交银施罗德增强收益债券型证券投资基金 2016年年度报告摘要

(交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金)

基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司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。

交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金保本周期期限三年。自交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金合同生效日(即2013年12月25日)起至三个公历年后对应日止,如该对应日为非工作日,保本周期到期日顺延至下一个工作日,即2016年12月26日。交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金保本周期期满时,基金管理人将决定是否以及如何对基金进行处理,并在保本期到期日前,以规则1交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金合同(以下简称"基金合同")的约定转型为非保本的混合型基金,即"交银施罗德增强收益债券型证券投资基金",基金托管人及基金登记机构不变,基金代码并保持不变为"519729"。转型后基金的投资目标、投资范围、投资策略、投资比例、业绩比较基准、估值方法及基金费率等按照《交银施罗德增强收益债券型证券投资基金基金合同》相关规定进行运作,前述修改变更事项已按照相关法律法规及基金合同的约定履行相关手续。

本报告期自2016年1月1日起至12月31日止。其中,自2016年12月26日(含)起至2016年12月29日(含)止为交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金保本周期期满期,共计2016年12月30日起,交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金正式转型为交银施罗德增强收益债券型证券投资基金。本报告按基金转型前后的两个报告期进行编制。其中,基金转型前的报告期间为2016年1月1日起至2016年12月29日止,基金转型后的报告期为2016年12月30日起至2016年12月31日。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

2.1.1 交银施罗德增强收益债券型证券投资基金

基金简称	交银增强收益债券
基金主代码	519729
交易代码	519729
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年12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
报告期末基金份额总额	78,679,121.31份
基金合同存续期	不定期

注:1.上表中"报告期末"指2016年12月31日。

2.交银施罗德荣泰保本基金的第一个保本周期自交银施罗德荣泰保本基金合同生效日起至三个公历年后对应日止(如该对应日为非工作日,保本周期到期日顺延至下一个工作日),即2016年12月26日。交银施罗德荣泰保本基金保本周期到期时,基金管理人将决定是否以及如何对基金进行处理,并在保本期到期日前,以规则1交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金合同(以下简称"基金合同")的约定转型为非保本的混合型基金,即交银施罗德增强收益债券型证券投资基金,其基金合同及托管协议即日起生效。

2.1.2 交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金

基金简称	交银荣泰保本混合
基金主代码	519729
交易代码	519729
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年12月25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	83,494,667.24份
基金合同存续期	不定期

注:1.本中"报告期末"指2016年12月29日。

2.2 基金产品说明

2.2.1 交银施罗德增强收益债券型证券投资基金

投资目标	在严格控制投资风险的基础上,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金将依据宏观经济数据和金融运行数据、货币政策、财政政策、以及债券市场和股票市场风险收益特征、分析判断市场利率水平变动趋势和股票市场走势,并根据实现经济、基准利率水平、股票市场整体估值水平、预期债券、可转债、新股申购等大类资产下一阶段的预期收益率水平,结合各类别资产的波动性以及流动性状况分析,进行大类资产配置。
业绩比较基准	90%×中证综合债券指数收益率+10%×沪深300指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型证券投资基金,其长期平均的预期收益和风险高于货币市场基金,低于股票型基金和股票型基金,属于证券投资基金中中等风险品种。

2.2.2 交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金

投资目标	本基金在追求保本周期到期时本金安全的基础上,通过稳健资产与风险资产的动态配置和有效的组合管理,力争实现基金资产的稳定增长。
投资策略	本基金在追求保本周期到期时本金安全的基础上,通过稳健资产与风险资产的动态配置和有效的组合管理,力争实现基金资产的稳定增长。
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	本基金是一只保本混合型基金,在证券投资基金中属于低风险品种。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙艳	田青
	联系电话	(021)61055050	010-67595096
	电子邮箱	xxpl@jyshd.com,disclosure@jyshd.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

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fund001.com,www.bocomschroder.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 交银施罗德增强收益债券型证券投资基金

3.1.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1.1 期间数据和指标	报告期 2016年12月30日至2016年12月31日
本期已实现收益	22,493.85
本期利润	26,493.85
加权平均基金份额本期利润	0.0003
本期基金份额净值增长率	0.08%
3.1.1.2 期末数据和指标	
期末可供分配基金份额利润	0.271
期末基金资产净值	99,968,966.85
期末基金份额净值	1.271

