

交银施罗德成长混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

基金管理人：交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人：中国农业银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一七年十月二十五日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告自2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金名称	交银成长混合
基金主代码	A160902
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年10月23日
报告期末基金份额总额	790,779,309.26份
投资目标	本基金属于中长期成长组合基金，主要投资于经过严格筛选的优质成长且具有良好成长性的上市公司股票，在适度控制股票仓位的前提下，追求基金资产的长期增值，力争实现超越业绩比较基准的投资目标。
投资策略	本基金采取分散化投资策略，精选个股，通过基本面分析、行业景气度分析、公司成长性分析等多种方法，结合定量与定性分析，选择具有良好成长性的上市公司股票，在适度控制股票仓位的前提下，追求基金资产的长期增值，力争实现超越业绩比较基准的投资目标。
业绩比较基准	70%×中证500指数收益率+30%×中国国债收益率
风险收益特征	本基金是一只混合型基金，属于证券投资基金中中等风险的品种，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
下属两级基金的基金简称	交银成长混合A
下属两级基金的基金代码	A160902 (前缀) A160901 (后缀)
报告期末下属两级基金的资产总额	797,409,702.13元

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

		单位:人民币元	
主要财务指标	报告期 (2017年7月1日-2017年9月30日)		
	交银成长混合A	交银成长混合H	
1.本期已实现收益	31,060,388.99	12,427,234	
2.本期利润	393,179,412.06	196,667.61	
3.加权平均基金份额本期利润	0.0490	0.0042	
4.期末基金资产净值	3,329,168,677.48	1,384,627,939	
5.期末基金份额净值	4.7360	4.4214	

注：1.上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后的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加上本期公允价值变动收益；

3.2 基金净值表现

3.2.1本报告期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、交银成长混合A/B：

阶段	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
过去三个月	12.76%	1.15%	3.67%	0.62%	9.12%	0.60%

2、交银成长混合H：

阶段	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
过去三个月	12.77%	1.15%	3.67%	0.62%	9.14%	0.61%

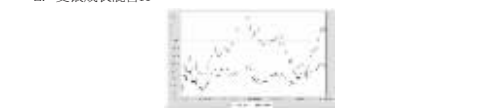
3.2.2 自基金合同生效以来基金基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

交银施罗德成长混合型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2006年10月23日至2017年9月30日)



注：图示日期为2006年10月23日至2017年9月30日。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。

2、交银成长混合H



注：本基金自2016年3月7日起，开始销售H类份额，当日投资者提交的申购申请于2016年3月8日被确认并将有效份额登记在册。图示日期为2016年3月8日至2017年9月30日。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金基金经理的期限	证券从业年限	说明
王少成	基金经理	2015-03-24	13年	王少成先生，复旦大学金融学硕士，曾任上海证券期货交易所研究员，中国银河证券资产管理部研究员，中国银河证券资产管理部基金经理，现任交银施罗德基金管理有限公司基金经理。2015年3月24日至2016年3月7日任交银成长混合A/B类基金份额基金经理，2016年3月8日至2016年3月14日任交银成长混合H类基金份额基金经理，2016年3月15日至2016年3月14日任交银施罗德成长混合型证券投资基金基金经理。2016年3月15日至2016年3月14日任交银施罗德成长混合型证券投资基金基金经理。

注：基金经理（或基金经理小组）期后变动（如有）敬请关注基金管理人发布的相关公告。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在报告期内，本基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，基金投资管理符合有关法律法规和基金合同的规定，为基金持有人谋求最大利益。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1公平交易制度的执行情况

本公司制定了严格的投资控制制度和公平交易监控制度来保证旗下基金运作的公平，旗下所管理的所有资产组合，包括证券投资基金和特定客户资产管理产品均严格遵循制度进行公平交易。

公司建立资源信息共享的投资信息平台，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。公司在交易执行环节实行集中交

