

（上接A22版）

九、基金的业绩比较标准
本基金的整体业绩比较基准采用：
66%×MSCI中国A股指数+35%×中债综合全债指数
如果市场推出更优基准，且更能表征本基金风险收益特征的指数，则本基金管理人可以视情况在经过适当的程序后调整本基金的业绩比较基准，并及时公告。
自2014年7月1日起，本基金业绩比较基准由“66%×MSCI中国A股指数+35%×新华巴克莱资本中国全债指数”变更为“66%×MSCI中国A股指数+35%×中债综合全债指数”，详情请见基金管理人于2013年6月26日发布的《交银施罗德基金管理有限责任公司关于变更交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金业绩比较基准并修改基金合同相关内容的公告》。

十、基金的风险收益特征
本基金属于证券投资基金产品中的中等风险品种，本基金的风险与预期收益处于股票型基金和债券型基金之间。本基金力争在有效分散风险的前提下追求实现基金资产长期稳定增长。

十一、基金投资报告
本基金管理人(即董事会和董事)本报告书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法律责任。
本基金托管人中国建设银行股份有限公司，于2014年10月23日复核了本报告中财务指标、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。

本报告期为2014年7月1日至2014年9月30日。本报告财务资料未经审计师审计。1.报告期末基金资产净值情况

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	2,728,631.00	0.09
8	合计	2,989,643,408.89	100.00

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	786,894.28	0.03
B	采矿业	56,794.41	-
C	制造业	1,280,788,843.49	43.10
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	330,118.89	0.01
E	建筑业	8,956,983.00	0.30
F	批发和零售业	21,355,993.99	0.72
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	6,180,000.00	0.21
I	信息传输、软件和信息技术服务业	575,181,465.58	19.35
J	金融业	167,320,462.58	5.64
K	房地产业	307,373,519.69	10.34
L	租赁和商务服务业	95,993,972.92	3.23
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	31,434,059.25	1.06
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社工作	132,468,107.25	4.46
R	文化、体育和娱乐业	125,793,614.33	4.23
S	综合	-	-
	合计	2,754,164,833.86	92.67

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	600609	青岛海尔	11,248,540	177,726,932.00	5.98
2	600109	中国国航	6,730,328	152,220,468.58	5.29
3	000671	阳光城	11,568,597	145,764,322.20	4.90
4	300226	上海钢联	2,660,428	138,794,528.76	4.67
5	600763	通威股份	2,745,453	132,468,107.25	4.46
6	000768	中航飞机	7,282,025	114,983,174.75	3.87
7	300104	乐视网	1,020,156,611	102,015,661.19	3.43
8	000550	江铃汽车	3,301,070	96,193,179.80	3.24
9	600138	中晋股份	8,532,928	95,893,336.32	3.23
10	600126	鲁商置业	4,457,300	92,488,973.00	3.11

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债逆回购	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	59,994,000.00	2.02
4	其中:政策性金融债	59,994,000.00	2.02
5	企业债	-	-
6	企业短期融资券	-	-
7	中期票据	22,951,874.00	0.77
8	其他	-	-
9	合计	82,945,874.00	2.79

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	国债逆回购	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	59,994,000.00	2.02
4	其中:政策性金融债	59,994,000.00	2.02
5	企业债	-	-
6	企业短期融资券	-	-
7	中期票据	22,951,874.00	0.77
8	其他	-	-
9	合计	82,945,874.00	2.79

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	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债逆回购	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	59,994,000.00	2.02
4	其中:政策性金融债	59,994,000.00	2.02
5	企业债	-	-
6	企业短期融资券	-	-
7	中期票据	22,951,874.00	0.77
8	其他	-	-
9	合计	82,945,874.00	2.79

注:1.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符合基金合同及招募说明书有关投资比例约定。

2.本基金业绩比较基准自2013年7月1日起,由“66%×MSCI中国A股指数+35%×新华巴克莱资本中国全债指数”变更为“66%×MSCI中国A股指数+35%×中债综合全债指数”。详情请见基金管理人于2013年6月26日发布的《交银施罗德基金管理有限责任公司关于变更交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金业绩比较基准并修改基金合同相关内容的公告》。

2.本基金合同生效后,基金管理人(即董事会和董事)本报告书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法律责任。

本基金托管人中国建设银行股份有限公司,于2014年10月23日复核了本报告中财务指标、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。

本报告期为2014年7月1日至2014年9月30日。本报告财务资料未经审计师审计。1.报告期末基金资产净值情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	6,082,912,371.89	90.65
	其中:股票	6,082,912,371.89	90.65
2	固定收益投资	271,920,474.80	4.05
	其中:债券	271,920,474.80	4.05
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	97,179,794.63	1.45
7	其他资产	28,544,137.56	0.43
8	合计	6,474,066,756.88	100.00

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	163,234,689.92	2.48
B	采矿业	39,361,033.82	0.59
C	制造业	2,880,458,746.80	43.19
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	73,622,000.00	1.10
E	建筑业	80,281,080.80	1.20
F	批发和零售业	668,463,150.16	10.02
G	交通运输、仓储和邮政业	4,281,574.62	0.06
H	住宿和餐饮业	23,589,410.20	0.36
I	信息传输、软件和信息技术服务业	916,575,308.97	13.74
J	金融业	557,623,341.18	8.31
K	房地产业	454,113,666.32	6.86
L	租赁和商务服务业	48,120,720.00	0.72
M	科学研究和技术服务业	38,321,525.58	0.58
N	水利、环境和公共设施管理业	72,872,291.62	1.09
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	66,153,571.56	0.99
S	综合	-	-
	合计	6,082,912,371.89	91.21

