

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

报告送达日期:二〇一五年三月三十一日
§ 1 重要提示

1.1 重要提示
基金管理人和董事、监事、高级管理人员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、完整性承担个别及连带的法律责任。本基金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。

基金托管人对本基金的财务报告、净值公告、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等重要内容，保证不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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财产，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。投资人有风险，投资人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，投资人欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

本报告期自2014年1月1日起至2014年12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 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

基金简称

交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金

基金代码

519718

基金运作方式

契约型开放式

基金合同生效日

2012年10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

报告期末基金资产总额

162,018,701.20(元)

报告期末基金份额总额

129,293,078.95(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。

2.2 基金产品说明

投资目标 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保值增值。

本基金充分发掘基金管理人的研究优势,将规范化的基本面研究、严谨的信用分析与科学的信用评级相结合,在分析和判断宏观经济运行状况和金融市场的变化趋势的基础上,通过久期策略、期限结构策略、债券类别配置策略,在深入分析的基础上,综合考虑各类债券的流动性、信用等级和利率水平,自下而上地精选个券。

业绩比较基准 中短期国债收益率

本基金一只投资于债券基金,属于债券基金中中等风险的品种,其长期平均的预期收益率要高于货币基金,但低于股票基金和混合基金。

风险特征 本基金一只投资于债券基金,属于债券基金中中等风险的品种,其长期平均的预期收益率要高于货币基金,但低于股票基金和混合基金。

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 中国农业银行股份有限公司

信息披露义务人 陈春雷

信息披露义务人联系电话 021-61605050

信息披露义务人电子邮箱 xsp@jdcfund.com, disclosure@jdcfund.com

客户服务电话 400-700-5001-61050000

传真 021-61050504

注2:主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标

2014年 2013年 2012年10月10日基金合同生效日起至2012年12月31日

交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金A/B 交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金A/C 交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金C

本期已实现收益 8,874,437.34 7,035,483.32 208,189.55 6,722,578.03 1,853,759.93 693,407.31

本期利润 18,097,497.27 13,299,434.61 12,085,494.58 5,794,700.13 2,128,599.84 808,358.00

加权平均基金份额净值 0.1026 0.1623 0.0981 0.0261 0.0014 0.0013

本期基金份额净值增长率 10.10% 9.44% -0.51% -1.11% 0.10% 0.10%

2014年末 2013年末 2012年末

13,970,753.21 33,960,357.78 241,610,866.95 16,890,421.36 510,536.00 415,435.00

期末基金份额净值 1.064 1.052 0.989 0.984 1.001 1.001

注3: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扣除本期费用后的余额。

3.2.2 主要财务指标

3.2.3 期末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.交银施罗德纯债债券型发起式A/B:

3.3.1 期间数据和指标

3.3.2 期末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

2.交银施罗德纯债债券型发起式C:

3.3.3 期末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

注:本基金的业绩比较基准为中债综合全价指数。

3.2.2 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.交银施罗德纯债债券型发起式A/B:

2.交银施罗德纯债债券型发起式C:

注:本基金的业绩比较基准为中债综合全价指数。

3.2.2 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.交银施罗德纯债债券型发起式A/B: