

---

交银施罗德增强收益债券型证券投资基金  
(交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金)

2016 年年度报告摘要

2016 年 12 月 31 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到期后，已按照《交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金基金合同》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，基金代码亦保持不变为“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到期期间，并自 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后，已按照《交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金基金合同》的约定于2016年12月30日转型为非保本的债券型基金，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：上表中“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。并根据宏观经济、基准利率水平、股票市场整体估值水平，预测债券、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，低于混合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@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

## 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%
<b>3.1.1.2 期末数据和指标</b>	
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%

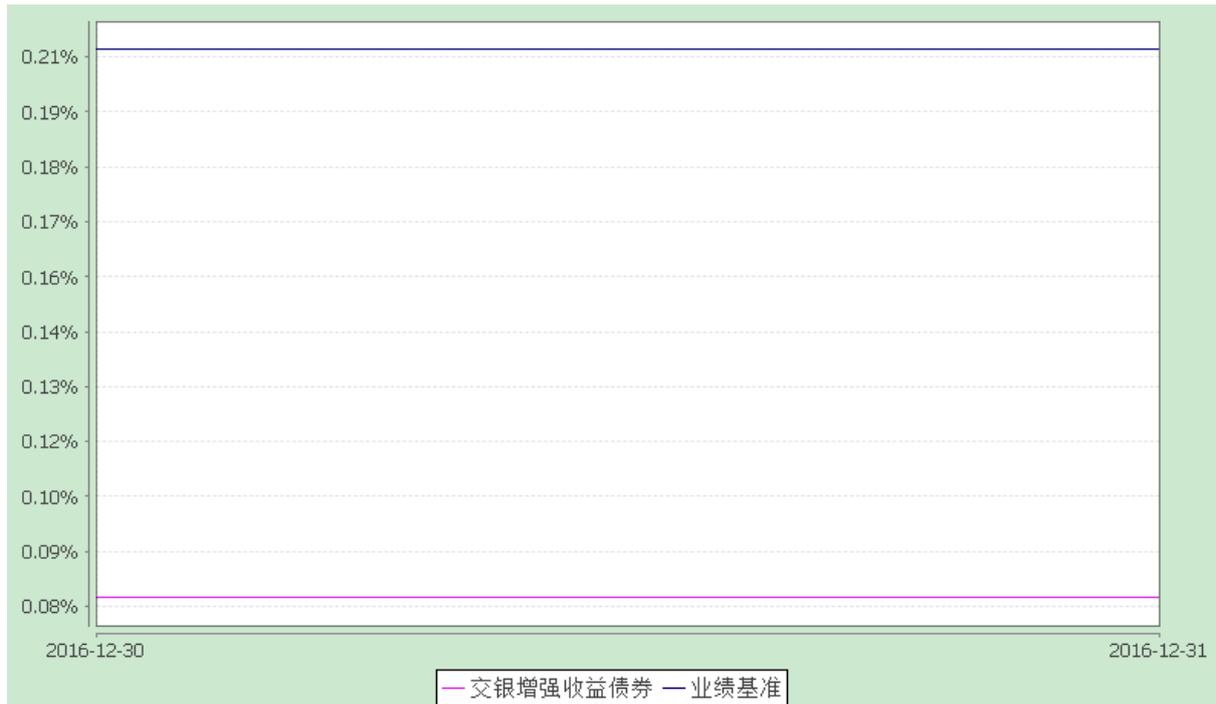
注：交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金从2016年12月30日起正式转型为交银施罗德增强收益债券型证券投资基金，本表列示的是本报告期基金转型后的基金净值表现，转型后基金的业绩比较基准为90%×中证综合债券指数收益率+10%×沪深300指数收益率。

