

汇添富季季红定期开放债券型证券投资基金

2014 第四季度 报告

2014年12月31日

基金管理人: 汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人: 中国工商银行股份有限公司
报告送出日期: 2015年01月22日**1.1 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。
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年1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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失或保证最低收益。
基金的过往业绩并不预示其未来表现,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。
本报告中所载资料截止于:
本报告自2014年10月1日起至2014年12月31日止。

1.2 基金产品概况

基金名称	汇添富季季红定期开放债券(非货币)证券投资基金
场内简称	添富季季
交易代码	164702
基金运作方式	定期开放式
基金合同生效日	2012年7月26日
报告期末基金份额总额	621,907,407.20份
投资目标	本基金主要投资于债券等固定收益品种,在严格控制投资风险的基础上,追求资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金奉行“自上而下”的资产配置与债券资产“自下而上”的资产配置相结合,通过宏观经济形势、中国经济周期、信用环境、利率走势、通胀预期、流动性等因素,动态调整资产配置,在严格控制风险的前提下,力争为基金份额持有人获取长期稳定的投资回报。
业绩比较基准	银行一年定期存款税后利率+1%
风险收益特征	本基金为债券基金,属于证券投资基金中的低风险品种,其预期风险与收益低于市场平均水平,属于证券投资基金中较低风险、收益较低的品种。
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

注:本基金自基金合同生效后,每封闭运作三年,集中开放一次申购和赎回,每三年(含三年)为一个封闭期,在此期间,投资者不能申购、赎回基金份额,但本基金可以在封闭期证券交易所上市交易,每个封闭期到期日的次日(工作日)起,本基金收入首期,当期封闭期至少一个月,在当期封闭期结束后,本基金进入下一期封闭期,以此类推,循环运作。

3.1 主要财务指标

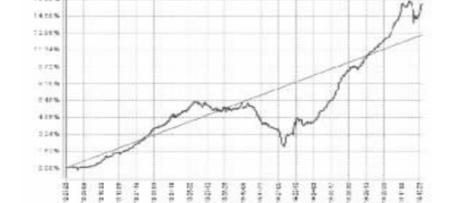
主要财务指标	报告期(2014年10月1日至2014年12月31日)
1.本期已实现收益	14,751,170.38
2.本期利润	20,358,041.63
3.加权平均基金份额本期利润	0.0327
4.期末基金份额净值	1.066

注:1.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。
2.所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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
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	3.16%	0.19%	1.30%	0.02%	1.86%	0.17%

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

汇添富季季红定期开放债券型证券投资基金自合同生效以来与同期业绩比较基准收益率的对比图



注:本基金建仓期为自本基金(基金合同)生效之日(2012年7月26日)起6个月,建仓期间各项资产配置比例符合合同约定。

本基金自基金合同生效后,每封闭运作三年,集中开放一次申购和赎回,每三年(含三年)为一个封闭期,在封闭期内,本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%(但在开放期开始前三个月至开放期结束后三个月内,不受前述投资组合比例的限制);权益类资产的投资比例合计不超过基金资产的20%。在开放期内,本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

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
陈文胜	基金经理	2012年7月26日	12年	硕士,中国、理学,华东师范大学金融学学士,相关业务资格:基金从业资格、从业资格、曾任上海申银万国证券研究所有限公司宏观策略分析师,2007年8月加入汇添富基金管理股份有限公司任固定收益部副经理,现任固定收益部副经理,2008年11月21日至2011年6月26日任汇添富基金季季红基金基金经理,2011年6月26日至2012年7月26日任汇添富基金季季红基金基金经理,2012年7月26日至2014年12月31日任汇添富基金季季红基金基金经理,2014年12月31日至今任汇添富基金季季红基金基金经理,2015年1月1日起任汇添富基金季季红基金基金经理,2015年1月1日起任汇添富基金季季红基金基金经理。

注:1.基金的过往业绩并不预示其未来表现,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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失或保证最低收益。
2.非曾任基金经理,其“任职日期”和“离任日期”分别指根据中国证监会的规定确定的聘任日期和解聘日期;
3.基金经理的任免日期以中国证监会《证券投资基金信息披露管理办法》的相关规定。

