交银施罗德丰盈收益债券型证券投资基金

【2015】第一季度报告

基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年四月二十一日

§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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年4月20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1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	交银丰盈收益债券
基金主代码	519740
交易代码	519740
基金运作方式	契约型,本基金在基金合同生效之日起三年(含三年)的期间内封闭式运作(按照基金合同的约定提前转换基金运作方式的除外),封闭期结束后转为开放式运作
基金合同生效日	2014年8月11日
报告期末基金份额总额	510,658,140.93份
投资目标	追求在有效控制风险的前提下,力争为基金资产获得稳健的投资收益和超额回报。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势,融合规范化的基本面研究和严谨的信用分析,在分析和判断宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上,充分利用封闭式运作优势,以买入持有和杠杆套息等为基本投资策略,获取稳定收益;同时,本基金将严格控制信用风险,在严谨深入的信用分析基础上,综合考量信用债券的信用评级,以及各类债券的流动性、供求关系和收益率水平等,自下而上精选个券。
业绩比较基准	三年期银行定期存款税后收益率
风险收益特征	本基金是一只债券型基金,其风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金,属于证券投资基金中中等风险的品种。
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司

§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

基金简称	报告期(2015年1月1日-2015年3月31日)
1.本期已实现收益	9,296,970.74
2.本期利润	11,613,882.04
3.加权平均基金份额本期利润	0.0227
4.期末基金资产净值	523,065,929.81
5.期末基金份额净值	1.024

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	2.17%	0.14%	0.98%	0.01%	1.19%	0.13%

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

交银施罗德丰盈收益债券型证券投资基金
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2014年8月11日至2015年3月31日)

注:本基金基金合同生效日为2014年8月11日,基金合同生效日至报告期期末,本基金运作时间未满一年。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		
赵凌琦	本基金、交银理财60天债券、交银双轮动债券、交银定期支付月月丰债券、交银强化回报债券的基金经理,公司固定收益部副总经理	2014-08-11	-	2年	赵凌琦女士,10年金融投资经验,财政部财政科研所经济学硕士。历任中国航空集团财务公司投资经理,中国人寿资产管理有限公司投资经理。2013年加入交银施罗德基金管理有限公司。

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《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口(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年一季度债券市场呈明显的V型走势,收益率从一月初开始出现明显的下行,其中的背景是经济增速不断下行,物价水平面临通缩风险,在市场宽松预期下,央行实施全面降准和降息,但随着春节结束,资金面回落成空,货币市场利率持续维持在高位,此外,市场对经济增长的前景看法也出现分歧,而财政部计划实行的债务置换也加大了债券市场的供给压力,债券收益率一路上行,收益率基本回到年初的水平。

中债总全价(总值)指数在1月上涨0.78%,2月上涨0.67%,3月下跌1.99%。本基金继续保持稳健的封闭式操作,净值跑赢业绩比较基准。

展望后市,经过一季度调整,债市安全边际可能提升。短期来看,更多的地方政府债务置换形成的供给压力和股市行情可能会对债市形成一定的压制,但股和债的风险收益比可能也会动态调整,经济形势最终可能仍会倒逼货币政策加大放松,基本面和政策面均有望对债市的中期走势形成强有力支撑。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2015年3月31日,本基金份额净值为1.024元,本报告期份额净值增长率为2.17%,同期业绩比较基准增长率为0.98%。

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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	938,080,644.20	95.47
	其中:债券	938,080,644.20	95.47
	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	17,858,202.89	1.82
7	其他资产	26,678,351.09	2.72
8	合计	982,617,198.18	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,663,440.00	0.51
	其中:政策性金融债	2,663,440.00	0.51
4	企业债券	699,844,804.20	133.80
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	235,572,400.00	45.04
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	938,080,644.20	179.34

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	122828	11抚州债	450,000	46,876,500.00	8.96
2	122323	14凤凰债	450,000	45,180,000.00	8.64
3	122308	13杭岳债	400,000	41,200,000.00	7.88
4	1282358	12盐国投MTN1	400,000	41,192,000.00	7.88
5	1180080	11德清债	400,000	41,172,000.00	7.87

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 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	24,441.53
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	26,653,909.56
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	26,678,351.09

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

6.1 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。

6.2 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。

§7 影响投资者决策的其他重要信息

根据《关于发布<中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准>的通知》(中基协发[2014]24号)的要求,交银施罗德基金管理有限公司经与各基金托管人、会计师事务所协商一致,决定自2015年3月19日起对旗下基金持有的上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种主要依据第三方估值机构提供的价格数据进行估值,该通知另有规定的除外。

