交银施罗德丰盈收益债券型证券投资基金 2016年年度报告摘要

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:二〇一七年三月二十九日

§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。

基金托管人中信银行股份有限公司(以下简称“中信银行”)根据本基金合同规定,于2017年3月28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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2016年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	交银丰盈收益债券
基金主代码	519740
交易代码	519740
基金运作方式	契约型,本基金在基金合同生效之日起三年(含三年)的期间内封闭式运作(按照基金合同的约定提前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08月11日
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	510,658,140.93份
基金合同存续期	不定期

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提前转换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。

2.2 基金产品说明

投资目标	追求在有效控制风险的前提下,力争为基金资产获得稳健的投资收益和超额回报。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势,融合规范化的基本面研究和严谨的信用分析,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,充分利用封闭式运作优势,以买入持有和杠杆套息等为基本投资策略,获取稳定收益;同时,本基金将严格控制信用风险,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,自下而上精选个券。
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。

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	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙艳	方霁
	联系电话	(021)61055050	4006800000
	电子邮箱	xxpl@jyshd.com, disclosure@jyshd.com	fangwei@citicbank.com
客户服务电话		400-700-5000,021-61055000	95558
传真		(021)61055054	010-85230024

2.4 信息披露方式

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

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2016年	2015年	2014年8月11日(基金合同生效日)至2014年12月31日
本期已实现收益	43,325,313.03	44,178,338.59	11,918,856.10
本期利润	18,470,689.60	68,388,176.61	11,007,067.79
加权平均基金份额本期利润	0.0362	0.1339	0.0218
本期基金份额净值增长率	3.42%	13.25%	2.20%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末	2015年末	2014年末
期末可供分配基金份额利润	0.010	0.090	0.022
期末基金资产净值	515,584,299.28	579,840,224.38	521,665,208.72
期末基金份额净值	1.010	1.135	1.022

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。

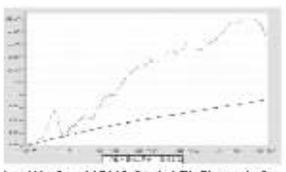
3.2 基金净值表现

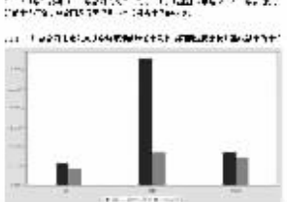
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	-1.32%	0.10%	0.70%	0.01%	-2.02%	0.09%
过去六个月	1.15%	0.09%	1.41%	0.01%	-0.26%	0.08%
过去一年	3.42%	0.09%	2.80%	0.01%	0.62%	0.08%
自基金合同生效起至今	19.70%	0.13%	7.87%	0.01%	11.83%	0.12%

注:本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 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





注:图示日期为2014年8月11日至2016年12月31日。基金合同生效当年的净值增长率按照当年实际存续期计算。

3.3过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2016年	1.620	82,726,614.70	-	82,726,614.70	-
2015年	0.200	10,213,160.95	-	10,213,160.95	-
2014年	-	-	-	-	-
合计	1.820	92,939,775.65	-	92,939,775.65	-

§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69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		
连端清	交银货币、交银理财60天债券、交银丰盈收益债券、交银现金宝货币、交银丰润收益债券、交银活期通货币、交银天利宝货币、交银裕隆纯债债券、交银天鑫宝货币、交银天益宝货币的基金经理	2015-08-04	-	5年	连端清先生,复旦大学经济学博士。历任交通银行总行金融市场部、湘财证券研究所研究员、中航信托资产管理部投资经理。2015年加入交银施罗德基金管理有限公司。
于海颖	交银丰盈收益债券的基金经理,公司固定收益(公募)投资总监	2016-12-29	-	10年	于海颖女士,天津大学数量经济学硕士、经济学学士,10年证券投资从业经验。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。万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。

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公平交易制度和控制方法

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所管理的所有资产组合投资运作的公平。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。制度中包含的主要控制方法如下:

