

交银施罗德丰硕收益债券型证券投资基金
2017 年半年度报告
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：中信银行股份有限公司

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。

基金托管人中信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。

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	6
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合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
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	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	34
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	35
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	35
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	35
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	36
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	36
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	36
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	36
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	36
7.12 投资组合报告附注	36

§8 基金份额持有人信息	37
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	37
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	37
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	38
§9 重大事件揭示	38
9.1 基金份额持有人大会决议	38
9.2 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	38
9.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	38
9.4 基金投资策略的改变	38
9.5 报告期内改聘会计师事务所情况	38
9.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	38
9.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	39
9.8 其他重大事件	40
§10 备查文件目录	40
10.1 备查文件目录	40
10.2 存放地点	40
10.3 查阅方式	40

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	交银施罗德丰硕收益债券型证券投资基金
基金简称	交银丰硕收益债券
基金主代码	519758
交易代码	519758
基金运作方式	契约型,本基金在基金合同生效之日起两年(含两年)的期间内封闭式运作(按照基金合同的约定提前转换基金运作方式的除外),封闭期结束后转为开放式运作。
基金合同生效日	2015年11月9日
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	438,630,665.79份
基金合同存续期	不定期

注：本基金在基金合同生效之日起两年（含两年）的期间内封闭式运作（按照基金合同的约定提前转换基金运作方式的除外）。封闭期内，基金投资者不能申购、赎回本基金基金份额，即C类基金份额。

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险的前提下,力求获得高于业绩基准的投资收益。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势,融合规范化的基本面研究和严谨的信用分析,在分析和判断宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上,充分利用封闭式运作优势,以买入持有和杠杆套息等为基本投资策略,获取稳定收益;同时,本基金将严格控制信用风险,在严谨深入的信用分析基础上,综合考量信用债券的信用评级,以及各类债券的流动性、供求关系和收益率水平等,自下而上精选投资标的。
业绩比较基准	两年期银行定期存款税后收益率+1.25%
风险收益特征	本基金是一只债券型基金,其风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金,属于证券投资基金中中等风险的品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		交银施罗德基金管理有限公司	中信银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙艳	方韡
	联系电话	(021) 61055050	4006800000
	电子邮箱	xxpl@jysld.com, disclosure@jysld.com	fangwei@citicbank.com
客户服务电话		400-700-5000, 021-61055000	95558
传真		(021) 61055054	010-85230024
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)	北京市东城区朝阳门北大街9号
办公地址		上海浦东新区世纪大道8号国金中心二期21-22楼	北京市东城区朝阳门北大街9号
邮政编码		200120	100010
法定代表人		于亚利	李庆萍

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

§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	399,724.58
本期利润	7,819,975.04
加权平均基金份额本期利润	0.0178
本期加权平均净值利润率	1.82%
本期基金份额净值增长率	1.85%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	-4,951,555.96
期末可供分配基金份额利润	-0.011
期末基金资产净值	433,679,109.83
期末基金份额净值	0.989
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	2.19%