#### 3.1.2.2 自基金转型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

交银施罗德增强收益债券型证券投资基金

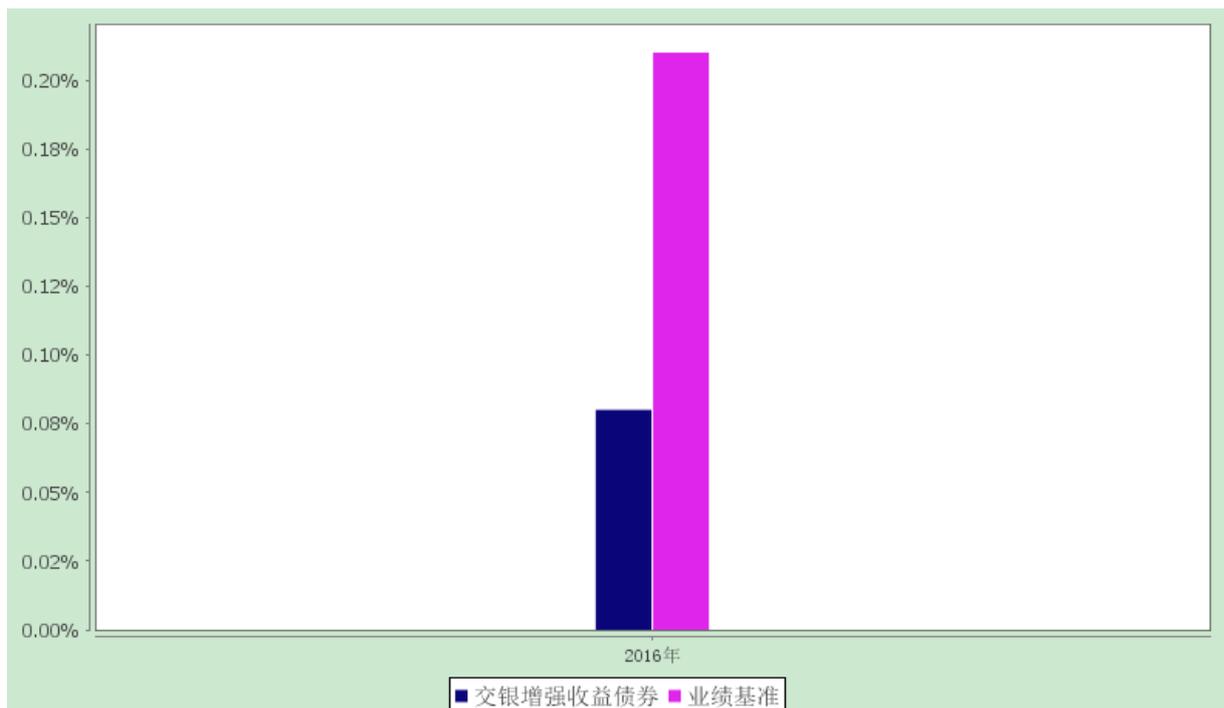
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2016年12月30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。本基金的投资转型期为交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金保本周期到期期间截止日的次日（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	42.94%	0.62%	10.55%	0.01%	32.39%	0.61%

12月29日						
--------	--	--	--	--	--	--

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前的基金净值表现，转型前基金的业绩比较基准为三年期银行定期存款税后收益率。

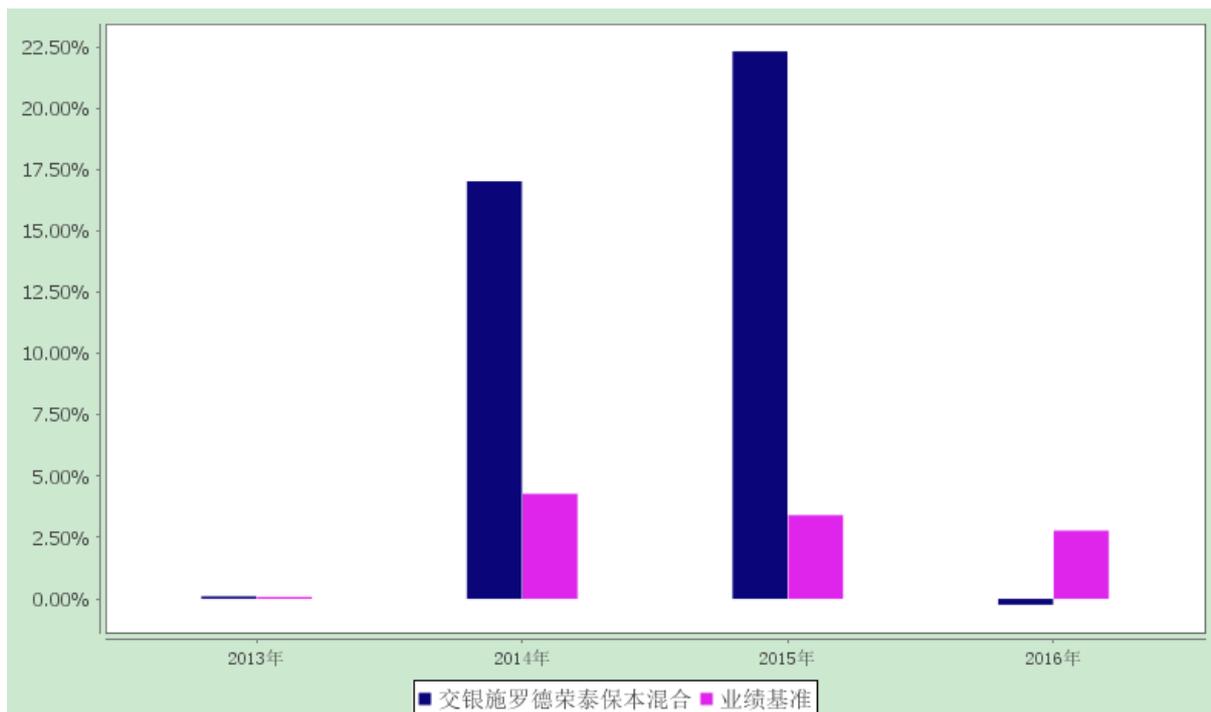
### 3.2.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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。

