

交银施罗德安心收益债券型证券投资基金
(原交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金转型)
2018 年半年度报告摘要
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：二〇一八年八月二十五日

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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年8月24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1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1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 基金简介

2.1 基金基本情况

2.1.1 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
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
报告期末基金份额总额	103,719,852.57份
基金合同存续期	不定期

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。

2.1.2 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
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
报告期末基金份额总额	189,784,733.61份
基金合同存续期	不定期

注：上表中“报告期末”指 2018 年 6 月 1 日。

2.2 基金产品说明

2.2.1 交银施罗德安心收益债券型证券投资基金

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。

2.2.2 交银施罗德荣和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。

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	中国民生银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王晚婷	罗菲菲
	联系电话	(021) 61055050	010-58560666
	电子邮箱	xxpl@jysld.com, disclosure@jysld.com	tgbfxjdzx@cmbc.com.cn
客户服务电话		400-700-5000, 021-61055000	95568
传真		(021) 61055054	010-58560798

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
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 交银施罗德安心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(2018年6月2日至2018年6月30日)
本期已实现收益	110,154.77
本期利润	109,995.25
加权平均基金份额本期利润	0.0009
本期基金份额净值增长率	0.10%
3.1.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.002
期末基金资产净值	105,552,588.47
期末基金份额净值	1.018

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。截至本报告期末(2018年6月30日)，交银施罗德安心收益债券型证券投资基金转型时间未满半年。

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
自基金转型生效起至今	0.10%	0.08%	0.37%	0.06%	-0.27%	0.02%

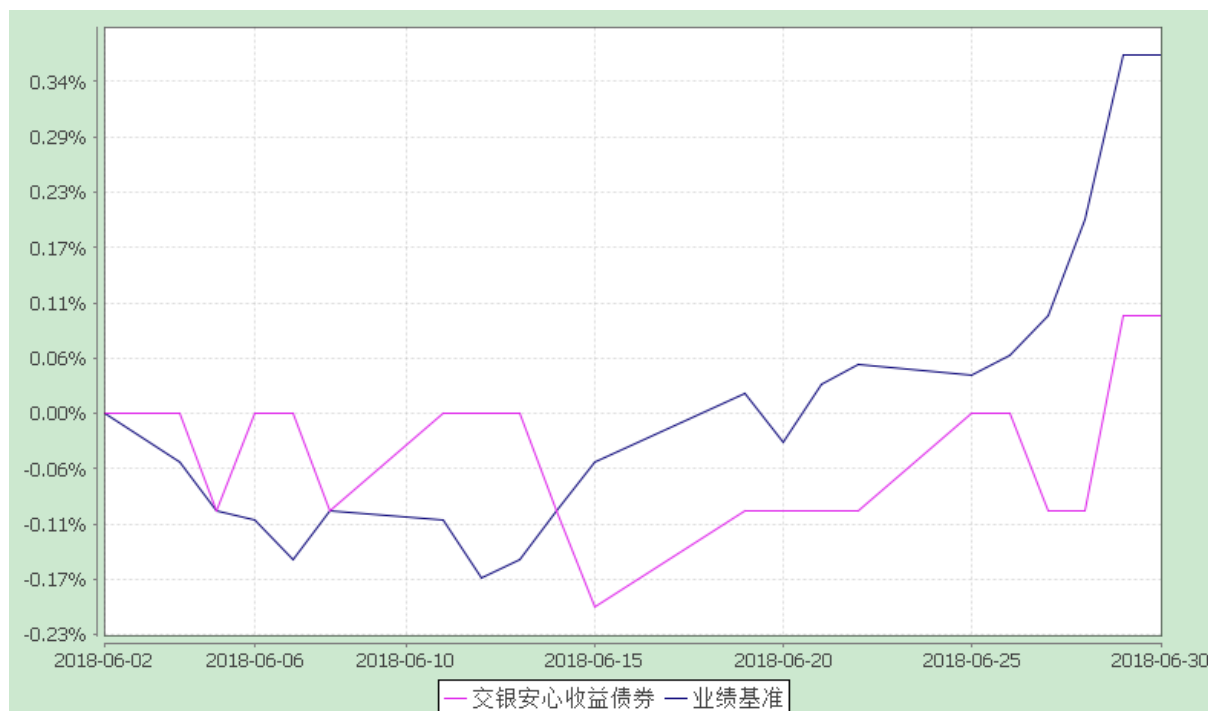
注：交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金从2018年6月2日起正式转型为交银施罗德安心收益债券型证券投资基金，本表列示的是本报告期基金转型后的基金净值表现，转型后基金的业绩比较基准为中债综合全价指数。

