# 交银施罗德主题优选灵活配置混合型证券投资基金

## 2015 第三季度 报告

2015年9月30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:二〇一五年十月二十七日**

### §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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月26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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

### §2 基金产品概况

| | | |
|---|---|---|
| 基金简称 | 交银主题优选混合 | |
| 基金主代码 | 519700 | |
| 交易代码 | 519700(前端) | 519701(后端) |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2010年6月30日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 463,339,869.99份 | |
| 投资目标 | 本基金力图通过前瞻性的主题优选,积极把握行业和个股投资机会,在控制风险并保持基金资产良好的流动性的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。 | |
| 投资策略 | 本基金充分发挥基金管理人的研究优势,将严谨、规范化的选股方法与积极主动的投资风格相结合,在分析和判断宏观经济发展趋势、经济周期和市场环境变化趋势的基础上,动态调整投资组合比例,自上而下灵活配置资产;通过优选主题配置和挖掘预期具有良好增长前景的优势行业相结合的方式,精选个股,以谋求超额收益。 | |
| 业绩比较基准 | 60%×沪深300指数收益率+40%×中信标普全债指数收益率 | |
| 风险收益特征 | 本基金是一只灵活配置的混合型基金,属于基金中的中高风险品种,本基金的风险与预期收益介于股票型基金和债券型基金之间。 | |
| 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 | |

### §3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2015年7月1日-2015年9月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -41,504,770.03 |
| 2.本期利润 | -161,893,174.01 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.3451 |
| 4.期末基金资产净值 | 694,881,365.81 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.500 |

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。

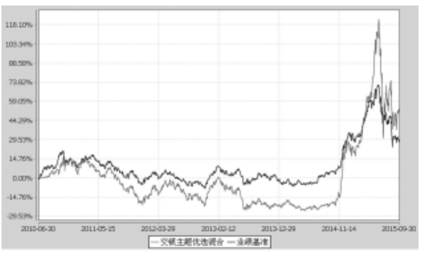
3.2 基金净值表现

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 | -15.92% | 3.49% | -16.84% | 2.01% | 0.92% | 1.48% |

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

交银施罗德主题优选灵活配置混合型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2010年6月30日至2015年9月30日)



注:本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至建仓期结束,本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

### §4 管理人报告

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 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 沈楠 | 交银主题优选混合、交银国企改革灵活配置混合的基金经理 | 2015-05-05 | - | 6年 | 沈楠先生,复旦大学硕士。历任长江证券高级分析师,2011年加入交银施罗德基金管理有限公司,历任行业分析师、基金经理助理。 |

注:基金经理(或基金经理小组)期后变动(如有)敬请关注基金管理人发布的相关公告。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在报告期内,本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同和其他相关法律法规的规定,并本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,基金投资管理符合有关法律法规和基金合同的规定,为基金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基金运作的公平,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。

公司建立资源共享的投资研究信息平台,确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。公司在交易执行环节实行集中交易制度,建立公平的交易分配制度。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。

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账户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。

报告期内本公司严格执行公平交易制度,公平对待旗下各投资组合,未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度,经济内需延续疲软,通胀压力平稳,货币政策则进一步趋向宽松。随着监管部门对于过度杠杆的监管加强,A股市场出现了历史罕见的快速调整,绝大部分上市公司股价难以幸免。本季度经历大幅下跌后,部分个股已经逐步回归前两年的估值合理水平,未来将逐步具备投资价值。

报告期内,本基金配置逐渐转向均衡配置,适度增加了国企改革类公司的配置比例,在市场大幅下跌后适度保持中性略高仓位。

展望四季度,产业创新方向不变,改革进程有望延续。我们对整体A股市场保持谨慎乐观,在传统行业中选择高分红率且需求稳定的行业公司,对新兴产业中集中持仓并挑选具备竞争壁垒和优势的细分领域龙头企业,同时本基金仍将适当参与相关改革主题。

4.5报告期内基金的业绩表现

截至2015年9月30日,本基金份额净值为1.500元,本报告期份额净值增长率为-15.92%,同期业绩比较基准增长率为-16.84%。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内无需预警说明。

