交银施罗德定期支付月月丰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:中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

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。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	交银定期支付月月丰债券	
基金主代码	519730	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年8月13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	
报告期末基金份额总额	38,815,296.94份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	交银定期支付月月丰债券A	交银定期支付月月丰债券C
下属分级基金的交易代码	519730	519731
报告期末下属分级基金的份额总额	36,868,931.57份	1,946,365.37份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金精选具有较高息票率的债券,以获取稳定的债息收入,并通过适当参与股票市场,力争实现基金资产的长期增值。
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,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;同时在严谨深入的信用分析基础上,综合考量企业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,自下而上地精选具有较高息票率的个券。同时,本基金深度关注股票、权证一级市场和二级市场的运行状况与相应风险收益特征,在严格控制基金资产运作风险的基础上,把握投资机会。
业绩比较基准	90%×中债综合全价指数收益率+10%×沪深300指数收益率
风险收益特征	本基金是一只债券型基金,属于证券投资基金中中等风险的品种,其长期平均的预期收益和预期风险高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王晚婷	田青
	联系电话	(021)61055050	010-67595096
	电子邮箱	xxpl@ysld.com, disclosure@ysld.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-700-5000,021-61055000	010-67595096
传真		(021)61055054	010-66275853

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 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年1月1日至2018年6月30日)	
	交银定期支付月月丰债券A	交银定期支付月月丰债券C
本期已实现收益	-1,605,753.02	-91,344.02
本期利润	-868,505.42	-52,252.96
加权平均基金份额本期利润	-0.0195	-0.0216
本期基金份额净值增长率	-1.80%	-1.98%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)	
	交银定期支付月月丰债券A	交银定期支付月月丰债券C
期末可供分配基金份额利润	0.365	0.337
期末基金资产净值	50,318,528.28	2,601,378.35
期末基金份额净值	1.365	1.337

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

交银定期支付月月丰债券A

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
过去一个月	-1.09%	0.56%	-0.47%	0.13%	-0.62%	0.43%
过去三个月	-1.52%	0.44%	-0.10%	0.14%	-1.42%	0.30%
过去六个月	-1.80%	0.39%	0.62%	0.13%	-2.42%	0.26%
过去一年	-1.52%	0.34%	0.41%	0.10%	-1.93%	0.24%
过去三年	6.72%	0.32%	-1.70%	0.17%	8.42%	0.15%
自基金合同生效起至今	36.50%	0.33%	8.93%	0.17%	27.57%	0.16%

注:本基金的业绩比较基准为90%×中债综合全价指数收益率+10%×沪深300指数收益率,每日进行再平衡过程。

交银定期支付月月丰债券C

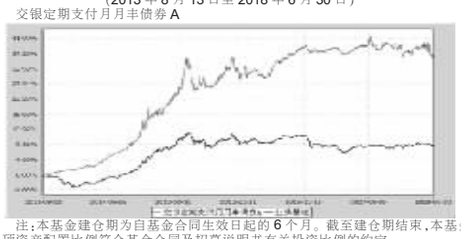
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-1.11%	0.56%	-0.47%	0.13%	-0.64%	0.43%
过去三个月	-1.55%	0.43%	-0.10%	0.14%	-1.45%	0.29%
过去六个月	-1.98%	0.39%	0.62%	0.13%	-2.60%	0.26%
过去一年	-1.91%	0.34%	0.41%	0.10%	-2.32%	0.24%
过去三年	5.44%	0.32%	-1.70%	0.17%	7.14%	0.15%
自基金合同生效起至今	33.70%	0.33%	8.93%	0.17%	24.77%	0.16%

注:本基金的业绩比较基准为90%×中债综合全价指数收益率+10%×沪深300指数收益率,每日进行再平衡过程。

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

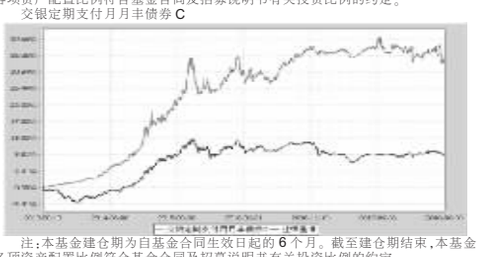
交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2013年8月13日至2018年6月30日)

