# 交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金

## 【2013】年度报告摘要

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：二〇一四年三月二十六日

§1 重要提示

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。本年度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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司（以下简称“中国农业银行”）根据本基金合同规定，于2014年3月24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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自2013年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|---|---|---|
| 基金简称 | 交银纯债债券发起 | |
| 基金主代码 | 519718 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2012年12月19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 | |
| 报告期末基金份额总额 | 261,384,633.99份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 交银纯债债券发起A/B | 交银纯债债券发起C |
| 下属分级基金的交易代码 | 519718(前端)、519719(后端) | 519720 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 244,216,310.62份 | 17,168,323.37份 |

注：1、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。

2、本基金为发起式基金。

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金为纯债基金，在严格控制投资风险的基础上，追求稳定的当期收益和基金资产的稳健增值。 |
| 投资策略 | 本基金充分发挥基金管理人的研究优势，将规范化的基本面研究，严谨的信用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，动态调整大类金融资产比例，自上而下决定债券组合久期、期限结构、债券类别配置策略，在严谨深入的分析基础上，综合考量各类债券的流动性、供求关系和收益率水平等，自下而上地精选个券。 |
| 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，属于证券投资基金中中等风险的品种，其长期平均的预期收益和风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。 |

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 | 中国农业银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 孙艳 | 李芳菲 |
| | 联系电话 | 021-61055050 | 010-66060069 |
| | 电子邮箱 | xxpl@jysld.com, disclosure@jysld.com | lifangfei@abchina.com |
| 客户服务电话 | | 400-700-5000，021-61055000 | 95599 |
| 传真 | | 021-61055054 | 010-63201816 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---|---|
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.fund001.com，www.bocomschroder.com |
| 基金年度报告备置地点 | 基金管理人的办公场所 |

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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 | 2013年 | | 2012年12月19日（基金合同生效日）至2012年12月31日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 交银纯债债券发起A/B | 交银纯债债券发起C | 交银纯债债券发起A/B | 交银纯债债券发起C |
| 本期已实现收益 | 20,288,189.15 | 6,722,578.27 | 1,853,757.93 | 693,407.31 |
| 本期利润 | 12,085,494.58 | 5,794,903.13 | 2,128,599.84 | 808,358.00 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0181 | 0.0261 | 0.0014 | 0.0013 |
| 本期基金份额净值增长率 | -0.51% | -1.11% | 0.10% | 0.10% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2013年末 | | 2012年末 | |
| | 交银纯债债券发起A/B | 交银纯债债券发起C | 交银纯债债券发起A/B | 交银纯债债券发起C |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.011 | -0.016 | 0.001 | 0.001 |
| 期末基金资产净值 | 241,610,086.95 | 16,890,421.36 | 1,494,536,503.60 | 625,035,413.45 |
| 期末基金份额净值 | 0.989 | 0.984 | 1.001 | 1.001 |

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 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. 交银纯债债券发起A/B：

| 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -2.08% | 0.12% | -2.67% | 0.10% | 0.59% | 0.02% |
| 过去六个月 | -1.69% | 0.10% | -4.54% | 0.09% | 2.85% | 0.01% |
| 过去一年 | -0.51% | 0.09% | -3.75% | 0.09% | 3.24% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | -0.42% | 0.09% | -3.71% | 0.08% | 3.29% | 0.01% |

注：本基金的业绩比较基准为中债综合全价指数。

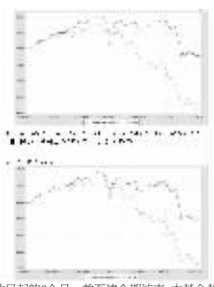
2. 交银纯债债券发起C：

| 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -2.09% | 0.12% | -2.67% | 0.10% | 0.58% | 0.02% |
| 过去六个月 | -2.09% | 0.10% | -4.54% | 0.09% | 2.45% | 0.01% |
| 过去一年 | -1.11% | 0.09% | -3.75% | 0.09% | 2.64% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | -1.01% | 0.09% | -3.71% | 0.08% | 2.70% | 0.01% |

