交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金

【2015】第四季度报告

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
报告送出日期:二〇一六年一月二十一日

§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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016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。

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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	交银定期支付双息平衡混合
基金主代码	519732
交易代码	519732
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年9月4日
报告期末基金份额总额	50,520,459.96份
投资目标	本基金精选具有长期增长潜力和较好分红能力的股票,以及具有较高息票率的债券,力争实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金精选具有较好现金分红能力、长期增长潜力且估值水平合理的上市公司以及具有较高息票率的债券,通过在股票和债券等不同类别资产中的平衡配置,追求基金资产在风险可控前提下的持续增值,充分享受股票分红和债券利息的双重收益。
业绩比较基准	50%×中证红利指数收益率+50%×中债综合全价指数收益率
风险收益特征	本基金是一只混合型基金,在证券投资基金中属于较高风险的品种,其长期平均风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金,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	中国农业银行股份有限公司

§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10月1日-2015年12月31日)
1.本期已实现收益	20,839,581.83
2.本期利润	28,890,400.87
3.加权平均基金份额本期利润	0.5296
4.期末基金资产净值	104,872,047.23
5.期末基金份额净值	2.076

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。

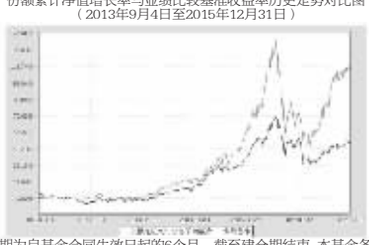
3.2 基金净值表现

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	32.31%	1.79%	11.63%	0.86%	20.68%	0.93%

3.2.2 目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

交银施罗德定期支付双息平衡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
(2013年9月4日至2015年12月31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		
杨浩	交银定期支付双息平衡混合的基金经理	2015-08-15	-	5年	杨浩先生,北京邮电大学通信与信息系统专业硕士。2010年加入交银施罗德基金管理有限公司,历任行业分析师。

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。

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

市场在经历了2015年三季度的快速下跌后,四季度迎来反弹,新兴产业表现尤为突出,其中云计算、文化消费、新医疗等方向个股表现亮眼,同时在"供给侧改革"的提法下,传统产业的供求关系变化亦同样受到市场关注。四季度本基金净值跑赢业绩比较基准,主要来自四季度初以来保持较高的仓位,以及对新兴成长行业的较早布局。

展望2016年一季度,人民币汇率的走势是主要关注点,同时我们认为个股差异会加剧。我们在关注新兴产业的投资机会同时也应当在其兑现时间和投资人耐心及估值水平间做出权衡,并时刻关注传统产业改革的蛛丝马迹。

4.5报告期内基金的业绩表现

截至2015年12月31日,本基金份额净值为2.076元,本报告期份额净值增长率为32.31%,同期业绩比较基准增长率为11.63%。

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	72,192,744.76	67.63
	其中:股票	72,192,744.76	67.63
2	固定收益投资	20,672,195.20	19.36
	其中:债券	20,672,195.20	19.36
	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	13,128,794.16	12.30
7	其他资产	760,002.11	0.71
8	合计	106,753,736.23	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	42,399,319.90	40.43
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	7,824,958.80	7.46
G	交通运输、仓储和邮政业	1,742,895.36	1.66
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	20,225,570.70	19.29
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	72,192,744.76	68.84

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	002131	利欧股份	312,700	6,097,650.00	5.81
2	300352	北信源	84,000	5,241,600.00	5.00
3	002474	榕基软件	211,730	5,070,933.50	4.84
4	600576	万家文化	182,720	4,968,156.80	4.74
5	300171	东富龙	150,595	4,514,838.10	4.31
6	300322	硕贝德	199,500	3,890,250.00	3.71
7	300078	思创医惠	68,626	3,348,948.80	3.19
8	600556	慧球科技	123,600	3,345,852.00	3.19
9	002280	联络互动	53,693	3,296,750.20	3.14
10	300161	华中数控	88,975	3,267,162.00	3.12

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	20,258,000.00	19.32
	其中:政策性金融债	20,258,000.00	19.32
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	414,195.20	0.39
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	20,672,195.20	19.71

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	150201	15国开01	100,000	10,248,000.00	9.77
2	150311	15进出11	100,000	10,010,000.00	9.54
3	128009	歌尔转债	2,390	335,723.30	0.32
4	113008	电气转债	570	78,471.90	0.07

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	154,446.78
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	537,116.37
5	应收申购款	68,438.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	760,002.11

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	128009	歌尔转债	335,723.30	0.32
2	113008	电气转债	78,471.90	0.07

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

报告期期初基金份额总额	60,343,646.61
本报告期期间基金总申购份额	4,547,932.58
减:本报告期期间基金总赎回份额	14,371,119.24
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	50,520,459.96

