# 交银施罗德先锋股票证券投资基金

## 2009年第四季度报告

2009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:中国农业银行股份有限公司　报告送出日期:二〇一〇年一月二十一日

### §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 2010 年 1 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 2009 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

### §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 交银先锋股票 |
| 基金主代码 | 519698 |
| 前端交易代码 | 519698 |
| 后端交易代码 | 519699 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2009年 4 月 10 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 2,707,245,189.29 份 |
| 投资目标 | 本基金主要通过投资于经过严格的品质筛选且具有持续成长潜力企业的股票,特别是处于快速成长过程中的中型及小型企业股票,在适度控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求长期持续的资本增值。 |
| 投资策略 | 本基金充分发挥基金管理人的研究优势,在分析和判断宏观经济运行和行业景气变化,以及上市公司成长潜力的基础上,主要通过优选成长性好、成长具有可持续性、成长质量优良、定价相对合理的股票,特别是处于快速成长过程中的中型及小型企业股票进行投资,以谋求超额收益。 |
| 业绩比较基准 | 75% × 中证 700 指数 +25% × 中信全债指数 |
| 风险收益特征 | 本基金是一只股票型基金,以具有持续成长潜力企业的股票,特别是处于快速成长过程中的中型及小型企业为主要投资对象,属于证券投资基金中较高预期收益和较高风险的品种。 |
| 基金管理人 | 交银施罗德基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国农业银行股份有限公司 |

### §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(2009 年 10 月 1 日 -2009 年 12 月 31 日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 201,587,478.40 |
| 2.本期利润 | 585,100,174.67 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.1970 |
| 4.期末基金资产净值 | 3,372,459,135.75 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.2457 |

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。

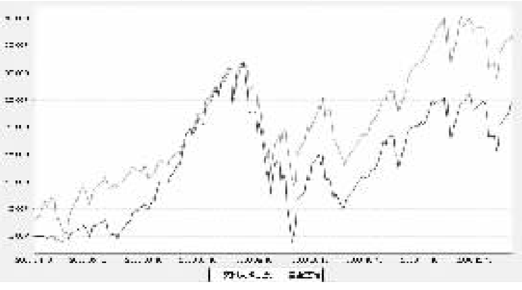
3.2 基金净值表现

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

| 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 | 16.88% | 1.60% | 20.28% | 1.45% | –3.40% | 0.15% |
| 自基金合同生效起至今 | 24.57% | 1.67% | 36.86% | 1.58% | –12.29% | 0.09% |

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

交银施罗德先锋股票证券投资基金
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
(2009 年 4 月 10 日至 2009 年 12 月 31 日)



注:本基金基金合同生效日为 2009 年 4 月 10 日,基金合同生效日至报告期期末,本基金运作时间未满一年。本基金建仓期为自基金合同生效日起的 6 个月。截至 2009 年 12 月 31 日,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 | | |
| 史伟 | 本基金的基金经理 | 2009–4–10 | – | 8年 | 史伟先生,中国国籍。英国雷丁大学经济学硕士。历任东方证券证券投资部行业研究员,华宝兴业基金管理有限公司高级研究员、基金经理助理、基金经理。2008年 4 月加入交银施罗德基金管理有限公司。 |

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》、《交银施罗德先锋股票证券投资基金基金合同》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

公平交易制度的执行情况:本公司有严格的投资控制制度和风险监控制度来保证旗下基金运作的公平,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。本投资组合与公司旗下管理的不同投资组合的整体收益率、分投资类别(股票、债券)的收益率以及不同时间窗内(同日内、5 日内、10 日内)同向交易的交易价格并未发现异常差异。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本公司旗下无与本基金投资风格相似的其他投资组合。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未发现异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2009 年四季度证券市场呈现震荡上涨的格局。2009 年 9 月份市场从 8 月份的暴跌中出现了反弹,多数股票跟随指数出现了一定上涨。10 月份开始,伴随着汽车、地产销售的再次转好,市场逐步走强,11 月、12 月周期类消费品出现较大超额收益;同时题材股非常活跃,如甲流、物联网等等,小股票的超额收益显著大于大股票。

本基金根据 9 月份 M1 上穿 M2,以及日趋活跃的实体经济,判断证券市场有望符合一般历史规律,即在这样的宏观状态下大股票更容易出现超额收益,但是小股票却反复活跃,对本基金投资也造成了一定影响。

展望 2010 年全年,经济增速在相对高位,就目前而言通胀的压力还不大,根据投资时钟理论,对股票市场应该做出相对乐观的判断。但是我们需要注意是,本次中央经济工作会议对于 2010 年的经济政策描述相对模糊与灵活,如"保持货币政策的稳定性与连续性,但提高针对性和有效性等等";同时中央对地产和房价的调控,对房地产行业和经济前景带来一定的不确定性,所以从贯穿全年的角度,我们需要保持一定的冷静和谨慎。

