# 交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金

## 2013 年度 报告摘要

2013年12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:中国建设银行股份有限公司**
**报告送出日期:二〇一四年三月二十六日**

### §1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)根据本基金合同规定,于2014年3月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2013年8月13日起至12月31日止。

### §2 基金简介

2.1 基金基本情况

| 基金简称 | 交银定期支付月月丰债券 | |
|---|---|---|
| 基金主代码 | 519730 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2013年8月13日 | |
| 基金管理人 | 交银施罗德基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 194,383,268.91份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 交银定期支付月月丰债券A | 交银定期支付月月丰债券C |
| 下属分级基金的交易代码 | 519730 | 519731 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 165,860,827.96份 | 28,522,440.95份 |

2.2 基金产品说明

| 投资目标 | 本基金精选具有较高息票率的债券,以获取稳定的债息收入,并通过适当参与股票市场,力争实现基金资产的长期增值。 |
|---|---|
| 投资策略 | 本基金充分发挥基金管理人的研究优势,将严谨、规范化的基本面研究分析与积极主动的投资风格相结合,在分析和判断宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上,自上而下决定债券组合久期、期限结构配置及债券类别配置;同时在严谨深入的信用分析基础上,综合考量企业债券的信用评级以及各类债券的流动性、供求关系和收益率水平等,自下而上地精选具有较高息票率的个券。同时,本基金深度关注股票、权证一级市场和二级市场的运行状况与相应风险收益特征,在严格控制基金资产运作风险的基础上,把握投资机会。 |
| 业绩比较基准 | 90%×中债综合全价指数收益率+10%×沪深300指数收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金是一只债券型基金,属于证券投资基金中中等风险的品种,其长期平均的预期收益和预期风险高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---|---|---|---|
| 名称 | | 交银施罗德基金管理有限公司 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 孙艳 | 田青 |
| | 联系电话 | 021-61055050 | 010-67595096 |
| | 电子邮箱 | xxpl@jysld.com,disclosure@jysld.com | tianqing1.zh@ccb.com |
| 客户服务电话 | | 400-700-5000,021-61055000 | 010-67595096 |
| 传真 | | 021-61055054 | 010-66275853 |

2.4 信息披露方式

| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.fund001.com,www.bocomschroder.com |
|---|---|
| 基金年度报告备置地点 | 基金管理人的办公场所 |

### §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2013年8月13日(基金合同生效日)至2013年12月31日 | |
|---|---|---|
| | 交银定期支付月月丰债券A | 交银定期支付月月丰债券C |
| 本期已实现收益 | 3,096,488.20 | 1,473,380.64 |
| 本期利润 | 3,122,251.88 | 1,471,801.64 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0159 | 0.0149 |
| 本期基金份额净值增长率 | 1.50% | 1.40% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2013年末 | |
| | 交银定期支付月月丰债券A | 交银定期支付月月丰债券C |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.015 | 0.014 |
| 期末基金资产净值 | 168,428,201.53 | 28,918,733.45 |
| 期末基金份额净值 | 1.015 | 1.014 |

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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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、本基金合同生效日为2013年8月13日,基金合同生效日至本报告期期末,本基金运作时间未满一年。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

1. 交银定期支付月月丰债券A:

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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 | 1.00% | 0.05% | -2.70% | 0.15% | 3.70% | -0.10% |
| 自基金合同生效起至今 | 1.50% | 0.05% | -3.41% | 0.15% | 4.91% | -0.10% |

注:本基金的业绩比较基准为90%×中债综合全价指数收益率+10%×沪深300指数收益率,每日进行再平衡过程。

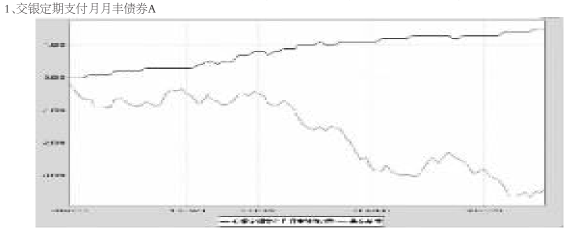
2. 交银定期支付月月丰债券C:

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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 | 0.90% | 0.05% | -2.70% | 0.15% | 3.60% | -0.10% |
| 自基金合同生效起至今 | 1.40% | 0.05% | -3.41% | 0.15% | 4.81% | -0.10% |

