

# 交银施罗德双利债券证券投资基金 2023 年第 1 季度报告

2023 年 3 月 31 日

基金管理人：交银施罗德基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 4 月 21 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 04 月 20 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 03 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 交银双利债券   |
| 基金主代码      | 519683   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2011 年 9 月 26 日  |
| 报告期末基金份额总额 | 23,521,867.86 份  |
| 投资目标       | 本基金根据宏观经济运行状况和金融市场的运行趋势，自上而下进行宏观分析，自下而上精选个券，在严格控制基金资产运作风险的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为投资者提供高于业绩比较基准的长期稳定投资回报。   |
| 投资策略       | 本基金充分发挥基金管理人的研究优势，将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，动态调整大类金融资产比例，自上而下决定债券组合久期及债券类属配置；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，自下而上地精选个券。同时，本基金深度关注股票、权证一级市场和二级市场的运行状况与相应风险收益特征，在严格控制基金资产运作风险的基础上，把握投资机会，力争为投资者提供高于业绩比较基准的长期稳定投资回报。 |
| 业绩比较基准     | 中债综合全价指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10%   |

|                 |   |                |
|-----------------|---|----------------|
| 风险收益特征          | 本基金是一只债券型基金，属于证券投资基金中中等风险的品种，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           | 中国建设银行股份有限公司  |                |
| 下属分级基金的基金简称     | 交银双利债券 A/B  | 交银双利债券 C       |
| 下属分级基金的交易代码     | 519683  | 519685         |
| 下属分级基金的前端交易代码   | 519683  | -              |
| 下属分级基金的后端交易代码   | 519684  | -              |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 18,804,174.21 份   | 4,717,693.65 份 |

注：本基金 A 类基金份额采用前端收费模式，B 类基金份额采用后端收费模式，前端交易代码即为 A 类基金份额交易代码，后端交易代码即为 B 类基金份额交易代码。

### § 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（2023 年 1 月 1 日-2023 年 3 月 31 日） |              |
|-----------------|-------------------------------------|--------------|
|                 | 交银双利债券 A/B                          | 交银双利债券 C     |
| 1. 本期已实现收益      | 516,171.63                          | 122,904.48   |
| 2. 本期利润         | 629,758.18                          | 144,614.87   |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0317                              | 0.0209       |
| 4. 期末基金资产净值     | 25,529,613.78                       | 6,098,264.95 |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.3577                              | 1.2926       |

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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

交银双利债券 A/B

| 阶段    | 净值增长率① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③   | ②-④   |
|-------|--------|---------------|----------------|-----------------------|-------|-------|
| 过去三个月 | 2.37%  | 0.22%         | 0.73%          | 0.08%                 | 1.64% | 0.14% |

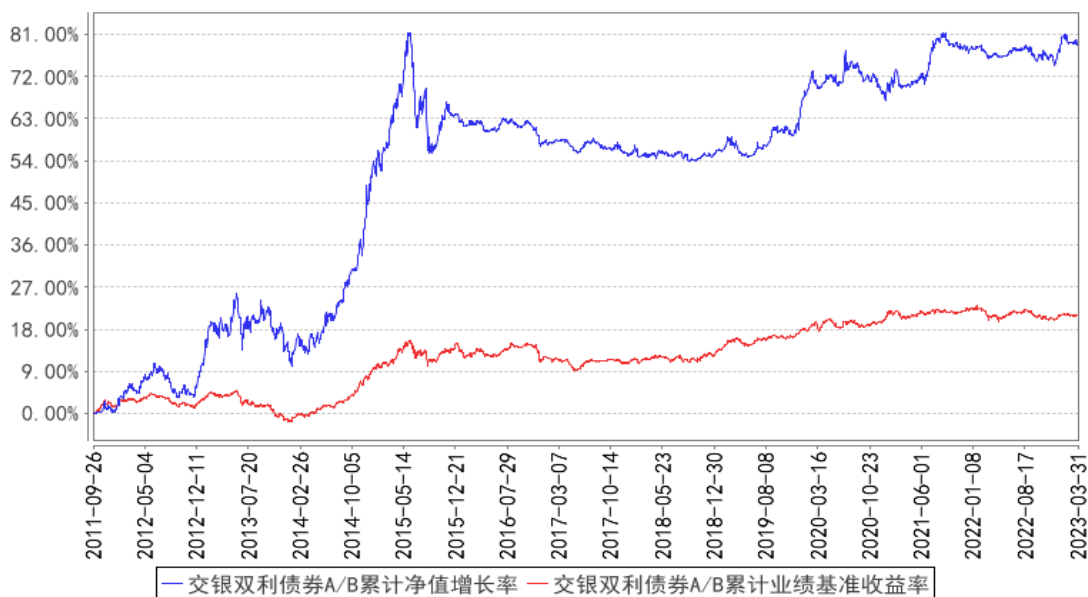
|                |        |       |        |       |        |       |
|----------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去六个月          | 2.49%  | 0.20% | 0.40%  | 0.11% | 2.09%  | 0.09% |
| 过去一年           | 2.03%  | 0.17% | 0.36%  | 0.11% | 1.67%  | 0.06% |
| 过去三年           | 5.90%  | 0.23% | 2.33%  | 0.13% | 3.57%  | 0.10% |
| 过去五年           | 15.84% | 0.22% | 8.55%  | 0.13% | 7.29%  | 0.09% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 80.01% | 0.38% | 21.22% | 0.15% | 58.79% | 0.23% |