预计 2010 年一季度是全年企业业绩增速较高和流动性相对充裕的时间段,虽然市场担心国家宏观刺激政策的逐步退出,但是我们也可以通过国家出台限售股征税与融资融券以及股指期货,感受到管理层对证券市场的呵护,综合这种情况,本基金认为投资者以乐观心态面对股市会更加合适。

本基金将按照基金合同与各项法律法规的要求下,注重自上而下的资产、行业配置与自下而上的精选个股相结合,争取为基金份额持有人获得持续稳定的投资回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2009 年 12 月 31 日,本基金份额净值为 1.2457 元,本报告期份额净值增长率为 16.88%,同期业绩比较基准增长率为 20.28%。

### §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 | 3,065,178,411.57 | 90.02 |
| | 其中:股票 | 3,065,178,411.57 | 90.02 |
| 2 | 固定收益投资 | – | – |
| | 其中:债券 | – | – |
| | 资产支持证券 | – | – |
| 3 | 金融衍生品投资 | – | – |
| 4 | 买入返售金融资产 | – | – |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | – | – |
| 5 | 银行存款和结算备付金合计 | 290,398,143.60 | 8.53 |
| 6 | 其他资产 | 49,270,826.97 | 1.45 |
| 7 | 合计 | 3,404,847,382.14 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 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 | 采掘业 | 275,987,209.13 | 8.18 |
| C | 制造业 | 1,644,932,352.86 | 48.78 |
| C0 | 食品、饮料 | 58,236,923.68 | 1.73 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | – | – |
| C2 | 木材、家具 | – | – |
| C3 | 造纸、印刷 | – | – |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 588,752,773.99 | 17.46 |
| C5 | 电子 | – | – |
| C6 | 金属、非金属 | 414,355,551.59 | 12.29 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 550,237,222.00 | 16.32 |
| C8 | 医药、生物制品 | 33,349,881.60 | 0.99 |
| C99 | 其他制造业 | – | – |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 34,010,251.00 | 1.01 |
| E | 建筑业 | 15,512,352.00 | 0.46 |
| F | 交通运输、仓储业 | – | – |
| G | 信息技术业 | 170,757,812.29 | 5.06 |
| H | 批发和零售贸易 | 16,832,547.00 | 0.50 |
| I | 金融、保险业 | 703,514,070.45 | 20.86 |
| J | 房地产业 | 164,824,206.73 | 4.89 |
| K | 社会服务业 | 3,600,298.32 | 0.11 |
| L | 传播与文化产业 | – | – |
| M | 综合类 | 35,207,311.79 | 1.04 |
| | 合计 | 3,065,178,411.57 | 90.89 |

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 | 600315 | 上海家化 | 7,738,488 | 254,596,255.20 | 7.55 |
| 2 | 600036 | 招商银行 | 10,209,886 | 184,288,442.30 | 5.46 |
| 3 | 600031 | 三一重工 | 4,335,451 | 159,587,951.31 | 4.73 |
| 4 | 600585 | 海螺水泥 | 2,793,703 | 139,294,031.58 | 4.13 |
| 5 | 601166 | 兴业银行 | 3,274,028 | 131,976,068.68 | 3.91 |
| 6 | 601169 | 北京银行 | 6,080,000 | 117,587,200.00 | 3.49 |
| 7 | 600426 | 华鲁恒升 | 4,972,651 | 116,807,571.99 | 3.46 |
| 8 | 000402 | 金 融 街 | 9,541,461 | 115,737,921.93 | 3.43 |
| 9 | 000983 | 西山煤电 | 2,853,989 | 113,845,621.21 | 3.38 |
| 10 | 000898 | 鞍钢股份 | 6,318,924 | 101,102,784.00 | 3.00 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期期末未持有债券。

5.5 报告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

本基金本报告期期末未持有债券。

5.6 报告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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | – |
| 2 | 应收证券清算款 | 19,316,450.47 |
| 3 | 应收股利 | – |
| 4 | 应收利息 | 64,178.50 |
| 5 | 应收申购款 | 29,890,198.00 |
| 6 | 其他应收款 | – |
| 7 | 待摊费用 | – |
| 8 | 其他 | – |
| 9 | 合计 | 49,270,826.97 |

5.8.4 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。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.8.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

