**交银施罗德增利增强债券型证券投资基金**

**2020年第3季度报告**

**2020年9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：中国建设银行股份有限公司**

**报告送出日期：二〇二〇年十月二十八日**

# §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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2020年10月27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2020年7月1日起至9月30日止。

# §2 基金产品概况

|  |  |
| --- | --- |
| 基金简称 | 交银增利增强债券 |
| 基金主代码 | 004427 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2017年6月2日 |
| 报告期末基金份额总额 | 29,537,371.89份 |
| 投资目标 | 本基金以债券投资为主，通过自上而下进行宏观分析，自下而上精选个券，在严格控制风险的前提下，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，动态调整大类资产比例。本基金自上而下决定债券组合久期、期限结构配置及债券类属配置；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。通过综合运用骑乘操作、套利操作等策略，提高投资组合收益。此外，本基金深度关注股票、权证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前提下，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。 |
| 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 |
| 下属两级基金的基金简称 | 交银增利增强债券A | 交银增利增强债券C |
| 下属两级基金的交易代码 | 004427 | 004428 |
| 报告期末下属两级基金的份额总额 | 21,423,328.96份 | 8,114,042.93份 |

# §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(2020年7月1日-2020年9月30日) |
| 交银增利增强债券A | 交银增利增强债券C |
| 1.本期已实现收益 | 1,420,521.54 | 753,680.31 |
| 2.本期利润 | 1,780,545.38 | 482,374.54 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0974 | 0.0565 |
| 4.期末基金资产净值 | 29,558,904.42 | 11,066,209.85 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.3798 | 1.3638 |

注：1、本基金A类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**

**1、交银增利增强债券A：**

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 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 |
| 过去三个月 | 10.21% | 1.06% | -1.48% | 0.08% | 11.69% | 0.98% |
| 过去六个月 | 12.82% | 0.84% | -2.50% | 0.10% | 15.32% | 0.74% |
| 过去一年 | 18.85% | 0.75% | -0.08% | 0.09% | 18.93% | 0.66% |
| 过去三年 | 35.41% | 0.52% | 4.21% | 0.07% | 31.20% | 0.45% |
| 自基金合同生效至今 | 37.98% | 0.49% | 4.98% | 0.07% | 33.00% | 0.42% |

**2、交银增利增强债券C：**

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 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 |
| 过去三个月 | 10.07% | 1.06% | -1.48% | 0.08% | 11.55% | 0.98% |
| 过去六个月 | 12.62% | 0.84% | -2.50% | 0.10% | 15.12% | 0.74% |
| 过去一年 | 18.28% | 0.75% | -0.08% | 0.09% | 18.36% | 0.66% |
| 过去三年 | 33.84% | 0.52% | 4.21% | 0.07% | 29.63% | 0.45% |
| 自基金合同生效至今 | 36.38% | 0.49% | 4.98% | 0.07% | 31.40% | 0.42% |

**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**

交银施罗德增利增强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的历史走势对比图

（2017年6月2日至2020年9月30日）

1．交银增利增强债券A



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。

2．交银增利增强债券C



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债券、交银增强收益债券、交银强化回报债券、交银周期回报灵活配置混合、交银新回报灵活配置混合、交银多策略回报灵活配置混合、交银优选回报灵活配置混合、交银优择回报灵活配置混合、交银瑞鑫定期开放灵活配置混合、交银增利增强债券、交银恒益灵活配置混合、交银裕祥纯债债券、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 | 2018-02-13 | 2020-07-23 | 14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。2018年2月13日至2020年7月22日担任交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金、交银施罗德增强收益债券型证券投资基金（原交银荣泰保本）、交银施罗德强化回报债券型证券投资基金、交银施罗德增利增强债券型证券投资基金的基金经理。2019年2月28日至2020年7月22日担任交银施罗德稳固收益债券型证券投资基金（原交银荣祥保本)的基金经理。2019年7月20日至2020年7月22日担任交银施罗德周期回报灵活配置混合型证券投资基金、交银施罗德新回报灵活配置混合型证券投资基金、交银施罗德多策略回报灵活配置混合型证券投资基金、交银施罗德优选回报灵活配置混合型证券投资基金、交银施罗德优择回报灵活配置混合型证券投资基金、交银施罗德瑞鑫定期开放灵活配置混合型证券投资基金、交银施罗德恒益灵活配置混合型证券投资基金、交银施罗德裕祥纯债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、交银丰润收益债券、交银增利增强债券、交银丰晟收益债券、交银裕如纯债债券、交银中债1-3年农发债指数、交银可转债债券、交银裕泰两年定期开放债券的基金经理 | 2018-11-02 | - | 8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。 |

