

交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金
(原交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金转型)
2020 年年度报告
2020 年 12 月 31 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

送出日期：二〇二一年三月三十日

§ 1 重要提示及目录

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 3 月 29 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。

本基金管理人已于 2020 年 5 月 22 日起至 2020 年 6 月 22 日以通讯方式召开了交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金的基金份额持有人大会。本次基金份额持有人大会决议已于 2020 年 6 月 23 日生效，并自 2020 年 7 月 28 日起，《交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金基金合同》失效且《交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金基金合同》同时生效，交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金正式变更为交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本报告按基金转型前后的两个报告期进行编制。其中，基金转型前的报告期间为 2020 年 1 月 1 日起至 7 月 27 日止，基金转型后的报告期为 2020 年 7 月 28 日起至 12 月 31 日。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	8
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	8
3.1 交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金	8
3.1.1 主要会计数据和财务指标	8
3.1.2 基金净值表现	9
3.1.3 过去三年基金的利润分配情况	11
3.2 交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金	11
3.2.1 主要会计数据和财务指标	11
3.2.2 基金净值表现	12
3.2.3 过去三年基金的利润分配情况	16
§ 4 管理人报告	17
4.1 基金管理人及基金经理情况	17
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	18
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	19
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	20
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	21
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	21
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	22
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	23
4.9 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	23
§ 5 托管人报告	23
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	23
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	23
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	23
§ 6 审计报告	23
6.1 交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金	23
6.1.1 审计意见	23
6.1.2 形成审计意见的基础	24
6.1.3 管理层和治理层对财务报表的责任	24
6.1.4 注册会计师对财务报表审计的责任	25
6.2 交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金	26
6.2.1 审计意见	26
6.2.2 形成审计意见的基础	26
6.2.3 管理层和治理层对财务报表的责任	26
6.2.4 注册会计师对财务报表审计的责任	27
§ 7 年度财务报表	28

7.1 交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金	28
7.1.1 资产负债表	28
7.1.2 利润表	30
7.1.3 所有者权益（基金净值）变动表	31
7.1.4 报表附注	31
7.2 交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金	51
7.2.1 资产负债表	51
7.2.2 利润表	52
7.2.3 所有者权益（基金净值）变动表	53
7.2.4 报表附注	55
§ 8 投资组合报告	76
8.1 交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金	76
8.1.1 期末基金资产组合情况	76
8.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	77
8.1.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	77
8.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动	77
8.1.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	77
8.1.6 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	77
8.1.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	78
8.1.8 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	78
8.1.9 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	78
8.1.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	78
8.1.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	78
8.1.12 投资组合报告附注	78
8.2 交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金	79
8.2.1 期末基金资产组合情况	79
8.2.2 债券回购融资情况	79
债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明	80
8.2.3 基金投资组合平均剩余期限	80
8.2.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明	81
8.2.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	81
8.2.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细	82
8.2.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	82
8.2.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	82
8.2.9 投资组合报告附注	82
§ 9 基金份额持有人信息	83
9.1 交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金	83
9.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	83
9.1.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	83
9.1.3 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情况	83
9.2 交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金	84
9.2.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	84
9.2.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	84
9.2.3 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情况	84
§ 10 开放式基金份额变动	85

§ 11 重大事件揭示	85
11.1 基金份额持有人大会决议	85
11.2 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	86
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	86
11.4 基金投资策略的改变	86
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	86
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	86
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	86
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况	88
11.9 其他重大事件	88
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	90
12.1 交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金	90
12.1.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	90
12.2 交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金	90
12.2.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	90
§ 13 备查文件目录	91
13.1 备查文件目录	91
13.2 存放地点	91
13.3 查阅方式	91

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

2.1.1 交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金

基金名称	交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金
基金简称	交银裕惠纯债债券
基金主代码	519722
交易代码	519722
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年7月28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
报告期末基金份额总额	769,512,873.77份
基金合同存续期	不定期

注：1、上表中“报告期末”指 2020 年 12 月 31 日。

2、本基金于 2020 年 7 月 28 日由交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金转型为交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金，新基金合同及托管协议即日起生效。

2.1.2 交银施罗德理财60天债券型证券投资基金

基金名称	交银施罗德理财60天债券型证券投资基金	
基金简称	交银理财60天债券	
基金主代码	519721	
交易代码	519721	
基金运作方式	契约型开放式	
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	
报告期末基金份额总额	770,059,000.76份	
基金合同存续期	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	3,346,487.94 份	766,712,512.82 份

注：上表中“报告期末”指 2020 年 7 月 27 日。

2.2 基金产品说明

2.2.1 交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金

投资目标	在严格控制风险和保持较高流动性的前提下，力求获得高于业绩比较基
------	---------------------------------

	准的投资收益。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势，融合规范化的基本面研究和严谨的信用分析，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，自上而下决定类属资产配置和债券组合久期、期限结构；在严谨深入的信用分析基础上，综合考量信用债券的信用评级，以及各类债券的流动性、供求关系和收益率水平等，自下而上精选投资标的。
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率
风险收益特征	本基金是一只债券型基金，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

