**交银施罗德增强收益债券型证券投资基金**

**（交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金）**

**2016年第4季度报告**

**2016年12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：二〇一七年一月十九日**

# §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2017年1月18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。

交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金保本周期期限三年，自交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金基金合同生效日（即2013年12月25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2016年12月26日。交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金保本周期到期后，已按照《交银施罗德荣泰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“交银施罗德增强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“519729”。 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、估值方法及基金费率等按照《交银施罗德增强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2016年10月1日起至12月31日止。其中，自2016年12月26日（含）起至2016年12月29日（含）止为交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金保本周期到期期间，并自2016年12月30日起，交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金正式转型为交银施罗德增强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2016年10月1日起至2016年12月29日止，基金转型后的报告期为2016年12月30日起至2016年12月31日。

# §2 基金产品概况

**2.1交银施罗德增强收益债券型证券投资基金**

|  |  |
| --- | --- |
| 基金简称 | 交银增强收益债券 |
| 基金主代码 | 519729 |
| 交易代码 | 519729 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2016年12月30日 |
| 报告期末基金份额总额 | 78,679,121.31份 |
| 投资目标 | 在严格控制投资风险的基础上，力争实现基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金将依据宏观经济数据和金融运行数据、货币政策、财政政策、以及债券市场和股票市场风险收益特征，分析判断市场利率水平变动趋势和股票市场走势。并根据宏观经济、基准利率水平、股票市场整体估值水平，预测债券、可转债、新股申购等大类资产下一阶段的预期收益率水平，结合各类别资产的波动性以及流动性状况分析，进行大类资产配置。 |
| 业绩比较基准 | 90%×中证综合债券指数收益率+10%×沪深300指数收益率 |
| 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，属于证券投资基金中中等风险品种。 |
| 基金管理人 | 交银施罗德基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 |

注：1、上表中“报告期末”指2016年12月31日。

 2、本基金于2016年12月30日由交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金转型为交银施罗德增强收益债券型证券投资基金基金，新基金合同及托管协议即日起生效。

**2.2 交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金**

|  |  |
| --- | --- |
| 基金简称 | 交银荣泰保本混合 |
| 基金主代码 | 519729 |
| 交易代码 | 519729 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2013年12月25日 |
| 报告期末基金份额总额 | 83,494,667.24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，通过稳健资产与风险资产的动态配置和有效的组合管理，力争实现基金资产的稳定增长 |
| 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 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 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2016年12月29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：2016年12月30日-2016年12月31日 | 报告期：2016年10月1日-2016年12月29日 |
| 1.本期已实现收益 | 22,493.85 | 4,783,488.46 |
| 2.本期利润 | 26,493.85 | 2,374,747.23 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0003 | 0.0204 |
| 4.期末基金资产净值 | 99,968,966.85 | 106,058,216.36 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.271 | 1.270 |

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、交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金从2016年12月30日起正式转型为交银施罗德增强收益债券型证券投资基金。

**3.2 基金净值表现**

**3.2.1 交银施罗德增强收益债券型证券投资基金**

**（报告期：2016年12月30日-2016年12月31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 |
| 2016年12月30日-2016年12月31日 | 0.08% | 0.06% | 0.21% | 0.15% | -0.13% | -0.09% |

注：交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金从2016年12月30日起正式转型为交银施罗德增强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90%×中证综合债券指数收益率+10%×沪深300指数收益率。

**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**

交银施罗德增强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

（2016年12月30日-2016年12月31日）



注：本基金由交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金转型而来。基金转型日为2016年12月30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泰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2016年12月30日）起的3个月。截至2016年12月31日，本基金尚处于投资转型期。

**3.2.2 交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金**

**（报告期：2016年10月1日-2016年12月29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 |
| 2016年10月1日-2016年12月29日 | 1.60% | 0.12% | 0.69% | 0.01% | 0.91% | 0.11% |

注：交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金从2016年12月30日起正式转型为交银施罗德增强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**

交银施罗德荣泰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12月25日-2016年12月29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 |
| 孙超 | 交银增利债券、交银纯债债券发起、交银荣祥保本混合、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、交银丰润收益债券、交银丰享收益债券、交银丰泽收益债券、交银丰硕收益债券、交银荣鑫保本混合的基金经理，公司固定收益部助理总经理 | 2015-11-07 | - | 5年 | 孙超先生，美国哥伦比亚大学经济学硕士。历任中信建投证券股份有限公司资产管理部经理、高级经理。2013年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任基金经理助理。2014年8月26日至2015年11月17日担任交银施罗德理财60天债券型证券投资基金基金经理，2014年8月26日至2015年11月17日担任交银施罗德双轮动债券型证券投资基金基金经理，2015年11月7日至2016年12月29日担任交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金基金经理。 |
| 章妍 | 交银荣祥保本混合、交银增强收益债券、交银裕通纯债债券、交银裕兴纯债债券、交银裕盈纯债债券、交银裕利纯债债券的基金经理 | 2015-11-21 | - | 1年 | 章妍女士，复旦大学金融学硕士、中央财经大学统计学学士。9年金融行业证券投资工作经验，历任太平洋资产管理有限公司高级投资经理、资深投资经理。2015年加入交银施罗德基金管理有限公司。2015年11月21日至2016年12月29日担任交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金基金经理。 |

注：1、孙超先生自2015年11月7日至2016年12月29日担任交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金基金经理，并自2016年12月30日起继续担任转型后的交银施罗德增强收益债券型证券投资基金基金经理至今。

