

交银施罗德增利债券证券投资基金 2010|第一季度报告

2010年3月31日

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

报告送出日期:二〇一〇年四月二十日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、监事会在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2010年4月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告内容，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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2010年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称

交银增利债券

基金代码

519690

基金运作方式

契约型开放式

基金合同生效日

2006-12-14

报告期末基金资产总额

3,118,223,612.80元

投资目标

本基金主要投资于信用等级较高的固定收益类金融工具，以获取稳定的利息收入，同时精选部分股票进行配置，以求在控制风险的前提下，获得超越基准的收益。

投资策略

本基金在充分分析宏观经济形势和金融市场运行状况的基础上，自上而下地动态调整大类金融资产的配置比例，适时配置固定收益类金融产品和股票等。

业绩比较基准

中债企业债指数

4.20%

风险收益特征

中低风险

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

下属分级基金的基金额度

519690 A类/B类

519691 B类

注:本报告期A类基金份额采用固定赎回费率,A类基金份额采用后端收费模式,赎回交易代码为A类基金份额交易代码,后端交易代码为B类基金份额交易代码。

§3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标

报告期(2010年1月1日-2010年3月31日)

交银增利债券 A/B

交银增利债券 C

1.本期已实现收益

44,566,831.47

17,852,729.42

2.本期利润

325,485.50

380,087.59

3.期间平均基金份额本期利润

0.0001

0.0004

4.期末基金资产净值

2,265,156,484.98

956,979,398.84

5.期末基金份额净值

1.0347

1.0300

注:1.本基金A类业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计算费用后的实际收益水平以定期所列数据为准;2.本期来实现收益指基金本期利润收入,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=基金本期已实现收益+本期利润收入+投资收益+其他收入(不含公允价值变动收益);3.基金净值表现=净值增长率为本期每份基金份额的利润增长与本金的比值;4.期末基金资产净值=期末总资产减去总负债,即报告期末基金资产总额减去总负债;5.期末基金份额净值=期末基金资产净值除以期末基金份额的总数。

3.2.1 本期来期份额净值增长率与其同期业绩比较基准收益率的比较

1.交银增利债券 A/B:

阶段

净值增长率①

0.21%

2.91%

0.07%

-2.70%

0.25%

自基金额度合同期效至今

21.17%

0.34%

9.13%

0.21%

12.04%

0.13%

2.交银增利债券 C:

阶段

净值增长率①

0.11%

0.32%

2.91%

0.07%

-2.80%

0.25%

自基金额度合同期效至今

20.11%

0.34%

9.15%

0.21%

10.98%

0.13%

3.2.2 本基金来期收益以A类基金份额的净值得增长率为基准,并将其与同期业绩比较基准收益的比值进行对比,即报告期来期份额净值增长率与其同期业绩比较基准收益率的比值。注:本报告期A类基金份额的净值得增长率为1.0347%,同期业绩比较基准收益率为1.0300%。注:本报告期C类基金份额的净值得增长率为0.34%,同期业绩比较基准收益率的历史走势对比如图。

2008年3月31日至2010年3月31日

1.交银增利债券 A/B:

阶段

净值增长率①

0.21%

2.91%

0.07%

-2.70%

0.25%

自基金额度合同期效至今

21.17%

0.34%

9.13%

0.21%

12.04%

0.13%

2.交银增利债券 C:

阶段

净值增长率①

0.11%

0.32%

2.91%

0.07%

-2.80%

0.25%

自基金额度合同期效至今

20.11%

0.34%

9.15%

0.21%

10.98%

0.13%

3.2.3 本基金来期收益以A类基金份额的净值得增长率为基准,并将其与同期业绩比较基准收益的比值进行对比,即报告期来期份额净值增长率与其同期业绩比较基准收益率的比值。注:本报告期A类基金份额的净值得增长率为1.0347%,同期业绩比较基准收益率的历史走势对比如图。

2008年3月31日至2010年3月31日

1.交银增利债券 A/B:

阶段

净值增长率①

-8.16%

12.4%

0.84%

-5.41%

0.40%

自基金额度合同期效至今

21.09%

1.89%

10.20%

1.05%

10.68%

0.39%

3.2.2 本基金来期收益以A类基金份额的净值得增长率为基准,并将其与同期业绩比较基准收益的比值进行对比,即报告期来期份额净值增长率与其同期业绩比较基准收益率的比值。注:本报告期A类基金份额的净值得增长率为1.0347%,同期业绩比较基准收益率的历史走势对比如图。

2006年6月14日至2010年3月31日

1.交银增利债券 C:

阶段

净值增长率①

-8.16%

12.4%

0.84%

-5.41%

0.40%

自基金额度合同期效至今

21.09%

1.89%

10.20%

1.05%

10.68%

0.39%

3.2.3 本基金来期收益以A类基金份额的净值得增长率为基准,并将其与同期业绩比较基准收益的比值进行对比,即报告期来期份额净值增长率与其同期业绩比较基准收益率的比值。注:本报告期A类基金份额的净值得增长率为1.0347%,同期业绩比较基准收益率的历史走势对比如图。

2006年6月14日至2010年3月31日

1.交银增利债券 A/B:

阶段

净值增长率①

-8.16%

12.4%

0.84%

-5.41%

0.40%

自基金额度合同期效至今

21.09%

1.89%

10.20%

1.05%

10.68%

0.39%

3.2.2 本基金来期收益以A类基金份额的净值得增长率为基准,并将其与同期业绩比较基准收益的比值进行对比,即报告期来期份额净值增长率与其同期业绩比较基准收益率的比值。注:本报告期A类基金份额的净值得增长率为1.0347%,同期业绩比较基准收益率的历史走势对比如图。

2006年6月14日至2010年3月31日

1.交银增利债券 C:

阶段

净值增长率①

-8.16%

12.4%

0.84%

-5.41%

0.40%

自基金额度合同期效至今

21.09%

1.89%

10.20%

1.05%

10.68%

0.39%