交银施罗德现金宝货币市场基金

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	交银现金宝货币
基金主代码	000710
交易代码	000710
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年9月12日
报告期末基金份额总额	311,143,841.45份
投资目标	在力求本金安全性和资产充分流动性的前提下,追求超过业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金在保持组合高度流动性的前提下,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	活期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金属于货币市场基金,是证券投资基金中的低风险品种,长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。
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1日-2015年3月31日)
1.本期已实现收益	2,551,888.06
2.本期利润	2,551,888.06
3.期末基金资产净值	311,143,841.45

注:1、自合同生效日起,本基金按照0.25%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,由于货币市场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

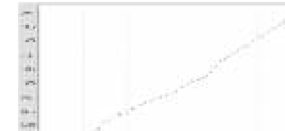
3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	1.0828%	0.0087%	0.0863%	0.0000%	0.9965%	0.0087%

注:本基金收益分配按日结转份额。

3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

交银施罗德现金宝货币市场基金
累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2014年9月12日至2015年3月31日)



注:本基金基金合同生效日为2014年9月12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		
林洪钧	本基金、交银货币、交银增利债券、交银信用添利债券(LOF)、交银理财21天债券、交银纯债债券发起的基金经理,公司固定收益部助理总经理	2014-09-12	–	11年	林洪钧先生,复旦大学硕士。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、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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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下(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

本报告期内,经济增长动能呈现进一步疲弱态势。1、2月工业增加值急速下滑至6.8,中采PMI在1、2月份跌破50枯荣线，分别为49.8、49.9,3月份稍有反弹至50.1；从金融数据上看,2月新增信贷11437亿,社会融资规模13532亿,从结构上看,居民中长期贷款较去年同期略有上升;经济增压压力在一季度逐渐增大,在此宏观背景下,货币政策及财政政策均采取了一定的对冲措施。货币政策层面,本报告期内央行降低存款准备金率50BP至19.5%,并在3月份降息25BP至2.5%。其他政策层面,3月30日房地产新政也将对稳增长起到一定作用。而通胀在一季度较为稳定,CPI 1月份0.76%,2月受春节等季节性因素影响上升至1.43%,但仍处于较低水平。较低的通胀也给后续的货币政策提供了较好的基础。

本报告期内,债券市场受权益市场的扰动尤为明显,跷跷板效应在一季度显示的较为明显。债券市场在一季度呈现了完全倒V字形走势。在1、2月份,由于经济数据表现不佳,市场对未来经济的担忧，以及对货币政策的预期，使债券收益率在1、2月份大幅下行。2015年第一期10年国开债(150205)在2月初发行票面为3.81%,在2月中上旬收益一度下行至3.65%附近,但在2月下旬降准之后,收益率开始逐步回升,上行至4.2%左右。2月下旬至整个3月份,由于IPO新股回报较高以及权益资产的良好表现,债券市场承受较大的压力,机构在资产配置时,债券资产的配置也受到一定挤压,债市的需求端受到一定的影响;除了需求受压之外,供给端是造成3月债市承压的最主要原因。政府债务置换将增加一万亿的利率产品,市场担心完全会由商业银行自行承担。从央行货币政策的连贯性上看,目前时点,大幅宽松的可能性仍较低,因此利率产品供给增加给债券市场增加了许多不确定因素,债券收益率也因此大幅上升。本报告期内,中债总财富指数上涨0.32%,绝大部分收益发生在1月份及2月上半月。

货币市场受IPO影响较为明显,本报告期内呈现间歇性地较为紧张情况;与此对应,存款及短期融资券收益率在一季度保持较高水平。

本基金本报告期内保持较低的债券仓位,同时由于规模逐渐增加,组合适度使用了杠杆,以增加基金在一季度的回报。

展望二季度,对债券市场而言,权益市场以及对供给的担忧是短期压制债券市场的最大两个因素;但通胀处于较低水平以及经济增长仍然疲弱对债券市场都有较强支撑,从这个层面上看,我们对货币政策仍可以有一定期待。总体而言,我们对二季度债券市场仍持中性偏谨慎观点,以十年期国开债为代表的长端收益率预计在3.9—4.4之间宽幅震荡,各种因素的互相干扰或将导致二季度债券收益率波动加大,同时也会增加债券市场的交易性机会。组合管理方面,本组合计划将适当增加短期融资券的仓位,同时,由于受IPO的冲击,组合在杠杆使用上将适度谨慎,争取在保持流动性平稳的同时,努力增加基金收益。

