

交银施罗德增强收益债券型证券投资基金

2017 年半年度报告摘要

2017 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：二〇一七年八月二十六日

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 2017 年 8 月 25 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|------------------|
| 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 | 41,588,317.71 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

注：交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金从 2016 年 12 月 31 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，本表列示的基金合同生效日及本报告列示的转型生效日均指 2016 年 12 月 30 日。

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 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。 |

2.3 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 | 姓名 | 孙艳 | 田青 |

| | | | |
|--------|------|--------------------------------------|----------------------|
| 负责人 | 联系电话 | (021) 61055050 | 010-67595096 |
| | 电子邮箱 | xxpl@jysld.com, disclosure@jysld.com | tianqingl.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 |

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（2017年1月1日至2017年6月30日） |
|---------------|---------------------------|
| 本期已实现收益 | 716,593.38 |
| 本期利润 | -67,606.48 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0013 |
| 本期基金份额净值增长率 | 0.08% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2017年6月30日) |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.272 |
| 期末基金资产净值 | 52,907,168.39 |
| 期末基金份额净值 | 1.272 |

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

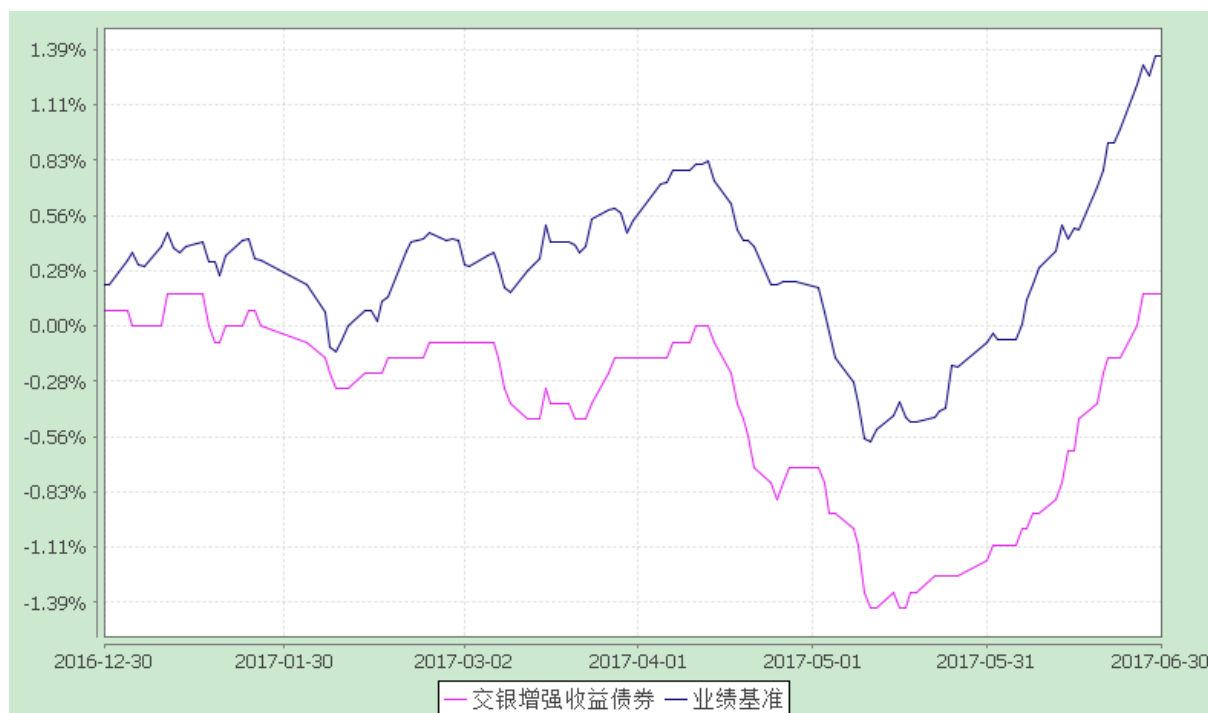
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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 | 1.35% | 0.06% | 1.44% | 0.08% | -0.09% | -0.02% |
| 过去三个月 | 0.32% | 0.09% | 0.84% | 0.09% | -0.52% | 0.00% |
| 过去六个月 | 0.08% | 0.08% | 1.15% | 0.09% | -1.07% | -0.01% |
| 自基金转型 生效日起至 今 | 0.16% | 0.08% | 1.36% | 0.09% | -1.20% | -0.01% |

