# 交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金
# 2021年中期报告

2021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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2021年8月30日

# §1 重要提示及目录

## 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2021 年 08 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

**§1 重要提示及目录** 2

1.1 重要提示 2
1.2 目录 3

**§2 基金简介** 5

2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 5
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6

**§3 主要财务指标和基金净值表现** 6

3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
3.3 其他指标 9

**§4 管理人报告** 10

4.1 基金管理人及基金经理情况 10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 11
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 12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 13

**§5 托管人报告** 13

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 13

**§6 半年度财务会计报告（未经审计）** 14

6.1 资产负债表 14
6.2 利润表 15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 16
6.4 报表附注 18

**§7 投资组合报告** 54

7.1 期末基金资产组合情况 54
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 55
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 55
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 57
7.6 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 57

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细..... 58
7.8 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贵金属投资明细..... 58
7.9 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..... 58
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... 58
7.11 投资组合报告附注..... 58

**§8 基金份额持有人信息..... 59**

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... 59
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... 60
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况..... 60

**§9 开放式基金份额变动..... 60**

**§10 重大事件揭示..... 61**

10.1 基金份额持有人大会决议..... 61
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动..... 61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... 61
10.4 基金投资策略的改变..... 61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... 61
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况..... 61
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... 62
10.8 其他重大事件..... 62

**§11 影响投资者决策的其他重要信息..... 63**

11.1 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..... 63
11.2 影响投资者决策的其他重要信息..... 64

**§12 备查文件目录..... 64**

12.1 备查文件目录..... 64
12.2 存放地点..... 64
12.3 查阅方式..... 64

# §2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

| | | |
|---|---|---|
| 基金名称 | 交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 交银定期支付月月丰债券 | |
| 基金主代码 | 519730 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2013 年 8 月 13 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 | |
| 报告期末基金份额总额 | 9,017,177.46 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 交银定期支付月月丰债券 A | 交银定期支付月月丰债券 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 519730 | 519731 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 7,211,219.30 份 | 1,805,958.16 份 |

## 2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金精选具有较高息票率的债券，以获取稳定的债息收入，并通过适当参与股票市场，力争实现基金资产的长期增值。 |
| 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，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；同时在严谨深入的信用分析基础上，综合考量企业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，自下而上地精选具有较高息票率的个券。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。 |
| 业绩比较基准 | 90%×中债综合全价指数收益率+10%×沪深 300 指数收益率 |
| 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预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。 |

## 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---|---|---|---|
| 名称 | | 交银施罗德基金管理有限公司 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 王晚婷 | 李申 |
| | 联系电话 | （021）61055050 | 021-60637102 |
| | 电子邮箱 | xxpl@jysld.com,disclosure@jysld.com | lishen.zh@ccb.com |

| | | |
|---|---|---|
| 客户服务电话 | 400-700-5000，021-61055000 | 021-60637111 |
| 传真 | （021）61055054 | 021-60635778 |
| 注册地址 | 中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号交通银行大楼二层（裙） | 北京市西城区金融大街 25 号 |
| 办公地址 | 上海市浦东新区世纪大道 8 号国金中心二期 21-22 楼 | 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼 |
| 邮政编码 | 200120 | 100033 |
| 法定代表人 | 阮红 | 田国立 |

## 2.4 信息披露方式

| | |
|---|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 《中国证券报》 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.fund001.com |
| 基金中期报告备置地点 | 基金管理人的办公场所 |

## 2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|---|---|---|
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司 | 北京市西城区太平桥大街 17 号 |

# §3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日) | |
|---|---|---|
| | 交银定期支付月月丰债券 A | 交银定期支付月月丰债券 C |
| 本期已实现收益 | 247,358.48 | 23,166.87 |
| 本期利润 | 272,412.33 | 53,595.90 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0229 | 0.0266 |
| 本期加权平均净值利润率 | 1.40% | 1.68% |
| 本期基金份额净值增长率 | 1.56% | 1.35% |
| 3.1.2 期末数据 | 报告期末(2021 年 6 月 30 日) | |

| 和指标 | | |
|---|---|---|
| 期末可供分配利润 | 4,615,892.52 | 1,061,229.42 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.6401 | 0.5876 |
| 期末基金资产净值 | 11,827,111.82 | 2,867,187.58 |
| 期末基金份额净值 | 1.6401 | 1.5876 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2021 年 6 月 30 日) | |
| 基金份额累计净值增长率 | 64.01% | 58.76% |

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 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

交银定期支付月月丰债券 A

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | -0.10% | 0.21% | -0.24% | 0.09% | 0.14% | 0.12% |
| 过去三个月 | 1.98% | 0.24% | 0.77% | 0.10% | 1.21% | 0.14% |
| 过去六个月 | 1.56% | 0.34% | 0.70% | 0.14% | 0.86% | 0.20% |
| 过去一年 | 4.00% | 0.29% | 2.31% | 0.13% | 1.69% | 0.16% |
| 过去三年 | 20.15% | 0.25% | 8.97% | 0.13% | 11.18% | 0.12% |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 自基金合同生效起至今 | 64.01% | 0.30% | 18.70% | 0.16% | 45.31% | 0.14% |