4.5报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金净值收益率为1.0828%,同期业绩比较基准增长率为0.0863%。

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	固定收益投资	92,303,694.02	28.95
	其中:债券	92,303,694.02	28.95
	资产支持证券	–	–
2	买入返售金融资产	–	–
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
3	银行存款和结算备付金合计	210,615,817.11	66.06
4	其他资产	15,897,187.69	4.99
5	合计	318,816,698.82	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目		占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额		5.79
	其中:买断式回购融资		–
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	7,424,876.29	2.39
	其中:买断式回购融资	–	–

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个银行间市场交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本基金本报告期内债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	66
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	84
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	9

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本基金合同约定:"本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天"。本报告期内,本基金未发生超标情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	16.27	2.39
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
2	30天(含)—60天	32.79	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
3	60天(含)—90天	28.93	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
4	90天(含)—180天	19.37	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
5	180天(含)—397天(含)	–	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
	合计	97.36	2.39

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	摊余成本(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	22,008,757.50	7.07
	其中:政策性金融债	22,008,757.50	7.07
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	70,294,936.52	22.59
6	中期票据	–	–
7	其他	–	–
8	合计	92,303,694.02	29.67
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	–	–

5.5 报告期末按摊余成本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	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	041461041	14潍坊滨投CP001	200,000	20,113,447.98	6.46
2	041472011	14江阴公CP001	200,000	20,110,917.17	6.46
3	071503002	15中信CP002	200,000	20,017,145.65	6.43
4	140213	14国开13	200,000	20,007,292.23	6.43
5	041472013	14日照港CP002	100,000	10,053,425.72	3.23
6	140212	14国开12	20,000	2,001,465.27	0.64

5.6"影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0次
报告期内偏离度的最高值	0.1205%
报告期内偏离度的最低值	-0.0090%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0222%

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。

5.8投资组合报告附注

5.8.1基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内按照实际利率和摊余成本逐日摊销计算损益。

5.8.2本基金报告期每日持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本均未超过当日基金资产净值的20%。

5.8.3报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体除15中信CP002（证券代码:071503002）外,未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

报告期内本基金投资的前十名证券之一15中信CP002(证券代码:071503002)的发行主体中信证券于2015年1月18日公告称,公司因存在为到期融资融券合约展期的问题,被中国证监会采取暂停新开融资融券客户信用账户3个月的行政监管措施。

本基金管理人对该证券投资决策程序的说明如下：本基金管理人对证券投资特别是重仓个券的投资有严格的投资决策流程控制。本基金在对该证券的投资也严格执行投资决策流程。在对该证券的选择上,严格执行公司个券审核流程。在对该证券的持有过程中研究员密切关注债券发行主体动向。在上述处罚发生时及时分析其对投资决策的影响,经过分析认为此事件对债券发行主体财务状况、经营成果和现金流量未产生重大的实质性影响,所以不影响对该债券基本面和投资价值的判断。

5.8.4其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	–
2	应收证券清算款	–
3	应收利息	3,431,403.98
4	应收申购款	12,465,783.71
5	其他应收款	–
6	待摊费用	–
7	其他	–
8	合计	15,897,187.69

5.8.5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

报告期期初基金份额总额	599,443,763.51
本报告期期间基金总申购份额	567,373,524.85
本报告期期间基金总赎回份额	855,673,446.91
报告期期末基金份额总额	311,143,841.45

注:1、如果本报告期间发生转换入、份额级别调整、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、份额级别调整业务,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;本基金管理人本报告期末持有本基金份额0.00份,占本基金期末总份额的0.00%。

§8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%。

§9备查文件目录

9.1备查文件目录

1、中国证监会准予交银施罗德现金宝货币市场基金募集注册的文件;
2、《交银施罗德现金宝货币市场基金基金合同》;
3、《交银施罗德现金宝货币市场基金招募说明书》;
4、《交银施罗德现金宝货币市场基金托管协议》;
5、关于申请募集交银施罗德现金宝货币市场基金的法律意见书;
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现金宝货币市场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。

交银施罗德新成长股票型证券投资基金

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:招商银行股份有限公司
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。

基金托管人招商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	交银新成长股票	
基金主代码	519736	
交易代码	519736(前端)	519737(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014年5月9日	
报告期末基金份额总额	134,129,970.06份	
投资目标	深入挖掘经济转型背景下的投资机会,自下而上精选个股,力争实现基金资产的长期稳定增值。	
投资策略	本基金充分发挥基金管理人研究优势,在经济转型大背景下,分析和判断宏观经济运行变化和政府产业政策等多因素影响,积极挖掘不同行业和子行业景气度新变化下的个股投资机会,通过团队对个股深入的基本面研究和细致的实地调研,精选公司品质良好、成长具有可持续性、定价相对合理的股票进行投资,以谋求超额收益。	
业绩比较基准	75%×富时中国A600成长指数+25%×中信标普全债指数	
风险收益特征	本基金是一只股票型基金,其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金,属于承担较高预期风险、预期收益较高的证券投资基金品种。	
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	

