

交银施罗德理财60天债券型证券投资基金

2017年度报告摘要

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：二〇一八年三月二十八日
\$ 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，并承担个别及连带的法律责任。
本基金合同规定，于2018年3月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、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。

本年度报告摘要须全文披露，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

本报告期自2017年1月1日起至12月31日止。

\$ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称 交银理财60天债券

基金代码 519721

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2013年3月13日

基金管理人 交银施罗德基金管理有限公司

基金托管人 中国建设银行股份有限公司

报告期末基金总资产 4,966,910,670,56份

基金份额持有人数 不定期

下属分级基金的基金简称 交银理财60天债券A 交银理财60天债券B

下属分级基金的交易代码 519721 519722

报告期末下属分级基金的份额总额 9,650,918,64份 4,947,259,751,92份

2.2 基金产品说明

投资目标 本基金在追求本金安全、保持资产流动性的基础上，努力追求相对收益，为基金份额持有人谋取稳定收益。

投资策略 本基金将综合运用动态的资产配置策略，结合宏观经济形势、货币市场利率、资金供求状况、收益率曲线、信用利差等各方面的分析，合理安排组合期限结构，积极选择投资工具，实现既定的投资目标。

业债比较基准 人民币上证国债到期收益率

风险收益特征 本基金属于中低风险收益投资品种，长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金及普通债券型基金，高于货币市场型证券投资基金。

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 中国建设银行股份有限公司

姓名 王晓婷 田冉

信息披露负责人 联席电话 (021)61665606 010-67595096

电子邮箱 xjy@synic.com; tianrong@cboc.com

客户服务电话 400-700-5000; 021-61665600 010-67595096

传真 (021)61665664 010-46727583

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 www.fund01.com, www.beimeimuchuode.com

基金年度报告备置地 中国建设银行股份有限公司

§ 3 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1 期间数据 和指标 2017年 2016年 2015年

本期已实现收益 329.103,198.319,174.48 60,623,286.00 60,623,286.00

本期利润 329.103,198.319,174.48 162,423,86 162,423,86

本期的净利润率 4.02% 4.32% 1.78%

本期的净收益 1.54% 1.54% 3.40%

本期的净资产收益率 3.70%

2017年末 2016年末 2015年末

交银理财 60天债券 A 交银理财 60天债券 B 交银理财 60天债券 A 交银理财 60天债券 B

期末基金资产净值 9,650.4,947,849.2,000.110,194,303,52 10,194,303,52

期末基金资产净值 298.64 2,529,751.92 23,938,366,524,238 42,929,509.2

期末基金份额净值 1.0000 1.0000 1.0000 1.0000

注：1.本基金的申购赎回费率为零；
2.本基金每日计算收益并分配，并在运作周期末集中支付。
3.本基金的业绩比较基准为人民币七天通知存款利率+0.05%。
4.本基金的业绩比较基准为人民币七天通知存款利率+0.05%，其与同期业绩比较基准收益变动的比例一致。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1. 交银理财60天债券A

阶段 份额净值增长
收益率 (%) ① 业绩比较基
准收益率 (%) ② ①-②

过去三个月 1.0646% 0.0007% 0.3403% 0.0000% 0.7243% 0.0007%

过去六个月 2.0942% 0.0007% 0.6805% 0.0000% 1.4137% 0.0007%

过去一年 4.0190% 0.0010% 1.3500% 0.0000% 2.6690% 0.0010%

过去三年 9.4707% 0.0085% 4.0637% 0.0000% 5.4170% 0.0085%

自基合同生效至今 17.1046% 0.0081% 6.4911% 0.0000% 10.6136% 0.0081%

注：1.本表净值收益率数据所取的基金运作周期为基金合同生效日起为起始日的运作周期。
2.本基金每日计算收益并分配，并在运作周期末集中支付。
3.本基金的业绩比较基准为人民币七天通知存款利率+0.05%，其与同期业绩比较基准收益变动的比例一致。

1. 交银理财60天债券B

阶段 份额净值增长
收益率 (%) ① 业绩比较基
准收益率 (%) ② ①-②

过去三个月 1.1370% 0.0007% 0.3403% 0.0000% 0.7970% 0.0007%

过去六个月 2.2425% 0.0007% 0.6805% 0.0000% 1.5620% 0.0007%

过去一年 4.2180% 0.0010% 1.3500% 0.0000% 2.9690% 0.0010%

过去三年 9.9426% 0.0088% 4.0637% 0.0000% 5.7989% 0.0088%

自基合同生效至今 15.1740% 0.0083% 6.4911% 0.0000% 8.6838% 0.0083%

注：1.本表净值收益率数据所取的基金运作周期为基金合同生效日起为起始日的运作周期。
2.本基金每日计算收益并分配，并在运作周期末集中支付。
3.本基金的业绩比较基准为人民币七天通知存款利率+0.05%，其与同期业绩比较基准收益变动的比例一致。