4.2 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内,本基金管理人中国工商银行股份有限公司于2014年11月3日发布公告,聘任赵冠华为中国工商银行投资管理有限公司副经理。

4.3 公平交易专项说明

本基金管理人高度重视投资者利益保护,根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规,借鉴国际经验,建立了健全、有效的公平交易制度体系,形成涵盖各开放式基金、特定资产管理组合和社保组合全部投资组合、交易所市场、银行间市场和银行间债券市场、债券、股票、回购等各投资标的,并贯穿于投资、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节的公平交易制度。
本报告期内,本基金管理人公平交易制度和公平交易机制实现了流程化或系统化,确保全程人工风险控制的有效性,包括投资独立决策、研究公平分享、集中交易公平执行、交易严密监控和报告及时分析等在内的公平交易各环节均严格执行到位。
本报告期内,通过投资交易监控、交易数据分析以及专项稽核检查,本基金管理人未发现任何违反公平交易的行为。

4.4 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金管理人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超过该证券当日成交量5%的交易次数为1次,是由市场环境活跃性的需求导致。

4.5 本报告期基金的投资策略和业绩表现说明

四季度,本基金管理人秉承“稳健投资、严控风险”的投资策略,在严格控制风险的前提下,追求资产的长期稳定增值。报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、严控风险”的投资策略,在严格控制风险的前提下,追求资产的长期稳定增值。

5.2 基金产品概况

基金名称	汇添富深证300ETF
场内简称	深300ETF
交易代码	159912
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011年4月20日
报告期末基金份额总额	70,188,001.069份
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要投资于标的指数成份券,正常情况下,本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.1%,跟踪误差也不超过0.2%。
业绩比较基准	深证300指数收益率。
风险收益特征	本基金属于股票基金,跟踪标的指数收益率水平高于混合基金,债券基金和货币市场基金,属于证券投资基金中的较高风险品种,其预期风险与收益高于混合基金、债券基金和货币市场基金,属于证券投资基金中的较高风险品种,具有与标的指数、以及标的指数所代表的证券市场相似的风险收益特征。
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

注:本基金建仓期为自本基金(基金合同)生效之日(2011年4月20日)起3个月,建仓期间和各项资产配置比例符合合同约定。

3.1 主要财务指标

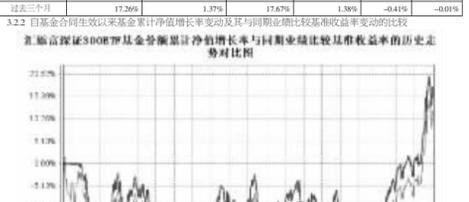
主要财务指标	报告期(2014年10月1日至2014年12月31日)
1.本期已实现收益	7,201,560.80
2.本期利润	13,083,208.28
3.加权平均基金份额本期利润	0.1929
4.期末基金份额净值	82,664,555.50
5.期末基金份额净值增长率	1.772%

注:1.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。
2.所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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
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	17.26%	1.37%	17.67%	1.38%	-0.41%	-0.01%

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

汇添富深证300ETF自基金合同生效以来与同期业绩比较基准收益率的对比图



注:本基金建仓期为自本基金(基金合同)生效之日(2011年4月20日)起3个月,建仓期间和各项资产配置比例符合合同约定。

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
王黎敏	基金经理	2011年4月20日	5年	硕士,中国、理学,上海交通大学金融学硕士,相关业务资格:基金从业资格、从业资格、曾任上海申银万国证券研究所有限公司宏观策略分析师,2007年8月加入汇添富基金管理股份有限公司任固定收益部副经理,现任固定收益部副经理,2008年11月21日至2011年6月26日任汇添富基金季季红基金基金经理,2011年6月26日至2012年7月26日任汇添富基金季季红基金基金经理,2012年7月26日至2014年12月31日任汇添富基金季季红基金基金经理,2014年12月31日至今任汇添富基金季季红基金基金经理,2015年1月1日起任汇添富基金季季红基金基金经理,2015年1月1日起任汇添富基金季季红基金基金经理。