交银双利债券 C

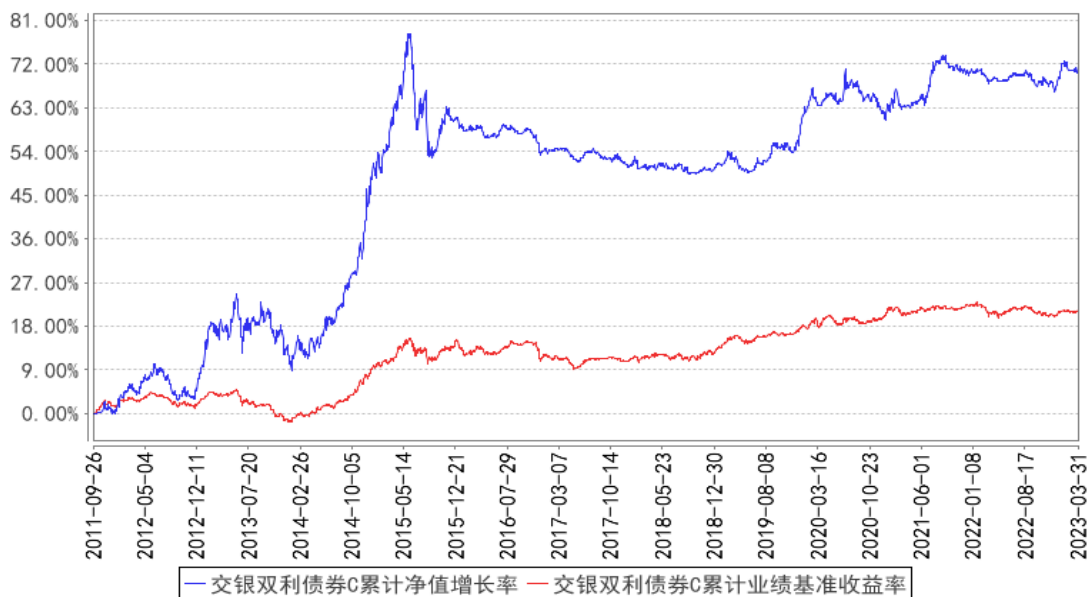
| 阶段             | 净值增长率① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③    | ②—④   |
|----------------|--------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月          | 2.26%  | 0.22%         | 0.73%          | 0.08%                 | 1.53%  | 0.14% |
| 过去六个月          | 2.28%  | 0.20%         | 0.40%          | 0.11%                 | 1.88%  | 0.09% |
| 过去一年           | 1.62%  | 0.17%         | 0.36%          | 0.11%                 | 1.26%  | 0.06% |
| 过去三年           | 4.66%  | 0.23%         | 2.33%          | 0.13%                 | 2.33%  | 0.10% |
| 过去五年           | 13.59% | 0.22%         | 8.55%          | 0.13%                 | 5.04%  | 0.09% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 71.48% | 0.38%         | 21.22%         | 0.15%                 | 50.26% | 0.23% |

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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

