

# 交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金 2018年年度报告摘要

基金管理人：交银施罗德基金管理有限公司  
基金托管人：中国建设银行股份有限公司  
报告送出日期：二〇一九年三月二十七日

## 重要提示

1.1 重要提示  
基金管理人、基金托管人、基金销售机构及基金服务机构不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对内容的真实性、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，并由董事长签署。  
基金托管人中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）根据本基金合同约定，于2019年3月20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。  
本报告自2018年1月1日起至12月31日止。

## 基金简介

| 基金名称         | 交银定期支付月月丰债券                  |
|--------------|------------------------------|
| 基金代码         | 519090                       |
| 基金的方式        | 契约型封闭式                       |
| 基金运作方式       | 定期开放式                        |
| 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   | 36,508,910,048份              |
| 报告期末的份额      | 不定期                          |
| 下属的基金类别和代码   | 交银定期支付月月丰债券A 交银定期支付月月丰债券C    |
| 下属的基金基金代码    | 519090 519091                |
| 报告期末下属基金资产净值 | 34,539,468,108 3,223,304,940 |

| 投资目标   | 本基金投资于具有较高债券价值的债券，以获取稳定的利息收入，并通过适度参与股票市场，力争实现基金资产的长期增值。                                                                                                  |
|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资策略   | 本基金在充分研究宏观经济、利率走势、资产价格、信用状况的基础上，采取自上而下的资产配置策略，在控制风险的前提下，合理配置资产。在固定收益资产方面，采取自上而下的资产配置策略，合理配置资产。在权益资产方面，采取自上而下的资产配置策略，合理配置资产。在另类资产方面，采取自上而下的资产配置策略，合理配置资产。 |
| 业绩比较基准 | 60%×中证综合债券指数收益率+40%×沪深300指数收益率                                                                                                                           |
| 风险等级   | 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，其风险等级为中等风险。                                                                                                                 |
| 风险评级   | 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，其风险等级为中等风险。                                                                                                                 |

## 基金管理人及基金托管人

| 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          |
| 姓名     | 王明                             | 田岗                    |
| 电话     | 021-68606666                   | 010-67594000          |
| 电子邮箱   | scs@jhs.com.cn, dcs@jhs.com.cn | ts@ccb.com.cn         |
| 客户服务电话 | 800-700-5000, 400-616-6000     | 010-67594000          |
| 网址     | http://www.jhs.com.cn          | http://www.ccb.com.cn |

## 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

## 主要会计数据和财务指标

| 项目          | 2018年度                    | 2017年度                    | 2016年度                    | 2015年度                    |
|-------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|
| 1.11 期间费用   | 交银定期支付月月丰债券A 交银定期支付月月丰债券C | 交银定期支付月月丰债券A 交银定期支付月月丰债券C | 交银定期支付月月丰债券A 交银定期支付月月丰债券C | 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     | -670,372.82               | -44,381.76                | 1,348,363.23              | 37,482.02                 |
| 本期利润        | -291,241.21               | -21,633.34                | 679,472.27                | 19,622.18                 |
| 本期基金份额净值增长率 | -0.0073                   | -0.0073                   | 0.0001                    | 0.0004                    |
| 本期基金份额净值增长率 | -0.0073                   | -0.0073                   | 0.0001                    | 0.0004                    |

## 基金净值表现

## 基金净值表现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

| 期间        | 基金份额净值增长率 | 业绩比较基准收益率 | 业绩比较基准收益率 |
|-----------|-----------|-----------|-----------|
| 过去三个月     | 1.80%     | 0.09%     | 0.02%     |
| 过去六个月     | 1.17%     | 0.09%     | 0.01%     |
| 过去一年      | 0.21%     | 0.16%     | -0.16%    |
| 过去三年      | 16.00%    | 0.20%     | -0.03%    |
| 过去五年      | 30.00%    | 0.23%     | 0.17%     |
| 自基金合同生效以来 | 38.10%    | 0.23%     | 0.16%     |

## 交银定期支付月月丰债券C

| 期间        | 基金份额净值增长率 | 业绩比较基准收益率 | 业绩比较基准收益率 |
|-----------|-----------|-----------|-----------|
| 过去三个月     | 1.80%     | 0.09%     | 0.02%     |
| 过去六个月     | 1.17%     | 0.09%     | 0.01%     |
| 过去一年      | 0.21%     | 0.16%     | -0.16%    |
| 过去三年      | 16.00%    | 0.20%     | -0.03%    |
| 过去五年      | 30.00%    | 0.23%     | 0.17%     |
| 自基金合同生效以来 | 38.10%    | 0.23%     | 0.16%     |