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，每日进行再平衡。

3.2.2 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历史走势对比图
(2016 年 12 月 30 日至 2017 年 6 月 30 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。截至投资转型期结束，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 75 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 | 2016-12-30 | 2017-06-22 | 6 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 |

| | | | | |
|--|---------------------------------------------------|--|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| | <p>丰硕收益债券、交银荣鑫保本混合、交银增利增强债券的基金经理，公司固定收益部助理总经理</p> | | | <p>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，2014 年 8 月 26 日至 2017 年 6 月 21 日担任交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金的基金经理，2014 年 8 月 26 日至 2017 年 6 月 21 日担任交银施罗德强化回报债券型证券投资基金的基金经理，2014 年 12 月 15 日至 2017 年 2 月 17 日担任交银施罗德丰润收益债券型证券投资基金基金经理，2015 年 1 月 19 日至 2017 年 2 月 17 日担任交银施罗德丰享收益债券型证券投资基金基金经理，2015 年 1 月 30 日至 2017 年 2 月 17 日担任交银施罗德丰泽收益债券型证券投资基金基金经理，2015 年 5 月 9 日至 2017 年 6 月 21 日担任交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金的基金经理，2015 年 7 月 18 日至 2017 年 6 月 21 日担任交银施罗德增利债券证券投资基金的基金经理，2015 年 11 月 7 日至 2016 年 12 月 29 日担任交银施罗德荣鑫保本混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 11 月 7 日至 2017 年 6 月 21 日担任交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 11 月 9 日至 2017 年 6 月 21 日担任交银施罗德丰硕收益债券型证券投资基金的基金经理，2016 年 3 月 25 日至 2017 年 6 月 21 日担任交银施罗德荣鑫保本</p> |
|--|---------------------------------------------------|--|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

| | | | | | |
|-----|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------|---|------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| | | | | | <p>混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 12 月 30 日至 2017 年 6 月 21 日担任交银施罗德增强收益债券型证券投资基金的基金经理，2017 年 6 月 2 日至 2017 年 6 月 21 日担任交银施罗德增利增强债券型证券投资基金基金经理。</p> |
| 于海颖 | <p>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、交银丰盈收益债券、交银丰硕收益债券、交银荣鑫保本混合、交银增利增强债券的基金经理，公司固定收益（公募）投资总监</p> | 2017-06-10 | - | 11 年 | <p>于海颖女士，天津大学数量经济学硕士、经济学学士。历任北方国际信托投资股份有限公司固定收益研究员，光大保德信基金管理有限公司交易员、基金经理助理、基金经理，银华基金管理有限公司基金经理，五矿证券有限公司固定收益事业部投资管理部总经理。其中 2007 年 11 月 9 日至 2010 年 8 月 30 日任光大保德信货币市场基金基金经理，2008 年 10 月 29 日至 2010 年 8 月 30 日任光大保德信增利收益债券型证券投资基金基金经理，2011 年 6 月 28 日至 2013 年 6 月 16 日任银华永祥保本混合型证券投资基金基金经理，2011 年 8 月 2 日至 2014 年 4 月 24 日任银华货币市场证券投资基金基金经理，2012 年 8 月 9 日至 2014 年 10 月 7 日任银华纯债信用主题债券型证券投资基金（LOF）基金经理，2013 年 4 月 1 日至 2014 年 4 月 24 日任银华交易型货币市场基金基金经理，2013 年 8 月 7 日至 2014 年 10 月 7 日任银华信用四季红债券型证券投资基金基金经理，2013 年</p> |

| | | | | | |
|----|-----------------------------------------------------------------------|------------|------------|-----|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| | | | | | 9 月 18 日至 2014 年 10 月 7 日任银华信用季季红债券型证券投资基金基金经理，2014 年 5 月 8 日至 2014 年 10 月 7 日任银华信用债券型证券投资基金 (LOF) 基金经理。2016 年加入交银施罗德基金管理有限公司。 |
| 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、交银启通灵活配置混合的基金经理 | 2015-11-21 | 2017-03-31 | 2 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。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，2016 年 1 月 9 日至 2017 年 3 月 30 日担任交银施罗德裕通纯债债券型证券投资基金的基金经理，2016 年 6 月 20 日至 2017 年 3 月 30 日担任交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 9 月 7 日至 2017 年 3 月 30 日担任交银施罗德裕兴纯债债券型证券投资基金的基金经理，2016 年 11 月 4 日至 2017 年 3 月 30 日担任交银施罗德裕盈纯债债券型证券投资基金的基金经理，2016 年 11 月 23 日至 2017 年 3 月 30 日担任交银施罗德裕利纯债债券型证券投资基金的基金经理，2016 年 12 月 30 日至 2017 年 3 月 30 日担任交银施罗德增强收益债券型证券投资基金的基金经理， |

