交银施罗德周期回报灵活配置混合型证券投资基金

2015 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:二〇一五年十月二十七日

§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2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	交银周期回报灵活配置混合	
基金主代码	519738	
交易代码	519738(前端)	519739(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014年5月22日	
报告期末基金份额总额	2,921,313,338.85份	
投资目标	本基金以交银施罗德投资时钟分析框架为基础,结合基金管理人对宏观经济周期和金融市场运行趋势的判断,通过灵活的资产配置策略和积极主动的投资管理,在控制下行风险的前提下,力争为投资者提供长期稳健的投资回报。	
投资策略	本基金充分发挥资产管理人的研究优势,在分析和判断宏观经济周期和金融市场运行趋势的基础上,运用交银施罗德投资时钟分析框架,自上而下调整基金大类资产配置比例和股票行业配置比例,确定债券组合久期和债券类别配置;在严谨深入的股票和债券研究分析基础上,自下而上精选股票和债券。	
业绩比较基准	50%×沪深300指数收益率+50%×中债综合全价指数收益率	
风险收益特征	本基金是一只混合型基金,其长期平均风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金,低于股票型基金。	
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(2015年7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-15,410,076.50
2.本期利润	-44,010,710.09
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0076
4.期末基金资产净值	3,292,248,061.09
5.期末基金份额净值	1.127

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	-0.35%	0.15%	-14.12%	1.67%	13.77%	-1.52%

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
交银施罗德周期回报灵活配置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对比图
(2014年5月22日至2015年9月30日)

注:本基金基金合同生效日为2014年5月22日,截至报告期期末,本基金已完成建仓但报告期期末距建仓结束未满一年。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		
项廷锋	交银双利债券、交银策略回报灵活配置混合、交银纯债债券、交银双利债券、交银保本混合、交银荣泰保本混合、交银周期回报灵活配置混合、交银新回报灵活配置混合、交银添和保本混合、交银多策略回报灵活配置混合的基金经理,公司投资总监	2014-06-03	-	16年	项廷锋先生,上海交通大学管理学博士。历任华安基金管理有限公司研究员、固定收益投资经理和基金经理。其中2003年12月至2007年5月担任华安现金富利投资基金基金经理。2007年加入交银施罗德基金管理有限公司,历任固定收益部总经理,2013年9月4日至2014年12月18日担任交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金基金经理。
李娜	交银周期回报灵活配置混合、交银新回报灵活配置混合、交银多策略回报灵活配置混合的基金经理	2015-08-04	-	5年	李娜女士,美国宾夕法尼亚大学应用数学与计算科学硕士。历任国泰基金管理有限公司研究员。2012年加入交银施罗德基金管理有限公司,历任债券分析师、基金经理助理。

注:1、本基金基金经理项廷锋先生于2015年10月7日因病去世,经本公司研究决定,本基金由李娜女士继续管理。
2、基金经理(或基金经理小组)期后变动(如有)敬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

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 报告期内基金的业绩表现

截至2015年9月30日,本基金份额净值为1.127元,本报告期份额净值增长率为-0.35%,同期业绩比较基准增长率为-14.12%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金份额变动情况

本基金本报告期内无需预警说明。

§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	124,415,614.80	3.77
	其中:股票	124,415,614.80	3.77
2	固定收益投资	3,037,863,593.97	91.98
	其中:债券	3,037,863,593.97	91.98
	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	70,000,345.00	2.12
	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	24,599,449.18	0.74
7	其他资产	45,985,260.48	1.39
8	合计	3,302,864,263.43	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	5,220,000.00	0.16
C	制造业	102,195,194.80	3.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,320,000.00	0.07
E	建筑业	4,839,000.00	0.15
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	3,006,000.00	0.09
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,390,620.00	0.04
J	金融业	-	-
K	房地产业	5,444,800.00	0.17
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	124,415,614.80	3.78

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	002749	国光股份	644,004	34,074,251.64	1.03
2	300463	迈克生物	233,333	18,981,639.55	0.58
3	600399	抚顺特钢	1,600,000	13,520,000.00	0.41
4	600277	亿利能源	899,968	7,496,733.44	0.23
5	300443	金雷风电	65,566	5,930,444.70	0.18
6	300436	广生堂	94,594	5,770,234.00	0.18
7	603993	洛阳钼业	500,000	5,220,000.00	0.16
8	600565	迪马股份	480,000	4,593,600.00	0.14
9	300159	新研股份	299,901	4,441,533.81	0.13
10	300488	恒锋工具	71,341	3,514,257.66	0.11

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	98,420,000.00	2.99
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,621,872,000.00	49.26
	其中:政策性金融债	1,621,872,000.00	49.26
4	企业债券	105,391,593.97	3.20
5	企业短期融资券	943,992,000.00	28.67
6	中期票据	268,188,000.00	8.15
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,037,863,593.97	92.27