### §5投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 392,725,962.45 | 55.45 |
| | 其中:股票 | 392,725,962.45 | 55.45 |
| 2 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中:债券 | - | - |
| | 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 | - | - |
| | 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 | 314,503,946.75 | 44.41 |
| 7 | 其他资产 | 983,897.45 | 0.14 |
| 8 | 合计 | 708,213,806.65 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | 7,137,263.00 | 1.03 |
| B | 采矿业 | 7,746,375.00 | 1.11 |
| C | 制造业 | 249,216,198.75 | 35.86 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 34,708,076.82 | 4.99 |
| F | 批发和零售业 | 20,126,126.01 | 2.90 |
| 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 | 49,380,579.84 | 7.11 |
| J | 金融业 | 11,407,498.90 | 1.64 |
| K | 房地产业 | 6,421,506.00 | 0.92 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 4,154,266.88 | 0.60 |
| 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 | 2,428,071.25 | 0.35 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 392,725,962.45 | 56.52 |

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

| 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(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 002717 | 岭南园林 | 1,960,591 | 29,448,076.82 | 4.24 |
| 2 | 002169 | 智光电气 | 1,215,923 | 21,558,314.79 | 3.10 |
| 3 | 002280 | 联络互动 | 506,114 | 17,845,579.64 | 2.57 |
| 4 | 002422 | 科伦药业 | 1,141,039 | 16,990,070.71 | 2.45 |
| 5 | 600501 | 航天晨光 | 1,000,000 | 16,280,000.00 | 2.34 |
| 6 | 300367 | 东方网力 | 288,533 | 16,264,605.21 | 2.34 |
| 7 | 300226 | 上海钢联 | 306,680 | 16,235,639.20 | 2.34 |
| 8 | 600976 | 健民集团 | 587,335 | 15,840,424.95 | 2.28 |
| 9 | 002053 | 云南盐化 | 835,158 | 15,759,431.46 | 2.27 |
| 10 | 600446 | 金证股份 | 602,100 | 15,299,361.00 | 2.20 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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。

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五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 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。

5.10 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体除科伦药业(证券代码:002422)外,未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

报告期内本基金投资的前十名证券之一科伦药业(证券代码:002422)于2015年4月23日公告,公司因信息披露违法违规于2015年4月22日收到《中国证券监督管理委员会四川监管局行政处罚决定书》。据此,四川证监局决定对公司给予警告,并处60万元罚款。

本基金管理人对该证券投资决策程序的说明如下:本基金管理人对证券投资特别是重仓股的投资有严格的投资决策流程控制。本基金在对该证券的投资也严格执行投资决策流程。在对该证券的选择上,严格执行公司股票池审核流程进入公司核心股票池。在对该证券的持有过程中公司研究员密切关注上市公司动向。在上述事件发生时及时分析其对投资决策的影响,经过分析认为此事件对上市公司财务状况、经营成果和现金流量未产生重大的实质性影响,所以不影响对该公司基本面和公司治理的投资判断。

5.11.2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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 648,134.22 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 51,675.65 |
| 5 | 应收申购款 | 284,087.58 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 983,897.45 |

5.11.4 报告期末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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 600446 | 金证股份 | 15,299,361.00 | 2.20 | 重大事项 |

5.11.6 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。

### §6 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 531,696,396.68 |
| 本报告期期间基金总申购份额 | 75,864,016.69 |
| 减:本报告期期间基金总赎回份额 | 144,220,543.38 |
| 本报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列) | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 463,339,869.99 |

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。

### §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

| | |
|---|---|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 177,778,105.88 |
| 本报告期买入/申购总份额 | - |
| 本报告期卖出/赎回总份额 | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 177,778,105.88 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%) | 38.37 |

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。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期内未进行本基金的申购、赎回、红利再投等。

### §8 影响投资者决策的其他重要信息

鉴于交银施罗德主题优选灵活配置混合型证券投资基金的业绩比较基准的指数停止计算编制,本基金管理人根据基金合同的相关约定,经与基金托管人协商一致,并报中国证监会备案,决定自2015年10月1日起将交银施罗德主题优选灵活配置混合型证券投资基金的业绩比较基准由原“60%×沪深300指数收益率+40%×中信标普全债指数收益率”变更为“60%×沪深300指数收益率+40%×中证综合债券指数收益率”,并相应修改基金合同的有关内容。详情请见本基金管理人于2015年9月28日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金业绩比较基准变更并修改基金合同相关内容的公告》。