交银定期支付月月丰债券 C

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | -0.13% | 0.21% | -0.24% | 0.09% | 0.11% | 0.12% |
| 过去三个月 | 1.88% | 0.24% | 0.77% | 0.10% | 1.11% | 0.14% |
| 过去六个月 | 1.35% | 0.34% | 0.70% | 0.14% | 0.65% | 0.20% |
| 过去一年 | 3.56% | 0.29% | 2.31% | 0.13% | 1.25% | 0.16% |
| 过去三年 | 18.74% | 0.25% | 8.97% | 0.13% | 9.77% | 0.12% |
| 自基金合同生效起至今 | 58.76% | 0.30% | 18.70% | 0.16% | 40.06% | 0.14% |

注：本基金的业绩比较基准为 90%×中债综合全价指数收益率+10%×沪深 300 指数收益率，每日进行再平衡过程。

### 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

交银定期支付月月丰债券A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

交银定期支付月月丰债券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。

## 3.3 其他指标

无。

# §4 管理人报告

## 4.1 基金管理人及基金经理情况

### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

交银施罗德基金管理有限公司是经中国证监会证监基金字[2005]128 号文批准，由交通银行股份有限公司、施罗德投资管理有限公司、中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司共同发起设立。公司成立于 2005 年 8 月 4 日，注册地在中国上海，注册资本金为 2 亿元人民币。其中，交通银行股份有限公司持有 65%的股份，施罗德投资管理有限公司持有 30%的股份，中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司持有 5%的股份。公司并下设交银施罗德资产管理（香港）有限公司和交银施罗德资产管理有限公司。

截至报告期末，公司管理了包括货币型、债券型、普通混合型和股票型在内的 100 只基金，其中股票型涵盖普通指数型、交易型开放式（ETF）、QDII 等不同类型基金。

### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 唐赟 | 交银信用添利债券(LOF)、交银双利债券、交银双轮动债券、交银定期支付月月丰债券、交银增强收益债券、交银强化回报债券、交银荣鑫灵活配置混合、交银稳固收益债券的基金经理 | 2020 年 7 月 14 日 | - | 11 年 | 唐赟先生，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。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。 |

注：1、本表所列基金经理（助理）任职日期和离职日期均以基金合同生效日或公司作出决定并公

告(如适用)之日为准。

2、本表所列基金经理（助理）证券从业年限中的“证券从业”的含义遵从中国证券业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、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。

### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

## 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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 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 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

2021 年上半年，债券市场整体震荡走强，收益率下行幅度较大。春节前受到资金面影响债市先涨后跌，其中一月下旬缴税带动资金面出现超预期紧张的局面，回购融资利率大幅攀升，收益率曲线熊平化。春节之后至六月底，资金面一直保持宽松态势，在资金面持续宽松的影响下，市场逐步开始对基本面数据的反映钝化，短端收益率明显下行，长端前期维持高位震荡，后续在情绪面和资金面催化下收益率一路震荡下行。

报告期内，本基金的债券资产维持短久期低仓位配置。权益资产则继续持有我们认为有着良好的长期增长前景的公司。

### 4.4.2 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 主要会计数据和财务指标”及“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”部分披露。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2021 年下半年，随着经济动力中的投资和出口逐步见顶，实体增长动能大概率逐步趋弱。通胀由于基数效应同比趋势回落的概率较大，总体上经济基本面和通胀对债市均较为有利。流动性方面，预计下半年信用收缩的节奏放缓，货币政策继续以稳为主，后续我们将关注地方债发行放量对资金面的边际扰动。对于债券市场，我们认为下半年或延续震荡偏强的态势。

组合策略方面，我们计划维持债券资产中性久期，并积极关注经济环比表现和拐点信号，寻找合适的长端利率波段交易介入时机，以期提升组合收益表现。权益资产方面，我们将继续持有我们认为有着良好的长期增长前景以及相对较高确定性的公司，并根据估值和公司的经营情况做动态平衡。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序，经公司管理层批准后实行，并成立了估值委员会，估值委员会成员由研究部、基金运营部、风险管理部等人员和固定收益人员及基金经理组成。

公司严格按照新会计准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定进行估值，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。估值委员会的研究部成员按投资品种的不同

性质，研究并参考市场普遍认同的做法，建议合理的估值模型，进行测算和认证，认可后交各估值委员会成员从基金会计、风险、合规等方面审批，一致同意后，报公司投资总监、总经理审批。

估值委员会会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后，及时召开临时会议进行研究，及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值委员会成员均具备相应的专业资格及工作经验。基金经理作为估值委员会成员，对本基金持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感，向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论。本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突，截止报告期末未有与任何外部估值定价服务机构签约。

### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

# §6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|---|
| **资 产：** | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 518,570.01 | 562,513.05 |
| 结算备付金 | | 48,731.98 | 363,717.99 |
| 存出保证金 | | 2,217.06 | 17,921.24 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 14,125,439.92 | 25,874,590.80 |
| 其中：股票投资 | | 2,137,151.32 | 4,958,768.00 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 11,988,288.60 | 20,915,822.80 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | - |
| 应收证券清算款 | | - | 192,104.65 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 121,436.61 | 474,005.13 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 1,077.04 | 1,932.97 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 14,817,472.62 | 27,486,785.83 |
| **负债和所有者权益** | **附注号** | **本期末<br>2021 年 6 月 30 日** | **上年度末<br>2020 年 12 月 31 日** |
| **负 债：** | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | 2,200,000.00 |
| 应付证券清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | 35,535.41 | 19,637.57 |
| 应付管理人报酬 | | 12,064.01 | 14,801.83 |
| 应付托管费 | | 3,446.84 | 4,229.09 |
| 应付销售服务费 | | 955.31 | 1,120.51 |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 2,512.88 | 23,692.39 |
| 应交税费 | | 4,807.83 | 4,806.68 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 应付利息 | | - | -795.61 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 63,850.94 | 39,302.67 |
| 负债合计 | | 123,173.22 | 2,306,795.13 |
| **所有者权益：** | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 9,017,177.46 | 15,662,108.54 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 5,677,121.94 | 9,517,882.16 |
| 所有者权益合计 | | 14,694,299.40 | 25,179,990.70 |
| 负债和所有者权益总计 | | 14,817,472.62 | 27,486,785.83 |

注： 报告截止日 2021 年 06 月 30 日,基金份额总额 9,017,177.46 份，其中交银定期支付月月丰债券 A 基金份额总额 7,211,219.30 份，基金份额净值 1.6401 元。交银定期支付月月丰债券 C 基金份额总额 1,805,958.16 份，基金份额净值 1.5876 元。

## 6.2 利润表

会计主体：交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|---|---|---|---|
| 一、收入 | | 550,199.14 | 1,489,397.52 |
| 1.利息收入 | | 408,419.38 | 517,378.38 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 2,352.75 | 9,492.97 |
| 债券利息收入 | | 405,191.91 | 497,377.16 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 874.72 | 10,508.25 |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 84,820.58 | 1,179,500.46 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | 338,858.14 | 574,540.91 |
| 基金投资收益 | - | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | -272,821.31 | 601,657.15 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.13.5 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.15 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.16 | 18,783.75 | 3,302.40 |
| 3.公允价值变动收益（损失 | 6.4.7.17 | 55,482.88 | -215,680.99 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 以“-”号填列） | | | |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.18 | 1,476.30 | 8,199.67 |
| 减：二、费用 | | 224,190.91 | 496,470.94 |
| 1．管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 78,703.48 | 112,814.63 |
| 2．托管费 | 6.4.10.2.2 | 22,486.67 | 32,232.69 |
| 3．销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 6,339.65 | 8,739.57 |
| 4．交易费用 | 6.4.7.19 | 7,708.36 | 257,412.76 |
| 5．利息支出 | | 34,939.61 | 5,232.70 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 34,939.61 | 5,232.70 |
| 6．税金及附加 | | 3.17 | 43.14 |
| 7．其他费用 | 6.4.7.20 | 74,009.97 | 79,995.45 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 326,008.23 | 992,926.58 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 326,008.23 | 992,926.58 |

## 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | | |
|---|---|---|---|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 15,662,108.54 | 9,517,882.16 | 25,179,990.70 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 326,008.23 | 326,008.23 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | -6,644,931.08 | -4,166,768.45 | -10,811,699.53 |
| 其中：1.基金申购款 | 2,132,169.58 | 1,314,307.06 | 3,446,476.64 |
| 2.基金赎 | -8,777,100.66 | -5,481,075.51 | -14,258,176.17 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 回款 | | | |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | - | - | - |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 9,017,177.46 | 5,677,121.94 | 14,694,299.40 |

| 项目 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年6月30日 | | |
|---|---|---|---|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 21,344,596.65 | 11,170,038.95 | 32,514,635.60 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 992,926.58 | 992,926.58 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | -1,824,135.35 | -1,009,588.97 | -2,833,724.32 |
| 其中：1.基金申购款 | 7,893,221.84 | 4,228,251.09 | 12,121,472.93 |
| 2.基金赎回款 | -9,717,357.19 | -5,237,840.06 | -14,955,197.25 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | - | - | - |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 19,520,461.30 | 11,153,376.56 | 30,673,837.86 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

| 谢卫 | 夏华龙 | 单江 |
|---|---|---|
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]754 号《关于核准交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金募集的批复》核准，由交银施罗德基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 344,213,956.62 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2013)第 508 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金基金合同》于 2013 年 8 月 13 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 344,340,245.54 份基金份额，其中认购资金利息折合 126,288.92 份基金份额。本基金的基金管理人为交银施罗德基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金基金合同》和《交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金招募说明书》，本基金自募集期起根据费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在在投资者认购/申购时收取前端认购/申购费用、赎回时收取赎回费用的，称为 A 类基金份额；在投资者认购/申购时不收取认购/申购费用，赎回时收取短期赎回费，并从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。

根据《交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金基金合同》和《交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金每月定期按照约定的年化现金支付比率，以约定的定期支付基准日的基金份额净值为基础，计算当期基金份额持有人可获得支付的现金，并自动赎回基金份额持有人所持的对应金额的基金份额，以该自动赎回的资金向基金份额持有人进行现金支付。本基金当前的年化现金支付比率为 4%。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证)、债券、货币市场工具、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产净值的 80%，对股票、权证等权益类资产的投资比例不高于基金资产的 20%；其中现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为 90%×中债综