交银双利债券A/B累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



交银双利债券C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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 |        |  |
| 唐贇 | 交银信用添利债券(LOF)、 | 2015年11月7日  | -    | 13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、平安资产管理公司信用分析员。 |

|     |  |                 |   |      |  |
|-----|--|-----------------|---|------|--|
|     | 交银双利债券、交银双轮动债券、交银定期支付月月丰债券、交银强化回报债券的基金经理   |                 |   |      | 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。2017 年 3 月 31 日至 2019 年 10 月 23 日担任交银施罗德裕通纯债债券型证券投资基金的基金经理。2018 年 6 月 2 日至 2019 年 12 月 13 日担任交银施罗德安心收益债券型证券投资基金的基金经理。2020 年 7 月 14 日至 2022 年 1 月 18 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。2019 年 2 月 28 日至 2022 年 3 月 11 日担任交银施罗德荣鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 7 月 14 日至 2022 年 7 月 8 日担任交银施罗德稳固收益债券型证券投资基金的基金经理。 |
| 魏玉敏 | 交银增利债券、交银纯债债券发起、交银增利增强债券、交银裕如纯债债券、交银可转债债券、交银裕泰两年定期开放债券、交银鑫选回报混合、交银安心收益债券、交银双利债券的基金经理 | 2022 年 8 月 18 日 | - | 11 年 | 魏玉敏女士，厦门大学金融学硕士、学士。2012 年至 2013 年任招商证券固定收益研究员，2013 年至 2016 年任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，历任基金经理助理。2018 年 8 月 29 日至 2020 年 10 月 16 日担任交银施罗德丰晟收益债券型证券投资基金的基金经理。2018 年 11 月 2 日至 2021 年 12 月 16 日担任交银施罗德丰润收益债券型证券投资基金的基金经理。2019 年 1 月 23 日至 2021 年 12 月 16 日担任交银施罗德中债 1-3 年农发行债券指数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私募资产管理计划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“价格优先、时间优先”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，遵循公平交易分配原则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

2023 年一季度，债券市场整体有所分化。利率债短端收益率在资金面影响下先上后下；长端受到经济预期波动以震荡为主，期限利差小幅收窄；信用债收益率基本以下行为主，信用利差明显收窄，信用债表现明显好于利率债。春节前，市场对疫后修复预期较为乐观，同时资金利率略紧，导致债市小幅调整。二月之后，虽然春节期间旅游消费数据向好，但由于春节返乡比例较高，节后复工速度略慢导致经济预期有所下修。一月，信贷开门红之下债市表现出较强韧性，利率债长端基本以震荡为主，理财资金回流及机构年初加大配置导致信用债收益率的快速下行。进

入三月，海外持续加息缩表带来金融体系波动加大，市场风险偏好有所下行带动债市情绪回暖。同时，三月中旬央行超预期市场对资金面预期转为平稳宽松，中短端利率明显下行带动收益率曲线小幅陡峭化。

一季度，多数时期经济数据缺位，仅依靠预期改善带来的估值修复逐渐乏力，股市涨势较 2022 年最后两个月趋向温和。具体来看，一月，经济预期低位回升，带动市场情绪好转，外资大幅流入也成为市场的主要驱动，A 股呈现明显的底部回升态势，大部分行业迎来反弹，热门赛道获得资金流入。二月，国内经济复苏的趋势仍在延续，但股市投资者对经济复苏的斜率产生分歧，叠加海外流动性收紧迟滞了北上资金的流入进度，因而权益市场窄幅震荡，小盘股领涨，大盘成长表现稍弱。三月，权益市场迎来调整。行业层面，市场对于复苏的交易暂歇，而“中特估”与 AI 的题材热度不断飙升，在 chatGPT 等主题概念催化下，TMT 强势领涨。一季度，理财赎回对转债的压制告一段落，债市窄幅波动，转债走势跟随权益，春节前以上行为主，春节后转入震荡。一月，转债指数上涨，估值快速拉升，涨幅靠前为有色、计算机行业及个股边际变化显著的品种。二月，转债指数下跌、估值快速压缩，涨幅靠前主要为高价转债，跌幅靠前的转债主要在有色、电力设备新能源、汽车等成长赛道。三月，转债指数小幅上涨、估值抬升，涨幅靠前主要为 TMT 和“中特估”题材。

报告期内，组合债券资产主要配置以利率债为主，并维持中性的转债仓位，结构上以偏股型的转债配置为主。权益资产的配置上偏向于具有成长性的科创类标的和行业层面迎来拐点的医药公司，同时以估值具有安全边际的品种为底仓配置。