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.交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金从2016年12月30日起正式转型为交银施罗德增强收益债券型证券投资基金。截至本报告期末(2016年12月31日),交银施罗德增强收益债券型证券投资基金转型时间未满一年。

3.1.2 基金净值表现

3.1.2.1 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
自基金合同生效起至今	0.08%	0.06%	0.21%	0.15%	-0.13%	-0.09%

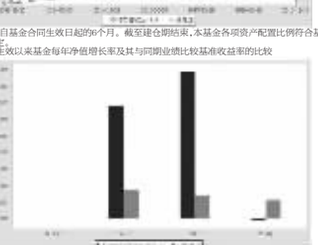
注:交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金从2016年12月30日起正式转型为交银施罗德增强收益债券型证券投资基金,本表列示的是本报告期基金转型后的基金净值表现,转型前基金的业绩比较基准为90%×中证综合债券指数收益率+10%×沪深300指数收益率。

3.1.2.2 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

交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金

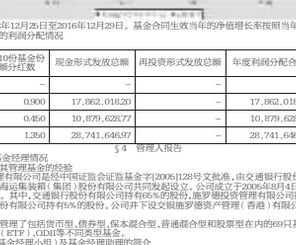
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2013年12月25日至2016年12月31日)



注:本基金由交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金转型而来。基金转型日为2016年12月30日,基金转型日至报告期期末,本基金转型时间未满一年。本基金的投资转型前为交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金保本周期期满期间和开放期以上日的次日(即2016年12月30日)起的3个月。截至2016年12月31日,本基金尚处于投资转型期。

3.1.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:图示日期为2016年12月30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。

3.1.3 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	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

3.2 交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金

3.2.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.2.1.1 期间数据和指标	报告期2016年1月1日至2016年12月29日		
		2015年末	2014年末
	交银荣泰保本混合	交银荣泰保本混合	交银荣泰保本混合
本期已实现收益	5,240,339.42	49,829,419.14	29,168,411.19
本期利润	-888,685.25	45,325,800.05	39,624,716.26
加权平均基金份额本期利润	-0.0072	0.2743	0.1575
本期基金份额净值增长率	-0.24%	22.31%	17.02%
3.2.1.2 期末数据和指标	2016年12月29日	2015年末	2014年末
期末可供分配基金份额利润	0.382	0.244	0.079
期末基金资产净值	106,058,216.36	168,635,510.24	246,234,594.01
期末基金份额净值	1.270	1.273	1.122

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。

3.2.2 基金净值表现

3.2.2.1 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
2016年10月1日至2016年12月29日	1.60%	0.12%	0.69%	0.01%	0.91%	0.11%
2016年7月1日至2016年12月29日	3.00%	0.14%	1.39%	0.01%	1.61%	0.13%
2016年1月1日至2016年12月29日	-0.24%	0.26%	2.78%	0.01%	-3.02%	0.25%
2014年1月1日至2016年12月29日	42.79%	0.63%	10.47%	0.01%	32.32%	0.62%
自基金合同生效起至2016年12月29日	42.94%	0.62%	10.55%	0.01%	32.39%	0.61%

注:交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金从2016年12月30日起正式转型为交银施罗德增强收益债券型证券投资基金。

3.2.2.2 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

交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金

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

(2013年12月25日至2016年12月29日)

注:本基金由交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金转型而来。基金转型日为2016年12月30日,基金转型日至报告期期末,本基金转型时间未满一年。本基金的投资转型前为交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金保本周期期满期间和开放期以上日的次日(即2016年12月30日)起的3个月。截至2016年12月31日,本基金尚处于投资转型期。

3.2.3 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	-	-	-	-	-
2015年	0.900	17,862,018.20	-	17,862,018.20	-
2014年	0.450	10,879,628.77	-	10,879,628.77	-
合计	1.350	28,741,646.97	-	28,741,646.97	-