合全价指数收益率+10%×沪深 300 指数收益率。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。 本财务报表以持续经营为基础编制。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 06 月 30 日的财务状况以及 2021 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融　房地产开发　教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)　资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 活期存款 | 518,570.01 |
| 定期存款 | - |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | - |
| 存款期限 1-3 个月 | - |
| 存款期限 3 个月以上 | - |
| 其他存款 | - |
| 合计 | 518,570.01 |

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 | | |
|---|---|---|---|---|
| | | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | 1,750,030.84 | 2,137,151.32 | 387,120.48 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 12,145,017.63 | 11,988,288.60 | -156,729.03 |
| | 银行间市场 | - | - | - |
| | 合计 | 12,145,017.63 | 11,988,288.60 | -156,729.03 |
| 资产支持证券 | | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - |
| 合计 | | 13,895,048.47 | 14,125,439.92 | 230,391.45 |

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 应收活期存款利息 | 94.91 |
| 应收定期存款利息 | - |
| 应收其他存款利息 | - |
| 应收结算备付金利息 | 21.90 |
| 应收债券利息 | 121,318.80 |
| 应收资产支持证券利息 | - |
| 应收买入返售证券利息 | - |
| 应收申购款利息 | - |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |
| 应收出借证券利息 | - |
| 其他 | 1.00 |
| 合计 | 121,436.61 |

### 6.4.7.6 其他资产

无。

### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 交易所市场应付交易费用 | 2,512.88 |
| 银行间市场应付交易费用 | - |
| 合计 | 2,512.88 |

### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 2.97 |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 预提审计费 | 14,876.39 |
| 预提信息披露费 | 39,671.58 |
| 预提账户维护费 | 9,300.00 |
| 合计 | 63,850.94 |

### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

交银定期支付月月丰债券 A

| 项目 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | |
|---|---|---|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 13,328,334.43 | 13,328,334.43 |
| 本期申购 | 1,137,486.40 | 1,137,486.40 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -7,254,601.53 | -7,254,601.53 |
| -基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算调整 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 7,211,219.30 | 7,211,219.30 |

交银定期支付月月丰债券 C

| 项目 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | |
|---|---|---|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 2,333,774.11 | 2,333,774.11 |
| 本期申购 | 994,683.18 | 994,683.18 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -1,522,499.13 | -1,522,499.13 |
| -基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算调整 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 1,805,958.16 | 1,805,958.16 |

注：1、如果本报告期间发生红利再投、转换入业务，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。

### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

交银定期支付月月丰债券 A

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|---|---|---|---|
| 上年度末 | 8,353,127.74 | -157,039.74 | 8,196,088.00 |
| 本期利润 | 247,358.48 | 25,053.85 | 272,412.33 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -3,977,237.29 | 124,629.48 | -3,852,607.81 |
| 其中：基金申 | 723,520.56 | 5,770.33 | 729,290.89 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 购款 | | | |
| 基金赎回款 | -4,700,757.85 | 118,859.15 | -4,581,898.70 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 4,623,248.93 | -7,356.41 | 4,615,892.52 |

交银定期支付月月丰债券 C

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|---|---|---|---|
| 上年度末 | 1,349,018.52 | -27,224.36 | 1,321,794.16 |
| 本期利润 | 23,166.87 | 30,429.03 | 53,595.90 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -308,718.54 | -5,442.10 | -314,160.64 |
| 其中：基金申购款 | 580,767.33 | 4,248.84 | 585,016.17 |
| 基金赎回款 | -889,485.87 | -9,690.94 | -899,176.81 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 1,063,466.85 | -2,237.43 | 1,061,229.42 |

### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 活期存款利息收入 | 1,295.75 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | 992.93 |
| 其他 | 64.07 |
| 合计 | 2,352.75 |

## 6.4.7.12 股票投资收益

### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|---|---|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | 338,858.14 |
| 股票投资收益——赎回差价收入 | - |
| 股票投资收益——申购差价收入 | - |
| 股票投资收益——证券出借差价收入 | - |
| 合计 | 338,858.14 |

### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 卖出股票成交总额 | 3,553,577.80 |
| 减：卖出股票成本总额 | 3,214,719.66 |
| 买卖股票差价收入 | 338,858.14 |

### 6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

## 6.4.7.13 债券投资收益

### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|---|---|
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | -272,821.31 |
| 债券投资收益——赎回差价收入 | - |
| 债券投资收益——申购差价收入 | - |
| 合计 | -272,821.31 |

### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|---|---|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | 14,879,948.55 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 14,953,299.30 |
| 减：应收利息总额 | 199,470.56 |
| 买卖债券差价收入 | -272,821.31 |

### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

无。

### 6.4.7.14 贵金属投资收益

#### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

#### 6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

#### 6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

#### 6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

### 6.4.7.15 衍生工具收益

#### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

#### 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 股票投资产生的股利收益 | 18,783.75 |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | - |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 18,783.75 |

### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|---|---|

| | |
|---|---|
| 1.交易性金融资产 | 55,482.88 |
| 股票投资 | -106,076.02 |
| 债券投资 | 161,558.90 |
| 资产支持证券投资 | - |
| 基金投资 | - |
| 贵金属投资 | - |
| 其他 | - |
| 2.衍生工具 | - |
| 权证投资 | - |
| 3.其他 | - |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | - |
| 合计 | 55,482.88 |

### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 基金赎回费收入 | 624.82 |
| 基金转换费收入 | 851.48 |
| 合计 | 1,476.30 |

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25%归入基金资产。

2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的不低于赎回费的 25%归入转出基金的基金资产。

### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 交易所市场交易费用 | 7,708.36 |
| 银行间市场交易费用 | - |
| 合计 | 7,708.36 |

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 审计费用 | 14,876.39 |
| 信息披露费 | 39,671.58 |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行费用 | 862.00 |
| 债券账户费用 | 18,600.00 |
| 合计 | 74,009.97 |

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

无。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

## 6.4.9 关联方关系

### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
| --- | --- |
| 交银施罗德基金管理有限公司(“交银施罗德基金公司”) | 基金管理人、基金销售机构 |
| 中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”) | 基金托管人、基金销售机构 |
| 交通银行股份有限公司(“交通银行”) | 基金管理人的股东、基金销售机构 |
| 施罗德投资管理有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 中国国际海运集装箱(集团)股份有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 交银施罗德资产管理有限公司 | 基金管理人的子公司 |
| 上海直源投资管理有限公司 | 受基金管理人控制的公司 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

本报告期实际与基金发生关联交易的关联方及关联交易具体情况请见下述内容。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

无。

#### 6.4.10.1.2 债券交易

无。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

无。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

## 6.4.10.2 关联方报酬

### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 78,703.48 | 112,814.63 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 21,542.34 | 31,680.39 |

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.70%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值×0.70%÷当年天数。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 22,486.67 | 32,232.69 |

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝前一日基金资产净值×0.20%÷当年天数。

### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | | |
|---|---|---|---|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 交银定期支付月月丰债券 A | 交银定期支付月月丰债券 C | 合计 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 交通银行 | - | 1,329.49 | 1,329.49 |
| 交银施罗德基金公司 | - | 1,126.11 | 1,126.11 |
| 中国建设银行 | - | 1,714.46 | 1,714.46 |
| 合计 | - | 4,170.06 | 4,170.06 |

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 | | |
|---|---|---|---|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 交银定期支付月月丰债券 A | 交银定期支付月月丰债券 C | 合计 |
| 交通银行 | - | 2,032.92 | 2,032.92 |
| 交银施罗德基金公司 | - | 1,266.12 | 1,266.12 |
| 中国建设银行 | - | 2,711.16 | 2,711.16 |
| 合计 | - | 6,010.20 | 6,010.20 |

注：支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日 C 类基金份额对应的基金资产净值 0.4%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日基金销售服务费＝前一日 C 类基金份额对应的资产净值× 0.4% ÷ 当年天数。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

#### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

#### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|---|---|---|
| | 交银定期支付月月丰债券 A | 交银定期支付月月丰债券 C |
| 基金合同生效日（ 2013 年 8 月 13 日）持有的基金份额 | - | - |
| 报告期初持有的基金份额 | 3,953,674.53 | - |
| 报告期间申购/买入总份额 | 0.00 | - |
| 报告期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额 | 3,953,674.53 | - |
| 报告期末持有的基金份额 | 0.00 | - |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.00% | - |

| 项目 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|---|---|---|
| | 交银定期支付月月丰债券 A | 交银定期支付月月丰债券 C |
| 基金合同生效日（ 2013 年 8 月 13 日）持有的基金份额 | - | - |
| 报告期初持有的基金份额 | 4,115,305.95 | - |
| 报告期间申购/买入总份额 | - | - |
| 报告期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额 | 81,402.70 | - |
| 报告期末持有的基金份额 | 4,033,903.25 | - |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 23.79% | - |

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。

3、基金管理人投资本基金适用的申购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年6月30日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国建设银行_活期存款 | 518,570.01 | 1,295.75 | 1,816,013.52 | 6,105.98 |

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，存款利率参考银行同业利率及银行存款利率确定。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

## 6.4.11 利润分配情况

无。

## 6.4.12 期末(2021 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.2 受限证券类别：债券 | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量（单位：张） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 113050 | 南银转债 | 2021 年 6 月 17 日 | 2021 年 7 月 1 日 | 新债未上市 | 100.00 | 100.00 | 60 | 6,000.00 | 6,000.00 | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 127038 | 国微转债 | 2021 年 6 月 16 日 | 2021 年 7 月 14 日 | 新债未上市 | 100.00 | 100.00 | 10 | 1,000.00 | 1,000.00 | - |

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的

股票)、债券、货币市场工具、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，通过精选具有较高息票率的债券，以获取稳定的债息收入，并通过适当参与股票市场，力争实现基金资产的长期增值。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立合规审核及风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由风险管理部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。风险管理部对公司总经理负责。督察长独立行使督察权利，直接对董事会负责，就内部控制制度和执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能，定期和不定期地向董事会报告公司内部控制执行情况。

本基金的基金管理人建立了以合规审核及风险管理委员会为核心的，由督察长、风险控制委员会、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国建设银行，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.18%（2020 年 12 月 31 日：0.01%）。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性

