

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:二〇一二年四月二十三日

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2012年4月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、账户信息等，保证复核结果与本报告一致。但不保证基金一定盈利。

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。投资人投资风险，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。

本报告附录财务数据未经审计。

本报告期自2012年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 交银信用添利债券

基金主代码 164902

交易代码 164902

契约型，本基金在基金合同期生效之日起三年(含三年)的期间内，采取封闭式运作(按照基金合同的约定提前转换基金运作方式的除外)，在深圳证券交易所上市交易，封闭期结束后转为上市开放式基金(LOF)

基金合同生效日 2011年7月27日

报告期末基金份额总额 1,895,085,749.23份

注:本基金建仓期为基金合同生效日起的6个月。截至建仓期结束及本报告期末，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书中有关投资比例的约定。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2012年1月1日-2012年3月31日)

1.本期已实现收益 33,273,220.71

2.本期利润 78,322,493.81

3.加权平均基金份额本期利润 0.0413

4.期末基金资产净值 1,925,387,700.59

5.期末基金份额净值 1.016

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低于所列数字。
2.本公司已就本基金定期利息收入、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金额向基金定期报告，基金定期报告中不体现本期间的应付利息收入。

3.2 基金净值增长率及其同行业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 绩效比较基准收益率③ 准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 4.21% 0.26% 0.76% 0.09% 3.45% 0.17%

3.2.2 本基金合同生效以来基金定期报告中“定期报告”与“同行业业绩比较基准收益变动的比较”

交银施罗德信用添利债券证券投资基金

基金份额净值增长率与同行业业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2011年7月27日至2012年3月31日)

交银施罗德信用添利债券证券投资基金

2012 第一季度报告



注:本基金建仓期为基金合同生效日起的6个月。截至建仓期结束及本报告期末，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书中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助理简介

姓名 职务 在本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

林洪伟 基金经理,交银施罗德基金管理有限公司投资部投资总监兼基金经理 8年 林洪伟先生，复旦大学学士，历任国泰君安证券股份有限公司上海分公司研究员、华泰联合证券有限公司研究员、华泰联合证券有限公司投资经理、华泰联合证券有限公司投资总监兼基金经理。2009年加入交银施罗德基金管理有限公司，现任专户投资部投资总监兼基金经理。

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，基金管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《交银施罗德信用添利债券证券投资基金基金合同》及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和运用基金资产，没有损害基金份额持有人的利益。

4.3 公平交易制度的执行情况

本公司制定严格的投票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建立良好的共享的研究平台，确保各投资组合获得公平的交易机会，通过交易系统实行比例配售，对于非集中竞价交易，以遵循“时间优先、价格优先、同比例分配”的原则；对于集中竞价交易，遵循“价格优先、先到先得”的原则；对于大宗交易，由基金经理根据具体情况决定是否执行。

4.4 公平交易专项说明

本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，本投资组合与公司旗下管理的不同的投资组合的平均收益差异、分投资组合的收益率差异以及不同投资组合的收益率差异均未出现异常。

4.5 报告期内公司履行公平交易制度、公平对待旗下各投资组合、本投资组合与公司旗下管理的不同的投资组合的平均收益差异、分投资组合的收益率差异以及不同投资组合的收益率差异均未发现异常。

4.6 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，确保各投资组合获得公平的交易机会，通过交易系统实行比例配售，对于非集中竞价交易，以遵循“时间优先、价格优先、同比例分配”的原则；对于集中竞价交易，遵循“价格优先、先到先得”的原则；对于大宗交易，由基金经理根据具体情况决定是否执行。

4.7 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，本投资组合与公司旗下管理的不同的投资组合的平均收益差异、分投资组合的收益率差异以及不同投资组合的收益率差异均未出现异常。

4.8 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，本投资组合与公司旗下管理的不同的投资组合的平均收益差异、分投资组合的收益率差异以及不同投资组合的收益率差异均未发现异常。

4.9 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，本投资组合与公司旗下管理的不同的投资组合的平均收益差异、分投资组合的收益率差异以及不同投资组合的收益率差异均未发现异常。

4.10 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，本投资组合与公司旗下管理的不同的投资组合的平均收益差异、分投资组合的收益率差异以及不同投资组合的收益率差异均未发现异常。

4.11 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，本投资组合与公司旗下管理的不同的投资组合的平均收益差异、分投资组合的收益率差异以及不同投资组合的收益率差异均未发现异常。

4.12 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，本投资组合与公司旗下管理的不同的投资组合的平均收益差异、分投资组合的收益率差异以及不同投资组合的收益率差异均未发现异常。

4.13 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，本投资组合与公司旗下管理的不同的投资组合的平均收益差异、分投资组合的收益率差异以及不同投资组合的收益率差异均未发现异常。

