

交银施罗德双轮动债券型证券投资基金

2019年半年度报告摘要

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:二〇一九年八月二十九日

1 重要提示

1.1 重要提示
基金管理人和基金托管人承诺本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其中内容的真实性、准确性、完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告经以上基金托管人同意，并由董事长签发。

基金托管人中信银行股份有限公司根据基金合同约定，于2019年8月2日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利率和费用情况、财务会计报告、投资组合报告等内函，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺就诚信经营、勤勉尽责的原则管理运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往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基金的招募说明书及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告附录为财务数据未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至6月30日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称:交银施罗德双轮动债券

基金代码:519723

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

报告期末基金份额总额:1,362,999,534.04份

基金合同生效日期:不定期

下属分级基金的基金简称:交银施罗德双轮动债券A/交银施罗德双轮动债券C

下属分级基金的交易代码:619723(场内) 519723(场外)

报告期末下属分级基金份额总额:1,224,309,320.29份 128,692,213.26份

注:本基金在各基金子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。

2.2 基金产品说明

投资目标 在严格控制投资组合风险的基础上,通过积极的资产配置,把握债券市场轮动变化的契机,力求实现基金资产的长期稳健增值。

本基金充分挖掘基金经理的研究优势,将传统的基本面研究、严谨的资产配置与积极主动的投资风格结合,在分析判断宏观经济形势、行业趋势、企业经营状况、债券市场资金面、信用利差、利率期限结构等的基础上,综合运用久期策略、信用策略、利率策略、套利策略、资产配置策略等不同的投资方法,构造大类资产配置比例,从而获得超越基准的收益。

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基金,其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

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

信息披露负责人:王静婷 李修霞

联系电话:(021)61066050 4006800000

电子邮箱:xjw@cboc.com,dwsw@cboc.com

客户服务电话:400-700-5000, 021-61065000

传真:(021)61065054 010-48230024

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告的管理人互联网网址:www.fund001.com

基金半年度报告备置地:基金管理人的办公场所

3 主要会计数据和财务指标

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(2019年1月1日至2019年6月30日)

交银施罗德双轮动债券A/B 交银施罗德双轮动债券C

本期实现收益 20,704,257.97 2,494,334.05

平均每日基金份额本期利润 21,217,384.68 2,613,386.42

本期基金份额净值增长率为 0.0164 0.0149

1.3.2期末数据和指标 报告期(2019年6月30日)

交银施罗德双轮动债券A/B 交银施罗德双轮动债券C

期末可供分配基金份额利润 0.0114 0.0112

期末基金份额净值 1,316,971,527.40 137,903,049.09

期末基金份额净值增长率 1.07% 1.07%

注:1.本基金A/B类业绩比较指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计划费用的实际情况以基金定期报告为准;

2.本期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.基金净值表现评价指标:与同期业绩比较基准收益增长率变动及其与同期业绩比

较基准收益率变动的比较

交银施罗德双轮动债券型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图(3月14日至2019年6月30日)

交银施罗德双轮动债券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。

交银施罗德双轮动债券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。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及其管理基金的情况

交银施罗德基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2006]1128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2006年4月1日,注册地在中国上海,注册资本为1亿元人民币,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。公司并开设交银施罗德资产管理(上海)有限公司和交银施罗德资产管理(北京)有限公司,并设有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(新加坡)有限公司。

4.1.2 基金经理及其基金经理助理的简介

姓名 职务 任本基金的基金经理(任职期限) 证券从业年限 说明

王艺伟 交银施罗德双轮动债券型证券投资基金基金经理 9年 2015-08-04

王艺伟女士,北京大学经济学学士,吉林大学法学学士,2012年加入交银施罗德基金管理有限公司,历任研究员、高级研究员、基金经理助理,现任交银施罗德基金管理有限公司基金经理。

4.2 管理人报告

4.2.1 基金管理人对报告期内基金运作遵规守信、谨慎经营情况的说明

报告期内,基金管理人严格按照《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定,恪守职业道德,规范运作,诚实守信,勤勉尽责地履行了基金管理人的职责,没有损害基金份额持有人的利益。

4.2.2 对报告期内基金估值政策和会计政策的说明

本基金在估值方法上严格按照《基金法》、《证券投资基金会计核算办法》、《基金估值指引》、《基金信息披露管理办法》等法律法规和基金合同的有关规定进行。

4.2.3 对报告期内内部控制制度的执行情况的说明

报告期内,基金管理人严格按照《基金法》、《证券投资基金会计核算办法》、《基金信息披露管理办法》等法律法规和基金合同的有关规定进行。

4.2.4 对报告期内募集资金使用的说明

报告期内,本基金未发生募集资金使用情况。

4.2.5 对报告期内关联交易的说明

报告期内,本基金未发生关联交易。

4.2.6 对报告期内基金业绩表现的说明

报告期内,本基金A/B类份额净值增长率分别为1.07%、1.07%,跑赢业绩比较基准收益率0.01%。

4.2.7 对基金未来业绩的展望

本基金在未来的投资运作中,将密切关注宏观经济环境、政策变化、利率走势、信用利差、资金面、海外市场等影响因素,结合对债券市场的深入研究,审慎操作,努力为基金份额持有人创造良好的回报。

4.2.8 风险揭示

本基金主要投资于固定收益类金融工具,因此存在一定的利率风险。

4.2.9 其他需要说明的事项

无。

4.3 管理人对本基金半年度报告的整体意见

基金管理人认为,本基金在报告期内运作合法合规,运作透明,符合基金合同的约定,能够有效保护基金份额持有人的合法权益。

4.4 管理人对会计师事务所出具的审计报告的说明

无。

4.5 备查文件

无。

4.6 其他需要说明的事项

无。

4.7 其他

无。

4.8 其他

无。

4.9 其他

无。

4.10 其他

无。

4.11 其他

无。

4.12 其他

无。

4.13 其他

无。

4.14 其他

无。

4.15 其他

无。

4.16 其他

无。

4.17 其他

无。

4.18 其他

无。

4.19 其他

无。

4.20 其他

无。

4.21 其他

无。

4.22 其他

无。

4.23 其他

无。

4.24 其他

无。

4.25 其他

无。

4.26 其他

无。

4.27 其他

无。

4.28 其他

无。

4.29 其他

无。

4.30 其他

无。

4.31 其他

无。

4.32 其他

无。

4.33 其他

无。

4.34 其他

无。

4.35 其他

无。

4.36 其他

无。