§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	24,482,848.16
2.本期利润	58,725,410.38
3.加权平均基金份额本期利润	0.5232
4.期末基金资产净值	214,066,022.06
5.期末基金份额净值	1.596

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。

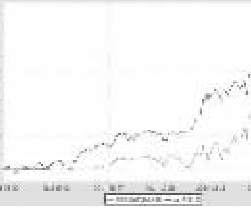
3.2 基金净值表现

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	46.96%	1.57%	20.02%	1.09%	26.94%	0.48%

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

交银施罗德新成长股票型证券投资基金
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
(2014年5月9日至2015年3月31日)



注:本基金基金合同生效日为2014年5月9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		
管华雨	本基金、交银施罗德成长股票证券投资基金,公司权益投资总监	2014-05-09	–	13年	管华雨先生,CFA,博士学历。历任申银万国证券股份有限公司投资部投资经理、高级投资经理,信诚基金管理有限公司分析师、基金经理助理和基金经理。其中2007年5月至2010年5月担任信诚四季红混合型证券投资基金基金经理。2010年加入交银施罗德基金管理有限公司,历任权益部总经理助理、副总经理、总经理,2010年10月8日至2015年3月23日担任交银施罗德成长股票证券投资基金基金经理,2010年12月22日至2012年3月12日担任交银施罗德趋势优先股票证券投资基金基金经理,2012年3月13日至2013年4月25日担任交银施罗德精选股票证券投资基金基金经理,2013年6月5日至2014年10月21日担任交银施罗德成长30股票型证券投资基金基金经理,2013年8月8日至2014年10月21日担任交银施罗德趋势优先股票证券投资基金基金经理。
王崇	本基金的基金经理	2014-10-22	–	7年	王崇先生,北京大学金融学博士。2008年加入交银施罗德基金管理有限公司,历任行业分析师、高级研究员。

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下(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,中国经济仍旧处于缓慢下行探底过程中,工业增加值增速不佳,内在通缩压力较大。与此同时政府加大反周期操作力度,采取相对积极的财政政策和稳健偏松的货币政策托底经济。在去年股票市场赚钱效应下,住户部门资产开始加速向股权市场转移,A股市场一季度经历了较大幅度的上涨,其中,以创业板中小板为首的中小市值新兴产业股票大幅跑赢主板市场的大型传统周期类股票。

本基金一季度采取均衡配置的策略,精选各个行业内优质成长龙头企业布局,整体表现跑赢业绩比较基准。其中,在医药、食品饮料、建筑装饰、传媒等行业获得较好收益。

展望未来,宽松货币政策环境有望持续相当一段时间,股票市场投资或仍旧处于较好的阶段。与此同时我们也看到部分板块泡沫已现,寻找估值处于合理范围的优质成长股难度在加大。本基金继续看好互联网对传统行业改造,国企改革、技术进步和商业模式创新带来的投资机会,继续坚持在一定安全边际的前提下,投资具有良好成长前景的行业和个股,努力为持有人创造较好的投资回报。

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1.596元,本报告期份额净值增长率为46.96%,同期业绩比较基准增长率为20.02%。

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	193,363,923.14	87.00
	其中:股票	193,363,923.14	87.00
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	25,281,797.29	11.38
7	其他资产	3,602,804.85	1.62
8	合计	222,248,525.28	100.00

5.2 报告期末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	–	–
B	采矿业	–	–
C	制造业	91,671,732.97	42.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,176,000.00	1.02
E	建筑业	17,230,489.39	8.05
F	批发和零售业	–	–
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	18,341,852.00	8.57
J	金融业	32,006,872.36	14.95
K	房地产业	6,747,181.00	3.15
L	租赁和商务服务业	6,833,292.06	3.19
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	1,825,500.00	0.85
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	12,164,403.36	5.68
R	文化、体育和娱乐业	4,366,600.00	2.04
S	综合	–	–
	合计	193,363,923.14	90.33