(1)公司建立资源共享的投资研究信息平台,所有研究成果对所有投资组合公平开放,确保各投资组合在获得研究支持和实施投资决策方面享有公平的机会。

(2)公司将投资管理职能和交易执行职能相隔离,实行集中交易制度,建立了合理且可操作的公平交易分配机制,确保各投资组合享有公平的交易执行机会。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。

(3)公司建立了清晰的投资授权制度,明确各层级投资决策主体的职责和权限划分,组合投资经理充分发挥专业判断能力,不受他人干预,在授权范围内独立行使投资决策权,维护公平的投资管理环境,维护所管理投资组合的合法利益,保证各投资组合交易决策的客观性和独立性,防范不公平及异常交易的发生。

(4)公司建立统一的投资对象备选库和交易对手备选库,制定明确的备选库建立、维护程序。在全公司适用股票、债券备选库的基础上,根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和关联交易限制等,按需要建立不同投资组合的投资对象风格库和交易对手备选库,组合经理在此基础上根据投资授权构建投资组合。

(5)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投资组合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。

4.3.2公平交易制度的执行情况

本报告期内公司严格执行公平交易制度,公平对待旗下各投资组合。通过投资交易监控、交易数据分析、专项稽核检查等,本基金管理人未发现任何违反公平交易制度的行为。

4.3.3异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内未发现异常交易行为。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超过该证券当日总成交量5%的情况有2次,是投资组合因投资策略或在合规范围内因被动超标调整需要而发生同日反向交易,未发现不公平交易和利益输送的情况。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发现异常。

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

2016年,主要受房地产市场回暖以及供给侧改革的影响,国内经济呈现企稳回暖的态势。在去库存政策刺激下,2016年国内一、二线城市楼市火爆,房地产投资结束了2013年以来持续下跌的颓势,在2016年2月份触底反弹。尽管第二、三季度遭遇下行的波折,但9月至11月房地产投资再次企稳反弹。鉴于房地产行业对于中国经济的重要性,2016年前三季度我国GDP增速站稳在6.7%的高度上。伴随着供给侧改革的推进,PPI年内由负转正,煤钢等产能过剩行业盈利显著好转。在西方,社会贫富分化加剧之下飞出两只大“黑天鹅”—6月下旬英国退欧与11月上旬特朗普当选美国总统,大大超出市场预期。

货币政策上,鉴于国内经济企稳但一、二线城市楼市泡沫急剧膨胀,央行收缩了货币政策宽松边际,并且随着楼市调控加码,四季度央行货币政策向中性偏紧方向回归。一季度央行公开市场净投放2,750亿且降准一次,二季度净投放6,750亿、三季度净投放4,658亿,四季度净投放仅3,114亿。

资金面上,受央行货币政策操作及MPA考核等因素影响,资金价格中枢不断上移,12月份中旬市场资金面变得异常紧张,12月底R007较2015年底上行32个BP以上。受配置需求、经济走势、资金面、信用事件及海外黑天鹅等多重因素冲击的影响,2016年债市波动较大。4月份受信用事件超预期冲击,政金债及信用债收益率出现快速大幅回调,但6月下旬英国退欧引发全球宽松预期,三季度债市再次出现大涨,甚至市场将国庆期间的楼市调整解读为经济下行利好债市的信号,10月也出现一波上涨行情,但是随后在经济短期平稳依旧,特别是资金面紧张超预期的冲击之下,债市在11月与12月遭遇大幅调整。基金操作方面,报告期内本基金继续加强信用风险管控,调整部分债券,灵活调整杠杆与久期以顺应市场节奏变化,积极防控12月份的债市大幅调整,努力为持有人创造较为稳健的回报。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2016年12月31日,本基金份额净值为1.010元,本报告期份额净值增长率为3.42%,同期业绩比较基准增长率为2.8%。

