

交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金
2016 年半年度报告
2016 年 6 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

报告送出日期：二〇一六年八月二十七日

§1 重要提示及目录

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。本半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 2016 年 8 月 26 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
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.....	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	12
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.....	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	33
7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合.....	33
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	35
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	37
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	38
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	38
7.8 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贵金属投资明细.....	38
7.9 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.....	38
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	38
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	38

7.12 投资组合报告附注.....	38
§8 基金份额持有人信息.....	39
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	39
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	40
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	40
§9 开放式基金份额变动.....	40
§10 重大事件揭示.....	41
10.1 基金份额持有人大会决议.....	41
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	41
10.4 基金投资策略的改变.....	41
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况.....	41
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	41
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	41
10.8 其他重大事件.....	44
§11 备查文件目录.....	45
11.1 备查文件目录.....	45
11.2 存放地点.....	45
11.3 查阅方式.....	45

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	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	125,108,212.18 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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	本基金运用恒定比例组合保险（CPPI，Constant Proportion Portfolio Insurance）原理，动态调整稳健资产与风险资产在基金组合中的投资比例，以确保本基金在保本周期到期时的本金安全，并实现基金资产在保本基础上的保值增值目的。
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@jysld.com, disclosure@jysld.com	tianqing1.zh@ccb.com

客户服务电话	400-700-5000, 021-61055000	010-67595096
传真	(021) 61055054	010-66275853
注册地址	上海市浦东新区银城中路 188号交通银行大楼二层 (裙)	北京市西城区金融大街25号
办公地址	上海市浦东新区世纪大道8 号国金中心二期21-22楼	北京市西城区闹市口大街1 号院1号楼
邮政编码	200120	100033
法定代表人	于亚利	王洪章

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.fund001.com, www.bocomschroder.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号
基金保证人	中国投融资担保股份有限公司	北京市海淀区西三环北路 100 号金玉大厦写字楼 9 层

§3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期（2016年1月1日至2016年6月30日）
本期已实现收益	-2,616,349.16
本期利润	-5,352,843.01
加权平均基金份额本期利润	-0.0419
本期加权平均净值利润率	-3.42%

本期基金份额净值增长率	-3.14%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)
期末可供分配利润	28,107,172.19
期末可供分配基金份额利润	0.225
期末基金资产净值	154,307,814.89
期末基金份额净值	1.233
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)
基金份额累计净值增长率	38.77%

注：1、本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
过去一个月	0.41%	0.14%	0.23%	0.01%	0.18%	0.13%
过去三个月	0.82%	0.14%	0.70%	0.01%	0.12%	0.13%
过去六个月	-3.14%	0.34%	1.39%	0.01%	-4.53%	0.33%
过去一年	-4.79%	0.81%	2.91%	0.01%	-7.70%	0.80%
自基金合同生效起至今	38.77%	0.68%	9.16%	0.01%	29.61%	0.67%

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

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历史走势对比图
 （2013年12月25日至2016年6月30日）



注：本基金建仓期为自基金合同生效日起的6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。

§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54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		

孙超	交银增利债券、交银纯债债券发起、交银荣祥保本混合、交银荣泰保本混合、交银定期支付月月丰债券、交银强化回报债券、交银丰润收益债券、交银丰享收益债券、交银丰泽收益债券、交银丰硕收益债券、交银荣鑫保本混合的基金经理	2015-11-07	-	5年	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经理、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8月26日至2015年11月17日担任交银施罗德理财60天债券型证券投资基金基金经理，2014年8月26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。
章妍	交银荣祥保本混合、交银荣泰保本混合、交银裕通纯债债券的基金经理	2015-11-21	-	1年	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年金融行业证券投资工作经验，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。

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合规守信情况的说明

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 公平交易制度的执行情况

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基金运作的公平，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。

公司建立资源共享的投资研究信息平台，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。公司在交易执行环节实行集中交易制度，建立公平的交易分配制度。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。

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账户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。