## 基金净值表现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

| 期间        | 基金份额净值增长率 | 业绩比较基准收益率 | 业绩比较基准收益率 |
|-----------|-----------|-----------|-----------|
| 过去三个月     | 1.80%     | 0.09%     | 0.02%     |
| 过去六个月     | 1.17%     | 0.09%     | 0.01%     |
| 过去一年      | 0.21%     | 0.16%     | -0.16%    |
| 过去三年      | 16.00%    | 0.20%     | -0.03%    |
| 过去五年      | 30.00%    | 0.23%     | 0.17%     |
| 自基金合同生效以来 | 38.10%    | 0.23%     | 0.16%     |

## 基金净值表现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C

| 期间        | 基金份额净值增长率 | 业绩比较基准收益率 | 业绩比较基准收益率 |
|-----------|-----------|-----------|-----------|
| 过去三个月     | 1.80%     | 0.09%     | 0.02%     |
| 过去六个月     | 1.17%     | 0.09%     | 0.01%     |
| 过去一年      | 0.21%     | 0.16%     | -0.16%    |
| 过去三年      | 16.00%    | 0.20%     | -0.03%    |
| 过去五年      | 30.00%    | 0.23%     | 0.17%     |
| 自基金合同生效以来 | 38.10%    | 0.23%     | 0.16%     |

## 基金净值表现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

| 期间        | 基金份额净值增长率 | 业绩比较基准收益率 | 业绩比较基准收益率 |
|-----------|-----------|-----------|-----------|
| 过去三个月     | 1.80%     | 0.09%     | 0.02%     |
| 过去六个月     | 1.17%     | 0.09%     | 0.01%     |
| 过去一年      | 0.21%     | 0.16%     | -0.16%    |
| 过去三年      | 16.00%    | 0.20%     | -0.03%    |
| 过去五年      | 30.00%    | 0.23%     | 0.17%     |
| 自基金合同生效以来 | 38.10%    | 0.23%     | 0.16%     |

## 基金净值表现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C

| 期间        | 基金份额净值增长率 | 业绩比较基准收益率 | 业绩比较基准收益率 |
|-----------|-----------|-----------|-----------|
| 过去三个月     | 1.80%     | 0.09%     | 0.02%     |
| 过去六个月     | 1.17%     | 0.09%     | 0.01%     |
| 过去一年      | 0.21%     | 0.16%     | -0.16%    |
| 过去三年      | 16.00%    | 0.20%     | -0.03%    |
| 过去五年      | 30.00%    | 0.23%     | 0.17%     |
| 自基金合同生效以来 | 38.10%    | 0.23%     | 0.16%     |

## 基金净值表现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

| 期间        | 基金份额净值增长率 | 业绩比较基准收益率 | 业绩比较基准收益率 |
|-----------|-----------|-----------|-----------|
| 过去三个月     | 1.80%     | 0.09%     | 0.02%     |
| 过去六个月     | 1.17%     | 0.09%     | 0.01%     |
| 过去一年      | 0.21%     | 0.16%     | -0.16%    |
| 过去三年      | 16.00%    | 0.20%     | -0.03%    |
| 过去五年      | 30.00%    | 0.23%     | 0.17%     |
| 自基金合同生效以来 | 38.10%    | 0.23%     | 0.16%     |

## 基金净值表现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C

| 期间        | 基金份额净值增长率 | 业绩比较基准收益率 | 业绩比较基准收益率 |
|-----------|-----------|-----------|-----------|
| 过去三个月     | 1.80%     | 0.09%     | 0.02%     |
| 过去六个月     | 1.17%     | 0.09%     | 0.01%     |
| 过去一年      | 0.21%     | 0.16%     | -0.16%    |
| 过去三年      | 16.00%    | 0.20%     | -0.03%    |
| 过去五年      | 30.00%    | 0.23%     | 0.17%     |
| 自基金合同生效以来 | 38.10%    | 0.23%     | 0.16%     |

## 基金净值表现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

| 期间        | 基金份额净值增长率 | 业绩比较基准收益率 | 业绩比较基准收益率 |
|-----------|-----------|-----------|-----------|
| 过去三个月     | 1.80%     | 0.09%     | 0.02%     |
| 过去六个月     | 1.17%     | 0.09%     | 0.01%     |
| 过去一年      | 0.21%     | 0.16%     | -0.16%    |
| 过去三年      | 16.00%    | 0.20%     | -0.03%    |
| 过去五年      | 30.00%    | 0.23%     | 0.17%     |
| 自基金合同生效以来 | 38.10%    | 0.23%     | 0.16%     |

## 基金净值表现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C

| 期间        | 基金份额净值增长率 | 业绩比较基准收益率 | 业绩比较基准收益率 |
|-----------|-----------|-----------|-----------|
| 过去三个月     | 1.80%     | 0.09%     | 0.02%     |
| 过去六个月     | 1.17%     | 0.09%     | 0.01%     |
| 过去一年      | 0.21%     | 0.16%     | -0.16%    |
| 过去三年      | 16.00%    | 0.20%     | -0.03%    |
| 过去五年      | 30.00%    | 0.23%     | 0.17%     |
| 自基金合同生效以来 | 38.10%    | 0.23%     | 0.16%     |