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遵规守信情况的说明**

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**

债券市场方面，回顾2020年三季度，债券收益率整体呈现震荡上行的趋势，经济复苏预期下叠加货币政策回归中性，资金面呈现出阶段性紧张局面，债券市场弱势震荡。具体来看，本季度初，周期类股票上涨强化了经济复苏预期，同时央行公开市场操作持续净回笼传递货币政策偏紧预期，特别国债发行导致供给压力增大，债券市场延续弱势调整。季度中期，债市在配置资金和避险情绪催化下开启一波反弹行情。进入季度末，在超储率低位的情况下，资金面持续维持平衡偏紧格局，银行负债压力加大，存单发行利率不断上行，带动曲线平坦化上行。

权益市场方面，七月上旬股市加速上行、债市情绪悲观，股债两极分化激发部分机构的再平衡。随后中美再起风波美股高位震荡，A股也同步回调。板块表现来看，前期表现强势的防御性板块在三季度的表现明显逊于二季度。包括A股在内的全球股市的反弹逻辑已从二季度的政策刺激，在三季度转变为对疫情后复苏期基本面的验证。转债指数于七月初随着周期板块上涨上行，后续随着正股回落，缺乏全面机会，只有部分个股机会，转债估值小幅压缩。

报告期内，本基金由于规模限制，债券配置以利率债和转债为主以保证组合流动性。组合在报告期内维持了较高的转债仓位配置，精选个券增厚组合收益。

展望2020年四季度，国内基本面恢复的节奏和货币信用的边际变化将成为影响债市的主要因素。短期来看经济延续改善趋势、工业品价格上行压力增大，货币政策回归中性以及银行负债端压力较大等因素影响下，我们认为债券市场将维持震荡上行，趋势性机会仍需要等待。但随着年末供给压力减弱、信用增速放缓以及中美关系不确定性提升，债券市场或存在波段交易机会。在广义流动性相对宽松的温和环境下，股票市场仍有结构性机会，中期逻辑围绕经济回升、盈利改善、政策渐进收敛。

操作策略方面，组合将继续以利率债和转债为主要配置。转债资产方面，整体仓位较此前小幅下降，选择盈利能力好，具有长期逻辑的个券作为重点配置，适当参与低价转债的配置机会。

**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六十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**

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 | 6,100,646.01 | 14.79 |
|  | 其中：股票 | 6,100,646.01 | 14.79 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 33,055,284.19 | 80.12 |
|  | 其中：债券 | 33,055,284.19 | 80.12 |
|  | 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 | 1,741,548.35 | 4.22 |
| 8 | 其他各项资产 | 361,007.67 | 0.87 |
| 9 | 合计 | 41,258,486.22 | 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**

金额单位：人民币元

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 代码 | 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（％） |
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 4,903,103.14 | 12.07 |
| 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 | 697,751.60 | 1.72 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | 193,671.27 | 0.48 |
| 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 | 184,800.00 | 0.45 |
| 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 | 121,320.00 | 0.30 |
| S | 综合 | - | - |
|  | 合计 | 6,100,646.01 | 15.02 |

**5.2.2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。

**5.3 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 | 603816 | 顾家家居 | 15,200 | 916,560.00 | 2.26 |
| 2 | 603866 | 桃李面包 | 13,660 | 813,999.40 | 2.00 |
| 3 | 002841 | 视源股份 | 7,811 | 760,869.51 | 1.87 |
| 4 | 002352 | 顺丰控股 | 8,593 | 697,751.60 | 1.72 |
| 5 | 002271 | 东方雨虹 | 10,792 | 581,688.80 | 1.43 |
| 6 | 603517 | 绝味食品 | 6,200 | 508,524.00 | 1.25 |
| 7 | 000789 | 万年青 | 14,200 | 216,124.00 | 0.53 |
| 8 | 002851 | 麦格米特 | 6,305 | 213,991.70 | 0.53 |
| 9 | 300059 | 东方财富 | 8,073 | 193,671.27 | 0.48 |
| 10 | 600323 | 瀚蓝环境 | 6,600 | 184,800.00 | 0.45 |

**5.4 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 | 6,179,864.70 | 15.21 |
| 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） | 26,875,419.49 | 66.15 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 33,055,284.19 | 81.37 |

**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**

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 | 019627 | 20国债01 | 60,000 | 5,994,000.00 | 14.75 |
| 2 | 132013 | 17宝武EB | 30,000 | 3,079,500.00 | 7.58 |
| 3 | 132015 | 18中油EB | 23,790 | 2,369,721.90 | 5.83 |
| 4 | 132005 | 15国资EB | 13,970 | 1,517,840.50 | 3.74 |
| 5 | 110045 | 海澜转债 | 15,000 | 1,458,900.00 | 3.59 |

**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**

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**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**

本基金本报告期末未持有贵金属。

**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**

本基金本报告期末未持有权证。

**5.9 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。

**5.10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。

**5.11投资组合报告附注**

**5.11.1**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。

**5.11.2**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。

**5.11.3**期末其他各项资产构成

金额单位：人民币元

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 序号 | 名称 | 金额 |
| 1 | 存出保证金 | 3,670.77 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 194,827.39 |
| 5 | 应收申购款 | 162,509.51 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 361,007.67 |