交银定期支付月月丰债券A



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。

交银定期支付月月丰债券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、中国国际海运集装箱(集团)股份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,中国国际海运集装箱(集团)股份有限公司持有5%的股份。公司并下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,其中股票型涵盖普通指数型、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)及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
凌超	交银定期支付月月丰债券、交银增强收益债券、交银强化回报债券、交银增利增强债券的基金经理,公司固定收益(公募)投资副总监	2018-02-13	-	12年	凌超先生,华中科技大学数量经济学硕士、武汉科技大学信息与计算科学学士。2006年至2009年任长江证券股份有限公司研究员、投资经理,2009年至2012年任光大保德信基金有限管理公司研究员、基金助理、基金经理,2012年至2016年任海富通基金管理有限公司投资顾问、基金经理,2016年至2017年任天弘基金管理有限公司固定收益部副总经理、基金经理。2010年8月31日至2012年3月1日任光大保德信货币市场基金基金经理,2013年12月19日至2016年1月12日任海富通一年定期开放债券型证券投资基金基金经理,2014年4月2日至2016年1月12日任海富通纯债债券型证券投资基金基金经理,2014年12月1日至2016年1月12日任海富通稳固收益债券型证券投资基金基金经理,2016年5月14日至2017年7月13日任天弘弘利债券型证券投资基金基金经理,2016年5月14日至2017年7月13日任天弘裕利灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2016年5月14日至2017年7月13日任天弘债券型发起式证券投资基金基金经理。2017年7月加入交银施罗德基金管理有限公司。
于海颖	交银增利债券、交银纯债债券发起、交银荣祥保本混合、交银定期支付月月丰债券、交银增强收益债券、交银强化回报债券、交银丰盈收益债券、交银丰硕收益债券、交银荣鑫保本混合、交银增利增强债券、交银丰瑞收益债券、交银裕如纯债债券的基金经理,公司固定收益(公募)投资总监	2017-06-10	-	12年	于海颖女士,天津大学数量经济学硕士,经济学学士。历任北方国际信托投资股份有限公司固定收益研究员,光大保德信基金管理有限公司交易员、基金经理助理、基金经理,银华基金管理有限公司基金经理,五矿证券有限公司固定收益事业部投资管理部总经理。其中:2007年11月9日至2010年8月30日任光大保德信货币市场基金基金经理,2008年10月29日至2010年8月30日任光大保德信增利收益债券型证券投资基金基金经理,2011年6月28日至2013年6月16日任银华永祥保本混合型证券投资基金基金经理,2011年8月2日至2014年4月24日任银华货币市场证券投资基金基金经理,2012年8月9日至2014年10月7日任银华纯债信用主题债券型证券投资基金(LOF)基金经理,2013年4月1日至2014年4月24日任银华交易型货币市场基金基金经理,2013年8月7日至2014年10月7日任银华信用四季红债券型证券投资基金基金经理,2013年9月18日至2014年10月7日任银华信用季季红债券型证券投资基金基金经理,2014年5月8日至2014年10月7日任银华信用债券型证券投资基金(LOF)基金经理。2016年加入交银施罗德基金管理有限公司。
王艺伟	交银荣祥保本混合、交银定期支付月月丰债券、交银增强收益债券、交银强化回报债券、交银荣鑫保本混合的基金经理助理	2017-02-10	-	6年	王艺伟女士,北京大学经济学硕士,吉林大学经济学学士。理学学士。2012年-2014年任光大证券研究所宏观分析师。2014年9月加入交银施罗德基金管理有限公司,曾任研究员、研究部助理总经理,现任固定收益部基金经理助理。

注:1、本表所列基金经理(助理)任职日期和离职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《证券业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