风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

注：流动性受限资产、7 个工作日可变现资产的计算口径见《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》第四十条。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评

估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|---|---|---|---|---|---|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 518,570.01 | - | - | - | 518,570.01 |
| 结算备付金 | 48,731.98 | - | - | - | 48,731.98 |
| 存出保证金 | 2,217.06 | - | - | - | 2,217.06 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 交易性金融资产 | 10,411,894.40 | - | 1,576,394.20 | 2,137,151.32 | 14,125,439.92 |
| 应收利息 | - | - | - | 121,436.61 | 121,436.61 |
| 应收申购款 | - | - | - | 1,077.04 | 1,077.04 |
| 资产总计 | 10,981,413.45 | - | 1,576,394.20 | 2,259,664.97 | 14,817,472.62 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 35,535.41 | 35,535.41 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 12,064.01 | 12,064.01 |
| 应付托管费 | - | - | - | 3,446.84 | 3,446.84 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 955.31 | 955.31 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 2,512.88 | 2,512.88 |
| 应交税费 | - | - | - | 4,807.83 | 4,807.83 |
| 其他负债 | - | - | - | 63,850.94 | 63,850.94 |
| 负债总计 | - | - | - | 123,173.22 | 123,173.22 |
| 利率敏感度缺口 | 10,981,413.45 | - | 1,576,394.20 | 2,136,491.75 | 14,694,299.40 |
| 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 562,513.05 | - | - | - | 562,513.05 |
| 结算备付金 | 363,717.99 | - | - | - | 363,717.99 |
| 存出保证金 | 17,921.24 | - | - | - | 17,921.24 |
| 交易性金融资产 | 11,335,303.80 | 9,577,164.20 | 3,354.80 | 4,958,768.00 | 25,874,590.80 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 192,104.65 | 192,104.65 |
| 应收利息 | - | - | - | 474,005.13 | 474,005.13 |
| 应收申购款 | - | - | - | 1,932.97 | 1,932.97 |
| 资产总计 | 12,279,456.08 | 9,577,164.20 | 3,354.80 | 5,626,810.75 | 27,486,785.83 |
| 负债 | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 2,200,000.00 | - | - | - | 2,200,000.00 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 19,637.57 | 19,637.57 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 14,801.83 | 14,801.83 |
| 应付托管费 | - | - | - | 4,229.09 | 4,229.09 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 1,120.51 | 1,120.51 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 23,692.39 | 23,692.39 |
| 应交税费 | - | - | - | 4,806.68 | 4,806.68 |
| 应付利息 | - | - | - | -795.61 | -795.61 |
| 其他负债 | - | - | - | 39,302.67 | 39,302.67 |
| 负债总计 | 2,200,000.00 | - | - | 106,795.13 | 2,306,795.13 |
| 利率敏感度缺口 | 10,079,456.08 | 9,577,164.20 | 3,354.80 | 5,520,015.62 | 25,179,990.70 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| | |
|---|---|
| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 |

| | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
|---|---|---|---|
| | | 本期末 （2021 年 6 月 30 日） | 上年度末 （2020 年 12 月 31 日 ） |
| 分析 | 市场利率上升 25 个基点 | -80,903.07 | -44,559.99 |
| | 市场利率下降 25 个基点 | 84,467.20 | 44,780.32 |

### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产净值的 80%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 | | 上年度末 2020年12月31日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
| 交易性金融资产－股票投资 | 2,137,151.32 | 14.54 | 4,958,768.00 | 19.69 |
| 交易性金融资产－基金投资 | - | - | - | - |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 交易性金融资产－债券投资 | 26,026.80 | 0.18 | 3,354.80 | 0.01 |
| 交易性金融资产－贵金属投资 | - | - | - | - |
| 衍生金融资产－权证投资 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 2,163,178.12 | 14.72 | 4,962,122.80 | 19.70 |

注：债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 14.72%（2020 年 12 月 31 日：19.70%），因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响（2020 年 12 月 31 日：同）。

### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## §7 投资组合报告

### 7.1 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 | 2,137,151.32 | 14.42 |
| | 其中：股票 | 2,137,151.32 | 14.42 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 11,988,288.60 | 80.91 |
| | 其中：债券 | 11,988,288.60 | 80.91 |
| | 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 | 567,301.99 | 3.83 |
| 8 | 其他各项资产 | 124,730.71 | 0.84 |
| 9 | 合计 | 14,817,472.62 | 100.00 |

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 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（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | 81,498.80 | 0.55 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 1,247,751.40 | 8.49 |
| 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 | 81,240.00 | 0.55 |
| 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 | 332,594.80 | 2.26 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 90,030.00 | 0.61 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 78,295.00 | 0.53 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 115,981.32 | 0.79 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 109,760.00 | 0.75 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 2,137,151.32 | 14.54 |