1、交银施罗德基金管理有限公司期末持有本基金份额 30,010,550.00 份,占本基金期末总份额的1.11%,报告期内未发生申购、赎回。

2、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

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 3,402,947,854.77 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 479,405,830.84 |
| 报告期期间基金总赎回份额 | 1,175,108,496.32 |
| 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 | 2,707,245,189.29 |

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 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会核准交银施罗德先锋股票证券投资基金募集的文件;

2、《交银施罗德先锋股票证券投资基金基金合同》;

3、《交银施罗德先锋股票证券投资基金招募说明书》;

4、《交银施罗德先锋股票证券投资基金托管协议》;

5、基金管理人业务资格批件、营业执照;

6、基金托管人业务资格批件、营业执照;

7、关于申请募集交银施罗德先锋股票证券投资基金之法律意见书;

8、报告期内交银施罗德先锋股票证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

7.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

7.3 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.jyfund.com,www.jysld.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。

---

# 交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金

## 2009年第四季度报告

2009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:二〇一〇年一月二十一日

### §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 2010 年 1 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 2009 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

### §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 交银稳健配置混合 |
| 基金主代码 | 519690 |
| 前端交易代码 | 519690 |
| 后端交易代码 | 519691 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2006年 6 月 14 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 4,839,757,824.32 份 |
| 投资目标 | 本基金将坚持并不断深化价值投资的基本理念,充分发挥专业研究与管理能力,根据宏观经济周期和市场环境的变化,自上而下灵活配置资产,自下而上精选证券,有效分散风险,谋求实现基金财产的长期稳定增长。 |
| 投资策略 | 把握宏观经济和投资市场的变化趋势,根据经济周期理论动态调整投资组合比例,自上而下配置资产,自下而上精选证券,有效分散风险。 |
| 业绩比较基准 | 65% × MSCI 中国 A 股指数 +35% × 新华巴克莱资本中国全债指数 |
| 风险收益特征 | 本基金是一只混合型基金,属于证券投资基金产品中的中等风险品种,本基金的风险与预期收益处于股票型基金和债券型基金之间。 |
| 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 |

### §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(2009 年 10 月 1 日 -2009 年 12 月 31 日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 518,117,163.70 |
| 2.本期利润 | 1,773,455,999.12 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.3374 |
| 4.期末基金资产净值 | 10,846,268,794.78 |
| 5.期末基金份额净值 | 2.2411 |

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。

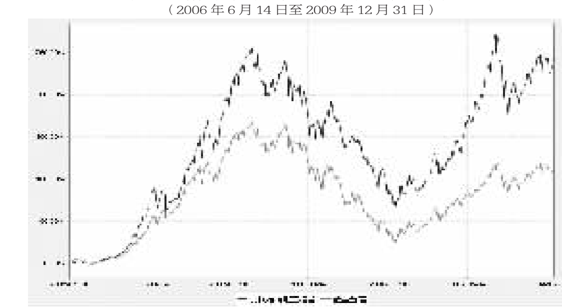
3.2 基金净值表现

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

| 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 | 16.53% | 1.64% | 12.44% | 1.13% | 4.09% | 0.51% |
| 自基金合同生效起至今 | 243.10% | 1.93% | 114.10% | 1.53% | 129.00% | 0.40% |

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

交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金
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
(2006 年 6 月 14 日至 2009 年 12 月 31 日)



注:本基金建仓期为自基金合同生效日起的 6 个月。截至 2009 年 12 月 31 日,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 | | |
| 李立 | 本基金的基金经理、交银施罗德精选股票证券投资基金基金经理、公司权益部副总经理 | 2009–8–21 | – | 8年 | 李立先生,中国国籍。经济学硕士。历任中国科技证券有限公司高级经理,招商基金管理有限公司股票投资高级经理,2006年加入交银施罗德基金管理有限公司,曾任投资研究部研究员和基金经理助理。 |
| 华昕 | 本基金的基金经理、公司研究总监 | 2009–9–10 | – | 13年 | 华昕先生,中国国籍。牛津大学商学院MBA。历任北京房地产信托投资公司上海证券业务部证券分析研究员,日兴证券有限公司投资分析师,和升国际有限公司中国研究主管,大华继显有限公司中国研究部主管,中银国际控股有限公司执行总经理。2008 年 2 月加入交银施罗德基金管理有限公司。 |

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》、《交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金基金合同》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