展望 2023 年二季度，预计经济复苏的斜率或将小幅放缓，考虑到年初以来信贷投放较为积极，经济内生修复的动力大概率将会延续，重点关注消费和地产反弹的力度。年初以来，服务业改善幅度强于制造业，主要受到人口流动恢复和积压性需求释放的影响。二季度在节假日消费场景的带动下，预计旅游和商旅出行有望继续回升，而汽车和地产后周期消费的持续改善取决于居民收入预期的回升，或需要政策进一步的支持。通胀方面，预计二季度整体压力不大，当前服务类价格有所上涨但幅度有限，在欧美较弱经济预期下大宗商品难以大幅上行，基数效应下通胀读数或保持低位震荡。央行降准之后预计市场利率将继续围绕政策利率波动，流动性维持合理充裕，社融增速窄幅震荡，预计债券市场延续震荡行情。权益方面，在弱复苏和温和流动性的背景下，重点关注新产业趋势的演变，尤其是行业基本面和估值都出现拐点的科创类成长股。我们将密切关注市场的演绎，仍然保持权益市场有结构性的机会可以参与的观点。转债市场的估值维持在高位，未来仍将受纯债和股票市场的影响，我们认为偏股型的转债或是性价比更高的选择，仍将聚焦正股层面的机会，选择估值和基本面匹配的标的。



#### 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 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

本基金本报告期内连续二十个工作日以上出现基金资产净值低于 5000 万元的情形，截至本报告期末，本基金基金资产净值仍低于 5000 万元。

### § 5 投资组合报告

#### 5.1 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              | 6,171,905.15  | 18.46        |
|    | 其中：股票             | 6,171,905.15  | 18.46        |
| 2  | 基金投资              | -             | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 25,834,323.82 | 77.27        |
|    | 其中：债券             | 25,834,323.82 | 77.27        |
|    | 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      | 1,213,554.59  | 3.63         |
| 8  | 其他资产              | 215,701.66    | 0.65         |
| 9  | 合计                | 33,435,485.22 | 100.00       |

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 5.2.1 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              | 3,535,611.42 | 11.18        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 482,561.00   | 1.53         |
| E  | 建筑业              | 290,680.00   | 0.92         |
| F  | 批发和零售业           | 59,214.00    | 0.19         |
| 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 | 1,564,449.73 | 4.95  |
| J | 金融业             | 102,150.00   | 0.32  |
| 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      | 65,400.00    | 0.21  |
| N | 水利、环境和公共设施管理业   | 7,264.00     | 0.02  |
| O | 居民服务、修理和其他服务业   | -            | -     |
| P | 教育              | -            | -     |
| Q | 卫生和社会工作         | 64,575.00    | 0.20  |
| R | 文化、体育和娱乐业       | -            | -     |
| S | 综合              | -            | -     |
|   | 合计              | 6,171,905.15 | 19.51 |

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.3.1 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  | 600970 | 中材国际 | 26,000 | 290,680.00 | 0.92         |
| 2  | 688677 | 海泰新光 | 2,674  | 269,218.32 | 0.85         |
| 3  | 600027 | 华电国际 | 41,900 | 242,601.00 | 0.77         |
| 4  | 600011 | 华能国际 | 28,000 | 239,960.00 | 0.76         |
| 5  | 002555 | 三七互娱 | 7,600  | 216,220.00 | 0.68         |
| 6  | 688012 | 中微公司 | 1,380  | 203,563.80 | 0.64         |
| 7  | 300981 | 中红医疗 | 8,500  | 193,630.00 | 0.61         |
| 8  | 688236 | 春立医疗 | 6,136  | 189,295.60 | 0.60         |
| 9  | 600079 | 人福医药 | 6,600  | 176,748.00 | 0.56         |
| 10 | 601360 | 三六零  | 10,100 | 176,245.00 | 0.56         |

### 5.4 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      | 9,033,184.85  | 28.56        |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | 12,059,485.48 | 38.13        |
|    | 其中：政策性金融债 | 12,059,485.48 | 38.13        |
| 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） | 4,741,653.49  | 14.99 |
| 8  | 同业存单      | -             | -     |
| 9  | 其他        | -             | -     |
| 10 | 合计        | 25,834,323.82 | 81.68 |

#### 5.5 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  | 210202 | 21 国开 02 | 107,000 | 10,821,727.89 | 34.22        |
| 2  | 019638 | 20 国债 09 | 43,000  | 4,378,051.48  | 13.84        |
| 3  | 019679 | 22 国债 14 | 43,000  | 4,353,714.66  | 13.77        |
| 4  | 018008 | 国开 1802  | 12,000  | 1,237,757.59  | 3.91         |
| 5  | 113044 | 大秦转债     | 6,350   | 717,021.12    | 2.27         |

