

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
信息披露:二〇一四年八月二十五日
1.1 重要提示
基金管理人承诺,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。

交银施罗德信用添利债券证券投资基金(LOF)

2014 半年度 报告摘要

2014年6月30日

资产负债表
资产 附注号 本期末 2014年6月30日 上期末 2013年12月31日
货币资金 6.4.1.1 1611,127.49 370,555,506.42
衍生金融资产 162,605.43 303,835.12
应收利息 18,435,810.75 20,841,500.20

支持的对价之间的差额,计入当期损益。
6.4.4 金融资产转移的披露
6.4.4.1 金融资产转移的确认依据和计量原则
金融资产转移的确认依据和计量原则:金融资产转移是指将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方,且放弃了对该金融资产的控制。

6.4.4.2 金融资产转移的终止确认
(1)存在活跃市场的金融资产,其公允价值按照公允价值计量,且公允价值在后续期间未发生重大变化且证券发行机构未发生重大事件,则按交易日的市场交易价格确定公允价值。
(2)不存在活跃市场的金融资产,其公允价值按照公允价值计量,且公允价值在后续期间未发生重大变化且证券发行机构未发生重大事件,则按交易日的市场交易价格确定公允价值。

6.4.4.3 金融资产转移的公允价值
6.4.4.3.1 公允价值计量的层次
公允价值计量所使用的输入值分为三个层次,即:
(1)第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
(2)第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债的可观察输入值。
(3)第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.4.3.2 金融资产转移的公允价值
6.4.4.3.2.1 金融资产转移的公允价值
6.4.4.3.2.1.1 金融资产转移的公允价值
6.4.4.3.2.1.1.1 金融资产转移的公允价值
6.4.4.3.2.1.1.1.1 金融资产转移的公允价值

6.4.4.3.2.2 金融资产转移的公允价值
6.4.4.3.2.2.1 金融资产转移的公允价值
6.4.4.3.2.2.1.1 金融资产转移的公允价值
6.4.4.3.2.2.1.1.1 金融资产转移的公允价值

6.4.4.3.2.3 金融资产转移的公允价值
6.4.4.3.2.3.1 金融资产转移的公允价值
6.4.4.3.2.3.1.1 金融资产转移的公允价值
6.4.4.3.2.3.1.1.1 金融资产转移的公允价值

6.4.4.3.2.4 金融资产转移的公允价值
6.4.4.3.2.4.1 金融资产转移的公允价值
6.4.4.3.2.4.1.1 金融资产转移的公允价值
6.4.4.3.2.4.1.1.1 金融资产转移的公允价值

6.4.4.3.2.5 金融资产转移的公允价值
6.4.4.3.2.5.1 金融资产转移的公允价值
6.4.4.3.2.5.1.1 金融资产转移的公允价值
6.4.4.3.2.5.1.1.1 金融资产转移的公允价值

6.4.4.3.2.6 金融资产转移的公允价值
6.4.4.3.2.6.1 金融资产转移的公允价值
6.4.4.3.2.6.1.1 金融资产转移的公允价值
6.4.4.3.2.6.1.1.1 金融资产转移的公允价值

6.4.4.3.2.7 金融资产转移的公允价值
6.4.4.3.2.7.1 金融资产转移的公允价值
6.4.4.3.2.7.1.1 金融资产转移的公允价值
6.4.4.3.2.7.1.1.1 金融资产转移的公允价值

6.4.4.3.2.8 金融资产转移的公允价值
6.4.4.3.2.8.1 金融资产转移的公允价值
6.4.4.3.2.8.1.1 金融资产转移的公允价值
6.4.4.3.2.8.1.1.1 金融资产转移的公允价值

6.4.4.3.2.9 金融资产转移的公允价值
6.4.4.3.2.9.1 金融资产转移的公允价值
6.4.4.3.2.9.1.1 金融资产转移的公允价值
6.4.4.3.2.9.1.1.1 金融资产转移的公允价值

6.4.4.3.2.10 金融资产转移的公允价值
6.4.4.3.2.10.1 金融资产转移的公允价值
6.4.4.3.2.10.1.1 金融资产转移的公允价值
6.4.4.3.2.10.1.1.1 金融资产转移的公允价值

6.4.4.3.2.11 金融资产转移的公允价值
6.4.4.3.2.11.1 金融资产转移的公允价值
6.4.4.3.2.11.1.1 金融资产转移的公允价值
6.4.4.3.2.11.1.1.1 金融资产转移的公允价值

7.3 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 占基金资产净值比例(%)
1 60085 同仁堂 300,000 5,229,000.00 2.06

注:投资者持有本报告期末本基金投资组合的所有股票明细,应阅读基金管理人网站的本半年度报告全文。
7.4 报告期内被投资标的重大变动
7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值20%或前20名股票投资明细

序号 股票代码 股票名称 本期累计买入金额 占期初基金资产净值比例(%)
1 000887 中顺洁柔 6,787,148.20 0.35

注:“本期累计买入金额”按买入成交金额(或成交均价×成交量)填列,不考虑相关交易费用。
7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值20%或前20名股票投资明细