公平交易制度的执行情况:本公司有严格的投资控制制度和风险监控制度来保证旗下基金运作的公平,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。本投资组合与公司旗下管理的不同投资组合的整体收益率、分投资类别(股票、债券)的收益率以及不同时间窗内(同日内、5 日内、10 日内)同向交易的交易价格并未发现异常差异。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本投资组合与公司旗下同属于中高风险投资风格的一只追求绝对收益的专户理财产品之间的 2009 年第四季度业绩表现差异大于 5%。投资组合之间的业绩表现差异主要来源于基金经理行业配置和选股策略及基金产品投资范围和运作机制上的不同,无不公平交易因素。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未发现异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2009 年四季度,一方面中国经济增长加速恢复,全球经济复苏迹象也愈发明显,另一方面,政府开始考虑逐步退出刺激经济政策,特别是地产调控的严厉程度超出预期,因此 A 股市场较为波动,但总体震荡上行。虽然企业盈利持续回升,在货币政策收缩的预期下,市场估值受到抑制,因此投资者心态较为谨慎。稳定成长类公司和各类题材股票表现良好,权重周期性行业持续调整。本基金在报告期内,首先减少了现金持有量、增加了股票资产比重,其次增加了资源瓶颈行业的资产比重、减持了估值到位的行业,一定程度上分享了市场上行带来的收益。

展望 2010 年一季度,经济增长势头将有望依然保持强劲,虽然投资增速会有所放缓,但海外经济的复苏将拉动出口,而消费增速仍将保持高位,随着 PPI 的快速回升,企业盈利的恢复将超预期。然而 CPI 的快速反弹将推升通胀预期,加重投资者对货币政策紧缩的预期,从而推动市场估值下移;最近出台的地产调控政策也将在短期抑制房地产的销量,因此我们预计市场可能仍将宽幅震荡。本基金将密切关注宏观数据和政策预期的变化,增加大类资产配置的灵活度,同时加大受益于 PPI 回升和促内需调结构政策的行业的配置,力争为基金份额持有人带来稳定的回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2009 年 12 月 31 日,本基金份额净值为 2.2411 元,本报告期份额净值增长率为 16.53%,同期业绩比较基准增长率为 12.44%。

### §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 | 9,988,562,836.43 | 90.88 |
| | 其中:股票 | 9,988,562,836.43 | 90.88 |
| 2 | 固定收益投资 | 560,251,000.00 | 5.10 |
| | 其中:债券 | 560,251,000.00 | 5.10 |
| | 资产支持证券 | – | – |
| 3 | 金融衍生品投资 | – | – |
| 4 | 买入返售金融资产 | – | – |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | – | – |
| 5 | 银行存款和结算备付金合计 | 340,494,685.82 | 3.10 |
| 6 | 其他资产 | 101,623,615.72 | 0.92 |
| 7 | 合计 | 10,990,932,137.97 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 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 | 采掘业 | 1,981,011,233.27 | 18.26 |
| C | 制造业 | 4,150,786,670.69 | 38.27 |
| C0 | 食品、饮料 | 413,632,000.00 | 3.81 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | 5,259,362.79 | 0.05 |
| C2 | 木材、家具 | – | – |
| C3 | 造纸、印刷 | – | – |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 696,094,848.46 | 6.42 |
| C5 | 电子 | 262,630,994.97 | 2.42 |
| C6 | 金属、非金属 | 1,110,181,790.42 | 10.24 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 1,569,190,104.45 | 14.47 |
| C8 | 医药、生物制品 | 72,417,740.64 | 0.67 |
| C99 | 其他制造业 | 21,379,828.96 | 0.20 |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | – | – |
| E | 建筑业 | 6,402,548.44 | 0.06 |
| F | 交通运输、仓储业 | – | – |
| G | 信息技术业 | 206,619,215.67 | 1.90 |
| H | 批发和零售贸易 | 315,496,191.64 | 2.91 |
| I | 金融、保险业 | 2,707,698,975.98 | 24.96 |
| J | 房地产业 | 515,312,685.20 | 4.75 |
| K | 社会服务业 | 15,542,284.00 | 0.14 |
| L | 传播与文化产业 | – | – |
| M | 综合类 | 89,693,031.54 | 0.83 |
| | 合计 | 9,988,562,836.43 | 92.09 |

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 | 600036 | 招商银行 | 28,499,638 | 514,418,465.90 | 4.74 |
| 2 | 601699 | 潞安环能 | 9,577,981 | 495,947,856.18 | 4.57 |
| 3 | 601169 | 北京银行 | 24,059,420 | 465,309,182.80 | 4.29 |
| 4 | 601166 | 兴业银行 | 11,457,549 | 461,853,800.19 | 4.26 |
| 5 | 600019 | 宝钢股份 | 43,999,798 | 425,038,048.68 | 3.92 |
| 6 | 000792 | 盐湖钾肥 | 6,485,367 | 369,601,065.33 | 3.41 |
| 7 | 601088 | 中国神华 | 10,356,612 | 360,617,229.84 | 3.32 |
| 8 | 601601 | 中国太保 | 13,000,556 | 333,074,244.72 | 3.07 |
| 9 | 601001 | 大同煤业 | 7,179,289 | 322,996,212.11 | 2.98 |
| 10 | 000568 | 泸州老窖 | 8,000,000 | 312,320,000.00 | 2.88 |