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	150210	15国开10	5,900,000	613,836,000.00	18.64
2	150213	15国开13	2,000,000	203,440,000.00	6.18
3	041456046	14青国投CP001	2,000,000	202,040,000.00	6.14
4	150217	15国开17	2,000,000	199,900,000.00	6.07
5	150218	15国开18	1,900,000	191,235,000.00	5.81

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	345,587.57
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	45,639,524.41
5	应收申购款	-
6	其他应收款	148.50
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	45,985,260.48

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	600277	亿利能源	7,496,733.44	0.23	重大事项
2	600565	迪马股份	4,593,600.00	0.14	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

报告期期初基金份额总额	8,257,282,595.78
本报告期期间基金总申购份额	5,504,175.82
减:本报告期期间基金总赎回份额	5,341,473,432.75
本报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	2,921,313,338.85

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
本报告期内未发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
本基金管理人未持有本基金的申购、赎回、红利再投等。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录
1、中国证监会核准交银施罗德周期回报灵活配置混合型证券投资基金募集的文件;
2、《交银施罗德周期回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;
3、《交银施罗德周期回报灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》;
4、《交银施罗德周期回报灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;
5、关于申请募集交银施罗德周期回报灵活配置混合型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周期回报灵活配置混合型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@jyshd.com。

交银施罗德新成长混合型证券投资基金

2015 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:招商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年十月二十七日

§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。

基金托管人招商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2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	交银新成长混合	
基金主代码	519736	
交易代码	519736(前端)	519737(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014年5月9日	
报告期末基金份额总额	252,559,389.85份	
投资目标	深入挖掘经济转型背景下的投资机会,自下而上精选个股,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研究优势,在经济转型大背景下,分析和判断宏观经济运行变化和政府产业政策等多因素影响,积极挖掘不同行业和子行业景气度新变化下的个股投资机会,通过团队对个股深入的基本面研究和细致的实地调研,精选公司品质良好、成长具有可持续性、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%×中信标普全债指数	
风险收益特征	本基金是一只混合型基金,其风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金,低于股票型基金。属于承担较高风险、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	招商银行股份有限公司	

§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(2015年7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-62,607,295.85
2.本期利润	-70,628,376.94
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2692
4.期末基金资产净值	369,356,748.50
5.期末基金份额净值	1.462

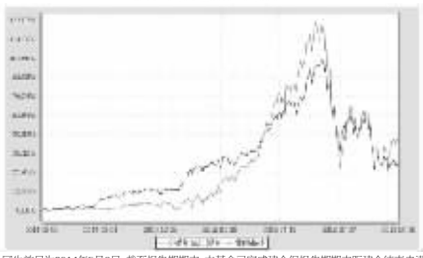
注:1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后的实际收益水平要低于所列数字;
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	-13.29%	3.57%	-23.50%	2.72%	10.21%	0.85%

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
交银施罗德新成长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对比图
(2014年5月9日至2015年9月30日)



注:本基金基金合同生效日为2014年5月9日,截至报告期期末,本基金已完成建仓但报告期期末距建仓结束未满一年。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		
王崇	交银新成长混合的基金经理	2014-10-22	-	7年	王崇先生,北京大学金融学博士。2008年加入交银施罗德基金管理有限公司,历任行业分析师、高级研究员。

注:基金经理(或基金经理小组)期后变动(如有)敬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

2015年三季度债券市场走势呈震荡上行走势,6月份股灾之后,原投资于股票和打新的资金纷纷流向债券。但随着8月份中国启动汇率改革以来,市场一度对人民币贬值预期加强,并引发了全球资产的大幅下跌,债市经历了短暂的调整。但随后央行加大外汇市场的管制力度,并实施一定的资本管制,目前汇率已经基本稳定,经济基本面依然不容乐观,债券重拾平稳走势。

中债总全价(总值)指数在三季度上涨1.3%。本基金在三季度总体上低配了权益类资产,选择性参与了部分反弹机会。

展望后市,银行理财等资金配置需求依然强烈,股票市场处于震荡行情,高收益资产稀缺,在各大类资产中债券或仍然具有较高的配置价值。年内政府债务置换已过大半,再加上利率债等也已经度过三季度发行最高峰,四季度供给量将大幅减少。最新的经济数据显示基本面依然疲弱,汇率短期内也趋于稳定,这都有利于中长期利率下行。信用债方面,信用利差已经压缩至历史低位,而这体经济盈利情况恶化明显,信用风险将逐渐暴露,债券绝对收益率下降会倒逼银行理财的收益率下行,未来低利率环境有望成为常态。货币当局为了对冲外汇储备下降以及引导资金成本下行,有望维持比较宽松的货币政策,年内再次降准、降息均可期。但同时,政府已经加大财政刺激,基建等投资力度有望加大,应警惕基本面边际改善对债市预期的变化以及投资者风险偏好的提升。经济转型之路漫漫,"预算软约束"问题依旧存在,一旦高压放松,地方政府加杠杆动力仍在。整个经济面临困境时,动员地方政府重新发力仍可能是最自然的选择。"跷跷板当,凤凰涅槃"对信用债定价模式的影响也值得密切关注。我们也将密切关注中央经济工作会议所传达的新信号。至于权益类资产,我们认为市场信心正处于逐步恢复过程中,拟择机增配。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2015年9月30日,交银强化回报债券A/B份额净值为1.161元,本报告期份额净值增长率为0.61%,同期业绩比较基准增长率为1.12%;交银强化回报债券C份额净值为1.156元,本报告期份额净值增长率为0.43%,同期业绩比较基准增长率为1.12%。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明
本基金本报告期内无需预警说明。