**5.11.4期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

金额单位：人民币元

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（％） |
| 1 | 132013 | 17宝武EB | 3,079,500.00 | 7.58 |
| 2 | 132015 | 18中油EB | 2,369,721.90 | 5.83 |
| 3 | 132005 | 15国资EB | 1,517,840.50 | 3.74 |
| 4 | 110045 | 海澜转债 | 1,458,900.00 | 3.59 |
| 5 | 110059 | 浦发转债 | 1,392,439.10 | 3.43 |
| 6 | 132009 | 17中油EB | 1,004,400.00 | 2.47 |
| 7 | 128029 | 太阳转债 | 967,629.00 | 2.38 |
| 8 | 113020 | 桐昆转债 | 892,430.00 | 2.20 |
| 9 | 113011 | 光大转债 | 834,165.60 | 2.05 |
| 10 | 113021 | 中信转债 | 765,377.10 | 1.88 |
| 11 | 120002 | 18中原EB | 760,852.00 | 1.87 |
| 12 | 123046 | 天铁转债 | 732,040.40 | 1.80 |
| 13 | 113504 | 艾华转债 | 660,937.20 | 1.63 |
| 14 | 113542 | 好客转债 | 567,546.90 | 1.40 |
| 15 | 128067 | 一心转债 | 559,171.60 | 1.38 |
| 16 | 128075 | 远东转债 | 352,212.80 | 0.87 |
| 17 | 113519 | 长久转债 | 320,094.40 | 0.79 |
| 18 | 113562 | 璞泰转债 | 283,950.40 | 0.70 |
| 19 | 110034 | 九州转债 | 234,868.50 | 0.58 |
| 20 | 128095 | 恩捷转债 | 209,434.80 | 0.52 |
| 21 | 128028 | 赣锋转债 | 208,798.40 | 0.51 |
| 22 | 128102 | 海大转债 | 189,614.70 | 0.47 |
| 23 | 128056 | 今飞转债 | 129,932.00 | 0.32 |
| 24 | 123028 | 清水转债 | 123,332.00 | 0.30 |
| 25 | 113567 | 君禾转债 | 120,182.40 | 0.30 |
| 26 | 123045 | 雷迪转债 | 118,336.70 | 0.29 |
| 27 | 113570 | 百达转债 | 116,488.30 | 0.29 |
| 28 | 110058 | 永鼎转债 | 116,370.00 | 0.29 |
| 29 | 113568 | 新春转债 | 116,182.00 | 0.29 |
| 30 | 110064 | 建工转债 | 108,763.20 | 0.27 |

**5.11.5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。

**5.11.6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

单位：份

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 项目 | 交银增利增强债券A | 交银增利增强债券C |
| 报告期期初基金份额总额 | 15,201,423.53 | 3,792,719.09 |
| 本报告期期间基金总申购份额 | 10,193,427.92 | 13,001,858.65 |
| 减：本报告期期间基金总赎回份额 | 3,971,522.49 | 8,680,534.81 |
| 本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 | 21,423,328.96 | 8,114,042.93 |

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**

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**

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 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**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 投资者类别  | 报告期内持有基金份额变化情况 | 报告期末持有基金情况 |
| 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 个人 | 1 | 2020/7/1-2020/9/30 | 4,064,227.64 | - | - | 4,064,227.64 | 13.76% |

|  |
| --- |
| 产品特有风险 |
| 本基金本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例超过基金总份额20%的情况。如该类投资者集中赎回，可能会对本基金带来流动性冲击，从而影响基金的投资运作和收益水平。基金管理人将加强流动性管理，防范相关风险，保护持有人利益。 |

**8.2 影响投资者决策的其他重要信息**

1、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2020年7月20日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德增利增强债券型证券投资基金可投资科创板股票的公告》。

2、为更好地维护基金份额持有人的利益，提高本基金基金份额净值的精确度，本基金管理人经与基金托管人协商一致，并报中国证券监督管理委员会备案，自2020年7月27日起调整本基金的基金份额净值计算小数点后保留位数，由保留到小数点后3位调整为小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，并对本基金的基金合同、托管协议作相应修改。详情请查阅本基金管理人于2020年7月24日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于调整旗下11只公募基金的基金份额净值计算小数点后保留位数并修改基金合同、托管协议的公告》。

# §9 备查文件目录

**9.1备查文件目录**

1、中国证监会准予交银施罗德增利增强债券型证券投资基金募集注册的文件；

2、《交银施罗德增利增强债券型证券投资基金基金合同》；

3、《交银施罗德增利增强债券型证券投资基金招募说明书》；

4、《交银施罗德增利增强债券型证券投资基金托管协议》；

5、关于申请募集注册交银施罗德增利增强债券型证券投资基金的法律意见书；

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增利增强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。