3.1.2.2 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日至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 交银施罗德荣和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(2018年1月1日至2018年6月1日)
本期已实现收益	162,699.78
本期利润	17,117,606.41
加权平均基金份额本期利润	0.0202
本期基金份额净值增长率	2.01%
3.2.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月1日)
期末可供分配基金份额利润	0.001
期末基金资产净值	192,954,419.53
期末基金份额净值	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。

3.2.2 基金净值表现

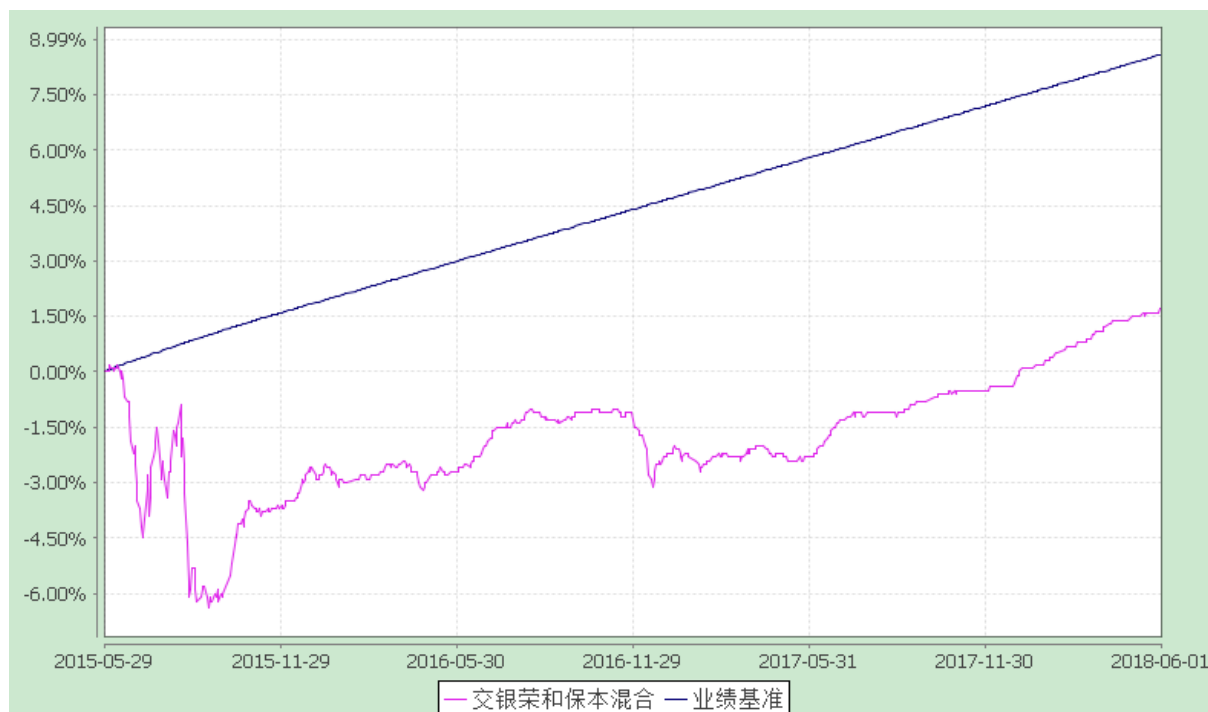
3.2.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
2018年6月1日至2018年6月1日	0.00%	0.00%	0.01%	0.00%	-0.01%	0.00%
2018年4月1日至2018年6月1日	0.59%	0.04%	0.47%	0.01%	0.12%	0.03%
2018年1月1日至2018年6月1日	2.01%	0.04%	1.16%	0.01%	0.85%	0.03%
2017年7月1日至2018年6月1日	3.14%	0.04%	2.57%	0.01%	0.57%	0.03%
2015年7月1日至2018年6月1日	3.78%	0.17%	8.27%	0.01%	-4.49%	0.16%
自基金合同生效起至2018年6月1日	1.70%	0.17%	8.59%	0.01%	-6.89%	0.16%