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 管理人对报告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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年上半年,债券收益率受经济上行动力趋缓、信用收缩、流动性偏宽以及海外风险扰动等多重因素影响震荡下行。年初流动性紧张一度令关键年期10年期国开债收益率上行约30BP至年内5.13%的高点,此后债券收益率一路震荡走低,仅在四月中旬至五月中旬期间,受到资管新规出台、降准释放资金和缴税缴准错位带来季末流动性的紧张等因素的影响,债券收益率阶段性上行。截至二季末,活跃10年期国开债收益率水平到达4.25%,较2017年年末下行约57BP。债券市场年初以来的行情是多方面因素交织影响的结果。经济增长方面,春节之后复工弱于往年,社融数据存量增速持续走低,信用收缩的担忧愈加浓厚。受到资金瓶颈的约束,基建单月投资增速放缓,叠加地产调控基调不变以及近期棚改货币化可能下降的传闻,令投资对经济的支撑力度明显下降。通胀方面,春节错位因素带来二月高点后,食品价格维持低位,非食品相对稳定,通胀水平整体保持平稳,对目前的货币政策并未构成制约。资金面方面,除年初及四月中旬的间歇性紧张外,上半年流动性整体超预期宽松,三月跟随联储加息上调政策利率5BP后,央行在四月及六月底先后宣布降准1个百分点和0.5个百分点,对于资金面的呵护也令债市情绪明显改善。风险事件方面,四月起,受中美贸易战不确定性影响,债券市场中利率债及高等级信用也成为避险资金青睐资产。不过,由于信用环境收紧、信用事件频繁出现,二季度信用利差出现了一定走阔。

权益市场方面,地产产业链及油气产业链等大盘蓝筹板块年初伊始引领市场走出了近一个月左右的上涨行情后,随着美股调整以及市场对地产政策的担忧,蓝筹板块回调,以计算机软件、集成电路板块为代表的成长板块接棒蓝筹成为市场上行的新动力。二季度市场受信用收缩,海外风险事件的影响出现调整,以消费为代表的防御属性板块以及部分业绩稳定成长的计算机等成长相对收益较为明显。

本报告期内,考虑到组合规模,债券方面以流动性较好的交易所利率债为主,并在春节前后及二季度持续拉长组合久期。股票方面,组合集中配置高景气细分行业。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金(各类)份额净值及业绩表现请见"3.1 主要财务指标"及"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"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,社会融资总额增速下滑对于总需求的影响可能逐渐体现,在通胀总体可控、流动性较2017年改善的情况下,我们维持对债市谨慎乐观看法。操作策略方面,组合维持目前久期不变。权益方面,组合将继续关注政策执行对于配置资金的影响,以及海外不确定性事件的进展,并将侧重于挑选高景气细分行业及估值调整至合理的优质个股,择机提升仓位。

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。估值委员会的研究部成员按投资品种的不同性质,研究并参考市场普遍认同的做法,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。

估值委员会会定期对估值政策和程序进行评价,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,截止报告期末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

本基金本报告期内未进行利润分配。

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,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害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,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

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。

6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:交银施罗德定期支付月月丰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	上年度末 2017年12月31日
资产:		-	-
银行存款	6.4.7.1	479,102.00	790,866.69
结算备付金		351,889.85	862,598.78
存出保证金		74,725.49	62,424.66
交易性金融资产	6.4.7.2	49,622,881.12	68,093,907.36
其中:股票投资		2,727,103.12	6,371,053.96
基金投资		-	-
债券投资		46,895,778.00	61,722,853.40
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	1,600,000.00	2,300,000.00
应收证券清算款		1,321,845.77	2,483,619.80
应收利息	6.4.7.5	694,888.02	1,462,432.44
应收股利		-	-
应收申购款		12,016.47	1,691.98
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		54,157,348.72	76,057,541.71
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
负债:		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,003,516.84	374,433.20
应付赎回款		6,611.66	1,342.36
应付管理人报酬		31,010.69	47,655.93
应付托管费		8,860.19	13,615.99
应付销售服务费		874.85	1,284.50
应付交易费用	6.4.7.7	97,221.53	283,974.42
应交税费		5,038.81	4,800.00
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	84,307.52	110,000.54
负债合计		1,237,442.09	837,106.94
所有者权益:		-	-
实收基金	6.4.7.9	38,815,296.94	54,169,152.83
未分配利润	6.4.7.10	14,104,609.69	21,051,281.94
所有者权益合计		52,919,906.63	75,220,434.77
负债和所有者权益总计		54,157,348.72	76,057,541.71

注:1、报告截止日2018年6月30日,A类基金份额净值1.365元,C类基金份额净值1.337元,基金份额总额38,815,296.94份,其中A类基金份额36,868,931.57份,C类基金份额1,946,365.37份。

