
交银施罗德稳固收益债券型证券投资基金
(交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金)

2019 年第 2 季度报告

2019 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：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一九年七月十七日

§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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年7月16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。

交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金保本周期期限三年，第一个保本周期自2013年4月24日起至2016年4月25日止，第二个保本周期自2016年5月26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，即本基金第二个保本周期于2019年5月27日到期。交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金保本周期到期后，已按照《交银施罗德荣祥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债券型基金，即“交银施罗德稳固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“519726”。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《交银施罗德稳固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2019年4月1日起至6月30日止。其中，自2019年5月27日（含）起至2019年5月30日（含）止为交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金保本周期到期期间，并自2019年5月31日起，交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金正式转型为交银施罗德稳固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2019年4月1日起至2019年5月30日止，基金转型后的报告期为2019年5月31日起至2019年6月30日。

§2 基金产品概况

2.1 交银施罗德稳固收益债券型证券投资基金

基金简称	交银稳固收益债券
基金主代码	519726
交易代码	519726
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年5月31日
报告期末基金份额总额	105,824,069.50份
投资目标	在追求本金安全、有效控制风险的基础上，力争实现基金资产的持续稳定增值。
投资策略	<p>本基金在逐期追求投资本金安全的风险控制目标下追求基金收益的稳定递增。自转型完成之日起，本基金以3年为一个运作周期逐期运作，每一运作周期期满后且后一运作周期起始日前，安排不少于5个工作日的运作调整期，除对持续持有期少于7日的基金份额持有人收取不低于1.5%的赎回费以外，投资者在运作调整期内办理本基金的申购和赎回业务时不收取申购、赎回费用。</p> <p>本基金在每一运作周期的投资目标为力求期末基金份额净值加上该运作周期累计分红金额不低于该运作周期第1个工作日的基金份额净值。在每一运作周期中，本基金通过适当的投资策略和运作机制，优化基金组合的风险收益和流动性，增强对组合流动性的保护，力争实现设定的投资目标，满足投资人获取持续稳定收益的需求。</p> <p>本基金不设置担保人或保本义务人，不承诺基金份额持有人在本基金运作周期期满时可以获得保本金额的保证。</p>
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	中国农业银行股份有限公司

注：1、上表中“报告期末”指2019年6月30日。

2、本基金于2019年5月31日由交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金转型为交银施罗德稳固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 交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金

基金简称	交银荣祥保本混合
基金主代码	519726
交易代码	519726
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年4月24日
报告期末基金份额总额	157,263,139.48份
投资目标	本基金在严格控制风险和追求本金安全的前提下，力争实现基金资产在保本周期内的稳定增值。
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	中国农业银行股份有限公司
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2019年5月30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 (2019年5月31日-2019年 6月30日)	报告期 (2019年4月1日-2019年 5月30日)
1.本期已实现收益	37,696.42	252,245.76
2.本期利润	114,371.24	622,592.09
3.加权平均基金份额本期利润	0.0010	0.0010
4.期末基金资产净值	113,882,485.96	169,069,914.69
5.期末基金份额净值	1.076	1.075

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、交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金从2019年5月31日起正式转型为交银施罗德稳固收益债券型证券投资基金。

