

## 交银施罗德丰润收益债券型证券投资基金

## [2015]第三季度报告

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：二〇一五年十月二十七日

§ 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的规定，于2015年10月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告内容，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财产，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。

本报告期末2015年7月1日起至9月30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	619743
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年12月15日
报告期末基金份额总额	425,488,276,426份
投资目标	在严格控制风险的前提下，力求获得高于业债基准的投资回报。
投资策略	本基金充分分析和理解宏观经济形势、融资市场的基本情况和利率走势，综合考虑货币市场、利率债、信用债、可转债、股票等不同资产类别的预期收益率，根据其波动率、相关性、流动性、杠杆率等因素，通过资产配置、久期调整、券种选择、个券选择、杠杆运用、信用筛选、以及各类债券的信用、息差和期限利差等，自下而上地精选券种。
业绩比较基准	两年定期存款利率+0.12%。
风险特征	本基金是一只债券型基金，其风险和预期收益水平低于股市中的基金，低于混合型基金的风险特征。
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
下属分级基金的基金简称	交银丰润收益债券A
下属分级基金的交易代码	619743
报告期末下属分级基金的份额总额	402,154,038,659份
报告期末下属分级基金的份额总额	23,334,238,368份

§ 3 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标		报告期(2015年7月1日-2015年9月30日)	
1.本期已实现收益		6,134,416.78	616,723.00
2.本期利润		17,621,389.75	980,840.40
3.期初至报告期期末的利润累积计算		0.0498	0.0492
4.期末基金资产净值		439,360,548.74	26,314,641.56
5.期末基金份额净值		1.000	1.005

注：1.本基金A类基金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，本期利润同时减去本期公允价值变动收益。

3.基金净值表现

3.21 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(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 4.21% 0.10% 0.96% 0.01% 3.26% 0.09%

2.交银丰润收益债券C：

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去六个月 4.03% 0.09% 0.96% 0.01% 3.07% 0.09%

3.22 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

份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势图对比如图

(2014年12月15日至2015年9月3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，基金合同生效日至报告期末，本基金运作时间未满一年。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，基金合同生效日至报告期末，本基金运作时间未满一年。本基金利润同时减去本期公允价值变动收益。

3.基金净值表现

3.23 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(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 4.21% 0.10% 0.96% 0.01% 3.26% 0.09%

2.交银丰润收益债券C：

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去六个月 4.03% 0.09% 0.96% 0.01% 3.07% 0.09%

3.24 本报告期基金份额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

份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势图对比如图

(2014年12月15日至2015年9月3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，基金合同生效日至报告期末，本基金运作时间未满一年。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，基金合同生效日至报告期末，本基金运作时间未满一年。本基金利润同时减去本期公允价值变动收益。

3.基金净值表现

3.25 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(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 4.21% 0.10% 0.96% 0.01% 3.26% 0.09%

2.交银丰润收益债券C：

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去六个月 4.03% 0.09% 0.96% 0.01% 3.07% 0.09%

3.26 本报告期基金份额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

份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势图对比如图

(2014年12月15日至2015年9月3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，基金合同生效日至报告期末，本基金运作时间未满一年。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，基金合同生效日至报告期末，本基金运作时间未满一年。本基金利润同时减去本期公允价值变动收益。

3.基金净值表现

3.27 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(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 4.21% 0.10% 0.96% 0.01% 3.26% 0.09%

2.交银丰润收益债券C：

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去六个月 4.03% 0.09% 0.96% 0.01% 3.07% 0.09%

3.28 本报告期基金份额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

份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势图对比如图

(2014年12月15日至2015年9月3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，基金合同生效日至报告期末，本基金运作时间未满一年。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，基金合同生效日至报告期末，本基金运作时间未满一年。本基金利润同时减去本期公允价值变动收益。

3.基金净值表现

3.29 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(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 4.21% 0.10% 0.96% 0.01% 3.26% 0.09%

2.交银丰润收益债券C：

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去六个月 4.03% 0.09% 0.96% 0.01% 3.07% 0.09%

3.30 本报告期基金份额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

份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势图对比如图

(2014年12月15日至2015年9月3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，基金合同生效日至报告期末，本基金运作时间未满一年。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，基金合同生效日至报告期末，本基金运作时间未满一年。本基金利润同时减去本期公允价值变动收益。

3.基金净值表现

3.31 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(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 4.21% 0.10% 0.96% 0.01% 3.26% 0.09%

2.交银丰润收益债券C：

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去六个月 4.03% 0.09% 0.96% 0.01% 3.07% 0.09%

3.32 本报告期基金份额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

份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势图对比如图

(2014年9月12日至2015年9月30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9月12日，截至报告期末，本基金已完成建仓但报告期未距建仓结束不满一个完整会计年度。报告期末，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9月12日，截至报告期末，本基金尚未完成建仓但报告期未距建仓结束不满一个完整会计年度。报告期末，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。

</div