

交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金

2015 年半年度报告摘要

2015 年 6 月 30 日

基金管理人：交银施罗德基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一五年八月二十九日

1 重要提示

1.1 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。本半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 2015 年 8 月 28 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	交银纯债债券发起	
基金主代码	519718	
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	
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	
报告期末基金份额总额	244,248,969.43 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	交银纯债债券发起 A/B	交银纯债债券发起 C
下属分级基金的交易代码	519718（前端）、 519719（后端）	519720
报告期末下属分级基金的份额总额	163,632,239.02 份	80,616,730.41 份

注：1、本基金 A 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，前端交易代码即为 A 类基金份额交易代码，后端交易代码即为 B 类基金份额交易代码。

2、本基金为发起式基金。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为纯债基金，在严格控制投资风险的基础上，追求稳定的当期收益和基金资产的稳健增值。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势，将规范化的基本面研究、严谨的信用分析与积极主动的投资风格相结合，在分析和判断宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上，动态调整大类金融资产比例，自上而下决定债券组合久期、期限结构、债券类别配置策略，在严谨深入的分析基础上，综合考量各类债券的流动性、供求关系和收益率水平等，自下而上地精选个券。
业绩比较基准	中债综合全价指数
风险收益特征	本基金是一只债券型基金，属于证券投资基金中中等风险的品种，其长期平均的预期收益和风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙艳	林葛
	联系电话	021-61055050	010-66060069
	电子邮箱	xxpl@jysld.com, disclosure@jysld.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-700-5000, 021-61055000	95599
传真		021-61055054	010-68121816

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.fund001.com, www.bocomschroder.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人的办公场所

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2015年1月1日至2015年6月30日）	
	交银纯债债券发起 A/B	交银纯债债券发起 C
本期已实现收益	6,140,843.22	2,522,606.82
本期利润	7,869,986.73	3,568,846.12
加权平均基金份额本期利润	0.0588	0.0606
本期基金份额净值增长率	5.81%	5.59%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)	
	交银纯债债券发起 A/B	交银纯债债券发起 C
期末可供分配基金份额利润	0.046	0.031

期末基金资产净值	177,408,539.01	86,186,504.80
期末基金份额净值	1.084	1.069

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 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

交银纯债债券发起 A/B

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.65%	0.07%	-0.08%	0.05%	0.73%	0.02%
过去三个月	3.84%	0.14%	1.35%	0.10%	2.49%	0.04%
过去六个月	5.81%	0.16%	1.19%	0.10%	4.62%	0.06%
过去一年	9.63%	0.16%	3.60%	0.11%	6.03%	0.05%
自基金合同生效起至今	16.02%	0.13%	3.81%	0.10%	12.21%	0.03%

注：本基金的业绩比较基准为中债综合全价指数。

交银纯债债券发起 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.56%	0.07%	-0.08%	0.05%	0.64%	0.02%
过去三个月	3.59%	0.14%	1.35%	0.10%	2.24%	0.04%
过去六个月	5.59%	0.17%	1.19%	0.10%	4.40%	0.07%

过去一年	9.13%	0.16%	3.60%	0.11%	5.53%	0.05%
自基金合同生效起至今	14.39%	0.13%	3.81%	0.10%	10.58%	0.03%