2.2.2 交银施罗德理财60天债券型证券投资基金

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，努力追求绝对收益，为基金份额持有人谋求资产的稳定增值。
投资策略	本基金在保持组合流动性的前提下，结合对国内外宏观经济运行、金融市场运行、资金流动格局、货币市场收益率曲线形态等各方面的分析，合理安排组合期限结构，积极选择投资工具，采取主动性的投资策略和精细化的操作手法。
业绩比较基准	人民币七天通知存款税后利率
风险收益特征	本基金属于短期理财债券型证券投资基金，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
信息披露负责人	姓名	王晚婷	李申
	联系电话	(021) 61055050	021-60637102
	电子邮箱	xxpl@jysld.com, disclosure@jysld.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400-700-5000, 021-61055000	021-60637111
传真		(021) 61055054	021-60635778
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号交通银行大楼二层（裙）	北京市西城区金融大街25号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道8号国金中心二期21-22楼	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		阮红	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fund001.com
基金年度报告备置地点	基金管理人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金

3.1.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1.1 期间数据和指标	报告期(2020 年 7 月 28 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日)
本期已实现收益	9,005,781.25
本期利润	8,882,484.66
加权平均基金份额本期利润	0.0115
本期加权平均净值利润率	1.15%
本期基金份额净值增长率	1.15%
3.1.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 12 月 31 日)
期末可供分配利润	8,881,634.33
期末可供分配基金份额利润	0.0115
期末基金资产净值	778,394,508.10
期末基金份额净值	1.0115

3.1.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 12 月 31 日)
基金份额累计净值增长率	1.15%

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、交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金从 2020 年 7 月 28 日起正式转型为交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金。截至本报告期末(2020 年 12 月 31 日)，交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金转型时间未满一年。

3.1.2 基金净值表现

3.1.2.1 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

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
过去三个月	0.95%	0.02%	0.64%	0.04%	0.31%	-0.02%
自基金合同生效起至今	1.15%	0.02%	-0.43%	0.05%	1.58%	-0.03%

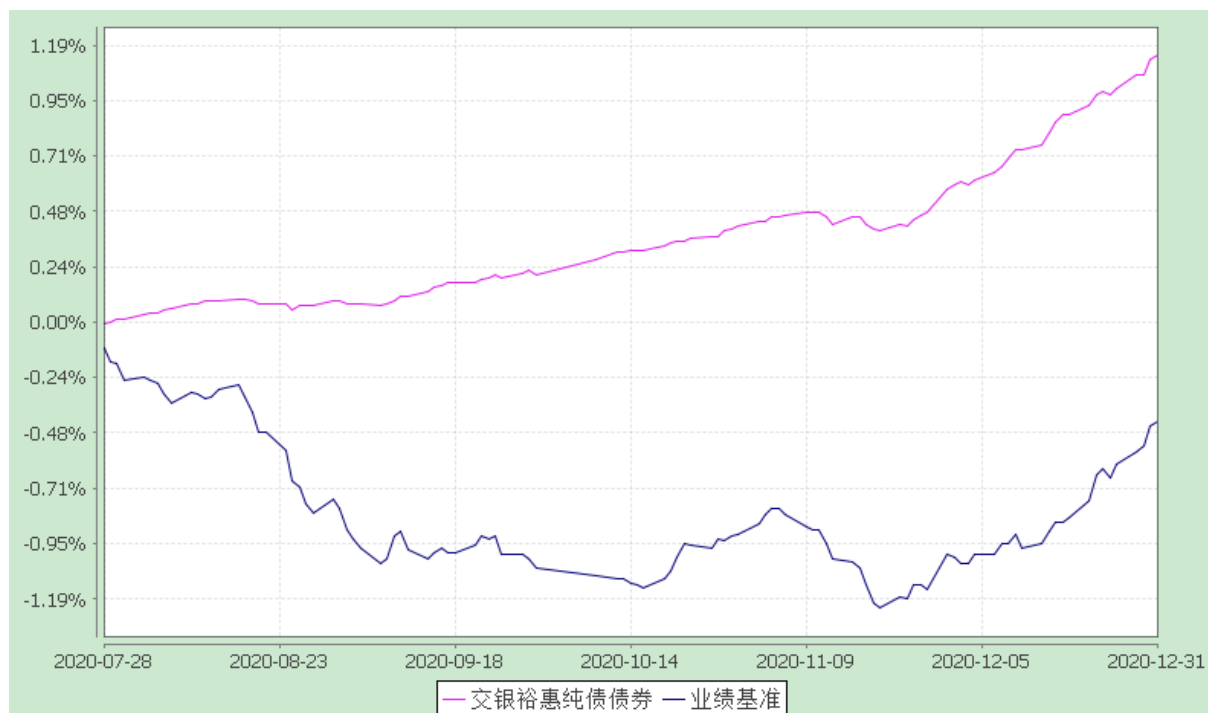
注：交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金从 2020 年 7 月 28 日起正式转型为交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金，本表列示的是本报告期基金转型后的基金净值表现，转型后基金的业绩比较基准为中债综合全价指数收益率。