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2017年,国内楼市调控以及英美等西方社会右翼化延续的概率较大,因此,如果2017年楼市调控进一步加码影响,那么国内经济可能将会面临一定的下行压力。在海外,美国特朗普逆全球化与贸易保护主义倾向、英国硬退欧风险、4月法国大选右势力上台可能性上升等海外风险点均增加了2017年国内经济的下行风险。但是,短期上,国内经济依旧弱势平稳,2016年12月中央经济工作会议已明确提出“货币政策要保持稳健中性……要把防控金融风险放到更加重要的位置……着力防控资产泡沫……既抑制房地产泡沫,又防止出现大起大落。”从现,在宏观经济相对平稳且政策诉求明确的背景下,央行货币政策更倾向于抑制资产价格泡沫为主。除非经济下行风险超预期,否则预计短期内央行将以稳健偏紧的货币政策为主。但是,倘若2017年经济下行压力较大,不排除央行货币政策再次转向相对宽松的可能。另外,2017年仍需警惕企业信用风险。组合管理方面,本基金将密切关注经济走势与央行货币政策操作动态,尽力控制信用风险,调整部分债券,积极跟踪把握市场节奏,努力为份额持有人创造较为稳健的回报。

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

根据相关法律法规和基金合同的规定,本基金对上一年度及本年度应分配的可供分配利润进行了收益分配,具体情况参见年度报告正文7.4.11利润分配情况。

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

作为本基金的托管人,中信银行严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对交银施罗德丰盈收益债券型证券投资基金2016年度基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为,交银施罗德基金管理有限公司在交银施罗德丰盈收益债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为,交银施罗德基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的交银施罗德丰盈收益债券型证券投资基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 审计报告

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)对交银施罗德丰盈收益债券型证券投资基金2016年12月31日的资产负债表,2016年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注出具了标准无保留意见的审计报告【普华永道中天审字(2017)第20179号】。投资者可通过本基金年度报告正文查看该审计报告全文。

§7年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:交银施罗德丰盈收益债券型证券投资基金

报告截止日:2016年12月31日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
资产:			
银行存款	7.4.7.1	844,886.69	2,988,007.70
结算备付金		19,006,752.02	28,716,025.07
存出保证金		8,651.11	-
交易性金融资产	7.4.7.2	766,084,757.80	925,938,278.90
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		766,084,757.80	925,938,278.90
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	9,900,134.95
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	20,235,564.81	25,158,224.79
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		806,180,612.43	992,700,671.31
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		289,799,448.80	411,999,602.00
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		356,431.68	391,593.81
应付托管费		66,830.95	73,423.84
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	21,239.60	16,026.98
应交税费		-	-
应付利息		52,102.12	79,600.30
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	300,200.00	300,200.00
负债合计		290,596,313.15	412,860,446.93
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	510,658,140.93	510,658,140.93
未分配利润	7.4.7.10	4,926,158.35	69,182,083.45
所有者权益合计		515,584,299.28	579,840,224.38
负债和所有者权益总计		806,180,612.43	992,700,671.31

注:1、报告截止日2016年12月31日,基金份额净值1.010元,基金份额总额510,658,140.93份。

2、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。

7.2 利润表

会计主体:交银施罗德丰盈收益债券型证券投资基金

本报告期:2016年1月1日至2016年12月31日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
一、收入		32,750,800.08	85,560,986.77
1.利息收入		53,099,351.04	58,829,423.47
其中:存款利息收入	7.4.7.11	390,350.88	358,978.41
债券利息收入		52,700,395.55	58,464,697.73
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		8,604.61	5,747.33
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		4,506,072.47	2,511,725.28
其中:股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	4,506,072.47	2,511,725.28
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.17	-24,854,623.43	24,209,838.02
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.18	-	-
减:二、费用		14,280,110.48	17,162,810.16
1. 管理人报酬		4,410,361.10	4,384,063.59
2. 托管费		826,942.64	822,011.97
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	5,139.79	2,283.98
5. 利息支出		8,681,072.88	11,598,231.32
其中:卖出回购金融资产支出		8,681,072.88	11,598,231.32
6. 其他费用	7.4.7.20	356,594.07	356,219.30
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		18,470,689.60	68,388,176.61
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净号损以“-”号填列)		18,470,689.60	68,388,176.61

