
**交银施罗德安心收益债券型证券投资基金
(交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金)**

2018 年第 2 季度报告

2018 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：中国民生银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年七月十八日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 7 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金保本周期期限三年，自交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金基金合同生效日（即 2015 年 5 月 29 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，即本基金第一个保本周期于 2018 年 5 月 29 日到期。交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金保本周期到期后，已按照《交银施罗德荣和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“交银施罗德安心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“519753”。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、申赎原则、收益分配及基金费率等按照《交银施罗德安心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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。其中，自 2018 年 5 月 29 日（含）起至 2018 年 6 月 1 日（含）止为交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金保本周期到期期间，并自 2018 年 6 月 2 日起，交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金正式转型为交银施罗德安心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 2018 年 4 月 1 日起至 2018 年 6 月 1 日止，基金转型后的报告期为 2018 年 6 月 2 日起至 2018 年 6 月 30 日。

§2 基金产品概况

2.1 交银施罗德安心收益债券型证券投资基金

基金简称	交银安心收益债券
基金主代码	519753
交易代码	519753
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年6月2日
报告期末基金份额总额	103,719,852.57份
投资目标	在严格控制投资风险和保持资产流动性的基础上，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势，将严谨、规范化的基本面研究分析与积极主动的投资风格相结合，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，动态调整债券、股票等大类资产比例。本基金以债券投资为核心，重点关注债券组合久期调整、期限结构配置及债券类属配置，并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，同时本基金也通过综合运用骑乘操作、套利操作等策略精选个券，提高投资组合收益。此外，在风险可控的前提下，本基金适度关注股票、权证市场的运行状况与相应风险收益特征，有效把握投资机会，适时增强组合收益。
业绩比较基准	中债综合全价指数
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。
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司

注：1、上表中“报告期末”指2018年6月30日。

2、本基金于2018年6月2日由交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金转型为交银施罗德安心收益债券型证券投资基金，新基金合同及托管协议即日起生效。

2.2 交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金

基金简称	交银荣和保本混合
基金主代码	519753
交易代码	519753
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年5月29日
报告期末基金份额总额	189,784,733.61份
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，通过运用投资组合保险技术，力争实现组合资产的稳定增值。
投资策略	本基金运用恒定比例组合保险（CPPI，Constant Proportion Portfolio Insurance）原理，动态调整稳健资产与风险资产在基金组合中的投资比例，以确保本基金在保本周期到期时的本金安全，并实现基金资产在保本基础上的保值增值目的。
业绩比较基准	三年期银行定期存款税后收益率
风险收益特征	本基金是一只保本混合型基金，在证券投资基金中属于低风险品种。
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司
基金保证人	中国投融资担保股份有限公司

注：上表中“报告期末”指2018年6月1日。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2018年6月2日-2018年 6月30日)	报告期 (2018年4月1日-2018年 6月1日)
1.本期已实现收益	110,154.77	-3,272,063.34
2.本期利润	109,995.25	4,489,802.89
3.加权平均基金份额本期利润	0.0009	0.0056
4.期末基金资产净值	105,552,588.47	192,954,419.53
5.期末基金份额净值	1.018	1.017

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、交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金从2018年6月2日起正式转型为交银施罗德安心收益债券型证券投资基金。

3.2 基金净值表现

3.2.1 交银施罗德安心收益债券型证券投资基金

（报告期：2018年6月2日-2018年6月30日）

3.2.1.1 本报告期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	净值增长率①	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
2018年6月2日-2018年6月30日	0.10%	0.08%	0.37%	0.06%	-0.27%	0.02%

