

交银施罗德裕兴纯债债券型证券投资基金 2017年年度报告摘要

基金管理人：交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人：兴业银行股份有限公司
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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金管理人兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”）根据本基金合同约定，于2018年3月27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。投资者有权利在作出投资决策前仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同。

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。

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	交银施罗德纯债债券
基金代码	510774
交易代码	510774
基金运作方式	契约型封闭式
基金存续日期	2016年09月27日
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
基金注册登记机构	上海浦东发展银行股份有限公司
基金合同生效日期	2016年09月27日
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
基金合同生效日期	2016年09月27日
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
基金合同生效日期	2016年09月27日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极的投资策略，追求基金资产的中长期增值，力争实现超越业绩比较基准的投资目标。
投资策略	本基金奉行基金管理人研究驱动的投资策略，实行自上而下和自下而上的投资策略。在资产配置上，本基金采取稳健的投资策略，在严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期增值。在股票投资上，本基金采取自下而上的投资策略，在严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期增值。在债券投资上，本基金采取自上而下的投资策略，在严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期增值。
业绩比较基准	中证综合债指数收益率
风险收益特征	本基金是一只债券型基金，风险与收益高于货币型基金，属于证券投资基金中的中低风险品种。

基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
基金注册登记机构	上海浦东发展银行股份有限公司
基金合同生效日期	2016年09月27日
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
基金合同生效日期	2016年09月27日

2.3 主要财务指标、基金份额表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

项目	2017年度	2016年度	2015年度
3.1.1 期间数据和指标			
本期净收益/亏损总额	2,337,000.74	140,300.00	6,134,300.00
加权平均基金份额净值	20.680,220.02	120,146.42	-81,494,321.00
加权平均基金份额净值增长率	0.0300	0.0001	-0.0169
基金份额净值增长率标准差	0.0202	0.0001	-0.0101
3.1.2 期末数据和指标			
期末基金份额净值	-1.6319	-1.6222	-0.0152
期末基金资产净值	6,222,700.22	9,126,136.00	991,342,000.00
期末基金份额净值	1.0401	1.0301	0.0001

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可能低于所列数字；

2、本期已实现收益指基金本期累计收入、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. 交银裕兴纯债债券A：

阶段	份额净值增长率	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	1.80%	0.00%	-1.10%	0.00%	2.90%	0.00%
过去六个月	0.22%	0.02%	-1.20%	0.00%	0.62%	0.02%
过去一年	0.02%	0.02%	-1.20%	0.00%	0.22%	0.02%
自基金合同生效以来	0.04%	0.01%	-1.60%	0.00%	1.14%	0.01%

注：本基金业绩比较基准为中证综合债指数

2. 交银裕兴纯债债券C：

阶段	份额净值增长率	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	1.80%	0.00%	-1.10%	0.00%	2.90%	0.00%
过去六个月	0.22%	0.02%	-1.20%	0.00%	0.62%	0.02%
过去一年	0.02%	0.02%	-1.20%	0.00%	0.64%	0.01%
自基金合同生效以来	0.04%	0.01%	-1.60%	0.00%	1.14%	0.01%

注：本基金业绩比较基准为中证综合债指数

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

1. 交银裕兴纯债债券A：

阶段	份额净值增长率	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	1.80%	0.00%	-1.10%	0.00%	2.90%	0.00%
过去六个月	0.22%	0.02%	-1.20%	0.00%	0.62%	0.02%
过去一年	0.02%	0.02%	-1.20%	0.00%	0.64%	0.01%
自基金合同生效以来	0.04%	0.01%	-1.60%	0.00%	1.14%	0.01%

注：本基金业绩比较基准为中证综合债指数

2. 交银裕兴纯债债券C：

阶段	份额净值增长率	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	1.80%	0.00%	-1.10%	0.00%	2.90%	0.00%
过去六个月	0.22%	0.02%	-1.20%	0.00%	0.62%	0.02%
过去一年	0.02%	0.02%	-1.20%	0.00%	0.64%	0.01%
自基金合同生效以来	0.04%	0.01%	-1.60%	0.00%	1.14%	0.01%