| | | | | | |
|-----|--------------------------------------------------------|------------|---|-----|-------------------------------------------------------------------------------------------------|
| | | | | | 2017 年 2 月 24 日至 2017 年 3 月 30 日担任交银施罗德启通灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。 |
| 王艺伟 | 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、交银荣鑫保本混合的基金经理助理 | 2017-05-24 | - | 5 年 | 王艺伟女士，北京大学经济学硕士，吉林大学经济学学士、理学学士。2012 年-2014 年任光大证券研究所宏观分析师。2014 年加入交银施罗德基金管理有限公司，曾任研究员、研究部助理总经理。 |

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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。

本报告期内，本基金整体运作合规合法，无不当内幕交易和关联交易，基金投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的约定，未发生损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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不存在异常交易行为。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没有超过该证券当日总成交量 5% 的情形，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出现异常。

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

本报告期内，外贸及地产销售对一季度宏观经济基本面形成有利支撑，尽管经济在四月出现下行迹象，但经济失速风险尚未出现，金融去杠杆导致的资金面收紧令债市面临持续调整压力。央行先后于 1 月 24 日、2 月 3 日上调 MLF 和公开市场操作利率，春节前资金面整体处于紧平衡状态，都直接带动现券收益率震荡上行，首次政策利率上调令 10 年国债收益率上行至 3.49%，10 年国开收益率上行至 4.19% 的阶段高点。四月伊始，银监会陆续推出多项监管文件以及叠加资金面的波动情况，市场情绪明显不佳，10 年国债收益率高点一度接近 3.70%，信用债收益率也明显上行，信用利差走扩。

在市场明显表达了对金融去杠杆的恐慌情绪后，监管层也开始通过多种方式稳定市场预期，五月中旬起，央行通过加大 MLF 的投放力度，开展 28 天逆回购等举措，极大地平稳了资金面预期，债券收益率出现下行。

权益市场方面，抱团龙头股是贯穿上半年的投资主线，股债联动也较为明显。一月权益市场整体调整，随后“一带一路”、消费、苹果产业链、新能源汽车等主题发力，带动大盘缓步上涨。三月底市场寻顶，创业板出现较大幅度回调。四月因资金面冲击及减持新规的影响，权益市场持续调整。五月中旬因央行态度缓和而反弹，低估值金融地产、新能源汽车及白马股走势较强。

本报告期内，考虑到本组合为原保本基金转型而来，因此在个券的选择上，增持了部分期限适中、且收益水平良好的中高等级信用品种，考虑到组合特点，我们对杠杆操作保持谨慎。在权益和转债配置方面，组合侧重配置低估值，有向上催化的标的，

配置方向主要为有色、机械及金融板块。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 6 月 30 日，本基金份额净值 1.272 元，本报告期份额净值增长率为 0.08%，同期业绩比较基准增长率为 1.15%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，我们认为随着库存周期从主动补库存向被动补库存转变，地方政府融资被进一步规范，经济仍有下行的压力，但整体看经济下行的幅度有限。货币政策仍将着力于去杠杆、防风险，中性偏紧的货币政策基调难改。下半年随着经济和通胀走弱，债券市场收益率将随名义增速的回落而下行，但由于货币政策难以放松，而经济下行的幅度有限，债券市场下行的空间将受到制约，机会依然来自对监管政策和资金面预期差博弈，而较大机会则来自于对宏观基本面拐点的把握。短期在宏观环境相对平稳、监管各项政策没有落地前，我们计划将维持目前的债券久期配置，并将根据宏观及监管政策的变化择机拉长久期。权益方面，2017 年下半年我们将重点关注低估值白马龙头及新能源汽车等行业表现。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序，经公司管理层批准后实行，并成立了估值委员会，估值委员会成员由研究部、基金运营部、风险管理部等人员和固定收益人员及基金经理组成。

公司严格按照新会计准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定进行估值，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。估值委员会的研究部成员按投资品种的不同性质，研究并参考市场普遍认同的做法，建议合理的估值模型，进行测算和认证，认可后交各估值委员会成员从基金会计、风险、合规等方面审批，一致同意后，报公司投资总监、总经理审批。