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 日至 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 81 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		
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(LOF)、	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经理、

	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				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。
--	---------------------------------------	--	--	--	--

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本公司制定了严格的投资控制制度和公平交易监控制度来保证旗下基金运作的公平，旗下所管理的所有资产组合，包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均严格遵循制度进行公平交易。

公司建立资源共享的投资研究信息平台，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。公司在交易执行环节实行集中交易制度，建立公平的交易分配制度。对于交易所公开竞价交易，遵循“时间优先、价格优先、比例分配”的原则，全部通过交易系统进行比例分配；对于非集中竞价交易、以公司名义进行的场外交易，遵循“价格优先、比例分配”的原则按事前独立确定的投资方案对交易结果进行分配。

公司中央交易室和风险管理部进行日常投资交易行为监控，风险管理部负责对各账户公平交易进行事后分析，于每季度和每年度分别对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析，通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内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说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年以来经济呈现出明显的“宽货币、紧信用”格局，推动债券收益率明显下行。年初以来央行连续两次降准，资金维持宽松，货币政策转向得到确认。随着资管新规落地，去杠杆进程从金融去杠杆转向实体去杠杆，表外融资压缩，更多的融资转向表内，但表内信贷受制于额度和银行资本金的约束，使得整体的社会信用收缩。经济的“宽货币”叠加“紧信用”的组合，对债市形成支撑。上半年预期之外的因素在于贸易格局的恶化，贸易战的持续发酵，引发市场对于全球和中国经济的进一步担忧，成为推动收益率下行的重要助攻。

报告期内，本基金转型为二级债券基金。本基金的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。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金（各类）份额转型后净值及业绩表现请见“3.1.1 主要财务指标”及“3.1.2.1 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”部分披露。

本基金（各类）份额转型前净值及业绩表现请见“3.2.1 主要财务指标”及“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”部分披露。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们判断债市可能在波折中缓慢下行。货币政策偏宽松的基调在短期内不会发生改变，尤其是在去杠杆进程深入推进，经济下行风险不确定的情况下，我们认为货币政策仍将保持较为宽松的基调。社会信用紧缩引起的信用风险事件频发已经引起各方面的重视，我们认为信用的扩张需要企业经济效益改善或经济主体进一步加杠杆，但目前我们认为二者的空间较为有限，信用重新扩张道阻且长。政策组合上，财政政策空间有限，货币政策虽然宽松但对货币供给施加的影响较为有限，“紧信用”格局的化解尚需时间。在上半年收益率已经大幅下行的情况下，我们认为收益率仍将缓慢下行。我们关注资管新规实施过程中细则的落地及审慎评判经济环境。同时我们也关注贸易格局的进展和全球经济走势的推进。

下半年操作上我们或将保持当前中性偏高的组合久期，计划以中高等级的信用债为底仓，择机进行利率债的波段操作，以期增强组合收益。权益市场方面，我们对下半年权益类资产持谨慎乐观

态度,关注风格是否持续,权益类资产或将继续保持中性仓位上下,在力求控制回撤的前提下争取增强组合的收益。

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

交银施罗德安心收益债券型证券投资基金自2018年6月2日至2018年6月30日未进行利润分配。

交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金自2018年1月1日至2018年6月1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

本报告期内,中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定,依法安全保管了基金财产,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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金的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，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、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 交银施罗德安心收益债券型证券投资基金

6.1.1 资产负债表

会计主体：交银施罗德安心收益债券型证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日
资 产：		
银行存款	6.1.4.7.1	6,084,947.77
结算备付金		3,710,580.43
存出保证金		5,522.05
交易性金融资产	6.1.4.7.2	79,932,310.80
其中：股票投资		4,476,010.80
基金投资		-
债券投资		75,456,300.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.1.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.1.4.7.4	20,000,000.00
应收证券清算款		17,402,484.54
应收利息	6.1.4.7.5	1,540,626.66