#### 5.6 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

无。

#### 5.7 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

无。

#### 5.8 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

无。

#### 5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 5.9.1 本期国债期货投资政策

无。

##### 5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

##### 5.9.3 本期国债期货投资评价

无。

## 5.10 投资组合报告附注

### 5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形披露如下：

2023 年 1 月 19 日，四川银保监局公示川银保监罚决字（2022）95 号行政处罚决定书，给予成都银行股份有限公司罚款 650 万元人民币罚款的行政处罚。

2022 年 7 月 15 日，央行成都分行公示成银罚字（2022）20 号行政处罚决定书，给予成都银行股份有限公司罚款 194.60 万元人民币罚款的行政处罚。

2022 年 5 月 31 日，央行杭州中心支行公示杭银处罚字（2022）30 号行政处罚决定书，给予杭州银行股份有限公司罚款 580 万元。

2022 年 12 月 30 日，央行南京分行公示南银罚决字（2022）4 号行政处罚决定书，给予苏州银行股份有限公司罚款 122.20 万元。

2023 年 2 月 10 日，中国人民银行公示银罚决字（2023）1 号行政处罚决定书，给予江苏银行股份有限公司罚款 773.60 万元人民币罚款的行政处罚。

本基金管理人对证券投资决策程序的说明如下：本基金管理人对证券投资特别是重仓证券的投资有严格的投资决策流程控制，对上述主体发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述主体外，本基金投资的前十名证券的其他发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

### 5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）      |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | 6,633.18   |
| 2  | 应收证券清算款 | 208,493.48 |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | -          |
| 5  | 应收申购款   | 575.00     |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 其他      | -          |
| 8  | 合计      | 215,701.66 |

## 5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称    | 公允价值（元）    | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|---------|------------|--------------|
| 1  | 113044 | 大秦转债    | 717,021.12 | 2.27         |
| 2  | 113055 | 成银转债    | 653,454.80 | 2.07         |
| 3  | 127058 | 科伦转债    | 333,892.37 | 1.06         |
| 4  | 110053 | 苏银转债    | 327,946.46 | 1.04         |
| 5  | 110079 | 杭银转债    | 327,051.60 | 1.03         |
| 6  | 127032 | 苏行转债    | 326,910.82 | 1.03         |
| 7  | 113050 | 南银转债    | 326,195.15 | 1.03         |
| 8  | 128121 | 宏川转债    | 275,023.13 | 0.87         |
| 9  | 127065 | 瑞鹄转债    | 224,007.52 | 0.71         |
| 10 | 110048 | 福能转债    | 175,069.51 | 0.55         |
| 11 | 123131 | 奥飞转债    | 170,915.62 | 0.54         |
| 12 | 110077 | 洪城转债    | 164,402.67 | 0.52         |
| 13 | 113039 | 嘉泽转债    | 164,193.63 | 0.52         |
| 14 | 127006 | 敖东转债    | 110,338.62 | 0.35         |
| 15 | 113654 | 永 02 转债 | 105,422.25 | 0.33         |
| 16 | 118016 | 京源转债    | 89,605.46  | 0.28         |
| 17 | 113504 | 艾华转债    | 80,907.59  | 0.26         |
| 18 | 128033 | 迪龙转债    | 60,842.30  | 0.19         |
| 19 | 110080 | 东湖转债    | 36,191.86  | 0.11         |

## 5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

## 5.10.6 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

单位：份

| 项目                        | 交银双利债券 A/B    | 交银双利债券 C      |
|---------------------------|---------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 20,303,827.50 | 5,101,283.48  |
| 报告期期间基金总申购份额              | 112,444.07    | 14,224,908.46 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 1,612,097.36  | 14,608,498.29 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -             | -             |
| 报告期期末基金份额总额               | 18,804,174.21 | 4,717,693.65  |

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

## § 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

无。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 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双利债券证券投资基金募集的文件；
- 2、《交银施罗德双利债券证券投资基金基金合同》；
- 3、《交银施罗德双利债券证券投资基金招募说明书》；
- 4、《交银施罗德双利债券证券投资基金托管协议》；
- 5、关于募集交银施罗德双利债券证券投资基金之法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、报告期内交银施罗德双利债券证券投资基金在规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。