注:本基金的业绩比较基准为90%×中债综合全价指数收益率+10%×沪深300指数收益率,每日进行再平衡过程。

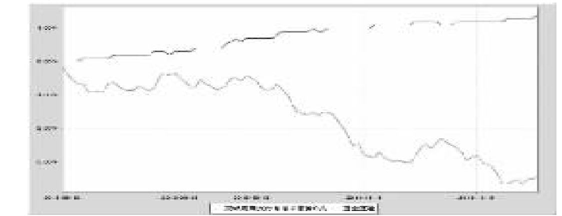
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

1、交银定期支付月月丰债券A



注:本基金基金合同生效日为2013年8月13日,基金合同生效日至报告期期末,本基金运作时间未满一年。本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至2013年12月31日,本基金尚处于建仓期。

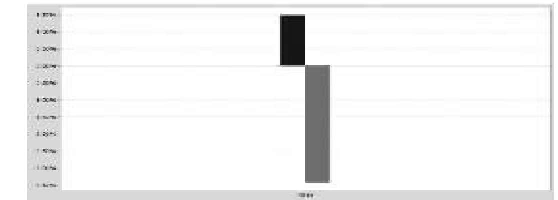
2、交银定期支付月月丰债券C



注:本基金基金合同生效日为2013年8月13日,基金合同生效日至报告期期末,本基金运作时间未满一年。本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至2013年12月31日,本基金尚处于建仓期。

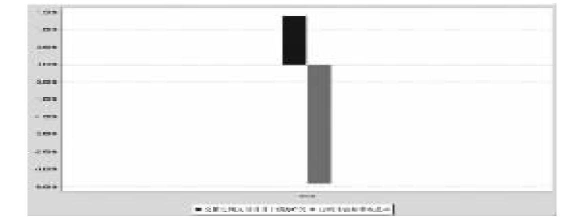
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1、交银定期支付月月丰债券A



注:图示日期为2013年8月13日至2013年12月31日。基金合同生效当年的净值增长率按照当年实际存续期计算。

2、交银定期支付月月丰债券C



注:图示日期为2013年8月13日至2013年12月31日。基金合同生效当年的净值增长率按照当年实际存续期计算。

3.3过去三年基金的利润分配情况

1、交银定期支付月月丰债券A:

单位:人民币元

| 年度 | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 年度利润分配合计 | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|
| 2013年 | - | - | - | - | - |
| 合计 | - | - | - | - | - |

2、交银定期支付月月丰债券C:

单位:人民币元

| 年度 | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 年度利润分配合计 | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|
| 2013年 | - | - | - | - | - |
| 合计 | - | - | - | - | - |

