交银施罗德安心收益债券型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

(原交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金转型)

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:中国民生银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一八年八月二十五日

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。本半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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年8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守信、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。本年度报告摘要编自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

交银施罗德安心收益债券型证券投资基金保本周期期限三年,自交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金基金合同生效日(即**2015年5月29日**)起至三个公历年后对应日止,如该对应日为非工作日,保本周期期限顺延至下一个工作日,即本基金第一个保本周期于**2018年5月29日**到期。交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金基本周期期限已按照《交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金基金合同》约定程序变更为**三年的混合型基金,即"交银施罗德安心收益债券型证券投资基金"**。基金托管人及基金登记机构不变,基金代码存续不变为**"519753"**。转型后基金的投资目标、投资范围、投资策略、投资比例、业绩比较基准、估值方法、申赎原则、收益分配及基金费率等规则按《交银施罗德安心收益债券型证券投资基金基金合同》相关规定进行运作。前述修改变更事项已按照相关法律法规及基金合同约定履行相关手续。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自**2018年1月1日**起至**6月30日**止。其中,自**2018年5月29日**(含)起至**2018年6月1日**(含)止为交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金保本周期到期期间,并自**2018年6月2日**起,交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金正式转型为交银施罗德安心收益债券型证券投资基金。本报告期基金转型前后的两个报告期进行编制。其中,基金转型前的报告期间为**2018年1月1日**至**2018年6月1日**止,基金转型后的报告期为**2018年6月2日**起至**2018年6月30日**。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

2.1.1 交银施罗德安心收益债券型证券投资基金

基金简称	交银安心收益债券
基金主代码	519753
交易代码	519753
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年6月2日
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	103,719,852.57份
基金合同存续期	不定期

注:1.上表中"报告期末"指**2018年6月30日**。
2.本基金于**2018年6月2日**由交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金转型为交银施罗德安心收益债券型证券投资基金,新基金合同及托管协议同日起生效。

2.1.2 交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金

基金简称	交银荣和保本混合
基金主代码	519753
交易代码	519753
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年5月29日
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	189,784,733.61份
基金合同存续期	不定期

注:1.上表中"报告期末"指**2018年6月30日**。
2.交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金转型为交银施罗德安心收益债券型证券投资基金,新基金合同及托管协议同日起生效。

2.2 基金产品说明

2.2.1 交银施罗德安心收益债券型证券投资基金

投资目标	在严格控制投资风险和保持资产流动性的基础上,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,动态调整债券、股票等大类资产比例。本基金以债券投资为核心,重点关注债券组合久期调整、期限结构配置及债券类属配置,并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,同时本基金通过综合运用坚实操作、妥利操作等策略精选个券,提高投资组合收益。此外,在风险可控的前提下,本基金适度关注股票、权证市场的运行状况与相应风险收益特征,有效把握投资机会,适时增强组合收益。
业绩比较基准	中债综合全价指数
风险收益特征	本基金为债券型证券投资基金,其长期平均的预期收益和风险高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。

2.2.2 交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金

投资目标	本基金在追求保本周期到期时本金安全的基础上,通过运用投资组合保险技术,力争实现组合资产的稳定增值。
投资策略	本基金运用恒定比例组合保险(CPPI,Constant Proportion Portfolio Insurance)原理,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低增值目的。
业绩比较基准	三年期银行定期存款税后收益率
风险收益特征	本基金是一只保本混合型基金,在证券投资基金中属于低风险品种。

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	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王晚婷	罗菲菲
	联系电话	(021)61055050	010-58560666
	电子邮箱	xxxpl@ysld.com, disclosure@ysld.com	tgbfxjdzx@cmbc.com.cn
客户服务电话		400-700-5000,021-61055000	95568
传真		(021)61055054	010-58560798

2.4 信息披露方式

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

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 交银施罗德安心收益债券型证券投资基金

3.1.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1.1 期间数据和指标	报告期(**2018年6月2日至2018年6月30日**)
本期已实现收益	110,154.77
本期利润	109,995.25
加权平均基金份额本期利润	0.0009
本期基金份额净值增长率	0.10%
3.1.1.2 期末数据和指标	报告期末(**2018年6月30日**)
期末可供分配基金份额利润	0.002
期末基金资产净值	105,552,588.47
期末基金份额净值	1.018

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.交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金从**2018年6月2日**起正式转型为交银施罗德安心收益债券型证券投资基金。截至本报告期末(**2018年6月30日**),交银施罗德安心收益债券型证券投资基金转型时期未满半年。