应收股利		-
应收申购款		29.98
递延所得税资产		-
其他资产	6.1.4.7.6	-
资产总计		128,676,502.23
负债和所有者权益		本期末 2018年6月30日
负 债:		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.1.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		22,497,679.48
应付赎回款		316,519.49
应付管理人报酬		67,108.10
应付托管费		19,173.74
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.1.4.7.7	45,522.69
应交税费		16,744.04
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.1.4.7.8	161,166.22
负债合计		23,123,913.76
所有者权益:		
实收基金	6.1.4.7.9	103,719,852.57
未分配利润	6.1.4.7.10	1,832,735.90
所有者权益合计		105,552,588.47
负债和所有者权益总计		128,676,502.23

注：1、报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.018 元，基金份额总额 103,719,852.57 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2018 年 6 月 2 日(转型生效日)至 2018 年 6 月 30 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。

6.1.2 利润表

会计主体：交银施罗德安心收益债券型证券投资基金

本报告期：2018年6月2日（转型生效日）至2018年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018年6月2日（转型生效日）至 2018年6月30日
一、收入		258,746.87
1.利息收入		712,394.91
其中：存款利息收入	6.1.4.7.11	22,713.15
债券利息收入		597,418.72
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		92,263.04
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-453,569.58
其中：股票投资收益	6.1.4.7.12	-418,941.66
基金投资收益		-
债券投资收益	6.1.4.7.13	-34,627.92
资产支持证券投资收益	6.1.4.7.14	-
贵金属投资收益	6.1.4.7.15	-
衍生工具收益	6.1.4.7.16	-
股利收益	6.1.4.7.17	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.1.4.7.18	-159.52
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.1.4.7.19	81.06
减：二、费用		148,751.62
1. 管理人报酬		67,108.10
2. 托管费		19,173.74
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.1.4.7.20	31,658.41
5. 利息支出		2,039.31
其中：卖出回购金融资产支出		2,039.31
6. 税金及附加		1,739.18
7. 其他费用	6.1.4.7.21	27,032.88
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		109,995.25
减：所得税费用		-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		109,995.25
-------------------	--	------------

6.1.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：交银施罗德安心收益债券型证券投资基金

本报告期：2018年6月2日（转型生效日）至2018年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2018年6月2日（转型生效日）至2018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）	189,784,733.61	3,169,685.92	192,954,419.53
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数（本 期利润）	-	109,995.25	109,995.25
三、本期基金份额交易 产生的基金净值变动数 （净值减少以“-”号填列）	-86,064,881.04	-1,446,945.27	-87,511,826.31
其中：1.基金申购款	26,889.86	447.91	27,337.77
2.基金赎回款	-86,091,770.90	-1,447,393.18	-87,539,164.08
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）	103,719,852.57	1,832,735.90	105,552,588.47

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1.1 至 6.1.4，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

6.1.4 报表附注

6.1.4.1 基金基本情况

交银施罗德安心收益债券型证券投资基金是由原交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金(以下简称“交银施罗德荣和保本基金”)转型而来。交银施罗德荣和保本混合型证券投资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]879号文《关于准予交银施罗德荣和保本

混合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《交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。交银施罗德荣和保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1,971,015,696.61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637号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金基金合同》于2015年5月29日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为1,971,186,670.30份基金份额，其中认购资金利息折合170,973.69份基金份额。

根据原《交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金基金合同》的有关约定，交银施罗德荣和保本基金的保本周期为三年。交银施罗德荣和保本基金第一个保本周期自交银施罗德荣和保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。交银施罗德荣和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，交银施罗德荣和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“交银施罗德安心收益债券型证券投资基金”。