### §9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准交银施罗德主题优选灵活配置混合型证券投资基金募集的文件;
2、《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》;
3、《交银施罗德主题优选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》;
4、《交银施罗德主题优选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;
5、关于募集交银施罗德主题优选灵活配置混合型证券投资基金之法律意见书;
6、基金管理人业务资格批件、营业执照;
7、基金托管人业务资格批件、营业执照;
8、报告期内交银施罗德主题优选灵活配置混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

9.3 查阅方式

投资者可在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅备查文件,或者登录基金管理人的网站(www.fund001.com,www.bocomschroder.com)查阅。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人交银施罗德基金管理有限公司。本公司客户服务中心电话:400-700-5000(免长途话费),021-61055000,电子邮件:services@jysld.com。

---

# 中信建投稳利保本混合型证券投资基金

## 2015 第三季度 报告

2015年9月30日

**基金管理人:中信建投基金管理有限公司**
**基金托管人:北京银行股份有限公司**
**报告送出日期:2015年10月27日**

### §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。

基金托管人北京银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月21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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

### §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 中信建投稳利保本 |
| 交易代码 | 000804 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2014年9月26日 |
| 报告期末基金份额总额 | 155,485,762.83份 |
| 投资目标 | 本基金通过稳健资产与风险资产的动态配置和有效的组合管理,在严格控制风险的基础上,力争实现基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | 本基金运用恒定比例组合保险策略(Constant Proportion Portfolio Insurance,简称CPPI策略),动态调整稳健资产与风险资产在基金组合中的投资比例,以确保本基金在保本周期到期时的本金安全,并实现基金资产在保本基础上的保值增值目的。 |
| 业绩比较基准 | 两年期银行定期存款税后收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金为保本混合型基金,属证券投资基金中的低风险品种,其长期平均预期风险与预期收益率低于股票型基金、非保本的混合型基金,高于货币市场基金。投资者投资于保本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构,保本基金在极端情况下仍然存在损失投资本金的风险。 |
| 基金管理人 | 中信建投基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 北京银行股份有限公司 |

### §3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -1,384,371.85 |
| 2.本期利润 | -2,882,788.04 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0162 |
| 4.期末基金资产净值 | 184,262,369.81 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.185 |

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。

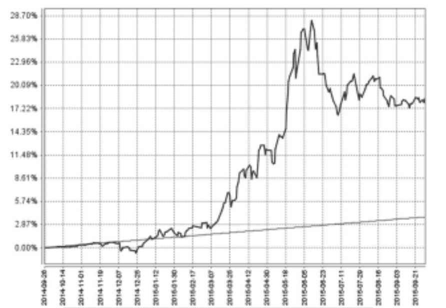
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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 | -1.00% | 0.50% | 0.92% | 0.01% | -1.92% | 0.49% |

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



### §4 管理人报告

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 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 王浩 | 本基金的基金经理 | 2014年9月26日 | - | 5 | 中国籍,1982年2月生,中央财经大学证券投资专业硕士。2010年7月至2013年9月任职于中信建投证券股份有限公司资产管理部,从事证券投资研究分析工作;2013年9月至今任职于中信建投基金管理有限公司投资研究部,从事投资研究工作。现任中信建投稳信定期开放债券型证券投资基金、中信建投稳利保本混合型证券投资基金基金经理。 |

注:1、任职日期是指本基金基金合同生效之日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《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守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易指导意见》、基金合同和其他有关法律法规,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合法合规,没有损害基金持有人利益。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易指导意见》,完善相应制度及流程,通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行,未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本报告期内,未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年三季度,宏观经济增速延续低迷态势,受到猪肉、蔬菜价格影响CPI略有反弹,而PPI通缩幅度继续扩大。政策角度,货币政策与财政政策延续积极态势,8月25日再次降准降息,同时推出了一系列稳增长的政策。

市场方面,债券市场受经济增长低迷及政策宽松支持,收益率加速下行,长端利率再创新低;股票市场则受到去杠杆等一系列规范措施的影响,出现大幅下跌,并且多次出现流动性严重不足的局面。