易制度，建立公平的交易分配制度，对于交易所公开竞价交易，遵循“时间优先、价格优先、比例分配”的原则，全部通过交易系统按比例分配；对于非集中竞价交易，以公司名义进行的场外交易，遵循“价格优先、比例分配”的原则按事前预先确定的投资方案对交易结果进行分配。

公司中央交易室和风险管理部进行日常投资交易行为监控，风险管理部负责对各账户公平交易进行事后分析，于每季度和每年度分别对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析，通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

报告期内本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内，本公司管理的所有投资组合参与与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量没有超过该证券当日总成交量5%的情形，本基金与本公司管理的其他投资组合在不同时间窗口（如日内、3日内、5日内）同向交易的交易价差未出现异常。

4.4报告期内基金的投资策略和运作分析

2017年三季度股市的风险偏好依旧高涨，美债收益率曲线平坦程度已达到历史极值，市场对美国经济增长过度悲观预期，同时美国政治进程的摇摆也使得市场跌跌不休，但中美经济类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析，通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

报告期内本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内，本公司管理的所有投资组合参与与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量没有超过该证券当日总成交量5%的情形，本基金与本公司管理的其他投资组合在不同时间窗口（如日内、3日内、5日内）同向交易的交易价差未出现异常。

4.4报告期内基金的投资策略和运作分析

2017年三季度股市的风险偏好依旧高涨，美债收益率曲线平坦程度已达到历史极值，市场对美国经济增长过度悲观预期，同时美国政治进程的摇摆也使得市场跌跌不休，但中美经济类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析，通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

报告期内本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内，本公司管理的所有投资组合参与与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量没有超过该证券当日总成交量5%的情形，本基金与本公司管理的其他投资组合在不同时间窗口（如日内、3日内、5日内）同向交易的交易价差未出现异常。

4.4报告期内基金的投资策略和运作分析

2017年三季度股市的风险偏好依旧高涨，美债收益率曲线平坦程度已达到历史极值，市场对美国经济增长过度悲观预期，同时美国政治进程的摇摆也使得市场跌跌不休，但中美经济类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析，通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

报告期内本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内，本公司管理的所有投资组合参与与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量没有超过该证券当日总成交量5%的情形，本基金与本公司管理的其他投资组合在不同时间窗口（如日内、3日内、5日内）同向交易的交易价差未出现异常。

4.4报告期内基金的投资策略和运作分析

2017年三季度股市的风险偏好依旧高涨，美债收益率曲线平坦程度已达到历史极值，市场对美国经济增长过度悲观预期，同时美国政治进程的摇摆也使得市场跌跌不休，但中美经济类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析，通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

报告期内本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内，本公司管理的所有投资组合参与与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量没有超过该证券当日总成交量5%的情形，本基金与本公司管理的其他投资组合在不同时间窗口（如日内、3日内、5日内）同向交易的交易价差未出现异常。

4.4报告期内基金的投资策略和运作分析

2017年三季度股市的风险偏好依旧高涨，美债收益率曲线平坦程度已达到历史极值，市场对美国经济增长过度悲观预期，同时美国政治进程的摇摆也使得市场跌跌不休，但中美经济类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析，通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

报告期内本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内，本公司管理的所有投资组合参与与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量没有超过该证券当日总成交量5%的情形，本基金与本公司管理的其他投资组合在不同时间窗口（如日内、3日内、5日内）同向交易的交易价差未出现异常。

4.4报告期内基金的投资策略和运作分析

2017年三季度股市的风险偏好依旧高涨，美债收益率曲线平坦程度已达到历史极值，市场对美国经济增长过度悲观预期，同时美国政治进程的摇摆也使得市场跌跌不休，但中美经济类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析，通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

报告期内本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内，本公司管理的所有投资组合参与与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量没有超过该证券当日总成交量5%的情形，本基金与本公司管理的其他投资组合在不同时间窗口（如日内、3日内、5日内）同向交易的交易价差未出现异常。

4.4报告期内基金的投资策略和运作分析

2017年三季度股市的风险偏好依旧高涨，美债收益率曲线平坦程度已达到历史极值，市场对美国经济增长过度悲观预期，同时美国政治进程的摇摆也使得市场跌跌不休，但中美经济类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析，通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