### 3.2.2.3 自基金合同生效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2013年12月25日至2016年12月29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。

### 3.2.3 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 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		
孙超	交银增利债券、交银纯债债券发起、交银荣祥保本混合、交银定期支付月月丰债券、交银增强收益债券、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	2015/11/7	-	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，2015 年 11 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的基金经理。

	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，公司固定收益部助理总经理				
章妍	交银荣祥保本混合、交银增强收益债券、交银裕通纯债债券、交银裕兴纯债债券、交银裕盈纯债债券、交银裕利纯债债券的基金经理	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。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的基金经理。

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(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 2015 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快速下跌后，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期限匹配固定收益产品为主，配合中性股票仓位，并在 12 月初逐步降低股票仓位至 0。后第三季度的稳健操作逐步弥补了 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 月股票和债券市场的下跌的影响不大。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 12 月 31 日，交银施罗德增强收益债券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，本基金已转型为二级债基，债券市场预计仍以震荡格局为主，受制于房价、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。在汇率和地产调控的风险阶段性地化解及流动性紧张缓解后，A 股市场有望改变弱势。本基金仍将以稳健思路操作，计划重点参与固定收益资产，累计一定收益后，逐步提高权益仓位，同时尽力控制权益仓位带来的回撤。

#### 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、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

交银施罗德增强收益债券型证券投资基金自 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自 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，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。

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 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 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 12 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	7. 1.4.7.6	-
<b>资产总计</b>		<b>106,445,220.73</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年12月31日</b>
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
<b>负债合计</b>		<b>6,476,253.88</b>
<b>所有者权益：</b>		<b>-</b>

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
<b>所有者权益合计</b>		<b>99,968,966.85</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>106,445,220.73</b>

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

项目	附注号	本期
		2016 年 12 月 30 日(转型生效日)至 2016 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		<b>25,207.82</b>
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
<b>减：二、费用</b>		<b>-1,286.03</b>
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
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>26,493.85</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>26,493.85</b>

### 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
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-4,815,545.93	-1,300,197.43	-6,115,743.36
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)	-	0.00	0.00
五、期末所有者权益 (基金净值)	78,679,121.31	21,289,845.54	99,968,966.85

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

## 7.1.4 报表附注

### 7.1.4.1 基金基本情况

交银施罗德增强收益债券型证券投资基金是由原交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金(以下简称“交银施罗德荣泰保本基金”)转型而来。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。原基金为契约

---

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。

根据原《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，交银施罗德荣泰保本基金的保本周期为三年。交银施罗德荣泰保本基金第一个保本周期自本基金转型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)。交银施罗德荣泰保本基金保本周期届满时，在符合保本基金存续条件下，继续存续并转入下一保本周期。在不符合保本基金存续条件下，交银施罗德荣泰保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”。

根据《交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金保本到期安排及交银施罗德增强收益债券型证券投资基金转型后运作相关业务规则的公告》，交银施罗德荣泰保本基金因未能符合保本基金存续条件，自 2016 年 12 月 30 日起转型为交银施罗德增强收益债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)，并相应修改基金的投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等。原《交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金基金合同》失效，《交银施罗德增强收益债券型证券投资基金基金合同》于同日起生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。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《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德增强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。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：固定收益类资产占基金资产的比例不低于 80%，固定收益类资产包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、可转换债券(含分离交易的可转换公司债券)、资产支持证券、次级债、债券回购等金融工具；股票、权证等权益类资产占基金资产的比例不高于 20%；现金及到期日在一年以