操作方面,本基金在二季度末已经大幅降低了权益投资仓位,从而较好的规避了市场的大幅下跌,期间以小仓位参与了7月市场的反弹,取得了不错的效果,总体来看,三季度在市场出现剧烈下跌的过程中,净值保持平稳,很好地保存了上半年的投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.185元,本报告期份额净值增长率为-1.00%,同期业绩比较基准收益率为0.92%。

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2015年四季度,在长周期因素影响下,宏观经济指标出现大幅反弹的可能性不大,但同时作为领先指标的货币供应数据已经企稳,随着各项稳增长政策效果的显现,预计四季度宏观经济下行幅度有限。通胀角度,虽然预计猪肉价格的上涨周期依然延续,但是其余各项指标依然疲弱,预计通胀水平暂时不会大幅回升,依然维持较低水平。在这样的经济背景下,预计四季度债券市场风险不大,而机会也相对有限;股票市场则依然处于筑底的阶段,可能出现阶段性反弹机会,但整体来说市场仍在修养阶段。本季度基金管理人将会在控制仓位的基础上,积极参与反弹机会,但依然以控制风险,防范净值回撤,获取稳定收益为主要目标。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期未发生基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元的情形。

### §5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 22,548,097.12 | 11.93 |
| | 其中:股票 | 22,548,097.12 | 11.93 |
| 2 | 固定收益投资 | 154,939,673.80 | 81.98 |
| | 其中:债券 | 154,939,673.80 | 81.98 |
| | 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 | - | - |
| | 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 | 7,383,066.84 | 3.91 |
| 7 | 其他资产 | 4,118,003.16 | 2.18 |
| 8 | 合计 | 188,988,840.92 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 22,548,097.12 | 12.24 |
| 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 | 22,548,097.12 | 12.24 |

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

| 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(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 000625 | 长安汽车 | 300,000 | 4,428,000.00 | 2.40 |
| 2 | 002179 | 中航光电 | 99,937 | 3,539,768.54 | 1.92 |
| 3 | 600978 | 宜华木业 | 200,000 | 2,964,000.00 | 1.61 |
| 4 | 300292 | 吴通通讯 | 90,000 | 2,884,500.00 | 1.57 |
| 5 | 300439 | 美康生物 | 90,000 | 2,743,200.00 | 1.49 |
| 6 | 300090 | 盛运环保 | 120,000 | 2,167,200.00 | 1.18 |
| 7 | 000782 | 美达股份 | 155,201 | 1,952,428.58 | 1.06 |
| 8 | 000418 | 小天鹅A | 100,000 | 1,869,000.00 | 1.01 |

注:本基金本报告期末仅持有上述八只股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 20,104,000.00 | 10.91 |
| | 其中:政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | 63,375,673.80 | 34.39 |
| 5 | 企业短期融资券 | 20,189,000.00 | 10.96 |
| 6 | 中期票据 | 51,271,000.00 | 27.83 |
| 7 | 可转债 | - | - |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 154,939,673.80 | 84.09 |

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债券投资明细

| 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(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 150307 | 15进出07 | 200,000 | 20,104,000.00 | 10.91 |
| 2 | 1382132 | 13宇通MTN1 | 100,000 | 10,411,000.00 | 5.65 |
| 3 | 101453023 | 14中天MTN001 | 100,000 | 10,266,000.00 | 5.57 |
| 4 | 101461035 | 14中科集团MTN001 | 100,000 | 10,243,000.00 | 5.56 |
| 5 | 101480003 | 14营口沿海MTN001 | 100,000 | 10,182,000.00 | 5.53 |

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十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本着谨慎原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,参与股指期货的投资,以改善组合的风险收益特性。

本基金本报告期未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

根据基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

报告期内,本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求,未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 436,968.75 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 3,681,034.41 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 4,118,003.16 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 600978 | 宜华木业 | 2,964,000.00 | 1.61 | 重大事项停牌 |

5.11.6 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。

### §6 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 210,183,845.46 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 959,974.12 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 55,658,056.75 |
| 报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列) | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 155,485,762.83 |