§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60%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,公司开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、股票型、保本混合型、普通混合型和股票型在内的60只基金,其中股票型基金普通指数型、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		
孙超	交银增利债券、交银灵活债券发起、交银保证金融证券混合、交银定期支付月月丰债券、交银稳健收益债券、交银保证回报债券、交银丰享收益债券、交银丰硕收益债券、交银实鑫保本混合、交银稳健收益债券、交银灵活债券基金经理、交银定期支付月月丰债券基金经理、交银稳健收益债券基金经理、交银灵活债券基金经理	2015/11/27	-	5	孙超先生,美国哥伦比亚大学经济学硕士。历任中信建投证券股份有限公司资产管理部固定收益组、高级经理。2013年加入交银施罗德基金管理有限公司。历任基金经理助理、2014年11月26日至2015年11月17日担任交银施罗德双利债券基金基金经理、2014年1月20日至2015年11月17日担任交银施罗德双轮动债券型证券投资基金基金经理、2014年6月20日至2015年11月17日担任交银施罗德双轮动债券型证券投资基金基金经理、交银实鑫保本混合基金经理、2015年1月7日至2016年12月29日担任交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金基金经理。
章妍	交银荣祥保本混合、交银稳强收益债券、交银稳健收益债券、交银灵活债券、交银稳健收益债券基金经理	2015/11/21	-	1	章妍女士,复旦大学金融学硕士、中央财经大学统计学学士。9年金融行业业务经验工作经验。历任太平洋资产管理有限公司高级投资经理,资深投资经理。2015年加入交银施罗德基金管理有限公司。2015年11月21日至2016年12月29日担任交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金基金经理。

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的日期为准。

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,无不当两家关联关联方,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 公平交易制度和执行方法

本公司制定了严格的投资控制制度和公平交易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指令进行分配。

(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。在全公司范围内,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及交易对手备选库,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笔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建动超标摆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年前三季度债券市场收益率震荡下行,但四季度受金融去杠杆、央行收紧流动性、美国加息等多重利空因素影响,债券市场呈现大幅调整格局,收益率上行至2016年三季度之前的水平,全年来看债券市场有一定程度的下跌。

股票市场在年初遭遇持续大幅下跌后,后三个季度呈现上有顶下有底的震荡走势。本基金在2016年12月26日结束保本周期,全年来看,本基金在本报告期内以短久期债券配置为收益产品为主,配合中性股票仓位,并在12月初逐渐降低股票仓位至0。后三季度的稳健操作逐步录入了2016年年初股市大幅下跌对组合的影响,同时对回撤进行了较好地控制,本基金受2016年12月股票市场多方因素的影响不大。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2016年12月31日,交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金份额净值为1.271元,自2016年12月30日至2016年12月31日其份额净值增长率为0.08%,同期业绩比较基准增长率为0.21%。

截至2016年12月29日,交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金份额净值为1.270元,自2016年1月1日至2016年12月29日份额净值增长率为-0.24%,同期业绩比较基准增长率为2.78%。

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,本基金将在"稳中求进"的大背景下,以"供给侧结构性改革"为主线,以"去产能、去杠杆和全球流动性收紧预期、叠加春节及季末因素,资金面仍将保持中性偏紧,在工业和地产调控的风险阶段性地化解及流动性紧张缓解后,人股市场有望改变颓势。本基金将将以稳健思路操作,计划重点参与固定收益资产,紧计一定收益后,逐步提高权益仓位,同时尽力把制权益仓位带来的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人负责组建、维护、运行、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致性。估值委员会的研究部成员投资品种的不同性质,研究并参考市场普遍认可的做法,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,参与估值反馈讨论,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

交银施罗德增强收益债券型证券投资基金日2016年12月30日至2016年12月31日未进行利润分配。

交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金日2016年1月1日至2016年12月29日未进行利润分配。

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,充分履行了基金托管人应履的义务。

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,未发现有违反基金合同约定的情况。

5.3 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。

§6 托管人报告

6.1 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,充分履行了基金托管人应履的义务。

6.2 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,未发现有违反基金合同约定的情况。

6.3 管理人编制的投资报告期间,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。在全公司范围内,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及交易对手备选库,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。

6.3.2 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。

6.3.3 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笔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建动超标摆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投资策略和运作分析

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016年前三季度债券市场收益率震荡下行,但四季度受金融去杠杆、央行收紧流动性、美国加息等多重利空因素影响,债券市场呈现大幅调整格局,收益率上行至2016年三季度之前的水平,全年来看债券市场有一定程度的下跌。

股票市场在年初遭遇持续大幅下跌后,后三个季度呈现上有顶下有底的震荡走势。本基金在2016年12月26日结束保本周期,全年来看,本基金在本报告期内以短久期债券配置为收益产品为主,配合中性股票仓位,并在12月初逐渐降低股票仓位至0。后三季度的稳健操作逐步录入了2016年年初股市大幅下跌对组合的影响,同时对回撤进行了较好地控制,本基金受2016年12月股票市场多方因素的影响不大。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2016年12月31日,交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金份额净值为1.271元,自2016年12月30日至2016年12月31日其份额净值增长率为0.08%,同期业绩比较基准增长率为0.21%。