2015年3月19日当日进行的上述相关调整对前一估值日各基金资产净值的影响不超过0.50%。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会准予交银施罗德丰盈收益债券型证券投资基金募集注册的文件;

2、《交银施罗德丰盈收益债券型证券投资基金基金合同》;

3、《交银施罗德丰盈收益债券型证券投资基金招募说明书》;

4、《交银施罗德丰盈收益债券型证券投资基金托管协议》;

5、基金管理人业务资格批件、营业执照;

6、基金托管人业务资格批件、营业执照;

7、关于申请募集注册交银施罗德丰盈收益债券型证券投资基金的法律意见书;

8、报告期内交银施罗德丰盈收益债券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@jysld.com。

交银施罗德丰泽收益债券型证券投资基金

【2015】第一季度报告

基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年四月二十一日

§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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年4月20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1月30日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	交银丰泽收益债券
基金主代码	519749
交易代码	519749
基金运作方式	契约型,本基金在基金合同生效之日起两年(含两年)的期间内封闭式运作(按照基金合同的约定提前转换基金运作方式的除外),封闭期结束后转为开放式运作
基金合同生效日	2015年1月30日
报告期末基金份额总额	226,060,553.36份
投资目标	在严格控制风险的基础上,力争获取高于业绩比较基准的稳定收益。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势,融合规范化的基本面研究和严谨的信用分析,在分析和判断宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上,充分利用封闭式运作优势,以买入持有和杠杆套息等为基本投资策略,获取稳定收益;同时,本基金将严格控制信用风险,在严谨深入的信用分析基础上,综合考量信用债券的信用评级,以及各类债券的流动性、供求关系和收益率水平等,自下而上精选个券。
业绩比较基准	两年期银行定期存款税后收益率+1.25%
风险收益特征	本基金是一只债券型基金,其风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金,属于证券投资基金中中等风险的品种。
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司

§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1月30日(基金合同生效日)-2015年3月31日)
1.本期已实现收益	1,233,586.31
2.本期利润	-306,448.17
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0014
4.期末基金资产净值	225,754,105.19
5.期末基金份额净值	0.999

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、本基金合同生效日为2015年1月30日,基金合同生效日至本报告期期末,本基金运作时间未满三个月。

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
自基金合同生效起至今	-0.10%	0.06%	0.76%	0.02%	-0.86%	0.04%

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

交银施罗德丰泽收益债券型证券投资基金
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2015年1月30日至2015年3月31日)

注:本基金基金合同生效日为2015年1月30日,基金合同生效日至报告期期末,本基金运作时间未满一年。本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至2015年3月31日,本基金尚处于建仓期。

§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		
孙超	本基金、交银理财60天债券、交银双轮动债券、交银定期支付月月丰债券、交银强化回报债券、交银丰润收益债券、交银丰享收益债券的基金经理	2015-01-30	-	4年	孙超先生,美国哥伦比亚大学经济学硕士。历任中信建投证券股份有限公司资产管理部经理、高级经理。2013年加入交银施罗德基金管理有限公司,历任基金经理助理。

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口(如日内、3日内、5日内)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口(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

一季度,市场在强烈的货币宽松预期中迎来全面降准和降息,春节前债市乐观情绪达到顶峰。春节后由于稳增长政策进一步推出、资金面宽松不达预期以及《2015年地方政府专项债券预算管理办法》颁布后引起市场对利率债供给的担忧,债券市场出现较大幅度的调整。

中债总全价(总值)指数在1月上涨0.78%,2月上涨0.67%,3月下跌1.99%。本基金已完成大部分仓位配置,本报告期内运作较为稳健。

债券市场投资机会正在逐渐显现,预计资金宽松、短端利率下行是大概率事件,长端走势则应密切关注地方债推出对利率债供给的影响以及经济基本面企稳的可靠性。存款保险制度推出后,打破信用债刚性兑付的预期进一步上升,我们保持对低等级信用债的警惕。本基金二季度将完成全部仓位配置,以与封闭期适度匹配的债券配置进行杠杆操作,力争获取相对稳定的收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2015年3月31日,本基金份额净值为0.999元,本报告期份额净值增长率为-0.10%,同期业绩比较基准增长率为0.76%。