注：交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金从2018年6月2日起正式转型为交银施罗德安

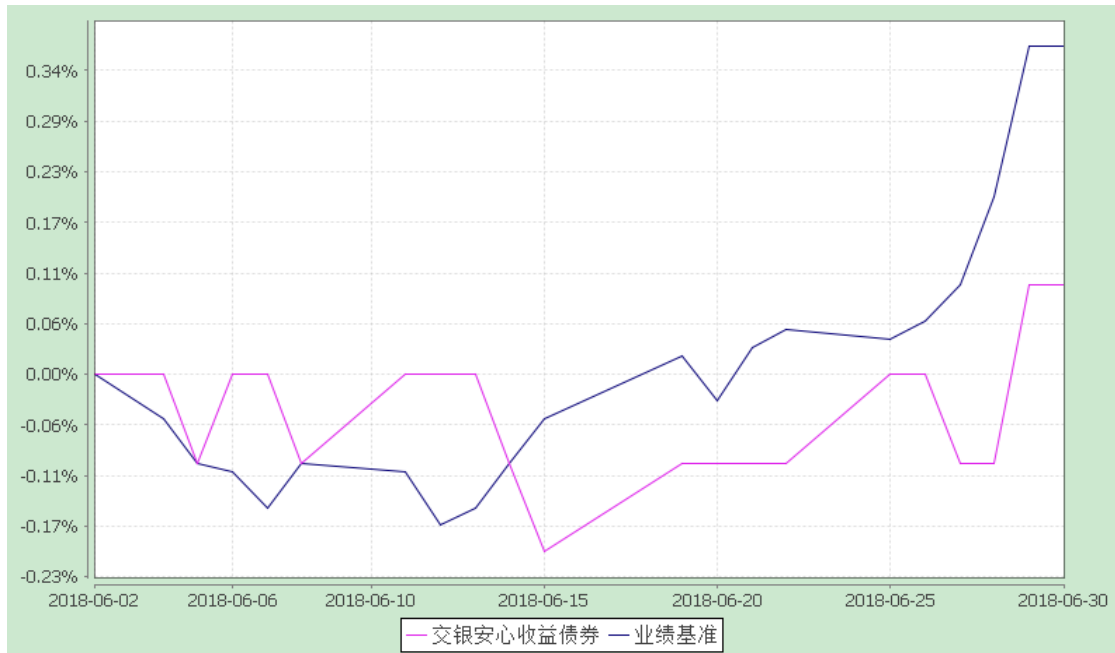
心收益债券型证券投资基金，本表列示的是本报告期基金转型后的基金净值表现，转型后基金的业绩比较基准为中债综合全价指数。

3.2.1.2 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

交银施罗德安心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

(2018年6月2日-2018年6月30日)



注：本基金由交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金转型而来。本基金转型日为2018年6月2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和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2018年6月2日）起的3个月。截止2018年6月30日，本基金尚处于投资转型期。

3.2.2 交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金

(报告期：2018年4月1日-2018年6月1日)

3.2.2.1 本报告期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

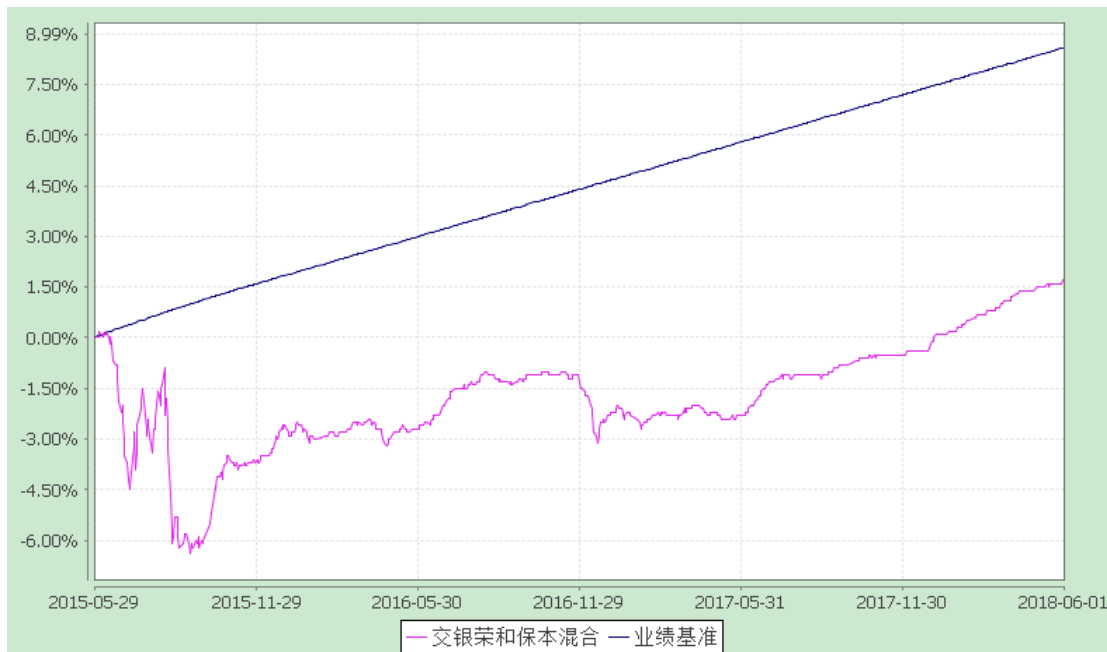
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④