估值委员会会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后，及时召开临时会议进行研究，及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值委员会成员均具备相应的专业资格及工作经验。基金经理作为估值委员会成员，对本基金持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感，向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论。本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突，截止报告期末未有与任何外部估值定价服务机构签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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：交银施罗德增强收益债券型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2017 年 6 月 30 日 | 上年度末 2016 年 12 月 31 日 |
|-------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资产： | | - | - |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 461,880.50 | 6,143,451.03 |
| 结算备付金 | | 477,588.26 | 223,160.02 |

| | | | |
|-----------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 存出保证金 | | 6,295.84 | 39,639.09 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 54,322,377.50 | 9,957,000.00 |
| 其中：股票投资 | | 266,760.00 | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 54,055,617.50 | 9,957,000.00 |
| 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 | - | 87,000,000.00 |
| 应收证券清算款 | | 33,770.01 | 3,015,722.20 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 836,651.48 | 66,248.39 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 19.98 | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 56,138,583.57 | 106,445,220.73 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2017年6月30日 | 上年度末 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 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | 3,000,000.00 | - |
| 应付证券清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | - | 6,109,563.03 |
| 应付管理人报酬 | | 30,383.12 | 128,682.92 |
| 应付托管费 | | 8,680.89 | 21,674.74 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 408.05 | 91,691.42 |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | -2,027.40 | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 193,970.52 | 124,641.77 |

| | | | |
|---------------|----------|---------------|----------------|
| 负债合计 | | 3,231,415.18 | 6,476,253.88 |
| 所有者权益： | | - | - |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 41,588,317.71 | 78,679,121.31 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 11,318,850.68 | 21,289,845.54 |
| 所有者权益合计 | | 52,907,168.39 | 99,968,966.85 |
| 负债和所有者权益总计 | | 56,138,583.57 | 106,445,220.73 |

注：1、注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.272 元，基金份额总额 41,588,317.71 份。

2、本摘要中资产负债表和利润表所列附注号为半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半年度报告正文。

6.2 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 |
|-----------------------|----------|---------------------------------|
| | | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |
| 一、收入 | | 509,009.42 |
| 1.利息收入 | | 1,527,177.14 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 26,893.76 |
| 债券利息收入 | | 1,388,227.14 |
| 资产支持证券利息收入 | | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 112,056.24 |
| 其他利息收入 | | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | -234,529.88 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | 91,142.29 |
| 基金投资收益 | | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | -325,672.17 |
| 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 | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | -784,199.86 |

| | | |
|----------------------------|----------|-------------------|
| 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 | 562.02 |
| 减：二、费用 | | 576,615.90 |
| 1. 管理人报酬 | | 237,998.22 |
| 2. 托管费 | | 67,999.61 |
| 3. 销售服务费 | | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.19 | 14,689.65 |
| 5. 利息支出 | | 108,552.02 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 108,552.02 |
| 6. 其他费用 | 6.4.7.20 | 147,376.40 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -67,606.48 |
| 减：所得税费用 | | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -67,606.48 |

6.3 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | | |
|-----------------------------------|---------------------------------|---------------|----------------|
| | 2017 年 1 月 1 日至 2017 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） | 78,679,121.31 | 21,289,845.54 | 99,968,966.85 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -67,606.48 | -67,606.48 |
| 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） | -37,090,803.60 | -9,903,388.38 | -46,994,191.98 |
| 其中：1. 基金申购款 | 625,712.00 | 167,775.05 | 793,487.05 |

| | | | |
|----------------------------------------|----------------|----------------|----------------|
| 2.基金赎回款 | -37,716,515.60 | -10,071,163.43 | -47,787,679.03 |
| 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） | 41,588,317.71 | 11,318,850.68 | 52,907,168.39 |

报表附注为财务报表的组成部分。

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

6.4 报表附注

6.4.1 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》于同一日起生效。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。

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(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 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 2017 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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 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[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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|-----------------|----------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 237,998.22 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | - |

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 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 × 1.5% ÷ 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|----------------|----------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 67,999.61 |

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 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 × 0.25% ÷ 当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费

无。

6.4.8.3 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。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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。

6.4.8.4.2 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。

6.4.8.5 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 2017年1月1日至2017年6月30日 | |
|--------------|----------------------------|-----------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国建设银行股份有限公司 | 461,880.50 | 16,582.77 |