注:1.基金的过往业绩并不预示其未来表现,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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失或保证最低收益。
2.非曾任基金经理,其“任职日期”和“离任日期”分别指根据中国证监会的规定确定的聘任日期和解聘日期;
3.曾任基金经理,其“任职日期”和“离任日期”分别指根据中国证监会的规定确定的聘任日期和解聘日期;
4.2 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
本报告期内,本基金管理人中国工商银行股份有限公司于2014年11月3日发布公告,聘任赵冠华为中国工商银行投资管理有限公司副经理。

4.3 公平交易专项说明

本基金管理人高度重视投资者利益保护,根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规,借鉴国际经验,建立了健全、有效的公平交易制度体系,形成涵盖各开放式基金、特定资产管理组合和社保组合全部投资组合、交易所市场、银行间市场和银行间债券市场、债券、股票、回购等各投资标的,并贯穿于投资、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节的公平交易制度。
本报告期内,本基金管理人公平交易制度和公平交易机制实现了流程化或系统化,确保全程人工风险控制的有效性,包括投资独立决策、研究公平分享、集中交易公平执行、交易严密监控和报告及时分析等在内的公平交易各环节均严格执行到位。
本报告期内,通过投资交易监控、交易数据分析以及专项稽核检查,本基金管理人未发现任何违反公平交易的行为。

4.4 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金管理人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超过该证券当日成交量5%的交易次数为1次,是由市场环境活跃性的需求导致。

4.5 本报告期基金的投资策略和业绩表现说明

四季度,本基金管理人秉承“稳健投资、严控风险”的投资策略,在严格控制风险的前提下,追求资产的长期稳定增值。报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、严控风险”的投资策略,在严格控制风险的前提下,追求资产的长期稳定增值。

5.2 基金产品概况

基金名称	交银施罗德丰盈收益债券(非货币)证券投资基金
场内简称	交银丰盈
交易代码	519740
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年4月20日
报告期末基金份额总额	1,161,588,967.1份
投资目标	本基金主要投资于债券等固定收益品种,在严格控制风险的前提下,追求资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金奉行“自上而下”的资产配置与债券资产“自下而上”的资产配置相结合,通过宏观经济形势、中国经济周期、信用环境、利率走势、通胀预期、流动性等因素,动态调整资产配置,在严格控制风险的前提下,力争为基金份额持有人获取长期稳定的投资回报。
业绩比较基准	银行一年定期存款税后利率+1%
风险收益特征	本基金为债券基金,属于证券投资基金中的低风险品种,其预期风险与收益低于市场平均水平,属于证券投资基金中较低风险、收益较低的品种。
基金管理人	交银施罗德基金管理有限责任公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

注:本基金自基金合同生效后,每封闭运作三年,集中开放一次申购和赎回,每三年(含三年)为一个封闭期,在此期间,投资者不能申购、赎回基金份额,但本基金可以在封闭期证券交易所上市交易,每个封闭期到期日的次日(工作日)起,本基金收入首期,当期封闭期至少一个月,在当期封闭期结束后,本基金进入下一期封闭期,以此类推,循环运作。

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2014年10月1日至2014年12月31日)
1.本期已实现收益	8,490,051.51
2.本期利润	4,399,084.84
3.加权平均基金份额本期利润	0.0086
4.期末基金份额净值	521,665,308.72
5.期末基金份额净值增长率	1.02%

注:1.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。
2.所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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
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	0.89%	0.29%	1.06%	0.01%	-0.17%	0.28%

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

交银施罗德丰盈收益债券型证券投资基金自合同生效以来与同期业绩比较基准收益率的对比图

注:本基金建仓期为自本基金(基金合同)生效之日(2011年4月20日)起3个月,建仓期间和各项资产配置比例符合合同约定。

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
赵冠华	基金经理	2014年11月3日	10年	硕士,中国、理学,上海交通大学金融学硕士,相关业务资格:基金从业资格、从业资格、曾任上海申银万国证券研究所有限公司宏观策略分析师,2007年8月加入汇添富基金管理股份有限公司任固定收益部副经理,现任固定收益部副经理,2008年11月21日至2011年6月26日任汇添富基金季季红基金基金经理,2011年6月26日至2012年7月26日任汇添富基金季季红基金基金经理,2012年7月26日至2014年12月31日任汇添富基金季季红基金基金经理,2014年12月31日至今任汇添富基金季季红基金基金经理,2015年1月1日起任汇添富基金季季红基金基金经理,2015年1月1日起任汇添富基金季季红基金基金经理。

