

交银施罗德双轮动债券型证券投资基金

2018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：中信银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一九年三月二十七日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事、高级管理人员及基金经理人声明本基金不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其中内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。

本年度报告经三分之二以上独立董事签字确认，并由董事签署意见。

基金管理人中诚信托有限公司以下简称“中信银行”根据基金合同规定，于2019年3月26日复核了本报告中的财务数据、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全文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

本报告期自2018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：交银施罗德双轮动债券

基金代码：610723

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2013年4月18日

基金管理人：交银施罗德基金管理有限公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

报告期末基金资产总额：1,321,247,206.04元

报告期末基金份额总额：1,132,246,764.01份

报告期末基金份额净值：1.099,000.0000元

注：本基金为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。

2.2 基金产品说明

投资目标：本基金严守风险控制的原则，通过长期的主动管理，力争实现基金资产长期稳健增值。

投资策略：本基金将投资管理能力和交易执行能力建立在集中交易制度，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。

业绩比较基准：中债综合全价指数

本基金是一只债券型基金，属于证券投资基金中等风险的品种，其预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于股票型基金。

风险特征：本基金为债券型基金，其预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于股票型基金。

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

交银施罗德基金管理有限公司 中信银行股份有限公司

姓名 王黎峰 李峰

信息披露负责人 联系电话 (021)61065090

电子邮件 xcep@jz.jcbchina.com

客户服务电话 400-700-5000;021-61066000

传真 (021)61065064

报告期结束日 2018年12月31日

2.4 信息披露方式

基金基本信息和公告的披露网站 www.fund100.com

基金年度报告披露网站 基金管理人的公司网站

§ 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 2018年 2017年

交银施罗德双轮动债券 A 交银施罗德双轮动债券 C 交银施罗德双轮动债券 A 交银施罗德双轮动债券 C

本期已实现收益 0.0294 2,002 11,766 1,040 4,800.36 4,105.00 1,040 694.62

本期可供分配利润 119,221 2,001 41,675 36,450 16,450 30,901 2,001 59,722.66

加权平均基金份额本期利润 0.0309 0.0708 0.0240 0.0215 0.0113 0.0129

本期基金份额总额 926.05% 78.94% 26.94% 2.16% 1.11% 0.36%

3.1.2年末数据和指标 2018年末 2017年末

交银施罗德双轮动债券 A 交银施罗德双轮动债券 C 交银施罗德双轮动债券 A 交银施罗德双轮动债券 C

基金份额总额 1,221,363 203,430 1,003,696 6,477 2,987,236 7,000 11,078 6,029,003

基金资产净值 2,056.2 4,973 1,064,406 3,045.6 626,000 3,076.08 1,064,151 3,045.6

基金份额净值 1.078 1.078 1.043 1.043 1.032 1.092

注：1.本基金A类、C类业绩指标不包括持有人认购或交易本基金的各项费用，计入费用后的实际收益水平可能低于所列数字；
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）减去相关基金费用后的余额，本期利润即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、交银双轮动债券A/B：

阶段 份额净值增长 率 份额净值增 长率标准差 业绩比较基 准收益率及 标准差 ①-③ ②-④

过去一个月 2.40% 0.00% 1.99% 0.00% 0.47% 0.01%

过去六个月 4.00% 0.07% 2.59% 0.00% 2.23% 0.01%

过去一年 7.84% 0.07% 4.79% 0.07% 3.46% 0.00%

过去五年 12.34% 0.08% -0.41% 0.08% 12.76% 0.00%

成立以来 34.39% 0.10% 10.64% 0.09% 23.05% 0.01%

百分比 合同生 效日至今 30.42% 0.08% 6.00% 0.08% 20.18% 0.00%

注：本基金的业绩比较基准为中债综合全价指数。

2、交银双轮动债券C：

阶段 份额净值增 长率 份额净值增 长率标准差 业绩比较基 准收益率及 标准差 ①-③ ②-④

过去一个月 2.40% 0.00% 1.99% 0.00% 0.47% 0.01%

过去六个月 4.00% 0.07% 2.59% 0.00% 2.23% 0.01%

过去一年 7.84% 0.07% 4.79% 0.07% 3.46% 0.00%

过去五年 12.34% 0.08% -0.41% 0.08% 12.76% 0.00%

成立以来 34.39% 0.10% 10.64% 0.09% 23.05% 0.01%

百分比 合同生 效日至今 30.42% 0.08% 6.00% 0.08% 20.18% 0.00%

注：本基金的业绩比较基准为中债综合全价指数。

2.4 报告期内基金资产配置情况

2.4.1 基金资产配置比例

报告期各时间段内基金资产配置情况

报告期各时间段