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定期支付双息平衡混合型证券投资基金募集的文件;

2、《交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金合同》;

3、《交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金招募说明书》;

4、《交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金托管协议》;

5、关于募集交银施罗德定期支付双息平衡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定期支付双息平衡混合型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。

交银施罗德丰润收益债券型证券投资基金

【2015】第四季度报告

基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年一月二十一日

§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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016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。

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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	交银丰润收益债券
基金主代码	519743
基金运作方式	契约型,本基金在基金合同生效之日起两年(含两年)的期间内封闭式运作(按照基金合同的约定提前转换基金运作方式的除外),封闭期结束后转为开放式运作
基金合同生效日	2014年12月15日
报告期末基金份额总额	425,488,278.42份
投资目标	在严格控制风险的基础上,力求获得高于业绩基准的投资收益。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势,融合现范化的基本面研究和严谨的信用分析,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,充分利用封闭式运作优势,以买入持有和杠杆套息等为基本投资策略,获取稳定收益;同时,本基金将严格控制信用风险,在严谨深入的信用分析基础上,综合考量信用债券的信用评级,以及各类债券的流动性、供求关系和收益率水平等,自下而上精选个券。
业绩比较基准	两年期银行定期存款税后收益率+1.25%
风险收益特征	本基金是一只债券型基金,其风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金,属于证券投资基金中中等风险的品种。
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司

下属两级基金的基金简称	交银丰润收益债券A	交银丰润收益债券C
下属两级基金的交易代码	519743	519745
报告期末下属两级基金的份额总额	402,154,039.59份	23,334,238.83份

§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10月1日-2015年12月31日)	
	交银丰润收益债券A	交银丰润收益债券C
1.本期已实现收益	8,821,192.12	470,566.55
2.本期利润	5,806,510.00	296,559.09
3.加权平均基金份额本期利润	0.0144	0.0127
4.期末基金资产净值	444,167,058.74	25,611,100.64
5.期末基金份额净值	1.104	1.098

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、交银丰润收益债券A:

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	1.28%	0.07%	0.87%	0.01%	0.41%	0.06%

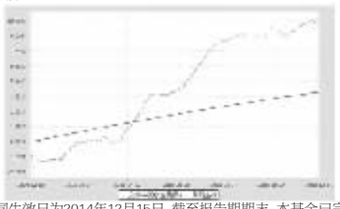
2、交银丰润收益债券C:

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	1.20%	0.08%	0.87%	0.01%	0.33%	0.07%

3.2.2 目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

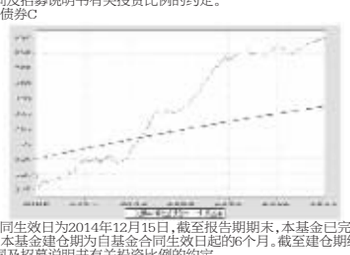
交银施罗德丰润收益债券型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2014年12月15日至2015年12月31日)

1. 交银丰润收益债券A



注:本基金基金合同生效日为2014年12月15日,截至报告期期末,本基金已完成建仓但报告期期末距建仓结束未满一年。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. 交银丰润收益债券C



注:本基金基金合同生效日为2014年12月15日,截至报告期期末,本基金已完成建仓但报告期期末距建仓结束未满一年。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		
孙超	交银增利债券、交银纯债债券发起、交银荣祥保本混合、交银荣泰保本混合、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、交银丰源收益债券、交银丰颐收益债券的基金经理	2014-12-15	-	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。2014年8月26日至2015年11月17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8月26日至2015年11月17日担任交银施罗德双轮动债券型证券投资基金基金经理。
连端清	交银货币、交银理财60天债券、交银丰盈收益债券、交银现金宝货币、交银丰润收益债券的基金经理	2015-08-04	-	4年	连端清先生,复旦大学经济学博士。历任交通银行总行金融市场部、湘财证券研究所研究员、中航信托资产管理部投资经理。2015年加入交银施罗德基金管理有限公司。

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年四季度,国内经济整体上依旧有下行压力,CPI低位运行。尽管受稳增长影响,部分指标如工业增加值及制造业投资有企稳好转迹象,但是房地产投资依旧处于下行通道,传统制造业去产能及房地产行业去库存的挑战依旧。

货币政策上,央行货币政策维持宽松操作思路。鉴于国内经济下行压力,央行赶在美联储加息前,于10月下旬再次降准降息。美联储在12月份如期加息,中美央行的货币政策再度分化。受央行宽松货币政策影响,四季度资金面宽裕,银行间市场回购利率维持低位。但是先后受到10月份央行双降、11月IPO重启及12月资金面整体宽松下配置增强等影响,四季度债市经历先涨、后回调、再涨的行情,波动较大,行情腾挪跌宕,整体上较三季度继续大涨。基金操作方面,报告期内,本基金调整部分债券,维持一定的杠杆与久期,运作较为稳健。