注:1.基金的过往业绩并不预示其未来表现,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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失或保证最低收益。
2.非曾任基金经理,其“任职日期”和“离任日期”分别指根据中国证监会的规定确定的聘任日期和解聘日期;
3.曾任基金经理,其“任职日期”和“离任日期”分别指根据中国证监会的规定确定的聘任日期和解聘日期;
4.2 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
本报告期内,本基金管理人中国工商银行股份有限公司于2014年11月3日发布公告,聘任赵冠华为中国工商银行投资管理有限公司副经理。

4.3 公平交易专项说明

本基金管理人高度重视投资者利益保护,根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规,借鉴国际经验,建立了健全、有效的公平交易制度体系,形成涵盖各开放式基金、特定资产管理组合和社保组合全部投资组合、交易所市场、银行间市场和银行间债券市场、债券、股票、回购等各投资标的,并贯穿于投资、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节的公平交易制度。
本报告期内,本基金管理人公平交易制度和公平交易机制实现了流程化或系统化,确保全程人工风险控制的有效性,包括投资独立决策、研究公平分享、集中交易公平执行、交易严密监控和报告及时分析等在内的公平交易各环节均严格执行到位。
本报告期内,通过投资交易监控、交易数据分析以及专项稽核检查,本基金管理人未发现任何违反公平交易的行为。

4.4 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金管理人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超过该证券当日成交量5%的交易次数为1次,是由市场环境活跃性的需求导致。

4.5 本报告期基金的投资策略和业绩表现说明

四季度,本基金管理人秉承“稳健投资、严控风险”的投资策略,在严格控制风险的前提下,追求资产的长期稳定增值。报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、严控风险”的投资策略,在严格控制风险的前提下,追求资产的长期稳定增值。

5.2 基金产品概况

基金名称	交银施罗德丰盈收益债券(非货币)证券投资基金
场内简称	交银丰盈
交易代码	519740
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年4月20日
报告期末基金份额总额	1,161,588,967.1份
投资目标	本基金主要投资于债券等固定收益品种,在严格控制风险的前提下,追求资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金奉行“自上而下”的资产配置与债券资产“自下而上”的资产配置相结合,通过宏观经济形势、中国经济周期、信用环境、利率走势、通胀预期、流动性等因素,动态调整资产配置,在严格控制风险的前提下,力争为基金份额持有人获取长期稳定的投资回报。
业绩比较基准	银行一年定期存款税后利率+1%
风险收益特征	本基金为债券基金,属于证券投资基金中的低风险品种,其预期风险与收益低于市场平均水平,属于证券投资基金中较低风险、收益较低的品种。
基金管理人	交银施罗德基金管理有限责任公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

注:本基金自基金合同生效后,每封闭运作三年,集中开放一次申购和赎回,每三年(含三年)为一个封闭期,在此期间,投资者不能申购、赎回基金份额,但本基金可以在封闭期证券交易所上市交易,每个封闭期到期日的次日(工作日)起,本基金收入首期,当期封闭期至少一个月,在当期封闭期结束后,本基金进入下一期封闭期,以此类推,循环运作。

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2014年10月1日至2014年12月31日)
1.本期已实现收益	8,490,051.51
2.本期利润	4,399,084.84
3.加权平均基金份额本期利润	0.0086
4.期末基金份额净值	521,665,308.72
5.期末基金份额净值增长率	1.02%

注:1.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。
2.所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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
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	0.89%	0.29%	1.06%	0.01%	-0.17%	0.28%