3.2 基金净值表现

3.2.1 交银施罗德稳固收益债券型证券投资基金

（报告期：2019年5月31日-2019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

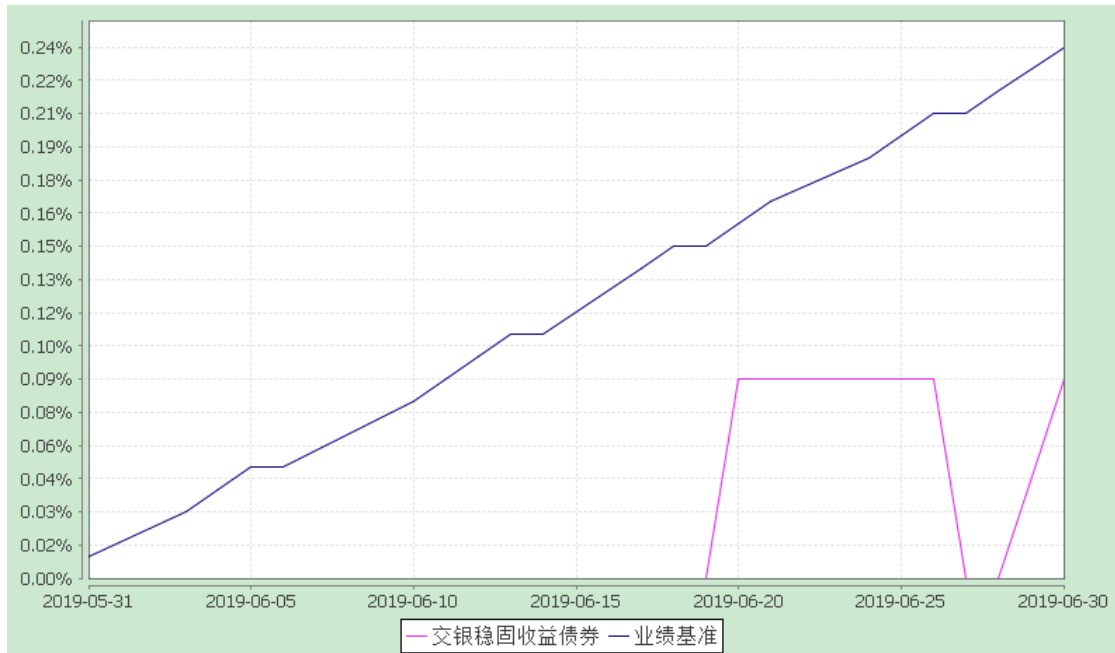
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2019年5月31日-2019年6月30日	0.09%	0.04%	0.24%	0.01%	-0.15%	0.03%

注：交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金从2019年5月31日起正式转型为交银施罗德稳固

固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三年期银行定期存款税后收益率。

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

交银施罗德稳固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
 (2019年5月31日-2019年6月30日)



注：本基金由交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金转型而来。基金转型日为2019年5月31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祥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2019年5月31日）起的3个月。截至2019年6月30日，本基金尚处于投资转型期。

3.2.2 交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金

(报告期：2019年4月1日-2019年5月30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

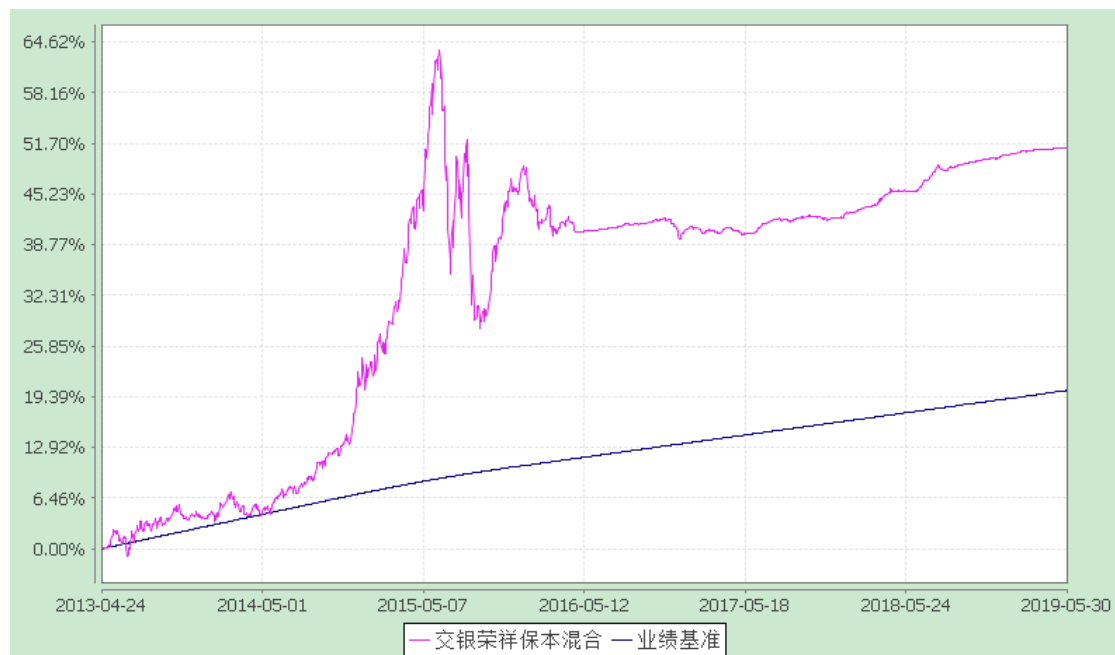
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2019年4月1日-2019年	0.09%	0.01%	0.46%	0.01%	-0.37%	0.00%