---

内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%。本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。

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。

#### **7.1.4.2 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》、《交银施罗德增强收益债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.1.4.4 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。

#### **7.1.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金 2016 年 12 月 30 日(转型生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间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 12 月 30 日(转型生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### **7.1.4.4 重要会计政策和会计估计**

##### **7.1.4.4.1 会计年度**

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期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。

##### **7.1.4.4.2 记账本位币**

本基金的记账本位币为人民币。

##### **7.1.4.4.3 金融资产和金融负债的分类**

###### **(1) 金融资产的分类**

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及

---

持有至到期投资。

本基金以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(主要为股指期货投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

## (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### 7.1.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动作为公允价值变动损益计入当期损益；在资产持有期间所取得的利息或现金股利以及处置时产生的处置损益计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解

---

除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### **7.1.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则**

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(主要为股指期货投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### **7.1.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### **7.1.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### **7.1.4.4.8 损益平准金**

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计

---

未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### **7.1.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量**

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时，处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### **7.1.4.4.10 费用的确认和计量**

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### **7.1.4.4.11 基金的收益分配政策**

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分(包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等)为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分后的余额)。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### **7.1.4.4.12 分部报告**

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### **7.1.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计**

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(2) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

#### **7.1.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **7.1.4.5.1 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。

##### **7.1.4.5.2 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。

##### **7.1.4.5.3 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。

#### **7.1.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[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)对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、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，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、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，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。

#### 7.1.4.7 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
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。

#### 7.1.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.1.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的交易。

##### 7.1.4.8.2 关联方报酬

###### 7.1.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2016年12月30日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,911.91
其中：支付销售机构的客户维护费	675.53

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.70%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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.70\% \div \text{当年天数}。$$

###### 7.1.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2016年12月30日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	546.26

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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% \div \text{当年天数}。$$

###### 7.1.4.8.2.3 销售服务费

无。

##### 7.1.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.1.4.8.4各关联方投资本基金的情况

##### 7.1.4.8.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内未发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

##### 7.1.4.8.4.2 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

本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金。

#### 7.1.4.8.5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12月30日(转型生效日)至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	6,143,451.03	245.74

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。

#### 7.1.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 7.1.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

#### 7.1.4.9 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.1.4.9.1 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。

##### 7.1.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.1.4.9.3 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。

#### 7.1.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

###### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

###### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

###### (i) 各层次金融工具公允价值

于2016年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为9,957,000.00元，无属于第一层次以及第三层次的余额。

###### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

###### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

###### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2016年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

###### (d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## 7.2 交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金

### 7.2.1 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12月29日(基金合同失效前日)

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年12月29日(基	上年度末 2015年12月31日
----	-----	----------------------	---------------------

		金合同失效前日)	
资产：		-	-
银行存款	7.2.4.7.1	1,965,848.21	13,860,927.24
结算备付金		223,160.02	330,094.18
存出保证金		39,639.09	139,394.26
交易性金融资产	7.2.4.7.2	9,953,000.00	150,013,074.43
其中：股票投资		-	36,724,074.43
基金投资		-	-
债券投资		9,953,000.00	113,289,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.2.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.2.4.7.4	90,000,000.00	-
应收证券清算款		9,034,136.11	-
应收利息	7.2.4.7.5	62,301.33	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	7.2.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>111,278,084.76</b>	<b>169,228,855.58</b>
<b>负债和所有者权益</b>		<b>本期末 2016年12月29日(基 金合同失效前日)</b>	<b>上年度末 2015年12月31日</b>
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.2.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-

应付赎回款		4,854,762.92	11,733.48
应付管理人报酬		126,771.01	172,585.82
应付托管费		21,128.48	28,764.31
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.2.4.7.7	91,691.42	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	7.2.4.7.8	125,514.57	180,179.58
<b>负债合计</b>		<b>5,219,868.40</b>	<b>593,345.34</b>
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	7.2.4.7.9	83,494,667.24	132,422,664.82
未分配利润	7.2.4.7.1 0	22,563,549.12	36,212,845.42
<b>所有者权益合计</b>		<b>106,058,216.36</b>	<b>168,635,510.24</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>111,278,084.76</b>	<b>169,228,855.58</b>

注：

- 1、报告截止日 2016 年 12 月 29 日(基金合同失效前日)，基金份额净值 1.270 元，基金份额总额 83,494,667.24 份。
- 2、本财务报表的实际编制期间为 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 29 日(基金合同失效前日)。
- 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。