注：本基金的业绩比较基准为中债综合全价指数。

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

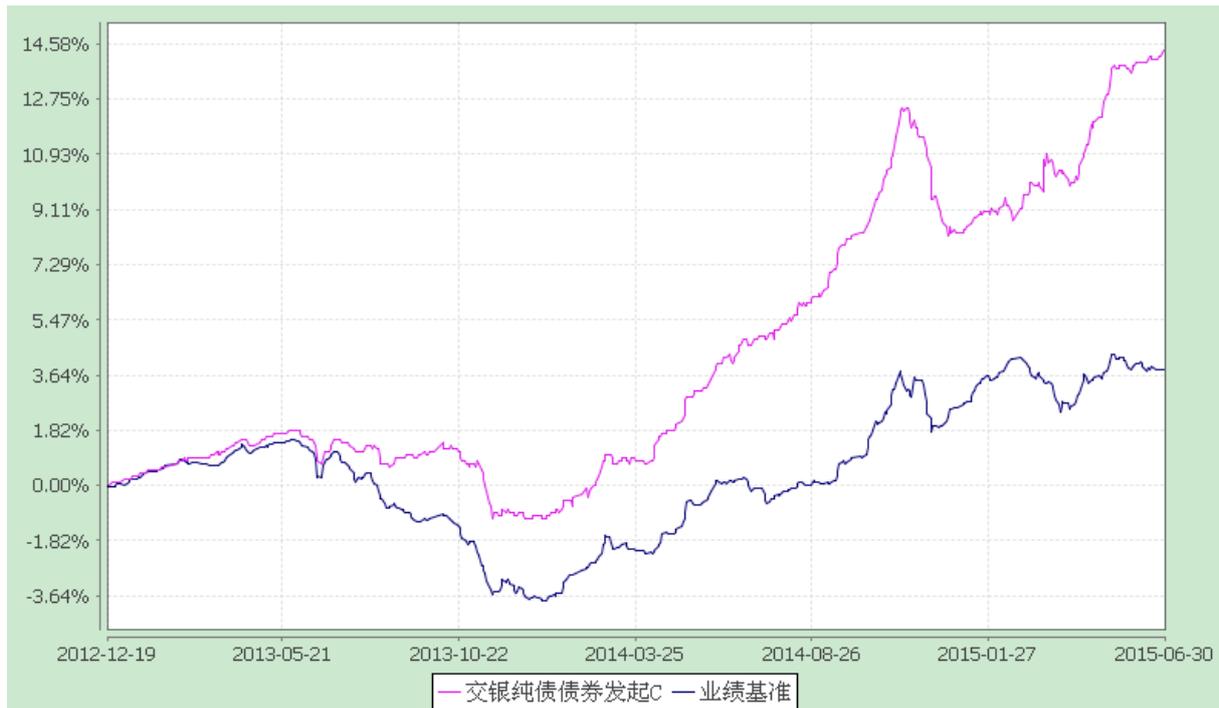
交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2012 年 12 月 19 日至 2015 年 6 月 30 日)

交银纯债债券发起 A/B



注：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。

交银纯债债券发起 C



注：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。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

交银施罗德基金管理有限公司是经中国证监会证监基金字[2005]128 号文批准，由交通银行股份有限公司、施罗德投资管理有限公司、中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司共同发起设立。公司成立于 2005 年 8 月 4 日，注册地在中国上海，注册资本金为 2 亿元人民币。其中，交通银行股份有限公司持有 65% 的股份，施罗德投资管理有限公司持有 30% 的股份，中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司持有 5% 的股份。公司并下设交银施罗德资产管理（香港）有限公司和交银施罗德资产管理有限公司。

截至报告期末，公司已经发行并管理了 46 只基金，包括 2 只货币市场基金、13 只债券型基金、9 只混合型基金、3 只保本混合型基金、19 只股票型基金（其中 3 只为 QDII 基金，2 只为交易型开放式基金（ETF），2 只为 ETF 联接基金）。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经 理（助理）期限	证券从 业年限	说明

		任职日期	离任日期		
林洪钧	交银货币、交银增利债券、交银信用添利债券(LOF)、交银理财 21 天债券、交银纯债债券发起、交银现金宝货币的基金经理，公司固定收益部助理总经理	2014-03-31	2015-06-01	11 年	林洪钧先生，复旦大学硕士。历任国泰君安证券股份有限公司上海分公司机构客户部客户经理，华安基金管理有限公司债券交易员，加拿大 Financial Engineering Source Inc. 金融研究员。2009 年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任专户投资部投资经理助理、专户投资经理、基金经理助理。2011 年 1 月 27 日至 2015 年 5 月 31 日担任交银施罗德信用添利债券证券投资基金(LOF)基金经理，2011 年 6 月 9 日至 2015 年 5 月 31 日担任交银施罗德货币市场证券投资基金基金经理，2012 年 11 月 5 日至 2015 年 5 月 31 日担任交银施罗德理财 21 天债券型证券投资基金基金经理，2014 年 3 月 31 日至 2015 年 5 月 31 日担任交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金基金经理，2014 年 8 月 4 日至 2015 年 5 月 31 日担任交银施罗德增利债券证券投资基金基金经理，2014 年 9 月 12 日至 2015 年 5 月 31 日担任交银施罗德现金宝货币市场基金基金经理。
孙超	交银纯债债券发起、交银理财 60 天债券、交银双轮动债券、交银定期支付月	2015-05-09	-	4 年	孙超先生，美国哥伦比亚大学经济学硕士。历任中信建投证券股份有限公司资产管理部经理、高级经理。2013 年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任基金经理助理。