报告期内本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 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 1 次，是投资组合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 年上半年国内经济经历了一季度由地产带动的强劲反弹后，二季度进入温和复苏加财政托底阶段。在一季度旺盛的配置需求带动下，债券市场走势先是快速上行，在形成阶段性高点后受经济基本面乐观情绪及诸多不利债市因素影响，收益率一路震荡上行，尤其是 4 月份，债券市场跌势惨重。后由于权威人士讲话，对经济形势并不乐观，债券市场获得喘息机会，重回上行轨道。6 月份受英国脱欧的黑天鹅事件冲击，全球避险资产大涨，国内债券也有较大涨幅。在短期较大涨幅的情况下，市场可能进入一个震

荡波动状态，长期来看，经济基本面对债市的支撑基础仍在。股市上半年则呈现猛烈下跌后不断震荡磨底的过程，2016年年初伴随人民币贬值预期加剧及新出台的熔断机制的恐慌心理，指数出现暴跌，2月份、3月份则呈现震荡整固、超跌反弹行情。4月份、5月份总体呈现震荡下跌格局，6月份市场经受诸多不利消息影响，基本保持平稳。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2016年6月30日，本基金份额净值1.233元，本报告期份额净值增长率为-3.14%，同期业绩比较基准增长率为1.39%。

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2016年下半年，基本面、情绪和流动性层面还很难形成合力，中期趋势仍不明朗。

本基金上半年降低了组合的股票仓位，主要配置高股息有安全边际的品种，同时积极参与新股申购。

展望下半年，市场可能会加大波动，本基金将在维持适度仓位的情况下，视市场情况，适当调整仓位。

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其适用性的情况后，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

本基金本报告期内未进行利润分配。

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，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。本基金本报告期内未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	12,624,645.97	13,860,927.24
结算备付金		52,362.51	330,094.18
存出保证金		43,801.55	139,394.26
交易性金融资产	6.4.7.2	120,911,238.54	150,013,074.43
其中：股票投资		17,751,238.54	36,724,074.43

基金投资		-	-
债券投资		103,160,000.00	113,289,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	20,000,000.00	-
应收证券清算款		100,210.87	-
应收利息	6.4.7.5	1,644,709.74	4,851,455.96
应收股利		-	-
应收申购款		-	33,909.51
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		155,376,969.18	169,228,855.58
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		768,648.18	-
应付赎回款		1,609.40	11,733.48
应付管理人报酬		151,493.89	172,585.82
应付托管费		25,248.99	28,764.31
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	42,569.27	200,082.15
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	79,584.56	180,179.58
负债合计		1,069,154.29	593,345.34
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	125,108,212.18	132,422,664.82

未分配利润	6.4.7.10	29,199,602.71	36,212,845.42
所有者权益合计		154,307,814.89	168,635,510.24
负债和所有者权益总计		155,376,969.18	169,228,855.58

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.233 元，基金份额总额 125,108,212.18 份。

6.2 利润表

会计主体：交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		-3,835,212.97	53,870,011.32
1.利息收入		2,775,915.22	3,197,565.39
其中：存款利息收入	6.4.7.11	86,873.79	96,211.69
债券利息收入		2,683,394.91	3,071,974.47
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		5,646.52	29,379.23
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-3,913,828.98	60,104,082.15
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-4,197,573.07	59,422,015.36
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	145,622.53	488,157.46
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	138,121.56	193,909.33
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-2,736,493.85	-9,918,022.78
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	39,194.64	486,386.56
减：二、费用		1,517,630.04	3,111,471.02
1. 管理人报酬		935,524.88	1,385,535.16

2. 托管费		155,920.83	230,922.47
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	235,369.79	1,235,143.73
5. 利息支出		86,062.11	117,563.31
其中：卖出回购金融资产支出		86,062.11	117,563.31
6. 其他费用	6.4.7.20	104,752.43	142,306.35
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-5,352,843.01	50,758,540.30
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-5,352,843.01	50,758,540.30

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30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）	132,422,664.82	36,212,845.42	168,635,510.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-5,352,843.01	-5,352,843.01
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）	-7,314,452.64	-1,660,399.70	-8,974,852.34
其中：1.基金申购款	1,773,255.69	408,320.64	2,181,576.33
2.基金赎回款	-9,087,708.33	-2,068,720.34	-11,156,428.67
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）	-	-	-
五、期末所有者权益	125,108,212.18	29,199,602.71	154,307,814.89