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 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 | 002415 | 海康威视 | 2,900 | 187,050.00 | 1.27 |
| 2 | 600036 | 招商银行 | 3,100 | 167,989.00 | 1.14 |
| 3 | 300059 | 东方财富 | 5,020 | 164,605.80 | 1.12 |
| 4 | 300750 | 宁德时代 | 300 | 160,440.00 | 1.09 |
| 5 | 000858 | 五 粮 液 | 500 | 148,945.00 | 1.01 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 6 | 300760 | 迈瑞医疗 | 300 | 144,015.00 | 0.98 |
| 7 | 601012 | 隆基股份 | 1,500 | 133,260.00 | 0.91 |
| 8 | 603501 | 韦尔股份 | 400 | 128,800.00 | 0.88 |
| 9 | 600276 | 恒瑞医药 | 1,820 | 123,705.40 | 0.84 |
| 10 | 300015 | 爱尔眼科 | 1,634 | 115,981.32 | 0.79 |
| 11 | 300413 | 芒果超媒 | 1,600 | 109,760.00 | 0.75 |
| 12 | 600031 | 三一重工 | 3,100 | 90,117.00 | 0.61 |
| 13 | 601888 | 中国中免 | 300 | 90,030.00 | 0.61 |
| 14 | 002714 | 牧原股份 | 1,340 | 81,498.80 | 0.55 |
| 15 | 002352 | 顺丰控股 | 1,200 | 81,240.00 | 0.55 |
| 16 | 603259 | 药明康德 | 500 | 78,295.00 | 0.53 |
| 17 | 600309 | 万华化学 | 700 | 76,174.00 | 0.52 |
| 18 | 600887 | 伊利股份 | 1,500 | 55,245.00 | 0.38 |

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 603501 | 韦尔股份 | 148,177.00 | 0.59 |
| 2 | 603806 | 福斯特 | 103,400.00 | 0.41 |
| 3 | 600887 | 伊利股份 | 86,940.00 | 0.35 |
| 4 | 601012 | 隆基股份 | 80,472.00 | 0.32 |
| 5 | 603259 | 药明康德 | 80,190.00 | 0.32 |

注：“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 600887 | 伊利股份 | 230,789.00 | 0.92 |
| 2 | 601012 | 隆基股份 | 221,420.00 | 0.88 |
| 3 | 600309 | 万华化学 | 220,492.00 | 0.88 |
| 4 | 600519 | 贵州茅台 | 209,103.00 | 0.83 |
| 5 | 603288 | 海天味业 | 198,138.00 | 0.79 |
| 6 | 000002 | 万 科 A | 193,390.00 | 0.77 |
| 7 | 002475 | 立讯精密 | 188,040.00 | 0.75 |
| 8 | 000651 | 格力电器 | 186,300.00 | 0.74 |
| 9 | 601888 | 中国中免 | 179,277.00 | 0.71 |
| 10 | 601318 | 中国平安 | 170,170.00 | 0.68 |
| 11 | 300015 | 爱尔眼科 | 162,981.00 | 0.65 |
| 12 | 002607 | 中公教育 | 156,492.00 | 0.62 |
| 13 | 300760 | 迈瑞医疗 | 136,366.00 | 0.54 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 14 | 600031 | 三一重工 | 130,816.00 | 0.52 |
| 15 | 002714 | 牧原股份 | 129,059.00 | 0.51 |
| 16 | 300750 | 宁德时代 | 126,000.00 | 0.50 |
| 17 | 300059 | 东方财富 | 109,634.00 | 0.44 |
| 18 | 002415 | 海康威视 | 100,188.00 | 0.40 |
| 19 | 603806 | 福斯特 | 100,097.00 | 0.40 |
| 20 | 300413 | 芒果超媒 | 95,952.00 | 0.38 |

注："本期累计卖出金额"按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|---|---|
| 买入股票成本（成交）总额 | 499,179.00 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 3,553,577.80 |

注："买入股票成本"或"卖出股票收入"均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

## 7.5 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 | 2,433,129.40 | 16.56 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 9,529,132.40 | 64.85 |
| | 其中：政策性金融债 | 9,529,132.40 | 64.85 |
| 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） | 26,026.80 | 0.18 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 11,988,288.60 | 81.58 |

## 7.6 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 | 018006 | 国开 1702 | 94,180 | 9,529,132.40 | 64.85 |
| 2 | 019547 | 16 国债 19 | 16,460 | 1,550,367.40 | 10.55 |
| 3 | 010107 | 21 国债(7) | 8,810 | 882,762.00 | 6.01 |
| 4 | 123111 | 东财转 3 | 130 | 19,026.80 | 0.13 |
| 5 | 113050 | 南银转债 | 60 | 6,000.00 | 0.04 |

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

## 7.8 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贵金属投资明细

无。

## 7.9 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。

## 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.10.1 本期国债期货投资政策

无。

### 7.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

### 7.10.3 本期国债期货投资评价

无。

## 7.11 投资组合报告附注

### 7.11.1 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。

### 7.11.2 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。

### 7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 2,217.06 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |

| | | |
|---|---|---|
| 4 | 应收利息 | 121,436.61 |
| 5 | 应收申购款 | 1,077.04 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 124,730.71 |

### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

### 7.11.6 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。

## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别 | 持有人户数（户） | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | | 持有份额 | 占总份额比例（%） | 持有份额 | 占总份额比例（%） |
| 交银定期支付月月丰债券 A | 555 | 12,993.19 | - | - | 7,211,219.30 | 100.00 |
| 交银定期支付月月丰债券 C | 114 | 15,841.74 | - | - | 1,805,958.16 | 100.00 |
| 合计 | 669 | 13,478.59 | - | - | 9,017,177.46 | 100.00 |

