

交银施罗德裕隆纯债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:中邮乐收银行股份有限公司
报告送达日期:二〇一八年三月二十日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监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,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。本基金报告经三分之二以上独立董事签字同意,并由基金经理签署。

基金托管人:中邮乐收银行股份有限公司以下简称“邮储银行”)根据本基金合同规定,于2018年3月20日复核了本报告的内容,对本基金不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏表示确认。

基金经理承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理本基金,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。

本年度报告摘要能简要年度报告正文,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2017年12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	交银施罗德裕隆纯债债券型证券投资基金
基金代码	619762
交易代码	619762
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年11月10日
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司
报告期末基金总资产	524,340,645.13份
基金合同的延续期	不定期
下属分级基金的基金简称	交银施罗德裕隆债券A 交银施罗德裕隆债券C
下属分级基金的交易代码	619762 619763
报告期末下属分级基金的份额总额	524,337,894.13份 2,661,00份

2.2 基金产品说明

投资目标 在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,通过积极的资产配置策略,力争实现长期稳定的资本增值。

投资策略 本基金主要投资于货币市场工具、对宏观经济运行趋势、财政以及货币政策走势分析和判断,对未来市场利差预期以及市场价格变化作出判断,动态调整大类金融资产配置比例,在严控风险的前提下力求获得超越基准收益。结合经济形势的变动对不同券种收益率、信用利差和风险的消长影响,深入挖掘被低估的券种。

业绩比较基准 中债综合全价指数收益率

风险收益特征 本基金是一只债券基金,其预期风险低于股票市场基金,低于混合基金和股票型基金,属于证券投资基金中低风险的基金。

2.3 基金管理人员和基金经理

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	中国邮政储蓄银行股份有限公司
姓名	王鸿鹏	田东晖
信息披露负责人	(021)61060506	010-69961113
电子邮箱	xph@jzsf.com.cn tiandonghai@pbdc.com	
客户服务电话	400-700-50000, 021-61050000	95569
传真	(021)61060504	010-69989120

2.4 信息披露方式

报告期内披露的正文中管理人互联网网址: www.jzsf001.com, www.jzcsch.com

基金管理人报告书披露地点:基金公司办公场所

2.5 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

金额单位:人民币元

3.1 本期数据和指标	2017年		2016年11月10日至2017年12月31日	
	本期已实现收益	期末可供分配利润	本期末	上一年度同日
交银施罗德裕隆纯债债券A	40,607,800.33	123.49	3,964,533.44	7166
交银施罗德裕隆纯债债券C	88,176,106.04	88.07	1,066,001.64	936
加权平均基金份额	0.0361	0.0260	0.0064	0.0025
本期基金份额净值	3.07%	2.48%	0.27%	0.24%
3.1.2 期末数据和指标	2017年末	2016年末		
交银施罗德裕隆纯债债券A	0.0336	0.0374	0.0024	0.0030
交银施罗德裕隆纯债债券C	0.0404	0.0404	0.0095	0.0095
期末基金份额净值	641,944,105.16	7,338.4	4,908,166.100	190.59
期末基金份额净值	1,0336	1,0274	1,0028	1,0025

注:本基金的业绩比较基准为中债综合全价指数。

3.2.2 交银施罗德纯债债券C

阶段 分期评价期限 预期收益率(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准准偏差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.20% 0.04% -1.15% 0.06% 1.26% -0.02%

过去六个月 1.15% 0.03% -1.20% 0.05% 2.45% -0.02%

过去一年 3.07% 0.09% -3.38% 0.06% 6.45% -0.01%

自基点合同生效以来 3.36% 0.04% -6.05% 0.09% 8.41% -0.06%

注:本基金业绩比较基准为中债综合全价指数。

3.2.3 本基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.3.1 交银施罗德裕隆纯债债券A

阶段 分期评价期限 预期收益率(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准准偏差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.11% 0.04% -1.15% 0.06% 1.26% -0.02%

过去六个月 0.95% 0.03% -1.20% 0.05% 2.45% -0.02%

过去一年 2.48% 0.04% -3.38% 0.06% 6.38% -0.02%

自基点合同生效以来 2.74% 0.04% -6.05% 0.09% 7.79% -0.06%

注:本基金合同生效日为2016年11月28日,截至报告期末,本基金已完成建仓但报告期末尚未建仓完毕。本基金建仓行为自基金合同生效之日起的6个月内,截至建仓结束,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。