### §4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金的基金管理人为交银施罗德基金管理有限公司。交银施罗德基金管理有限公司是经中国证监会证监基字[2005]128号文批准,于2005年8月4日成立的合资基金管理公司。公司总部设于上海,注册资本为2亿元人民币。截止到2013年12月31日,公司已经发行并管理的基金共有三十一只:交银施罗德精选股票证券投资基金(基金合同生效日:2005年9月29日)、交银施罗德货币市场证券投资基金(基金合同生效日:2006年1月20日)、交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金(基金合同生效日:2006年6月14日)、交银施罗德成长股票证券投资基金(基金合同生效日:2006年10月23日)、交银施罗德蓝筹股票证券投资基金(基金合同生效日:2007年8月8日)、交银施罗德增利债券证券投资基金(基金合同生效日:2008年3月31日)、交银施罗德环球精选价值证券投资基金(基金合同生效日:2008年8月22日)、交银施罗德优势行业灵活配置混合型证券投资基金(基金合同生效日:2009年1月21日)、交银施罗德先锋股票证券投资基金(基金合同生效日:2009年4月10日)、上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金(基金合同生效日:2009年9月25日)、交银施罗德上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金(基金合同生效日:2009年9月29日)、交银施罗德主题优选灵活配置混合型证券投资基金(基金合同生效日:2010年6月30日)、交银施罗德趋势优先股票证券投资基金(基金合同生效日:2010年12月22日)、交银施罗德信用添利债券证券投资基金(基金合同生效日:2011年1月27日)、交银施罗德先进制造股票证券投资基金(基金合同生效日:2011年6月22日)、深证300价值交易型开放式指数证券投资基金(基金合同生效日:2011年9月22日)、交银施罗德双利债券证券投资基金(基金合同生效日:2011年9月26日)、交银施罗德深证300价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金(基金合同生效日:2011年9月28日)、交银施罗德全球自然资源证券投资基金(基金合同生效日:2012年5月22日)、交银施罗德荣安保本混合型证券投资基金(基金合同生效日:2012年6月20日)、交银施罗德阿尔法核心股票型证券投资基金(基金合同生效日:2012年8月3日)、交银施罗德理财21天债券型证券投资基金(基金合同生效日:2012年11月5日)、交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金(基金合同生效日:2012年11月7日)、交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金(基金合同生效日:2012年12月19日)、交银施罗德理财60天债券型证券投资基金(基金合同生效日:2013年3月13日)、交银施罗德双轮动债券型证券投资基金(基金合同生效日:2013年4月18日)、交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金(基金合同生效日:2013年4月24日)、交银施罗德成长30股票型证券投资基金(基金合同生效日:2013年6月5日)、交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金(基金合同生效日:2013年8月13日)、交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金(基金合同生效日:2013年9月4日)、交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金(基金合同生效日:2013年12月25日)。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理(助理)期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 李家春 | 本基金的基金经理、交银施罗德增利债券证券投资基金基金经理、交银施罗德双利债券证券投资基金基金经理、公司固定收益部副总经理 | 2013-08-13 | - | 14年 | 李家春先生,香港大学MBA。历任长江证券有限责任公司投资经理,汉唐证券有限责任公司高级经理、投资主管,泰信基金管理有限公司高级研究员。2006年加入交银施罗德基金管理有限公司,2006年12月27日至2011年6月8日担任交银施罗德货币市场证券投资基金基金经理。 |
| 赵凌琦 | 本基金的基金经理、公司固定收益部副总经理 | 2013-09-03 | - | 0.5年 | 赵凌琦女士,9年金融投资经验,财政部财政科研所经济学硕士。历任中国航空集团财务公司投资经理,中国人寿资产管理有限公司投资经理。2013年加入交银施罗德基金管理有限公司。 |

注:1、本表所列基金经理(助理)任职日期和离职日期均以基金合同生效日或公司作出决定并公告(如适用)之日为准。

2、本表所列基金经理(助理)证券从业年限中的“证券从业”的含义遵从中国证券业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵循《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益。

本报告期内,本基金整体运作合规合法,无不当内幕交易和关联交易,基金投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的约定,未发生损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本公司制定了严格的投资控制制度和公平交易监控制度来保证旗下所管理的所有资产组合投资运作的公平。旗下所管理的所有资产组合,包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均严格遵循制度进行公平交易。制度中包含的主要控制方法如下:

(1)公司建立资源共享的投资研究信息平台,所有研究成果对所有投资组合公平开放,确保各投资组合在获得研究支持和实施投资决策方面享有公平的机会。

(2)公司将投资管理职能和交易执行职能相隔离,实行集中交易制度,建立了合理且可操作的公平交易分配机制,确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于交易所公开竞价交易,遵循“时间优先、价格优先、比例分配”的原则,全部通过交易系统进行比例分配;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、比例分配”的原则按事前独立确定的投资方案对交易结果进行分配。

(3)公司建立了清晰的投资授权制度,明确各层级投资决策主体的职责和权限划分,组合投资经理充分发挥专业判断能力,不受他人干预,在授权范围内独立行使投资决策权,维护公平的投资管理环境,维护所管理投资组合的合法利益,保证各投资组合交易决策的客观性和独立性,防范不公平及异常交易的发生。

(4)公司建立统一的投资对象备选库和交易对手备选库,制定明确的备选库建立、维护程序。在全公司适用股票、债券备选库的基础上,根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和关联交易限制等,按需要建立不同投资组合的投资对象风格库和交易对手备选库,组合经理在此基础上根据投资授权构建投资组合。