3.1.2 基金净值表现

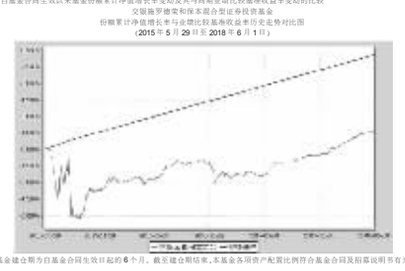
3.1.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
自基金转型生效起至今	0.10%	0.08%	0.37%	0.06%	-0.27%	0.02%

注:交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金从**2018年6月2日**起正式转型为交银施罗德安心收益债券型证券投资基金,本表列示的是本报告期基金转型后的基金净值表现,转型前基金的业绩比较基准为三年期银行定期存款税后收益率。

3.1.2.2 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

交银施罗德安心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历史走势对比图
(**2015年5月29日**至**2018年6月1日**)



注:本基金由交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金转型而来。本基金转型日为**2018年6月2日**,基金转型日至报告期末,本基金转型时间未满一年。本基金的投资转型期为交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金保本周期到期期间截止日的次日(即**2018年6月2日**)起的**3个月**,截止**2018年6月30日**,本基金尚处于投资转型期。

3.2 交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金

3.2.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.2.1.1 期间数据和指标	报告期(**2018年1月1日至2018年6月1日**)
本期已实现收益	162,699.78
本期利润	17,117,606.41
加权平均基金份额本期利润	0.0202
本期基金份额净值增长率	2.01%
3.2.1.2 期末数据和指标	报告期末(**2018年6月1日**)
期末可供分配基金份额利润	0.001
期末基金资产净值	192,954,419.53
期末基金份额净值	1.017

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。

3.2.2 基金净值表现

3.2.2.1 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

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
2018年6月1日至2018年6月1日	0.00%	0.00%	0.01%	0.00%	-0.01%	0.00%
2018年4月1日至2018年6月1日	0.59%	0.04%	0.47%	0.01%	0.12%	0.03%
2018年1月1日至2018年6月1日	2.01%	0.04%	1.16%	0.01%	0.85%	0.03%
2017年7月1日至2018年6月1日	3.14%	0.04%	2.57%	0.01%	0.57%	0.03%
2015年7月1日至2018年6月1日	3.78%	0.17%	8.27%	0.01%	-4.49%	0.16%
自基金合同生效起至**2018年6月1日**	1.70%	0.17%	8.59%	0.01%	-6.89%	0.16%

注:交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金从**2018年6月2日**起正式转型为交银施罗德安心收益债券型证券投资基金,本表列示的是本报告期基金转型后的基金净值表现,转型前基金的业绩比较基准为三年期银行定期存款税后收益率。

3.2.2.2 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

交银施罗德荣和保本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
(**2015年5月29日**至**2018年6月1日**)

注:本基金建立期为自基金合同生效日起的**6个月**,截至建立期结束,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

交银施罗德基金管理有限公司是经中国证监会证监基金字[2005]128号文批准,由交通银行股份有限公司、施罗德投资管理有限公司、中国国际商业集团有限公司共同发起设立,公司成立于**2005年8月4日**,注册地在中国上海,注册资本金为**2亿**元人民币,其中,交通银行股份有限公司持有**65%**的股份,施罗德投资管理有限公司持有**30%**的股份,中国国际商业集团有限公司持有**5%**的股份,公司并于设交银施罗德资产管理(香港)有限公司和交银施罗德资产管理有限公司。

截至报告期末,公司管理了包括货币型、债券型、保本混合型、普通混合型和股票型在内的**81**只基金,其中股票型融资普通指数型、交易型开放式(**ETF**)、**QDII**等不同类型基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及其基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王少成	交银成长混合、交银策略回报灵活配置混合、交银成长**30**混合、交银荣和保本的基金经理,公司权益投资总监	**2015-11-07**	**2018-05-16**	**14**年	王少成先生,复旦大学硕士学历,历任上海融昌资产管理公司研究员,中原证券投资经理,信诚基金管理有限公司研究总监助理,东吴基金管理有限公司投资经理、基金经理、投资部副总经理,其中**2010年9月**至**2012年10月**担任东吴新创业股票型证券投资基金基金经理,**2011年2月**至**2012年11月**担任东吴证券证券兴产业指数证券投资基金基金经理,**2011年5月**至**2012年11月**担任东吴证券信息优化双动力股票型证券投资基金基金经理,**2012年加入**交银施罗德基金管理有限公司,历任公司权益部副总经理。**2013年3月21日**至**2015年8月14日**担任交银施罗德先进制造股票型证券投资基金(原交银施罗德先进制造股票证券投资基金)基金经理,**2013年5月29日**至**2015年8月14日**担任交银施罗德先锋股票证券投资基金(原交银施罗德先锋股票证券投资基金)基金经理,**2015年11月7日**至**2018年5月15日**担任交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金的基金经理,**2015年11月7日**至**2018年6月7日**担任交银施罗德策略回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
唐腾	交银信用添利债券(**LOF**)、交银双利债券、交银双秧动债券、交银裕通纯债债券、交银安心收益债券的基金经理	**2015-11-07**	-	**6**年	唐腾先生,香港城市大学电子工程硕士。历任政府银行环球企业部助理客户经理、平安资产管理公司投用分析员。**2012年加入**交银施罗德基金管理有限公司,历任固定收益研究员、基金经理助理。**2015年11月7日**至**2018年6月1日**担任转型前的交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金的基金经理。