3.2.3.2 交银施罗德裕隆纯债债券C

阶段 分期评价期限 预期收益率(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准准偏差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.11% 0.04% -1.15% 0.06% 1.26% -0.02%

过去六个月 0.95% 0.03% -1.20% 0.05% 2.45% -0.02%

过去一年 2.48% 0.04% -3.38% 0.06% 6.38% -0.02%

自基点合同生效以来 2.74% 0.04% -6.05% 0.09% 7.79% -0.06%

注:本基金合同生效日为2016年11月28日,截至报告期末,本基金已完成建仓但报告期末尚未建仓完毕。本基金建仓行为自基金合同生效之日起的6个月内,截至建仓结束,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。

3.2.3.3 交银施罗德裕隆纯债债券A

阶段 分期评价期限 预期收益率(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准准偏差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.11% 0.04% -1.15% 0.06% 1.26% -0.02%

过去六个月 0.95% 0.03% -1.20% 0.05% 2.45% -0.02%

过去一年 2.48% 0.04% -3.38% 0.06% 6.38% -0.02%

自基点合同生效以来 2.74% 0.04% -6.05% 0.09% 7.79% -0.06%

注:本基金合同生效日为2016年11月28日,截至报告期末,本基金已完成建仓但报告期末尚未建仓完毕。本基金建仓行为自基金合同生效之日起的6个月内,截至建仓结束,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。

3.2.3.4 交银施罗德裕隆纯债债券C

阶段 分期评价期限 预期收益率(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准准偏差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.11% 0.04% -1.15% 0.06% 1.26% -0.02%

过去六个月 0.95% 0.03% -1.20% 0.05% 2.45% -0.02%

过去一年 2.48% 0.04% -3.38% 0.06% 6.38% -0.02%

自基点合同生效以来 2.74% 0.04% -6.05% 0.09% 7.79% -0.06%

注:本基金合同生效日为2016年11月28日,截至报告期末,本基金已完成建仓但报告期末尚未建仓完毕。本基金建仓行为自基金合同生效之日起的6个月内,截至建仓结束,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。

3.2.3.5 交银施罗德裕隆纯债债券A

阶段 分期评价期限 预期收益率(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准准偏差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.11% 0.04% -1.15% 0.06% 1.26% -0.02%

过去六个月 0.95% 0.03% -1.20% 0.05% 2.45% -0.02%

过去一年 2.48% 0.04% -3.38% 0.06% 6.38% -0.02%

自基点合同生效以来 2.74% 0.04% -6.05% 0.09% 7.79% -0.06%

注:本基金合同生效日为2016年11月28日,截至报告期末,本基金已完成建仓但报告期末尚未建仓完毕。本基金建仓行为自基金合同生效之日起的6个月内,截至建仓结束,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。

3.2.3.6 交银施罗德裕隆纯债债券C

阶段 分期评价期限 预期收益率(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准准偏差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.11% 0.04% -1.15% 0.06% 1.26% -0.02%

过去六个月 0.95% 0.03% -1.20% 0.05% 2.45% -0.02%

过去一年 2.48% 0.04% -3.38% 0.06% 6.38% -0.02%

自基点合同生效以来 2.74% 0.04% -6.05% 0.09% 7.79% -0.06%

注:本基金合同生效日为2016年11月28日,截至报告期末,本基金已完成建仓但报告期末尚未建仓完毕。本基金建仓行为自基金合同生效之日起的6个月内,截至建仓结束,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。

3.2.3.7 交银施罗德裕隆纯债债券A

阶段 分期评价期限 预期收益率(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准准偏差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.11% 0.04% -1.15% 0.06% 1.26% -0.02%

过去六个月 0.95% 0.03% -1.20% 0.05% 2.45% -0.02%

过去一年 2.48% 0.04% -3.38% 0.06% 6.38% -0.02%

自基点合同生效以来 2.74% 0.04% -6.05% 0.09% 7.79% -0.06%

注:本基金合同生效日为2016年11月28日,截至报告期末,本基金已完成建仓但报告期末尚未建仓完毕。本基金建仓行为自基金合同生效之日起的6个月内,截至建仓结束,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。

3.2.3.8 交银施罗德裕隆纯债债券C

阶段 分期评价期限 预期收益率(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准准偏差(%) ①-③ ②-④

过去三个月