(5)公司中央交易室和风险管理部进行日常投资交易行为监控,风险管理部负责对各投资组合公平交易进行事后分析,于每季度和每年度分别对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析,通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内公司严格执行公平交易制度,公平对待旗下各投资组合。通过投资交易监控、交易数据分析、专项稽核检查等,本基金管理人未发现任何违反公平交易制度的行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内,本公司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量没有超过该证券当日总成交量5%的情形,本基金与本公司管理的其他投资组合在不同时间窗下(如日内、3日内、5日内)同向交易的交易价差未出现异常。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2013年整体经济仍保持了较快增长、通胀水平温和可控,但经济增速中枢下移。全年增长的主动力是房地产和基建投资,并依赖于“土地”来扩张金融,表现为“资产负债表”的扩张。实体经济的“滞”与金融、资产部门的“涨”同时存在,成本上升与盈利能力下降使得实业趋于虚弱,企业与地方政府的债务风险也在持续累积。政策当局加大经济结构调整力度。在经济调结构背景下,货币当局推进利率市场化改革并且通过偏紧的流动性政策倒逼金融体系去杠杆,最终引发金融机构主动调整资产负债表,并引发债券市场的深度调整。

从2013年全年看债市跌幅较深。中债总净价指数下跌5.88%。从分阶段走势看,2013年全年债市的走势呈现明显的先涨后跌的过山车形态。上半年债券市场在资金面宽松和经济数据不达预期的共同推动下延续了慢牛行情。下半年随着稳增长政策使得经济企稳回升以及钱荒之后面临依然偏紧的资金面制约,债市出现断崖式下跌。10年期国债收益率不断创出历史新高到达4.7%的高位。

本基金自建仓以来对市场维持趋势看空观点,采取防守配置策略,重仓协议存款和短久期、资质有保证的CP,并适当参与了股票市场结构性机会。因此组合整体表现明显好于业绩比较基准。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2013年12月31日,交银月月丰债券A类份额净值为1.015元,本报告期份额净值增长率为1.50%,同期业绩比较基准增长率为-3.41%;交银月月丰债券C类份额净值为1.014元,本报告期份额净值增长率为1.40%,同期业绩比较基准增长率为-3.41%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2014年,全球复苏还将持续,国内经济则喜忧参半,债券市场资金面维持中性概率偏大,并且不排除阶段性的宽松格局。债市走势仍然取决于货币政策态度和市场机构配置行为的取向。如果央行态度不继续收紧,监管当局对非标的监管落到实处,则利率债有望先启动一波行情,然后是中、高等级信用债。信用债整体分化可能会加大,低等级信用利差预计仍然会走阔,尤其是潜在未发的信用违约风险会一直是牵制信用债行情的隐患。基于以上分析,本基金预计会择时关注信用债和利率债表现,拉长组合久期,力求分享2014年债市回暖带来的超额收益机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序,经公司管理层批准后实行,并成立了估值委员会,估值委员会成员由研究部、基金运营部、风险管理部等人员和固定收益人员及基金经理组成。

公司严格按照新会计准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定进行估值,保证基金估值的公平、合理,保持估值政策和程序的一贯性。估值委员会的研究部成员按投资品种的不同性质,研究并参考市场普遍认同的做法,建议合理的估值模型,进行测算和认证,认可后交各估值委员会成员从基金会计、风险、合规等方面审批,一致同意后,报公司投资总监、总经理审批。

估值委员会会定期对估值政策和程序进行评价,在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后,及时召开临时会议进行研究,及时修订估值方法,以保证其持续适用。估值委员会成员均具备相应的专业资格及工作经验。基金经理作为估值委员会成员,对本基金持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感,向估值委员会提供估值参考信息,参与估值政策讨论。本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突,截止报告期末未有与任何外部估值定价服务机构签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

### §5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

### §6 审计报告

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)对交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金2013年12月31日的资产负债表,2013年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注出具了标准无保留意见的审计报告{普华永道中天审字(2014)第20588号}。投资者可通过本基金年度报告正文查看该审计报告正文。