截至2016年12月29日,交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金份额净值为1.270元,自2016年1月1日至2016年12月29日份额净值增长率为-0.24%,同期业绩比较基准增长率为2.78%。

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,本基金将在"稳中求进"的大背景下,以"供给侧结构性改革"为主线,以"去产能、去杠杆和全球流动性收紧预期、叠加春节及季末因素,资金面仍将保持中性偏紧,在工业和地产调控的风险阶段性地化解及流动性紧张缓解后,人股市场有望改变颓势。本基金将将以稳健思路操作,计划重点参与固定收益资产,紧计一定收益后,逐步提高权益仓位,同时尽力把制权益仓位带来的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人负责组建、维护、运行、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致性。估值委员会的研究部成员投资品种的不同性质,研究并参考市场普遍认可的做法,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,参与估值反馈讨论,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

交银施罗德增强收益债券型证券投资基金日2016年12月30日至2016年12月31日未进行利润分配。

交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金日2016年1月1日至2016年12月29日未进行利润分配。

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,充分履行了基金托管人应履的义务。

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,未发现有违反基金合同约定的情况。

5.3 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。

§6 审计报告

6.1 交银施罗德增强收益债券型证券投资基金

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)对交银施罗德增强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1月30日(转型生效日)至2016年12月31日止期间的利润表和所有者权益(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20187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。

6.2 交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)对交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金2016年12月29日(基金合同失效前日)的资产负债表,2016年1月1日至2016年12月29日(基金合同失效前日)止期间的利润表和所有者权益(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20196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 交银施罗德增强收益债券型证券投资基金

7.1.1 资产负债表

会计主体:交银施罗德增强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
资产:		-
银行存款	7.1.4.7.1	6,143,451.03
结算备付金		223,160.02
存出保证金		39,639.09
交易性金融资产	7.1.4.7.2	9,957,000.00
其中:股票投资		-
基金投资		-
债券投资		9,957,000.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.1.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.1.4.7.4	87,000,000.00
应收证券清算款		3,015,722.20
应收利息	7.1.4.7.5	66,248.39
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产		-
资产总计		106,445,220.73
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年12月31日
负债:		-
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.1.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		6,109,563.03
应付管理人报酬		128,682.92
应付托管费		21,674.74
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.1.4.7.7	91,691.42
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.1.4.7.8	124,641.77
负债合计		6,476,253.88
所有者权益:		-
实收基金	7.1.4.7.9	78,679,121.31
未分配利润	7.1.4.7.10	21,289,845.54
所有者权益合计		99,968,966.85
负债和所有者权益总计		106,445,220.73

注:

1.报告截止日2016年12月31日,基金份额净值1.271元,基金份额总额78,679,121.31份。

2.本财务报表的实际编制期间为2016年12月30日(转型生效日)至2016年12月31日止期间。

3.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。

7.1.2 利润表

会计主体:交银施罗德增强收益债券型证券投资基金

本报告期:2016年12月30日(转型生效日)至2016年12月31日

单位:人民币元

资产	附注号	本期 2016年12月30日(转型生效日)至2016年12月31日
一.收入		25,207.82
1.利息收入		19,669.26
其中:存款利息收入	7.1.4.7.11	269.40
债券利息收入		1,183.56
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		18,216.30
其他利息收入		-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-
其中:股票投资收益	7.1.4.7.12	-
基金投资收益		-
债券投资收益	7.1.4.7.13	-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	7.1.4.7.15	-
股利收益	7.1.4.7.16	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	7.1.4.7.17	4,000.00
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	7.1.4.7.18	1,538.56
减:二.费用		-1,286.03
1.管理人报酬		1,911.91
2.托管费		546.26
3.销售服务费		-
4.交易费用	7.1.4.7.19	-
5.利息支出		-
其中:卖出回购金融资产支出		-
6.其他费用	7.1.4.7.20	-3,744.20
三.利润总额(亏损总额以"-"号填列)		26,493.85
减:所得税费用		-
四.净利润(净亏损以"-"号填列)		26,493.85

7.1.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:交银施罗德增强收益债券型证券投资基金

本报告期:2016年12月30日(转型生效日)至2016年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2016年12月30日(转型生效日)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)	83,494,667.24	22,563,549.12	106,058,216.36
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	26,493.85	26,493.85
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)	-4,815,545.93	-1,300,197.43	-6,115,743.36