注：本基金业绩比较基准为中证综合债指数

3.2.3 自基金合同生效以来基金份额累计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

1. 交银裕兴纯债债券A：

阶段	份额净值增长率	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	1.80%	0.00%	-1.10%	0.00%	2.90%	0.00%
过去六个月	0.22%	0.02%	-1.20%	0.00%	0.62%	0.02%
过去一年	0.02%	0.02%	-1.20%	0.00%	0.64%	0.01%
自基金合同生效以来	0.04%	0.01%	-1.60%	0.00%	1.14%	0.01%

注：本基金业绩比较基准为中证综合债指数

2. 交银裕兴纯债债券C：

阶段	份额净值增长率	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	1.80%	0.00%	-1.10%	0.00%	2.90%	0.00%
过去六个月	0.22%	0.02%	-1.20%	0.00%	0.62%	0.02%
过去一年	0.02%	0.02%	-1.20%	0.00%	0.64%	0.01%
自基金合同生效以来	0.04%	0.01%	-1.60%	0.00%	1.14%	0.01%

注：本基金业绩比较基准为中证综合债指数

3.2.3 自基金合同生效以来基金份额累计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

1. 交银裕兴纯债债券A：

阶段	份额净值增长率	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	1.80%	0.00%	-1.10%	0.00%	2.90%	0.00%
过去六个月	0.22%	0.02%	-1.20%	0.00%	0.62%	0.02%
过去一年	0.02%	0.02%	-1.20%	0.00%	0.64%	0.01%
自基金合同生效以来	0.04%	0.01%	-1.60%	0.00%	1.14%	0.01%

注：本基金业绩比较基准为中证综合债指数

2. 交银裕兴纯债债券C：

阶段	份额净值增长率	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	1.80%	0.00%	-1.10%	0.00%	2.90%	0.00%
过去六个月	0.22%	0.02%	-1.20%	0.00%	0.62%	0.02%
过去一年	0.02%	0.02%	-1.20%	0.00%	0.64%	0.01%
自基金合同生效以来	0.04%	0.01%	-1.60%	0.00%	1.14%	0.01%

注：本基金业绩比较基准为中证综合债指数

3.2.3 自基金合同生效以来基金份额累计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

1. 交银裕兴纯债债券A：

阶段	份额净值增长率	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	1.80%	0.00%	-1.10%	0.00%	2.90%	0.00%
过去六个月	0.22%	0.02%	-1.20%	0.00%	0.62%	0.02%
过去一年	0.02%	0.02%	-1.20%	0.00%	0.64%	0.01%
自基金合同生效以来	0.04%	0.01%	-1.60%	0.00%	1.14%	0.01%

注：本基金业绩比较基准为中证综合债指数

2. 交银裕兴纯债债券C：

阶段	份额净值增长率	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	1.80%	0.00%	-1.10%	0.00%	2.90%	0.00%
过去六个月	0.22%	0.02%	-1.20%	0.00%	0.62%	0.02%
过去一年	0.02%	0.02%	-1.20%	0.00%	0.64%	0.01%
自基金合同生效以来	0.04%	0.01%	-1.60%	0.00%	1.14%	0.01%

注：本基金业绩比较基准为中证综合债指数

3.2.3 自基金合同生效以来基金份额累计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

1. 交银裕兴纯债债券A：

阶段	份额净值增长率	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	1.80%	0.00%	-1.10%	0.00%	2.90%	0.00%
过去六个月	0.22%	0.02%	-1.20%	0.00%	0.62%	0.02%
过去一年	0.02%	0.02%	-1.20%	0.00%	0.64%	0.01%
自基金合同生效以来	0.04%	0.01%	-1.60%	0.00%	1.14%	0.01%

注：本基金业绩比较基准为中证综合债指数

2. 交银裕兴纯债债券C：

阶段	份额净值增长率	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	1.80%	0.00%	-1.10%	0.00%	2.90%	0.00%
过去六个月	0.22%	0.02%	-1.20%	0.00%	0.62%	0.02%
过去一年	0.02%	0.02%	-1.20%	0.00%	0.64%	0.01%
自基金合同生效以来	0.04%	0.01%	-1.60%	0.00%	1.14%	0.01%