注：本基金的业绩比较基准为中债综合全价指数。

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

1、交银纯债债券发起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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1、交银纯债债券发起A/B

注：图示日期为2012年12月19日至2013年12月31日。基金合同生效当年的净值增长率按照当年实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

1、交银纯债债券发起A/B：

单位：人民币元

| 年度 | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 年度利润分配合计 | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|
| 2013年 | 0.070 | 3,103,373.00 | 108,459.74 | 3,211,832.74 | - |
| 合计 | 0.070 | 3,103,373.00 | 108,459.74 | 3,211,832.74 | - |

2、交银纯债债券发起C：

单位：人民币元

| 年度 | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 年度利润分配合计 | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|
| 2013年 | 0.060 | 1,926,823.70 | 10,625.98 | 1,937,449.68 | - |
| 合计 | 0.060 | 1,926,823.70 | 10,625.98 | 1,937,449.68 | - |

§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

本基金的基金管理人为交银施罗德基金管理有限公司。交银施罗德基金管理有限公司是经中国证监会证监基字[2005]128号文批准，于2005年8月4日成立的合资基金管理公司。公司总部设于上海，注册资本为2亿元人民币。截止到2013年12月31日，公司已经发行并管理的基金共有三十一只：交银施罗德精选股票证券投资基金（基金合同生效日：2005年9月29日）、交银施罗德货币市场证券投资基金（基金合同生效日：2006年1月20日）、交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金（基金合同生效日：2006年6月14日）、交银施罗德成长股票证券投资基金（基金合同生效日：2006年10月23日）、交银施罗德蓝筹股票证券投资基金（基金合同生效日：2007年8月8日）、交银施罗德增利债券证券投资基金（基金合同生效日：2008年3月31日）、交银施罗德环球精选价值证券投资基金（基金合同生效日：2008年8月22日）、交银施罗德优势行业灵活配置混合型证券投资基金（基金合同生效日：2009年1月21日）、交银施罗德先锋股票证券投资基金（基金合同生效日：2009年4月10日）、上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金（基金合同生效日：2009年9月25日）、交银施罗德上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金（基金合同生效日：2009年9月29日）、交银施罗德主题优选灵活配置混合型证券投资基金（基金合同生效日：2010年6月30日）、交银施罗德趋势优先股票证券投资基金（基金合同生效日：2010年12月22日）、交银施罗德信用添利债券证券投资基金（基金合同生效日：2011年1月27日）、交银施罗德先进制造股票证券投资基金（基金合同生效日：2011年6月22日）、深证300价值交易型开放式指数证券投资基金（基金合同生效日：2011年9月22日）、交银施罗德双利债券证券投资基金（基金合同生效日：2011年9月26日）、交银施罗德深证300价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金（基金合同生效日：2011年9月28日）、交银施罗德全球自然资源证券投资基金（基金合同生效日：2012年5月22日）、交银施罗德荣安保本混合型证券投资基金（基金合同生效日：2012年6月20日）、交银施罗德阿尔法核心股票型证券投资基金（基金合同生效日：2012年8月3日）、交银施罗德理财21天债券型证券投资基金（基金合同生效日：2012年11月5日）、交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金（基金合同生效日：2012年11月7日）、交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金（基金合同生效日：2012年12月19日）、交银施罗德理财60天债券型证券投资基金（基金合同生效日：2013年3月13日）、交银施罗德双轮动债券型证券投资基金（基金合同生效日：2013年4月18日）、交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金（基金合同生效日：2013年4月24日）、交银施罗德成长30股票型证券投资基金（基金合同生效日：2013年6月5日）、交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金（基金合同生效日：2013年8月13日）、交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金（基金合同生效日：2013年9月4日）、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：2013年12月25日）。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