### §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:本报告期内,基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

### §8 影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人于2015年7月9日发布了《中信建投基金管理有限公司高级管理人员变更公告》,由张杰女士担任公司总经理,董事长蒋月勤先生不再代行总经理职务。

### §9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会核准基金募集的文件;
2、《中信建投稳利保本混合型证券投资基金基金合同》;
3、《中信建投稳利保本混合型证券投资基金托管协议》;
4、基金管理人业务资格批件、营业执照;
5、基金托管人业务资格批件、营业执照。

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人办公场所。

9.3 查阅方式

投资者可以在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件。

**中信建投基金管理有限公司**
**2015年10月27日**

---

# 交银施罗德增利债券证券投资基金

## 2015 第三季度 报告

2015年9月30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:二〇一五年十月二十七日**

### §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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月26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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

### §2 基金产品概况

| | | |
|---|---|---|
| 基金简称 | 交银增利债券 | |
| 基金主代码 | 519680 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2008年3月31日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 1,711,377,070.80份 | |
| 投资目标 | 本基金根据宏观经济运行状况和金融市场的运行趋势,自上而下进行宏观分析,自下而上精选个券,在控制信用风险、利率风险、流动性风险前提下,主要通过投资承担一定信用风险、具有较高息票率的债券,实现基金资产的长期稳定增长。 | |
| 投资策略 | 本基金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,动态调整大类金融资产比例,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,自下而上地配置债券类属和精选个券。 | |
| 业绩比较基准 | 中债企业债总指数 | |
| 风险收益特征 | 本基金是一只债券型基金,在证券投资基金中属于中等风险的品种,其长期平均风险和预期收益高于货币市场基金,低于股票型基金。 | |
| 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 | |
| 下属两级基金的基金简称 | 交银增利债券A/B | 交银增利债券C |
| 下属两级基金的交易代码 | 519680(前端)、519681(后端) | 519682 |
| 报告期末下属两级基金的份额总额 | 1,269,017,013.37份 | 442,360,057.43份 |

注:本基金A类基金份额采用前端收费模式,B类基金份额采用后端收费模式,前端交易代码即为A类基金份额交易代码,后端交易代码即为B类基金份额交易代码。

### §3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2015年7月1日-2015年9月30日) | |
|---|---|---|
| | 交银增利债券A/B | 交银增利债券C |
| 1.本期已实现收益 | 28,703,684.12 | 16,350,455.10 |
| 2.本期利润 | 22,005,593.75 | 10,179,074.39 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0199 | 0.0175 |
| 4.期末基金资产净值 | 1,302,013,655.32 | 453,204,168.17 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.0260 | 1.0245 |

注:1、本基金A/B类业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后的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。

3.2 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

1、交银增利债券A/B:

| 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 | 2.26% | 0.07% | 0.99% | 0.07% | 1.27% | 0.00% |

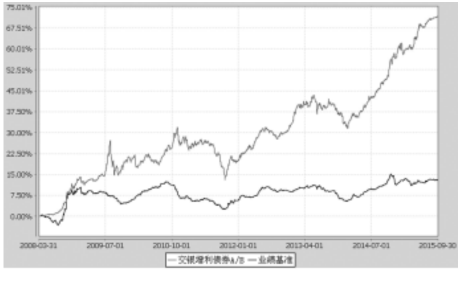
2、交银增利债券C:

| 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 | 2.14% | 0.07% | 0.99% | 0.07% | 1.15% | 0.00% |

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

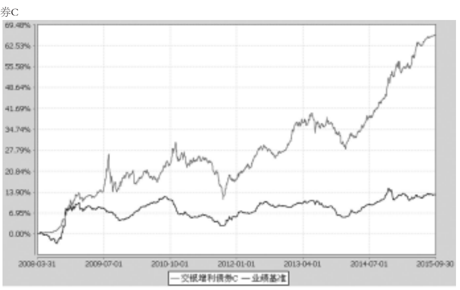
交银施罗德增利债券证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2008年3月31日至2015年9月30日)

1. 交银增利债券A/B



注:本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至建仓期结束,本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

2. 交银增利债券C



注:本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至建仓期结束,本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

