

交银施罗德保本混合型证券投资基金

2009 第一季度报告

2009年3月31日

基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

重要提示
基金管理人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。
基金投资组合报告
截至2009年3月31日止

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2009年1月1日至2009年3月31日)
1.本期已实现收益: 9,451,649.48
2.本期利润: 35,846,899.98

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,计入费用后的实际收益水平可能低于所列数字。

3.2 基金净值表现

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

Table with 6 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率②, 业绩比较基准收益率③, ①-③, ②-④

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变动的比较

交银施罗德保本混合型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
2009年1月21日至2009年3月31日

注:本基金基金合同生效日为2009年1月21日,基金合同生效日至报告期末,本基金运作时间未满一年,本基金建仓期自基金合同生效日起的6个月。截至2009年3月31日,本基金处于建仓期。

4.1 基金经理(基金经理小组)简介

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期限(任职日期, 离任日期), 证券从业年限, 说明

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

报告期内,本基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规和基金合同的约定,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况
本公司有严格的投资控制制度和风险控制制度来保证基金运作的公平,报告期内本公司严格执行公平交易制度,公平对待下各投资组合,并管理好不同投资组合的收益差异,分投资类别(股票、债券、货币)收益以及不同时间期间(每日、每5日、10日)期间内交易的交易价格未发生异常差异。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩表现并未出现差异超过5%的情况。

4.3.3 异常交易专项说明

本基金本报告期未发生异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人严格执行了《基金合同》中约定的投资策略,本基金投资组合在报告期内较好地控制了风险,保持了基金资产的流动性,较好地实现了基金合同约定的投资目标。

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.3 报告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

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

Table with 4 columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.7 报告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

Table with 4 columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,在本报告编制前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责或处罚。

5.8.2 本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同约定的备选股票库之外的股票。

5.8.3 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.8.4 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.8.6 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.8.7 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.8 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.8.9 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.8.10 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.11 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.8.12 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.8.13 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.14 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.8.15 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.8.16 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.17 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.8.18 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.19 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.8.20 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.21 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.8.22 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.23 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.8.24 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.25 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.8.26 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.27 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.8.28 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.29 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.8.30 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.31 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.8.32 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.33 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.8.34 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.35 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.8.36 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.37 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.8.38 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.39 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.8.40 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.41 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.8.42 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.43 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.8.44 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.45 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.8.46 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.47 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.8.48 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.49 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.8.50 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.51 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.8.52 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.53 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.8.54 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.55 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.8.56 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.57 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.8.58 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.59 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.8.60 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.61 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.8.62 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.63 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.8.64 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.65 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.8.66 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.67 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.8.68 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.69 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.8.70 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.71 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.8.72 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.73 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.8.74 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.75 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.8.76 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.77 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.8.78 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.79 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.8.80 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.81 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.8.82 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.83 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.8.84 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.85 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.8.86 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.87 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.8.88 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.89 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.8.90 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.91 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.8.92 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.93 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.8.94 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.95 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.8.96 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.97 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.8.98 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.99 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.8.100 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。