3.1.2.2 自基金转型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

交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金

自基金转型以来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

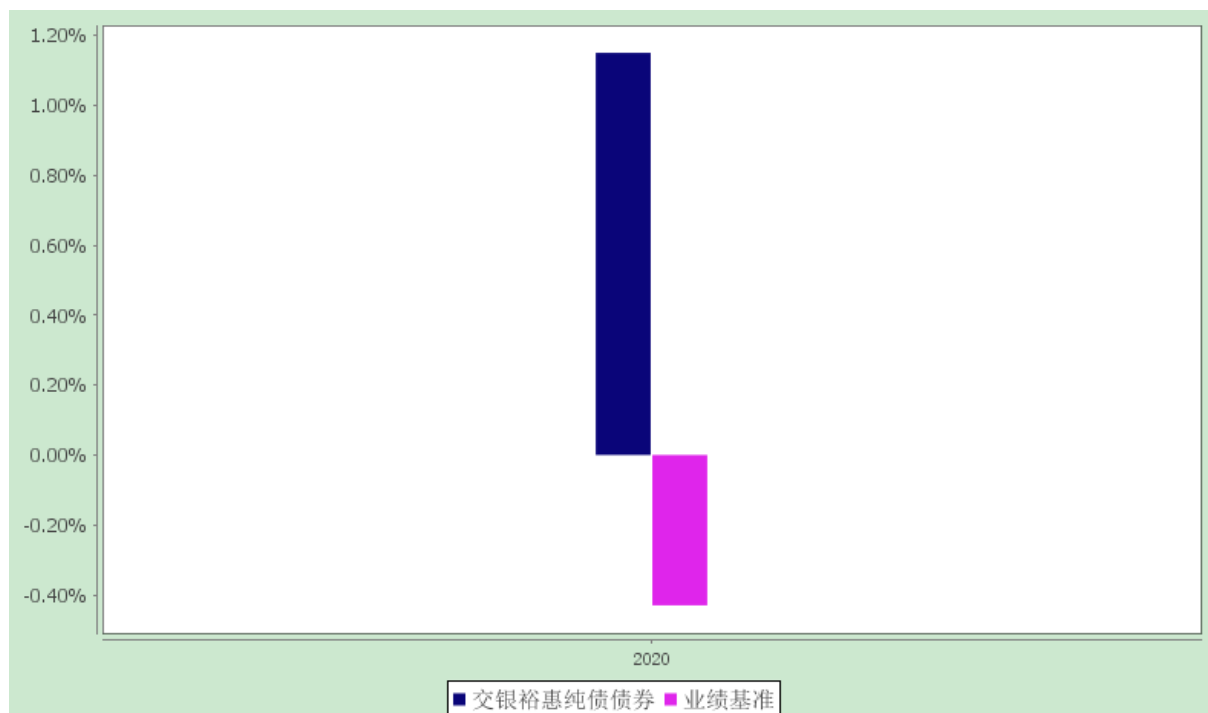
(2020 年 7 月 28 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日)



注:本基金由交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金转型而来。基金转型日为 2020 年 7 月 28 日。本基金基金合同生效日为 2020 年 7 月 28 日,基金合同生效日至报告期期末,本基金运作时间未满一年。本基金建仓期为自基金合同生效日起的 6 个月。截至 2020 年 12 月 31 日,本基金尚处于建仓期。

3.1.2.3 基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金



注：图示日期为 2020 年 7 月 28 日至 2020 年 12 月 31 日。基金转型生效当年的净值增长率按照当年实际存续期计算。

3.1.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2020 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

3.2 交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金

3.2.1 主要会计数据和财务指标

3.2.1.1 期间数据和指标	报告期 (2020 年 1 月 1 日至 2020 年 7 月 27 日)		2019 年		2018 年	
	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	交银理财 60 天债券 A	交银理财 60 天债券 B
本期已实现收益	59,131.25	91,116,697.57	253,459.46	269,156,843.81	392,490.36	563,352,364.35
本期利润	59,131.25	91,116,697.57	253,459.46	269,156,843.81	392,490.36	563,352,364.35

本期净值收益率	1.26%	1.43%	2.82%	3.12%	4.10%	4.40%
3.2.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 7 月 27 日)		2019 年末		2018 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	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	3,346,487.94	766,712,512.82	5,498,988.29	7,089,630,685.43	8,956,638.90	11,759,859,670.82
期末基金份额净值	1	1	1	1	1	1
3.2.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 7 月 27 日)		2019 年末		2018 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	交银理财 60 天债券 A	交银理财 60 天债券 B
累计净值收益率	26.92%	25.77%	25.34%	23.99%	21.90%	20.24%

注：1、本基金申购赎回费为零。

2、本基金收益分配按运作期结转份额。

3、自合同生效日起，本基金实行销售服务费分类收费方式，分设两类基金份额：A 类基金份额和 B 类基金份额。A 类基金份额与 B 类基金份额的管理费、托管费相同，A 类基金份额按照 0.30% 的年费率计提销售服务费，B 类基金份额按照 0.01% 的年费率计提销售服务费。

4、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，由于本基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

5、交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金从 2020 年 7 月 28 日起正式转型为交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金。

3.2.2 基金净值表现

3.2.2.1 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

交银理财 60 天债券 A

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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
2020 年 7 月 1 日至 2020 年 7 月	0.2236%	0.0084%	0.0999%	0.0000%	0.1237%	0.0084%

27 日						
2020 年 4 月 1 日至 2020 年 7 月 27 日	0.6819%	0.0050%	0.4364%	0.0000%	0.2455%	0.0050%
2019 年 10 月 1 日至 2020 年 7 月 27 日	1.9164%	0.0034%	1.1133%	0.0000%	0.8031%	0.0034%
2017 年 10 月 1 日至 2020 年 7 月 27 日	9.5399%	0.0031%	3.8133%	0.0000%	5.7266%	0.0031%
2015 年 10 月 01 至 2020 年 7 月 27 日	15.2922%	0.0033%	6.5170%	0.0000%	8.7752%	0.0033%
自基金合同生效起至 2020 年 7 月 27 日	26.9249%	0.0068%	9.9641%	0.0000%	16.9608%	0.0068%