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后的实际收益水平要低于所列数字；

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

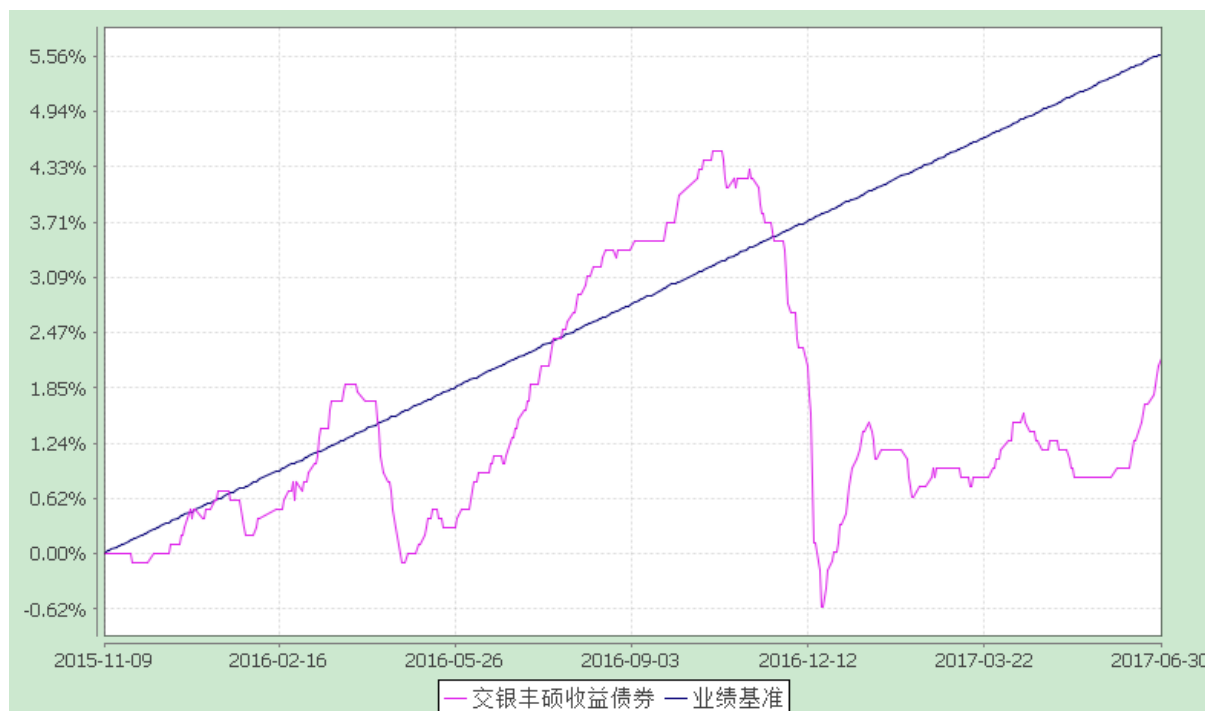
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.33%	0.06%	0.28%	0.01%	1.05%	0.05%
过去三个月	1.02%	0.07%	0.85%	0.01%	0.17%	0.06%
过去六个月	1.85%	0.08%	1.68%	0.01%	0.17%	0.07%
过去一年	0.78%	0.13%	3.40%	0.01%	-2.62%	0.12%
自基金合同生效起至今	2.19%	0.12%	5.58%	0.01%	-3.39%	0.11%

注：本基金业绩比较基准为两年期银行定期存款税后收益率+1.25%。

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

交银施罗德丰硕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
(2015年11月9日至2017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	2015-11-09	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 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

					<p>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泰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，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，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混合型证券投资基金的基金经理，2016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</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</p>

	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>益债券型证券投资基金基金经理，2011年6月28日至2013年6月16日任银华永祥保本混合型证券投资基金基金经理，2011年8月2日至2014年4月24日任银华货币市场证券投资基金基金经理，2012年8月9日至2014年10月7日任银华纯债信用主题债券型证券投资基金（LOF）基金经理，2013年4月1日至2014年4月24日任银华交易型货币市场基金基金经理，2013年8月7日至2014年10月7日任银华信用四季红债券型证券投资基金基金经理，2013年9月18日至2014年10月7日任银华信用季季红债券型证券投资基金基金经理，2014年5月8日至2014年10月7日任银华信用债券型证券投资基金（LOF）基金经理。2016年加入交银施罗德基金管理有限公司。</p>
魏玉敏	交银增利债券、交银信用添利债券（LOF）、交银双利债券、交银纯债债券发起、交银双轮动债券、交银荣和保本混合、交银丰硕收益债券的基金经理助理	2017-5-24	-	5年	<p>魏玉敏女士，厦门大学金融学硕士。历任招商证券固定收益研究员，国信证券固定收益高级分析师。2016年加入交银施罗德基金管理有限公司。</p>

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。

本报告期内，本组合的债券配置继续按照期限匹配的策略，提升组合的静态收益水平。同时，考虑到本基金将于四季度封闭期到期，因此针对部分流动性较弱的个券品种，本组合采取了置换操作。同时，利用存单利率较高的时机，择机增持了部分期限匹配且收益较好的高等级存单，以期提升组合杠杆及组合静态收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2017年6月30日，本基金份额净值为0.989元，本报告期份额净值增长率为1.85%，同期业绩比较基准增长率为1.68%。