	月丰债券、交银强化回报债券、交银丰润收益债券、交银丰享收益债券、交银丰泽收益债券的基金经理				
张靖爽	交银货币、交银信用添利债券（LOF）、交银理财 21 天债券、交银纯债债券发起的基金经理助理	2014-07-01	2015-03-15	5 年	张靖爽女士，美国北卡罗莱纳大学数量金融学硕士。历任中银基金固定收益部研究员。2011 年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任债券分析师。

注：1、本表所列基金经理（助理）任职日期和离职日期均以基金合同生效日或公司作出决定并公告（如适用）之日为准。

2、本表所列基金经理（助理）证券从业年限中的“证券从业”的含义遵从中国证券业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。

本报告期内，本基金整体运作合规合法，无不当内幕交易和关联交易，基金投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的约定，未发生损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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专户均严格遵循制度进行公平交易。

公司建立资源共享的投资研究信息平台，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，全部通过交易系统进行比例分配；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”的原则按事前独立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的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下（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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015 年上半年，经济仍在底部，上行动力不足，但政策加码稳增长延续：国内融资定向支持力度增强，PSL 和地方可置换债务规模均有所扩大，地产销量持续好转。市场在强烈的货币宽松预期中迎来多次降息、降准。二季度以来 1 年期金融债收益率大幅下行约 100bp，10 年金融债收益率则维持窄幅震荡，整体收益率曲线呈陡峭化。收益率曲线形态反映了市场对地方债置换、财政政策加码和经济触底企稳的预期和担忧。

中债总全价（总值）指数在一季度下跌 0.56%，二季度上涨 1.34%。本基金报告期内维持了较高的债券仓位，基金净值增长的主要收益来自于较高的票息收入，以及在收益率下行过程中获得的资本利得。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2015 年 6 月 30 日，交银纯债债券发起 A/B 份额净值为 1.084 元，本报告期份额净值增长率为 5.81%，同期业绩比较基准增长率为 1.19%；交银纯债债券发起 C 份额净值为 1.069 元，本报告期份额净值增长率为 5.59%，同期业绩比较基准增长率为 1.19%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年，债券市场面临多重考验：稳增长政策持续发力、资金面宽松已被充分预期、美联储加息渐行渐近、地方债置换进度亦有可能超出投资者预期。财政政策的进一步加码是大概率事件。信用方面，打破刚性兑付的预期进一步上升，我们继续保持对低等级信用债的警惕。当然，随着权益类市场的波动加大，银行体系及其客户风险偏好下降将导致部分资产配置方向转移到固定收益类资产上来，而高收益资产的匮乏也使得银行有下调负债端成本的动力。财富效应消退则对房地产市场的复苏和消费的企稳有负面影响，经济复苏的持续性有待观察。总体而言，我们对下半年债券市场持谨慎态度，警惕预期先于现实而进行调整。本基金下半年将以审慎的操作风格应对债券市场可能的波动。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序，经公司管理层批准后实行，并成立了估值委员会，估值委员会成员由研究部、基金运营部、风险管理部等人员和固定收益人员及基金经理组成。

公司严格按照新会计准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定进行估值，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。估值委员会的研究部成员按投资品种的不同性质，研究并参考市场普遍认同的做法，建议合理的估值模型，进行测算和认证，认可后交各估值委员会成员从基金会计、风险、合规等方面审批，一致同意后，报公司投资总监、总经理审批。

估值委员会会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后，及时召开临时会议进行研究，及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值委员会成员均具备相应的专业资格及工作经验。基金经理作为估值委员会成员，对本基金持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感，向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论。本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突，截止报告期末未有与任何外部估值定价服务机构签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规和基金合同的规定，本基金对上一年度及本年度应分配的可供分配利润进行了收益分配，具体情况参见半年度报告正文 6.4.8.2 资产负债表日后事项及 6.4.11 利润分配情况。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内无需预警说明。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—交银施罗德基金管理有限公司本报告期基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，交银施罗德基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，交银施罗德基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