### §7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金

报告截止日:2013年12月31日

单位:人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末 2013年12月31日 |
|---|---|---|
| 资 产: | | |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 142,025,115.75 |
| 结算备付金 | | 2,659,322.09 |
| 存出保证金 | | 6,557.45 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 44,652,500.00 |
| 其中:股票投资 | | 1,669,100.00 |
| 基金投资 | | - |
| 债券投资 | | 42,983,400.00 |
| 资产支持证券投资 | | - |
| 贵金属投资 | | - |
| 衍生金融资产 | 7.4.7.3 | - |
| 买入返售金融资产 | 7.4.7.4 | 9,000,000.00 |
| 应收证券清算款 | | 1,200,823.61 |
| 应收利息 | 7.4.7.5 | 2,092,952.87 |
| 应收股利 | | - |
| 应收申购款 | | 2,491.26 |
| 递延所得税资产 | | - |
| 其他资产 | 7.4.7.6 | - |
| 资产总计 | | 201,639,763.03 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2013年12月31日 |
| 负 债: | | |
| 短期借款 | | - |
| 交易性金融负债 | | - |
| 衍生金融负债 | 7.4.7.3 | - |
| 卖出回购金融资产款 | | 3,068,878.47 |
| 应付证券清算款 | | - |
| 应付赎回款 | | 825,586.68 |
| 应付管理人报酬 | | 118,686.37 |
| 应付托管费 | | 33,910.42 |
| 应付销售服务费 | | 11,399.01 |
| 应付交易费用 | 7.4.7.7 | 23,624.97 |
| 应交税费 | | 4,800.00 |
| 应付利息 | | 323.10 |
| 应付利润 | | - |
| 递延所得税负债 | | - |
| 其他负债 | 7.4.7.8 | 205,619.03 |
| 负债合计 | | 4,292,828.05 |
| 所有者权益: | | |
| 实收基金 | 7.4.7.9 | 194,383,268.91 |
| 未分配利润 | 7.4.7.10 | 2,963,666.07 |
| 所有者权益合计 | | 197,346,934.98 |
| 负债和所有者权益总计 | | 201,639,763.03 |

注:1、报告截止日2013年12月31日,A类基金份额净值1.015元,C类基金份额净值1.014元,基金份额总额194,383,268.91份,其中A类基金份额165,860,827.96份,C类基金份额28,522,440.95份。

2、本财务报表的实际编制期间为2013年8月13日(基金合同生效日)至2013年12月31日。

3、本摘要中资产负债表和利润表所列附注号为年度报告正文中对应的附注号,投资者欲了解相应附注的内容,应阅读登载于基金管理人网站的年度报告正文。

7.2 利润表

会计主体:交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金

本报告期:2013年8月13日(基金合同生效日)至2013年12月31日

单位:人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期 2013年8月13日(基金合同生效日)至2013年12月31日 |
|---|---|---|
| 一、收入 | | 6,061,044.77 |
| 1.利息收入 | | 6,097,522.78 |
| 其中:存款利息收入 | 7.4.7.11 | 5,831,519.47 |
| 债券利息收入 | | 92,896.48 |
| 资产支持证券利息收入 | | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 173,106.83 |
| 其他利息收入 | | - |
| 2.投资收益(损失以“-”填列) | | -84,954.52 |
| 其中:股票投资收益 | 7.4.7.12 | -91,985.45 |
| 基金投资收益 | | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.13 | 7,030.93 |
| 资产支持证券投资收益 | 7.4.7.14 | - |
| 贵金属投资收益 | | - |
| 衍生工具收益 | 7.4.7.15 | - |
| 股利收益 | 7.4.7.16 | - |
| 3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列) | 7.4.7.17 | 24,184.68 |
| 4.汇兑收益(损失以“-”号填列) | | - |
| 5.其他收入(损失以“-”号填列) | 7.4.7.18 | 24,291.83 |
| 减:二、费用 | | 1,466,991.25 |
| 1.管理人报酬 | | 807,014.83 |
| 2.托管费 | | 230,575.73 |
| 3.销售服务费 | | 155,110.09 |
| 4.交易费用 | 7.4.7.19 | 44,345.20 |
| 5.利息支出 | | 17,042.96 |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | | 17,042.96 |
| 6.其他费用 | 7.4.7.20 | 212,902.44 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | | 4,594,053.52 |
| 减:所得税费用 | | - |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | | 4,594,053.52 |

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金

本报告期:2013年8月13日(基金合同生效日)至2013年12月31日

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2013年8月13日(基金合同生效日)至2013年12月31日 | | |
|---|---|---|---|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 344,340,245.54 | - | 344,340,245.54 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 4,594,053.52 | 4,594,053.52 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列) | -149,956,976.63 | -1,630,387.45 | -151,587,364.08 |
| 其中:1.基金申购款 | 50,623,919.96 | 655,857.66 | 51,279,777.62 |
| 2.基金赎回款 | -200,580,896.59 | -2,286,245.11 | -202,867,141.70 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | - | - | - |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 194,383,268.91 | 2,963,666.07 | 197,346,934.98 |

