

## 交银施罗德荣安保本混合型证券投资基金

## [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。

基金托管人中行银行股份有限公司根据本基金合同的规定，于二〇一五年四月二十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。

基金过往业绩并不代表未来表现。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	交银荣安保本混合
基金代码	519170
交易代码	519170
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年6月20日
报告期末基金份额总额	696,474,389.43份

本基金追求资本增值，在风险控制的前提下，通过稳健资产与风险资产的合理配置，力争实现本基金资产的稳定增值。

本基金采用CPPI(Constant Propportion Portfolio Insurance)策略，通过调整股票资产的风险资产在基金组合中的资产比例，以确保本基金在保本周期到期时的本金安全，并实现基金资产在保本基础上的稳定增值。

业绩比较基准：三年定期存款利率后收益率

风险收益特征：本基金是一只保本混合型基金，在证券投资基金中属中低风险品种。

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

中国投资者协会有限公司

§ 3 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 84,412,969.23

2.本期利润 85,576,100.09

3.加权平均基金份额本期利润 0.1177

4.期末基金份额净值 849,284,118.20

5.期末基金份额净值 1.219

注:1.本基金的申购赎回费用不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计费规则详见基金合同和招募说明书。

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.基金净值是指基金资产总值除以基金份额净值，通常情况下，基金净值是不会有折增、折减的。

4.期末基金份额净值=基金资产净值/基金份额总数。

5.期末基金份额净值=基金资产净值/基金份额总数。

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，计费规则详见基金合同和招募说明书。

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.加权平均基金份额本期利润=本期利润/期末基金份额总数。

4.期末基金份额净值=基金资产净值/基金份额总数。

5.期末基金份额净值=基金资产净值/基金份额总数。

注:本基金建仓期为自基金合同生效日起的9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相关说明有关规定的比例。

§ 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
项群祥	本基金基金经理	2012-06-20	-	16年

注:本基金基金经理于2012年6月20日开始履行基金经理的职责。

4.2 管理人对报告期内基金运作的说明

在报告期内，本基金严格遵守《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，本着诚信、审慎、规范的原则，认真履行了管理人职责，实现了基金资产的保值增值。

4.3 公平交易制度的执行情况

本公司严格按照《公平交易制度》和《公平交易监控制度》进行公平交易，旗下所有理财产品都有相应的公平交易政策，包括证券投资基金、集合资产管理计划、企业年金、养老金、保险资金等。