报告期内本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内，本公司管理的所有投资组合参与与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量没有超过该证券当日总成交量5%的情形，本基金与本公司管理的其他投资组合在不同时间窗口（如日内、3日内、5日内）同向交易的交易价差未出现异常。

4.4报告期内基金的投资策略和运作分析

2017年三季度股市的风险偏好依旧高涨，美债收益率曲线平坦程度已达到历史极值，市场对美国经济增长过度悲观预期，同时美国政治进程的摇摆也使得市场跌跌不休，但中美经济类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析，通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

报告期内本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内，本公司管理的所有投资组合参与与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量没有超过该证券当日总成交量5%的情形，本基金与本公司管理的其他投资组合在不同时间窗口（如日内、3日内、5日内）同向交易的交易价差未出现异常。

4.4报告期内基金的投资策略和运作分析

2017年三季度股市的风险偏好依旧高涨，美债收益率曲线平坦程度已达到历史极值，市场对美国经济增长过度悲观预期，同时美国政治进程的摇摆也使得市场跌跌不休，但中美经济类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析，通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

报告期内本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内，本公司管理的所有投资组合参与与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量没有超过该证券当日总成交量5%的情形，本基金与本公司管理的其他投资组合在不同时间窗口（如日内、3日内、5日内）同向交易的交易价差未出现异常。

4.4报告期内基金的投资策略和运作分析

2017年三季度股市的风险偏好依旧高涨，美债收益率曲线平坦程度已达到历史极值，市场对美国经济增长过度悲观预期，同时美国政治进程的摇摆也使得市场跌跌不休，但中美经济类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析，通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

报告期内本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内，本公司管理的所有投资组合参与与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量没有超过该证券当日总成交量5%的情形，本基金与本公司管理的其他投资组合在不同时间窗口（如日内、3日内、5日内）同向交易的交易价差未出现异常。

4.4报告期内基金的投资策略和运作分析

2017年三季度股市的风险偏好依旧高涨，美债收益率曲线平坦程度已达到历史极值，市场对美国经济增长过度悲观预期，同时美国政治进程的摇摆也使得市场跌跌不休，但中美经济类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析，通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

报告期内本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内，本公司管理的所有投资组合参与与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量没有超过该证券当日总成交量5%的情形，本基金与本公司管理的其他投资组合在不同时间窗口（如日内、3日内、5日内）同向交易的交易价差未出现异常。

4.4报告期内基金的投资策略和运作分析

2017年三季度股市的风险偏好依旧高涨，美债收益率曲线平坦程度已达到历史极值，市场对美国经济增长过度悲观预期，同时美国政治进程的摇摆也使得市场跌跌不休，但中美经济类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析，通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

报告期内本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内，本公司管理的所有投资组合参与与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量没有超过该证券当日总成交量5%的情形，本基金与本公司管理的其他投资组合在不同时间窗口（如日内、3日内、5日内）同向交易的交易价差未出现异常。

4.4报告期内基金的投资策略和运作分析

2017年三季度股市的风险偏好依旧高涨，美债收益率曲线平坦程度已达到历史极值，市场对美国经济增长过度悲观预期，同时美国政治进程的摇摆也使得市场跌跌不休，但中美经济类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析，通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

报告期内本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内，本公司管理的所有投资组合参与与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量没有超过该证券当日总成交量5%的情形，本基金与本公司管理的其他投资组合在不同时间窗口（如日内、3日内、5日内）同向交易的交易价差未出现异常。

4.4报告期内基金的投资策略和运作分析

2017年三季度股市的风险偏好依旧高涨，美债收益率曲线平坦程度已达到历史极值，市场对美国经济增长过度悲观预期，同时美国政治进程的摇摆也使得市场跌跌不休，但中美经济类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析，通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