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，我们计划维持目前的债券久期配置，并将根据组合的个券流动性情况逐步进行置换操作。

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

自2015年11月9日交银施罗德丰硕收益债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）成立以来，作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内，本托管人按照国家有关法律法规、基金合同和托管协议要求，对基金管理人——交银施罗德基金管理有限公司在本基金投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。本报告期，本基金未进行利润分配，经本托管人复核，符合合同相关要求，不存在损害持有人利益的情况。

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

由本基金管理人——交银施罗德基金管理有限公司编制，并经本托管人复核审查

的本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§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：交银施罗德丰硕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	1,844,588.76	3,394,086.10
结算备付金		4,998,289.18	11,993,619.32
存出保证金		31,860.87	35,823.27
交易性金融资产	6.4.7.2	615,210,436.00	760,065,794.00
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		557,401,236.00	702,065,794.00
资产支持证券投资		57,809,200.00	58,000,000.00
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	-	-
应收证券清算款		-	234,000.00
应收利息	6.4.7.5	8,779,892.96	11,213,751.95
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		630,865,067.77	786,937,074.64
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		195,197,974.88	359,999,650.00
应付证券清算款		1,029,187.92	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		282,689.41	293,066.79
应付托管费		53,004.27	54,950.04
应付销售服务费		212,017.05	219,800.08
应付交易费用	6.4.7.7	12,363.67	9,873.44
应交税费		-	-
应付利息		9,953.22	194,599.50
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	388,767.52	306,000.00
负债合计		197,185,957.94	361,077,939.85
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	438,630,665.79	438,630,665.79
未分配利润	6.4.7.10	-4,951,555.96	-12,771,531.00
所有者权益合计		433,679,109.83	425,859,134.79
负债和所有者权益总计		630,865,067.77	786,937,074.64

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，C 类基金份额净值 0.989 元，C 类基金份额总额 438,630,665.79 份。

6.2 利润表

会计主体：交银施罗德丰硕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	上年度可比期间
		2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		15,170,750.50	10,547,206.20
1.利息收入		13,048,154.75	10,634,920.08
其中：存款利息收入	6.4.7.11	106,551.30	294,603.41
债券利息收入		11,069,293.98	10,191,105.17

资产支持证券利息收入		1,831,993.09	149,211.50
买入返售金融资产收入		40,316.38	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-5,297,654.71	2,030,748.47
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-5,297,654.71	2,030,748.47
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	7,420,250.46	-2,118,462.35
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	-	-
减：二、费用		7,350,775.46	6,412,602.62
1. 管理人报酬		1,701,931.91	1,758,685.82
2. 托管费		319,112.20	329,753.53
3. 销售服务费		1,276,448.97	1,319,014.37
4. 交易费用	6.4.7.19	5,232.32	3,493.86
5. 利息支出		3,871,097.65	2,830,457.78
其中：卖出回购金融资产支出		3,871,097.65	2,830,457.78
6. 其他费用	6.4.7.20	176,952.41	171,197.26
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7,819,975.04	4,134,603.58
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,819,975.04	4,134,603.58

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：交银施罗德丰硕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)	438,630,665.79	-12,771,531.00	425,859,134.79
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	7,819,975.04	7,819,975.04
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 (净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	438,630,665.79	-4,951,555.96	433,679,109.83
项目	上年度可比期间 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)	438,630,665.79	2,118,787.13	440,749,452.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	4,134,603.58	4,134,603.58
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-

四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	438,630,665.79	6,253,390.71	444,884,056.50

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：单江

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

交银施罗德丰硕收益债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]2267号《关于准予交银施罗德丰硕收益债券型证券投资基金注册的批复》核准，由交银施罗德基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德丰硕收益债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型封闭式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 438,442,304.66 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(2015)第 1235 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《交银施罗德丰硕收益债券型证券投资基金基金合同》于 2015 年 11 月 9 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 438,630,665.79 份基金份额，其中认购资金利息折合 188,361.13 份基金份额。本基金的基金管理人为交银施罗德基金管理有限公司，基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据《交银施罗德丰硕收益债券型证券投资基金基金合同》和《交银施罗德丰硕收益债券型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用、赎回费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人申购时收取申购费用、赎回时收取赎回费用的，称为 A 类基金份额，在投资人认购/申购、赎回时不收取认购/申购费用、赎回费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额；本基金募集期内仅开放 C 类基金份额的认购；在基金合同生效之日起两年(含两年)的期间内封闭式运作（按照基金合同的约定提前转换基金运作方式的除外），封闭期结束后转为开放式运作，并可视业务情况择时增开 A 类基金份额的申购。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德丰硕收益债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包