项目	上年度可比期间		
	2015年1月1日至2015年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
(基金净值)			
一、期初所有者权益 (基金净值)	219,467,536.03	26,767,057.98	246,234,594.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	50,758,540.30	50,758,540.30
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)	-57,625,476.49	-11,990,126.48	-69,615,602.97
其中：1.基金申购款	35,285,781.88	9,066,579.58	44,352,361.46
2.基金赎回款	-92,911,258.37	-21,056,706.06	-113,967,964.43
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)	-	-17,862,018.20	-17,862,018.20
五、期末所有者权益 (基金净值)	161,842,059.54	47,673,453.60	209,515,513.14

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，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：朱鸣

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金(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[2013]150号《关于核准交银施罗德荣泰保本混合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《交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，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 271,771,686.22 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(2013)第 838 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金基金合同》于 2013 年 12 月 25 日正式生效，基金合同生效

日的基金份额总额为 271,898,528.26 份基金份额，其中认购资金利息折合 126,842.04 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金基金合同》的有关约定，本基金的保本周期为三年。本基金第一个保本周期自本基金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)。本基金保本周期届满时，在符合保本基金存续条件下，本基金继续存续并转入下一保本周期。在不符保本基金存续条件下，本基金变更为非保本的债券型基金，基金名称相应变更为“交银施罗德增强收益债券型证券投资基金”。本基金第一个保本周期由中国投融资担保有限公司作为担保人，为本基金第一个保本周期的保本提供不可撤销的连带责任保证。

本基金目前处于第一个保本周期，根据《交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，在本基金募集期内认购本基金的基金份额持有人持有本基金至当期保本周期到期的，如可赎回金额加上保本周期内的累计分红金额低于其认购金额(即认购保本金额，包括该等基金份额的净认购金额、认购费用以及募集期间的认购利息)，基金管理人或保本义务人应补足该差额。但上述基金份额持有人未持有到期而赎回或转换出本基金的，赎回或转换出部分不适用保本条款；基金份额持有人在保本周期内申购或转换入的基金份额也不适用保本条款。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德荣泰保本混合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，包括国内依法公开发行交易的债券、股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。本基金将按照恒定比例组合保险机制将资产配置于稳健资产和风险资产。本基金投资的稳健资产为国内依法发行交易的债券、货币市场工具和定期存款等，其中债券包括国债、金融债、央行票据、地方政府债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、可转换公司债券(含分离交易的可转换公司债券)、资产支持证券、债券回购等。风险资产为股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、股指期货等。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。本基金的投资组合比例为：债券、货币市场工具等稳健资产占基金资产的比例不低于 60%，其中基金应保留不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券；股票、权证、股指期货等风险资产占基金资产的比例不高于 40%，其中，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%。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。

6.4.2 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颁布的(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》、《交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年上半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 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，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。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月

以内(含 1 个月)的, 其股息红利所得全额计入应纳税所得额; 持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的, 暂减按 50% 计入应纳税所得额; 持股期限超过 1 年的, 于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额, 自 2015 年 9 月 8 日起, 暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股, 解禁后取得的股息、红利收入, 按照上述规定计算纳税, 持股时间自解禁日起计算; 解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税, 买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末
	2016 年 6 月 30 日
活期存款	12,624,645.97
定期存款	-
其他存款	-
合计	12,624,645.97

6.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目	本期末			
	2016 年 6 月 30 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	16,157,662.51	17,751,238.54	1,593,576.03	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	1,350,000.00	1,350,000.00	0.00
	银行间市场	100,050,100.00	101,810,000.00	1,759,900.00
	合计	101,400,100.00	103,160,000.00	1,759,900.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	117,557,762.51	120,911,238.54	3,353,476.03	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所买入返售金融资产	20,000,000.00	-
合计	20,000,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	3,066.69
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	23.60
应收债券利息	1,641,599.65
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	19.80
合计	1,644,709.74

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	42,164.27
银行间市场应付交易费用	405.00
合计	42,569.27

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	21.44
预提信息披露费	59,672.34
预提审计费	19,890.78
合计	79,584.56