根据《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》，交银施罗德荣和保本基金保本周期到期因未能符合保本基金存续条件，自2018年6月2日起转型为交银施罗德安心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《交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金基金合同》失效，《交银施罗德安心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。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，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德安心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、短期融资券、中期票据、可转换债券及可分离转债、次级债、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具等固定收益类品种，和股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证等权益类品种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(但须符合中国证监会相关规定)。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：债券、货币市场工具等稳健资产占基金资产的比例不低于60%，其中基金应保留不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券；股票、权证、股指期货等风险资产占基金资产的比例不高于40%，其中，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%。本

基金的业绩比较基准为三年期银行定期存款税后收益率。

6.1.4.2 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》、《交银施罗德安心收益债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.1.4.4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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.1.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018年6月2日(转型生效日)至2018年6月30日止期间的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2018年6月30日的财务状况以及2018年6月2日(转型生效日)至2018年6月30日止期间的的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.1.4.4 重要会计政策和会计估计

6.1.4.4.1 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2018年6月2日(转型生效日)至2018年6月30日止期间。

6.1.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.1.4.4.3 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。

6.1.4.4.4 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。

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。

6.1.4.4.5 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 and 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；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不

应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.1.4.4.6 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。

6.1.4.4.7 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。

6.1.4.4.8 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)。

6.1.4.4.9 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；于处置时，其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。

6.1.4.4.10 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。

6.1.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。保本周期内本基金仅采取现金分红一种收益分配方式。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。

6.1.4.4.12 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，不需要披露分部信息。

6.1.4.4.13 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股票投资和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) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)于2017年11月15日前对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会会计字[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》之

附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。自2017年11月15日起，对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)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)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的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所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.1.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.1.4.5.1 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。

6.1.4.5.2 会计估计变更的说明

根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》，对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，本基金自2017年11月15日起改为按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。该估值技术变更对本基金无影响。

6.1.4.5.3 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。

6.1.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.1.4.7 关联方关系

6.1.4.7.1 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。

6.1.4.7.2 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
中国民生银行股份有限公司（“中国民生银行”）	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。

6.1.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.1.4.8.1 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。

6.1.4.8.2 关联方报酬

6.1.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年6月2日（转型生效日）至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	67,108.10
其中：支付销售机构的客户维护费	30,021.71

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：

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

6.1.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2018年6月2日（转型生效日）至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	19,173.74

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：

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

6.1.4.8.2.3 销售服务费

无。

6.1.4.8.2.4 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

6.1.4.8.3 各关联方投资本基金的情况

6.1.4.8.3.1 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。

6.1.4.8.3.2 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。

6.1.4.8.4 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 2018年6月2日（转型生效日）至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国民生银行股份有限公司	6,084,947.77	17,732.66

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。

6.1.4.8.5 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。

6.1.4.8.6 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。

6.1.4.9 期末（2018年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.1.4.9.1 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。

6.1.4.9.2 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。

6.1.4.9.3 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。

6.2 交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金

6.2.1 资产负债表

会计主体：交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金

报告截止日：2018年6月1日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018年6月1日	上年度末 2017年12月31日
资产：			
银行存款	6.2.4.7.1	77,643,678.95	2,055,241.91
结算备付金		5,165,042.44	7,090,011.85
存出保证金		8,489.60	21,506.79
交易性金融资产	6.2.4.7.2	180,958,000.00	1,313,976,317.80
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		180,958,000.00	1,313,976,317.80
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.2.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.2.4.7.4	-	-
应收证券清算款		11,000,000.00	427,987.94
应收利息	6.2.4.7.5	5,762,221.36	31,403,407.68
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.2.4.7.6	-	-
资产总计		280,537,432.35	1,354,974,473.97
负债和所有者权益		本期末 2018年6月1日	上年度末 2017年12月31日
负债：			
短期借款		-	-

交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.2.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		11,000,000.00	435,053,740.00
应付证券清算款		-	90,656.41
应付赎回款		75,309,689.47	1,499,069.00
应付管理人报酬		787,272.32	954,774.48
应付托管费		131,212.04	159,129.10
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.2.4.7.7	23,309.92	49,205.32
应交税费		196,185.23	-
应付利息		-	143,232.82
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.2.4.7.8	135,343.84	331,305.01
负债合计		87,583,012.82	438,281,112.14
所有者权益：		-	-
实收基金	6.2.4.7.9	189,784,733.61	919,800,730.97
未分配利润	6.2.4.7.10	3,169,685.92	-3,107,369.14
所有者权益合计		192,954,419.53	916,693,361.83
负债和所有者权益总计		280,537,432.35	1,354,974,473.97