## 7.2.2 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 12 月 29 日(基金合同失效前日)

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
----	-----	----	---------

		2016年1月1日至 2016年12月29日(基 金合同失效前日)	2015年1月1日至 2015年12月31日
<b>一、收入</b>		<b>2,162,888.25</b>	<b>50,729,427.99</b>
1.利息收入		5,387,576.02	6,215,686.11
其中：存款利息收入	7.2.4.7.11	469,696.26	177,769.75
债券利息收入		4,603,496.19	5,999,910.01
资产支持证券利 息收入		-	-
买入返售金融资 产收入		314,383.57	38,006.35
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“- ”填列）		2,817,265.79	48,304,978.13
其中：股票投资收益	7.2.4.7.12	1,516,653.66	47,556,120.06
基金投资收益		-	
债券投资收益	7.2.4.7.13	1,089,070.15	521,428.74
资产支持证券 投资收益	7.2.4.7.14	-	-
贵金属投资收 益		-	-
衍生工具收益	7.2.4.7.15	-	-
股利收益	7.2.4.7.16	211,541.98	227,429.33
3.公允价值变动收益 （损失以“-”号填列）	7.2.4.7.17	-6,129,024.67	-4,503,619.09
4.汇兑收益（损失以 “-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“- ”号填列）	7.2.4.7.18	87,071.11	712,382.84

<b>减：二、费用</b>		<b>3,051,573.50</b>	<b>5,403,627.94</b>
1. 管理人报酬		1,826,787.10	2,420,948.09
2. 托管费		304,464.44	403,491.33
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.2.4.7.19	610,719.83	2,069,679.19
5. 利息支出		137,828.83	287,683.53
其中：卖出回购金融资产支出		137,828.83	287,683.53
6. 其他费用	7.2.4.7.20	171,773.30	221,825.80
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-888,685.25</b>	<b>45,325,800.05</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-888,685.25</b>	<b>45,325,800.05</b>

### 7.2.3 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12月29日(基金合同失效前日)

单位：人民币元

项目	本期		
	2016年1月1日至2016年12月29日(基金合同失效前日)		
	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）	-	-888,685.25	-888,685.25
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”	-48,927,997.58	-12,760,611.05	-61,688,608.63

”号填列)			
其中：1.基金申购款	2,599,928.29	620,780.56	3,220,708.85
2.基金赎回款	-51,527,925.87	-13,381,391.61	-64,909,317.48
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（基金净值）	83,494,667.24	22,563,549.12	106,058,216.36
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）	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）	-	45,325,800.05	45,325,800.05
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）	-87,044,871.21	-18,017,994.41	-105,062,865.62
其中：1.基金申购款	48,352,839.72	12,373,093.58	60,725,933.30
2.基金赎回款	-135,397,710.93	-30,391,087.99	-165,788,798.92
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	132,422,664.82	36,212,845.42	168,635,510.24

(基金净值)			
--------	--	--	--

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

## 7.2.4 报表附注

### 7.2.4.1 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。在不符合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。

根据《交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金基金合同》及《交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金保本到期安排及交银施罗德增强收益债券型证券投资基金转型后运作相关业务规则的公告》的相关内容，本基金保本周期到期因未能符合保本基

---

金存续条件，按照基金合同的约定自 2016 年 12 月 30 日起转型为非保本的债券型基金，即“交银施罗德增强收益债券型证券投资基金”，并相应修改基金的投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等。原《交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金基金合同》自 2016 年 12 月 30 日起失效，修订后的《交银施罗德增强收益债券型证券投资基金基金合同》于同日起生效，并已报中国证监会备案。

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。

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。

#### **7.2.4.2 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 7.2.4.4 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。

经中国证监会批准，本基金的基金管理人交银施罗德基金管理有限公司将本基金于基金转型日 2016 年 12 月 30 日转型为交银施罗德增强收益债券型证券投资基金，因此本基金财务报表仍以持续经营假设为编制基础。

#### **7.2.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 29 日(基金合同失效前日)止期间的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 29 日(基金合同失效前日)的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 29 日(基金合同失效前日)止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### **7.2.4.4 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的说明。

#### **7.2.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **7.2.4.5.1 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。

##### **7.2.4.5.2 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。

##### **7.2.4.5.3 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。

##### **7.2.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[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股票、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股票、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，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、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，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。

#### 7.2.4.7 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
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。