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 | – | – |
| 2 | 央行票据 | 560,251,000.00 | 5.17 |
| 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 | 可转债 | – | – |
| 7 | 其他 | – | – |
| 8 | 合计 | 560,251,000.00 | 5.17 |

5.5 报告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

| 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 | 0701026 | 07央行票据 26 | 1,900,000 | 190,798,000.00 | 1.76 |
| 2 | 0901042 | 09央行票据 42 | 1,400,000 | 137,564,000.00 | 1.27 |
| 3 | 0901046 | 09央行票据 46 | 1,200,000 | 117,888,000.00 | 1.09 |
| 4 | 0901055 | 09央行票据 55 | 500,000 | 49,835,000.00 | 0.46 |
| 5 | 0701085 | 07央行票据 85 | 440,000 | 44,528,000.00 | 0.41 |

5.6 报告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。

5.7 报告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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。在报告期内本基金投资的前十名证券除盐湖钾肥之外在本报告编制日前一年内未受到公开谴责和处罚。

报告期内本基金投资的盐湖钾肥(证券代码:000792)于 2009 年 2 月 27 日公告,该公司由于公司销售部门在 2008 年部分销售期间,未及时严格履行监管部门制订的氯化钾销售临时指导价格(公司氯化钾售价超出指导价),监管部门对公司 2008 年进行了 500 万元的相关经济处罚。

本基金管理人对该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股的投资有严格的投资决策流程控制。本基金在重大事件发生前已经持有该证券,对该证券的投资也严格执行投资决策流程。在对该证券的选择上,严格执行公司股票池审核流程进入核心股票池;在对该证券的持有过程中公司研究员密切关注上市公司动向,在上述事件发生时及时分析其对投资决策的影响,经过分析认为此事件对上市公司财务状况、经营成果和现金流量未产生重大的实质性影响,所以不影响对该公司基本面和公司治理的投资判断。

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 12,538,260.39 |
| 2 | 应收证券清算款 | 68,692,174.89 |
| 3 | 应收股利 | – |
| 4 | 应收利息 | 7,032,600.86 |
| 5 | 应收申购款 | 13,360,579.58 |
| 6 | 其他应收款 | – |
| 7 | 待摊费用 | – |
| 8 | 其他 | – |
| 9 | 合计 | 101,623,615.72 |

5.8.4 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。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.8.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

1、交银施罗德基金管理有限公司期末持有本基金份额 53,110,370.40 份,占本基金期末总份额的1.10%。报告期内未发生申购、赎回;

2、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

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 5,713,840,284.00 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 459,556,674.21 |
| 报告期期间基金总赎回份额 | 1,333,639,133.89 |
| 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 | 4,839,757,824.32 |

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 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会批准交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金募集的文件;

2、《交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金基金合同》;

3、《交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金招募说明书》;

4、《交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金托管协议》;

5、关于募集交银施罗德稳健配置混合型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稳健配置混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

7.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

7.3 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.jyfund.com,www.jysld.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。

---

# 交银施罗德增利债券证券投资基金

## 2009年第四季度报告

2009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:二〇一〇年一月二十一日

### §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 2010 年 1 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 2009 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

### §2 基金产品概况

| | | |
|---|---|---|
| 基金简称 | 交银增利债券 | |
| 基金主代码 | 519680 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2008年 3 月 31 日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 3,301,018,399.96 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,自下而上个券选配,在控制信用风险、利率风险、流动性风险前提下,主要通过投资承担一定信用风险、具有较高息票率的债券,实现基金资产的长期稳定增长。 | |
| 投资策略 | 本基金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、期限结构配置及债券类别配置,自下而上地配置债券类属和精选个券。 | |
| 业绩比较基准 | 中债企业债总指数 | |
| 风险收益特征 | 本基金是一只债券型基金,在证券投资基金中属于中等风险的品种,其长期平均风险和预期收益高于货币市场基金,低于股票型基金。 | |
| 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 | |
| 下属两级基金的基金简称 | 交银增利债券 A/B | 交银增利债券 C |
| 下属两级基金的交易代码 | 519680(前端)、519681(后端) | 519682 |
| 报告期末下属两级基金的份额总额 | 2,245,625,490.64 份 | 1,055,392,909.32 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(2009 年 10 月 1 日 -2009 年 12 月 31 日) | |
|---|---|---|
| | 交银增利债券 A/B | 交银增利债券 C |
| 1.本期已实现收益 | 43,691,422.35 | 21,982,470.44 |
| 2.本期利润 | 120,540,363.03 | 68,294,414.68 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0529 | 0.0549 |
| 4.期末基金资产净值 | 2,430,039,608.48 | 1,138,152,201.01 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.0821 | 1.0784 |