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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	338,644,001.64	96.83
	其中:债券	318,618,401.64	91.11
	资产支持证券	20,025,600.00	5.73
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	5,514,257.16	1.58
7	其他资产	5,561,688.96	1.59
8	合计	349,719,947.76	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	188,805,401.64	83.63
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	129,813,000.00	57.50
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	318,618,401.64	141.14

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	101454033	14马钢MTN001	200,000	20,400,000.00	9.04
2	1080133	10天业债	200,000	20,180,000.00	8.94
3	1280135	12昆钢控股债	200,000	20,104,000.00	8.91
4	101462040	14东方MTN001	200,000	20,026,000.00	8.87
5	122362	14沪宝债	200,000	19,997,843.29	8.86

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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	119122	15金通A2	200,000	20,025,600.00	8.87

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 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	9,439.53
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,552,249.43
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,561,688.96

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

6.1 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。

6.2 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。

§7 影响投资者决策的其他重要信息

根据《关于发布<中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准>的通知》(中基协发[2014]24号)的要求,交银施罗德基金管理有限公司经与各基金托管人、会计师事务所协商一致,决定自2015年3月19日起对旗下基金持有的上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种主要依据第三方估值机构提供的价格数据进行估值,该通知另有规定的除外。

2015年3月19日当日进行的上述相关调整对前一估值日各基金资产净值的影响不超过0.50%。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会准予交银施罗德丰泽收益债券型证券投资基金募集注册的文件;

2、《交银施罗德丰泽收益债券型证券投资基金基金合同》;

3、《交银施罗德丰泽收益债券型证券投资基金招募说明书》;

4、《交银施罗德丰泽收益债券型证券投资基金托管协议》;

5、基金管理人业务资格批件、营业执照;

6、基金托管人业务资格批件、营业执照;

7、关于申请募集注册交银施罗德丰泽收益债券型证券投资基金的法律意见书;

8、报告期内交银施罗德丰泽收益债券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@jysld.com。

交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金

【2015】第一季度报告

基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年四月二十一日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年4月20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1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	交银沪深300分层等权指数
基金主代码	519714
交易代码	519714(前端) 519715(后端)
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年11月7日
报告期末基金份额总额	6,784,829.67份
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为指数型基金,绝大部分资产采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数,即按照成份股在沪深300行业分层等权重指数中的成份股组成及其权重构建股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。
业绩比较基准	沪深300行业分层等权重指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金属于股票基金,风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。同时本基金为指数型基金,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§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1月1日-2015年3月31日)
1.本期已实现收益	403,598.14
2.本期利润	2,128,164.56
3.加权平均基金份额本期利润	0.2843
4.期末基金资产净值	11,883,893.46
5.期末基金份额净值	1.752

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。

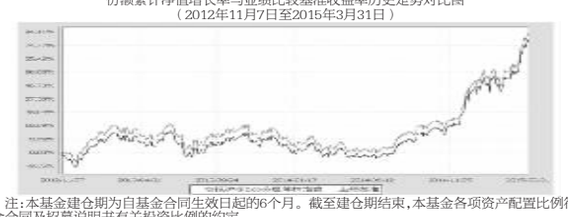
3.2 基金净值表现

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	20.50%	1.52%	21.62%	1.52%	-1.12%	0.00%

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

交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金
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
(2012年11月7日至2015年3月31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		
蔡铮	本基金、交银上证180公司治理ETF及其联接基金、交银深证300价值ETF及其联接基金、交银国证新能源指数分级基金的基金经理,公司量化投资部助理总经理	2012-12-27	-	6年	蔡铮先生,复旦大学电子工程硕士。历任瑞士银行香港分行分析员。2009年加入交银施罗德基金管理有限公司,历任投资研究部数量分析师、基金经理助理。

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口(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年第一季度,国内经济增速依旧低迷,经济基本面对资本市场的支持力度较为有限。但随着无风险利率下行预期和居民大类资产配置对风险资产的偏好,市场维持着自去年第四季度以来的强势行情。市场结构分化比较显著,代表结构转型和技术进步的投资标的表现突出。作为跟踪基准指数的指数基金,在本季度获得较为可喜的涨幅。

展望未来一个季度,在微刺激的经济政策背景下,预计货币政策将逐渐趋于宽松,预计股市将持续震荡向上。在整体政策着力于改革与结构调整的大趋势下,市场或将进入良性有序的可持续发展阶段。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2015年3月31日,本基金份额净值为1.752元,本报告期份额净值增长率为20.50%,同期业绩比较基准增长率为21.62%。本报告期