报表附注为财务报表的组成部分

本报告页码(序号)从7.1至7.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人:战龙,主管会计工作负责人:许珊燕,会计机构负责人:朱鸣

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]754号《关于核准交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金募集的批复》核准,由交银施罗德基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币344,213,956.62元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2013)第508号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金基金合同》于2013年8月13日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为344,340,245.54份基金份额,其中认购资金利息折合126,288.92份基金份额。本基金的基金管理人为交银施罗德基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金基金合同》和《交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金招募说明书》,本基金自募集期起根据费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在在投资者认购/申购时收取前端认购/申购费用、赎回时收取赎回费用的,称为A类基金份额;在投资者认购/申购、赎回时不收取认购/申购费用、赎回费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为C类基金份额。

根据《交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金基金合同》和《交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金每月定期按照约定的年化现金支付比率,以约定的定期支付基准日的基金份额净值为基础,计算当期基金份额持有人可获得支付的现金,并自动赎回基金份额持有人所持的对应金额的基金份额,以该自动赎回的资金向基金份额持有人进行现金支付。本基金当前的年化现金支付比率为4%。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产净值的80%,对股票、权证等权益类资产的投资比例不高于基金资产的20%;其中现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的5%,本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%。本基金的业绩比较基准为90%×中债综合全价指数收益率+10%×沪深300指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人交银施罗德基金管理有限公司于2014年3月21日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2013年8月13日(基金合同生效日)至2013年12月31日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2013年12月31日的财务状况以及2013年8月13日(基金合同生效日)至2013年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2013年8月13日(基金合同生效日)至2013年12月31日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动作为公允价值变动损益计入当期损益;在资产持有期间所取得的利息或现金股利以及处置时产生的处置损益计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2) 该金融资产已转移,且本基金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;或者(3) 该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易,但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具,如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场,采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;且2) 交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项,根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分,将本金部分冲减资产支持证券投资成本,并将投资收益部分确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;处置时,处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

在存续期内,本基金按照基金合同的约定每月定期向基金份额持有人支付一定的现金,即按照招募说明书约定的年化现金支付比率,以约定的定期支付基准日的基金份额净值为基础,计算当期基金份额持有人可获得支付的现金,并自动赎回基金份额持有人所持有的对应金额的基金份额,以该自动赎回的资金向基金份额持有人进行现金支付。除上述定期支付外,本基金不另外进行收益分配。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分:(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用;(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果,以决定向其配置资源、评价其业绩;(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征,并且满足一定条件的,则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作,不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作,本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

(a)对于证券交易所上市的股票,若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况,本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(b) 在银行间同业市场交易的债券品种,根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值,具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起,对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 关联方关系

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|---|---|
| 交银施罗德基金管理有限公司(“交银施罗德基金公司”) | 基金管理人、基金销售机构 |
| 中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”) | 基金托管人、基金代销机构 |
| 交通银行股份有限公司(“交通银行”) | 基金管理人的股东、基金代销机构 |
| 施罗德投资管理有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 中国国际海运集装箱(集团)股份有限公司 | 基金管理人的股东 |

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.8.2关联方报酬

7.4.8.2.1基金管理费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2013年8月13日(基金合同生效日)至2013年12月31日 |
|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 807,014.83 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 542,131.16 |

注:支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值0.7%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.7%÷当年天数。

7.4.8.2.2基金托管费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2013年8月13日(基金合同生效日)至2013年12月31日 |
|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 230,575.73 |

注:支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.2%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值×0.2%÷当年天数。

7.4.8.2.3销售服务费

单位:人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期 2013年8月13日(基金合同生效日)至2013年12月31日 | | |
|---|---|---|---|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 交银定期支付月月丰债券A | 交银定期支付月月丰债券C | 合计 |
| 交通银行 | - | 23,072.53 | 23,072.53 |
| 中国建设银行 | - | 125,015.58 | 125,015.58 |
| 交银施罗德基金公司 | - | 47,133.27 | 47,133.27 |
| 合计 | - | 195,221.38 | 195,221.38 |

注:支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日C类基金份额对应的基金资产净值0.4%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给基金管理人,再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为:

日基金销售服务费=前一日C类基金份额对应的资产净值× 0.4% ÷ 当年天数。

7.4.8.3与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内未发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.8.4.2报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金。