注：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。

6.4.8.6 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。

6.4.8.7 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。

6.4.9 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.2 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。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 3,000,000.00 元，于 2017 年 7 月 3 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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 | 266,760.00 | 0.48 |
| | 其中：股票 | 266,760.00 | 0.48 |
| 2 | 固定收益投资 | 54,055,617.50 | 96.29 |
| | 其中：债券 | 54,055,617.50 | 96.29 |
| | 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 | - | - |
| | 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 | 939,468.76 | 1.67 |
| 7 | 其他各项资产 | 876,737.31 | 1.56 |
| 8 | 合计 | 56,138,583.57 | 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 | - | - |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| 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 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 266,760.00 | 0.50 |
| 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 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 266,760.00 | 0.50 |

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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 | 600054 | 黄山旅游 | 15,600 | 266,760.00 | 0.50 |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

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 | 600426 | 华鲁恒升 | 531,853.20 | 0.53 |
| 2 | 002539 | 云图控股 | 454,000.00 | 0.45 |
| 3 | 603556 | 海兴电力 | 439,000.00 | 0.44 |
| 4 | 601607 | 上海医药 | 408,876.61 | 0.41 |
| 5 | 300407 | 凯发电气 | 357,134.00 | 0.36 |
| 6 | 002019 | 亿帆医药 | 307,965.00 | 0.31 |
| 7 | 002712 | 思美传媒 | 267,165.90 | 0.27 |
| 8 | 600054 | 黄山旅游 | 263,668.00 | 0.26 |
| 9 | 300156 | 神雾环保 | 256,300.00 | 0.26 |
| 10 | 002185 | 华天科技 | 237,600.00 | 0.24 |
| 11 | 601117 | 中国化学 | 218,100.00 | 0.22 |
| 12 | 300182 | 捷成股份 | 103,600.00 | 0.10 |

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 | 600426 | 华鲁恒升 | 570,098.00 | 0.57 |
| 2 | 002539 | 云图控股 | 469,569.00 | 0.47 |
| 3 | 603556 | 海兴电力 | 442,000.00 | 0.44 |
| 4 | 601607 | 上海医药 | 413,800.00 | 0.41 |
| 5 | 300407 | 凯发电气 | 363,500.00 | 0.36 |
| 6 | 002019 | 亿帆医药 | 320,146.00 | 0.32 |
| 7 | 002712 | 思美传媒 | 287,516.00 | 0.29 |
| 8 | 002185 | 华天科技 | 246,000.00 | 0.25 |
| 9 | 300156 | 神雾环保 | 244,482.00 | 0.24 |
| 10 | 601117 | 中国化学 | 222,900.00 | 0.22 |
| 11 | 300182 | 捷成股份 | 92,726.00 | 0.09 |

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 | 3,845,262.71 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 3,672,737.00 |

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 | 3,569,069.70 | 6.75 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 4,921,000.00 | 9.30 |

| | | | |
|----|-----------|---------------|--------|
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | 9,868,500.00 | 18.65 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 35,403,500.00 | 66.92 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 293,547.80 | 0.55 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 54,055,617.50 | 102.17 |

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 | 101461018 | 14 株城发 MTN001 | 50,000 | 5,178,500.00 | 9.79 |
| 2 | 101554011 | 15 淄博城运 MTN001 | 50,000 | 5,132,000.00 | 9.70 |
| 3 | 101354002 | 13 桂机场 MTN001 | 50,000 | 5,087,500.00 | 9.62 |
| 4 | 101575001 | 15 金融街 MTN001 | 50,000 | 5,048,000.00 | 9.54 |
| 5 | 101551028 | 15 华侨城 MTN001 | 50,000 | 5,034,000.00 | 9.51 |

7.7 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。

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除 16 华泰 G3（证券代码：136873）外，未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

报告期内本基金投资的前十名证券之一 16 华泰 G3（证券代码：136873）的发行主体华泰证券于 2016 年 11 月 29 日公告，公司因未按规定审查、了解客户真实身份违法违规行为于 2016 年 11 月 28 日收到中国证监会《行政处罚决定书》（[2016]126 号）。据此，中国证监会决定对公司责令改正，给予警告，没收违法所得 18,235,275.00 元，并处以 54,705,825.00 元罚款。