本公司对不同客户账户均实行公平交易制度，确保各投资组合获得公平对待。

4.4 报告期内公平交易情况的说明

一、定期报告期间，风险调整后收益较高的投资组合在交易时机选择上优先于风险较低的投资组合，从而使得定期报告期间内不同投资组合之间的收益率差异显著。

二、定期报告期间，风险调整后收益较高的投资组合在交易时机选择上优先于风险较低的投资组合，从而使得定期报告期间内不同投资组合之间的收益率差异显著。

三、定期报告期间，风险调整后收益较高的投资组合在交易时机选择上优先于风险较低的投资组合，从而使得定期报告期间内不同投资组合之间的收益率差异显著。

四、定期报告期间，风险调整后收益较高的投资组合在交易时机选择上优先于风险较低的投资组合，从而使得定期报告期间内不同投资组合之间的收益率差异显著。

五、定期报告期间，风险调整后收益较高的投资组合在交易时机选择上优先于风险较低的投资组合，从而使得定期报告期间内不同投资组合之间的收益率差异显著。

六、定期报告期间，风险调整后收益较高的投资组合在交易时机选择上优先于风险较低的投资组合，从而使得定期报告期间内不同投资组合之间的收益率差异显著。

七、定期报告期间，风险调整后收益较高的投资组合在交易时机选择上优先于风险较低的投资组合，从而使得定期报告期间内不同投资组合之间的收益率差异显著。

八、定期报告期间，风险调整后收益较高的投资组合在交易时机选择上优先于风险较低的投资组合，从而使得定期报告期间内不同投资组合之间的收益率差异显著。

九、定期报告期间，风险调整后收益较高的投资组合在交易时机选择上优先于风险较低的投资组合，从而使得定期报告期间内不同投资组合之间的收益率差异显著。

十、定期报告期间，风险调整后收益较高的投资组合在交易时机选择上优先于风险较低的投资组合，从而使得定期报告期间内不同投资组合之间的收益率差异显著。

十一、定期报告期间，风险调整后收益较高的投资组合在交易时机选择上优先于风险较低的投资组合，从而使得定期报告期间内不同投资组合之间的收益率差异显著。

十二、定期报告期间，风险调整后收益较高的投资组合在交易时机选择上优先于风险较低的投资组合，从而使得定期报告期间内不同投资组合之间的收益率差异显著。

十三、定期报告期间，风险调整后收益较高的投资组合在交易时机选择上优先于风险较低的投资组合，从而使得定期报告期间内不同投资组合之间的收益率差异显著。

十四、定期报告期间，风险调整后收益较高的投资组合在交易时机选择上优先于风险较低的投资组合，从而使得定期报告期间内不同投资组合之间的收益率差异显著。

十五、定期报告期间，风险调整后收益较高的投资组合在交易时机选择上优先于风险较低的投资组合，从而使得定期报告期间内不同投资组合之间的收益率差异显著。

十六、定期报告期间，风险调整后收益较高的投资组合在交易时机选择上优先于风险较低的投资组合，从而使得定期报告期间内不同投资组合之间的收益率差异显著。

十七、定期报告期间，风险调整后收益较高的投资组合在交易时机选择上优先于风险较低的投资组合，从而使得定期报告期间内不同投资组合之间的收益率差异显著。

十八、定期报告期间，风险调整后收益较高的投资组合在交易时机选择上优先于风险较低的投资组合，从而使得定期报告期间内不同投资组合之间的收益率差异显著。

十九、定期报告期间，风险调整后收益较高的投资组合在交易时机选择上优先于风险较低的投资组合，从而使得定期报告期间内不同投资组合之间的收益率差异显著。

二十、定期报告期间，风险调整后收益较高的投资组合在交易时机选择上优先于风险较低的投资组合，从而使得定期报告期间内不同投资组合之间的收益率差异显著。

二十一、定期报告期间，风险调整后收益较高的投资组合在交易时机选择上优先于风险较低的投资组合，从而使得定期报告期间内不同投资组合之间的收益率差异显著。

二十二、定期报告期间，风险调整后收益较高的投资组合在交易时机选择上优先于风险较低的投资组合，从而使得定期报告期间内不同投资组合之间的收益率差异显著。

二十三、定期报告期间，风险调整后收益较高的投资组合在交易时机选择上优先于风险较低的投资组合，从而使得定期报告期间内不同投资组合之间的收益率差异显著。

二十四、定期报告期间，风险调整后收益较高的投资组合在交易时机选择上优先于风险较低的投资组合，从而使得定期报告期间内不同投资组合之间的收益率差异显著。

二十五、定期报告期间，风险调整后收益较高的投资组合在交易时机选择上优先于风险较低的投资组合，从而使得定期报告期间内不同投资组合之间的收益率差异显著。

二十六、定期报告期间，风险调整后收益较高的投资组合在交易时机选择上优先于风险较低的投资组合，从而使得定期报告期间内不同投资组合之间的收益率差异显著。

二十七、定期报告期间，风险调整后收益较高的投资组合在交易时机选择上优先于风险较低的投资组合，从而使得定期报告期间内不同投资组合之间的收益率差异显著。

二十八、定期报告期间，风险调整后收益较高的投资组合在交易时机选择上优先于风险较低的投资组合，从而使得定期报告期间内不同投资组合之间的收益率差异显著。

二十九、定期报告期间，风险调整后收益较高的投资组合在交易时机选择上优先于风险较低的投资组合，从而使得定期报告期间内不同投资组合之间的收益率差异显著。

三十、定期报告期间，风险调整后收益较高的投资组合在交易时机选择上优先于风险较低的投资组合，从而使得定期报告期间内不同投资组合之间的收益率差异显著。

三十一、定期报告期间，风险调整后收益较高的投资组合在交易时机选择上优先于风险较低的投资组合，从而使得定期报告期间内不同投资组合之间的收益率差异显著。

三十二、定期报告期间，风险调整后收益较高的投资组合在交易时机选择上优先于风险较低的投资组合，从而使得定期报告期间内不同投资组合之间的收益率差异显著。