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为起始日的运作周期。

2、本基金每日计算当日收益并分配，并在运作期期末集中支付。

3、交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金从 2020 年 7 月 28 日起正式转型为交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金，本表列示的是本报告期基金转型前的基金净值表现，转型前基金的业绩比较基准为人民币七天通知存款税后利率。

交银理财 60 天债券 B

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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
2020 年 7 月 1 日至 2020 年 7 月 27 日	0.2458%	0.0083%	0.0999%	0.0000%	0.1459%	0.0083%
2020 年 4 月 1 日至 2020 年 7 月 27 日	0.7770%	0.0050%	0.4364%	0.0000%	0.3406%	0.0050%
2019 年 10 月 1 日至 2020 年 7 月 27 日	2.1610%	0.0034%	1.1133%	0.0000%	1.0477%	0.0034%
2017 年 10 月 1 日至 2020 年 7 月 27 日	10.4376%	0.0031%	3.8133%	0.0000%	6.6243%	0.0031%
2015 年 10 月 01 至 2020 年 7 月 27 日	16.2971%	0.0038%	6.5170%	0.0000%	9.7801%	0.0038%

自基金合同生效 起至 2020 年 7 月 27 日	25.7653%	0.0070%	9.9641%	0.0000%	15.8012%	0.0070%
----------------------------------	----------	---------	---------	---------	----------	---------

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为起始日的运作周期。

2、本基金每日计算当日收益并分配，并在运作期期末集中支付。

3、交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金从 2020 年 7 月 28 日起正式转型为交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金，本表列示的是本报告期基金转型前的基金净值表现，转型前基金的业绩比较基准为人民币七天通知存款税后利率。

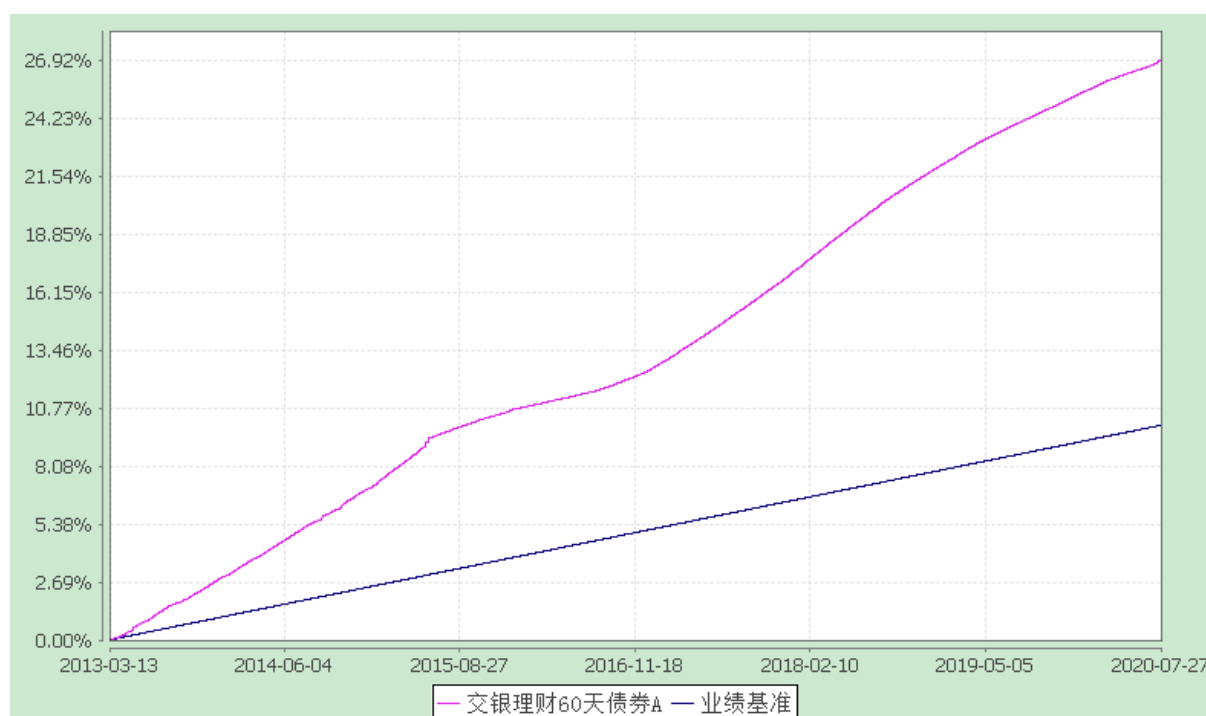
3.2.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金