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	132,422,664.82	132,422,664.82
本期申购	1,773,255.69	1,773,255.69
本期赎回（以“-”号填列）	-9,087,708.33	-9,087,708.33
本期末	125,108,212.18	125,108,212.18

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	32,354,329.22	3,858,516.20	36,212,845.42
本期利润	-2,616,349.16	-2,736,493.85	-5,352,843.01
本期基金份额交易产生的变动数	-1,630,807.87	-29,591.83	-1,660,399.70

其中：基金申购款	398,729.34	9,591.30	408,320.64
基金赎回款	-2,029,537.21	-39,183.13	-2,068,720.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	28,107,172.19	1,092,430.52	29,199,602.71

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	84,760.83
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	0.00
结算备付金利息收入	1,486.28
其他	626.68
合计	86,873.79

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	81,935,612.10
减：卖出股票成本总额	86,133,185.17
买卖股票差价收入	-4,197,573.07

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	24,625,061.70
减：卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	23,846,367.26
减：应收利息总额	633,071.91
买卖债券(债转股及债券到期兑付)	145,622.53

差价收入	
------	--

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	138,121.56
基金投资产生的股利收益	-
合计	138,121.56

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1.交易性金融资产	-2,736,493.85
——股票投资	-1,425,493.85
——债券投资	-1,311,000.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	-2,736,493.85

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期

	2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	35,531.40
基金转换费收入	3,663.24
合计	39,194.64

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的不低于赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	235,194.79
银行间市场交易费用	175.00
合计	235,369.79

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	19,890.78
信息披露费	59,672.34
债券账户维护费	18,800.00
银行汇划费	6,389.31
合计	104,752.43

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	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

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015 年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	935,524.88	1,385,535.16
其中：支付销售机构的客户维护费	374,127.34	587,163.42

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20% 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 × 1.20% ÷ 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	155,920.83	230,922.47

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 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 × 0.20% ÷ 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	12,624,645.97	84,760.83	65,357,051.91	90,206.48

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。

6.4.10.6 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。

6.4.10.7 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。

6.4.11 利润分配情况

本基金于本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300488	恒锋工具	2015-06-25	-	限售股	20.11	72.10	29,598	595,215.78	2,134,015.80	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601611	中国核建	2016-06-30	重大事项	20.92	2016-07-01	23.01	4,134	14,344.98	86,483.28	-
600358	国旅联合	2016-04-05	重大事项	12.81	2016-08-05	1,215.00	60,000	763,300.00	768,600.00	-

注：本基金截至2016年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行交易的债券、股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关

规定。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在追求保本周期到期本金安全的基础上，力争实现保本周期内基金资产的稳定增长。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立合规审核及风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由风险管理部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。风险管理部对公司总经理负责。督察长独立行使督察权利，直接对董事会负责，就内部控制制度和执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能，定期和不定期地向董事会报告公司内部控制执行情况。

本基金的基金管理人建立了以合规审核及风险管理委员会为核心的，由督察长、风险控制委员会、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.87%(2015 年 12 月 31 日：0.06%)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市

场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。本基金所持证券部分在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2016 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金及存出保证金等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 年 6 月 30 日	1 年以内	1 至 5 年	5 年以上	不计息	合计

资产					
银行存款	12,624,645.97	-	-	-	12,624,645.97
结算备付金	52,362.51	-	-	-	52,362.51
存出保证金	43,801.55	-	-	-	43,801.55
交易性金融资产	101,810,000.00	1,350,000.00	-	17,751,238.54	120,911,238.54
买入返售金融资产	20,000,000.00	-	-	-	20,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	100,210.87	100,210.87
应收利息	-	-	-	1,644,709.74	1,644,709.74
资产总计	134,530,810.03	1,350,000.00	-	19,496,159.15	155,376,969.18
负债					
应付证券清算款	-	-	-	768,648.18	768,648.18
应付赎回款	-	-	-	1,609.40	1,609.40
应付管理人报酬	-	-	-	151,493.89	151,493.89
应付托管费	-	-	-	25,248.99	25,248.99
应付交易费用	-	-	-	42,569.27	42,569.27
其他负债	-	-	-	79,584.56	79,584.56
负债总计	-	-	-	1,069,154.29	1,069,154.29
利率敏感度缺口	134,530,810.03	1,350,000.00	-	18,427,004.86	154,307,814.89
上年度末 2015年12月31日	1年以内	1至5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	13,860,927.24	-	-	-	13,860,927.24
结算备付金	330,094.18	-	-	-	330,094.18
存出保证金	139,394.26	-	-	-	139,394.26
交易性金融资产	10,001,000.00	103,195,000.00	93,000.00	36,724,074.43	150,013,074.43
应收利息	-	-	-	4,851,455.96	4,851,455.96
应收申购款	-	-	-	33,909.51	33,909.51
资产总计	24,331,415.68	103,195,000.00	93,000.00	41,609,439.90	169,228,855.58
负债					
应付赎回款	-	-	-	11,733.48	11,733.48

