

交银施罗德丰盈收益债券型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

2018年6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:中信银行股份有限公司

1 重要提示
1.1 重要提示
基金管理人、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。

2 基金简介
2.1 基金基本情况
基金名称:交银丰盈收益债券
基金代码:519740

Table with 2 columns: 基金名称, 基金代码, 基金简称, 基金管理人, 基金托管人, 报告期末基金份额总额

注:本基金自2017年8月14日起转为开放式运作。
2.2 基金产品说明

Table with 2 columns: 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人, 基金销售机构, 基金管理人及基金托管人

2.4 信息披露方式
基金管理人网站: www.fund001.com

3 主要财务指标和基金净值表现
3.1 主要会计数据和财务指标

Table with 2 columns: 项目, 报告期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

注: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;

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

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

注:本基金自2017年8月14日起转为开放式运作,本基金的业绩比较基准由“三年期银行定期存款税后收益率”变更为“中债综合全价指数”。

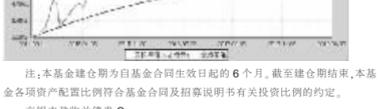
Table with 4 columns: 阶段, 份额净值增长率, 业绩比较基准收益率, ①-②, ③-④

注:本基金自2017年8月14日起转为开放式运作,本基金的业绩比较基准由“三年期银行定期存款税后收益率”变更为“中债综合全价指数”。

3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩指标与同期业绩比较基准收益率的比较



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。



注:本基金自2017年8月14日起增加C类份额,投资者提交的申购申请于2017年8月15日被确认并将有效份额登记在账,图示日期为2017年8月14日至2018年6月30日。

4 管理人报告
4.1 基金管理人及基金情况
4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

注:本基金自2017年8月14日起增加C类份额,投资者提交的申购申请于2017年8月15日被确认并将有效份额登记在账,图示日期为2017年8月14日至2018年6月30日。

4.2 基金管理人及基金情况
4.2.1 基金管理人及其管理基金的经验

4.2.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

注:本基金自2017年8月14日起增加C类份额,投资者提交的申购申请于2017年8月15日被确认并将有效份额登记在账,图示日期为2017年8月14日至2018年6月30日。

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期

注:1、本表所列基金经理(助理)任职日期和离任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《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、基金经理(或基金经理小组)期间变动(如有)敬请关注基金管理人发布的相关公告。

4.2 管理人报告
4.2.1 基金管理人及基金情况
4.2.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

4.2.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

注: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 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 4 columns: 阶段, 份额净值增长率, 业绩比较基准收益率, ①-②, ③-④

注:本基金自2017年8月14日起转为开放式运作,本基金的业绩比较基准由“三年期银行定期存款税后收益率”变更为“中债综合全价指数”。

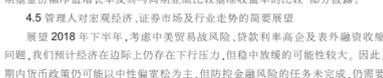
Table with 4 columns: 阶段, 份额净值增长率, 业绩比较基准收益率, ①-②, ③-④

注:本基金自2017年8月14日起转为开放式运作,本基金的业绩比较基准由“三年期银行定期存款税后收益率”变更为“中债综合全价指数”。

3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩指标与同期业绩比较基准收益率的比较



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。



注:本基金自2017年8月14日起增加C类份额,投资者提交的申购申请于2017年8月15日被确认并将有效份额登记在账,图示日期为2017年8月14日至2018年6月30日。

4 管理人报告
4.1 基金管理人及基金情况
4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

注:本基金自2017年8月14日起增加C类份额,投资者提交的申购申请于2017年8月15日被确认并将有效份额登记在账,图示日期为2017年8月14日至2018年6月30日。

4.2 基金管理人及基金情况
4.2.1 基金管理人及其管理基金的经验

4.2.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

注:本基金自2017年8月14日起增加C类份额,投资者提交的申购申请于2017年8月15日被确认并将有效份额登记在账,图示日期为2017年8月14日至2018年6月30日。

4.3 基金管理人及基金情况
4.3.1 基金管理人及其管理基金的经验

4.3.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

注:本基金自2017年8月14日起增加C类份额,投资者提交的申购申请于2017年8月15日被确认并将有效份额登记在账,图示日期为2017年8月14日至2018年6月30日。

会计主体:交银施罗德丰盈收益债券型证券投资基金

报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

Table with 4 columns: 资产, 附注号, 期末数 2018年6月30日, 上年期末数 2017年12月31日

注:1、报告截止日2018年6月30日,A类基金份额净值1.051元,C类基金份额净值1.097元,基金份额总额34,798,758.05份,其中A类基金份额33,322,315.55份,C类基金份额1,476,442.50份。

