

## 交银施罗德丰泽收益债券型证券投资基金

## 2017年第三季度报告

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.交银丰泽收益债券C :						
份额	净值增长率 (①)	净值增长率 标准差差 距	业绩比较基 准收益率 标准差	业绩比较基 准收益率 差	①-③	②-④
过去三个月	-0.03%	0.05%	-0.08%	0.04%	0.06%	0.01%

注:本基金自2017年2月6日起转为开放式运作,本基金的业绩比较基准由“两年期银行定期存款后收益率+1.25%”变更为“中债综合全价指数”,3.22%。

2.交银丰泽收益债券C :						
份额	净值增长率 (①)	净值增长率 标准差差 距	业绩比较基 准收益率 标准差	业绩比较基 准收益率 差	①-③	②-④
过去三个月	0.16%	0.04%	-0.16%	0.04%	0.26%	0.00%

注:本基金自2017年2月6日起转为开放式运作,本基金的业绩比较基准由“两年期银行定期存款后收益率+1.25%”变更为“中债综合全价指数”,3.22%。

3.2 基金产品概况						
基金名称	交银施罗德丰泽收益债券型证券投资基金					
基金代码	010749					
基金运作方式	契约型开放式					
基金合同生效日	2016年1月31日					
报告期末基金资产总额	10,269,194.48元					
投资目标	严控风险的前提下,力争实现基金资产的稳定增值。					
投资策略	本基金在综合分析宏观经济、金融市场的运行情况,在分析和把握宏观经济运行状况的基础上,结合运用利率期限结构分析、久期分析、收益率曲线分析、信用分析等方法,在严格控制风险的前提下,通过资产配置,在不同资产类别之间进行动态调整,以期在保证本金安全的前提下,力争实现基金资产的稳定增值。					
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					
下属分级基金的基金简称	交银施罗德丰泽收益债券A					
下属分级基金的交易代码	010749					
报告期末下属分级基金的份额总额	10,269,194.48份					
报告期末下属分级基金的资产净值	1,012元					
报告期末下属分级基金的份额净值	1.004					

注:本基金自2017年2月6日起转为开放式运作。

3.3 主要财务指标							
报告期	2017年1月1日至2017年9月30日	报告期	2017年1月1日至2017年9月30日	报告期	2017年1月1日至2017年9月30日	报告期	2017年1月1日至2017年9月30日
主要财务指标							
报告期初基金资产总额	-12,734.60	报告期初基金资产总额	-12,734.60	报告期初基金资产总额	-12,734.60	报告期初基金资产总额	-12,734.60
报告期末基金资产总额	-7,624.62	报告期末基金资产总额	-7,624.62	报告期末基金资产总额	-7,624.62	报告期末基金资产总额	-7,624.62
报告期基金净值增长率	-6.00%	报告期基金净值增长率	-6.00%	报告期基金净值增长率	-6.00%	报告期基金净值增长率	-6.00%
报告期基金资产净值	10,269,194.48	报告期基金资产净值	10,269,194.48	报告期基金资产净值	10,269,194.48	报告期基金资产净值	10,269,194.48
报告期基金资产净值	1,012	报告期基金资产净值	1,012	报告期基金资产净值	1,012	报告期基金资产净值	1,012

注:本基金自2017年2月6日起转为开放式运作。

3.4 主要财务指标							
报告期	2017年1月1日至2017年9月30日	报告期	2017年1月1日至2017年9月30日	报告期	2017年1月1日至2017年9月30日	报告期	2017年1月1日至2017年9月30日
主要财务指标							
报告期初基金资产总额	-12,734.60	报告期初基金资产总额	-12,734.60	报告期初基金资产总额	-12,734.60	报告期初基金资产总额	-12,734.60
报告期末基金资产总额	-7,624.62	报告期末基金资产总额	-7,624.62	报告期末基金资产总额	-7,624.62	报告期末基金资产总额	-7,624.62
报告期基金净值增长率	-6.00%	报告期基金净值增长率	-6.00%	报告期基金净值增长率	-6.00%	报告期基金净值增长率	-6.00%
报告期基金资产净值	1,012	报告期基金资产净值	1,012	报告期基金资产净值	1,012	报告期基金资产净值	1,012

