交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金

【2014】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:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年四月二十二日

§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2014年4月18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2014年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	交银纯债债券发起
基金主代码	519718
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年12月19日
报告期末基金份额总额	181,400,602.95份
投资目标	本基金为纯债基金,在严格控制投资风险的基础上,追求稳定的当期收益和基金资产的稳健增值。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势,将规范化的基本面研究,严谨的信用分析与积极主动的投资风格相结合,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,动态调整大类金融资产比例,自上而下决定债券组合久期、期限结构、债券类别配置策略,在严谨深入的分析基础上,综合考量各类债券的流动性、供求关系和收益率水平等,自下而上地精选个券。
业绩比较基准	中债综合全价指数
风险收益特征	本基金是一只债券型基金,属于证券投资基金中中等风险的品种,其长期平均的预期收益和风险高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。
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
下属两级基金的基金简称	交银纯债债券发起A/B　交银纯债债券发起C
下属两级基金的交易代码	519718(前端),519719(后端)　519720
报告期末下属两级基金的份额总额	170,008,855.48份　11,391,747.47份

注:1、本基金A类基金份额采用前端收费模式,B类基金份额采用后端收费模式,前端交易代码因为A类基金份额交易代码,后端交易代码因为B类基金份额交易代码。
2、本基金为发起式基金。

§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(2014年1月1日-2014年3月31日)	
	交银纯债债券发起A/B	交银纯债债券发起C
1.本期已实现收益	-1,175,782.92	-66,428.59
2.本期利润	4,224,215.83	281,523.45
3.加权平均基金份额本期利润	0.0202	0.0174
4.期末基金资产净值	171,608,596.41	11,411,490.38
5.期末基金份额净值	1.009	1.002

注:1、本基金A/B类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

1、交银纯债债券发起A/B:

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	2.02%	0.11%	1.61%	0.08%	0.41%	0.03%

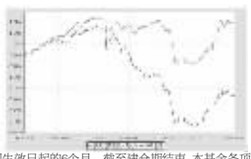
2、交银纯债债券发起C:

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	1.83%	0.11%	1.61%	0.08%	0.22%	0.03%

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

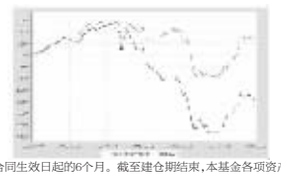
交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2012年12月19日至2014年3月31日)

1. 交银纯债债券发起A/B



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。

2. 交银纯债债券发起C



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		
胡军华	本基金、交银理财60天债券、交银双轮动债券的基金经理,公司固定收益部总经理	2012-12-19	2014-03-31	22年	胡军华女士,中国人民大学经济学硕士。历任中国经济开发信托投资公司证券业务总部研究部副总经理,华鑫证券有限公司深圳营业部副总经理,原南方证券有限公司债券业务总部投资经理,招商基金管理有限公司固定收益部总监、基金经理,瑞银证券资产管理部/财富管理部董事,高级投资组合经理。其中2005年5月至2006年5月担任招商现金增值开放式证券投资基金基金经理,2005年8月至2008年12月担任招商安泰系列证券投资基金基金经理,2006年7月至2008年12月担任招商安本增利债券型证券投资基金基金经理。2012年加入交银施罗德基金管理有限公司,2012年12月19日至2014年3月30日担任交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金基金经理,公司固定收益部副总经理
林洪钧	本基金、交银货币、交银信用添利债券(LOF)、交银理财21天债券的基金经理,交银荣安保本混合、交银荣祥保本混合的基金经理助理,公司固定收益部助理总经理	2014-03-31	-	10年	林洪钧先生,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机构客户部客户经理,华安基金管理有限公司债券交易员,加拿大Financial Engineering Source Inc.金融研究员。2009年加入交银施罗德基金管理有限公司,历任专户投资部投资经理助理、专户投资经理。

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,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

本报告期内,本公司管理的所有投资组合未发生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超过该证券当日总成交量5%的情形。本基金于本报告期内未出现异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2014年伊始,去年孱弱的债券市场似乎慢慢出现了些许变化:紧绷的流动性神经开始舒缓,银行间7天质押式回购利率在春节后逐步降低,3月上旬基本平稳在2.5%水平;通胀低于预期,经济复苏动能同样低于预期;债券市场在2月份、3月初经历了一波小阳春行情。在这种背景下,2月份债券市场表现相当养眼,中、高评级的企业债收益率一路下行,城投债重新受到投资者青睐,部分城投债收益率下行100—150BP。然而,正当市场对债市的憧憬升温之际,3月份市场似乎又悄然发生了一些变化:汇率波动改革造成人民币贬值预期,贬值预期影响了外汇占款流入预期,随之影响的是债券市场对流动性的预期;于此同时,保经济的可能性在不断挑战债券投资者原先乐观的预期。在此情况下,整个3月份,债市表现平平,收益率出现了小幅上升。