本基金管理人对该证券投资决策程序的说明如下：本基金管理人对证券投资特别是重仓个券的投资有严格的投资决策流程控制。本基金在对该证券的投资也严格执行投资决策流程。在对该证券的选择上，严格执行公司个券审核流程。在对该证券的持有过程中研究员密切关注债券发行主体动向。在上述处罚发生时及时分析其对投资决策的影响，经过分析认为此事件对债券发行主体财务状况、经营成果和现金流量未产生重大的实质性影响，所以不影响对该债券基本面和投资价值的判断。

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 | 6,295.84 |
| 2 | 应收证券清算款 | 33,770.01 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 836,651.48 |
| 5 | 应收申购款 | 19.98 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 876,737.31 |

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 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 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 | |
| | | 持有份额 | 占总份额比 例 | 持有份额 | 占总份额比 例 |
| 624 | 66,647.95 | - | - | 41,588,317.71 | 100.00% |

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（2016年12月30日）基金份额总额 | 271,898,528.26 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 78,679,121.31 |
| 本报告期基金总申购份额 | 625,712.00 |

| | |
|---------------|---------------|
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 37,716,515.60 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 41,588,317.71 |

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，本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

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

本报告期内公司收到中国证监会 2016 年“两个加强、两个遏制”回头看专项检查后采取责令改正的要求，公司已根据监管要求认真制订并落实了整改计划，按照要求完成了改进工作，并将整改情况向监管部门进行了报告。除上述情况外，本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

（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 | |
| 中国银河证券股份有限公司 | 2 | 785,098.00 | 10.44% | 731.17 | 10.44% | - |
| 东方证券股份有限公司 | 2 | 442,000.00 | 5.88% | 411.55 | 5.88% | - |
| 兴业证券股份有限公司 | 1 | 3,563,238.00 | 47.40% | 3,318.34 | 47.40% | - |
| 西南证券股份有限公司 | 1 | 267,165.90 | 3.55% | 248.82 | 3.55% | - |
| 中信证券股份有限公司 | 1 | 263,668.00 | 3.51% | 245.55 | 3.51% | - |
| 国金证券股份有限公司 | 1 | 2,019,529.81 | 26.86% | 1,880.78 | 26.86% | - |
| 川财证券有限责任公司 | 1 | 177,300.00 | 2.36% | 165.11 | 2.36% | - |
| 方正证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 上海华信证券有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国联证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国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 | - | - | - | - | - |

| 公司 | | | | | | |
|--------------|---|---|---|---|---|---|
| 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 | - | - | - | - | - |
| 招商证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 长城证券股份有限公司 | 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 | - | - | - | - | - |
| 西部证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源证券有限公司 | 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 |
| 中国银河证券股份有限公司 | 1,998,000.00 | 4.45% | 37,000,000.00 | 3.73% | - | - |
| 东方证券股份有限公司 | - | - | 90,500,000.00 | 9.13% | - | - |
| 兴业证券股份有限公司 | 3,241,625.90 | 7.22% | 300,000.00 | 0.03% | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 3,034,249.32 | 6.75% | 173,600,000.00 | 17.51% | - | - |
| 国金证券股份有限公司 | 6,548,475.73 | 14.58% | 446,500,000.00 | 45.04% | - | - |
| 川财证券有 | 1,078,520. | 2.40% | - | - | - | - |

| | | | | | | | |
|----------------------|-------------------|--------|--------------------|--------|---|---|---|
| 限责任公司 | 00 | | | | | | |
| 国信证券股份 有限公司 | - | - | 52,200,0 00.00 | 5.27% | - | - | - |
| 国泰君安证 券股份有限 公司 | - | - | 65,000,0 00.00 | 6.56% | - | - | - |
| 中国国际金 融股份有限 公司 | - | - | 102,800, 000.00 | 10.37% | - | - | - |
| 中信建投证 券股份有限 公司 | 10,752,625 .48 | 23.93% | - | - | - | - | - |
| 西部证券股 份有限公司 | - | - | 9,000,00 0.00 | 0.91% | - | - | - |
| 申万宏源证 券有限公司 | 18,273,164 .05 | 40.67% | 14,500,0 00.00 | 1.46% | - | - | - |

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。

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|------------------------|---------------|------|---------------|------------|------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 1 | 2017/1/1-2017/6/30 | 20,000,800.00 | - | 20,000,800.00 | - | - |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 本基金本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例超过基金总份额20%的情况。如该类投资者集中赎回，可能会对本基金带来流动性冲击，从而影响基金的投资运作和收益水平。基金管理人将加强流动性管理，防范相关风险，保护持有人利益。 | | | | | | | |