

交银施罗德丰享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

基金持有人的董事会及监事会在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。

基金管理人和基金托管人对本基金定期报告的内容真实、准确和完整承担连带责任。

基金管理人和基金托管人根据本基金合同规定，于2016年1月20日核对了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核后的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。投资人投资本基金在作出投资决策前应仔细阅读本基

金的招募说明书。

本报告经基金财务资料未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至2015年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称：交银施罗德丰享收益债券

基金代码：610798

交易代码：610798

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2015年1月19日

报告期末基金份额总额：259,386,400.06份

投资目标：在严格控制风险的前提下追求资产稳健增值的基础上，力求获得高于业绩基准的回报收益。

本基金在报告期内不进行日常交易行为。本报告期内，本公司管理的所有投资组合参与的交易所买卖协议同日向交易双方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，情形符合与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）向同交易的交易价差未出现异常。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金在报告期内不进行日常交易行为。本报告期内，本公司管理的所有投资组合参与的交易所买卖协议同日向交易双方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，情形符合与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）向同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

本报告期内，经济增长低迷，央行继续维持宽松的货币政策。货币市场利率维持低位，小幅波动，年末因素并未对总体流动性造成太大的影响。受IPO重启的影响，债券收益率在12月底、11月初有一定明显的上升，后因经济数据疲弱，降准预期升温，机构对2016年一季度普遍乐观使配置需求提高的因素影响下，收益率又快速下行到历史低位。2015年12月31日，10年期国债收益率较上季度大幅下降12bp到2.82%水平。本基金以与封闭期适度匹配的债券配置进行杠杆操作，报告期内运作稳健。

展望2016年，预计经济基本面依旧弱势，通胀仍将维持低位，货币宽松也将延续，降息降准周期尚未结束，债券收益率预计将呈现下行趋势，但考虑到整体收益率已经处于历史低位，预计债市波动性的特征将贯穿全年。此外随着产能去产能，部分企业或将面临破产或兼并重组，相关信用风险值得警惕。组合管理方面，本基金将维持现有仓位配置，力争为投资者创造稳健的回报收益。

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1.105元，本报告期份额净值增长率为1.56%，同期业绩比较基准增长率为0.55%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金份额净值变动情况说明

本基金本报告期无份额变动情况。

§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 -

2 固定收益投资 606,817,462.00 96.12

3 货币市场工具 466,791,862.00 8.51

4 其他资产 50,025,600.00 0.41

5 买入返售金融资产 -

6 银行存款和结算备付金合计 15,610,526.02 2.94

7 其他资产 10,347,420.06 1.96

8 合计 521,775,409.57 100.00

5.2 报告期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) 内基金资产净值比例 (%)

1 国家债券 -

2 行业债券 -

3 企业债券 250,369,862.00 87.34

4 金融债 39,972,000.00 13.04

5 中期票据 165,420,000.00 57.70

6 可转换债券 -

7 同业存单 -

8 回购协议 -

9 其他 -

10 合计 465,791,862.00 100.00

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 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 1280136 12号回购股债 240,000 24,729,600.00 8.63

2 112043 11东证A 240,000 24,681,800.00 8.61

3 112233 14国开债 220,000 23,947,600.00 8.26

4 112107 13山开E01 200,000 21,224,820.00 7.40

5 122326 14上证E01 200,000 21,220,000.00 7.40

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一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 119122 15通盈A 200,000 20,025,600.00 6.08

2 210914 15通A1A 200,000 20,000,000.00 6.08

3 119106 14中行EIA 100,000 10,000,000.00 3.49

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 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名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 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名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 报告期末按资产净值排序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。

5.12 报告期末按资产净值排序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中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.13 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 2,485.36

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 -

4 应收利息 10,344,763.30

5 应收申购款 -

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 10,347,420.00

5.14 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。

5.15 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。

5.16 投资组合报告附注

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。

5.17 投资组合报告附注的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

6.1 基金管理人持有的债券回购资金余额

本基金报告期内未有债券回购资金余额。

6.2 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.3 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人报告期内未进行本基金的申购、赎回、分红再投等。

6.4 备查文件目录

1. 中国证监会准予交银施罗德丰享收益债券型证券投资基金募集注册的文件；

2. 《交银施罗德丰享收益债券型证券投资基金基金合同》；

3. 《交银施罗德丰享收益债券型证券投资基金招募说明书》；

4. 《交银施罗德丰享收益债券型证券投资基金托管协议》；

5. 基金管理人办理业务资格批件、营业执照；

6. 基金托管人办理业务资格批件、营业执照；

7. 关于申请募集注册交银施罗德丰享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享收益债券型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原文。

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

投资者可以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.bocomrc.com查阅。

对于电子公告公开竞价交易，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。

对于非集中竞价交易，遵循“价格优先、比例分配”的原则，全部通过交易系统进行。

对于集中竞价交易，遵循“价格优先、比例分配”的原则，全部通过交易系统进行。

对于柜台交易，遵循“价格优先、比例分配”的原则，全部通过交易系统进行。

对于大宗交易，遵循“价格优先、比例分配”的原则，全部通过交易系统进行。

对于质押式回购交易，遵循“价格优先、比例分配”的原则，全部通过交易系统进行。

对于反向回购交易，遵循“价格优先、比例分配”的原则，全部通过交易系统进行。

对于定期定额投资，遵循“先进先出”的原则，全部通过交易系统进行。

对于基金转换，遵循“先进先出”的原则，全部通过交易系统进行。

对于定期开放式基金，遵循“先进先出”的原则，全部通过交易系统进行。

对于定期开放式基金，遵循“先进先出”的原则，全部通过交易系统进行。