三十三、定期报告期间，风险调整后收益较高的投资组合在交易时机选择上优先于风险较低的投资组合，从而使得定期报告期间内不同投资组合之间的收益率差异显著。

三十四、定期报告期间，风险调整后收益较高的投资组合在交易时机选择上优先于风险较低的投资组合，从而使得定期报告期间内不同投资组合之间的收益率差异显著。

三十五、定期报告期间，风险调整后收益较高的投资组合在交易时机选择上优先于风险较低的投资组合，从而使得定期报告期间内不同投资组合之间的收益率差异显著。

三十六、定期报告期间，风险调整后收益较高的投资组合在交易时机选择上优先于风险较低的投资组合，从而使得定期报告期间内不同投资组合之间的收益率差异显著。

三十七、定期报告期间，风险调整后收益较高的投资组合在交易时机选择上优先于风险较低的投资组合，从而使得定期报告期间内不同投资组合之间的收益率差异显著。

三十八、定期报告期间，风险调整后收益较高的投资组合在交易时机选择上优先于风险较低的投资组合，从而使得定期报告期间内不同投资组合之间的收益率差异显著。

三十九、定期报告期间，风险调整后收益较高的投资组合在交易时机选择上优先于风险较低的投资组合，从而使得定期报告期间内不同投资组合之间的收益率差异显著。

四十、定期报告期间，风险调整后收益较高的投资组合在交易时机选择上优先于风险较低的投资组合，从而使得定期报告期间内不同投资组合之间的收益率差异显著。

四十一、定期报告期间，风险调整后收益较高的投资组合在交易时机选择上优先于风险较低的投资组合，从而使得定期报告期间内不同投资组合之间的收益率差异显著。

四十二、定期报告期间，风险调整后收益较高的投资组合在交易时机选择上优先于风险较低的投资组合，从而使得定期报告期间内不同投资组合之间的收益率差异显著。

四十三、定期报告期间，风险调整后收益较高的投资组合在交易时机选择上优先于风险较低的投资组合，从而使得定期报告期间内不同投资组合之间的收益率差异显著。

四十四、定期报告期间，风险调整后收益较高的投资组合在交易时机选择上优先于风险较低的投资组合，从而使得定期报告期间内不同投资组合之间的收益率差异显著。

四十五、定期报告期间，风险调整后收益较高的投资组合在交易时机选择上优先于风险较低的投资组合，从而使得定期报告期间内不同投资组合之间的收益率差异显著。

四十六、定期报告期间，风险调整后收益较高的投资组合在交易时机选择上优先于风险较低的投资组合，从而使得定期报告期间内不同投资组合之间的收益率差异显著。

四十七、定期报告期间，风险调整后收益较高的投资组合在交易时机选择上优先于风险较低的投资组合，从而使得定期报告期间内不同投资组合之间的收益率差异显著。

四十八、定期报告期间，风险调整后收益较高的投资组合在交易时机选择上优先于风险较低的投资组合，从而使得定期报告期间内不同投资组合之间的收益率差异显著。

四十九、定期报告期间，风险调整后收益较高的投资组合在交易时机选择上优先于风险较低的投资组合，从而使得定期报告期间内不同投资组合之间的收益率差异显著。

五十、定期报告期间，风险调整后收益较高的投资组合在交易时机选择上优先于风险较低的投资组合，从而使得定期报告期间内不同投资组合之间的收益率差异显著。

五十一、定期报告期间，风险调整后收益较高的投资组合在交易时机选择上优先于风险较低的投资组合，从而使得定期报告期间内不同投资组合之间的收益率差异显著。

五十二、定期报告期间，风险调整后收益较高的投资组合在交易时机选择上优先于风险较低的投资组合，从而使得定期报告期间内不同投资组合之间的收益率差异显著。

五十三、定期报告期间，风险调整后收益较高的投资组合在交易时机选择上优先于风险较低的投资组合，从而使得定期报告期间内不同投资组合之间的收益率差异显著。

五十四、定期报告期间，风险调整后收益较高的投资组合在交易时机选择上优先于风险较低的投资组合，从而使得定期报告期间内不同投资组合之间的收益率差异显著。

五十五、定期报告期间，风险调整后收益较高的投资组合在交易时机选择上优先于风险较低的投资组合，从而使得定期报告期间内不同投资组合之间的收益率差异显著。

五十六、定期报告期间，风险调整后收益较高的投资组合在交易时机选择上优先于风险较低的投资组合，从而使得定期报告期间内不同投资组合之间的收益率差异显著。

五十七、定期报告期间，风险调整后收益较高的投资组合在交易时机选择上优先于风险较低的投资组合，从而使得定期报告期间内不同投资组合之间的收益率差异显著。

五十八、定期报告期间，风险调整后收益较高的投资组合在交易时机选择上优先于风险较低的投资组合，从而使得定期报告期间内不同投资组合之间的收益率差异显著。

五十九、定期报告期间，风险调整后收益较高的投资组合在交易时机选择上优先于风险较低的投资组合，从而使得定期报告期间内不同投资组合之间的收益率差异显著。

六十、定期报告期间，风险调整后收益较高的投资组合在交易时机选择上优先于风险较低的投资组合，从而使得定期报告期间内不同投资组合之间的收益率差异显著。

六十一、定期报告期间，风险调整后收益较高的投资组合在交易时机选择上优先于风险较低的投资组合，从而使得定期报告期间内不同投资组合之间的收益率差异显著。

六十二、定期报告期间，风险调整后收益较高的投资组合在交易时机选择上优先于风险较低的投资组合，从而使得定期报告期间内不同投资组合之间的收益率差异显著。

六十三、定期报告期间，风险调整后收益较高的投资组合在交易时机选择上优先于风险较低的投资组合，从而使得定期报告期间内不同投资组合之间的收益率差异显著。

六十四、定期报告期间，风险调整后收益较高的投资组合在交易时机选择上优先于风险较低的投资组合，从而使得定期报告期间内不同投资组合之间的收益率差异显著。

六十五、定期报告期间，风险调整后收益较高的投资组合在交易时机选择上优先于风险较低的投资组合，从而使得定期报告期间内不同投资组合之间的收益率差异显著。</p