| 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 | | |
| 胡军华 | 本基金的基金经理、交银施罗德理财60天债券型证券投资基金基金经理、交银施罗德双轮动债券型证券投资基金基金经理、公司固定收益部总经理 | 2012-12-19 | - | 21年 | 胡军华女士，中国人民大学经济学硕士。历任中国经济开发信托投资公司证券业务总部研究部副总经理，华鑫证券有限公司深圳营业部副总经理，原南方证券有限公司债券业务总部投资经理，招商基金管理有限公司固定收益部总监、基金经理，瑞银证券资产管理部/财富管理部董事、高级投资组合经理。其中2005年5月至2006年5月担任招商现金增值开放式证券投资基金基金经理，2005年8月至2008年12月担任招商安泰系列证券投资基金基金经理，2006年7月至2008年12月担任招商安本增利债券型证券投资基金基金经理。2012年加入交银施罗德基金管理有限公司。 |
| 孙超 | 本基金、交银施罗德理财60天债券型证券投资基金、交银施罗德双轮动债券型证券投资基金的基金经理助理 | 2013-07-08 | - | 2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债券投资经理兼固定收益总监助理。2013年加入交银施罗德基金管理有限公司。 |

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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。

本报告期内，本基金整体运作合规合法，无不当内幕交易和关联交易，基金投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的约定，未发生损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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所管理的所有资产组合投资运作的公平。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。制度中包含的主要控制方法如下：

（1）公司建立资源共享的投资研究信息平台，所有研究成果对所有投资组合公平开放，确保各投资组合在获得研究支持和实施投资决策方面享有公平的机会。

（2）公司将投资管理职能和交易执行职能相隔离，实行集中交易制度，建立了合理且可操作的公平交易分配机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。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。

（3）公司建立了清晰的投资授权制度，明确各层级投资决策主体的职责和权限划分，组合投资经理充分发挥专业判断能力，不受他人干预，在授权范围内独立行使投资决策权，维护公平的投资管理环境，维护所管理投资组合的合法利益、保证各投资组合交易决策的客观性和独立性，防范不公平及异常交易的发生。

（4）公司建立统一的投资对象备选库和交易对于备选库，制定明确的备选库建立、维护程序，在全公司适用股票、债券备选库的基础上，根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和关联交易限制等，按需要建立不同投资组合的投资对象风格库和交易对于备选库，组合经理在此基础上根据投资授权构建投资组合。

（5）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投资组合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。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合。通过投资交易监控、交易数据分析、专项稽核检查等，本基金管理人未发现任何违反公平交易制度的行为。

4.3.3 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

2013年债券市场跌宕起伏、冰火两重天。市场对宏观经济预期在增长弱复苏与增速放缓之间反复，资金利率在充沛流动性与钱荒之间反复，债券供求在一券难求与无人问津之间反复。受商业银行资产负债表结构调整、非标业务与理财产品刚性兑付、互联网金融推升商业银行吸存成本等因素综合影响，下半年以来货币市场利率与债券收益率持续攀升，债券收益率几乎创历史新高。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2013年12月31日，交银纯债债券发起A/B份额净值为0.989元，本报告期份额净值增长率为-0.51%，同期业绩比较基准增长率为-3.75%；交银纯债债券发起C份额净值为0.984元，本报告期份额净值增长率为-1.11%，同期业绩比较基准增长率为-3.75%。

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2014年，中央经济工作会议明确了积极财政与稳健货币的政策取向、积极防控地方政府性债务风险的主要任务。同业非标融资、理财产品刚性兑付、资金游离实体经济之外等不可持续，将抑制未来社会融资总量增速并对实体经济构成下行压力，我们观察到2013年6月以来的高利率对经济影响逐渐显现，发电量、粗钢、铁路货运增速下行，显示经济处于回落态势。全国性债务审计结果出台后，未来地方债务无序扩张的局面有望改变，地方融资平台对资金吸噬的黑洞效应将有所减弱，2014年资金紧张程度预计弱于2013年。2014年关注债市基本面与资金面预期改善带来的投资机会。