括国内依法发行交易的国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、分离交易可转债的纯债、次级债、资产支持证券、短期融资券、中期票据、非公开发行公司债、债券回购、银行存款、货币市场工具等固定收益类资产和法律法规允许投资的其他金融工具。其中，封闭期内，本基金所投资企业债和公司债信用评级需在 AA 级(含)以上。本基金不投资股票、权证等权益类资产。同时本基金不参与可转换债券投资(分离交易可转债的纯债部分除外)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：债券资产的比例不低于基金资产的 80%，但在封闭期结束前三个月和转开放后三个月内，基金投资不受上述债券资产投资比例限制。本基金在开放期内，现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金封闭期内投资的业绩比较基准为两年期银行定期存款税后收益率+1.25%。

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》、《交银施罗德丰硕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[1998]55号《关于证券投资基金税收问题的通知》、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[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，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

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 2017年6月30日
活期存款	1,844,588.76
定期存款	-
其他存款	-
合计	1,844,588.76

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日

		成本	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	90,985,844.59	88,344,800.00	-2,641,044.59
	银行间市场	472,501,518.64	469,056,436.00	-3,445,082.64
	合计	563,487,363.23	557,401,236.00	-6,086,127.23
资产支持证券		57,809,200.00	57,809,200.00	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		621,296,563.23	615,210,436.00	-6,086,127.23

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	642.44
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	2,249.20
应收债券利息	8,765,682.60
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	11,318.72
合计	8,779,892.96

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 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	12,363.67
合计	12,363.67

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	388,767.52
合计	388,767.52

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	438,630,665.79	438,630,665.79
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	438,630,665.79	438,630,665.79

注：1、本基金自2015年10月23日至2015年11月4日止期间公开发售，共募集有效净认购资金438,442,304.66元。根据《交银施罗德丰硕收益债券型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入188,361.13元在本基金成立后，折算为188,361.13份基金份额，划入基金份额持有人账户。

2、根据《交银施罗德丰硕收益债券型证券投资基金基金合同》及《交银施罗德丰硕收益债券型证券投资基金招募说明书》的相关规定，本基金于2015年11月9日(基金合同生效日)至2017年11月9日止期间暂不向投资人开放基金交易。

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	734,846.69	-13,506,377.69	-12,771,531.00
本期利润	399,724.58	7,420,250.46	7,819,975.04
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,134,571.27	-6,086,127.23	-4,951,555.96

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	27,514.28
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	78,806.02
其他	231.00
合计	106,551.30

6.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期内无股票投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	649,783,223.50
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	646,041,986.10
减：应收利息总额	9,038,892.11

买卖债券（债转股及债券到期兑付） 差价收入	-5,297,654.71
--------------------------	---------------

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

本基金本报告期内无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1.交易性金融资产	7,420,250.46
——股票投资	-
——债券投资	7,420,250.46
——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	7,420,250.46

6.4.7.18 其他收入

注：本基金本报告期内无其他收入。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日

交易所市场交易费用	952.32
银行间市场交易费用	4,280.00
合计	5,232.32

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	119,014.74
债券账户维护费	18,300.00
银行划款手续费	9,584.89
其他	300.00
合计	176,952.41

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
中信银行股份有限公司(“中信银行”)	基金托管人、基金销售机构
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	基金管理人的股东、基金销售机构

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 2017年1月1日至2017年 6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至 2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,701,931.91	1,758,685.82
其中：支付销售机构的客户维护费	864,004.63	892,924.68

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.8%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.8%÷当年天数。

6.4.10.2.2 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	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	319,112.20	329,753.53

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.15%÷当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各 关联方名称	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销售服务费
交通银行	199,954.58
中信银行	10,818.36
交银施罗德基金	2,512.19
合计	213,285.13
获得销售服务费的各	上年度可比期间