2、本表中基金资产负债和利润表所列数字均为半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,应阅读载于基金管理人网站的半年度报告正文。

6.2 利润表
会计主体:交银施罗德丰盈收益债券型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

Table with 4 columns: 项目, 附注号, 本期 2018年1月1日至2018年6月30日, 上年同期可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日

6.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:交银施罗德丰盈收益债券型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

Table with 4 columns: 项目, 本期 2018年1月1日至2018年6月30日, 上期期末余额, 本期期末余额

报告附注为财务报表的重要组成部分

本报告6.1至6.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人:阮红,主管会计工作负责人:夏华云,会计机构负责人:单江

6.4 报表附注
6.4.1 基金基本情况

交银施罗德丰盈收益债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会备案(以下简称“中国证监会”)证监许可[2014]721号《关于核准交银施罗德丰盈收益债券型证券投资基金募集的批复》,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《交银施罗德丰盈收益债券型证券投资基金合同》负责公开募集。本基金为契约型、存续期不定,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,按照基金合同约定的提前结束转开放式运作(除特殊情况外),封闭期结束后转为开放式运作。本基金首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币510,566,610.35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(2014)第451号验资报告予以验证。于2014年9月11日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为510,566,140.93份基金份额,其中认购资金利息折合88,530.58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,基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据《交银施罗德丰盈收益债券型证券投资基金合同》和《交银施罗德丰盈收益债券型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购/申购费用、赎回费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资认购/申购时收取前认购/申购费用、赎回时收取赎回费用的,称为A类基金份额;在投资认购时不收取申购费用,赎回时收取前申购费用和赎回费用的,称为B类基金份额;在投资认购、申购、赎回时不收取申购费用、赎回费用,而是从本类基金份额资产中计提销售服务费的,称为C类基金份额。本基金募集期内仅开通A类基金份额的认购,在基金合同生效之日起三年(含三年)的期间内封闭式运作,封闭期结束后转为开放式运作,并增加B类和C类基金份额的申购。根据《关于交银施罗德丰盈收益债券型证券投资基金封闭式运作期间结束转为开放式运作并增加增加B类和C类基金份额开放基金日常申购、赎回、定期定额投资业务并增加前申购费率优惠的公告》的相关规定,本基金封闭期于2018年8月11日(基金合同生效日)至2017年8月11日止,自2017年8月14日起转为开放式运作,自该日起开始办理日常申购、赎回业务,并同时增加开通C类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德丰盈收益债券型证券投资基金合同》的有关规定,本基金的估值对象为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行的国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债券、分离交易可转债、次级债、资产支持证券、短期融资券、中期票据、国债回购、银行存款、货币市场工具等固定收益类资产和法律法规允许投资的其他金融工具。其中,封闭期内,本基金所投资的企业信用评级在AA(含)以上,本基金不投资于二级市场买入股票、权证等权益类资产,也不参与一级市场新股申购和股票增发。同时本基金不参与可转换债券投资(分离交易可转债的纯债部分除外),如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%,但在封闭期结束转开放的前后三个月内,基金投资不

受上述债券资产投资比例限制。本基金在开放期内,现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金封闭期内业绩比较基准为三年期银行定期存款税后收益率,转为开放式运作后业绩比较基准为中债综合全价指数。

6.4.2 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日及以后期间颁布的《企业会计准则——基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(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(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《交银施罗德丰盈收益债券型证券投资基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定
本基金2018年上半年度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2018年6月30日的财务状况以及2018年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明
本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明
6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 差错更正的说明
本基金在本报告期间内无需说明的会计差错更正。

6.4.6 税项
根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发贷款辅助费增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税,对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已缴纳金额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品的贷款服务,以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场取得的收入,包括买卖债券的差价收入,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利息收入,应由发行债券的企业在基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

(4) 本基金的城镇维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳的增值税额计算缴纳。

6.4.7 关联方关系
6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关系方发生变化的情况
本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关系方发生变化的情况。

6.4.7.2 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
中信银行股份有限公司(“中信银行”) 基金托管人、基金销售机构
交银施罗德证券有限公司(“交银施罗德”) 基金管理人关联方、基金销售机构

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条件订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易
本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.8.2 关联方报酬
6.4.8.2.1 基金管理费
单位:人民币元

Table with 4 columns: 项目, 本期 2018年1月1日至2018年6月30日, 上年同期可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日