 章妍女士于2015年11月21日至2016年12月29日担任交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金基金经理，并自2016年12月30日起继续担任转型后的交银施罗德增强收益债券型证券投资基金基金经理至今。

 2、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，受央行收紧流动性、美国加息等多重利空因素影响，债券市场呈现大幅调整格局，收益率上行至2015年三季度之前的水平。

2016年四季度A股市场先涨后跌，总体小幅上涨。低估值蓝筹股表现较好。

本基金在2016年12月26日结束保本周期，在本报告期内以短久期期限匹配固定收益产品为主，配合中性股票仓位，并在12月初逐步降低股票仓位至0。因此本基金受2016年12月股票和债券市场下跌的影响不大。

展望2017年一季度，债券市场预计仍以震荡格局为主，受制于房价、去杠杆和全球流动性收紧预期，叠加春节及季末因素，资金面仍将保持中性偏紧。在汇率和地产调控的风险阶段性的化解及流动性紧张缓解后，A股市场有望改变弱势。本基金仍将以稳健思路操作，计划重点参与固定收益资产，以期累计一定收益，并择机逐步提高权益仓位，同时尽力控制权益仓位带来的回撤。

**4.5报告期内基金的业绩表现**

截至2016年12月31日，交银施罗德增强收益债券型证券投资基金份额净值为1.271元，自2016年12月30日至2016年12月31日其份额净值增长率为0.08%，同期业绩比较基准增长率为0.21%。

截至2016年12月29日，交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金份额净值为1.270元，自2016年10月1日至2016年12月29日其份额净值增长率为1.60%，同期业绩比较基准增长率为0.69%。

**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交银施罗德增强收益债券型证券投资基金**

**（报告期：2016年12月30日-2016年12月31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 | - | - |
|  | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 固定收益投资 | 9,957,000.00 | 9.35 |
|  | 其中：债券 | 9,957,000.00 | 9.35 |
|  | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | 87,000,000.00 | 81.73 |
|  | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 6,366,611.05 | 5.98 |
| 7 | 其他各项资产 | 3,121,609.68 | 2.93 |
| 8 | 合计 | 106,445,220.73 | 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沪港通投资股票投资组合**

本基金本报告期末未持有通过沪港通投资的股票。

**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**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 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 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | 9,957,000.00 | 9.96 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 9,957,000.00 | 9.96 |

**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 | 011698470 | 16南航股SCP009 | 100,000 | 9,957,000.00 | 9.96 |

**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 | 39,639.09 |
| 2 | 应收证券清算款 | 3,015,722.20 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 66,248.39 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 3,121,609.68 |

**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 交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金**

**（报告期：2016年10月1日-2016年12月29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 | 固定收益投资 | 9,953,000.00 | 8.94 |
|  | 其中：债券 | 9,953,000.00 | 8.94 |
|  | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | 90,000,000.00 | 80.88 |
|  | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 2,189,008.23 | 1.97 |
| 7 | 其他资产 | 9,136,076.53 | 8.21 |
| 8 | 合计 | 111,278,084.76 | 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沪港通投资股票投资组合**

本基金本报告期末未持有通过沪港通投资的股票。

**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 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | 9,953,000.00 | 9.39 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 9,953,000.00 | 9.39 |

**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 | 011698470 | 16南航股SCP009 | 100,000 | 9,953,000.00 | 9.39 |

**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 | 39,639.09 |
| 2 | 应收证券清算款 | 9,034,136.11 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 62,301.33 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 9,136,076.53 |

**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 开放式基金份额变动**

**6.1 交银施罗德增强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 | 83,494,667.24 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 | - |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | 4,815,545.93 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 78,679,121.31 |

注：1、上表中“报告期”指2016年12月30日至2016年12月31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 交银施罗德荣泰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 | 120,335,230.83 |
| 本报告期期间基金总申购份额 | - |
| 减：本报告期期间基金总赎回份额 | 36,840,563.59 |
| 本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 | 83,494,667.24 |

注：1、上表中“报告期”指2016年10月1日至2016年12月29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**

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

交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金保本周期期限三年，自交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金基金合同生效日（即2013年12月25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2016年12月26日。交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金保本周期到期后，已按照《交银施罗德荣泰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“交银施罗德增强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“519729”。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、估值方法及基金费率等按照《交银施罗德增强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。

交银施罗德荣泰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增强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2016年12月19日发布的《交银施罗德荣泰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增强收益债券型证券投资基金转型后运作相关业务规则的公告》及刊登在2016年12月19日《中国证券报》、2016年12月20日《上海证券报》和2016年12月21日《证券时报》上的交银施罗德增强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增强收益债券型证券投资基金的相关基金法律文件。

# §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泰保本混合型证券投资基金募集的文件；

2、《交银施罗德增强收益债券型证券投资基金基金合同》；

3、《交银施罗德增强收益债券型证券投资基金招募说明书》；

4、《交银施罗德增强收益债券型证券投资基金托管协议》；

5、《交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金基金合同》；

6、《交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金招募说明书》；

7、《交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金托管协议》；

8、《交银施罗德荣泰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泰保本混合型证券投资基金之法律意见书；

12、关于交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金保本周期到期转型及基金合同修改的法律意见；

13、报告期内交银施罗德增强收益债券型证券投资基金、交银施罗德荣泰保本混合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，www.bocomschroder.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。