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	002153	益盛药业	10,209,740	716,417,455.80	10.74
2	600309	万华化学	2,000,000	346,200,000.00	5.19
3	600519	贵州茅台	16,889,000	273,850,540.40	4.19
4	600208	招商中宝	59,084,128	247,562,496.32	3.74
5	000581	威孚高科	9,044,698	235,575,170.82	3.51
6	000712	广汇股份	12,339,260	217,281,580.16	3.27
7	600030	中信证券	15,000,000	209,292,000.00	3.12
8	000671	阳光城	16,292,000	199,551,170.00	3.00
9	600858	银座股份	22,960,000	186,440,000.00	2.84
10	100800	一汽轿车	16,344,393	181,422,762.30	2.72

注:1.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符合基金合同及招募说明书有关投资比例约定。

2.本基金业绩比较基准自2013年7月1日起,由“66%×MSCI中国A股指数+35%×新华巴克莱资本中国全债指数”变更为“66%×MSCI中国A股指数+35%×中债综合全债指数”。详情请见基金管理人于2013年6月26日发布的《交银施罗德基金管理有限责任公司关于变更交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金业绩比较基准并修改基金合同相关内容的公告》。

2.本基金合同生效后,基金管理人(即董事会和董事)本报告书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法律责任。

本基金托管人中国建设银行股份有限公司,于2014年10月23日复核了本报告中财务指标、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。

本报告期为2014年7月1日至2014年9月30日。本报告财务资料未经审计师审计。1.报告期末基金资产净值情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	6,082,912,371.89	90.65
	其中:股票	6,082,912,371.89	90.65
2	固定收益投资	271,920,474.80	4.05
	其中:债券	271,920,474.80	4.05
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	97,179,794.63	1.45
7	其他资产	28,544,137.56	0.43
8	合计	6,474,066,756.88	100.00

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	163,234,689.92	2.48
B	采矿业	39,361,033.82	0.59
C	制造业	2,880,458,746.80	43.19
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	73,622,000.00	1.10
E	建筑业	80,281,080.80	1.20
F	批发和零售业	668,463,150.16	10.02
G	交通运输、仓储和邮政业	4,281,574.62	0.06
H	住宿和餐饮业	23,589,410.20	0.36
I	信息传输、软件和信息技术服务业	916,575,308.97	13.74
J	金融业	557,623,341.18	8.31
K	房地产业	454,113,666.32	6.86
L	租赁和商务服务业	48,120,720.00	0.72
M	科学研究和技术服务业	38,321,525.58	0.58
N	水利、环境和公共设施管理业	72,872,291.62	1.09
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	66,153,571.56	0.99
S	综合	-	-
	合计	6,082,912,371.89	91.21

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	002153	益盛药业	10,209,740	716,417,455.80	10.74
2	600309	万华化学	2,000,000	346,200,000.00	5.19
3	600519	贵州茅台	16,889,000	273,850,540.40	4.19
4	600208	招商中宝	59,084,128	247,562,496.32	3.74
5	000581	威孚高科	9,044,698	235,575,170.82	3.51
6	000712	广汇股份	12,339,260	217,281,580.16	3.27
7	600030	中信证券	15,000,000	209,292,000.00	3.12
8	000671	阳光城	16,292,000	199,551,170.00	3.00
9	600858	银座股份	22,960,000	186,440,000.00	2.84
10	100800	一汽轿车	16,344,393	181,422,762.30	2.72

注:1.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符合基金合同及招募说明书有关投资比例约定。

2.本基金业绩比较基准自2013年7月1日起,由“66%×MSCI中国A股指数+35%×新华巴克莱资本中国全债指数”变更为“66%×MSCI中国A股指数+35%×中债综合全债指数”。详情请见基金管理人于2013年6月26日发布的《交银施罗德基金管理有限责任公司关于变更交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金业绩比较基准并修改基金合同相关内容的公告》。

2.本基金合同生效后,基金管理人(即董事会和董事)本报告书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法律责任。

本基金托管人中国建设银行股份有限公司,于2014年10月23日复核了本报告中财务指标、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。

本报告期为2014年7月1日至2014年9月30日。本报告财务资料未经审计师审计。1.报告期末基金资产净值情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	6,082,912,371.89	90.65
	其中:股票	6,082,912,371.89	90.65
2	固定收益投资	271,920,474.80	4.05
	其中:债券	271,920,474.80	4.05
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	97,179,794.63	1.45
7	其他资产	28,544,137.56	0.43
8	合计	6,474,066,756.88	100.00

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	163,234,689.92	2.48
B	采矿业	39,361,033.82	0.59
C	制造业	2,880,458,746.80	43.19
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	73,622,000.00	1.10
E	建筑业	80,281,080.80	1.20
F	批发和零售业	668,463,150.16	10.02
G	交通运输、仓储和邮政业	4,281,574.62	0.06
H	住宿和餐饮业	23,589,410.20	0.36
I	信息传输、软件和信息技术服务业	916,575,308.97	13.74
J	金融业	557,623,341.18	8.31
K	房地产业	454,113,666.32	6.86
L	租赁和商务服务业	48,120,720.00	0.72
M	科学研究和技术服务业	38,321,525.58	0.58
N	水利、环境和公共设施管理业	72,872,291.62	1.09
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	66,153,571.56	0.99
S	综合	-	-
	合计	6,082,912,371.89	91.21

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	002153	益盛药业	10,209,740	716,417,455.80	10.74
2	600309	万华化学	2,000,000	346,200,000.00	5.19