				④		
2018年4月1日-2018年6月1日	0.59%	0.04%	0.47%	0.01%	0.12%	0.03%

注：交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金从2018年6月2日起正式转型为交银施罗德安心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

交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2015年5月29日-2018年6月1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 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年	说明
----	----	-------------	-------	----

		任职日期	离任日期	限	
王少成	交银成长混合、交银策略回报灵活配置混合、交银成长30混合、交银荣和保本的基金经理，公司权益投资总监	2015-11-07	2018-05-16	14年	王少成先生，复旦大学硕士学历。历任上海融昌资产管理公司研究员，中原证券投资经理，信诚基金管理有限公司研究总监助理，东吴基金管理有限公司投资经理、基金经理、投资部副总经理。其中2010年9月至2012年10月担任东吴创新创业股票型证券投资基金基金经理，2011年2月至2012年11月担任东吴中证新兴产业指数证券投资基金基金经理，2011年5月至2012年11月担任东吴价值成长双动力股票型证券投资基金基金经理。2012年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任公司权益部副总经理。2013年3月21日至2015年8月14日担任交银施罗德先进制造混合型证券投资基金（原交银施罗德先进制造股票证券投资基金）基金经理，2013年5月29日至2015年8月14日担任交银施罗德先锋混合型证券投资基金（原交银施罗德先锋股票证券投资基金）基金经理，2015年11月7日至2018年5月15日担任交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金的基金经理，2015年11月7日至2018年6月7日担任交银施罗德策略回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
唐贇	交银信用添利债券	2015-11-07	-	6年	唐贇先生，香港城市大学电子工程硕士。历任渣打银行环球企业部助理客户

	(LOF)、交银双利债券、交银双轮动债券、交银裕通纯债债券、交银安心收益债券的基金经理				经理、平安资产管理公司信用分析员。2012年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任固定收益研究员、基金经理助理。 2015年11月7日至2018年6月1日担任转型前的交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金的基金经理。
--	---------------------------------------------	--	--	--	---------------------------------------------------------------------------------------------------------------

注：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

在报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，基金投资管理符合有关法律法规和基金合同的规定，为基金持有人谋求最大利益。

4.3 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度以来在意外降准、表外融资持续收缩、经济通胀趋弱、贸易战局势反复发酵等多方面因素交织的背景下，债券收益率呈现出先下后上继而再次大幅下行的宽幅波动中。四月上旬债券收益率延续了一季度以来的下行趋势，稳步下行。央行在四月宣布降准1个百分点置换MLF操作，债券市场在反复预期中终于确认货币政策已经实质性转松，债市强势上涨，收益率大幅下行。四月下旬开始由于降准释放资金和缴税缴准错位，季末流动性紧张，叠加资管新规的出台，收益率震荡上行。进入六月后随着最新社会融资规模数据公布，信用收紧格局下收益率重回下行通道。六月底央行再一次降准0.5个百分点，收益率再次开启大幅下行空间。

报告期内，本基金转型为二级债券基金。基于对收益率下行大趋势的判断，本基金债券部分维持了较高的久期配置。同时，基于对权益市场较为谨慎的看法，组合控制整体权益仓位配置，选择个别具有防御性板块个股进行波段操作作为组合增强收益。