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

交银施罗德丰盈收益债券型证券投资基金自合同生效以来与同期业绩比较基准收益率的对比图

注:本基金建仓期为自本基金(基金合同)生效之日(2011年4月20日)起3个月,建仓期间和各项资产配置比例符合合同约定。

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
赵冠华	基金经理	2014年11月3日	10年	硕士,中国、理学,上海交通大学金融学硕士,相关业务资格:基金从业资格、从业资格、曾任上海申银万国证券研究所有限公司宏观策略分析师,2007年8月加入汇添富基金管理股份有限公司任固定收益部副经理,现任固定收益部副经理,2008年11月21日至2011年6月26日任汇添富基金季季红基金基金经理,2011年6月26日至2012年7月26日任汇添富基金季季红基金基金经理,2012年7月26日至2014年12月31日任汇添富基金季季红基金基金经理,2014年12月31日至今任汇添富基金季季红基金基金经理,2015年1月1日起任汇添富基金季季红基金基金经理,2015年1月1日起任汇添富基金季季红基金基金经理。

注:1.基金的过往业绩并不预示其未来表现,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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失或保证最低收益。
2.非曾任基金经理,其“任职日期”和“离任日期”分别指根据中国证监会的规定确定的聘任日期和解聘日期;
3.曾任基金经理,其“任职日期”和“离任日期”分别指根据中国证监会的规定确定的聘任日期和解聘日期;
4.2 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
本报告期内,本基金管理人中国工商银行股份有限公司于2014年11月3日发布公告,聘任赵冠华为中国工商银行投资管理有限公司副经理。

4.3 公平交易专项说明

本基金管理人高度重视投资者利益保护,根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规,借鉴国际经验,建立了健全、有效的公平交易制度体系,形成涵盖各开放式基金、特定资产管理组合和社保组合全部投资组合、交易所市场、银行间市场和银行间债券市场、债券、股票、回购等各投资标的,并贯穿于投资、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节的公平交易制度。
本报告期内,本基金管理人公平交易制度和公平交易机制实现了流程化或系统化,确保全程人工风险控制的有效性,包括投资独立决策、研究公平分享、集中交易公平执行、交易严密监控和报告及时分析等在内的公平交易各环节均严格执行到位。
本报告期内,通过投资交易监控、交易数据分析以及专项稽核检查,本基金管理人未发现任何违反公平交易的行为。

4.4 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金管理人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超过该证券当日成交量5%的交易次数为1次,是由市场环境活跃性的需求导致。

4.5 本报告期基金的投资策略和业绩表现说明

四季度,本基金管理人秉承“稳健投资、严控风险”的投资策略,在严格控制风险的前提下,追求资产的长期稳定增值。报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、严控风险”的投资策略,在严格控制风险的前提下,追求资产的长期稳定增值。

5.2 基金产品概况

基金名称	交银施罗德丰盈收益债券(非货币)证券投资基金
场内简称	交银丰盈
交易代码	519740
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年4月20日
报告期末基金份额总额	1,161,588,967.1份
投资目标	本基金主要投资于债券等固定收益品种,在严格控制风险的前提下,追求资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金奉行“自上而下”的资产配置与债券资产“自下而上”的资产配置相结合,通过宏观经济形势、中国经济周期、信用环境、利率走势、通胀预期、流动性等因素,动态调整资产配置,在严格控制风险的前提下,力争为基金份额持有人获取长期稳定的投资回报。
业绩比较基准	银行一年定期存款税后利率+1%
风险收益特征	本基金为债券基金,属于证券投资基金中的低风险品种,其预期风险与收益低于市场平均水平,属于证券投资基金中较低风险、收益较低的品种。
基金管理人	交银施罗德基金管理有限责任公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

注:本基金自基金合同生效后,每封闭运作三年,集中开放一次申购和赎回,每三年(含三年)为一个封闭期,在此期间,投资者不能申购、赎回基金份额,但本基金可以在封闭期证券交易所上市交易,每个封闭期到期日的次日(工作日)起,本基金收入首期,当期封闭期至少一个月,在当期封闭期结束后,本基金进入下一期封闭期,以此类推,循环运作。

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2014年10月1日至2014年12月31日)
1.本期已实现收益	8,490,051.51
2.本期利润	4,399,084.84
3.加权平均基金份额本期利润	0.0086
4.期末基金份额净值	521,665,308.72
5.期末基金份额净值增长率	1.02%

注:1.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。
2.所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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
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	0.89%	0.29%	1.06%	0.01%	-0.17%	0.28%

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

交银施罗德丰盈收益债券型证券投资基金自合同生效以来与同期业绩比较基准收益率的对比图