## 基金净值表现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

| 期间        | 基金份额净值增长率 | 业绩比较基准收益率 | 业绩比较基准收益率 |
|-----------|-----------|-----------|-----------|
| 过去三个月     | 1.80%     | 0.09%     | 0.02%     |
| 过去六个月     | 1.17%     | 0.09%     | 0.01%     |
| 过去一年      | 0.21%     | 0.16%     | -0.16%    |
| 过去三年      | 16.00%    | 0.20%     | -0.03%    |
| 过去五年      | 30.00%    | 0.23%     | 0.17%     |
| 自基金合同生效以来 | 38.10%    | 0.23%     | 0.16%     |

## 基金净值表现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C

| 期间        | 基金份额净值增长率 | 业绩比较基准收益率 | 业绩比较基准收益率 |
|-----------|-----------|-----------|-----------|
| 过去三个月     | 1.80%     | 0.09%     | 0.02%     |
| 过去六个月     | 1.17%     | 0.09%     | 0.01%     |
| 过去一年      | 0.21%     | 0.16%     | -0.16%    |
| 过去三年      | 16.00%    | 0.20%     | -0.03%    |
| 过去五年      | 30.00%    | 0.23%     | 0.17%     |
| 自基金合同生效以来 | 38.10%    | 0.23%     | 0.16%     |

## 基金净值表现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

| 期间        | 基金份额净值增长率 | 业绩比较基准收益率 | 业绩比较基准收益率 |
|-----------|-----------|-----------|-----------|
| 过去三个月     | 1.80%     | 0.09%     | 0.02%     |
| 过去六个月     | 1.17%     | 0.09%     | 0.01%     |
| 过去一年      | 0.21%     | 0.16%     | -0.16%    |
| 过去三年      | 16.00%    | 0.20%     | -0.03%    |
| 过去五年      | 30.00%    | 0.23%     | 0.17%     |
| 自基金合同生效以来 | 38.10%    | 0.23%     | 0.16%     |

## 基金净值表现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C

| 期间        | 基金份额净值增长率 | 业绩比较基准收益率 | 业绩比较基准收益率 |
|-----------|-----------|-----------|-----------|
| 过去三个月     | 1.80%     | 0.09%     | 0.02%     |
| 过去六个月     | 1.17%     | 0.09%     | 0.01%     |
| 过去一年      | 0.21%     | 0.16%     | -0.16%    |
| 过去三年      | 16.00%    | 0.20%     | -0.03%    |
| 过去五年      | 30.00%    | 0.23%     | 0.17%     |
| 自基金合同生效以来 | 38.10%    | 0.23%     | 0.16%     |

## 基金净值表现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

| 期间        | 基金份额净值增长率 | 业绩比较基准收益率 | 业绩比较基准收益率 |
|-----------|-----------|-----------|-----------|
| 过去三个月     | 1.80%     | 0.09%     | 0.02%     |
| 过去六个月     | 1.17%     | 0.09%     | 0.01%     |
| 过去一年      | 0.21%     | 0.16%     | -0.16%    |
| 过去三年      | 16.00%    | 0.20%     | -0.03%    |
| 过去五年      | 30.00%    | 0.23%     | 0.17%     |
| 自基金合同生效以来 | 38.10%    | 0.23%     | 0.16%     |

## 基金净值表现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C

| 期间        | 基金份额净值增长率 | 业绩比较基准收益率 | 业绩比较基准收益率 |
|-----------|-----------|-----------|-----------|
| 过去三个月     | 1.80%     | 0.09%     | 0.02%     |
| 过去六个月     | 1.17%     | 0.09%     | 0.01%     |
| 过去一年      | 0.21%     | 0.16%     | -0.16%    |
| 过去三年      | 16.00%    | 0.20%     | -0.03%    |
| 过去五年      | 30.00%    | 0.23%     | 0.17%     |
| 自基金合同生效以来 | 38.10%    | 0.23%     | 0.16%     |

## 基金净值表现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

| 期间        | 基金份额净值增长率 | 业绩比较基准收益率 | 业绩比较基准收益率 |
|-----------|-----------|-----------|-----------|
| 过去三个月     | 1.80%     | 0.09%     | 0.02%     |
| 过去六个月     | 1.17%     | 0.09%     | 0.01%     |
| 过去一年      | 0.21%     | 0.16%     | -0.16%    |
| 过去三年      | 16.00%    | 0.20%     | -0.03%    |
| 过去五年      | 30.00%    | 0.23%     | 0.17%     |
| 自基金合同生效以来 | 38.10%    | 0.23%     | 0.16%     |