注：本基金业绩比较基准为中证综合债指数

3.2.3 自基金合同生效以来基金份额累计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

1. 交银裕兴纯债债券A：

阶段	份额净值增长率	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	1.80%	0.00%	-1.10%	0.00%	2.90%	0.00%
过去六个月	0.22%	0.02%	-1.20%	0.00%	0.62%	0.02%
过去一年	0.02%	0.02%	-1.20%	0.00%	0.64%	0.01%
自基金合同生效以来	0.04%	0.01%	-1.60%	0.00%	1.14%	0.01%

注：本基金业绩比较基准为中证综合债指数

2. 交银裕兴纯债债券C：

阶段	份额净值增长率	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	1.80%	0.00%	-1.10%	0.00%	2.90%	0.00%
过去六个月	0.22%	0.02%	-1.20%	0.00%	0.62%	0.02%
过去一年	0.02%	0.02%	-1.20%	0.00%	0.64%	0.01%
自基金合同生效以来	0.04%	0.01%	-1.60%	0.00%	1.14%	0.01%

注：本基金业绩比较基准为中证综合债指数

3.2.3 自基金合同生效以来基金份额累计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

1. 交银裕兴纯债债券A：

阶段	份额净值增长率	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	1.80%	0.00%	-1.10%	0.00%	2.90%	0.00%
过去六个月	0.22%	0.02%	-1.20%	0.00%	0.62%	0.02%
过去一年	0.02%	0.02%	-1.20%	0.00%	0.64%	0.01%
自基金合同生效以来	0.04%	0.01%	-1.60%	0.00%	1.14%	0.01%

注：本基金业绩比较基准为中证综合债指数

2. 交银裕兴纯债债券C：

阶段	份额净值增长率	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	1.80%	0.00%	-1.10%	0.00%	2.90%	0.00%
过去六个月	0.22%	0.02%	-1.20%	0.00%	0.62%	0.02%
过去一年	0.02%	0.02%	-1.20%	0.00%	0.64%	0.01%
自基金合同生效以来	0.04%	0.01%	-1.60%	0.00%	1.14%	0.01%

注：本基金业绩比较基准为中证综合债指数

3.2.3 自基金合同生效以来基金份额累计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

1. 交银裕兴纯债债券A：

阶段	份额净值增长率	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	1.80%	0.00%	-1.10%	0.00%	2.90%	0.00%
过去六个月	0.22%	0.02%	-1.20%	0.00%	0.62%	0.02%
过去一年	0.02%	0.02%	-1.20%	0.00%	0.64%	0.01%
自基金合同生效以来	0.04%	0.01%	-1.60%	0.00%	1.14%	0.01%

注：本基金业绩比较基准为中证综合债指数

2. 交银裕兴纯债债券C：

阶段	份额净值增长率	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	1.80%	0.00%	-1.10%	0.00%	2.90%	0.00%
过去六个月	0.22%	0.02%	-1.20%	0.00%	0.62%	0.02%
过去一年	0.02%	0.02%	-1.20%	0.00%	0.64%	0.01%
自基金合同生效以来	0.04%	0.01%	-1.60%	0.00%	1.14%	0.01%

注：本基金业绩比较基准为中证综合债指数

3.2.3 自基金合同生效以来基金份额累计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

1. 交银裕兴纯债债券A：

阶段	份额净值增长率	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	1.80%	0.00%	-1.10%	0.00%	2.90%	0.00%
过去六个月	0.22%	0.02%	-1.20%	0.00%	0.62%	0.02%
过去一年	0.02%	0.02%	-1.20%	0.00%	0.64%	0.01%
自基金合同生效以来	0.04%	0.01%	-1.60%	0.00%	1.14%	0.01%

注：本基金业绩比较基准为中证综合债指数

2. 交银裕兴纯债债券C：

阶段	份额净值增长率	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	1.80%	0.00%	-1.10%	0.00%	2.90%	0.00%
过去六个月	0.22%	0.02%				