

交银施罗德蓝筹股票证券投资基金

[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

报告期截止日期:二〇一五年四月二十一日

重要提示
基金管理人的董事会及高级管理人员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。
基金托管人对本基金年度报告的基本情况、运作合规性等事项进行了复核，确认不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金投资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预示其未来表现。投资人投资于本基金前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告书对财务资料未经审计。

本报告书自2015年1月1日起至3月31日止。

5.2 基金产品概况

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农林、牧、渔业	17,441,782.12	0.24
B	制造业	53,329,513.48	0.73
C	批发业	2,886,158,549.79	39.37
D	电力、热力、燃气及水生产供应业	204,345,373.70	2.79
E	建筑业	654,649,716.62	8.95
F	批发和零售业	134,305,295.99	1.84
G	交通运输、仓储和邮政业	130,710,372.04	1.79
H	其他行业	-	-
I	信息技术服务	887,603,009.41	12.13
J	金融业	1,034,303,276.48	14.14
K	房地产业	278,152,614.27	3.80
L	租赁和商务服务业	168,275,455.49	2.30
M	科学研究、技术服务和地质勘查业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	37,049,200.00	0.51
O	教育	-	-
P	卫生和社会工作	136,317,339.60	1.86
Q	文化、体育和娱乐业	210,356,466.48	2.88
R	综合	18,441,200.00	0.25
S	合计	684,813,221.43	93.98

5.3 主要财务指标和基金净值表现

5.3.1 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	615,273,802.97	
2.本期利润	1,753,608,360.61	
3.期末可供分配利润本年末利润	6,227.33	
4.期末基金资产净值	7,315,798,307.55	
5.期末基金份额净值	1.0482	

注:1.上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的费用,计算费用后的实际收益水平要低于上述数字;
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。

3.2.1 基金估值表现

3.2.1.1 本报告期前十名份额增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计增长幅度及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2.1 交银施罗德蓝筹股票证券投资基金历史走势图

(2007年8月8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36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中投资比例的约定。

§ 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	任本基金的日期	离任本基金的日期	说明
李黎黎	基金经理	2014-10-22	-	本基金基金经理,2014年10月22日起开始担任本基金基金经理,2016年1月1日起不再担任本基金基金经理,交银施罗德基金管理有限公司,2016年1月1日起不再担任本基金基金经理。
李黎黎	基金经理助理	2014-10-22	-	本基金基金经理助理,2014年10月22日起开始担任本基金基金经理助理,2016年1月1日起不再担任本基金基金经理助理,交银施罗德基金管理有限公司,2016年1月1日起不再担任本基金基金经理助理。
孙晓	基金经理助理	2014-10-22	-	本基金基金经理助理,2014年10月22日起开始担任本基金基金经理助理,2016年1月1日起不再担任本基金基金经理助理,交银施罗德基金管理有限公司,2016年1月1日起不再担任本基金基金经理助理。
基金经理	(本基金基金经理小组)简介			本公司制作了严格的资产控制制度和公平交易制度来保证旗下基金运作的公平,旗下所管理的所有投资组合,包括股票投资基⾦和债券投资基⾦,均严格遵守在合乎规定的交易制度下进行投资决策,并确保公平的交易制度,建立公开的交易制度,对于交易对象上公允竞价交易,遵循“时间优先、价格优先、比例配售”的原则,全部通过交易所系统进行比例配售;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、比例分摊”的原则,根据事先独立的定价原则和运用基金资产,基金投资管理符合适用法律法 律法规的规定,并代其承担相应的法律责任。