关联方名称	2016年1月1日至2016年6月30日	
	当期发生的基金应支付的销售服务费	
交通银行		206,646.95
中信银行		11,180.16
交银施罗德基金		2,596.32
合计		220,423.43

注：支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日 C 类基金份额对应的基金资产净值 0.6% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给交银施罗德基金公司，再由交银施罗德基金公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日基金销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额对应的资产净值} \times 0.6\% \div \text{当年天数}。$$

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 2017年1月1日至2017年6月 30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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
中信银行股份有限公司	1,844,588.76	27,514.28	698,803.70	53,237.90

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

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2017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

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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2017年6月30日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额150,197,974.88元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值 单价	数量（张）	期末估值总额
111791503	17 郑州银行 CD034	2017-07-05	96.70	200,000	19,340,000.00
111796025	17 包商银行 CD052	2017-07-05	97.77	325,000	31,775,250.00
011771013	17 中材国际 SCP001	2017-07-03	100.49	400,000	40,196,000.00
101663013	16 兵团二师 MTN001	2017-07-03	96.94	400,000	38,776,000.00
101652002	16 厦钨 MTN001	2017-07-03	98.22	200,000	19,644,000.00
041675002	16 张家经发 CP001	2017-07-03	100.36	24,000	2,408,640.00
合计				1,549,000	152,139,890.00

6.4.12.3.2 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 45,000,000.00 元，于 2017 年 7 月 1 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。

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

本基金是一只债券型基金，其风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金，属于证券投资基金中中等风险的品种。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行交易的国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、分离交易可转债的纯债、次级债、资产支持证券、短期融资券、中期票据、非公开发行公司债、债券回购、银行存款、货币市场工具等固定收益类资产和法律法规允许投资的其他金融工具。其中，封闭期内，本基金所投资企业债和公司债信用评级需在 AA 级（含）以上。本基金不投资股票、权证等权益类资产。同时本基金不参与可转换债券投资（分离交易可转债的纯债部分除外）。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以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益高于货币市场基金而低于平衡型基金，谋求稳定和可持续的绝对收益”的风险收益目标。

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同责任，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信银行，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。本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2017年6月30日	上年末 2016年12月31日
A-1	100,136,000.00	39,584,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	187,453,000.00	79,854,000.00
合计	287,589,000.00	119,438,000.00

注：未评级部分为企业超短期融资券和同业存单。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2017年6月30日	上年末 2016年12月31日
AAA	71,955,800.00	198,056,000.00
AAA 以下	255,665,636.00	442,571,794.00
未评级	-	-
合计	327,621,436.00	640,627,794.00

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证券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 2017 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 195,197,974.88 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同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，因此账面余额约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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，此外还持有银行存款、结算备付金、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 2017 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	1,844,588.76	-	-	-	1,844,588.76
结算备付金	4,998,289.18	-	-	-	4,998,289.18
存出保证金	31,860.87	-	-	-	31,860.87

交易性金融资产	357,808,000.00	257,402,436.00	-	-	615,210,436.00
应收利息	-	-	-	8,779,892.96	8,779,892.96
资产总计	364,682,738.81	257,402,436.00	-	8,779,892.96	630,865,067.77
负债					
卖出回购金融资产款	195,197,974.88	-	-	-	195,197,974.88
应付证券清算款	-	-	-	1,029,187.92	1,029,187.92
应付管理人报酬	-	-	-	282,689.41	282,689.41
应付托管费	-	-	-	53,004.27	53,004.27
应付销售服务费	-	-	-	212,017.05	212,017.05
应付交易费用	-	-	-	12,363.67	12,363.67
应付利息	-	-	-	9,953.22	9,953.22
其他负债	-	-	-	388,767.52	388,767.52
负债总计	195,197,974.88	-	-	1,987,983.06	197,185,957.94
利率敏感度缺口	169,484,763.93	257,402,436.00	-	6,791,909.90	433,679,109.83
上年度末 2016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	3,394,086.10	-	-	-	3,394,086.10
结算备付金	11,993,619.32	-	-	-	11,993,619.32
存出保证金	35,823.27	-	-	-	35,823.27
交易性金融资产	139,220,000.00	620,845,794.00	-	-	760,065,794.00
应收证券清算款	-	-	-	234,000.00	234,000.00
应收利息	-	-	-	11,213,751.95	11,213,751.95
资产总计	154,643,528.69	620,845,794.00	-	11,447,751.95	786,937,074.64
负债					
卖出回购金融资产款	359,999,650.00	-	-	-	359,999,650.00
应付管理人报酬	-	-	-	293,066.79	293,066.79
应付托管费	-	-	-	54,950.04	54,950.04
应付销售服务费	-	-	-	219,800.08	219,800.08
应付交易费用	-	-	-	9,873.44	9,873.44
应付利息	-	-	-	194,599.50	194,599.50