份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

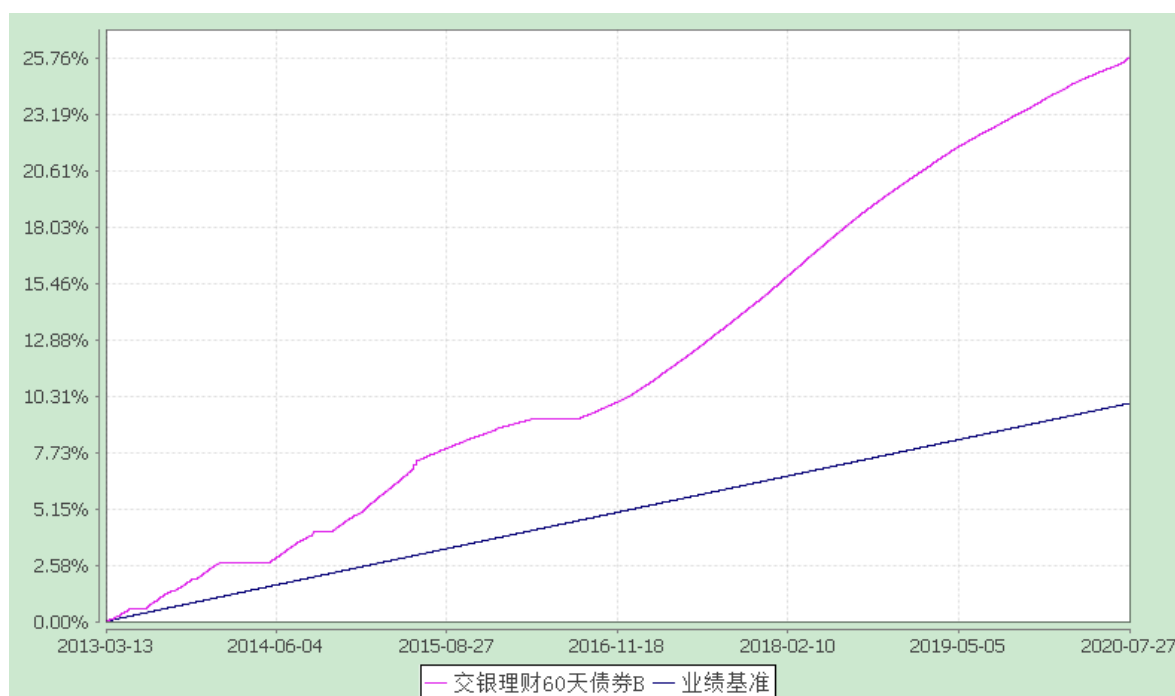
(2013 年 3 月 13 日至 2020 年 7 月 27 日)