### §4 管理人报告

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 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 赵凌琦 | 交银增利债券、交银信用添利债券(LOF)、交银理财60天债券、交银双轮动债券、交银定期支付月月丰债券、交银强化回报债券、交银丰盈收益债券的基金经理,公司固定收益部副总经理 | 2015-05-09 | 2015-08-29 | 2年 | 赵凌琦女士,10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。2013年9月3日至2015年8月15日担任交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金基金经理,2014年1月28日至2015年8月15日担任交银施罗德强化回报债券型证券投资基金基金经理,2014年3月31日至2015年8月15日担任交银施罗德理财60天债券型证券投资基金基金经理。2014年3月31日至2015年8月28日担任交银施罗德双轮动债券型证券投资基金基金经理,2014年8月11日至2015年8月28日担任交银施罗德丰盈收益债券型证券投资基金基金经理,2015年5月9日至2015年8月28日担任交银施罗德信用添利债券证券投资基金(LOF)基金经理,2015年5月9日至2015年8月28日担任交银施罗德增利债券证券投资基金基金经理。 |
| 孙超 | 交银增利债券、交银纯债债券发起、交银理财60天债券、交银双轮动债券、交银定期支付月月丰债券、交银强化回报债券、交银丰润收益债券、交银丰享收益债券、交银丰泽收益债券的基金经理 | 2015-07-18 | - | 4年 | 孙超先生,美国哥伦比亚大学经济学硕士。历任中信建投证券股份有限公司资产管理部经理、高级经理。2013年加入交银施罗德基金管理有限公司,历任基金经理助理。 |

注:基金经理(或基金经理小组)期后变动(如有)敬请关注基金管理人发布的相关公告。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在报告期内,本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同和其他相关法律法规的规定,并本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,基金投资管理符合有关法律法规和基金合同的规定,为基金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基金运作的公平,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。

公司建立资源共享的投资研究信息平台,确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。公司在交易执行环节实行集中交易制度,建立公平的交易分配制度。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。

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账户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。

报告期内本公司严格执行公平交易制度,公平对待旗下各投资组合,未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2015年三季度债券市场走势呈震荡上行走势,6月份股灾之后,原投资于股票和打新的资金纷纷流向债券。但随着8月份中国启动汇率改革以来,市场一度对人民币贬值预期加强,并引发了全球资产的大幅下跌,债市经历了短暂的调整。但随后央行加大外汇市场的管制力度,并实施一定的资本管制,目前汇率已经基本稳定,经济基本面依然不容乐观,债券重拾平稳走势。

中债总全价(总值)指数在三季度上涨1.3%。本基金在债券收益下行的过程中逐步减少信用债配置,提高组合的流动性;在期间大量资金申购的过程中维持了净值的平稳上涨。本基金在三季度低配了权益类资产。

展望后市,银行理财等资金配置需求依然强烈,股票市场处于震荡行情,高收益资产稀缺,在各大类资产中债券或仍然具有较高的配置价值。年内政府债务置换已过大半,再加上利率债等也已经度过三季度发行最高峰,四季度供给量将大幅减少。最新的经济数据显示基本面依然疲弱,汇率短期内也趋于稳定,这都有利于中长期利率下行。信用债方面,信用利差已经压缩至历史低位,而实体经济盈利情况恶化明显,信用风险将逐渐暴露。债券绝对收益率下降会倒逼银行理财的收益率下行,未来低利率环境有望成为常态。货币当局为了对冲外汇储备下降以及引导资金成本下行,有望维持比较宽松的货币政策,年内再次降准、降息均可期。但同时,政府已经加大财政刺激,基建等投资力度有望加大,应警惕基本面边际改善对债市预期的变化以及投资者风险偏好的提升。经济转型之路漫漫,“预算软约束”问题依旧存在,一旦高压放松,地方政府加杠杆动力仍在。整个经济面临困境时,动员地方政府重新发力仍可能是最自然的选择。“腾笼换鸟、凤凰涅槃”对信用债定价模式的影响也值得密切关注。我们也将密切关注中央经济工作会议所传达的新信号。至于权益类资产,我们认为市场信心正处于逐步恢复过程中,拟择机增配。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2015年9月30日,交银增利债券A/B份额净值为1.0260元,本报告期份额净值增长率为2.26%,同期业绩比较基准增长率为0.99%;交银增利债券C份额净值为1.0245元,本报告期份额净值增长率为2.14%,同期业绩比较基准增长率为0.99%。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内无需预警说明。