注:1、本基金 A/B 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、交银增利债券 A/B:

| 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 | 5.02% | 0.31% | 0.67% | 0.08% | 4.35% | 0.23% |
| 自基金合同生效起至今 | 20.92% | 0.35% | 6.05% | 0.22% | 14.87% | 0.13% |

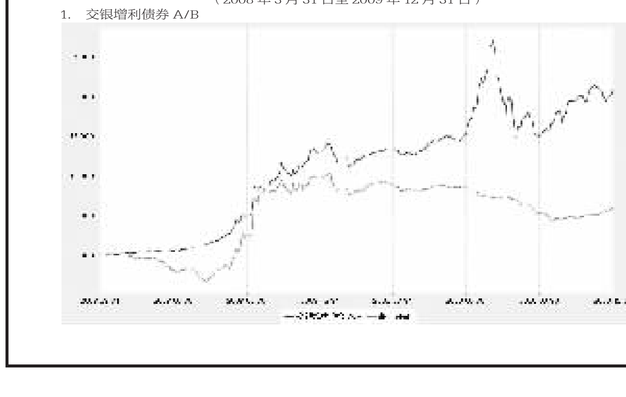
2、交银增利债券 C:

| 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 | 4.90% | 0.31% | 0.67% | 0.08% | 4.23% | 0.23% |
| 自基金合同生效起至今 | 19.98% | 0.35% | 6.05% | 0.22% | 13.93% | 0.13% |

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

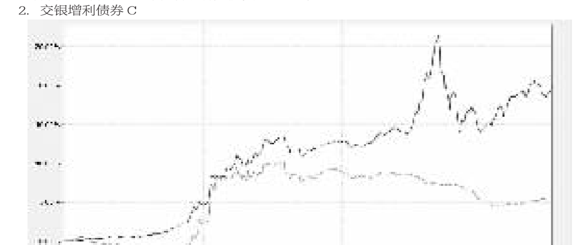
交银施罗德增利债券证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2008 年 3 月 31 日至 2009 年 12 月 31 日)

1. 交银增利债券 A/B



注:本基金建仓期为自基金合同生效日起的 6 个月。截至 2009 年 12 月 31 日,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 2009 年 12 月 31 日,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 | | |
| 李家春 | 本基金的基金经理、交银施罗德货币市场证券投资基金基金经理 | 2008–3–31 | – | 10年 | 李家春先生,中国国籍。香港大学 MBA。历任长江证券有限责任公司投资经理,汉唐证券有限责任公司高级经理、投资主管,泰信基金管理有限公司高级研究员。2006 年加入交银施罗德基金管理有限公司。 |
| 陈晓秋 | 本基金的基金经理、交银施罗德货币市场证券投资基金基金经理 | 2008–3–31 | 2009–10–31 | 7年 | 陈晓秋女士,中国国籍。经济学硕士。曾任富国基金管理有限公司研究策略部和投资部研究员,负责债券及宏观分析、债券投资。2005 年加入交银施罗德基金管理有限公司。 |

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》、《交银施罗德增利债券证券投资基金基金合同》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

公平交易制度的执行情况:本公司有严格的投资控制制度和风险监控制度来保证旗下基金运作的公平,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。本投资组合与公司旗下管理的不同投资组合的整体收益率、分投资类别(股票、债券)的收益率以及不同时间窗内(同日内、5 日内、10 日内)同向交易的交易价格并未发现异常差异。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本投资组合与公司旗下投资风格相似的其他投资组合之间的业绩表现未出现差异超过 5%的情形。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未发现异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2009 年四季度,我国社会消费品零售总额增速呈现小幅调整的态势,固定资产投资增速在严格控制过剩产能和信贷过快增长的政策环境下,也出现了一定的回落。而随着外需的逐步恢复,进出口贸易成为推动我国经济增速进一步加快的重要力量。根据海关总署的统计,进口与出口的月度同比在 10 月和 11 月相继结束了前期大幅下降的格局,进而在 12 月实现了 55.9%和 17.7%的正增长,环比增速也分别达到了 18.8%和 15%的水平。对外贸易的复苏不仅弥补了内需增长的阶段性放缓,更进一步推升工业增加值月度增速至接近 20%的水平。从内需到外需的全面增长增强了消费者和企业家信心指数。12 月全国制造业采购经理指数(PMI)亦达到 56.6%,高于 11 月 1.4 个百分点,创 2008 年 5 月以来的新高。