交银理财 60 天债券 A



注：本基金建仓期为自基金合同生效日起的 2 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。

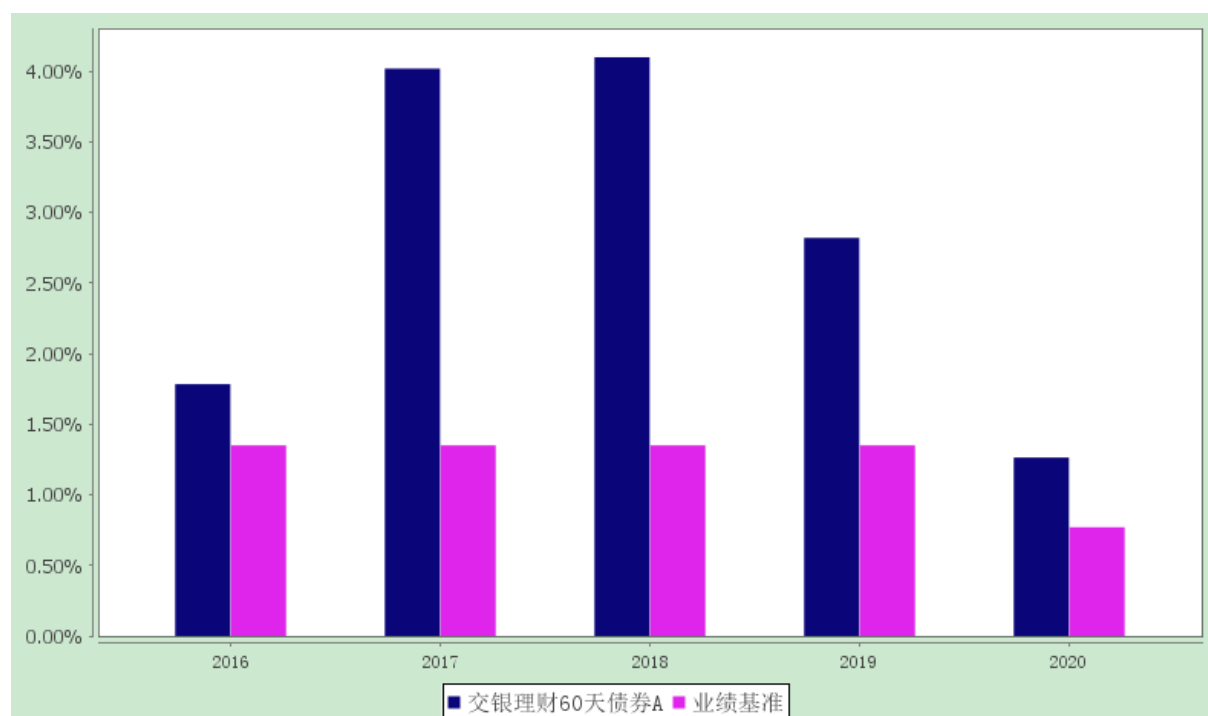
交银理财 60 天债券 B



注：本基金建仓期为自基金合同生效日起的 2 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。

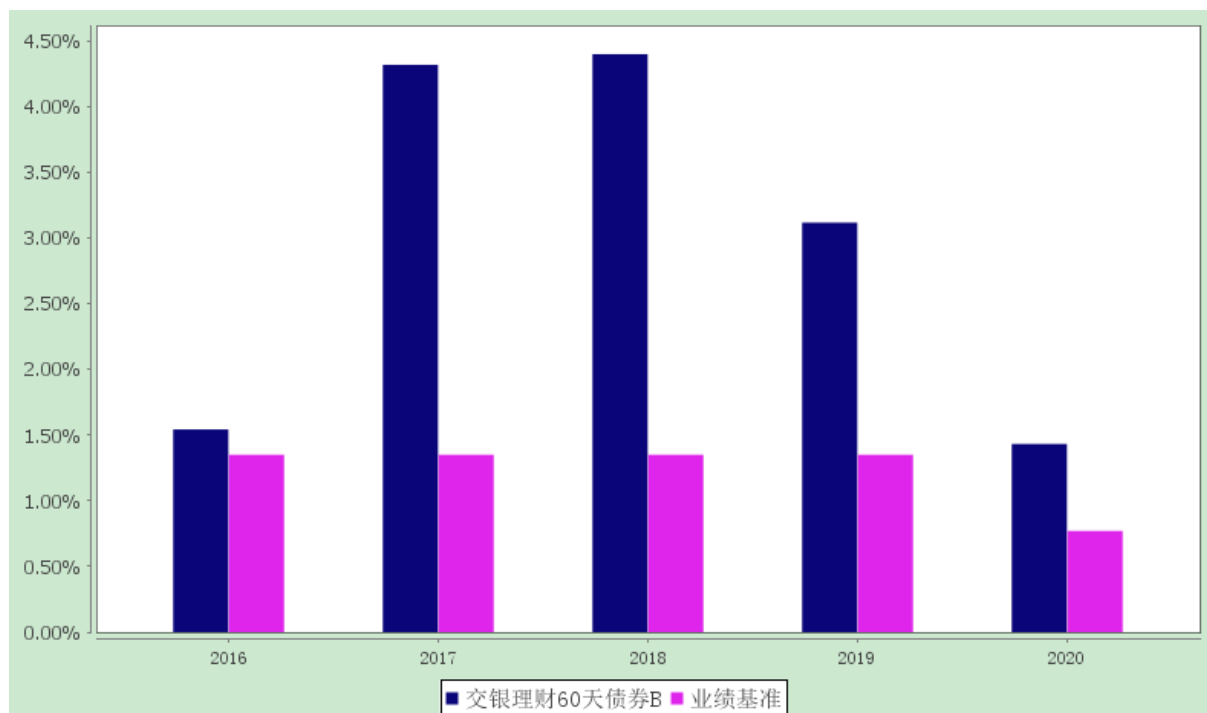
3.2.2.3 过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

交银理财 60 天债券 A



注：图示日期为 2016 年 1 月 1 日至 2020 年 7 月 27 日。

交银理财 60 天债券 B



注：图示日期为 2016 年 1 月 1 日至 2020 年 7 月 27 日。

3.2.3 过去三年基金的利润分配情况

交银理财 60 天债券 A

单位：人民币元

年度	已按再投资 形式转实收 基金	直接通过应付 赎回款转出金 额	应付利润本年变动	年度利润分配合 计	备注
2020 年	64,673.86	7,281.76	-12,824.37	59,131.25	-
2019 年	243,941.16	23,359.03	-13,840.73	253,459.46	-
2018 年	335,042.16	66,132.36	-8,684.16	392,490.36	-
合计	643,657.18	96,773.15	-35,349.26	705,081.07	-

交银理财 60 天债券 B

单位：人民币元

年度	已按再投资形 式转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金 额	应付利润本年变动	年度利润分配合 计	备注
2020 年	113,653,963.51	2,343,939.50	-24,881,205.44	91,116,697.57	-
2019 年	264,845,877.53	25,445,139.45	-21,134,173.17	269,156,843.81	-
2018 年	437,709,436.92	90,047,172.18	35,595,755.25	563,352,364.35	-
合计	816,209,277.96	117,836,251.13	-10,419,623.36	923,625,905.73	-

§ 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，公司管理了包括货币型、债券型、混合型和股票型在内的 94 只基金，其中股票型涵盖普通指数型、交易型开放式（ETF）、QDII 等不同类型基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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		
连端清	交银丰盈收益债券、交银活期通货币、交银裕盈纯债债券、交银裕利纯债债券、交银裕惠纯债债券的基金经理	2020-07-28	-	7 年	连端清先生，复旦大学经济学博士。历任交通银行总行金融市场部、湘财证券研究所研究员、中航信托资产管理部投资经理。2015 年加入交银施罗德基金管理有限公司。2017 年 3 月 31 日至 2018 年 8 月 23 日担任交银施罗德裕兴纯债债券型证券投资基金的基金经理。2015 年 8 月 4 日至 2019 年 8 月 2 日担任交银施罗德现金宝货币市场基金的基金经理。2015 年 10 月 16 日至 2019 年 8 月 2 日担任交银施罗德货币市场证券投资基金的基金经理。2016 年 12 月 7 日至 2019 年 8 月 2 日担任交

					银施罗德天鑫宝货币市场基金的基金经理。2017 年 12 月 29 日至 2019 年 8 月 2 日担任交银施罗德天运宝货币市场基金的基金经理。2016 年 10 月 19 日至 2019 年 9 月 29 日担任交银施罗德天利宝货币市场基金的基金经理。2016 年 11 月 28 日至 2019 年 9 月 29 日担任交银施罗德裕隆纯债债券型证券投资基金的基金经理。2016 年 12 月 20 日至 2019 年 9 月 29 日担任交银施罗德天益宝货币市场基金的基金经理。2017 年 3 月 3 日至 2019 年 9 月 29 日担任交银施罗德境尚收益债券型证券投资基金的基金经理。2015 年 10 月 16 日至 2020 年 7 月 27 日担任转型前的交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金的基金经理。2015 年 8 月 4 日至 2020 年 8 月 21 日担任交银施罗德丰润收益债券型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

