

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:二〇一五年三月三十一日
§ 1 重要提示

1.1 基金管理人的董事会、监事会、董事对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、完整性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事签发。

基金管理人、基金托管人、中信银行股份有限公司以下简称“中信银行”）根据本基金合同规定，于2015年3月30日复核了本基金报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其摘要。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

本报告期自2014年8月11日起至12月31日止。

§ 2 基金简介

基金简称	交银施罗德丰盈收益债券型证券投资基金
基金代码	510686
交易代码	510740
契约型基金，本基金在基金合同生效后三年（含三年）的期间内封闭式运作（按照基金合同的约定提前终止封闭运作方式的除外），封闭期结束后开放为开放式。	
基金合同生效日	2014年8月11日
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
报告期末基金资产总额	510,686,140.93%
基金合同的延续	不定期

2.1 基金基本情况

基金名称	交银施罗德丰盈收益债券型证券投资基金
基金代码	510740
交易代码	510740
契约型基金，本基金在基金合同生效后三年（含三年）的期间内封闭式运作（按照基金合同的约定提前终止封闭运作方式的除外），封闭期结束后开放为开放式。	
基金合同生效日	2014年8月11日
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
报告期末基金资产总额	510,686,140.93%
基金合同的延续	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在有效控制风险的前提下，力争为基金投资者获得稳健的收益和超越回报。
投资策略	本基金在分析基金投资人的风险承受能力、综合考虑宏观经济状况和金融市场运行趋势的基础上，充分运用封闭式运作机制，以买入持有和杠杠投资为基本投资策略，获取稳定收益。同时，本基金将根据宏观经济形势和证券市场的变化，适时调整投资策略，以各种投资品种的流动性、风险收益特征为投资对象，追求资产的保值增值。
业绩比较基准	三年定期银行存款利率+0.2%
风险收益特征	本基金是一只债券基金，其风险与预期收益率低于股票市场基金，低于混合型基金和股票基金，属于证券投资基金中等风险的产品。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	交银施罗德基金管理有限公司	中信银行股份有限公司
姓名	孙晓	方静
信息披露负责 人	董新宇	010-89903630
电子邮箱	xsp@jysjtd.com, disclosure@jysjtd.com	fangwei@citicbank.com
客户服务电话	400-700-5000, 021-61065000	96598
传真	021-61055004	010-66660832

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.jysjtd.com, www.bocomanager.com
基金管理人办公地址	基金管理人办公地址

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标		金额单位:人民币元
3.1.1 本期数据和指标	2014年8月11日（基金合同生效日）至2014年12月31日	
本期实现收益	11,918,866.10	
加权平均基金份额本期利润	1.11,007,067.79	0.0218
本期基金份额净值增长率	2.20%	
3.1.2 期末数据和指标	2014年末	
可供分配基金份额利润	0.022	
基金份额净值	521,666,208.72	
基金份额净值增长率	1.022	

注:1、上述基金的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不计费用的水平。

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2014年8月11日，基金合同生效日至本报告期末，本基金运作时间未满一年。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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	份额净值增长 率	业绩比较基 准收益率	业绩比较基 准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	0.89%	0.20%	1.00%	0.01%	-0.17%
自基金合同生 命日起至今	2.20%	0.23%	1.60%	0.01%	0.64%

注:本基金的业绩比较基准为三年期银行定期存款利率后收益率。

3.2.2 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比

较

注:本基金的业绩比较基准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不计费用的水平。

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2014年8月11日，基金合同生效日至本报告期末，本基金运作时间未满一年。

3.2.3 基金净值表现

3.2.1.1 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	份额净值增长 率	业绩比较基 准收益率	业绩比较基 准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	0.89%	0.20%	1.00%	0.01%	-0.17%
自基金合同生 命日起至今	2.20%	0.23%	1.60%	0.01%	0.64%

注:本基金的业绩比较基准为三年期银行定期存款利率后收益率。

3.2.2.1 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比

较

注:本基金的业绩比较基准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不计费用的水平。

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2014年8月11日，基金合同生效日至本报告期末，本基金运作时间未满一年。

3.2.3.1 基金净值表现

3.2.3.1.1 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	份额净值增长 率	业绩比较基 准收益率	业绩比较基 准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	0.89%	0.20%	1.00%	0.01%	-0.17%
自基金合同生 命日起至今	2.20%	0.23%	1.60%	0.01%	0.64%

注:本基金的业绩比较基准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不计费用的水平。

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2014年8月11日，基金合同生效日至本报告期末，本基金运作时间未满一年。

3.2.4 基金净值表现

3.2.4.1 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	份额净值增长 率	业绩比较基 准收益率	业绩比较基 准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	0.89%	0.20%	1.00%	0.01%	-0.17%
自基金合同生 命日起至今	2.20%	0.23%	1.60%	0.01%	0.64%

注:本基金的业绩比较基准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不计费用的水平。

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2014年8月11日，基金合同生效日至本报告期末，本基金运作时间未满一年。

3.2.5 基金净值表现

3.2.5.1 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	份额净值增长 率	业绩比较基 准收益率	业绩比较基 准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	0.89%	0.20%	1.00%	0.01%	-0.17%
自基金合同生 命日起至今	2.20%	0.23%	1.60%	0.01%	0.64%

注:本基金的业绩比较基准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不计费用的水平。

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2014年8月11日，基金合同生效日至本报告期末，本基金运作时间未满一年。