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

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	601318	中国平安	203,464	15,919,023.36	7.44
2	002568	百润股份	185,369	14,857,325.35	6.94
3	300347	泰格医药	223,282	12,164,403.36	5.68
4	002280	联络互动	82,200	11,664,180.00	5.45
5	002081	金螳螂	317,620	11,170,695.40	5.22
6	002180	艾派克	299,990	9,743,675.20	4.55
7	000681	视觉中国	220,878	9,097,964.82	4.25
8	300028	金亚科技	180,000	6,899,400.00	3.22
9	002400	省广股份	166,747	6,833,292.06	3.19
10	000671	阳光城	336,350	6,747,181.00	3.15

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	132,398.89
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	6,042.54
5	应收申购款	3,464,363.42
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	3,602,804.85

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000671	阳光城	6,747,181.00	3.15	重大事项
2	002280	联络互动	11,664,180.00	5.45	重大事项
3	002180	艾派克	9,743,675.20	4.55	重大事项

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

报告期期初基金份额总额	164,340,938.05
本报告期期间基金总申购份额	85,892,908.09
减:本报告期期间基金总赎回份额	116,103,876.08
本报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	–
报告期期末基金份额总额	134,129,970.06

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

本报告期内未发生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

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%。

§9备查文件目录

9.1备查文件目录

1、中国证监会准予交银施罗德新成长股票型证券投资基金募集注册的文件;
2、《交银施罗德新成长股票型证券投资基金基金合同》;
3、《交银施罗德新成长股票型证券投资基金招募说明书》;
4、《交银施罗德新成长股票型证券投资基金托管协议》;
5、关于申请募集注册交银施罗德新成长股票型证券投资基金的法律意见书;
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新成长股票型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。

交银施罗德信用添利债券证券投资基金(LOF)

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:中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业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	交银信用添利债券(LOF)	
场内简称	交银添利	
基金主代码	164902	
交易代码	164902(前端)	164903(后端)
基金运作方式	上市契约型开放式	
基金合同生效日	2011年1月27日	
报告期末基金份额总额	95,357,608.89份	
投资目标	本基金根据宏观经济运行状况和金融市场的运行趋势,自上而下进行宏观分析,自下而上精选个券,在控制信用风险、利率风险和流动性风险前提下,力求通过主动承担适度信用风险获得持续投资收益,谋求基金资产的长期稳定增长。	
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及债券类属配置;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,自下而上地精选个券。同时,本基金也会关注股票一级市场、权证一级市场等其它相关市场存在的投资机会,力争实现基金总体风险收益特征保持不变前提下的基金资产增值最大化。	
业绩比较基准	80%×中债企业债总全价指数收益率+20%×中债国债总全价指数收益率	
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	

注:根据本基金《基金合同》及《招募说明书》的相关规定,本基金在基金合同生效之日起三年(含三年)的期间内,采取封闭式运作,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)。本基金封闭期自2011年1月27日(基金合同生效日)起至2014年1月27日止,自2014年1月28日起基金运作方式转为"上市契约型开放式",并于同日起开放本基金的申购、赎回业务。本基金在募集期仅开通前端基金份额的认购,转为上市开放式基金(LOF)后将同时开通前端基金份额和后端基金份额的申购和赎回。

§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	538,980.62
2.本期利润	928,677.73
3.加权平均基金份额本期利润	0.0079
4.期末基金资产净值	110,779,754.55
5.期末基金份额净值	1.162

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。

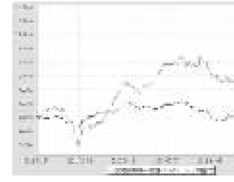
3.2 基金净值表现

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	0.78%	0.41%	-0.61%	0.10%	1.39%	0.31%

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

交银施罗德信用添利债券证券投资基金(LOF)
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
(2011年1月27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		
林洪钧	本基金、交银货币、交银增利债券、交银理财21天债券、交银纯债债券发起、交银现金宝货币的基金经理,公司固定收益部助理总经理	2011-01-27	–	11年	林洪钧先生,复旦大学硕士。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、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下(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

本报告期内,经济增长动能呈现进一步疲弱态势。1、2月工业增加值急速下滑至6.8,中采PMI在1、2月份跌破50枯荣线，分别为49.8、49.9,3月份稍有反弹至50.1；从金融数据上看,2月新增信贷11437亿,社会融资规模13532亿,从结构上看,居民中长期贷款较去年同期略有上升;经济增压压力在一季度逐渐增大,在此宏观背景下,货币政策及财政政策均采取了一定的对冲措施。货币政策层面,本报告期内央行降低存款准备金率50BP至19.5%,并在3月份降息25BP至2.5%。其他政策层面,3月30日房地产新政也将对稳增长起到一定作用。而通胀在一季度较为稳定,CPI1月份0.76%,2月受春节等季节性因素影响上升至1.43%，但仍处于较低水平。较低的通胀也给后续的货币政策提供了较好的基础。