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

在报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同和其他相

关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，基金整体运作符合有
关法律法规和基金合同的规定，为基金持有人谋求最大利益。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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所管理的所有资产组合投资运作的公平。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。制度中包含的主要控制方法如下：

(1) 公司建立资源共享的投资研究信息平台，所有研究成果对所有投资组合公平开放，确保各投资组合在获得研究支持和实施投资决策方面享有公平的机会。

(2) 公司将投资管理职能和交易执行职能相隔离，实行集中交易制度，建立了合理且可操作的公平交易分配机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。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。

(3) 公司建立了清晰的投资授权制度，明确各层级投资决策主体的职责和权限划分，组合投资经理充分发挥专业判断能力，不受他人干预，在授权范围内独立行使投资决策权，维护公平的投资管理环境，维护所管理投资组合的合法利益，保证各投资组合交易决策的客观性和独立性，防范不公平及异常交易的发生。

(4) 公司建立统一的投资对象备选库和交易对手备选库，制定明确的备选库建立、维护程序。在全公司适用股票、债券备选库的基础上，根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和关联交易限制等，按需要建立不同投资组合的投资对象风格库和交易对手备选库，组合经理在此基础上根据投资授权构建投资组合。

(5) 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投资组合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。

4.3.2 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私募资产管理计划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“价格优先、时间优先”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，遵循公平交易分配原则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。

4.3.3 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

2020 年，突如其来的新冠疫情改变了整个世界。一季度新冠疫情导致我国经济大幅下滑。我国 GDP 同比下降 6.8%，消费、投资与外贸较 2019 年同期均大幅下滑。在我国政府与人民齐心协力防控之下，二月中下旬之后，我国疫情防控形势逐步好转，复工复产逐渐展开。二季度以来，国内经济迎来修复期，主要经济指标逐渐改善。制造业景气度回升，房地产投资快速修复且保持较高增长，出口超预期高速增长，社会消费逐步改善。直至四季度，我国经济增速已恢复到潜在增长水平以上，GDP 同比增长 6.5%。

为了应对疫情造成的经济大幅波动，二月至四月我国货币政策与财政政策均加大宽松力度。货币政策方面，央行通过公开市场逆回购与 MLF，以及降准等方式释放了充裕的流动性的同时下调了逆回购与 MLF 操作利率。但是，随着经济数据边际改善，以及资金套利空转引起监管层重视，自五月以来央行货币政策操作呈现边际收敛态势。直至十一月，信用债违约事件冲击债市，债市融资大幅萎缩，资金价格快速上升。当月下旬开始央行公开市场操作边际再次转向宽松，以维稳市场。

新冠疫情冲击之下，2020 年我国经济呈 V 型走势，央行货币政策整体上从应对疫情的宽松模式转向边际收敛。受此影响，2020 年银行间市场资金面与债市波动显著放大。资金面上，货币市场利率中枢在二月至五月持续下移至历史低位。随后主要由于央行货币政策边际收敛，货币市场利率中

枢缓慢抬升，至十一月下旬之后货币市场利率中枢再次回落。债市方面，一季度与四月的债市大幅上涨，十年国债 YTM 降至历史低位。但自五月以来，国内经济修复超预期，央行货币政策边际收敛，利率债大幅回调。十一月信用债违约事件冲击之下，十年国债 YTM 上升至年内高点，当月下旬之后债市才有所回暖。

基金操作方面，本基金于三季度完成转型之后，根据债市行情，按防御策略下逐步完成组合债券配置。四季度调整组合久期、杠杆以及组合持仓品种结构，重点加仓中等期限利率债，在市场回调中努力控制风险，分享了十二月债市反弹回暖带来的机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金（各类）份额转型后净值及业绩表现请见“3.1.1 主要会计数据和财务指标”及“3.1.2.1 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”部分披露。

本基金（各类）份额转型前净值及业绩表现请见“3.2.1 主要会计数据和财务指标”及“3.2.2.1 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”部分披露。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2021 年，国内经济整体上继续修复的概率较大。但是一方面由于疫苗接种与疫情的防控可能需较长时间，疫情等的不确定性依然存在，国内经济复苏的基础是否扎实尚待观察。另一方面，支撑 2020 年国内经济超预期的出口与房地产投资等经济变量走势值得关注。在海外，似乎海外风险有所收敛。但是，如何尽早控制住疫情，降低日益分化的社会分裂程度，并且引领发达经济体走向经济复苏，重重考验刚刚开始。在如此复杂的格局下，预计短期内我国央行可能以中性货币政策为主。我们将密切关注央行货币政策操作边际上的变化以及疫情防控与疫苗接种进展。组合管理方面，本基金将跟踪研判宏观经济走势与央行货币政策操作，保持较好的流动性，力求把握市场波动机会，尽力控制风险，力争为投资者创造稳健的回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2020 年度，根据《证券投资基金法》等法律法规及有关要求，本基金管理人诚实守信、勤勉尽责，依法履行基金管理人职责，落实风险控制，强化合规管理职能，确保基金管理业务运作的安全、规范，保护基金投资人的合法权益。

本报告期内，本基金管理人为了确保公司业务的规范运作，主要做了以下工作：

（一）继续深化全面风险管理，提高风险控制有效性。

公司风险管理部门持续加大信用风险事前防范力度，加强对信用风险的监控，信用风险提示进一步前移；继续加强流动性风险管理，坚持开展定期及不定期压力测试工作机制；定期排查风险控制阈值，提高公司旗下组合风险控制精准度；不断优化业务操作流程，通过量化考核指标加强操作