序号 股票代码 股票名称 本期累计卖出金额 占期初基金资产净值比例(%)
1 60085 同仁堂 13,271,439.13 0.68

注:“本期累计卖出金额”按卖出成交金额(或成交均价×成交量)填列,不考虑相关交易费用。
7.4.3 买入股票成本及公允价值变动的确认
7.4.3.1 买入股票成本及公允价值变动的确认

序号 债券品种 公允价值 占基金资产净值比例(%)
1 国债债券 -- --
2 央行票据 -- --

7.6 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 占基金资产净值比例(%)
1 120000A 12光大银行次级债 50,000 30,000,000.00 19.73

注:因“12光大银行次级债”暂无市场报价,上表中债券代码“120000A”为系统自动生成。
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资明细
7.8 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

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细
7.10 本报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
7.11 本报告期末未持仓的股指期货
7.12 投资股指期货的说明

7.12.1 报告期末持仓的股指期货
7.12.2 本报告期末持仓的股指期货
7.12.3 本报告期末持仓的股指期货

序号 名称 金额
1 存出保证金 162,605.43
2 应收证券清算款 4,408,270.65

7.12.4 投资组合报告期末其他资产科目余额
7.12.5 期末持仓前十名权证在流通受限情况说明

序号 股票代码 股票名称 流通受限部分的公允价值 占基金资产净值比例(%) 流通受限情况说明
1 603369 今世缘 16,930.00 0.01 新股上市申购

8.1 期末按基金份额持有人户数及持有金额
8.2 期末上市基金份额持有人
8.3 期末按基金份额持有人户数及持有金额

8.4 期末按基金份额持有人户数及持有金额
8.5 期末按基金份额持有人户数及持有金额
8.6 期末按基金份额持有人户数及持有金额

8.7 期末按基金份额持有人户数及持有金额
8.8 期末按基金份额持有人户数及持有金额
8.9 期末按基金份额持有人户数及持有金额

8.10 期末按基金份额持有人户数及持有金额
8.11 期末按基金份额持有人户数及持有金额
8.12 期末按基金份额持有人户数及持有金额

8.13 期末按基金份额持有人户数及持有金额
8.14 期末按基金份额持有人户数及持有金额
8.15 期末按基金份额持有人户数及持有金额

8.16 期末按基金份额持有人户数及持有金额
8.17 期末按基金份额持有人户数及持有金额
8.18 期末按基金份额持有人户数及持有金额

8.19 期末按基金份额持有人户数及持有金额
8.20 期末按基金份额持有人户数及持有金额
8.21 期末按基金份额持有人户数及持有金额

8.22 期末按基金份额持有人户数及持有金额
8.23 期末按基金份额持有人户数及持有金额
8.24 期末按基金份额持有人户数及持有金额

5.1 重要提示
基金管理人承诺,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。

5.2 基金简介
5.2.1 基金基本情况
名称 交银信用添利债券(LOF)
场内简称 交银添利
基金主代码 164802

5.2.2 基金管理人及基金托管人
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

5.2.3 基金主要财务指标和基金净值表现
5.2.3.1 主要会计数据和财务指标
3.1.1 主要会计数据和财务指标
3.1.2 主要会计数据和财务指标

3.1.3 主要会计数据和财务指标
3.1.4 主要会计数据和财务指标
3.1.5 主要会计数据和财务指标

3.1.6 主要会计数据和财务指标
3.1.7 主要会计数据和财务指标
3.1.8 主要会计数据和财务指标

3.1.9 主要会计数据和财务指标
3.1.10 主要会计数据和财务指标
3.1.11 主要会计数据和财务指标

3.1.12 主要会计数据和财务指标
3.1.13 主要会计数据和财务指标
3.1.14 主要会计数据和财务指标

3.1.15 主要会计数据和财务指标
3.1.16 主要会计数据和财务指标
3.1.17 主要会计数据和财务指标

3.1.18 主要会计数据和财务指标
3.1.19 主要会计数据和财务指标
3.1.20 主要会计数据和财务指标

3.1.21 主要会计数据和财务指标
3.1.22 主要会计数据和财务指标
3.1.23 主要会计数据和财务指标

3.1.24 主要会计数据和财务指标
3.1.25 主要会计数据和财务指标
3.1.26 主要会计数据和财务指标

3.1.27 主要会计数据和财务指标
3.1.28 主要会计数据和财务指标
3.1.29 主要会计数据和财务指标

3.1.30 主要会计数据和财务指标
3.1.31 主要会计数据和财务指标
3.1.32 主要会计数据和财务指标

3.1.33 主要会计数据和财务指标
3.1.34 主要会计数据和财务指标
3.1.35 主要会计数据和财务指标

3.1.36 主要会计数据和财务指标
3.1.37 主要会计数据和财务指标
3.1.38 主要会计数据和财务指标

3.1.39 主要会计数据和财务指标
3.1.40 主要会计数据和财务指标
3.1.41 主要会计数据和财务指标

3.1.42 主要会计数据和财务指标
3.1.43 主要会计数据和财务指标
3.1.44 主要会计数据和财务指标