应付管理人报酬	-	-	-	172,585.82	172,585.82
应付托管费	-	-	-	28,764.31	28,764.31
应付交易费用	-	-	-	200,082.15	200,082.15
其他负债	-	-	-	180,179.58	180,179.58
负债总计	-	-	-	593,345.34	593,345.34
利率敏感度缺口	24,331,415.68	103,195,000.00	93,000.00	41,016,094.56	168,635,510.24

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
	市场利率上升25个基点	减少约19	减少约29
	市场利率下降25个基点	增加约19	增加约29

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人将基本面研究分析与积极主动的投资风格相结合，利用恒定比例组合保险(CPPI, Constant Proportion Portfolio Insurance)原理，动态调整稳健资产与风

险资产在基金组合中的投资比例，以确保本基金在保本周期到期时的本金安全，并实现基金资产在保本基础上的保值增值目的。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中债券、货币市场工具等稳健资产占基金资产的比例不低于 60%，其中基金应保留不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券；股票、权证、股指期货等风险资产占基金资产的比例不高于 40%，其中，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%。

本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		上年度末 2015年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	17,751,238.54	11.50	36,724,074.43	21.78
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	17,751,238.54	11.50	36,724,074.43	21.78

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除“沪深 300”指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
	1.“沪深 300”指数上升 5%	无重大影响	增加约 258
	2.“沪深 300”指数下降 5%	无重大影响	减少约 258

注：于 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 11.50%，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	17,751,238.54	11.42
	其中：股票	17,751,238.54	11.42
2	固定收益投资	103,160,000.00	66.39
	其中：债券	103,160,000.00	66.39
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	20,000,000.00	12.87
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	12,677,008.48	8.16
7	其他各项资产	1,788,722.16	1.15
8	合计	155,376,969.18	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	8,173,055.26	5.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供	3,354,500.00	2.17

	应业		
E	建筑业	86,483.28	0.06
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	1,515,900.00	0.98
K	房地产业	646,000.00	0.42
L	租赁和商务服务业	768,600.00	0.50
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	3,206,700.00	2.08
S	综合	-	-
	合计	17,751,238.54	11.50

7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过沪港通投资的股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300488	恒锋工具	29,598	2,134,015.80	1.38
2	600483	福能股份	150,000	1,702,500.00	1.10
3	600674	川投能源	200,000	1,652,000.00	1.07
4	002539	新都化工	100,000	1,529,000.00	0.99
5	300144	宋城演艺	60,000	1,494,600.00	0.97
6	600104	上汽集团	69,984	1,419,975.36	0.92

7	601801	皖新传媒	80,000	933,600.00	0.61
8	600967	北方创业	80,000	850,400.00	0.55
9	600816	安信信托	50,000	843,500.00	0.55
10	300133	华策影视	50,000	778,500.00	0.50
11	600358	国旅联合	60,000	768,600.00	0.50
12	002662	京威股份	50,000	755,500.00	0.49
13	600686	金龙汽车	50,000	736,500.00	0.48
14	600958	东方证券	40,000	672,400.00	0.44
15	600720	祁连山	100,000	671,000.00	0.43
16	600565	迪马股份	100,000	646,000.00	0.42
17	601611	中国核建	4,134	86,483.28	0.06
18	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.05