展望2016年一季度,考虑短期内依然面临传统制造业去产能及房地产行业去库存等问题,房地产投资增速仍有继续下滑的可能,国内经济整体上依然有下行压力。央行整体上将维持宽松的货币政策,但流动性边际改善的幅度可能不及2015年。但预计2016年一季度将更多以定向工具及公开市场操作为主来维持较宽裕的流动性,不排除降准降息的可能性,但全面降准降息的频率较2015年可能下降。组合管理方面,本基金计划维持一定的杠杆水平,力求获取债券息差,同时控制信用风险,努力为持有人获取相对稳健的收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2015年12月31日,交银丰润收益债券A份额净值为1.104元,本报告期份额净值增长率为1.28%,同期业绩比较基准增长率为0.87%;交银丰润收益债券C份额净值为1.098元,本报告期份额净值增长率为1.20%,同期业绩比较基准增长率为0.87%。

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	753,708,798.14	91.86
	其中:债券	738,708,798.14	90.03
	资产支持证券	15,000,000.00	1.83
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	10,000,135.00	1.22
	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	38,504,523.77	4.69
7	其他资产	18,318,699.11	2.23
8	合计	820,532,156.02	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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	100,888,200.00	21.48
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	422,327,598.14	89.90
5	企业短期融资券	20,090,000.00	4.28
6	中期票据	195,403,000.00	41.59
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	738,708,798.14	157.25

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	122367	14财富债	400,000	42,224,000.00	8.99
2	101562001	15东方MTN001	400,000	41,528,000.00	8.84
3	101553002	15峰峰MTN001	400,000	40,928,000.00	8.71
4	122342	13包钢03	400,000	40,088,000.00	8.53
5	123306	14财通02	300,000	31,914,000.00	6.79

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	119163	15中油1A	150,000	15,000,000.00	3.19

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	0.07
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	18,318,699.04
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,318,699.11

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

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 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

6.1 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。

6.2 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。

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会准予交银施罗德丰润收益债券型证券投资基金募集注册的文件;

2、《交银施罗德丰润收益债券型证券投资基金基金合同》;

3、《交银施罗德丰润收益债券型证券投资基金招募说明书》;

4、《交银施罗德丰润收益债券型证券投资基金托管协议》;

5、基金管理人业务资格批件、营业执照;

6、基金托管人业务资格批件、营业执照;

7、关于申请募集注册交银施罗德丰润收益债券型证券投资基金的法律意见书;

8、报告期内交银施罗德丰润收益债券型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

7.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

7.3 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。

交银施罗德多策略回报灵活配置混合型证券投资基金

【2015】第四季度报告

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
报告送出日期:二〇一六年一月二十一日

§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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016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。

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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	交银多策略回报灵活配置混合
基金主代码	519755
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月2日
报告期末基金份额总额	3,974,103,645.93份
投资目标	本基金通过灵活运用多种投资策略,充分挖掘和利用市场中潜在的投资机会,在控制下行风险的前提下,力争为投资者提供长期稳健的投资回报。
投资策略	本基金将结合宏观经济环境、政策形势、证券市场走势的综合分析,灵活运用多种投资策略,主动判断市场时机,进行积极的资产配置,合理确定基金在股票、债券等各类资产类别上的投资比例,以最大限度地降低投资组合的风险、提高稳健投资收益。
业绩比较基准	50%×沪深300指数收益率+50%×中债综合全价指数收益率
风险收益特征	本基金是一只混合型基金,其风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金,低于股票型基金。属于承担较高风险、预期收益较高的证券投资基金品种。
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

下属两级基金的基金简称	交银多策略回报灵活配置混合A	交银多策略回报灵活配置混合C
下属两级基金的交易代码	519755	519761
报告期末下属两级基金的份额总额	1,728,105,032.27份	2,245,998,613.66份

§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10月1日-2015年12月31日)	
	交银多策略回报灵活配置混合A	交银多策略回报灵活配置混合C
1.本期已实现收益	31,188,125.41	5,043,490.36
2.本期利润	43,130,366.03	10,447,225.32
3.加权平均基金份额本期利润	0.0197	0.0045
4.期末基金资产净值	1,741,010,243.06	2,260,760,643.93
5.期末基金份额净值	1.007	1.007

注:1、上述基金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、交银多策略回报灵活配置混合A:

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	1.72%	0.08%	9.14%	0.83%	-7.42%	-0.75%

2、交银多策略回报灵活配置混合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
自基金分级日起至今	0.50%	0.05%	0.26%	0.84%	0.24%	-0.79%

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

交银施罗德多策略回报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的历史走势对比图
(2015年6月2日至2015年12月31日)

1. 交银多策略回报灵活配置混合A

注:图示日期为2015年6月2日至2015年12月31日。本基金基金合同生效日为2015