4.2 管理人对投资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 管理人对投资期内公平交易情况的专项说明

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决策流程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的投资指令均按照公平交易。

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。公司在各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,遵循一时间优先、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通过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在有异常交易行为。本报告期内,本公司管理的所有投资组合等与本公司管理的证券投资基金之间在单笔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

今年以来经济呈现出明显的"宏观冷、某位用"格局,推动债券收益率明显下行。年初以来央行连续两次降准,资金维持宽松,货币政策转向得到确认。随着资管新规落地,去杠杆进程从金融去杠杆转向实体去杠杆,表外融资压缩,更多的融资转向表内,但表内信贷受制于额度和银行资本金的约束,使得整体的社会信用规模、经济的"宏观冷"叠加"某位用"的组合,对债市形成支撑。上半年规模之外的因素在于贸易格局的重化、贸易战的持续发酵,引发市场对于全球和中国经济的进一步担忧,成为推动收益率下行的重要动力。

报告期内,本基金秉持为二级债券基金、本基金的债券部分维持了较高的久期配置。同时,基于对权益市场较为谨慎的看法,组合控制整体权益仓位配置,选择个别具有防御性板块个股进行波段操作为组合增强收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金(各类)份额转型后净值及业绩表现说见"**3.1.1**主要财务指标"及"**3.1.2.1**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"部分披露。

本基金(各类)份额转型前净值及业绩表现说见"**3.2.1**主要财务指标"及"**3.2.2.1**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"部分披露。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,我们判断货币可能在流动性中性偏平行,货币政策偏宽松的基调在短期内不会发生改变,尤其是在去杠杆进程深入推进,经济下行风险不确定的情况下,我们为信用扩张的强度和持续性进行了一定的乐观估计,但目前我们认为二者的空间较为有限,信用重新扩张通胀且长、政策组合上,政策组合上有限,货币政策虽然宽松但对货币供给端加的影响较为有限,"紧信用"格局的化解尚需时间。在上半年收益率已经大幅下行的情况下,我们认为收益率的持续下行,我们关注货币政策和实施过程中期的态地及审慎评判经济环境,同时我们也关注贸易格局的走势和经济的韧性。

下半年操作上我们或将保持当前中性偏高的组合久期,计划以中高等级的信用债为底仓,择机进行利率债的波段操作,以期增强组合收益。权益市场方面,我们对下半年权益类资产持谨慎乐观态度,关注风格变化、贸易战、权益类资产或将继续保持中性仓位上下,在方求控制回撤的前提下争取增强组合的收益。

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。估值委员会定期或视投资品种的不同性质,研究报告提出建议,提交给相关部门,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。

估值委员会定期对估值政策和程序进行评估,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,基金托管人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

交银施罗德安心收益债券型证券投资基金**2018年6月2日**至**2018年6月30日**未进行利润分配。

交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金**2018年1月1日**至**2018年6月1日**未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内无需预警说明。

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

本报告期内,中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定,依法安全保管了基金财产,不存在因资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

本报告期内,根据相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定,本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督,对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同规定进行。

本报告期内,本基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 交银施罗德安心收益债券型证券投资基

6.1.1 资产负债表

会计主体:交银施罗德安心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

资产	附注号	本期末 2018年6月30日
资产:		
银行存款	**6.1.4.7.1**	6,084,947.77
结算备付金		3,710,580.43
存出保证金		5,522.05
交易性金融资产	**6.1.4.7.2**	79,932,310.80
其中:股票投资		4,476,010.80
基金投资		-
债券投资		75,456,300.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	**6.1.4.7.3**	-
买入返售金融资产	**6.1.4.7.4**	20,000,000.00
应收证券清算款		17,402,484.54
应收利息	**6.1.4.7.5**	1,540,626.66
应收股利		-
应收申购款		29.98
递延所得税资产		-
其他资产	**6.1.4.7.6**	-
资产总计		128,676,502.23