注:支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.80%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=托管费÷前一日基金资产净值×0.80%÷当年天数。

6.4.8.2.2 基金销售费
单位:人民币元

Table with 4 columns: 项目, 本期 2018年1月1日至2018年6月30日, 上年同期可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日

注:支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.15%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×0.15%÷当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费
单位:人民币元

Table with 4 columns: 项目, 本期 2018年1月1日至2018年6月30日, 上年同期可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日

注:支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金份额的资产净值×0.4%÷当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易
本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 关联方投资本基金的情况
6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
本报告期及上年度可比期间未发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.8.4.2 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
本报告期及上年度未发生基金管理人之外的其他关联方持有本基金。

6.4.8.5 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

Table with 4 columns: 关联方名称, 2018年1月1日至2018年6月30日, 2017年1月1日至2017年6月30日, 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日

注:本基金的银行存款由基金托管人保管,按银行约定利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期间参与承销承销的情况
本基金本报告期及上年度可比期间未参与承销期间参与承销承销。

6.4.8.7 其他关联方交易事项的说明
本基金本报告期未持有通过港股通投资的股票。

6.4.9 期末持有(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券
6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券
本基金本报告期末未从事债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款。

7 投资组合报告
7.1 期末投资组合资产配置情况
金额单位:人民币元

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

7.2 期末按行业分类的股票投资组合
7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

7.3 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
本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动
本基金本报告期末未持有股票。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合
金额单位:人民币元

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

7.6 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

Table with 5 columns: 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(%)

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 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。

7.12 投资组合报告附注
7.12.1 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。

7.12.2 本基金投资的前十名股票中,没有出现超出基金合同约定的备选股票之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成
单位:人民币元

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额

7.12.4 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转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末未持有股票。

7.12.6 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。

8 基金份额持有人信息
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构
份额单位:份

Table with 4 columns: 份额类别, 持有人户数(户), 户内持有基金份额, 机构投资者持有份额, 个人投资者持有份额

8.2 期末基金管理人及基金托管人持有本基金的情况
金额单位:人民币元

Table with 4 columns: 项目, 份额类别, 持有基金份额的数量(份), 占基金份额总额比例(%)

8.3 期末基金管理人及基金托管人持有本基金的情况
金额单位:人民币元

Table with 4 columns: 项目, 份额类别, 持有基金份额的数量(份), 占基金份额总额比例(%)

9 开放式基金份额变动
单位:份

Table with 4 columns: 项目, 2018年1月1日至2018年6月30日, 2017年1月1日至2017年6月30日

注:支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.15%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×0.15%÷当年天数。

10 重大事件揭示
10.1 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。

10.2 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的重大人事变动
1.基金管理人、基金托管人、基金销售机构于2018年6月30日本基金管理人发布公告,经公司第四届董事会第三十二次会议审议通过,同意苏亦春先生辞去公司董事长职务,并决定由公司总经理阮红女士代理董事长职务,自即日起生效。如有敬请关注基金管理人发布的相关公告。

2.基金托管人、基金销售机构的重大人事变动:本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼
本报告期内未发生涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变
本基金本报告期内未发生投资策略重大变化。

10.5 报告期末持有的基金发生的重大影响因素
无。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况
本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为基金提供审计服务。

10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况
1.管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况
基金管理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。

2.托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况
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。

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况
10.8.1 基金租用证券公司交易单元进行投资及佣金支付情况
金额单位:人民币元

Table with 6 columns: 券商名称, 交易金额, 成交金额, 占基金总资产比例, 佣金, 占基金佣金比例

注:1、报告期内,本基金交易单元未发生变化;

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)、券商研究实力(研究报告质量、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四个方面;

3、租用证券公司交易单元的原则: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。

11 影响投资者决策的其他重要信息
11.1 影响投资者决策的其他重要信息
1.本基金管理人依据国家税收法律、法规及税收规范性文件的规定,对管理的基金产品运营过程中产生的应税收入,计提及缴纳增值税及附加税费,该部分税费由基金资产承担。详情请查阅本基金管理人于2018年3月22日发布的有关公告及法律文件。

2、根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》的有关规定及相关监管要求,与基金托管人协商一致并报备监管机构,基金管理人对本基金基金合同等法律文件作相应修改,请投资者关注基金合同中“对持续持有期少于7日的基金份额持有人收取不低于1.5%的赎回费并计入基金财产”的条款已于2018年3月31日正式实施,欲知详情请查阅本基金管理人于2018年3月22日发布的有关公告及法律文件。