1. 交银理财60天债券A

阶段 份额净值增长
收益率 (%) ① 业绩比较基
准收益率 (%) ② ①-②

过去三个月 1.0646% 0.0007% 0.3403% 0.0000% 0.7243% 0.0007%

过去六个月 2.0942% 0.0007% 0.6805% 0.0000% 1.4137% 0.0007%

过去一年 4.0190% 0.0010% 1.3500% 0.0000% 2.6690% 0.0010%

过去三年 9.4707% 0.0085% 4.0637% 0.0000% 5.7989% 0.0088%

自基合同生效至今 17.1046% 0.0081% 6.4911% 0.0000% 10.6136% 0.0081%

注：1.本表净值收益率数据所取的基金运作周期为基金合同生效日起为起始日的运作周期。
2.本基金每日计算收益并分配，并在运作周期末集中支付。
3.本基金的业绩比较基准为人民币七天通知存款利率+0.05%，其与同期业绩比较基准收益变动的比例一致。

1. 交银理财60天债券B

阶段 份额净值增长
收益率 (%) ① 业绩比较基
准收益率 (%) ② ①-②

过去三个月 1.1370% 0.0007% 0.3403% 0.0000% 0.7970% 0.0007%

过去六个月 2.2425% 0.0007% 0.6805% 0.0000% 1.5620% 0.0007%

过去一年 4.2180% 0.0010% 1.3500% 0.0000% 2.9690% 0.0010%

过去三年 9.9426% 0.0088% 4.0637% 0.0000% 5.7989% 0.0088%

自基合同生效至今 15.1740% 0.0083% 6.4911% 0.0000% 8.6838% 0.0083%

注：1.本表净值收益率数据所取的基金运作周期为基金合同生效日起为起始日的运作周期。
2.本基金每日计算收益并分配，并在运作周期末集中支付。
3.本基金的业绩比较基准为人民币七天通知存款利率+0.05%，其与同期业绩比较基准收益变动的比例一致。

1. 交银理财60天债券A

阶段 份额净值增长
收益率 (%) ① 业绩比较基
准收益率 (%) ② ①-②

过去三个月 1.0646% 0.0007% 0.3403% 0.0000% 0.7243% 0.0007%

过去六个月 2.0942% 0.0007% 0.6805% 0.0000% 1.4137% 0.0007%

过去一年 4.0190% 0.0010% 1.3500% 0.0000% 2.6690% 0.0010%

过去三年 9.4707% 0.0085% 4.0637% 0.0000% 5.7989% 0.0085%

自基合同生效至今 17.1046% 0.0081% 6.4911% 0.0000% 10.6136% 0.0081%

注：1.本表净值收益率数据所取的基金运作周期为基金合同生效日起为起始日的运作周期。
2.本基金每日计算收益并分配，并在运作周期末集中支付。
3.本基金的业绩比较基准为人民币七天通知存款利率+0.05%，其与同期业绩比较基准收益变动的比例一致。

1. 交银理财60天债券B

阶段 份额净值增长
收益率 (%) ① 业绩比较基
准收益率 (%) ② ①-②

过去三个月 1.1370% 0.0007% 0.3403% 0.0000% 0.7970% 0.0007%

过去六个月 2.2425% 0.0007% 0.6805% 0.0000% 1.5620% 0.0007%

过去一年 4.2180% 0.0010% 1.3500% 0.0000% 2.9690% 0.0010%

过去三年 9.9426% 0.0088% 4.0637% 0.0000% 5.7989% 0.0088%

自基合同生效至今 15.1740% 0.0083% 6.4911% 0.0000% 8.6838% 0.0083%

注：1.本表净值收益率数据所取的基金运作周期为基金合同生效日起为起始日的运作周期。
2.本基金每日计算收益并分配，并在运作周期末集中支付。
3.本基金的业绩比较基准为人民币七天通知存款利率+0.05%，其与同期业绩比较基准收益变动的比例一致。

1. 交银理财60天债券A

阶段 份额净值增长
收益率 (%) ① 业绩比较基
准收益率 (%) ② ①-②

过去三个月 1.0646% 0.0007% 0.3403% 0.0000% 0.7243% 0.0007%

过去六个月 2.0942% 0.0007% 0.6805% 0.0000% 1.4137% 0.0007%

过去一年 4.0190% 0.0010% 1.3500% 0.0000% 2.6690% 0.0010%

过去三年 9.4707% 0.0085% 4.0637% 0.0000% 5.7989% 0.0088%

自基合同生效至今 17.1046% 0.0081% 6.4911% 0.0000% 10.6136% 0.0081%

注：1.本表净值收益率数据所取的基金运作周期为基金合同生效日起为起始日的运作周期。
2.本基金每日计算收益并分配，并在运作周期末集中支付。
3.本基金的业绩比较基准为人民币七天通知存款利率+0.05%，其与同期业绩比较基准收益变动的比例一致。

1. 交银理财60天债券B

阶段 份额净值增长
收益率 (%) ① 业绩比较基
准收益率 (%) ② ①-②

过去三个月 1.1370