4.3 公平交易制度的执行情况

4.3.1 平等对待所有客户的执行情况

4.3.2 异常交易行为的专门说明

4.3.3 公开披露异常交易行为的专项说明

4.3.4 报告期内未进行定期报告的专项说明

4.3.5 交易价格未达到异常波动标准的专项说明

4.3.6 本公司未将基金投资收益分配给任何机构的情况

4.3.7 本公司未将基金投资收益分配给任何个人的情况

4.3.8 本公司未将基金投资收益分配给任何单位的情况

4.3.9 本公司未将基金投资收益分配给任何组织的情况

4.3.10 本公司未将基金投资收益分配给任何其他机构的情况

4.3.11 本公司未将基金投资收益分配给任何个人的情况

4.3.12 本公司未将基金投资收益分配给任何单位的情况

4.3.13 本公司未将基金投资收益分配给任何组织的情况

4.3.14 本公司未将基金投资收益分配给任何其他机构的情况

4.3.15 本公司未将基金投资收益分配给任何个人的情况

4.3.16 本公司未将基金投资收益分配给任何单位的情况

4.3.17 本公司未将基金投资收益分配给任何组织的情况

4.3.18 本公司未将基金投资收益分配给任何其他机构的情况

4.3.19 本公司未将基金投资收益分配给任何个人的情况

4.3.20 本公司未将基金投资收益分配给任何单位的情况

4.3.21 本公司未将基金投资收益分配给任何组织的情况

4.3.22 本公司未将基金投资收益分配给任何其他机构的情况

4.3.23 本公司未将基金投资收益分配给任何个人的情况

4.3.24 本公司未将基金投资收益分配给任何单位的情况

4.3.25 本公司未将基金投资收益分配给任何组织的情况

4.3.26 本公司未将基金投资收益分配给任何其他机构的情况

4.3.27 本公司未将基金投资收益分配给任何个人的情况

4.3.28 本公司未将基金投资收益分配给任何单位的情况

4.3.29 本公司未将基金投资收益分配给任何组织的情况

4.3.30 本公司未将基金投资收益分配给任何其他机构的情况

4.3.31 本公司未将基金投资收益分配给任何个人的情况

4.3.32 本公司未将基金投资收益分配给任何单位的情况

4.3.33 本公司未将基金投资收益分配给任何组织的情况

4.3.34 本公司未将基金投资收益分配给任何其他机构的情况

4.3.35 本公司未将基金投资收益分配给任何个人的情况

4.3.36 本公司未将基金投资收益分配给任何单位的情况

4.3.37 本公司未将基金投资收益分配给任何组织的情况

4.3.38 本公司未将基金投资收益分配给任何其他机构的情况

4.3.39 本公司未将基金投资收益分配给任何个人的情况

4.3.40 本公司未将基金投资收益分配给任何单位的情况

4.3.41 本公司未将基金投资收益分配给任何组织的情况

4.3.42 本公司未将基金投资收益分配给任何其他机构的情况

4.3.43 本公司未将基金投资收益分配给任何个人的情况

4.3.44 本公司未将基金投资收益分配给任何单位的情况

4.3.45 本公司未将基金投资收益分配给任何组织的情况

4.3.46 本公司未将基金投资收益分配给任何其他机构的情况

4.3.47 本公司未将基金投资收益分配给任何个人的情况

4.3.48 本公司未将基金投资收益分配给任何单位的情况

4.3.49 本公司未将基金投资收益分配给任何组织的情况

4.3.50 本公司未将基金投资收益分配给任何其他机构的情况

4.3.51 本公司未将基金投资收益分配给任何个人的情况

4.3.52 本公司未将基金投资收益分配给任何单位的情况

4.3.53 本公司未将基金投资收益分配给任何组织的情况

4.3.54 本公司未将基金投资收益分配给任何其他机构的情况

4.3.55 本公司未将基金投资收益分配给任何个人的情况

4.3.56 本公司未将基金投资收益分配给任何单位的情况

4.3.57 本公司未将基金投资收益分配给任何组织的情况

4.3.58 本公司未将基金投资收益分配给任何其他机构的情况

4.3.59 本公司未将基金投资收益分配给任何个人的情况

4.3.60 本公司未将基金投资收益分配给任何单位的情况

4.3.61 本公司未将基金投资收益分配给任何组织的情况

4.3.62 本公司未将基金投资收益分配给任何其他机构的情况

4.3.63 本公司未将基金投资收益分配给任何个人的情况

4.3.64 本公司未将基金投资收益分配给任何单位的情况

4.3.65 本公司未将基金投资收益分配给任何组织的情况

4.3.66 本公司未将基金投资收益分配给任何其他机构的情况

4.3.67 本公司未将基金投资收益分配给任何个人的情况

4.3.68 本公司未将基金投资收益分配给任何单位的情况

4.3.69 本公司未将基金投资收益分配给任何组织的情况

4.3.70 本公司未将基金投资收益分配给任何其他机构的情况

4.3.71 本公司未将基金投资收益分配给任何个人的情况

4.3.72 本公司未将基金投资收益分配给任何单位的情况

4.3.73 本公司未将基金投资收益分配给任何组织的情况

4.3.74 本公司未将基金投资收益分配给任何其他机构的情况

4.3.75 本公司未将基金投资收益分配给任何个人的情况

4.3.76 本公司未将基金投资收益分配给任何单位的情况

4.3.77 本公司未将基金投资收益分配给任何组织的情况

4.3.78 本公司未将基金投资收益分配给任何其他机构的情况

4.3.79 本公司未将基金投资收益分配给任何个人的情况

4.3.80 本公司未将基金投资收益分配给任何单位的情况

4.3.81 本公司未将基金投资收益分配给任何组织的情况

4.3.82 本公司未将基金投资收益分配给任何其他机构的情况

4.3.83 本公司未将基金投资收益分配给任何个人的情况

4.3.84 本公司未将基金投资收益分配给任何单位的情况

4.3.85 本公司未将基金投资收益分配给任何组织的情况

4.3.86 本公司未将基金投资收益分配给任何