注：1、报告截止日 2018 年 6 月 1 日(基金合同失效前日)，基金份额净值 1.017 元，基金份额总额 189,784,733.61 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 1 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。

6.2.2 利润表

会计主体：交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 1 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 1 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入	-	26,917,912.27	31,278,574.72
1.利息收入	-	24,341,933.16	47,230,942.81
其中：存款利息收入	6.2.4.7.11	74,729.46	132,362.63

债券利息收入	-	24,119,434.08	47,098,580.18
资产支持证券利息收入	-	-	-
买入返售金融资产收入	-	147,769.62	-
其他利息收入	-	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-	-14,380,391.06	-12,690,538.34
其中：股票投资收益	6.2.4.7.12	-	-1,556,220.10
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.2.4.7.13	-14,380,391.06	-11,134,318.24
资产支持证券投资收益	6.2.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.2.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.2.4.7.16	-	-
股利收益	6.2.4.7.17	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.2.4.7.18	16,954,906.63	-3,406,370.48
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.2.4.7.19	1,463.54	144,540.73
减：二、费用	-	9,800,305.86	19,882,992.00
1. 管理人报酬	-	4,247,496.60	7,979,234.01
2. 托管费	-	707,916.11	1,329,872.30
3. 销售服务费	-	-	-
4. 交易费用	6.2.4.7.20	6,612.09	72,494.18
5. 利息支出	-	4,602,023.73	10,284,914.60
其中：卖出回购金融资产支出	-	4,602,023.73	10,284,914.60
6. 税金及附加	-	75,211.47	-
7. 其他费用	6.2.4.7.21	161,045.86	216,476.91
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-	17,117,606.41	11,395,582.72
减：所得税费用	-	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-	17,117,606.41	11,395,582.72

6.2.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金

本报告期：2018年1月1日至2018年6月1日

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月1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)	919,800,730.97	-3,107,369.14	916,693,361.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	17,117,606.41	17,117,606.41
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)	-730,015,997.36	-10,840,551.35	-740,856,548.71
其中：1.基金申购款	206,049.77	1,793.44	207,843.21
2.基金赎回款	-730,222,047.13	-10,842,344.79	-741,064,391.92
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)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	189,784,733.61	3,169,685.92	192,954,419.53
项目	上年度可比期间 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)	1,519,102,047.86	-35,276,816.33	1,483,825,231.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	11,395,582.72	11,395,582.72
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)	-331,997,554.79	7,301,809.78	-324,695,745.01
其中：1.基金申购款	85,360.47	-1,915.73	83,444.74
2.基金赎回款	-332,082,915.26	7,303,725.51	-324,779,189.75
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)	1,187,104,493.07	-16,579,423.83	1,170,525,069.24
---------------------	------------------	----------------	------------------

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.2.1 至 6.2.4，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

6.2.4 报表附注

6.2.4.1 基金基本情况

交银施罗德荣和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[2015]879 号文《关于准予交银施罗德荣和保本混合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《交银施罗德荣和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 1,971,015,696.61 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 637 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 5 月 29 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,971,186,670.30 份基金份额，其中认购资金利息折合 170,973.69 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，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

根据《交银施罗德荣和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。交银施罗德荣和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，交银施罗德荣和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“交银施罗德安心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《交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金基金合同》及《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》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 2018 年 6 月 2 日起转型为交银施罗德安心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《交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金基金合同》失效，《交银施罗德安心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《交银施罗德荣和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，包括国内依法发行上市的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、中期票据、货币市场工具、银行存款、权证、资产支持证券、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(但须符合中国证监会相关规定)。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。本基金的基金资产包括稳健资产和风险资产，稳健资产为国内依法发行交易的债券、货币市场工具和银行存款等，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。基金的投资组合比例为：债券、货币市场工具等稳健资产占基金资产的比例不低于 60%，其中基金应保留不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券；股票、权证、股指期货等风险资产占基金资产的比例不高于 40%，其中，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%。本基金的业绩比较基准为三年期银行定期存款税后收益率。