6半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	4,491,951.59	2,422,594.73
结算备付金		7,593,770.28	12,766,809.71
存出保证金		6,599.72	31,879.42
交易性金融资产	6.4.7.2	422,643,253.39	331,830,649.50
其中：股票投资		-	-

基金投资		-	-
债券投资		422,643,253.39	331,830,649.50
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	6,856,141.99	7,892,055.00
应收股利		-	-
应收申购款		3,218,126.71	146,533.35
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		444,809,843.68	355,090,521.71
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		179,999,755.80	181,599,605.60
应付证券清算款		4,693.44	65,750.97
应付赎回款		417,677.25	550,054.33
应付管理人报酬		129,037.53	105,553.54
应付托管费		43,012.49	35,184.51
应付销售服务费		29,060.79	16,545.46
应付交易费用	6.4.7.7	13,975.74	13,206.64
应交税费		425,400.00	425,400.00
应付利息		3,418.08	28,106.45
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	148,768.75	320,003.22
负债合计		181,214,799.87	183,159,410.72
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	244,248,969.43	162,018,201.74

未分配利润	6.4.7.10	19,346,074.38	9,912,909.25
所有者权益合计		263,595,043.81	171,931,110.99
负债和所有者权益总计		444,809,843.68	355,090,521.71

注：1、报告截止日 2015 年 6 月 30 日，A/B 基金份额净值 1.084 元，C 基金份额净值 1.069 元，基金份额总额 244,248,969.43 份，其中 A/B 基金份额 163,632,239.02 份，C 基金份额 80,616,730.41 份。

2、本摘要中资产负债表和利润表所列附注号为半年度报告正文中对应的附注号，投资者欲了解相应附注的内容，应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

6.2 利润表

会计主体：交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
一、收入		14,688,006.33	16,568,420.50
1.利息收入		10,356,423.18	8,314,846.00
其中：存款利息收入	6.4.7.11	121,555.84	38,931.28
债券利息收入		10,234,867.34	7,932,691.46
资产支持证券利息收入		-	90,739.73
买入返售金融资产收入		-	252,483.53
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,553,880.78	-4,116,627.49
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,553,880.78	-4,116,627.49
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	2,775,382.81	12,256,062.33
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	2,319.56	114,139.66
减：二、费用		3,249,173.48	2,622,647.29
1. 管理人报酬		607,805.63	688,427.47
2. 托管费		202,601.84	229,475.75
3. 销售服务费		122,853.26	84,651.69
4. 交易费用	6.4.7.19	6,407.30	5,441.15
5. 利息支出		2,127,859.09	1,388,530.44
其中：卖出回购金融资产支出		2,127,859.09	1,388,530.44
6. 其他费用	6.4.7.20	181,646.36	226,120.79
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		11,438,832.85	13,945,773.21
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		11,438,832.85	13,945,773.21

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	162,018,201.74	9,912,909.25	171,931,110.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	11,438,832.85	11,438,832.85
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	82,230,767.69	4,568,922.27	86,799,689.96
其中：1.基金申购款	255,788,215.97	13,490,733.06	269,278,949.03
2.基金赎回款	-173,557,448.28	-8,921,810.79	-182,479,259.07
四、本期向基金份额	-	-6,574,589.99	-6,574,589.99

持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	244,248,969.43	19,346,074.38	263,595,043.81
项目	上年度可比期间		
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	261,384,633.99	-2,884,125.68	258,500,508.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	13,945,773.21	13,945,773.21
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	18,642,337.85	2,166,052.15	20,808,390.00
其中：1.基金申购款	154,502,205.20	2,965,165.50	157,467,370.70
2.基金赎回款	-135,859,867.35	-799,113.35	-136,658,980.70
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	280,026,971.84	13,227,699.68	293,254,671.52

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：阮红，主管会计工作负责人：夏华龙，会计机构负责人：朱鸣

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2012]1287 号《关于核准交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金募集的批复》核准，由交银施罗德基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金