下半年尤其是四季度经济的全面复苏使得管理层制定政策的出发点和侧重点有所改变。2009 年中央经济工作会议在要求继续实施积极的财政政策和适度宽松的货币政策的同时, 提出要加强政策的针对性和灵活性,注重提高经济增长质量和效益,注重推动经济发展方式转变和经济结构调整。最明显的变化体现在,会后相关部门迅速出台了一系列调控房地产市场的政策,基本取消了本轮金融危机爆发后出台的针对房地产市场的所有优惠措施,甚至恢复了部分 2007 年的调控举措。而严厉的信贷控制也从总量角度开始修正货币政策过度宽松的状况。刺激政策的退出已经由预期转变为现实。

四季度影响投资者行为的另外一个重要因素是居民消费价格指数由负转正, 令投资者的通胀预期有所升温。处于初期相对温和的通胀预期、强劲的经济数据和持续改善的公司业绩推动了股票价格上涨。四季度,沪深 300 指数最终上涨了 19%,收复了 8 月调整中的大部分失地。债券市场则相反,由于物价水平的回升,中债－总指数下跌了 0.39%,信用债券则表现出对利率风险的免疫能力,中债－企业债净价指数上涨了 0.37%。

四季度,本基金基于对宏观经济的正确判断,保持了利率产品较低的配置比例和短久期策略,有效规避了利率风险。合理的信用债券配置比例在确保资产流动性的前提下进一步提升了基金净值的表现。股票市场回升令可转债和新股申购等投资对基金净值也做出了重要贡献。

展望 2010 年一季度,我国经济增长速度有望达到更高的水平,但可能在更长时间范围内将面临回调的压力。通胀水平的上升和资产价格泡沫会令刺激政策的退出更为坚决,信贷和货币供应量的控制将贯穿全年,紧缩的阴影对债券市场和股票市场均形成一定压力。但考虑到不同政策工具的不同影响,债券市场并非完全没有机会,机会大小在很大程度上取决于风险释放的大小。对于股票市场而言,流动性推动估值水平全面提升的阶段基本结束,上市公司业绩增长对股票价格的影响程度加大,挖掘成长性和业绩超预期的公司成为超额收益的主要来源。同时我们也将关注股指期货、融资融券业务的推出对债券市场和股票市场的影响,以控制风险。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2009 年 12 月 31 日, 交银增利 A/B 份额净值为 1.0821 元, 本报告期份额净值增长率为5.02%,同期业绩比较基准增长率为 0.67%;交银增利 C 份额净值为 1.0784 元,本报告期份额净值增长率为 4.90%,同期业绩比较基准增长率为 0.67%。

### §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 | 368,941,935.18 | 10.02 |
| | 其中:股票 | 368,941,935.18 | 10.02 |
| 2 | 固定收益投资 | 3,059,874,354.23 | 83.08 |
| | 其中:债券 | 3,056,017,044.28 | 82.97 |
| | 资产支持证券 | 3,857,309.95 | 0.10 |
| 3 | 金融衍生品投资 | – | – |
| 4 | 买入返售金融资产 | – | – |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | – | – |
| 5 | 银行存款和结算备付金合计 | 150,617,691.07 | 4.09 |
| 6 | 其他资产 | 103,627,778.76 | 2.81 |
| 7 | 合计 | 3,683,061,759.24 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 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 | 采掘业 | – | – |
| C | 制造业 | 123,495,622.39 | 3.46 |
| C0 | 食品、饮料 | 9,645,422.13 | 0.27 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | 14,937,475.96 | 0.42 |
| C2 | 木材、家具 | – | – |
| C3 | 造纸、印刷 | 4,134,234.79 | 0.12 |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 20,981,654.51 | 0.59 |
| C5 | 电子 | 480,047.58 | 0.01 |
| C6 | 金属、非金属 | 7,459,355.28 | 0.21 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 56,571,475.92 | 1.59 |
| C8 | 医药、生物制品 | 8,198,430.30 | 0.23 |
| C99 | 其他制造业 | 1,087,525.92 | 0.03 |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 1,906,359.02 | 0.05 |
| E | 建筑业 | 100,135,643.82 | 2.81 |
| F | 交通运输、仓储业 | 55,488,434.22 | 1.56 |
| G | 信息技术业 | 26,940,539.58 | 0.76 |
| H | 批发和零售贸易 | 4,478,307.75 | 0.13 |
| I | 金融、保险业 | 45,777,406.71 | 1.28 |
| J | 房地产业 | 1,300,391.16 | 0.04 |
| K | 社会服务业 | 6,344,694.72 | 0.18 |
| L | 传播与文化产业 | 3,074,535.81 | 0.09 |
| M | 综合类 | – | – |
| | 合计 | 368,941,935.18 | 10.34 |

