

交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金

[2015] 第三季度报告

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：二〇一五年十一月二十七日

§ 1 重要提示

基金管理人和托管人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责任。

基金托管人在本基金合同规定的范围内，对基金管理人的投资运作进行监督，但不以任何方式影响基金管理人的正常运作。

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。

本报告期自2015年7月1日起至2015年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	交银纯债债券发起
基金代码	610118
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年11月10日
报告期末基金份额总额	1,663,471,487.20份

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长期增值。

投资策略

本基金通过分析宏观经济指标、利率水平、收益率曲线、信用利差等指标，综合判断利率趋势和信用风险，确定资产配置比例。

本基金通过深入研究企业基本面，精选具有稳定现金流、盈利能力强、经营稳健的公司，构建合理的投资组合。

本基金通过严谨的风险管理，严控信用风险，追求绝对收益。

业绩比较基准

中债综合全价指数

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品种，其长期平均的预期收益率低于股票型基金，高于货币市场基金和固定收益类基金。

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

下属分级基金的基金简称

交银施罗德纯债债券发起A/B

交银施罗德纯债债券发起C

基金代码

610118(前端),610119(后端)

份额

1,643,946,703.51份

注：本基金在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，即610118。

2.基金的发起式基金。

§ 3 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标

报告期(2015年7月1日至2015年9月30日)

交银施罗德纯债债券发起A/B

交银施罗德纯债债券发起C

报告期初基金份额总额

10,110,117,111份

报告期末基金份额总额

9,538,000,406份

报告期基金份额变动

-671,116,705份

报告期基金份额净值

0.0337份

报告期期末基金份额净值

0.0336份

报告期每份额可供分配利润

0.0001元

报告期利润

674,361,012.02份

报告期所得税费用

0.00份

报告期手续费

1,000份

报告期净收益

1,000份

报告期已实现收益

10,110,117,111份

报告期未实现收益

0.00份

报告期已赚取未实现损益

0.00份

报告期其他收入

0.00份

报告期净亏损

0.00份

报告期可供分配利润

0.00份

报告期期末可供分配利润

0.00份

报告期期末可供分配基金份额净值

0.0336份

报告期期末可供分配金额

0.00份

报告期期末可供分配基金份额总额

0.00份

报告期期末可供分配基金利润

0.00份

报告期期末可供分配金额

0.00份

报告期期末可供分配基金份额总额

0.00份