本报告期内,债券市场受权益市场的扰动尤为明显,跷跷板效应在一季度显示地较为明显。债券市场在一季度呈现了完全倒V字形走势。在1、2月份,由于经济数据表现不佳,市场对未来经济的担忧，以及对货币政策的预期，使债券收益率在1、2月份大幅下行。2015年第一期10年国开债(150205)在2月初发行票面为3.81%,在2月中上旬收益一度下行至3.65%附近,但在2月下旬降准之后,收益率开始逐步回升,上行至4.2%左右。2月下旬至整个3月份,由于IPO新股回报较高以及权益资产的良好表现,债券市场承受较大的压力,机构在资产配置时,债券资产的配置也受到一定挤压,债市的需求端受到一定的影响;除了需求受压之外,供给端是造成3月债市承压的最主要原因。政府债务置换将增加一万亿的利率产品,市场担心完全会由商业银行自行承担。从央行货币政策的连贯性上看,目前时点,大幅宽松的可能性仍较低,因此利率产品供给增加给债券市场增加了许多不确定因素,债券收益率也因此大幅上升。本报告期内,中债总财富指数上涨0.32%,绝大部分收益发生在1月份及2月上半月。

本基金本报告期内债券仓位逐渐降低,基金净值贡献主要来自于组合内债券票息收入以及部分权益类资产的收益。由于组合在一季度对债券持仓组合进行了一定调整,将组合内流动性较弱的品种调整出组合,调整过程给基金净值带来了一定的影响。

展望二季度,对债券市场而言,权益市场以及对供给的担忧是短期压制债券市场的最大两个因素;但通胀处于较低水平以及经济增长仍然疲弱对债券市场都有较强支撑,从这个层面上看,我们对货币政策仍可以有一定期待。总体而言,我们对二季度债券市场仍持中性偏谨慎观点,以十年期国开债为代表的长端收益率预计在3.9—4.4之间宽幅震荡，各种因素的互相干扰或将导致二季度债券收益率波动加大,同时也会增加债券市场的交易性机会。组合管理方面,本组合计划保持较短的久期,同时将增加交易性的仓位;另一方面,可转债等权益性资产持仓有可能仍为组合在二季度的收益的主要来源。

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1.162元,本报告期份额净值增长率为0.78%,同期业绩比较基准增长率为-0.61%。

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	9,036,000.00	4.88
	其中:股票	9,036,000.00	4.88
2	固定收益投资	156,529,683.60	84.60
	其中:债券	156,529,683.60	84.60
	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	16,389,398.56	8.86
7	其他资产	3,060,463.33	1.65
8	合计	185,015,545.49	100.00

5.2 报告期末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	–	–
B	采矿业	–	–
C	制造业	9,036,000.00	8.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	–	–
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	–	–
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	–	–
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	–	–
S	综合	–	–
	合计	9,036,000.00	8.16

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

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	601989	中国重工	900,000	9,036,000.00	8.16

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	29,548,000.00	26.67
	其中:政策性金融债	29,548,000.00	26.67
4	企业债券	97,514,683.60	88.03
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	29,467,000.00	26.60
7	可转债	–	–
8	其他	–	–
9	合计	156,529,683.60	141.30

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	122826	11北港债	200,000	20,300,000.00	18.32
2	150203	15国开03	200,000	19,548,000.00	17.65
3	1382136	13乌兰煤MTN1	200,000	19,474,000.00	17.58
4	124517	14怀化02	160,000	17,166,400.00	15.50
5	122302	13天房债	100,000	10,585,000.00	9.55

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	32,440.41
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	2,965,204.99
5	应收申购款	62,817.93
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	3,060,463.33

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 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	118,796,383.24
本报告期期间基金总申购份额	27,497,035.11
减:本报告期期间基金总赎回份额	50,935,809.46
本报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	–
报告期期末基金份额总额	95,357,608.89

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

本报告期内未发生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

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%。

§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信用添利债券证券投资基金募集的文件;
2、《交银施罗德信用添利债券证券投资基金基金合同》;
3、《交银施罗德信用添利债券证券投资基金招募说明书》;
4、《交银施罗德信用添利债券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、关于申请募集交银施罗德信用添利债券证券投资基金之法律意见书;
8、报告期内交银施罗德信用添利债券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。