

交银施罗德趋势优先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:中国工商银行股份有限公司
报告送达日期:二〇一五年十月十七日

§ 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、完整性承担责任。本公司承诺在公告前向中国证监会报送了基金合同文本，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。

基金经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。

基金过往业绩并不代表其未来表现。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。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

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 制造业	-	-	-
C 制造业	138,607,400.00	54.06	
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,900,400.00	1.15	
E 建筑业	20,584,702.21	8.16	
F 批发和零售业	6,170,450.62	2.45	
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	12,563,502.40	4.98	
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	-	-	
N 水利、环境和公共设施管理业	5,361,100.00	2.12	
O 居民服务、修理和其他服务业	-	-	
P 教育	-	-	
Q 卫生和社会工作	20,970,237.35	8.32	
R 文化、体育和娱乐业	-	-	
S 综合	-	-	
合计	207,167,929.00	82.16	

§ 3.3 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	000002	万科A	903,700	17,082,350.00	7.09
2	000415	康美药业	450,162	14,066,277.00	6.02
3	000605	京新药业	629,264	14,025,337.00	5.60
4	000673	通策医疗	176,971	13,272,901.60	5.26
5	000673	通策医疗	400,172	11,833,060.04	4.69
6	300025	芭庄时尚	799,117	10,907,047.00	4.33
7	002017	新南洋	644,258	9,676,755.00	3.94
8	600206	华域汽车	200,000	9,228,000.00	3.66
9	000660	万向钱潮	496,960	8,664,113.00	3.52
10	000004	银行	909,938	8,504,140.00	3.37

§ 3.4 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 150016 10农开16 100,000 10,003,000.00 3.09

§ 3.5 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 行政票据 - -

3 金融债券 10,003,000.00 3.09

其中:政策性金融债 10,003,000.00 3.09

4 企业债券 - -

5 中期票据 - -

6 可转债 - -

7 回购协议 - -

8 其他 - -

9 合计 10,003,000.00 3.09

§ 3.6 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贵金属投资明细

序号 代码 品种 数量(克) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 150016 10农开16 100,000 10,003,000.00 3.09

§ 3.7 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权证投资明细

序号 代码 品种 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 150016 10农开16 100,000 10,003,000.00 3.09

§ 3.8 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境外投资组合

序号 代码 品种 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 150016 10农开16 100,000 10,003,000.00 3.09

§ 3.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资组合

序号 代码 品种 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 150016 10农开16 100,000 10,003,000.00 3.09

§ 3.10 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组合

序号 代码 品种 数量(克) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 150016 10农开16 100,000 10,003,000.00 3.09

§ 3.11 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组合

序号 代码 品种 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 150016 10农开16 100,000 10,003,000.00 3.09

§ 3.12 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境外投资组合

序号 代码 品种 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 150016 10农开16 100,000 10,003,000.00 3.09

§ 3.13 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资产支持证券投资组合

序号 代码 品种 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 150016 10农开16 100,000 10,003,000.00 3.09

§ 3.14 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组合

序号 代码 品种 数量(克) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 150016 10农开16 100,000 10,003,000.00 3.09

§ 3.15 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组合

序号 代码 品种 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 150016 10农开16 100,000 10,003,000.00 3.09

§ 3.16 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境外投资组合

序号 代码 品种 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 150016 10农开16 100,000 10,003,000.00 3.09

§ 3.17 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资产支持证券投资组合

序号 代码 品种 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 150016 10农开16 100,000 10,003,000.00 3.09

§ 3.18 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组合

序号 代码 品种 数量(克) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 150016 10农开16 100,000 10,003,000.00 3.09

§ 3.19 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组合

序号 代码 品种 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 150016 10农开16 100,000 10,003,000.00 3.09

§ 3.20 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境外投资组合

序号 代码 品种 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 150016 10农开16 100,000 10,003,000.00 3.09

§ 3.21 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资产支持证券投资组合

序号 代码 品种 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 150016 10农开16 100,000 10,003,000.00 3.09

§ 3.22 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组合

序号 代码 品种 数量(克) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 150016 10农开16 100,000 10,003,000.00 3.09

§ 3.23 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组合

序号 代码 品种 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 150016 10农开16 100,000 10,003,000.00 3.09

§ 3.24 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境外投资组合

序号 代码 品种 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 150016 10农开16 100,000 10,003,000.00 3.09

§ 3.25 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资产支持证券投资组合

序号 代码 品种 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 150016 10农开16 100,000 10,003,000.00 3.09

§ 3.26 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组合

序号 代码 品种 数量(克) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 150016 10农开16 100,000 10,003,000.00 3.09

§ 3.27 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组合

序号 代码