5月30日						
-------	--	--	--	--	--	--

注：交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金从2019年5月31日起正式转型为交银施罗德稳固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

交银施罗德荣祥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
 (2013年4月24日-2019年5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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
凌超	交银定期支付月月丰	2019-02-28	-	13年	凌超先生，华中科技大学数量经济学硕士、武汉科技大学信息与计算科学学

	债券、 交银增 强收益 债券、 交银强 化回报 债券、 交银增 利增强 债券、 交银稳 固收益 债券的 基金经 理，公 司固定 收益 (公募) 投资副 总监				<p>士。2006年至2009年任长江证券股份有限公司研究员、投资经理，2009年至2012年任光大保德信基金有限管理公司研究员、基金助理、基金经理，2012年至2016年任海富通基金管理有限公司投资顾问、基金经理，2016年至2017年任天弘基金管理有有限公司固定收益部副总经理、基金经理。2010年8月31日至2012年3月1日任光大保德信货币市场基金基金经理，2013年12月19日至2016年1月12日任海富通一年定期开放债券型证券投资基金基金经理，2014年4月2日至2016年1月12日任海富通纯债债券型证券投资基金基金经理，2014年12月1日至2016年1月12日任海富通稳固收益债券型证券投资基金基金经理，2016年5月14日至2017年7月13日任天弘弘利债券型证券投资基金基金经理，2016年5月14日至2017年7月13日任天弘裕利灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016年5月14日至2017年7月13日任天弘债券型发起式证券投资基金基金经理。2017年7月加入交银施罗德基金管理有有限公司。2019年2月28日至2019年5月30日担任转型前的交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金的基金经理。</p>
--	---	--	--	--	--

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，基金整体运作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未发现异常交易行为。本报告期内，本公司管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量5%的情况有1次，是投资组合因投资策略需要而发生同日反向交易，未发现不公平交易和利益输送的情况。本基金与本公司管理的其他投资组合在不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）同向交易的交易价差未发现异常。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

本报告期内，随着海外风险事件再度升温，经济预期逐步回落。五月，个

别银行信用风险暴露影响信用利差有所扩大。从经济基本面看，三月春节错位令市场对于经济的预期高涨，市场利率一路走高。此后，经济环比数据自然回落，并伴随着中观行业订单季节性下降，地产销量逐步走低。五月，中美贸易争端升温，经济预期进一步回落，市场利率明显回落，并维持震荡。5月受个别银行信用风险暴露影响，银行间流动性分化，存单收益率上行，信用债收益率一度走高，信用利差明显走扩。随着跨季资金流动性维持宽松，短端收益率下行，中高等级信用债收益率也出现回落，但中低等级信用债成交依然不多。

受经济环比回落，中美贸易争端再度升温等事件影响，权益市场自四月中下旬震荡下行。行业层面看，部分消费及金融有一定绝对收益，TMT及强周期等板块均有明显跌幅。

本基金处于投资转型期，在组合操作中，维持短久期利率底仓位，并通过长端利率债波段操作增厚组合债券部分收益。权益投资方面，基金管理人暂以观望为主。

展望2019年三季度，从高频数据看，我们认为经济基本面面临下行压力，因此对于债券市场我们维持谨慎乐观的看法，拟维持中短久期配置，适时进行长债波段操作以赚取超额收益。权益方面，我们将密切关注市场的走势变化，灵活积极适度配置相关行业与个股，争取为组合获得更好收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金（各类）份额净值及业绩表现请见“3.1 主要财务指标”及“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”、“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。