展望三季度，我们判断债市收益率下行的趋势不改。经济基本面仍面临一定的下行压力，一方面体现在融资环境收缩对地产和基建投资的挤压上，另一方面表现为中美贸易摩擦升级对出口的负面影响上。随着去杠杆政策的持续推进，为了避免信用风险发酵带来流动性危机和经济失速下滑，我们预计货币政策将保持较为宽松态势，宽货币紧信用大逻辑继续支持债券市场收益率下行。风险方面，我们关注监管政策落地带来的短期调整风险和不断压缩的中美利差可能阶段性地成为制约债市收益率下行的因素。整体而言，我们认为债券市场上涨的机会大于下跌的风险。随着去杠杆进程的推进，信用风险逐渐暴露，我们认为低等级信用债利差未能充分反应未来的信用风险，我们将继续规避中低评级信用债，

以中高等级的信用债为底仓，保持中性偏高久期债券配置。

可转债方面，权益市场表现低迷，三季度我们认为转债缺乏系统性的机会，我们将在控制转债仓位的前提下，关注新兴行业转债个券，灵活操作尽力为组合增强收益。

权益市场方面，我们对三季度权益类资产持谨慎态度，关注风格是否持续，计划权益类资产将继续保持中性仓位，在尽力控制回撤的前提下争取增强组合的收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2018 年 6 月 30 日，交银施罗德安心收益债券型证券投资基金份额净值为 1.018 元，自 2018 年 6 月 2 日至 2018 年 6 月 30 日其份额净值增长率为 0.10%，同期业绩比较基准增长率为 0.37%。

截至 2018 年 6 月 1 日，交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金份额净值为 1.017 元，自 2018 年 4 月 1 日至 2018 年 6 月 1 日其份额净值增长率为 0.59%，同期业绩比较基准增长率为 0.47%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内无需预警说明。

§5 投资组合报告

5.1 交银施罗德安心收益债券型证券投资基金

（报告期：2018年6月2日-2018年6月30日）

5.1.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	4,476,010.80	3.48
	其中：股票	4,476,010.80	3.48
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	75,456,300.00	58.64
	其中：债券	75,456,300.00	58.64
	资产支持证券	-	-

4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	20,000,000.00	15.54
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	9,795,528.20	7.61
7	其他各项资产	18,948,663.23	14.73
8	合计	128,676,502.23	100.00

5.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.1.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,434,910.80	2.31
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	1,180,100.00	1.12
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	-	-

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	861,000.00	0.82
S	综合	-	-
	合计	4,476,010.80	4.24

5.1.2.2 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。

5.1.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300595	欧普康视	24,940	1,117,810.80	1.06
2	000681	视觉中国	30,000	861,000.00	0.82
3	600315	上海家化	20,000	792,600.00	0.75
4	300036	超图软件	30,000	611,700.00	0.58
5	300170	汉得信息	35,000	568,400.00	0.54
6	300401	花园生物	25,000	524,500.00	0.50

5.1.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	6,022,800.00	5.71
	其中：政策性金融债	6,022,800.00	5.71
4	企业债券	24,973,000.00	23.66
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	44,460,500.00	42.12
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	75,456,300.00	71.49
----	----	---------------	-------

5.1.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	122789	11 象屿债	100,000	10,004,000.00	9.48
2	018005	国开 1701	60,000	6,022,800.00	5.71
3	101772012	17 海淀国资 MTN002	50,000	5,037,000.00	4.77
4	143538	18 陆债 01	50,000	5,033,500.00	4.77
5	101800696	18 闽投 MTN002	50,000	5,019,500.00	4.76

5.1.6 报告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。

5.1.7 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。

5.1.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.1.9 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。

5.1.10 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。

5.1.11 投资组合报告附注

5.1.11.1 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。

5.1.11.2 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。

5.1.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	5,522.05
2	应收证券清算款	17,402,484.54
3	应收股利	-

4	应收利息	1,540,626.66
5	应收申购款	29.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,948,663.23

5.1.11.4 报告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。

5.1.11.5 报告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。

5.1.11.6 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。

5.2 交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金

(报告期：2018年4月1日-2018年6月1日)

5.2.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	180,958,000.00	64.50
	其中：债券	180,958,000.00	64.50
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-

	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	82,808,721.39	29.52
7	其他各项资产	16,770,710.96	5.98
8	合计	280,537,432.35	100.00