6.2.4.2 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》、《交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.2.4.4 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 2018 年 6 月 2 日转型为交银施罗德安心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。

6.2.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 1 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 2018 年 6 月 1 日(基金合同失效前日)的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 1 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。

6.2.4.4 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。

6.2.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.2.4.5.1 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。

6.2.4.5.2 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。

6.2.4.5.3 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。

6.2.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以

2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.2.4.7 关联方关系

6.2.4.7.1 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。

6.2.4.7.2 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
中国民生银行股份有限公司(“中国民生银行”)	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。

6.2.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.2.4.8.1 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。

6.2.4.8.2 关联方报酬

6.2.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月	上年度可比期间 2017年1月1日至

	1日	2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,247,496.60	7,979,234.01
其中：支付销售机构的客户维护费	1,937,757.51	3,743,320.54

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.2%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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.2\% \div \text{当年天数}。$$

6.2.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年6月1日	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	707,916.11	1,329,872.30

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.2%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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.2\% \div \text{当年天数}。$$

无。

6.2.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期						
2018年1月1日至2018年6月1日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国民生银行股份有限公司	-	52,018,902.05	-	-	580,645,000.00	80,593.93
上年度可比期间						
2017年1月1日至2017年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-

6.2.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.2.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用自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自有资金投资本基金的情况。

6.2.4.8.4.2 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。

6.2.4.8.5 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 2018年1月1日至2018年6月1日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国民生银行股份有限公司	77,643,678.95	30,931.25	999,457.83	37,997.04

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。

6.2.4.8.6 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。

6.2.4.8.7 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。

6.2.4.9 期末（2018年6月1日）本基金持有的流通受限证券

6.2.4.9.1 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。

6.2.4.9.2 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。

6.2.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.2.4.9.3.1 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。

6.2.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2018年6月1日止，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11,000,000.00元，于2018年6月4日（先后）到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，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 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)

7.1.1 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	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
8	其他各项资产	18,948,663.23	14.73
9	合计	128,676,502.23	100.00

7.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.1.2.1 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	-	-
T	合计	4,476,010.80	4.24

7.1.2.2 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。

7.1.3 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

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	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

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年度报告正文。

7.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.1.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例（%）
1	600779	水井坊	2,643,070.20	2.50
2	300347	泰格医药	1,703,010.00	1.61
3	002234	民和股份	1,460,926.00	1.38

4	300595	欧普康视	1,097,230.00	1.04
5	000681	视觉中国	861,300.00	0.82
6	600315	上海家化	793,319.00	0.75
7	000418	小天鹅 A	605,600.00	0.57
8	300036	超图软件	600,591.00	0.57
9	600559	老白干酒	582,033.15	0.55
10	300601	康泰生物	577,828.00	0.55
11	300357	我武生物	567,831.00	0.54
12	300401	花园生物	546,250.00	0.52
13	300170	汉得信息	538,928.00	0.51

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。

7.1.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	600779	水井坊	2,500,433.29	2.37
2	300347	泰格医药	1,688,420.00	1.60
3	002234	民和股份	1,334,579.00	1.26
4	000418	小天鹅 A	565,600.00	0.54
5	300357	我武生物	551,740.00	0.52
6	300601	康泰生物	542,000.00	0.51
7	600559	老白干酒	538,584.40	0.51

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。

7.1.4.3 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	12,577,916.35
卖出股票的收入（成交）总额	7,721,356.69

7.1.5 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	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	其他	-	-
9	合计	75,456,300.00	71.49

7.1.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	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

7.1.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

7.1.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.1.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.1.10 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。

7.1.11 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。

7.1.12 投资组合报告附注

7.1.12.1 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，在本报告编制日以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。

7.1.12.2 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。

7.1.12.3 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	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

7.1.12.4 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。

7.1.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.1.12.6 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。

7.2 交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金

(报告期：2018年1月1日-2018年6月1日)

