

交银施罗德丰盈收益债券型证券投资基金

[2015]第四季度报告

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:二〇一六年一月二十一日

§ 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规定,于2016年1月20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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期2015年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	交银施罗德丰盈收益债券
基金代码	6101940
交易代码	6101940
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年9月11日
报告期末基金份额总额	610,698,140,939
投资目标	追求有效资产配置的收益前提下,力争为基金资产获得稳健的投资收益和回报。
投资策略	本基金充分运用基金管理人的研究优势,综合运用量化基金的层面研究和定性研究,在分析和判断宏观经济和金融市场的运行趋势的基础上,充分运用对利率、信用利差、以及持有期限的杠杠信息等基本指标的配置,在综合考虑收益的情况下,本基金管理人将通过定期调整资产配置比例,在综合考虑收益的情况下,本基金管理人将通过定期调整资产配置比例,在综合考虑收益的情况下,本基金管理人将通过定期调整资产配置比例,以及类债券的流动性,追求资产配置的稳定性。
业绩比较基准	三年期银行定期存款收益率
风险收益特征	本基金是一只债券型基金,其风险及预期收益低于货币市场基金,属于债券型基金中等风险收益特征。
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

注:本基金在基金合同生效之日起三年(含三年)的期间内,采取封闭式运作(按照基金合同的约定转换为基金运作方式的除外)。封闭期内,基金投资者不能申购、赎回本基金基金份额,即A类基金份额。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标		报告期2015年10月1日-2015年12月31日
1. 本期已实现收益		10,946,316.29
2. 本期利润		11,693,921.00
3. 加权平均基金份额本期利润		0.0227
4. 期末基金份额净值		679,840,224.38
5. 期末基金资产净值		1,136

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.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	业绩比较基准收益率	差额(%)	差额(%)
过去三个月	1.98%	0.07%	0.72%	0.01%

3.2.2 自基金成立以来以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



交银施罗德丰盈收益债券型证券投资基金

累计份额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8月11日至2015年12月31日)

5.6 报告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

本基金报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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

本基金报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

本基金报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金报告期末未持有国债期货。

5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金报告期末未持有国债期货。

5.12 公司投资组合附注

本基金报告期末未持有资产支持证券。

5.13 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	25,168,224.79
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	存货	-
8	其他	-
9	合计	25,168,224.79

5.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.15 报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

本基金报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.16 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。

§ 6 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

6.1 基金管理人持有本基金管理费的变动情况

本报告期未发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期未使用本基金的申购、赎回、红利再投等。

6.3 备查文件目录

1、中国证监会准予交银施罗德丰盈收益债券型证券投资基金募集注册的文件;

2、《交银施罗德丰盈收益债券型证券投资基金基金合同》;

3、《交银施罗德丰盈收益债券型证券投资基金招募说明书》;

4、《交银施罗德丰盈收益债券型证券投资基金托管协议》;

5、基金管理人业务资格批件、营业执照;

6、基金管理人业务资格批件、营业执照;

7、关于本基金募集交银施罗德丰盈收益债券型证券投资基金的法律意见书;

8、报告期内交银施罗德丰盈收益债券型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

7.2 备查文件

投资者在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅读文件,或者登录基金管理人的网站(www.fund001.com,www.bocomachroder.com)查阅。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得上述文本的复印件或复印件。投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人交银施罗德基金管理有限公司。本公司客户服务电话:400-700-5000(免长途话费),021-61055000,电子邮件:services@jysld.com。

7.3 备查方式

投资者在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅读文件,或者登录基金管理人的网站(www.fund001.com,www.bocomachroder.com)查阅。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得上述文本的复印件或复印件。

7.4 备查文件存放于基金管理人的办公场所。

7.5 备查文件

投资者在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅读文件,或者登录基金管理人的网站(www.fund001.com,www.bocomachroder.com)查阅。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得上述文本的复印件或复印件。

7.6 备查文件

投资者在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅读文件,或者登录基金管理人的网站(www.fund001.com,www.bocomachroder.com)查阅。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得上述文本的复印件或复印件。

7.7 备查文件

投资者在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅读文件,或者登录基金管理人的网站(www.fund001.com,www.bocomachroder.com)查阅。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得上述文本的复印件或复印件。

7.8 备查文件

投资者在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅读文件,或者登录基金管理人的网站(www.fund001.com,www.bocomachroder.com)查阅。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得上述文本的复印件或复印件。

7.9 备查文件

投资者在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅读文件,或者登录基金管理人的网站(www.fund001.com,www.bocomachroder.com)查阅。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得上述文本的复印件或复印件。

7.10 备查文件

投资者在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅读文件,或者登录基金管理人的网站(www.fund001.com,www.bocomachroder.com)查阅。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得上述文本的复印件或复印件。

7.11 备查文件

投资者在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅读文件,或者登录基金管理人的网站(www.fund001.com,www.bocomachroder.com)查阅。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得上述文本的复印件或复印件。

7.12 备查文件

投资者在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅读文件,或者登录基金管理人的网站(www.fund001.com,www.bocomachroder.com)查阅。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得上述文本的复印件或复印件。

7.13 备查文件

投资者在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅读文件,或者登录基金管理人的网站(www.fund001.com,www.bocomachroder.com)查阅。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得上述文本的复印件或复印件。

7.14 备查文件

投资者在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅读文件,或者登录基金管理人的网站(www.fund001.com,www.bocomachroder.com)查阅。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得上述文本的复印件或复印件。

7.15 备查文件

投资者在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅读文件,或者登录基金管理人的网站(www.fund001.com,www.bocomachroder.com)查阅。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得上述文本的复印件或复印件。

7.16 备查文件

投资者在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅读文件,或者登录基金管理人的网站(www.fund001.com,www.bocomachroder.com)查阅。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得上述文本的复印件或复印件。

7.17 备查文件

投资者在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅读文件,或者登录基金管理人的网站(www.fund001.com,www.bocomachroder.com)查阅。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得上述文本的复印件或复印件。

7.18 备查文件

投资者在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅读文件,或者登录基金管理人的网站(www.fund001.com,www.bocomachroder.com)查阅。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得上述文本的复印件或复印件。

7.19 备查文件

投资者在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅读文件,或者登录基金管理人的网站(www.fund001.com,www.bocomachroder.com)查阅。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得上述文本的复印件或复印件。

7.20 备查文件

投资者在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅读文件,或者登录基金管理人的网站(www.fund001.com,<a href="http://www.bocomachro