5.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.1 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。

5.2.2.2 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。

5.2.3 报告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。

5.2.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	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	49,920,000.00	25.87
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	131,038,000.00	67.91
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	180,958,000.00	93.78

5.2.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资
----	------	------	-------	---------	------

					产净值比例(%)
1	101551051	15 中航控 MTN001	400,000	40,272,000.00	20.87
2	101356002	13 渝富 MTN001	200,000	20,216,000.00	10.48
3	1382301	13 洪市政 MTN1	200,000	20,206,000.00	10.47
4	101555012	15 杭实投 MTN001	200,000	20,148,000.00	10.44
5	101561015	15 京技投 MTN001	200,000	20,126,000.00	10.43

5.2.6 报告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。

5.2.7 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。

5.2.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.2.9 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。

5.2.10 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。

5.2.11 投资组合报告附注

5.2.11.1 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。

5.2.11.2 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。

5.2.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	8,489.60
2	应收证券清算款	11,000,000.00
3	应收股利	-

4	应收利息	5,762,221.36
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,770,710.96

5.2.11.4 报告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。

5.2.11.5 报告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。

5.2.11.6 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。

§6 基金中基金

6.1 交银施罗德安心收益债券型证券投资基金

(报告期: 2018年6月2日-2018年6月30日)

6.1.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

6.1.2 当期交易及持有基金产生的费用

本基金本报告期内未交易或持有基金。

6.1.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

6.2 交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金

(报告期: 2018年4月1日-2018年6月1日)

6.2.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

6.2.2 当期交易及持有基金产生的费用

本基金本报告期内未交易或持有基金。

6.2.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

§7 开放式基金份额变动

7.1 交银施罗德安心收益债券型证券投资基金

单位: 份

本报告期期初基金份额总额	189,784,733.61
报告期期间基金总申购份额	26,889.86
减: 报告期期间基金总赎回份额	86,091,770.90
报告期期间基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	103,719,852.57

注: 1、上表中“报告期”指2018年6月2日至2018年6月30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。

7.2 交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金

单位：份

本报告期初基金份额总额	853,727,865.82
报告期期间基金总申购份额	51,231.80
减：报告期期间基金总赎回份额	663,994,364.01
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	189,784,733.61

注：1、上表中“报告期”指2018年4月1日至2018年6月1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。

§8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

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。

8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

8.2.1 交银施罗德安心收益债券型证券投资基金

本基金管理人本报告期内未进行本基金的申购、赎回、红利再投等。

8.2.2 交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金

本基金管理人本报告期内未进行本基金的申购、赎回、红利再投等。

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 影响投资者决策的其他重要信息

交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金保本周期期限三年，自交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金基金合同生效日（即2015年5月29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，本基金第一个保本周期于

2018年5月29日到期。交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金保本周期到期后，已按照《交银施罗德荣和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“交银施罗德安心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“519753”。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、申赎原则、收益分配及基金费率等按照《交银施罗德安心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。

交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金保本周期到期安排及交银施罗德安心收益债券型证券投资基金转型后运作相关业务规则详情请查阅本基金管理人于2018年5月22日发布的《交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金保本周期到期安排及转型为交银施罗德安心收益债券型证券投资基金后运作相关业务规则的公告》及刊登在2018年5月22日《中国证券报》、2018年5月23日《上海证券报》和2018年5月24日《证券时报》上的交银施罗德安心收益债券型证券投资基金的《基金合同摘要》、《招募说明书》等。投资者亦可通过本基金管理人网站或相关销售机构查阅交银施罗德安心收益债券型证券投资基金的相关基金法律文件。

§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荣和保本混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《交银施罗德安心收益债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《交银施罗德安心收益债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《交银施罗德安心收益债券型证券投资基金托管协议》；
- 5、《交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金基金合同》；
- 6、《交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金招募说明书》；
- 7、《交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金托管协议》；
- 8、《交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金保证合同》；
- 9、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 10、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 11、关于申请募集注册交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金的法律意见书；

12、关于修改《交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金基金合同》的法律意见书

13、报告期内交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金、交银施罗德安心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)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

交银施罗德基金管理有限公司

二〇一八年七月十八日