#### 7.2.4.8本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.2.4.8.1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。

##### 7.2.4.8.2关联方报酬

###### 7.2.4.8.2.1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29日(基金合同失 效前日)	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	1,826,787.10	2,420,948.09
其中：支付销售机构的客户维护 费	726,391.52	1,008,306.48

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。

###### 7.2.4.8.2.2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29日(基金合同失 效前日)	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	304,464.44	403,491.33

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。

###### 7.2.4.8.2.3 销售服务费

无。

### 7.2.4.8.3 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。

### 7.2.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

#### 7.2.4.8.4.1 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。

#### 7.2.4.8.4.2 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。

### 7.2.4.8.5 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29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
中国建设银行股份有限公司	1,965,848.21	128,444.40	13,860,927.24	165,095.19

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。

### 7.2.4.8.6 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。

### 7.2.4.8.7 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。

### 7.2.4.9 期末（2016年12月29日）本基金持有的流通受限证券

#### 7.2.4.9.1 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。

#### 7.2.4.9.2 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流通受限股票。

### 7.2.4.9.3 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。

### 7.2.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

#### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

###### (i) 各层次金融工具公允价值

于2016年12月29日(基金合同失效前日)，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为9,953,000.00元，无属于第一层次以及第三层次的余额(2015年12月31日：第一层次31,162,802.03元，第二层次118,532,032.40元，第三层次318,240.00元)。

###### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 第三层次公允价值余额和本期变动金额

上述第三层次资产变动如下：

	交易性金融资产 ——股票投资
2016年1月1日	318,240.00
转入第三层次	-
转出第三层次	246,956.73
当期利得或损失总额 ——计入损益的利得或损失	-71,283.27
2016年12月29日	-
	-

2016年12月29日仍持有的资产计入  
2016年1月1日至2016年12月  
29日(基金合同失效前日)止期间的损  
益的未实现利得或损失的变动  
——公允价值变动损益

交易性金融资产  
——股票投资

2015年1月1日	-
转入第三层次	225,420.00
转出第三层次	-
当期利得或损失总额	
——计入损益的利得或损 失	92,820.00
2015年12月31日	<u>318,240.00</u>

2015年12月31日仍持 有的资产计入2015年度 损益的未实现利得或损失 的变动	
——公允价值变动损益	<u>-17,611.83</u>

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动收益、投资收益等项目。

使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值按照可比公司法确定。

## §8 投资组合报告

### 8.1 交银施罗德增强收益债券型证券投资基金

#### 8.1.1 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	9,957,000.00	9.35
	其中：债券	9,957,000.00	9.35
	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	87,000,000.00	81.73
	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	6,366,611.05	5.98
7	其他各项资产	3,121,609.68	2.93
8	合计	106,445,220.73	100.00

### 8.1.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.1.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

#### 8.1.2.2 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。

### 8.1.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

### 8.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动

本基金本报告期末未持有股票。

### 8.1.5 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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	9,957,000.00	9.96
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	其他	-	-
9	合计	9,957,000.00	9.96

#### 8.1.6 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	011698470	16 南航股 SCP009	100,000	9,957,000.00	9.96

#### 8.1.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 8.2.8 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。

#### 8.1.9 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。

#### 8.1.10 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。

#### 8.1.11 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。

### 8.1.12 投资组合报告附注

8.1.12.1 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。

8.1.12.2 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。

#### 8.1.12.3 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	39,639.09
2	应收证券清算款	3,015,722.20
3	应收股利	-
4	应收利息	66,248.39
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,121,609.68

#### 8.1.12.4 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。

#### 8.1.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

#### 8.1.12.6 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。

## 8.2 交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金

### 8.2.1 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	9,953,000.00	8.94
	其中：债券	9,953,000.00	8.94
	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	90,000,000.00	80.88
	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	2,189,008.23	1.97
7	其他各项资产	9,136,076.53	8.21
8	合计	111,278,084.76	100.00