2、本摘要中资产负债表和利润表所列附注号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,应阅读登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:交银施罗德定期支付月月丰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

项目	附注号	本期 2018年1月1日至2018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
一、收入		85,862.77	1,198,040.84
1.利息收入		1,038,826.03	1,880,047.66
其中:存款利息收入	6.4.7.11	13,149.03	41,641.10
债券利息收入		1,006,853.20	1,777,845.59
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		18,823.80	60,560.97
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-1,733,086.08	-833,631.73
其中:股票投资收益	6.4.7.12	-1,877,376.77	-403,565.44
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	99,879.25	-476,490.89
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	44,411.44	46,424.60
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	6.4.7.17	776,338.66	142,676.92
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	6.4.7.18	3,784.16	8,947.99
减:二、费用		1,006,621.15	929,034.06
1.管理人报酬		226,726.13	448,738.97
2.托管费		64,778.86	128,211.07
3.销售服务费		6,542.62	16,460.38
4.交易费用	6.4.7.19	533,600.32	143,280.77
5.利息支出		69,528.16	82,691.03
其中:卖出回购金融资产支出		69,528.16	82,691.03
6.税金及附加		156.41	-
7.其他费用	6.4.7.20	105,288.65	109,651.84
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-920,758.38	269,006.78
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-920,758.38	269,006.78

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:交银施罗德定期支付月月丰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

项目	本期 2018年1月1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)	54,169,152.83	21,051,281.94	75,220,434.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-920,758.38	-920,758.38
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)	-15,353,855.89	-6,025,913.87	-21,379,769.76
其中:1.基金申购款	673,075.35	252,550.03	925,625.38
2.基金赎回款	-16,026,931.24	-6,278,463.90	-22,305,395.14
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)	38,815,296.94	14,104,609.69	52,919,906.63
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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)	107,566,688.21	40,911,112.03	148,477,800.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	269,006.78	269,006.78
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)	-28,046,345.34	-10,607,765.12	-38,654,110.46
其中:1.基金申购款	9,622,716.68	3,504,215.27	13,126,931.95
2.基金赎回款	-37,669,062.02	-14,111,980.39	-51,781,042.41
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)	79,520,342.87	30,572,353.69	110,092,696.56

报表附注为财务报表的组成部分。

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:夏华龙,会计机构负责人:单江

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2013]754号《关于核准交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金募集的批复》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《交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。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344,213,956.62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(2013)第508号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金基金合同》于2013年8月13日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为344,340,245.54份基金份额,其中认购资金利息折合126,288.92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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金基金合同》和《交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金招募说明书》,本基金自募集期起根据费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在在投资者认购/申购时收取前端认购/申购费用、赎回时收取赎回费用的,称为A类基金份额;在投资者认购/申购、赎回时不收取认购/申购费用、赎回费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为C类基金份额。

根据《交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金基金合同》和《交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金每月定期按照约定的年化现金支付比率,以约定的定期支付基准日的基金份额净值为基础,计算当期基金份额持有人可获得支付的现金,并自动赎回基金份额持有人所持的对应金额的基金份额,以该自动赎回的资金向基金份额持有人进行现金支付。本基金当前的年化现金支付比率为4%。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产净值的80%,对股票、权证等权益类资产的投资比例不高于基金资产的20%;其中现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的5%,本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%。本基金的业绩比较基准为90%×中债综合全价指数收益率+10%×沪深300指数收益率。

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》、《交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金基金合同》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的声明

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[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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教育辅助服务等增值税政策的通知》、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,已纳税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、债券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提供的贷款服务,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)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股票的股息、红利收入,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券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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联方发生变化的情况

本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
中国建设银行股份有限公司("中国建设银行")	基金托管人、基金销售机构
交通银行股份有限公司("交通银行")	基金管理人的股东、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款订立。

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

本基金本报告期内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

项目	本期 2018年1月1日至2018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
当期发生的基金应支付的管理费	226,726.13	448,738.97
其中,支付销售机构的客户维护费	46,458.23	144,660.70

注:支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值0.7%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:

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.7%÷当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018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
当期发生的基金应支付的托管费	64,778.86	128,211.07

注:支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.2%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×0.2%÷当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	交银定期支付月月丰债