基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式的发起式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 2,115,460,756.65 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第 527 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》于 2012 年 12 月 19 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,116,634,959.21 份基金份额，其中认购资金利息折合 1,174,202.56 份基金份额。本基金的基金管理人为交银施罗德基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金为发起式基金，基金募集份额总额不少于 5,000 万份，基金募集金额不少于 5,000 万元，其中基金管理人作为发起资金的提供方认购的金额为 1,000 万元且承诺持有期限不少于三年。

根据《交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》和《交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用、赎回费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取前端认购/申购费用、赎回时收取赎回费用的，称为 A 类基金份额；在投资者认购/申购时不收取认购/申购费用、赎回时收取后端认购/申购费用和赎回费用的，称为 B 类基金份额；在投资者认购/申购、赎回时不收取认购/申购费用、赎回费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。由于基金费用的不同，本基金 A/B 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额，但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、短期融资券、中期票据、公司债、分离交易可转债、资产支持证券、债券逆回购、银行存款等固定收益类资产以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。本基金不直接在二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场新股申购和新股增发。因投资于分离交易可转债而产生的权证，在其可交易之日起的 30 个交易日内卖出。同时本基金不参与可转换债券投资。本基金投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%；现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：中债综合全价指数。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告一致，但会计估计有所变更，详见 6.4.5.2。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期改为采用中央国债登记结算有限责任公司/中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖债券的差价收入不予征收营业税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
交银施罗德基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	基金托管人、基金销售机构
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年 6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	607,805.63	688,427.47
其中：支付销售机构的客户维护 费	59,402.35	114,229.18

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.6%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.6%÷当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年 6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	202,601.84	229,475.75

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.2%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.2% ÷ 当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	交银纯债债券发起 A/B	交银纯债债券发起 C	合计
交通银行	-	5,714.32	5,714.32
中国农业银行	-	5,866.78	5,866.78
交银施罗德基金公司	-	97,182.14	97,182.14
合计	-	108,763.24	108,763.24
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	交银纯债债券发起 A/B	交银纯债债券发起 C	合计
交通银行	-	10,753.43	10,753.43
中国农业银行	-	11,248.75	11,248.75
交银施罗德基金公司	-	59,109.40	59,109.40
合计	-	81,111.58	81,111.58

注：支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日的 C 类基金份额对应的基金资产净值 0.4% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日基金销售服务费 = 前一日 C 类基金份额对应的资产净值 × 0.4% ÷ 当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期		上年度可比期间	
	2015年1月1日至2015年6月30日		2014年1月1日至2014年6月30日	
	交银纯债债券 发起A/B	交银纯债债券发 起C	交银纯债债券发 起A/B	交银纯债债券发 起C
报告期初持有的 基金份额	10,308,519.63	-	10,072,734.64	-
报告期间申购/买 入总份额	397,788.46	-	-	-
报告期间因拆分 变动份额	-	-	-	-
减：报告期间赎 回/卖出总份额	-	-	-	-
报告期末持有的 基金份额	10,706,308.09	-	10,072,734.64	-
报告期末持有的 基金份额 占基金总份额比 例	6.54%	-	6.12%	-

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；
2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2015年1月1日至2015年6月 30日		2014年1月1日至2014年6月 30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限 公司	4,491,951.5 9	19,566.73	2,504,907.6 3	19,579.74

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.9 期末（2015 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 79,999,760.00 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
1382144	13 青城投 MTN1	2015-07-01	102.36	100,000	10,236,000.00
1480044	14 怀化债 02	2015-07-01	108.89	100,000	10,889,000.00
150311	15 进出 11	2015-07-01	99.87	200,000	19,974,000.00
1282340	12 巨化 MTN1	2015-07-01	101.42	100,000	10,142,000.00
1282532	12 蓉公交 MTN1	2015-07-01	102.40	100,000	10,240,000.00
1480276	14 滕州债 02	2015-07-01	106.01	200,000	21,202,000.00
合计				800,000	82,683,000.00

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 99,999,995.80 元，于 2015 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	422,643,253.39	95.02
	其中：债券	422,643,253.39	95.02
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	12,085,721.87	2.72
7	其他各项资产	10,080,868.42	2.27
8	合计	444,809,843.68	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

本基金本报告期内未持有股票。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-

3	金融债券	69,301,000.00	26.29
	其中：政策性金融债	69,301,000.00	26.29
4	企业债券	222,451,253.39	84.39
5	企业短期融资券	50,010,000.00	18.97
6	中期票据	80,881,000.00	30.68
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	422,643,253.39	160.34

