

## 交银施罗德丰润收益债券型证券投资基金

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、基金托管人及基金销售机构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预示其未来表现。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。  
本报告期财务资料未经审计。

§2 基金产品概况	
基金名称	交银施罗德丰润收益债券
基金代码	519743
基金运作方式	契约型，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（按照基金合同的约定定期转换基金运作方式的除外），封闭期结束后转为开放式运作。
基金合同生效日	2014年12月15日
报告期末基金份额总额	426,488,276.42份
投资目标	在严格控制风险的基础上，力求获得高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金充分挖掘基金管理人的研究优势，结合国际国内宏观经济的基本面研究和严谨的信用分析，在严格控制交易和投资风险的前提下，采取自上而下和自下而上的投资策略，在充分分散化投资的基础上，力求获得高于业绩比较基准的投资收益。本基金在资产配置上，主要采取自上而下和自下而上的投资策略，力求获得高于业绩比较基准的投资收益。
业绩比较基准	两年期银行定期存款利率（税后）+1.20%
风险收益特征	本基金是一只债券型基金，其风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金，属于证券投资基金中中等风险的品种。
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
下属两级基金的名称	交银施罗德丰润债券A 交银施罗德丰润债券C
下属两级基金的代码	519743 519745
报告期末下属两级基金的资产总额	402,154,030.59份 23,334,238.82份

## 3.1 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日至2015年9月30日)
1.本期已实现收益	6,134,416.78
2.本期利润	17,621,288.75
3.加权平均基金份额本期利润	0.0438
4.期末基金资产净值	426,488,276.42
5.期末基金份额净值	1.000

注：1、本基金A类基金份额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。

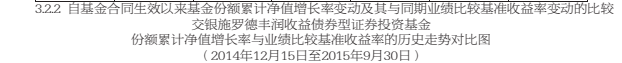
## 3.2 基金净值表现

## 3.2.1 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

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	4.21%	0.10%	0.06%	0.01%	3.25%	0.09%

## 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

交银施罗德丰润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的历史走势对比图  
(2014年12月15日至2015年9月30日)



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96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。

2、交银丰润收益债券C



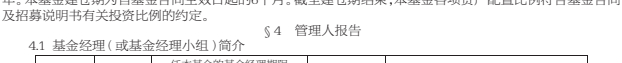
注：本基金基金合同生效日为2014年12月15日，基金合同生效日至报告期末，本基金运作时间未满一年。本基金建仓期为自基金合同生效日起的96个月，截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

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。本基金建仓期为自基金合同生效日起的96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。

2、交银丰润收益债券C



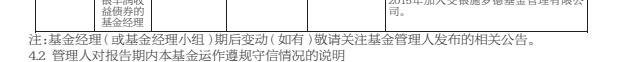
注：本基金基金合同生效日为2014年12月15日，基金合同生效日至报告期末，本基金运作时间未满一年。本基金建仓期为自基金合同生效日起的96个月，截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

2、交银丰润收益债券C



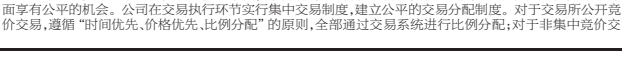
注：本基金基金合同生效日为2014年12月15日，基金合同生效日至报告期末，本基金运作时间未满一年。本基金建仓期为自基金合同生效日起的96个月，截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

2、交银丰润收益债券C



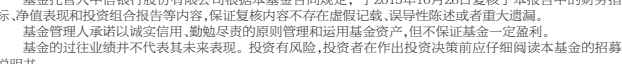
注：本基金基金合同生效日为2014年12月15日，基金合同生效日至报告期末，本基金运作时间未满一年。本基金建仓期为自基金合同生效日起的96个月，截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

2、交银丰润收益债券C



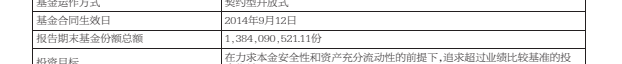
注：本基金基金合同生效日为2014年12月15日，基金合同生效日至报告期末，本基金运作时间未满一年。本基金建仓期为自基金合同生效日起的96个月，截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

2、交银丰润收益债券C



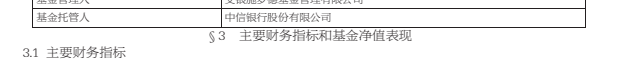
注：本基金基金合同生效日为2014年12月15日，基金合同生效日至报告期末，本基金运作时间未满一年。本基金建仓期为自基金合同生效日起的96个月，截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

2、交银丰润收益债券C



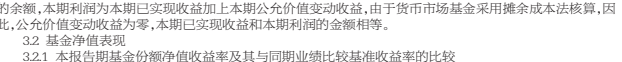
注：本基金基金合同生效日为2014年12月15日，基金合同生效日至报告期末，本基金运作时间未满一年。本基金建仓期为自基金合同生效日起的96个月，截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

2、交银丰润收益债券C



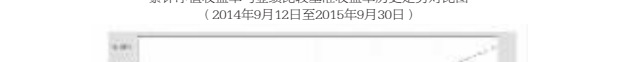
注：本基金基金合同生效日为2014年12月15日，基金合同生效日至报告期末，本基金运作时间未满一年。本基金建仓期为自基金合同生效日起的96个月，截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

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。本基金建仓期为自基金合同生效日起的96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。

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。本基金建仓期为自基金合同生效日起的96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。

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。本基金建仓期为自基金合同生效日起的96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。

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。本基金建仓期为自基金合同生效日起的96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。

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。本基金建仓期为自基金合同生效日起的96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。

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。本基金建仓期为自基金合同生效日起的96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。

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。本基金建仓期为自基金合同生效日起的96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。

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。本基金建仓期为自基金合同生效日起的96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。

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。本基金建仓期为自基金合同生效日起的96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。

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。本基金建仓期为自基金合同生效日起的96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。

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。本基金建仓期为自基金合同生效日起的96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。

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。本基金建仓期为自基金合同生效日起的96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。

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。本基金建仓期为自基金合同生效日起的96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。

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。本基金建仓期为自基金合同生效日起的96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。

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。本基金建仓期为自基金合同生效日起的96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。

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。本基金建仓期为自基金合同生效日起的96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。

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。本基金建仓期为自基金合同生效日起的96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。

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。本基金建仓期为自基金合同生效日起的96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。

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。本基金建仓期为自基金合同生效日起的96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。

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。本基金建仓期为自基金合同生效日起的96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。

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。本基金建仓期为自基金合同生效日起的96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。

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。本基金建仓期为自基金合同生效日起的96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。

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。本基金建仓期为自基金合同生效日起的96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。

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。本基金建仓期为自基金合同生效日起的96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。

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。本基金建仓期为自基金合同生效日起的96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。

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。本基金建仓期为自基金合同生效日起的96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。

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。本基金建仓期为自基金合同生效日起的96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。

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。本基金建仓期为自基金合同生效日起的96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。

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。本基金建仓期为自基金合同生效日起的96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。

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。本基金建仓期为自基金合同生效日起的96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。

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。本基金建仓期为自基金合同生效日起的96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。

2、交银丰润收益债券C

</