

交银施罗德定期支付双息平衡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、监事及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、完整性、及时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数据、净值表现、收益分配政策和报告的其他内容，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。

本报告中财务数据未经审计。

本基金报告日期2015年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称：交银定期支付双息平衡混合

基金代码：619123

基金运作方式：契约型开放式

基金合同的生效日：2013年9月4日

报告期末基金份额总额：60,243,646.01份

投资目标：本基金选择具有长线增长潜力和阶段性盈利能力的股票，以及具有较高息票率的债券，力争实现基金资产的长期增值。

投资策略：本基金选择具有长线增长潜力和阶段性盈利能力的股票，以及具有较高息票率的债券，力争实现基金资产的长期增值。

业绩比较基准：60%×中证利源收益指数+40%×中证综合债指数收益率

风险收益特征：本基金是一只混合型基金，在证券投资基金中属于高风险的品种，其长期平均风险和预期收益率高于货币市场基金和债券型基金，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
1.本期实现收益		-3,012,500.05
2.本期利润		-22,736,102.49
3.期初至报告期期末的利润累积金额		3,049.00
4.期末基金净值-净值-净值		94,062,118.91
5.期末基金份额净值		1.60

注：1.本期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，本期利润为期初至本期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 本基金报告期内基金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(净值增长率差额) 业绩比较基准(净值增长率差额) 业绩比较基准收益率(1)-(2)

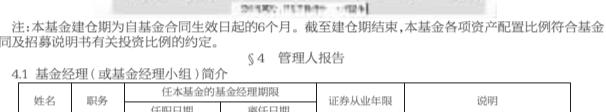
过去三个月 -16.83% 1.00% -1.00% -0.48%

3.2.2 本基金合同生效以来基金份额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

交银定期支付双息平衡混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2013年9月4日至2015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

张理军 基金经理 2013-09-04 2015-07-11 16年 张理军先生，经济学硕士。历任申万宏源证券研究所助理研究员、策略分析师、研究员，申万宏源证券有限公司资产管理部基金经理，2008年6月加入交银施罗德基金管理有限公司，历任行业研究员、基金经理助理、基金经理，2013年9月4日至2015年7月11日担任交银施罗德双息平衡混合型证券投资基金基金经理，2014年5月10日至2015年7月11日担任交银施罗德双息平衡混合型证券投资基金基金经理，2014年9月1日至2015年7月11日担任交银施罗德双息平衡混合型证券投资基金基金经理，2014年10月21日至2015年7月11日担任交银施罗德双息平衡混合型证券投资基金基金经理，2015年1月10日至2015年7月11日担任交银施罗德双息平衡混合型证券投资基金基金经理，2015年7月11日至2015年8月20日担任交银施罗德双息平衡混合型证券投资基金基金经理，2015年8月20日至2015年9月4日担任交银施罗德双息平衡混合型证券投资基金基金经理，2015年9月4日至2015年9月11日担任交银施罗德双息平衡混合型证券投资基金基金经理，2015年9月11日至2015年9月30日担任交银施罗德双息平衡混合型证券投资基金基金经理。

张理军先生长期从事证券研究工作，具有丰富的证券研究经验，具备良好的研究能力和丰富的投资管理经验，能够为本基金创造良好的投资回报。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规的说明

报告期内，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，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理运作基金资产，履行了法定职责，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

本公司制定了严格的投资控制制度和公平交易管理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，包括本基金在内的所有投资组合的总体交易偏差、分投资类别收益的偏差率差值等。

本公司执行公平交易制度的流程包括：对于不同类别资产的公平交易制度，对于非集中交易竞价交易、以公司名义进行的场外交易、遵循“价格优先、时间优先”的原则来确定投资方案；对于集中交易竞价交易，通过评估价差和波动率等方法，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、时间优先”的原则来确定投资方案。

4.4 报告期内基金的投资策略及运作分析

三季度，工业增长和PPI触底回升，下半年整体的板块风格以互联网、IT硬件跌幅甚大，但整体上仍有行业领涨的迹象。

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1.5659元，本报告份额净值增长率为-15.83%，同期业绩比较增长率为-14.81%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金报告期内无需特别预警说明。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

单位：人民币元

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 40,166,471.00 51.36

2 固定收益投资 20,406,734.70 21.41

3 其中：债券 20,406,734.70 21.41

4 货币市场基金 - -

5 金融衍生品投资 - -

6 其他 - -

7 其他资产 - -

8 合计 95,738,318.36 100.00

注：1.本基金费用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，本期利润为期初至本期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 本基金报告期内基金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(净值增长率差额) 业绩比较基准(净值增长率差额) 业绩比较基准收益率(1)-(2)

过去三个月 -12.15% 1.00% -0.81% -1.33%

3.2.2 本基金合同生效以来基金份额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

份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2013年12月25日至2015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。

§ 6 开放式基金份额持有人信息

6.1 报告期末基金份额持有人户数及持有人结构

6.2 报告期末基金份额前十名持有人

6.3 报告期末持有量最大的5名基金份额持有人情况

6.4 报告期内基金份额变动情况

6.5 报告期内基金投资组合报告

6.6 报告期内基金投资组合报告附注

6.7 报告期内基金投资组合报告附注

6.8 报告期内基金投资组合报告附注

6.9 报告期内基金投资组合报告附注

6.10 报告期内基金投资组合报告附注

6.11 报告期内基金投资组合报告附注

6.12 报告期内基金投资组合报告附注

6.13 报告期内基金投资组合报告附注

6.14 报告期内基金投资组合报告附注

6.15 报告期内基金投资组合报告附注

6.16 报告期内基金投资组合报告附注

6.17 报告期内基金投资组合报告附注

6.18 报告期内基金投资组合报告附注

6.19 报告期内基金投资组合报告附注

6.20 报告期内基金投资组合报告附注

6.21 报告期内基金投资组合报告附注

6.22 报告期内基金投资组合报告附注

6.23 报告期内基金投资组合报告附注

6.24 报告期内基金投资组合报告附注

6.25 报告期内基金投资组合报告附注

6.26 报告期内基金投资组合报告附注

6.27 报告期内基金投资组合报告附注

6.28 报告期内基金投资组合报告附注

6.29 报告期内基金投资组合报告附注

6.30 报告期内基金投资组合报告附注

6.31 报告期内基金投资组合报告附注

6.32 报告期内基金投资组合报告附注

6.33 报告期内基金投资组合报告附注

6.34 报告期内基金投资组合报告附注

6.35 报告期内基金投资组合报告附注

6.36 报告期内基金投资组合报告附注

6.37 报告期内基金投资组合报告附注

6.38 报告期内基金投资组合报告附注

6.39 报告期内基金投资组合报告附注

6.40 报告期内基金投资组合报告附注

6.41 报告期内基金投资组合报告附注

6.42 报告期内基金投资组合报告附注

6.43 报告期内基金投资组合报告附注

6.44 报告期内基金投资组合报告附注

6.45 报告期内基金投资组合报告附注

6.46 报告期内基金投资组合报告附注

6.47 报告期内基金投资组合报告附注

6.48 报告期内基金投资组合报告附注

6.49 报告期内基金投资组合报告附注

6.50 报告期内基金投资组合报告附注

6.51 报告期内基金投资组合报告附注

6.52 报告期内基金投资组合报告附注

6.53 报告期内基金投资组合报告附注

6.54 报告期内基金投资组合报告附注