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:交银施罗德丰盈收益债券型证券投资基金

本报告期:2016年1月1日至2016年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31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)	510,658,140.93	69,182,083.45	579,840,224.38
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	18,470,689.60	18,470,689.60
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)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	-	-82,726,614.70	-82,726,614.70
五、期末所有者权益(基金净值)	510,658,140.93	4,926,158.35	515,584,299.28
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31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)	510,658,140.93	11,007,067.79	521,665,208.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	68,388,176.61	68,388,176.61
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)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	-	-10,213,160.95	-10,213,160.95
五、期末所有者权益(基金净值)	510,658,140.93	69,182,083.45	579,840,224.38

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码(序号)从7.1至7.4,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

7.4 报表附注

7.4.1基金基本情况

交银施罗德丰盈收益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[2014]721号《关于核准交银施罗德丰盈收益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《交银施罗德丰盈收益债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型封闭式,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510,569,610.35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(2014)第451号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《交银施罗德丰盈收益债券型证券投资基金基金合同》于2014年8月11日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为510,658,140.93份基金份额,其中认购资金利息折合88,530.58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,基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据《交银施罗德丰盈收益债券型证券投资基金基金合同》和《交银施罗德丰盈收益债券型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购/申购费用、赎回费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/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,在投资人申购时不收取申购费用、赎回时收取后端申购费用和赎回费用的,称为B类基金份额,在投资人申购、赎回时不收取申购费用、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。本基金募集期内仅开通A类基金份额的认购;在基金合同生效之日起三年(含三年)的期间内封闭式运作,封闭期结束后转为开放式运作,并增开B类和C类基金份额的申购。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德丰盈收益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,包括国内依法发行交易的国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、分离交易可转债的纯债、次级债、资产支持证券、短期融资券、中期票据、债券回购、银行存款、货币市场工具等固定收益类资产和法律法规允许投资的其他金融工具。其中,封闭期内,本基金所投企业债和公司债信用评级需在AA级(含)以上。本基金不直接在二级市场买入股票、权证等权益类资产,也不参与一级市场新股申购和新股增发。同时本基金不参与可转换债券投资(分离交易可转债的纯债部分除外)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%,但在封闭期结束转开放的前后三个月内,基金投资不受上述债券资产投资比例限制。本基金在开放期内,现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为三年期银行定期存款税后收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人交银施罗德基金管理有限公司于2017年3月24日批准报出。

7.4.2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》、《交银施罗德丰盈收益债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4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。

7.4.3遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2016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2016年12月31日的财务状况以及2016年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4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。

7.4.5会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6税项

根据财政部、国家税务总局财税[1998]55号《关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 于2016年5月1日前,以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起,金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖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。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖债券的差价收入,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。

7.4.7关联方关系

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
中信银行股份有限公司(“中信银行”)	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
施罗德投资管理有限公司	基金管理人的股东
中国国际海运集装箱(集团)股份有限公司	基金管理人的股东
交银施罗德资产管理有限公司	基金管理人的子公司
上海直源投资管理有限公司	受基金管理人控制的公司
交烨投资管理(上海)有限公司	受基金管理人控制的公司

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。

7.4.8本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1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。

7.4.8.2关联方报酬

7.4.8.2.1基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	4,410,361.10	4,384,063.59
其中:支付销售机构的客户维护费	2,000,792.68	1,986,891.97

注:支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值0.80%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×0.80%÷当年天数。

7.4.8.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	826,942.64	822,011.97

注:支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.15%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×0.15%÷当年天数。

7.4.8.2.3销售服务费

无。

7.4.8.3与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间未发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.8.4.2报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金。

7.4.8.5由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信银行	844,886.69	54,087.61	2,988,007.70	49,740.38

注:本基金的银行存款由基金托管人保管,按银行同业利率计息。

7.4.8.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.8.7其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.9期末(2016年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.9.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1银行间市场债券正回购

截至本报告期末2016年12月31日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额100,799,448.80元,是以如下债券作为抵押:

金额单位:人民币元

| 债券代码 | 债券名称 | 回购到期日 | 期末估