7.2.1 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	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
8	其他各项资产	16,770,710.96	5.98
9	合计	280,537,432.35	100.00

7.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.2.1 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。

7.2.2.2 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。

7.2.3 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。

7.2.4 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。

7.2.5 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	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	-	-
8	其他	-	-

9	合计	180,958,000.00	93.78
---	----	----------------	-------

7.2.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	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

7.2.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

7.2.8 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。

7.2.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.2.10 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。

7.2.11 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。

7.2.12 投资组合报告附注

7.2.12.1 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。

7.2.12.2 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。

7.2.12.3 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	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

7.2.12.4 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。

7.2.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.2.12.6 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。

8 基金份额持有人信息

8.1 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)

8.1.1 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 比例	持有份额	占总份额 比例
1,095	94,721.33	-	-	103,719,852.57	100.00%

8.1.2 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	5,038.58	0.00%

8.1.3 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

8.2 交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金

(报告期: 2018年1月1日-2018年6月1日)

8.2.1 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
1,582	119,965.07	-	-	189,784,733.61	100.00%

8.2.2 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	5,028.81	0.00%

8.2.3 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

9.1 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)

单位: 份

基金转型生效日(2018年6月2日)基金份额 总额	189,784,733.61
本报告期期初基金份额总额	189,784,733.61
本报告期基金总申购份额	26,889.86
减: 本报告期基金总赎回份额	86,091,770.90

本报告期基金拆分变动份额	-
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。

9.2 交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金

(报告期：2018年1月1日-2018年6月1日)

单位：份

基金合同生效日（2015 年 5 月 29 日）基金份额总额	1,971,186,670.30
本报告期期初基金份额总额	919,800,730.97
本报告期基金总申购份额	206,049.77
减：本报告期基金总赎回份额	730,222,047.13
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	189,784,733.61

- 注：1、上表中“报告期”指 2018 年 1 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。

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：2018 年 6 月 30 日本基金管理人发布公告，经公司第四届董事会第三十二次会议审议通过，同意苏奋先生辞去公司督察长职务，并决定由公司总经理阮红女士代为履行公司督察长职务。期后变动（如有）敬请关注基金管理人发布的相关公告。

2、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动：本基金托管人中国民生银行股份有限公司于 2018 年 4 月 19 日公告，根据工作需要，任命张庆先生担任其资产托管部总经理，主持资产托管部相关工作。

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

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。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。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

10.6 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。

10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

1、管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金管理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。

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。

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 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)

10.8.1.1 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	
长江证券股份有限公司	2	20,299,273.04	100.00%	18,904.73	100.00%	-

10.8.1.2 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
长江证券股份有限公司	43,050,026.18	100.00%	346,100,000.00	100.00%	-	-

注：1、报告期内，本基金交易单元未发生变化；

2、租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：券商基本面评价（财务状况、经营状况）、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）、券商每日信息评价（及时性和有效性）和券商协作表现评价等四个方面；

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

10.8.2 交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金

（报告期：2018年1月1日-2018年6月1日）

10.8.2.1 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	
长江证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

10.8.2.2 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	成交金额	占当期回购成交总额	成交金额	占当期权证成交总额的比例

		的比例		的比例		
长江证券股份有限公司	54,367,183.30	100.00 %	5,497,753,000.00	100.00%	-	-

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 影响投资者决策的其他重要信息

1、本基金管理人依据国家税收法律、法规、规章及税收规范性文件的规定，对管理的基金产品运营过程中产生的应税收入，计提及缴纳增值税及附加税费，该部分税费由基金资产承担。详情请见有关公告。

2、根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》的有关规定及相关监管要求，经与基金托管人协商一致并报监管机构备案，基金管理人对本基金基金合同等法律文件作相应修改。请投资者关注基金合同中“对持续持有期少于 7 日的基金份额持有人收取不低于 1.5% 的赎回费并全额计入基金财产”的条款已于 2018 年 3 月 31 日起正式实施。欲知详情请查阅本基金管理人于 2018 年 3 月 22 日发布的有关公告及法律文件。

3、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。

交银施罗德基金管理有限公司

二〇一八年八月二十五日