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	150205	15 国开 05	300,000	29,241,000.00	11.09
2	124440	13 宁德投	200,000	21,268,000.00	8.07
3	1480276	14 滕州债 02	200,000	21,202,000.00	8.04
4	124711	14 象山债	200,000	21,116,000.00	8.01
5	122527	12 温国投	200,000	20,810,000.00	7.89

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

7.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	6,599.72
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,856,141.99
5	应收申购款	3,218,126.71
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,080,868.42

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构				
			机构投资者		个人投资者		
			持有	占总份	持有	占总份额比例	

			份额	额比例	份额	
交银纯债债券发起 A/B	480	340,900.50	143,672,344.45	87.80%	19,959,894.57	12.20%
交银纯债债券发起 C	319	252,717.02	65,008,268.81	80.64%	15,608,461.60	19.36%
合计	799	305,693.33	208,680,613.26	85.44%	35,568,356.17	14.56%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	交银纯债债券发起 A/B	-	-
	交银纯债债券发起 C	92.33	0.00%
	合计	92.33	0.00%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	交银纯债债券发起 A/B	0
	交银纯债债券发起 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	交银纯债债券发起 A/B	0
	交银纯债债券发起 C	0
	合计	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额 总数	持有份额 占基金总 份额比例	发起份额 总数	发起份额 占基金总 份额比例	发起份额 承诺持有 期限
基金管理人固有资金	10,706,308.09	4.38%	10,072,734.64	4.12%	不低于三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,706,308.09	4.38%	10,072,734.64	4.12%	-

注：本报告期末持有份额总数为发起份额总数和截至本报告期末红利再投份额数的合计。

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	交银纯债债券发起 A/B	交银纯债债券发起 C
基金合同生效日（2012 年 12 月 19 日）基金份额总额	1,492,407,903.76	624,227,055.45
本报告期期初基金份额总额	129,725,123.09	32,293,078.65
本报告期基金总申购份额	49,494,632.30	206,293,583.67
减：本报告期基金总赎回份额	15,587,516.37	157,969,931.91
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	163,632,239.02	80,616,730.41

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；
2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人的重大人事变动：

(1) 2015 年 3 月 2 日本基金管理人发布公告，经公司第三届董事会第三十五次会议审议通过，同意钱文挥先生辞去公司董事长（法定代表人）、代任总经理职务。

(2) 2015 年 4 月 9 日本基金管理人发布公告，经公司第三届董事会第三十五次会议审议通过，并经中国证券监督管理委员会证监许可【2015】562 号文核准批复，阮红女士担任公司总经理及代为履行公司董事长（法定代表人）职责。

(3) 2015 年 5 月 28 日本基金管理人发布公告，经公司第三届董事会第四十一次会议审议通过，夏华龙先生、乔宏军先生担任公司副总经理。

2、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动：本基金托管人的基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员本报告期内未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元	股票交易	应支付该券商的佣金	备注

	数量	成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
申万宏源证券有限公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	1	-	-	-	-	-

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
申万宏源证券有限公司	8,317,898.08	9.24%	379,800,000.00	2.83%	-	-
中国国际金融有限公司	81,737,361.65	90.76%	13,038,700,000.00	97.17%	-	-

注：1、报告期内，本基金交易单元未发生变化；

2、租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：券商基本面评价（财务状况、经营状况）、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）、券商每日信息评价（及时性和有效性）和券商协作表现评价等四个方面；

3、租用证券公司交易单元的程序：首先根据租用证券公司交易单元的选择标准进行综合评价，然后根据评价选择基金交易单元。研究部提交方案，并上报公司批准。

11 影响投资者决策的其他重要信息

根据《关于发布<中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准>的通知》（中基协发[2014]24 号）的要求，交银施罗德基金管理有限公司经与各基金托管人、会计师事务所协商一致，决定自 2015 年 3 月 19 日起对旗下基金持有的上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种主要依据第三方估值机构提供的价格数据进行估值，该通知另有规定的除外。

2015 年 3 月 19 日当日进行的上述相关调整对前一估值日各基金资产净值的影响不

超过 0.50%。