7.4.8.5由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期 2013年8月13日(基金合同生效日)至2013年12月31日 | |
|---|---|---|
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国建设银行 | 1,025,115.75 | 27,269.69 |

注:本基金的银行存款由基金托管人保管,按银行同业利率计息。

7.4.8.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.8.7其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

7.4.9期末(2013年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.9.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1银行间市场债券正回购

截至本报告期末2013年12月31日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额3,068,878.47元,是以如下债券作为抵押:

金额单位:人民币元

| 债券代码 | 债券名称 | 回购到期日 | 期末估值单价 | 数量(张) | 期末估值总额 |
|---|---|---|---|---|---|
| 130248 | 13国开48 | 2014-01-02 | 99.83 | 31,000 | 3,094,730.00 |
| 合计 | | - | - | 31,000 | 3,094,730.00 |

7.4.9.3.2交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.10有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值,公允价值层级可分为:

第一层级:相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级:直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级:以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ii) 各层次金融工具公允价值

于2013年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层级的余额为4,658,500.00元,属于第二层级的余额为39,994,000.00元,无属于第三层级的余额。

(iii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和债券的公允价值列入第一层级;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层级或第三层级。

(iv) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(2) 除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

### §8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 1,669,100.00 | 0.83 |
| | 其中:股票 | 1,669,100.00 | 0.83 |
| 2 | 固定收益投资 | 42,983,400.00 | 21.32 |
| | 其中:债券 | 42,983,400.00 | 21.32 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | 9,000,000.00 | 4.46 |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 144,684,437.84 | 71.75 |
| 7 | 其他各项资产 | 3,302,825.19 | 1.64 |
| 8 | 合计 | 201,639,763.03 | 100.00 |

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 1,669,100.00 | 0.85 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 1,669,100.00 | 0.85 |

8.3 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

金额单位:人民币元

| 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 | 002415 | 海康威视 | 40,000 | 919,200.00 | 0.47 |
| 2 | 600703 | 三安光电 | 20,000 | 495,800.00 | 0.25 |
| 3 | 000550 | 江铃汽车 | 10,000 | 254,100.00 | 0.13 |

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于基金管理人网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期末基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 300070 | 碧水源 | 2,955,250.00 | 1.50 |
| 2 | 300303 | 聚飞光电 | 1,889,563.00 | 0.96 |
| 3 | 000550 | 江铃汽车 | 1,883,050.12 | 0.95 |
| 4 | 300306 | 远方光电 | 1,738,314.99 | 0.88 |
| 5 | 300118 | 东方日升 | 1,664,605.00 | 0.84 |
| 6 | 002583 | 海能达 | 1,483,188.00 | 0.75 |
| 7 | 300137 | 先河环保 | 1,034,353.00 | 0.52 |
| 8 | 002415 | 海康威视 | 919,800.00 | 0.47 |
| 9 | 600880 | 博瑞传播 | 570,000.00 | 0.29 |
| 10 | 600703 | 三安光电 | 488,668.00 | 0.25 |
| 11 | 600021 | 上海电力 | 397,000.00 | 0.20 |
| 12 | 600030 | 中信证券 | 381,200.00 | 0.19 |

注:“本期累计买入金额”按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期末基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 300070 | 碧水源 | 3,066,457.16 | 1.55 |
| 2 | 000550 | 江铃汽车 | 1,751,855.00 | 0.89 |
| 3 | 300118 | 东方日升 | 1,707,601.50 | 0.87 |
| 4 | 300303 | 聚飞光电 | 1,640,029.00 | 0.83 |
| 5 | 300306 | 远方光电 | 1,547,403.00 | 0.78 |
| 6 | 002583 | 海能达 | 1,369,328.00 | 0.69 |
| 7 | 300137 | 先河环保 | 1,349,665.00 | 0.68 |
| 8 | 600880 | 博瑞传播 | 472,200.00 | 0.24 |
| 9 | 600030 | 中信证券 | 381,600.00 | 0.19 |
| 10 | 600021 | 上海电力 | 362,200.00 | 0.18 |