宏观方面,1、2月份数据相对较少,1、2月累计工业增加值8.6%,远低此前预期;1月通胀2.5%,2月通胀2.0%,都处较低水平;同时2月PPI继续下降达到-2.0%也反映了市场需求仍比较疲弱。在疲弱的基本面下,债券市场风向标的10年国债收益率却一直维持在4.5%水平,这反映了今年债券市场较为纠结的情绪。利率未动而信用先行的局面可能显示出:一季度债券的小阳春可能更多的仅仅是流动性改善因素导致。

本基金持有的高等级中票在2月份表现较好。

展望二季度,受汇率影响,流动性预期发生变化;保增长财政措施导致经济预期的变化及供给可能出现的变化,债券市场面临不确定性因素增加;因此,二季度,本基金保持较谨慎态度,计划将降低组合内债券持仓及久期,以持有票息为主。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2014年3月31日,交银纯债债券发起A/B份额净值为1.009元,本报告期份额净值增长率为2.02%,同期业绩比较基准增长率为1.61%;交银纯债债券发起C份额净值为1.002元,本报告期份额净值增长率为1.83%,同期业绩比较基准增长率为1.61%。

§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	212,949,000.00	93.47
	其中:债券	212,949,000.00	93.47
	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	517,998.03	0.23
7	其他资产	14,355,922.23	6.30
8	合计	227,822,920.26	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	79,114,000.00	43.23
	其中:政策性金融债	79,114,000.00	43.23
4	企业债券	54,836,000.00	29.96
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	78,999,000.00	43.16
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	212,949,000.00	116.35

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	140203	14国开03	300,000	30,273,000.00	16.54
2	130236	13国开36	200,000	19,978,000.00	10.92
3	101354022	13兴泸MTN001	200,000	19,900,000.00	10.87
4	1382028	13山水MTN1	200,000	19,722,000.00	10.78
5	130246	13国开46	200,000	19,348,000.00	10.57

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	376.06
2	应收证券清算款	10,231,971.81
3	应收股利	-
4	应收利息	4,122,676.27
5	应收申购款	898.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,355,922.23

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

本基金本报告期末未持有股票。

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

项目	交银纯债债券发起A/B	交银纯债债券发起C
本报告期期初基金份额总额	244,216,310.62	17,168,323.37
本报告期基金总申购份额	9,055,160.10	21,475,688.15
减:本报告期基金总赎回份额	83,262,615.24	27,252,264.05
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	170,008,855.48	11,391,747.47

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

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,072,734.64
本报告期买入/申购总份额	-
本报告期卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,072,734.64
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	5.55

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。

7.2 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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,072,734.64	5.55%	10,003,472.22	5.51%	不低于三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,072,734.64	5.55%	10,003,472.22	5.51%	-

注:本报告期末持有份额总数为发起份额总数和截至本报告期末红利再投份额数的合计。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金募集的文件;
2、《交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》;
3、《交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金招募说明书》;
4、《交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金托管协议》;
5、关于募集交银施罗德纯债债券型发起式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纯债债券型发起式证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

9.3 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

【2014】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:二〇一四年四月二十二日

§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2014年4月18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2014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	19,126,895.04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(2014年1月1日-2014年3月31日)
1.本期已实现收益	-733,722.36
2.本期利润	-2,233,812.68
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0926
4.期末基金资产净值	18,822,593.62
5.期末基金份额净值	0.984

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。

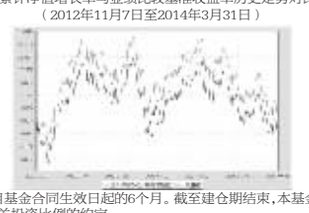
3.2 基金净值表现

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	-8.26%	1.19%	-7.58%	1.20%	-0.68%	-0.01%

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2014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及其联接基金基金经理	2012-12-27	-	5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。

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

本报告期内,本公司管理的所有投资组合未发生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超过该证券当日总成交量5%的情形。本基金于本报告期内未出现异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2014年第一季度,经济和市场走势大致呈现震荡下跌格局。年初至二月上旬,经济小幅回落,市场仍延续去年以来的成长主题;二月下旬至三月国内经济下行加速,PMI、制造业投资、消费等各项经济指标均低于预期,使市场加速下探。作为跟踪基准指数的指数基金,在本季度内总体震荡下探。