### §5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | - | - |
| | 其中:股票 | - | - |
| 2 | 固定收益投资 | 1,797,759,732.96 | 83.96 |
| | 其中:债券 | 1,681,699,732.96 | 78.54 |
| | 资产支持证券 | 116,060,000.00 | 5.42 |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | 301,016,291.53 | 14.06 |
| | 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 | 21,888,020.15 | 1.02 |
| 7 | 其他资产 | 20,607,387.20 | 0.96 |
| 8 | 合计 | 2,141,271,431.84 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | 51,140,000.00 | 2.91 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 382,555,000.00 | 21.80 |
| | 其中:政策性金融债 | 382,555,000.00 | 21.80 |
| 4 | 企业债券 | 600,495,232.96 | 34.21 |
| 5 | 企业短期融资券 | 480,167,000.00 | 27.36 |
| 6 | 中期票据 | 163,408,000.00 | 9.31 |
| 7 | 可转债 | 3,934,500.00 | 0.22 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 1,681,699,732.96 | 95.81 |

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债券投资明细

| 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(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 150213 | 15国开13 | 1,400,000 | 142,408,000.00 | 8.11 |
| 2 | 150217 | 15国开17 | 1,000,000 | 99,950,000.00 | 5.69 |
| 3 | 125872 | 15永安债 | 600,000 | 60,000,000.00 | 3.42 |
| 4 | 1480534 | 14京天恒债 | 500,000 | 51,570,000.00 | 2.94 |
| 5 | 150016 | 15附息国债16 | 500,000 | 51,140,000.00 | 2.91 |

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十名资产支持证券投资明细

| 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(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 1589212 | 15开元5A2 | 500,000 | 50,075,000.00 | 2.85 |
| 2 | 1589213 | 15开元5A3 | 500,000 | 49,485,000.00 | 2.82 |
| 3 | 119237 | 15南方A1 | 50,000 | 5,000,000.00 | 0.28 |
| 4 | F0000E | 濮阳优先02 | 40,000 | 4,000,000.00 | 0.23 |
| 5 | F0000F | 濮阳优先03 | 40,000 | 4,000,000.00 | 0.23 |
| 6 | F0000D | 濮阳优先01 | 35,000 | 3,500,000.00 | 0.20 |

注:因“濮阳优先02”“濮阳优先03”“濮阳优先01”暂无市场代码,上表中对应的证券代码为系统虚拟代码。

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五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 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。

5.10 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1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。

5.11.2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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 54,135.95 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 20,098,818.28 |
| 5 | 应收申购款 | 454,432.97 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 20,607,387.20 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 113008 | 电气转债 | 3,934,500.00 | 0.22 |

5.11.5 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情况。

5.11.6 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。

### §6 开放式基金份额变动

单位:份

| 项目 | 交银增利债券A/B | 交银增利债券C |
|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 724,011,276.95 | 177,598,077.69 |
| 本报告期期间基金总申购份额 | 996,168,305.64 | 1,209,213,456.30 |
| 减:本报告期期间基金总赎回份额 | 451,162,569.22 | 944,451,476.56 |
| 本报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列) | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 1,269,017,013.37 | 442,360,057.43 |

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。

### §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

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。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期内未进行本基金的申购、赎回、红利再投等。

### §8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准交银施罗德增利债券证券投资基金募集的文件;
2、《交银施罗德增利债券证券投资基金基金合同》;
3、《交银施罗德增利债券证券投资基金招募说明书》;
4、《交银施罗德增利债券证券投资基金托管协议》;
5、关于募集交银施罗德增利债券证券投资基金之法律意见书;
6、基金管理人业务资格批件、营业执照;
7、基金托管人业务资格批件、营业执照;
8、报告期内交银施罗德增利债券证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

8.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

8.3 查阅方式

投资者可在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅备查文件,或者登录基金管理人的网站(www.fund001.com,www.bocomschroder.com)查阅。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人交银施罗德基金管理有限公司。本公司客户服务中心电话:400-700-5000(免长途话费),021-61055000,电子邮件:services@jysld.com。