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例（%） |
|---|---|---|---|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 交银定期支付月月丰债券 A | 6.32 | 0 |
| | 交银定期支付月月丰债券 C | 324.63 | 0.02 |
| | 合计 | 330.95 | 0 |

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目 | 份额级别 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|---|---|---|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 交银定期支付月月丰债券 A | 0 |
| | 交银定期支付月月丰债券 C | 0 |
| | 合计 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 交银定期支付月月丰债券 A | 0 |
| | 交银定期支付月月丰债券 C | 0 |
| | 合计 | 0 |

# §9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 交银定期支付月月丰债券 A | 交银定期支付月月丰债券 C |
|---|---|---|
| 基金合同生效日（2013 年 8 月 13 日）基金份额总额 | 214,214,667.51 | 130,125,578.03 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 13,328,334.43 | 2,333,774.11 |
| 本报告期基金总申购份额 | 1,137,486.40 | 994,683.18 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 7,254,601.53 | 1,522,499.13 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 7,211,219.30 | 1,805,958.16 |

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。

# §10 重大事件揭示

## 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

## 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人的重大人事变动：2021 年 1 月 23 日本基金管理人发布公告，经公司第五届董事会第二十三次会议审议通过，许珊燕女士离任公司副总经理职位。2021 年 4 月 24 日本基金管理人发布公告，经公司第五届董事会第二十七次会议审议通过，聘任马俊先生担任公司副总经理职位。

2、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动：本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

## 10.4 基金投资策略的改变

无。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

1、管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金管理人及其高级管理人员本报告期内未受监管部门稽查或处罚。

2、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金托管人及其高级管理人员本报告期内未受监管部门稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 申万宏源证券 | 1 | 2,319,755.80 | 57.24% | 2,160.43 | 57.24% | - |
| 中信建投证券 | 1 | 1,733,001.00 | 42.76% | 1,613.92 | 42.76% | - |

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 申万宏源证券 | 20,503,626.40 | 99.91% | 81,800,000.00 | 87.58% | - | - |
| 中信建投证券 | 19,065.29 | 0.09% | 11,600,000.00 | 12.42% | - | - |

注：1、报告期内，本基金交易单元未发生变化；

2、租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：券商基本面评价（财务状况、经营状况）、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）、券商每日信息评价（及时性和有效性）和券商协作表现评价等四个方面；

3、租用证券公司交易单元的程序：首先根据租用证券公司交易单元的选择标准进行综合评价，然后根据评价选择基金交易单元。研究部提交方案，并上报公司批准。

## 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|---|---|---|---|
| 1 | 交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告 | 公司网站 | 2021 年 1 月 21 日 |
| 2 | 交银施罗德基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站 | 2021 年 1 月 23 日 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 3 | 交银施罗德基金管理有限公司关于增加和耕传承基金销售有限公司为旗下基金销售机构的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站 | 2021 年 2 月 5 日 |
| 4 | 交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金 2020 年年度报告 | 公司网站 | 2021 年 3 月 30 日 |
| 5 | 交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告 | 公司网站 | 2021 年 4 月 21 日 |
| 6 | 交银施罗德基金管理有限公司关于副总经理任职的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站 | 2021 年 4 月 24 日 |
| 7 | 交银施罗德基金管理有限公司关于增加北京植信基金销售有限公司为旗下基金销售机构的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站 | 2021 年 5 月 26 日 |
| 8 | 交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金托管协议 | 公司网站 | 2021 年 6 月 30 日 |
| 9 | 交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新(2021 年第 1 号) | 公司网站 | 2021 年 6 月 30 日 |
| 10 | 交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新(2021 年第 1 号) | 公司网站 | 2021 年 6 月 30 日 |
| 11 | 交银施罗德基金管理有限公司关于旗下 31 只基金根据《公开募集证券投资基金侧袋机制指引(试行)》修改基金合同等法律文件的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站 | 2021 年 6 月 30 日 |
| 12 | 交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金（更新）招募说明书（2021 年第 1 号） | 公司网站 | 2021 年 6 月 30 日 |
| 13 | 交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金基金合同 | 公司网站 | 2021 年 6 月 30 日 |

# §11 影响投资者决策的其他重要信息

## 11.1 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（%） |
| 机构 | 1 | 2021/1/1-202 | 3,953,674.53 | - | 3,953,674.53 | - | - |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 1/6/30 | | | | | |

| 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。 |

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金侧袋机制指引(试行)》及各基金基金合同、托管协议、招募说明书及其更新等规定，经与基金托管人协商一致，本基金管理人对本基金实施侧袋机制修订了基金合同等法律文件，欲知详情请查阅本基金管理人发布的最新法律文件。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

1、中国证监会批准交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金募集的文件；

2、《交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金基金合同》；

3、《交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金招募说明书》；

4、《交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金托管协议》；

5、关于募集交银施罗德定期支付月月丰债券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定期支付月月丰债券型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

### 12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

### 12.3 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。