

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:二〇一四年八月二十五日

§ 1 重要提示

基金管理人、董事、监事、高级管理人员、基金经理、基金经理助理以及其他可能影响基金运作的人员在报告期内没有发生损害基金份额持有人利益的行为。本年度报告所载信息不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性、完整性、及时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，并由董事长签章。

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6月22日核对了本报告中的财务指标、净值表现、列示的信息、财务会计报告、投资组合报告等内容,保留在其托管的基金账户中。

基金管理人以诚实信用、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未来的业绩表现。投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告中的分析数据截至2014年6月30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 约定开放型

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

报告期基金总资产 280,026,971.84份

报告期基金总负债 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(前缀) 519720(后缀)

报告期末下属分级基金的份额总额 164,569,385.40份 115,457,586.44份

注:1.本基金管理人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 本基金充分借鉴基金管理人的研究优势,根据规范的基本面研究、严谨的信用分析以及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的运行趋势的基础上,动态调整大类金融资产比例,自下而上决定债券组合久期、期限结构、券种类别配置策略,在严谨深邃的分析基础上,综合考量各类券种的流动性的、供求关系和收益率水平,自下而上地精选个券。

业绩比较基准 中债综合全价指数

本基金是一只债券基金,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

姓名 孙艳 李芳菲

信息披露负责人 联系电话 021-61055050 010-66600609

电子邮箱 xpl@jdd.com.cn;disclosure@jysd.com

客户服务电话 400-700-5000,021-61055000 95599

传真 021-61055054 010-68121816

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 www.fund001.com/www.hocomicrider.com

基金半年度报告备置地点 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

报告期(2014年1月1日至2014年6月30日)

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 729,224.92 960,485.96

本期利润 10,999,824.74 2,945,948.47

加权平均基金份额本期利润 0.0594 0.0688

本期基金份额净值增长率 6.27% 5.89%

报告期(2014年6月30日)

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 0.018 0.009

期末基金资产净值 172,991,492.16 120,263,179.36

期末基金份额净值 1.051 1.042

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,计算费用后的实际收益水

平要低于上述数字。

2.本期可供分配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,即期末可供分配利润。

3.本基金的期末可供分配利润以期末可供分配利润除以最新总份额后的结果为准。

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

交银纯债债券发起A/B

阶段 份额净值增长 率长率(①) 份额净值增长 率标准差(②) 业绩比较基 准收益率标准差(③) 业绩比较基 准收益率差(④) ①-③ ②-④

过去一个月 1.25% 0.12% 0.41% 0.07% 0.84% 0.05%

过去三个月 4.16% 0.13% 2.42% 0.09% 1.74% 0.04%

过去六个月 6.27% 0.12% 4.07% 0.08% 2.20% 0.04%

过去一年 4.47% 0.11% -0.66% 0.09% 5.13% 0.02%

自基金合同生 4.82% 0.10% 0.21% 0.09% 4.61% 0.01%

效起至今 5.83% 0.10% 0.21% 0.09% 5.62% 0.01%

注:本基金的业绩比较基准为中债综合全价指数。

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 准收益率标准 差(③) 业绩比较基 准收益率差(④) ①-③ ②-④

过去一个月 1.25% 0.12% 0.41% 0.07% 0.84% 0.05%

过去三个月 4.16% 0.13% 2.42% 0.09% 1.74% 0.04%

过去六个月 6.27% 0.12% 4.07% 0.08% 2.20% 0.04%

过去一年 4.47% 0.11% -0.66% 0.09% 5.13% 0.02%

自基金合同生 4.82% 0.10% 0.21% 0.09% 4.61% 0.01%

效起至今 5.83% 0.10% 0.21% 0.09% 5.62% 0.01%

注:本基金的业绩比较基准为中债综合全价指数。

交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金

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

(2012年12月19日至2014年6月30日)

交银纯债债券发起A/B

报告期(2014年1月1日至2014年6月30日)

单位:人民币元

项目 附注号 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日

本期已实现收益 729,224.92 960,485.96

本期利润 10,999,824.74 2,945,948.47

加权平均基金份额本期利润 0.0594 0.0688

本期基金份额净值增长率 6.27% 5.89%

报告期(2014年6月30日)

交银纯债债券发起C

报告期(2014年1月1日至2014年6月30日)

单位:人民币元

项目 附注号 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日

本期已实现收益 729,224.92 960,485.96

本期利润 10,999,824.74 2,945,948.47

加权平均基金份额本期利润 0.0594 0.0688

本期基金份额净值增长率 6.27% 5.89%

报告期(2014年6月30日)

交银纯债债券发起C

报告期(2014年1月1日至2014年6月30日)

单位:人民币元

项目 附注号 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日

本期已实现收益 729,224.92 960,485.96

本期利润 10,999,824.74 2,945,948.47

加权平均基金份额本期利润 0.0594 0.0688

本期基金份额净值增长率 6.27% 5.89%

报告期(2014年6月30日)

交银纯债债券发起C

报告期(2014年1月1日至2014年6月30日)

单位:人民币元

项目 附注号 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日

本期已实现收益 729,224.92 960,485.96

本期利润 10,999,824.74 2,945,948.47

加权平均基金份额本期利润 0.0594 0.0688

本期基金份额净值增长率 6.27% 5.89%

报告期(2014年6月30日)

交银纯债债券发起C

报告期(2014年1月1日至2014年6月30日)

单位:人民币元

项目 附注号 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日

本期已实现收益 729,224.92 960,485.96

本期利润 10,999,824.74 2,945,948.47

加权平均基金份额本期利润 0.0594 0.0688

本期基金份额净值增长率 6.27% 5.89%

报告期(2014年6月30日)

交银纯债债券发起C

报告期(2014年1月1日至2014年6月30日)

单位:人民币元

项目 附注号 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日

本期已实现收益 729,224.92 960,485.96

本期利润 10,999,824.74 2,945,948.47

加权平均基金份额本期利润 0.0594 0.0688

本期基金份额净值增长率 6.27% 5.89%

报告期(2014年6月30日)

交银纯债债券发起C

报告期(2014年1月1日至2014年6月30日)

单位:人民币元