4.6 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 交银施罗德稳固收益债券型证券投资基金

（报告期：2019年5月31日-2019年6月30日）

5.1.1 报告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	70,778,848.50	46.84
	其中：债券	70,778,848.50	46.84
	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	37,000,000.00	24.49
	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	42,544,157.88	28.16
8	其他各项资产	783,018.18	0.52
9	合计	151,106,024.56	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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

5.1.4 报告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	60,590,848.50	53.20

	其中：政策性金融债	60,590,848.50	53.20
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	10,188,000.00	8.95
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	70,778,848.50	62.15

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

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	108602	国开 1704	599,850	60,590,848.50	53.20
2	101554065	15 广珠轨交 MTN001	100,000	10,188,000.00	8.95

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。

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	17,927.10
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	763,407.45
5	应收申购款	1,683.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	783,018.18

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

本基金本报告期末未持有股票。

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 交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金

(报告期：2019年4月1日-2019年5月30日)

5.2.1 报告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	19,898,000.00	9.32

	其中：债券	19,898,000.00	9.32
	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	193,420,881.29	90.57
8	其他各项资产	246,786.41	0.12
9	合计	213,565,667.70	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

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	19,898,000.00	11.77
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-

7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	19,898,000.00	11.77

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

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	199911	19 贴现国债 11	200,000	19,898,000.00	11.77

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	17,268.74
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	229,517.67
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	246,786.41

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

本基金本报告期末未持有股票。

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 开放式基金份额变动

6.1 交银施罗德稳固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	157,263,139.48
报告期期间基金总申购份额	92,544.28
减：报告期期间基金总赎回份额	51,531,614.26
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	105,824,069.50

注：1、上表中“报告期”指2019年5月31日至2019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。

6.2 交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金

单位：份

本报告期期初基金份额总额	453,967,529.43
报告期期间基金总申购份额	529,081.75
减：报告期期间基金总赎回份额	297,233,471.70
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	157,263,139.48

注：1、上表中“报告期”指2019年4月1日至2019年5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 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 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。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

7.2.1 交银施罗德稳固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。

7.2.2 交银施罗德荣祥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。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 影响投资者决策的其他重要信息

1、交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金保本周期期限三年，第一个保本周期自2013年4月24日起至2016年4月25日止，第二个保本周期自2016年5月26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，即本基金第二个保本周期于2019年5月27日到期。交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金保本周期到期后，已按照《交银施罗德荣祥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债券型基金，即“交银施罗德稳固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“519726”。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《交银施罗德稳固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。

交银施罗德荣祥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稳固收益债券型证券投资基金后运作相关业务规则详情请查阅本基金管理人于2019年5月20日发布的《交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金第二个保本周期到期安排及转型为交银施罗德稳固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2019年5月20日《上海证券报》上的交银施罗德稳固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稳固收益债券型证券投资基金的相关基金法律文件。

2、根据有关法律法规规定和基金合同的约定，本基金可投资科创板股票。基金资产投资于科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于市场风险、流动性风险、退市风险、集中度风险、系统性风险、政策风险等。有关详情请查阅本基金管理人于2019年6月22日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告》。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《交银施罗德稳固收益债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《交银施罗德稳固收益债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《交银施罗德稳固收益债券型证券投资基金托管协议》；
- 5、《交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金基金合同》；
- 6、《交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金招募说明书》；
- 7、《交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金托管协议》；
- 8、《交银施罗德荣祥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、关于申请募集交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金之法律意见书；
- 12、关于修改《交银施罗德荣祥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祥保本混合型证券投资基金、交银施罗德稳固收益债券型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

9.3 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。