

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：二〇一五年三月三十一日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、董事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、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本基金报告已经三十二位上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中信银行股份有限公司（以下简称“中信银行”）根据本基金合同规定，于2015年3月30日核对了本基金中的财务指标、净值表现、利率分配情况、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。

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

基金简称 交银双轮动债券基金

基金代码 519723

基金运作方式 契约型开放式

基金合同生效日 2013年1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 232,259,191.24

基金合同生效日期 不定期

下属分级基金的基金简称 交银双轮动债券A/B

交银双轮动债券C

下属分级基金的交易代码 519723(前场), 519724(后场)

519725

报告期末下属分级基金的份额总额 160,413,747,005.00

718,455,444.24份

注：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。

2.2 基金产品说明

投资目标 本基金严控信用风险的基础上，通过积极主动的投资管理，把握债券市

场的定价机会，力求实现基金资产的增值。

投资策略 本基金主要投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具，包括国债、金融债、企业债、公司债、可转债、央行票据、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行间同业拆借和银行间债券回购、证券投资基金、货币市场基金、权证、国债期货等金融工具，同时可少量投资于股票、权证等权益类金融工具，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金不投资于股票。

业绩比较基准 中证综合债指数

风险收益特征 本基金是一只债券基金，属于“证券投资基金中中等风险品种”，其长期平均

的预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于股票基金和混合型基金。

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 中信银行股份有限公司

联系人 方维

联系电话 021-61055050

电子邮箱 xph@jzqd.com, disclosure@jzqd.com

客户服务电话 400-700-5000, 021-61055000

传真 021-61055054

金額(单位:人民币元)

24 信息披露方式

登载基金年度报告的管理人互联网网址 www.fund001.com, www.bocomchinese.com

基金年度报告备置地点 基金管理人的办公场所

§ 3 主要财务指标、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)

3.1.3 期间数据和指标 2014年 2013年4月18日(基金合同生效日)至2013年12月31日

交银双轮动债券A/B 交银双轮动债券C 交银双轮动债券C

本期已实现收益 14,266,148.25 11,008,981.92 16,455,609.33 4,075,984.05

本期利润 26,094,949.89 19,096,383.83 3,914,629.85 1,007,799.47

加权平均基金份额本期利润 0.0163 0.1211 0.0039 0.0031

本期基金份额净值增长 10.04% 9.44% -0.11% -0.41%

2014年末 10.04% 9.44% -0.11% -0.41%

3.1.2 本期数据和指标 交银双轮动债券A/B 交银双轮动债券C 交银双轮动债券C

期末可供分配基金份额利润 0.033 0.027 - -

基金份额净值 168,913,913.15 75,232,237.15 554,227,557.95 106,371,195.15

期末基金份额净值 1.053 1.047 0.993 0.990

注：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所列示的金额。

3.2 本期已实现收益金额收入、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。

3.2 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 累计净值增长 累计净值增长 累计净值增长 累计净值增长 累计净值增长

份额净值增长 累计净值增长 累计净值增长 累计净值增长 累计净值增长 累计净值增长

率(%) 基准收益率(%) 基准收益率(%) 基准收益率(%) 基准收益率(%) 基准收益率(%)

过去三个月 1.04% 0.24% 1.67% 0.17% -0.63% 0.07%

过去六个月 3.96% 0.17% 2.38% 0.13% 1.58% 0.04%

过去一年 10.04% 0.14% 6.54% 0.11% 3.50% 0.03%

成立以来 9.92% 0.12% 1.26% 0.11% 8.66% 0.01%

近一年至今 9.92% 0.12% 1.26% 0.11% 8.66% 0.01%

注：本基金的业绩比较基准为中债综合全价指数。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计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 累计净值增长 累计净值增长 累计净值增长 累计净值增长 累计净值增长

份额净值增长 累计净值增长 累计净值增长 累计净值增长 累计净值增长 累计净值增长

率(%) 基准收益率(%) 基准收益率(%) 基准收益率(%) 基准收益率(%) 基准收益率(%)

过去三个月 0.86% 0.24% 1.67% 0.17% -0.81% 0.07%

过去六个月 3.68% 0.18% 2.38% 0.13% 1.58% 0.04%

过去一年 9.44% 0.14% 6.54% 0.11% 3.50% 0.03%

成立以来 9.00% 0.12% 1.26% 0.11% 8.66% 0.01%

近一年至今 9.00% 0.12% 1.26% 0.11% 8.66% 0.01%

注：本基金合同生效以来的净值得增长率按照当年实际净值统计。

3.2.3 过去三年基金的利润分配情况

1. 交银双轮动债券A/B：

单位:人民币元

1.1 交银双轮动债券A/B

金额(单位:人民币元)

2014年 0.390 8,289,693.09 328,418.78 7,158,078.47 6,455,985.60 -

2013年 0.060 4,554,570.36 81,190.18 4,635,760.54 -

合计 0.450 11,384,263.45 409,604.96 11,793,868.41 -

单位:人民币元

2. 交银双轮动债券C

金额(单位:人民币元)

2014年 0.360 7,170,504.21 78,181.39 6,549,685.60 -

2013年 0.060 4,170,313.72 14,862.51 4,125,767.23 -

合计 0.420 7,581,873.93 93,045.90 7,674,861.83 -

单位:人民币元

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人的情况

交银施罗德基金管理有限公司是经中国证监会证监基金字[2002]128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8月4日，注册资本在人民币上

亿元人民币。其中，交通银行股份有限公司持有65%的股份，公司并下设交银施罗德资产管理(香港)有限公司和交银施罗

德基金管理有限公司(以下简称“基金管理公司”)。

4.1.2 基金管理人的从业人员情况

基金管理人目前有员工1200人，其中，高级管理人员12人，基金经理人3人，基金经理助理1人，研究人员12人，

客户服务人员10人，其他人员1066人。

4.1.3 基金管理人的信息披露情况

基金管理人严格按照《基金信息披露管理办法》及中国证监会其他有关规定，通过公司网站、中国证监会指定的基金信息披露

信息披露媒体、基金定期报告、临时公告、基金净值公告、基金宣传推介材料、基金销售机构网站、基金评价机构网站、

中国证监会基金电子披露系统、基金业协会网站等途径，披露了基金合同、基金招募说明书、基金产品资料概要、基金

定期报告、临时报告、基金净值公告、基金宣传推介材料、基金销售机构网站、基金评价机构网站、中国证监会基金电子

信息披露系统、基金业协会网站等途径，披露了基金合同、基金招募说明书、基金产品资料概要、基金定期报告、基金

临时报告、基金净值公告、基金宣传推介材料、基金销售机构网站、基金评价机构网站、中国证监会基金电子信息披露

系统、基金业协会网站等途径，披露了基金合同、基金招募说明书、基金产品资料概要、基金定期报告、基金临时报告、

基金净值公告、基金宣传推介材料、基金销售机构网站、基金评价机构网站、中国证监会基金电子信息披露系统、

基金业协会网站等途径，披露了基金合同、基金招募说明书、基金产品资料概要、基金定期报告、基金临时报告、

基金净值公告、基金宣传推介材料、基金销售机构网站、基金评价机构网站、中国证监会基金电子信息披露系统、

基金业协会网站等途径，披露了基金合同、基金招募说明书、基金产品资料概要、基金定期报告、基金临时报告、