展望第二季度,宏观经济在整体政策取向改革与结构调整的背景下仍将保持稳速增长,政府持续、坚决的推进改革及转型,或能增强投资者对中长期经济的信心,使得市场进入良性可持续的回暖阶段。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2014年3月31日,本基金份额净值为0.984元,本报告期份额净值增长率为-8.26%,同期业绩比较基准增长率为-7.58%。本报告期内本基金的日均跟踪偏离度为0.04%,跟踪误差为0.04%。

§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	17,670,230.46	93.04
	其中:股票	17,670,230.46	93.04
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	1,311,410.42	6.90
7	其他资产	11,317.27	0.06
8	合计	18,992,958.15	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

5.2.2 指数投资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	287,271.59	1.53
B	采矿业	1,891,990.28	10.05
C	制造业	8,141,451.72	43.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,997,467.30	10.61
E	建筑业	509,145.84	2.70
F	批发和零售业	782,987.60	4.16
G	交通运输、仓储和邮政业	317,985.65	1.69
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	891,133.50	4.73
J	金融业	1,375,987.83	7.31
K	房地产业	609,502.17	3.24
L	租赁和商务服务业	244,961.96	1.30
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	144,534.37	0.77
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	302,866.43	1.61
S	综合	172,944.22	0.92
	合计	17,670,230.46	93.88

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小的股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资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	600886	国投电力	40,252	185,159.20	0.98
2	600027	华电国际	52,896	163,977.60	0.87
3	600863	内蒙华电	45,360	161,028.00	0.86
4	600674	川投能源	14,294	159,806.92	0.85
5	600795	国电电力	66,633	157,253.88	0.84
6	600011	华能国际	31,031	156,396.24	0.83
7	600008	首创股份	22,922	151,285.20	0.80
8	600642	申能股份	34,042	150,465.64	0.80
9	600900	长江电力	25,859	149,206.43	0.79
10	601139	深圳燃气	20,056	145,004.88	0.77

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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	4,625.70
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	424.10
5	应收申购款	6,267.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,317.27

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 报告期末投资的股票存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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

本报告期期初基金份额总额	26,223,680.55
本报告期基金总申购份额	1,521,523.28
减:本报告期基金总赎回份额	8,618,308.79
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	19,126,895.04

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

本报告期内本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

本基金托管人2014年2月7日发布任免通知,解聘尹东中国建设银行投资托管业务部总经理助理职务。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会核准交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金募集的文件;
2、《交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金基金合同》;
3、《交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金招募说明书》;
4、《交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金托管协议》;
5、关于申请募集交银施罗德沪深300行业分层等权重指数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沪深300行业分层等权重指数证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

9.3 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。

交银施罗德理财60天债券型证券投资基金

【2014】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:二〇一四年四月二十二日

§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2014年4月18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2014年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	交银理财60天债券	
基金主代码	519721	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年3月13日	
报告期末基金份额总额	18,146,202.29份	
投资目标	本基金在追求本金安全、保持资产流动性的基础上,努力追求绝对收益,为基金份额持有人谋求资产的稳定增值。	
投资策略	本基金在保持组合流动性的前提下,结合对国内外宏观经济运行、金融市场运行、资金流动格局、货币市场收益率曲线形态等各方面的分析,合理安排组合期限结构,积极选择投资工具,采取主动性的投资策略和精细化的操作手法。	
业绩比较基准	人民币七天通知存款税后利率	
风险收益特征	本基金属于短期理财债券型证券投资基金,长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金及普通债券型基金,高于货币市场型证券投资基金。	
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	交银理财60天债券A	交银理财60天债券B
下属两级基金的交易代码	519721	519722
报告期末下属两级基金的份额总额	18,146,202.29份	-

§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(2014年1月1日-2014年3月31日)	
	交银理财60天债券A	交银理财60天债券B
1.本期已实现收益	222,320.12	29,841.78
2.本期利润	222,320.12	29,841.78
3.期末基金资产净值	18,146,202.29	-

注:1、自合同生效日起,本基金实行销售服务费分类收费方式,分设两类基金份额:A类基金份额和B类基金份额。A类基金份额与B类基金份额的管理费、托管费相同,A类基金份额按照0.30%的年费率计提销售服务费,B类基金份额按照0.01%的年费率计提销售服务费。
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,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金