注:“本期累计卖出金额”按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

| 买入股票的成本(成交)总额 | 15,404,992.11 |
|---|---|
| 卖出股票的收入(成交)总额 | 13,648,338.66 |

注:“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 9,983,000.00 | 5.06 |
| | 其中:政策性金融债 | 9,983,000.00 | 5.06 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | 30,011,000.00 | 15.21 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 | 2,989,400.00 | 1.51 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 42,983,400.00 | 21.78 |

8.6 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

金额单位:人民币元

| 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 | 041358008 | 13山钢CP001 | 100,000 | 10,069,000.00 | 5.10 |
| 2 | 130248 | 13国开48 | 100,000 | 9,983,000.00 | 5.06 |
| 3 | 041358038 | 13华谊兄弟CP002 | 100,000 | 9,976,000.00 | 5.06 |
| 4 | 041355016 | 13宝钢包装CP001 | 100,000 | 9,966,000.00 | 5.05 |
| 5 | 113005 | 平安转债 | 10,000 | 1,072,500.00 | 0.54 |

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 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

本基金本报告期末未持有权证。

8.10报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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,在本报告编制日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和处罚。

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

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 6,557.45 |
| 2 | 应收证券清算款 | 1,200,823.61 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 2,092,952.87 |
| 5 | 应收申购款 | 2,491.26 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 3,302,825.19 |

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 113001 | 中行转债 | 963,300.00 | 0.49 |
| 2 | 110015 | 石化转债 | 953,600.00 | 0.48 |

8.12.5 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。

8.12.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

### §9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

| 份额级别 | 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | | 持有份额 | 占总份额比例 | 持有份额 | 占总份额比例 |
| 交银定期支付月月丰债券A | 965 | 171,876.51 | 49,357,354.39 | 29.76% | 116,503,473.57 | 70.24% |
| 交银定期支付月月丰债券C | 303 | 94,133.47 | - | - | 28,522,440.95 | 100.00% |
| 合计 | 1,268 | 153,299.11 | 49,357,354.39 | 25.39% | 145,025,914.52 | 74.61% |

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有份额总数(份) | 占基金总份额比例 |
|---|---|---|---|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 交银定期支付月月丰债券A | - | - |
| | 交银定期支付月月丰债券C | 988.39 | 0.00% |
| | 合计 | 988.39 | 0.00% |

注:本基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人、本基金基金经理未持有本基金。

### §10 开放式基金份额变动

单位:份

| 项目 | 交银定期支付月月丰债券A | 交银定期支付月月丰债券C |
|---|---|---|
| 基金合同生效日(2013年8月13日)基金份额总额 | 214,214,667.51 | 130,125,578.03 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 | 49,518,204.28 | 1,105,715.68 |
| 减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | 97,872,043.83 | 102,708,852.76 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 165,860,827.96 | 28,522,440.95 |

注:1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务,则总申购份额中包含该业务;

2、如果本报告期间发生转换出业务,则总赎回份额中包含该业务。

### §11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人的重大人事变动:本基金管理人本报告期内未发生重大人事变动。

2、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动:本基金托管人2013年12月5日发布任免通知,聘任黄秀莲为中国建设银行投资托管业务部副总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内,为本基金提供审计服务的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙),本期审计费用为55,000.00元。自本基金基金合同生效以来,本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员本报告期内未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 中信建投证券股份有限公司 | 1 | 26,000,462.77 | 89.49% | 23,670.88 | 89.49% | - |
| 申银万国证券股份有限公司 | 1 | 3,052,868.00 | 10.51% | 2,779.33 | 10.51% | - |

11.7.2基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 回购交易 | | 权证交易 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 申银万国证券股份有限公司 | 52,306,520.95 | 100.00% | 762,500,000.00 | 100.00% | - | - |

注:1、报告期内,本基金交易单元均为新增交易单元;

2、租用证券公司交易单元的选择标准主要包括:券商基本面评价(财务状况、经营状况)、券商研究机构(评价报告质量、及时性和数量)、券商每日信息评价(及时性和有效性)和券商协作表现评价等四个方面;

3、租用证券公司交易单元的程序:首先根据租用证券公司交易单元的选择标准进行综合评价,然后根据评价选择基金交易单元。研究部提交方案,并上报公司批准。

### §12 影响投资者决策的其他重要信息

本基金托管人2013年12月5日发布任免通知,聘任黄秀莲为中国建设银行投资托管业务部副总经理。

**交银施罗德基金管理有限公司**
**二〇一四年三月二十六日**