其他负债	-	-	-	306,000.00	306,000.00
负债总计	359,999,650.00	-	-	1,078,289.85	361,077,939.85
利率敏感度缺口	-205,356,121.31	620,845,794.00	-	10,369,462.10	425,859,134.79

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 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
	市场利率下降25个基点	增加约196	增加约341
	市场利率上升25个基点	减少约195	减少约338

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债券，因此无重大其他价格风险。

§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	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	615,210,436.00	97.52
	其中：债券	557,401,236.00	88.36
	资产支持证券	57,809,200.00	9.16
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	6,842,877.94	1.08
7	其他各项资产	8,811,753.83	1.40
8	合计	630,865,067.77	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

本基金本报告期末未持有股票。

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所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

本基金本报告期内未持有股票。

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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	90,588,236.00	20.89
5	企业短期融资券	150,363,000.00	34.67
6	中期票据	179,224,000.00	41.33
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	137,226,000.00	31.64
9	其他	-	-
10	合计	557,401,236.00	128.53

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	111710281	17 兴业银行 CD281	500,000	49,445,000.00	11.40
2	111796025	17 包商银行 CD052	500,000	48,885,000.00	11.27
3	101456074	14 豫高管 MTN001	400,000	40,612,000.00	9.36
4	011771013	17 中材国际 SCP001	400,000	40,196,000.00	9.27
5	041761004	17 晋经建 CP001	400,000	40,080,000.00	9.24

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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	142148	16 福碧桂园 A2	400,000	40,000,000.00	9.22
2	131684	汇金 1B	180,000	17,809,200.00	4.11

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	31,860.87
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,779,892.96
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,811,753.83

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

本基金本报告期末未持有股票。

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
2,244	195,468.21	80,043.20	0.02%	438,550,622.59	99.98%

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	58,012.69	0.01%

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	-
本基金基金经理持有本开放式基金	-

§9 重大事件揭示

9.1 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。

9.2 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。

9.3 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。

9.4 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。

9.5 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。

9.6 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。

9.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

9.7.1 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	
安信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国金证券股	2	-	-	-	-	-

份有限公司						
中泰证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-

9.7.2 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
安信证券股份 有限公司	348,013,597.92	100.00%	7,741,000,000.00	100.00%	-	-

注：1、报告期内，本基金新增加交易单元为中泰证券股份有限公司和国金证券股份有限公司，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。

9.8 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	交银施罗德丰硕收益债券型证券投资基金 2016 年第 4 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-01-19
2	交银施罗德丰硕收益债券型证券投资基金 2016 年年度报告摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-03-29
3	交银施罗德丰硕收益债券型证券投资基金 2017 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-04-24
4	交银施罗德基金管理有限公司关于增聘于海颖女士担任交银施罗德丰硕收益债券型证券投资基金基金经理的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-06-10
5	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德丰硕收益债券型证券投资基金基金经理变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-06-22
6	交银施罗德丰硕收益债券型证券投资基	中国证券报、上海证	2017-06-23

	金（更新）招募说明书摘要（2017 年第 1 号）	券报、证券时报	
--	---------------------------	---------	--

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予交银施罗德丰硕收益债券型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《交银施罗德丰硕收益债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《交银施罗德丰硕收益债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《交银施罗德丰硕收益债券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、关于申请募集注册交银施罗德丰硕收益债券型证券投资基金的法律意见书；
- 8、报告期内交银施罗德丰硕收益债券型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

10.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

10.3 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。