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600036	招商银行	4,558,535.40	2.70
2	601801	皖新传媒	3,955,397.00	2.35
3	600674	川投能源	3,216,518.90	1.91
4	002597	金禾实业	2,602,574.00	1.54
5	300271	华宇软件	2,497,168.00	1.48
6	600257	大湖股份	2,480,065.00	1.47
7	600483	福能股份	2,265,298.00	1.34
8	002368	太极股份	2,249,954.00	1.33

9	000513	丽珠集团	2,124,669.60	1.26
10	002539	新都化工	2,075,836.00	1.23
11	601238	广汽集团	1,976,972.00	1.17
12	600565	迪马股份	1,848,222.00	1.10
13	600816	安信信托	1,664,926.00	0.99
14	300144	宋城演艺	1,645,110.72	0.98
15	601333	广深铁路	1,631,794.00	0.97
16	300171	东富龙	1,631,251.00	0.97
17	600054	黄山旅游	1,611,782.00	0.96
18	601006	大秦铁路	1,500,500.00	0.89
19	002582	好想你	1,500,150.00	0.89
20	002662	京威股份	1,486,413.00	0.88

注：“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600036	招商银行	4,791,467.00	2.84
2	002368	太极股份	4,651,537.87	2.76
3	601009	南京银行	4,062,849.16	2.41
4	600565	迪马股份	3,023,561.00	1.79
5	600242	中昌海运	2,909,253.00	1.73
6	000513	丽珠集团	2,760,805.06	1.64
7	601801	皖新传媒	2,741,829.00	1.63
8	002597	金禾实业	2,657,968.00	1.58

9	600257	大湖股份	2,549,602.00	1.51
10	601333	广深铁路	2,424,398.89	1.44
11	002438	江苏神通	2,247,728.00	1.33
12	300271	华宇软件	2,076,335.00	1.23
13	601238	广汽集团	2,013,786.00	1.19
14	601988	中国银行	1,690,000.00	1.00
15	600054	黄山旅游	1,676,775.60	0.99
16	002582	好想你	1,619,710.00	0.96
17	600816	安信信托	1,612,846.50	0.96
18	600057	象屿股份	1,582,516.00	0.94
19	600309	万华化学	1,568,879.21	0.93
20	600674	川投能源	1,564,914.00	0.93

注：“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	68,585,843.13
卖出股票的收入（成交）总额	81,935,612.10

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	101,810,000.00	65.98
	其中：政策性金融债	101,810,000.00	65.98
4	企业债券	-	-

5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,350,000.00	0.87
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	103,160,000.00	66.85

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	140424	14 农发 24	500,000	50,955,000.00	33.02
2	140407	14 农发 07	500,000	50,855,000.00	32.96
3	132006	16 皖新 EB	13,500	1,350,000.00	0.87

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

7.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	43,801.55
2	应收证券清算款	100,210.87
3	应收股利	-
4	应收利息	1,644,709.74
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,788,722.16

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	300488	恒锋工具	2,134,015.80	1.38	限售股

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

- 1、本基金本报告期末未持有处于交换期的可交换债券。
- 2、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。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构	
		机构投资者	个人投资者

	额	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
1,273	98,278.25	20,000,800.00	15.99%	105,107,412.18	84.01%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	-	-

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013年12月25日）基金份额总额	271,898,528.26
本报告期期初基金份额总额	132,422,664.82
本报告期基金总申购份额	1,773,255.69
减：本报告期基金总赎回份额	9,087,708.33
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	125,108,212.18

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人的重大人事变动：本报告期内，经公司第四届董事会第九次会议审议通过，乔宏军先生不再担任公司副总经理职务。基金管理人就上述重大人事变动已按照相关规定向监管部门报告并履行了必要的信息披露程序。

2、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动：本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

（1）管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

针对中国证监会在 2015 年“两加强两遏制”检查后就公司内部控制提出的改进意见及采取责令改正的行政监管措施，以及上海证监局于本报告期内对公司相关负责人的警示，公司认真落实整改要求，完成相关问题的整改并向监管部门上报专项报告。整改工作中，公司进一步加强制度建设和风控措施，提升公司内部控制和风险管理水平。除上述情况外，报告期内管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

（2）托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金托管人及其高级管理人员本报告期内未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易	股票交易	应支付该券商的佣金	备注