注:本基金自2017年2月6日起转为开放式运作。

3.5 主要财务指标							
报告期	2017年1月1日至2017年9月30日	报告期	2017年1月1日至2017年9月30日	报告期	2017年1月1日至2017年9月30日	报告期	2017年1月1日至2017年9月30日
主要财务指标							
报告期初基金资产总额	-12,734.60	报告期初基金资产总额	-12,734.60	报告期初基金资产总额	-12,734.60	报告期初基金资产总额	-12,734.60
报告期末基金资产总额	-7,624.62	报告期末基金资产总额	-7,624.62	报告期末基金资产总额	-7,624.62	报告期末基金资产总额	-7,624.62
报告期基金净值增长率	-6.00%	报告期基金净值增长率	-6.00%	报告期基金净值增长率	-6.00%	报告期基金净值增长率	-6.00%
报告期基金资产净值	1,012	报告期基金资产净值	1,012	报告期基金资产净值	1,012	报告期基金资产净值	1,012

注:本基金自2017年2月6日起转为开放式运作。

3.6 主要财务指标							
报告期	2017年1月1日至2017年9月30日	报告期	2017年1月1日至2017年9月30日	报告期	2017年1月1日至2017年9月30日	报告期	2017年1月1日至2017年9月30日
主要财务指标							
报告期初基金资产总额	-12,734.60	报告期初基金资产总额	-12,734.60	报告期初基金资产总额	-12,734.60	报告期初基金资产总额	-12,734.60
报告期末基金资产总额	-7,624.62	报告期末基金资产总额	-7,624.62	报告期末基金资产总额	-7,624.62	报告期末基金资产总额	-7,624.62
报告期基金净值增长率	-6.00%	报告期基金净值增长率	-6.00%	报告期基金净值增长率	-6.00%	报告期基金净值增长率	-6.00%
报告期基金资产净值	1,012	报告期基金资产净值	1,012	报告期基金资产净值	1,012	报告期基金资产净值	1,012

注:本基金自2017年2月6日起转为开放式运作。

3.7 主要财务指标							
报告期	2017年1月1日至2017年9月30日	报告期	2017年1月1日至2017年9月30日	报告期	2017年1月1日至2017年9月30日	报告期	2017年1月1日至2017年9月30日
主要财务指标							
报告期初基金资产总额	-12,734.60	报告期初基金资产总额	-12,734.60	报告期初基金资产总额	-12,734.60	报告期初基金资产总额	-12,734.60
报告期末基金资产总额	-7,624.62	报告期末基金资产总额	-7,624.62	报告期末基金资产总额	-7,624.62	报告期末基金资产总额	-7,624.62
报告期基金净值增长率	-6.00%	报告期基金净值增长率	-6.00%	报告期基金净值增长率	-6.00%	报告期基金净值增长率	-6.00%
报告期基金资产净值	1,012	报告期基金资产净值	1,012	报告期基金资产净值	1,012	报告期基金资产净值	1,012

注:本基金自2017年2月6日起转为开放式运作。

3.8 主要财务指标							
报告期	2017年1月1日至2017年9月30日	报告期	2017年1月1日至2017年9月30日	报告期	2017年1月1日至2017年9月30日	报告期	2017年1月1日至2017年9月30日
主要财务指标							
报告期初基金资产总额	-12,734.60	报告期初基金资产总额	-12,734.60	报告期初基金资产总额	-12,734.60	报告期初基金资产总额	-12,734.60
报告期末基金资产总额	-7,624.62	报告期末基金资产总额	-7,624.62	报告期末基金资产总额	-7,624.62	报告期末基金资产总额	-7,624.62
报告期基金净值增长率	-6.00%	报告期基金净值增长率	-6.00%	报告期基金净值增长率	-6.00%	报告期基金净值增长率	-6.00%
报告期基金资产净值	1,012	报告期基金资产净值	1,012	报告期基金资产净值	1,012	报告期基金资产净值	1,012

注:本基金自2017年2月6日起转为开放式运作。