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

本报告期内，根据相关法律法规和基金合同要求，本基金对本报告期可供分配利润进行了收益分配，具体情况参见年度报告正文7.4.11利润分配情况。

§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

在托管交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》、《交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金托管协议》的约定，对交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金管理人—交银施罗德基金管理有限公司2013年1月1日至2013年12月31日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，交银施罗德基金管理有限公司在交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，交银施罗德基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 审计报告

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）对交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金2013年12月31日及2012年12月31日的资产负债表、2013年度和2012年12月19日(基金合同生效日)至2012年12月31日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注出具了标准无保留意见的审计报告(普华永道中天审字(2014)第20569号)。投资者可通过本基金年度报告正文查看该审计报告正文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2013年12月31日

单位：人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末 2013年12月31日 | 上年度末 2012年12月31日 |
|---|---|---|---|
| 资 产： | | | |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 458,432.58 | 1,249,544,557.18 |
| 结算备付金 | | 1,422,709.53 | - |
| 存出保证金 | | 1.30 | - |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 230,536,900.00 | 653,503,000.00 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 230,536,900.00 | 653,503,000.00 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 7.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 7.4.7.4 | 45,890,468.84 | 203,610,320.42 |
| 应收证券清算款 | | - | - |
| 应收利息 | 7.4.7.5 | 5,559,561.34 | 13,560,536.72 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 4,582.98 | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 7.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 283,872,656.57 | 2,120,218,414.32 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2013年12月31日 | 上年度末 2012年12月31日 |
| 负 债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 7.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | 24,051,787.97 | - |
| 应付证券清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | 283,768.60 | - |
| 应付管理人报酬 | | 144,194.49 | 416,649.87 |
| 应付托管费 | | 48,064.86 | 138,883.28 |
| 应付销售服务费 | | 6,346.10 | 81,914.00 |
| 应付交易费用 | 7.4.7.7 | 11,093.27 | 5,645.42 |
| 应交税费 | | 425,400.00 | - |
| 应付利息 | | 2,161.97 | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 7.4.7.8 | 399,331.00 | 3,404.70 |
| 负债合计 | | 25,372,148.26 | 646,497.27 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 7.4.7.9 | 261,384,633.99 | 2,116,634,959.21 |
| 未分配利润 | 7.4.7.10 | -2,884,125.68 | 2,936,957.84 |
| 所有者权益合计 | | 258,500,508.31 | 2,119,571,917.05 |
| 负债和所有者权益总计 | | 283,872,656.57 | 2,120,218,414.32 |

注：1，报告截止日2013年12月31日，A/B类基金份额净值0.989元，C类基金份额净值0.984元，基金份额总额261，384，633.99份，其中A/B类基金份额244，216，310.62份，C类基金份额17，168，323.37份。

2、本财务报表的实际编制期间为2013年度和2012年12月19日(基金合同生效日)至2012年12月31日。

3、本摘要中资产负债表和利润表所列附注号为年度报告正文中对应的附注号，投资者欲了解相应附注的内容，应阅读登载于基金管理人网站的年度报告正文。

7.2 利润表

会计主体：交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金

本报告期：2013年1月1日至2013年12月31日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期 2013年1月1日至2013年12月31日 | 上年度可比期间 2012年12月19日（基金合同生效日）至2012年12月31日 |
|---|---|---|---|
| 一、收入 | | 30,285,984.24 | 3,585,037.19 |
| 1.利息收入 | | 42,469,402.06 | 3,137,030.21 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.11 | 6,720,409.89 | 2,032,005.95 |
| 债券利息收入 | | 31,744,526.32 | 505,172.62 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 4,004,465.85 | 599,851.64 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | -3,505,468.87 | 58,214.38 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.12 | - | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.13 | -3,505,468.87 | 58,214.38 |
| 资产支持证券投资收益 | 7.4.7.14 | - | - |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | 7.4.7.15 | - | - |
| 股利收益 | 7.4.7.16 | - | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17 | -9,130,369.71 | 389,792.60 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 7.4.7.18 | 452,420.76 | - |
| 减：二、费用 | | 12,405,586.53 | 648,079.35 |
| 1.管理人报酬 | | 5,497,226.53 | 416,649.87 |
| 2.托管费 | | 1,832,408.87 | 138,883.28 |
| 3.销售服务费 | | 908,342.30 | 81,914.00 |
| 4.交易费用 | 7.4.7.19 | 31,098.65 | 5,325.00 |
| 5.利息支出 | | 3,662,594.65 | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 3,662,594.65 | - |
| 6.其他费用 | 7.4.7.20 | 473,915.53 | 5,307.20 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 17,880,397.71 | 2,936,957.84 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 17,880,397.71 | 2,936,957.84 |