	单元数量	成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东方证券股份有限公司	2	8,514,111.18	5.67%	7,929.30	5.67%	-
瑞银证券有限责任公司	1	8,164,248.50	5.43%	7,603.39	5.43%	-
华创证券有限责任公司	2	7,366,970.40	4.90%	6,860.85	4.90%	-
北京高华证券有限责任公司	1	5,436,712.56	3.62%	5,063.14	3.62%	-
兴业证券股份有限公司	1	5,101,232.66	3.40%	4,750.83	3.40%	-
申万宏源证券有限公司	1	4,010,123.28	2.67%	3,734.65	2.67%	-
西南证券股份有限公司	1	3,180,685.68	2.12%	2,962.16	2.12%	-
中国银河证券股份有限公司	2	3,115,532.00	2.07%	2,901.51	2.07%	-
国金证券股份有限公司	1	30,337,801.44	20.19%	28,253.52	20.19%	-
方正证券股份有限公司	1	26,635,489.62	17.73%	24,805.74	17.73%	-
中信建投证券股份有限公司	2	2,576,517.22	1.72%	2,399.54	1.72%	-
中信证券股份有限公司	1	16,961,871.15	11.29%	15,796.26	11.29%	-
招商证券股份有限公司	1	15,787,437.78	10.51%	14,702.84	10.51%	-
国泰君安证券股份有限公司	1	13,040,598.45	8.68%	12,144.69	8.68%	-
上海华信证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
川财证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

国联证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
第一创业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	1	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东方证券股份有限公司	-	-	20,000,000.00	50.00%	-	-
华创证券有限责任公司	105,750.70	1.67%	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	2,894,230.50	45.63%	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	368,265.00	5.81%	20,000,000.00	50.00%	-	-
中信证券股份有限公司	190,732.50	3.01%	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	247,371.00	3.90%	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2,536,162.00	39.99%	-	-	-	-

注：1、报告期内，本交易单元未发生变化；

2、租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：券商基本面评价（财务状况、经

营状况)、券商研究机构评价(报告质量、及时性和数量)、券商每日信息评价(及时性和有效性)和券商协作表现评价等四个方面;

3、租用证券公司交易单元的程序:首先根据租用证券公司交易单元的选择标准进行综合评价,然后根据评价选择基金交易单元。研究部提交方案,并上报公司批准。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	交银施罗德基金管理有限公司关于旗下基金在指数熔断期间调整开放时间的补充公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-01-06
2	交银施罗德基金管理有限公司关于增加大泰金石投资管理有限公司为旗下部分基金的场外销售机构并参与电子交易平台基金前端申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-01-15
3	交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-01-21
4	交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金(更新)招募说明书摘要(2015 年第 2 号)	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-02-06
5	交银施罗德基金管理有限公司关于旗下基金所持停牌股票估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-02-23
6	交银施罗德基金管理有限公司关于增加平安证券有限责任公司为旗下部分基金场外销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-03-16
7	交银施罗德基金管理有限公司关于调整投资者场外投资旗下部分基金单笔最低赎回份额限制的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-03-25
8	交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金 2015 年年度报告摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-03-29
9	交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金参与平安证券有限责任公司基金前端申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-04-06
10	交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-04-20
11	交银施罗德基金管理有限公司关于网上直销交易平台关闭支付宝基金网上支付服务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-05-10
12	交银施罗德基金管理有限公司关于旗下基金所持停牌股票估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-05-14
13	交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司基金网上银行、手机银行前端申购费率优	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-06-29

	惠活动的公告		
14	交银施罗德基金管理有限公司关于增加北京汇成基金销售有限公司为旗下部分基金的场外销售机构并参与电子交易平台基金前端申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-06-29

§11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《交银施罗德荣泰保本混合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、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、关于申请募集交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金之法律意见书；
- 8、《交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金保证合同》；
- 9、报告期内交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

11.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

11.3 查阅方式

投资者可在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅备查文件，或者登录基金管理人的网站(www.fund001.com, www.bocomschroder.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件的复制件或复印件。

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。本公司客户服务中心电话：400-700-5000（免长途话费），021-61055000，电子邮件：services@jysld.com。