§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	4,689,884.02	1.32
	其中:股票	4,689,884.02	1.32
2	固定收益投资	313,424,862.50	88.15
	其中:债券	313,424,862.50	88.15
	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	-	-
	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	32,041,747.35	9.01
7	其他资产	5,382,931.90	1.51
8	合计	355,539,425.77	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	25,940.00	0.01
C	制造业	4,311,109.74	1.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	23,160.00	0.01
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	224,400.00	0.06
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	54,061.67	0.02
K	房地产业	12,692.61	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	38,520.00	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	4,689,884.02	1.32

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	300073	当升科技	160,000	3,200,000.00	0.90
2	000630	铜陵有色	399,800	923,538.00	0.26
3	601021	春秋航空	2,000	224,400.00	0.06
4	002572	索菲亚	2,000	76,640.00	0.02
5	300329	海伦钢琴	2,000	43,200.00	0.01
6	600054	黄山旅游	2,000	38,520.00	0.01
7	600000	浦发银行	2,000	33,260.00	0.01
8	600585	海螺水泥	1,968	33,160.80	0.01
9	600820	隧道股份	2,000	23,160.00	0.01
10	000001	平安银行	1,983	20,801.67	0.01

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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	861.00	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	162,210,254.84	43.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	15,430,779.00	4.18
F	批发和零售业	17,067,763.60	4.62
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	41,650,748.83	11.28
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	12,126,966.10	3.28
N	水利、环境和公共设施管理业	17,674,979.04	4.79
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,969.52	0.00
S	综合	-	-
	合计	266,164,301.93	72.06

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	300017	网宿科技	447,315	23,577,973.65	6.38
2	002020	京新药业	725,358	19,221,987.00	5.20
3	600054	黄山旅游	917,704	17,674,979.04	4.79
4	002450	康得新	570,291	17,274,114.39	4.68
5	300262	巴安水务	1,130,460	15,430,779.00	4.18
6	300367	东方网力	233,900	13,184,943.00	3.57
7	600418	江淮汽车	952,500	12,649,200.00	3.42
8	600276	恒瑞医药	263,228	12,158,501.32	3.29
9	300332	天壕环境	597,387	12,126,966.10	3.28
10	600804	鹏博士	548,722	11,813,984.66	3.20

5.6 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	30,080,000.00	8.14
	其中:政策性金融债	30,080,000.00	8.14
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	合计	30,080,000.00	8.14

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	140230	14国开30	200,000	20,044,000.00	5.43
2	150301	15进出01	100,000	10,036,000.00	2.72

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	559,903.03
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	887,607.20
5	应收申购款	117,346.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,564,856.85

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	300262	巴安水务	15,430,779.00	4.18	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

报告期期初基金份额总额	296,367,057.25
本报告期期间基金总申购份额	54,546,457.30
减:本报告期期间基金总赎回份额	98,354,124.70
本报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	252,559,389.85

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
本报告期内未发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。
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

1. 根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《关于实施<公开募集证券投资基金运作管理办法>有关问题的规定》以及《公开募集证券投资基金运作管理办法》第三十条的规定"基金合同和基金招募说明书应当按照下列规定载明基金的类别:(一)百分之八十以上的基金资产投资于股票的,为股票基金;……(五)投资于股票、债券、货币市场工具或其他基金份额,并且股票投资、债券投资、基金投资的比例不符合第(一)项、第(二)项规定的,为混合基金;……",由于交银施罗德新成长股票型证券投资基金的基金投资比例已不符合《公开募集证券投资基金运作管理办法》中关于股票型基金的要求,经与基金托管人协商一致,并报中国证监会备案,本基金管理人决定自2015年8月8日起,调整本基金类型为混合型基金,基金名称变更为"交银施罗德新成长混合型证券投资基金",同时相应修改基金合同和托管协议相关表述。详情请见本基金管理人于2015年8月5日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金变更基金类别及修改基金名称并相应修改基金合同和托管协议的公告》。

2. 鉴于交银施罗德新成长混合型证券投资基金的业绩比较基准的指数停止计算编制,本基金管理人根据基金合同的相关约定,经与基金托管人协商一致,并报中国证监会备案,决定自2015年10月1日起将交银施罗德新成长混合型证券投资基金的业绩比较基准由原"75%×富时中国A600成长指数+25%×中信标普全债指数"