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金

本报告期：2013年1月1日至2013年12月31日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2013年1月1日至2013年12月31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） | 2,116,634,959.21 | 2,936,957.84 | 2,119,571,917.05 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 17,880,397.71 | 17,880,397.71 |
| 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） | -1,855,250,325.22 | -18,552,198.81 | -1,873,802,524.03 |
| 其中：1.基金申购款 | 977,865,361.05 | 10,708,335.73 | 988,573,696.78 |
| 2.基金赎回款 | -2,833,115,686.27 | -29,260,534.54 | -2,862,376,220.81 |
| 四、本期向基金分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） | - | -5,149,282.42 | -5,149,282.42 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 261,384,633.99 | -2,884,125.68 | 258,500,508.31 |
| 项目 | 上年度可比期间 2012年12月19日（基金合同生效日）至2012年12月31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） | 2,116,634,959.21 | - | 2,116,634,959.21 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 2,936,957.84 | 2,936,957.84 |
| 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） | - | - | - |
| 其中：1.基金申购款 | - | - | - |
| 2.基金赎回款 | - | - | - |
| 四、本期向基金分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） | 2,116,634,959.21 | 2,936,957.84 | 2,119,571,917.05 |

报表附注为财务报表的组成部分

本报告页码（序号）从7.1至7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：战龙，主管会计工作负责人：许珊燕，会计机构负责人：朱鸣

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金(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[2012]1287号《关于核准交银施罗德纯债债券型发起式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《交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》公开募集。本基金为契约型开放式的发起式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集2，115，460，756.66元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第527号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》于2012年12月19日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为2，116，634，959.21份基金份额，其中认购资金利息折合1，174，202.56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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金为发起式基金，基金募集份额总额不少于5，000万份，基金募集金额不少于5，000万元，其中基金管理人作为发起资金的提供方认购的金额为1，000万元且承诺持有期限不少于三年。

根据《交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》和《交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用、赎回费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购日收取前端认购/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、赎回时收取后端认购/申购费用和赎回费用的，称为B类基金份额；在投资者认购/申购、赎回时不收取认购/申购费用、赎回费用，而是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。由于基金费用的不同，本基金A/B类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额，但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德纯债债券型发起式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，包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、短期融资券、中期票据、公司债、分离交易可转债、资产支持证券、债券逆回购、银行存款等固定收益类资产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相关规定。本基金不直接在二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场新股申购和新股增发。因投资于分离交易可转债而产生的权证，在其可交易之日起的30个交易日内卖出。同时本基金不参与可转换债券投资。本基金投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的80%；现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为：中债综合全价指数。

本财务报表由本基金的基金管理人交银施罗德基金管理有限公司于2014年3月21日批准报出。

7.4.2 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日颁布的《企业会计准则－基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(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<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2013年度和2012年12月19日(基金合同生效日)至2012年12月31日止期间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2013年12月31日及2012年12月31日的财务状况以及2013年度和2012年12月19日(基金合同生效日)至2012年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本财务报表的实际编制期间为2013年度和2012年12月19日(基金合同生效日)至2012年12月31日止期间。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金以交易目的持有的债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动作为公允价值变动损益计入当期损益；在资产持有期间所取得的利息或现金股利以及处置时产生的处置损益计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普