### 8.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

#### 8.2.2.2 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。

### 8.2.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

## 8.2.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.2.4.1 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	600062	华润双鹤	3,751,321.00	2.22
4	001696	宗申动力	3,649,603.27	2.16
5	600886	国投电力	3,543,000.00	2.10
6	600257	大湖股份	3,428,055.00	2.03
7	001979	招商蛇口	3,384,335.00	2.01
8	600674	川投能源	3,216,518.90	1.91
9	002662	京威股份	3,127,460.00	1.85
10	300407	凯发电气	2,656,743.40	1.58
11	002597	金禾实业	2,602,574.00	1.54
12	300271	华宇软件	2,497,168.00	1.48
13	113009	广汽转债	2,446,700.00	1.45
14	300144	宋城演艺	2,365,110.72	1.40
15	002343	慈文传媒	2,360,480.64	1.40
16	600104	上汽集团	2,347,318.24	1.39
17	600483	福能股份	2,265,298.00	1.34
18	002368	太极股份	2,249,954.00	1.33
19	300437	清水源	2,243,804.00	1.33
20	000951	中国重汽	2,228,319.00	1.32

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。

### 8.2.4.2 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	600104	上汽集团	4,276,077.32	2.54
4	601009	南京银行	4,062,849.16	2.41

5	600062	华润双鹤	4,010,808.40	2.38
6	000951	中国重汽	3,911,578.44	2.32
7	601801	皖新传媒	3,813,129.00	2.26
8	600565	迪马股份	3,685,561.00	2.19
9	001696	宗申动力	3,606,150.42	2.14
10	001979	招商蛇口	3,516,384.58	2.09
11	600257	大湖股份	3,505,802.00	2.08
12	600886	国投电力	3,476,000.00	2.06
13	002662	京威股份	3,371,242.00	2.00
14	600674	川投能源	3,269,414.00	1.94
15	600242	中昌数据	2,909,253.00	1.73
16	300407	凯发电气	2,894,834.20	1.72
17	002539	云图控股	2,863,161.00	1.70
18	000513	丽珠集团	2,760,805.06	1.64
19	300488	恒锋工具	2,725,593.28	1.62
20	002597	金禾实业	2,657,968.00	1.58

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。

#### 8.2.4.3 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	177,902,746.58
卖出股票的收入（成交）总额	212,524,939.01

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。

#### 8.2.5 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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-

5	企业短期融资券	9,953,000.00	9.38
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	其他	-	-
9	合计	9,953,000.00	9.38

#### 8.2.6 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	011698470	16 南航股 SCP009	100,000	9,953,000.00	9.39

#### 8.2.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 8.2.8 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。

#### 8.2.9 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。

#### 8.2.10 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。

#### 8.2.11 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。

### 8.2.12 投资组合报告附注

8.2.12.1 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。

8.2.12.2 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。

### 8.2.12.3 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	39,639.09
2	应收证券清算款	9,034,136.11
3	应收股利	-
4	应收利息	62,301.33
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,136,076.53

### 8.2.12.4 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。

### 8.2.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

### 8.2.12.6 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。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 交银施罗德增强收益债券型证券投资基金

#### 9.1.1 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	
		持有份额	占总份额比	持有份额	占总份额

			例		比例
838	93,889.17	20,000,800.00	25.42%	58,678,321.31	74.58%

### 9.1.2 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	-	-

### 9.1.3 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、基金投资和研发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

## 9.2 交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金

### 9.2.1 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	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
879	94,988.24	20,000,800.00	23.95%	63,493,867.24	76.05%

### 9.2.2 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	-	-

### 9.2.3 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、基金投资和研发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
-----------------	---

## §10 开放式基金份额变动

### 10.1 交银施罗德增强收益债券型证券投资基金

单位：份

转型生效日（2016年12月30日）基金份额总额	83,494,667.24
转型生效日起至报告期期末基金总申购份额	-
减：转型生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-4,815,545.93
转型生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	78,679,121.31

注：

- 1、上表中“报告期”指2016年12月30日至2016年12月31日；
- 2、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；
- 3、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。

### 10.2 交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金

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
本报告期期末基金总申购份额	2,599,928.29
减：本报告期基金总赎回份额	-51,527,925.87
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	83,494,667.24

注：

- 1、上表中“报告期”指2016年1月1日至2016年12月29日；
- 2、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；
- 3、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。

---

## §11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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。经公司第四届董事会第十四次会议审议通过，印皓女士担任公司副总经理。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。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

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。转型后基金的投资目标、投资策略和业绩比较基准等按照《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。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)，本期审计费用为50,000.00元。自本基金基金合同生效以来，本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

### 11.6 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

公司于2016年1月和10月接受来自上海证监局和中国证监会的现场检查，并于报告期内收到监管部门对公司相关负责人的警示。公司已认真落实整改要求，加强制度和风控措施，进一步提升了公司内部控制和风险管理能力，并向监管部门进行了报告。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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 交银施罗德增强收益债券型证券投资基金