负债和所有者权益		本期末 2018年6月30日
负债:		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	**6.1.4.7.3**	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		22,497,679.48
应付赎回款		316,519.49
应付管理人报酬		67,108.10
应付托管费		19,173.74
应付销售服务费		-
应付交易费用	**6.1.4.7.7**	45,522.69
应交税费		16,744.04
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	**6.1.4.7.8**	161,166.22
负债合计		23,123,913.76
所有者权益:		
实收基金	**6.1.4.7.9**	103,719,852.57
未分配利润	**6.1.4.7.10**	1,832,735.90
所有者权益合计		105,552,588.47
负债和所有者权益总计		128,676,502.23

注:**1.**报告截止日**2018年6月30日**,基金份额净值**1.018**元,基金份额总额**103,719,852.57**份。
2.财务报表的实际编制期间为**2018年6月2日**(转型生效日)至**2018年6月30日**止期间。
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。

6.1.2 利润表

会计主体:交银施罗德安心收益债券型证券投资基金
本报告期:**2018年6月2日**(转型生效日)至**2018年6月30日**

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2018年6月2日(转型生效日)至2018年6月30日
一、收入		258,746.87
1.利息收入		712,394.91
其中:存款利息收入	**6.1.4.7.11**	22,713.15
债券利息收入		597,418.72
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		92,263.04
其他利息收入		-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-453,569.58
其中:股票投资收益	**6.1.4.7.12**	-418,941.66
基金投资收益		-
债券投资收益	**6.1.4.7.13**	-34,627.92
资产支持证券投资收益	**6.1.4.7.14**	-
贵金属投资收益	**6.1.4.7.15**	-
衍生工具收益	**6.1.4.7.16**	-
股利收益	**6.1.4.7.17**	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	**6.1.4.7.18**	-159.52
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	**6.1.4.7.19**	81.06
减:二、费用		148,751.62
1.管理人报酬		67,108.10
2.托管费		19,173.74
3.销售服务费		-
4.交易费用	**6.1.4.7.20**	31,658.41
5.利息支出		2,039.31
其中:卖出回购金融资产支出		2,039.31
6.税金及附加		1,739.18
7.其他费用	**6.1.4.7.21**	27,032.88
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		109,995.25
减:所得税费用		-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		109,995.25

6.1.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:交银施罗德安心收益债券型证券投资基金
本报告期:**2018年6月2日**(转型生效日)至**2018年6月30日**

单位:人民币元

项目	本期 2018年6月2日(转型生效日)至2018年6月30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)	189,784,733.61	3,169,685.92	192,954,419.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	109,995.25	109,995.25
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)	-86,064,881.04	-1,446,945.27	-87,511,826.31
其中:1.基金申购款	26,889.86	447.91	27,337.77
2.基金赎回款	-86,091,770.90	-1,447,393.18	-87,539,164.08
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)	103,719,852.57	1,832,735.90	105,552,588.47

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告**6.1.1**至**6.1.4**,财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人:倪红,主管会计工作负责人:夏华龙,会计机构负责人:崇江

6.1.4 报表附注

6.1.4.1 基金基本情况

交银施罗德安心收益债券型证券投资基金是由原交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金(以下简称"交银施罗德荣和保本基金")转型而来,交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")监证许可[2015]879号文(关于准予交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金注册的批复)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《交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。交银施罗德荣和保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**1,971,015,696.61**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(**2015**)第**637**号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,(交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金基金合同)于**2015年5月29日**正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为**1,971,186,670.30**份基金份额,其中认购资金利息折合**170,973.69**份基金份额。

根据《交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金基金合同》的有关约定,交银施罗德荣和保本基金的保本周期为三年。交银施罗德荣和保本基金第一个保本周期自交银施罗德荣和保本基金基金合同生效日起至三个公历年后对应日止,如该对应日为非工作日,保本周期到期日顺延至下一个工作日。交银施罗德荣和保本基金保本周期届满时,在符合保本基金合同条件下,提请存续并转入下一保本周期。在不符合保本基金合同条件下,交银施罗德荣和保本基金宣布进入保本期到期日顺延至下一个工作日,保本周期到期日顺延期间,在符合保本基金合同条件下,提请存续并转入下一保本周期。在不符合保本基金合同条件下,交银施罗德荣和保本基金宣布进入保本