4.14 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，本投资组合与公司旗下管理的不同的投资组合的平均收益差异、分投资组合的收益率差异以及不同投资组合的收益率差异均未发现异常。

4.15 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，本投资组合与公司旗下管理的不同的投资组合的平均收益差异、分投资组合的收益率差异以及不同投资组合的收益率差异均未发现异常。

4.16 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，本投资组合与公司旗下管理的不同的投资组合的平均收益差异、分投资组合的收益率差异以及不同投资组合的收益率差异均未发现异常。

4.17 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，本投资组合与公司旗下管理的不同的投资组合的平均收益差异、分投资组合的收益率差异以及不同投资组合的收益率差异均未发现异常。

4.18 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，本投资组合与公司旗下管理的不同的投资组合的平均收益差异、分投资组合的收益率差异以及不同投资组合的收益率差异均未发现异常。

4.19 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，本投资组合与公司旗下管理的不同的投资组合的平均收益差异、分投资组合的收益率差异以及不同投资组合的收益率差异均未发现异常。

4.20 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，本投资组合与公司旗下管理的不同的投资组合的平均收益差异、分投资组合的收益率差异以及不同投资组合的收益率差异均未发现异常。

4.21 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，本投资组合与公司旗下管理的不同的投资组合的平均收益差异、分投资组合的收益率差异以及不同投资组合的收益率差异均未发现异常。

4.22 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，本投资组合与公司旗下管理的不同的投资组合的平均收益差异、分投资组合的收益率差异以及不同投资组合的收益率差异均未发现异常。

4.23 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，本投资组合与公司旗下管理的不同的投资组合的平均收益差异、分投资组合的收益率差异以及不同投资组合的收益率差异均未发现异常。

4.24 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，本投资组合与公司旗下管理的不同的投资组合的平均收益差异、分投资组合的收益率差异以及不同投资组合的收益率差异均未发现异常。

4.25 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，本投资组合与公司旗下管理的不同的投资组合的平均收益差异、分投资组合的收益率差异以及不同投资组合的收益率差异均未发现异常。

4.26 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，本投资组合与公司旗下管理的不同的投资组合的平均收益差异、分投资组合的收益率差异以及不同投资组合的收益率差异均未发现异常。

4.27 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，本投资组合与公司旗下管理的不同的投资组合的平均收益差异、分投资组合的收益率差异以及不同投资组合的收益率差异均未发现异常。

4.28 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，本投资组合与公司旗下管理的不同的投资组合的平均收益差异、分投资组合的收益率差异以及不同投资组合的收益率差异均未发现异常。

4.29 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，本投资组合与公司旗下管理的不同的投资组合的平均收益差异、分投资组合的收益率差异以及不同投资组合的收益率差异均未发现异常。

4.30 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，本投资组合与公司旗下管理的不同的投资组合的平均收益差异、分投资组合的收益率差异以及不同投资组合的收益率差异均未发现异常。

4.31 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，本投资组合与公司旗下管理的不同的投资组合的平均收益差异、分投资组合的收益率差异以及不同投资组合的收益率差异均未发现异常。

4.32 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，本投资组合与公司旗下管理的不同的投资组合的平均收益差异、分投资组合的收益率差异以及不同投资组合的收益率差异均未发现异常。

4.33 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，本投资组合与公司旗下管理的不同的投资组合的平均收益差异、分投资组合的收益率差异以及不同投资组合的收益率差异均未发现异常。

4.34 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，本投资组合与公司旗下管理的不同的投资组合的平均收益差异、分投资组合的收益率差异以及不同投资组合的收益率差异均未发现异常。

4.35 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，本投资组合与公司旗下管理的不同的投资组合的平均收益差异、分投资组合的收益率差异以及不同投资组合的收益率差异均未发现异常。

4.36 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，本投资组合与公司旗下管理的不同的投资组合的平均收益差异、分投资组合的收益率差异以及不同投资组合的收益率差异均未发现异常。

4.37 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，本投资组合与公司旗下管理的不同的投资组合的平均收益差异、分投资组合的收益率差异以及不同投资组合的收益率差异均未发现异常。

4.38 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，本投资组合与公司旗下管理的不同的投资组合的平均收益差异、分投资组合的收益率差异以及不同投资组合的收益率差异均未发现异常。

4.39 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，本投资组合与公司旗下管理的不同的投资组合的平均收益差异、分投资组合的收益率差异以及不同投资组合的收益率差异均未发现异常。

4.40 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，本投资组合与公司旗下管理的不同的投资组合的平均收益差异、分投资组合的收益率差异以及不同投资组合的收益率差异均未发现异常。

4.41 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格执行公平交易制度，公平对待