名称	JPMorgan Chase Bank,National Association
境外资产托管人中文名称	摩根大通银行

§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	-112,509.08
2.本期利润	60,201.01
3.加权平均基金份额本期利润	0.0085
4.期末基金资产净值	8,168,396.35
5.期末基金份额净值	1.211

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、自《公开募集证券投资基金运作管理办法》生效日(2014年8月8日)起至本报告期末,本基金连续37个工作日基金资产净值低于五千万元。

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 |