报告期内本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内，本公司管理的所有投资组合参与与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量没有超过该证券当日总成交量5%的情形，本基金与本公司管理的其他投资组合在不同时间窗口（如日内、3日内、5日内）同向交易的交易价差未出现异常。

4.4报告期内基金的投资策略和运作分析

2017年三季度股市的风险偏好依旧高涨，美债收益率曲线平坦程度已达到历史极值，市场对美国经济增长过度悲观预期，同时美国政治进程的摇摆也使得市场跌跌不休，但中美经济类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析，通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

报告期内本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内，本公司管理的所有投资组合参与与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量没有超过该证券当日总成交量5%的情形，本基金与本公司管理的其他投资组合在不同时间窗口（如日内、3日内、5日内）同向交易的交易价差未出现异常。

4.4报告期内基金的投资策略和运作分析

2017年三季度股市的风险偏好依旧高涨，美债收益率曲线平坦程度已达到历史极值，市场对美国经济增长过度悲观预期，同时美国政治进程的摇摆也使得市场跌跌不休，但中美经济类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析，通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

报告期内本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内，本公司管理的所有投资组合参与与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量没有超过该证券当日总成交量5%的情形，本基金与本公司管理的其他投资组合在不同时间窗口（如日内、3日内、5日内）同向交易的交易价差未出现异常。

4.4报告期内基金的投资策略和运作分析

2017年第三季度，A股市场在企稳回升的带动下迎来较好行情，各大指数均有表现。在周期产业领域，以资源类和化工产业为代表，随着环保政策等因素倒逼改革的深化，以及龙头企业本身的竞争力增强，较多公司取得优秀业绩。在成长产业领域，以新能源汽车、消费升级为代表，迎来行业新机遇，龙头企业盈利能力快速增长。我们认为以盈利驱动的市场行情是比较坚实的，而未来更多的盈利增长来源于其内在竞争力的增强，更为难能可贵。

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：二〇一七年十月二十五日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告自2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金名称	交银施罗德纯债债券发起式证券投资基金
基金主代码	519072
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年12月19日
报告期末基金份额总额	460,960,274.02份
投资目标	本基金属于中长期债券基金，在严格控制投资风险的基础上，追求稳定的当期收益和长期增值，力争实现超越业绩比较基准的投资目标。
投资策略	本基金采取分散化投资策略，精选个股，通过基本面分析、行业景气度分析、公司成长性分析等多种方法，结合定量与定性分析，选择具有良好成长性的上市公司股票，在适度控制股票仓位的前提下，追求基金资产的长期增值，力争实现超越业绩比较基准的投资目标。
业绩比较基准	中证500指数收益率+30%×中国国债收益率
风险收益特征	本基金是一只混合型基金，属于证券投资基金中中等风险的品种，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
下属两级基金的基金简称	交银成长混合A
下属两级基金的基金代码	A160902 (前缀) A160901 (后缀)
报告期末下属两级基金的资产总额	797,409,702.13元

注：1.本基金A/B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，前端交易佣金计入A类基金份额申购费用，后端交易佣金计入B类基金份额申购费用；

2.本基金为发起式基金。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

主要财务指标	2017年7月1日-2017年9月30日	2017年7月1日-2017年9月30日
	交银纯债债券发起A/B	交银纯债债券发起C
1.本期已实现收益	2,797,562,654	92,587,025
2.本期利润	2,136,659,957	113,066,520
3.加权平均基金份额本期利润	0.0071	0.0062
4.期末基金份额净值	607.72,638.47	17.447,330.68
5.期末基金份额净值增长率	1.000	1.000

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，计入费用后的实际收益才低于所列数据。

2、本期利润=本期已实现收益+资本公积转增收益+投资收益+其他收入（不含公允价值变动损益）-实际计提基金费用。本期利润=本期已实现收益+公允价值变动损益+

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，计入费用后的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加上本期公允价值变动收益；

3.2 基金净值表现

3.2.1本报告期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、交银纯债债券发起A/B：

阶段	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
过去三个月	0.70%	0.03%	-0.10%	0.04%	0.80%	0.01%