## 基金净值表现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C

| 期间        | 基金份额净值增长率 | 业绩比较基准收益率 | 业绩比较基准收益率 |
|-----------|-----------|-----------|-----------|
| 过去三个月     | 1.80%     | 0.09%     | 0.02%     |
| 过去六个月     | 1.17%     | 0.09%     | 0.01%     |
| 过去一年      | 0.21%     | 0.16%     | -0.16%    |
| 过去三年      | 16.00%    | 0.20%     | -0.03%    |
| 过去五年      | 30.00%    | 0.23%     | 0.17%     |
| 自基金合同生效以来 | 38.10%    | 0.23%     | 0.16%     |

## 基金净值表现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

| 期间        | 基金份额净值增长率 | 业绩比较基准收益率 | 业绩比较基准收益率 |
|-----------|-----------|-----------|-----------|
| 过去三个月     | 1.80%     | 0.09%     | 0.02%     |
| 过去六个月     | 1.17%     | 0.09%     | 0.01%     |
| 过去一年      | 0.21%     | 0.16%     | -0.16%    |
| 过去三年      | 16.00%    | 0.20%     | -0.03%    |
| 过去五年      | 30.00%    | 0.23%     | 0.17%     |
| 自基金合同生效以来 | 38.10%    | 0.23%     | 0.16%     |

## 基金净值表现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C

| 期间        | 基金份额净值增长率 | 业绩比较基准收益率 | 业绩比较基准收益率 |
|-----------|-----------|-----------|-----------|
| 过去三个月     | 1.80%     | 0.09%     | 0.02%     |
| 过去六个月     | 1.17%     | 0.09%     | 0.01%     |
| 过去一年      | 0.21%     | 0.16%     | -0.16%    |
| 过去三年      | 16.00%    | 0.20%     | -0.03%    |
| 过去五年      | 30.00%    | 0.23%     | 0.17%     |
| 自基金合同生效以来 | 38.10%    | 0.23%     | 0.16%     |

## 基金净值表现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

| 期间        | 基金份额净值增长率 | 业绩比较基准收益率 | 业绩比较基准收益率 |
|-----------|-----------|-----------|-----------|
| 过去三个月     | 1.80%     | 0.09%     | 0.02%     |
| 过去六个月     | 1.17%     | 0.09%     | 0.01%     |
| 过去一年      | 0.21%     | 0.16%     | -0.16%    |
| 过去三年      | 16.00%    | 0.20%     | -0.03%    |
| 过去五年      | 30.00%    | 0.23%     | 0.17%     |
| 自基金合同生效以来 | 38.10%    | 0.23%     | 0.16%     |

## 基金净值表现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C

| 期间        | 基金份额净值增长率 | 业绩比较基准收益率 | 业绩比较基准收益率 |
|-----------|-----------|-----------|-----------|
| 过去三个月     | 1.80%     | 0.09%     | 0.02%     |
| 过去六个月     | 1.17%     | 0.09%     | 0.01%     |
| 过去一年      | 0.21%     | 0.16%     | -0.16%    |
| 过去三年      | 16.00%    | 0.20%     | -0.03%    |
| 过去五年      | 30.00%    | 0.23%     | 0.17%     |
| 自基金合同生效以来 | 38.10%    | 0.23%     | 0.16%     |

## 基金净值表现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

| 期间        | 基金份额净值增长率 | 业绩比较基准收益率 | 业绩比较基准收益率 |
|-----------|-----------|-----------|-----------|
| 过去三个月     | 1.80%     | 0.09%     | 0.02%     |
| 过去六个月     | 1.17%     | 0.09%     | 0.01%     |
| 过去一年      | 0.21%     | 0.16%     | -0.16%    |
| 过去三年      | 16.00%    | 0.20%     | -0.03%    |
| 过去五年      | 30.00%    | 0.23%     | 0.17%     |
| 自基金合同生效以来 | 38.10%    | 0.23%     | 0.16%     |

## 基金净值表现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C

| 期间        | 基金份额净值增长率 | 业绩比较基准收益率 | 业绩比较基准收益率 |
|-----------|-----------|-----------|-----------|
| 过去三个月     | 1.80%     | 0.09%     | 0.02%     |
| 过去六个月     | 1.17%     | 0.09%     | 0.01%     |
| 过去一年      | 0.21%     | 0.16%     | -0.16%    |
| 过去三年      | 16.00%    | 0.20%     | -0.03%    |
| 过去五年      | 30.00%    | 0.23%     | 0.17%     |
| 自基金合同生效以来 | 38.10%    | 0.23%     | 0.16%     |

## 基金净值表现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

| 期间    | 基金份额净值增长率 | 业绩比较基准收益率 | 业绩比较基准收益率 |
|-------|-----------|-----------|-----------|
| 过去三个月 | 1         |           |           |