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 | 601668 | 中国建筑 | 15,000,000 | 70,800,000.00 | 1.98 |
| 2 | 600033 | 福建高速 | 8,000,000 | 52,800,000.00 | 1.48 |
| 3 | 600999 | 招商证券 | 857,581 | 25,204,305.59 | 0.71 |
| 4 | 601618 | 中国中冶 | 4,429,807 | 24,009,553.94 | 0.67 |
| 5 | 601788 | 光大证券 | 806,156 | 20,573,101.12 | 0.58 |
| 6 | 601299 | 中国北车 | 3,218,544 | 19,729,674.72 | 0.55 |
| 7 | 600725 | 云维股份 | 680,000 | 14,504,400.00 | 0.41 |
| 8 | 600312 | 平高电气 | 909,169 | 14,010,294.29 | 0.39 |
| 9 | 002154 | 报 喜 鸟 | 536,502 | 12,103,485.12 | 0.34 |
| 10 | 300002 | 神州泰岳 | 71,753 | 7,548,415.60 | 0.21 |

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 | – | – |
| 2 | 央行票据 | 493,227,000.00 | 13.82 |
| 3 | 金融债券 | 388,806,000.00 | 10.90 |
| | 其中:政策性金融债 | 308,170,000.00 | 8.64 |
| 4 | 企业债券 | 1,138,825,575.00 | 31.92 |
| 5 | 企业短期融资券 | – | – |
| 6 | 可转债 | 1,035,158,469.28 | 29.01 |
| 7 | 其他 | – | – |
| 8 | 合计 | 3,056,017,044.28 | 85.65 |

5.5 报告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

| 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 | 0801047 | 08央行票据 47 | 3,500,000 | 360,185,000.00 | 10.09 |
| 2 | 110003 | 新钢转债 | 2,316,220 | 318,665,547.60 | 8.93 |
| 3 | 125709 | 唐钢转债 | 2,515,351 | 306,646,440.41 | 8.59 |
| 4 | 080216 | 08国开 16 | 2,000,000 | 208,180,000.00 | 5.83 |
| 5 | 088031 | 08天保投资债 | 1,800,000 | 187,578,000.00 | 5.26 |

5.6 报告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

| 序号 | 证券代码 | 证券名称 | 数量(张) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 119005 | 浦建收益 | 400,000 | 3,857,309.95 | 0.11 |

5.7 报告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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 499,401.98 |
| 2 | 应收证券清算款 | 61,091,617.27 |
| 3 | 应收股利 | – |
| 4 | 应收利息 | 40,526,605.63 |
| 5 | 应收申购款 | 1,510,153.88 |
| 6 | 其他应收款 | – |
| 7 | 待摊费用 | – |
| 8 | 其他 | – |
| 9 | 合计 | 103,627,778.76 |

5.8.4 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 | 110003 | 新钢转债 | 318,665,547.60 | 8.93 |
| 2 | 125709 | 唐钢转债 | 306,646,440.41 | 8.59 |
| 3 | 125960 | 锡业转债 | 41,225,439.20 | 1.16 |
| 4 | 110598 | 大荒转债 | 32,588,000.00 | 0.91 |
| 5 | 110567 | 山鹰转债 | 24,268,440.00 | 0.68 |

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 600999 | 招商证券 | 25,204,305.59 | 0.71 | 网下新股锁定期 |
| 2 | 601299 | 中国北车 | 19,729,674.72 | 0.55 | 网下新股锁定期 |
| 3 | 300002 | 神州泰岳 | 7,548,415.60 | 0.21 | 网下新股锁定期 |

5.8.6 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 | 交银增利债券 A/B | 交银增利债券 C |
|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 2,241,247,265.35 | 1,418,944,988.59 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 590,359,881.97 | 286,890,860.07 |
| 报告期期间基金总赎回份额 | 585,981,656.68 | 650,442,939.34 |
| 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 | 2,245,625,490.64 | 1,055,392,909.32 |

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 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会批准交银施罗德增利债券证券投资基金募集的文件;

2、《交银施罗德增利债券证券投资基金基金合同》;

3、《交银施罗德增利债券证券投资基金招募说明书》;

4、《交银施罗德增利债券证券投资基金托管协议》;

5、关于募集交银施罗德增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增利债券证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

7.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

7.3 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.jyfund.com,www.jysld.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。