11.7.1.1 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	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		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	
国金证券股份有限公司	1					
方正证券股份有限公司	1					
川财证券股份有限公司	1					
瑞银证券有限责任公司	1					
兴业证券股份有限公司	1					
中国银河证券股份有限公司	2					
东方证券股份有限公司	2					
中信证券股份有限公司	1					
国泰君安证券股份有限公司	1					
北京高华证券有限责任公司	1					
西部证券股份有限公司	1					
招商证券股份有限公司	1					
中信建投证券股份有限公司	2					
华创证券有限责任公司	2					
西南证券股份有限公司	1					
申万宏源证券	1					

有限公司						
东吴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国联证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
红塔证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
第一创业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华融证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	1	-	-	-	-	-
长城证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-

#### 11.7.1.2 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
国金证券股份有限公司	-	-	87,000,000.00	100.00%	-	-

注：1、报告期内，本基金交易单元未发生变化；

2、租用证券公司专用交易单元的选择标准主要包括：券商基本面评价（财务状况和经营状况）、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、租用证券公司专用交易单元的程序：首先根据租用证券公司专用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专用交易单元。研究部提交方案，并上报公司批准。

## 11.7.2 交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金

### 11.7.2.1 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	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		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	
国金证券股份有限公司	1	72,071,429.30	18.51%	67,120.14	18.51%	-
方正证券股份有限公司	1	42,897,958.64	11.02%	39,951.07	11.02%	-
川财证券股份有限公司	1	980,927.00	0.25%	913.52	0.25%	-
瑞银证券有限责任公司	1	21,617,724.30	5.55%	20,132.65	5.55%	-
兴业证券股份有限公司	1	18,897,956.86	4.85%	17,599.74	4.85%	-
中国银河证券股份有限公司	2	11,440,244.40	2.94%	10,654.36	2.94%	-
东方证券股份有限公司	2	13,686,967.18	3.52%	12,746.83	3.52%	-
中信证券股份有限公司	1	48,726,733.21	12.52%	45,379.03	12.52%	-
国泰君安证券股份有限公司	1	13,040,598.45	3.35%	12,144.69	3.35%	-
北京高华证券有限责任公司	1	5,436,712.56	1.40%	5,063.14	1.40%	-
西部证券股份有限公司	1	58,461,777.09	15.02%	54,445.95	15.02%	-
招商证券股份有限公司	1	42,800,983.29	10.99%	39,860.82	10.99%	-
中信建投证券股份有限公司	2	14,086,616.20	3.62%	13,118.95	3.62%	-
华创证券有限责任公司	2	7,366,970.40	1.89%	6,860.85	1.89%	-
西南证券股份有限公司	1	13,794,257.88	3.54%	12,846.63	3.54%	-
申万宏源证券有限公司	1	4,010,123.28	1.03%	3,734.65	1.03%	-
东吴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

华信证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
国联证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
红塔证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
第一创业证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华融证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融 有限公司	1	-	-	-	-	-
长城证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-

#### 11.7.2.2 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
国金证券股份 有限公司	1,052,230.32	12.13%	832,800,0 00.00	57.94%	-	-
瑞银证券有限 责任公司	1,428,649.69	16.47%	185,500,0 00.00	12.91%	-	-
中国银河证券 股份有限公司	-	-	81,000,00 0.00	5.64%	-	-
东方证券股份 有限公司	-	-	20,000,00 0.00	1.39%	-	-
中信证券股份 有限公司	190,732.50	2.20%	318,000,0 00.00	22.12%	-	-
国泰君安证券 股份有限公司	2,536,162.00	29.24%	-	-	-	-
北京高华证券 有限责任公司	2,894,230.50	33.37%	-	-	-	-

西部证券股份 有限公司	218,872.50	2.52%	-	-	-	-
招商证券股份 有限公司	247,371.00	2.85%	-	-	-	-
华创证券有限 责任公司	105,750.70	1.22%	-	-	-	-

注：1、报告期内，本基金新增交易单元为西部证券股份有限公司，终止交易单位为中泰证券股份有限公司，其它交易单元未发生变化；

2、租用证券公司专用交易单元的选择标准主要包括：券商基本面评价（财务状况和经营状况）、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、租用证券公司专用交易单元的程序：首先根据租用证券公司专用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专用交易单元。研究部提交方案，并上报公司批准。

交银施罗德基金管理有限公司

二〇一七年三月二十九日