风险管理；继续加强各项潜在风险排查，落实防范措施和跟踪机制，不断提升公司风险管理水平。

（二）全面开展内部监督检查，强化公司内部控制。

公司审计部门坚持以法律法规和公司各项制度为依据，按照监管机构的要求对基金运作和公司经营所涉及的各个环节实施严格的稽核监督。通过对投资研究、市场销售、运营、信息技术等业务条线内部控制关键点开展定期和不定期检查，有效促进公司内部控制制度规范、执行有效，内控管理水平不断提升。

（三）着力打造完备的合规管理体系，促进合规文化建设取得新成果。

公司法律合规部门着力搭建完备的合规管理体系，体系内三道防线各司其职、形成合力，促进公司合规文化建设取得新成果；全年重点推动新法规跟踪落实工作，认真分析潜在影响，利用系统化工具跟踪督促新法规予以贯彻落实；重点推进公司制度更新梳理及体系化建设工作，以持续抓好制度建设及执行助推公司合规管理常态长效发展。

（四）强化培训教育及重点领域合规提示，持续提高全员风险合规意识。

公司继续抓好全员风险合规教育工作。公司围绕行业热点、重点、难点问题，组织开展了多场培训工作，加强重点领域合规提示，加深了员工对新法律法规的理解及强化其风险合规意识，抓牢抓实员工合规底线教育，强化员工行为合规管控，提高了员工内部控制、风险管理的技能和水平，公司内部控制和风险管理基础得到进一步的夯实和优化。

4.7 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金（各类）份额转型后本报告期内未进行利润分配。

遵照法律法规及基金合同的约定，本基金（各类）份额转型前每日分配收益，按运作期结转份额。本基金（各类）份额转型前本报告期内利润分配情况参见 7.2.4.7.10。

4.9 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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，转型前交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金实施利润分配的金额为 A 类 59,131.25 元，B 类 91,116,697.57 元。

报告期内，转型后交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§6 审计报告

6.1 交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金

普华永道中天审字(2021)第 24570 号

交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金(原交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金)全体基金份额持有人：

6.1.1 审计意见

(一) 我们审计的内容

我们审计了交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金(原交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金, 以下简称“交银裕惠纯债基金”)的财务报表, 包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表, 2020 年 7 月 28 日(基金转型生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间的的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

(二) 我们的意见

我们认为, 后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制, 公允反映了交银裕惠纯债基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年 7 月 28 日(基金转型生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间的的经营成果和基金净值变动情况。

6.1.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信, 我们获取的审计证据是充分、适当的, 为发表审计意见提供了基础。

按照中国注册会计师职业道德守则, 我们独立于交银裕惠纯债基金, 并履行了职业道德方面的其他责任。

6.1.3 管理层和治理层对财务报表的责任

交银裕惠纯债基金的基金管理人交银施罗德基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表, 使其实现公允反映, 并设计、执行和维护必要的内部控制, 以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时, 基金管理人管理层负责评估交银裕惠纯债基金的持续经营能力, 披露与持续经营相关的事项(如适用), 并运用持续经营假设, 除非基金管理人管理层计划清算交银裕惠纯债基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督交银裕惠纯债基金的财务报告过程。

6.1.4 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对交银裕惠纯债基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致交银裕惠纯债基金不能持续经营。

(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

童咏静 金诗涛

上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

2021 年 3 月 26 日

6.2 交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金

普华永道中天审字(2021)第 24570 号

交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金全体基金份额持有人：

6.2.1 审计意见

(一) 我们审计的内容

我们审计了交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金(以下简称“交银理财 60 天债券基金”)的财务报表，包括 2020 年 7 月 27 日(基金合同失效前日)的资产负债表，2020 年 1 月 1 日至 2020 年 7 月 27 日(基金合同失效前日)止期间的的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

(二) 我们的意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了交银理财 60 天债券基金 2020 年 7 月 27 日(基金合同失效前日)的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 7 月 27 日(基金合同失效前日)止期间的的经营成果和基金净值变动情况。

6.2.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于交银理财 60 天债券基金，并履行了职业道德方面的其他责任。

6.2.3 管理层和治理层对财务报表的责任

交银理财 60 天债券基金的基金管理人交银施罗德基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务

操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估交银理财 60 天债券基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算交银理财 60 天债券基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督交银理财 60 天债券基金的财务报告过程。

6.2.4 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对交银理财 60 天债券基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报

表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致交银理财 60 天债券基金不能持续经营。

(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

童咏静 金诗涛

上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

2021 年 3 月 26 日

§7 年度财务报表

7.1 交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金

7.1.1 资产负债表

会计主体：交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	7.1.4.7.1	1,252,444.69
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	7.1.4.7.2	743,009,000.00
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		743,009,000.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-

衍生金融资产	7.1.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.1.4.7.4	25,000,157.50
应收证券清算款		-
应收利息	7.1.4.7.5	9,631,110.00
应收股利		-
应收申购款		997.01
递延所得税资产		-
其他资产	7.1.4.7.6	-
资产总计		778,893,709.20
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日
负 债:		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.1.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		197,105.82
应付托管费		65,701.92
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.1.4.7.7	15,830.16
应交税费		1,263.20
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.1.4.7.8	219,300.00
负债合计		499,201.10
所有者权益:		
实收基金	7.1.4.7.9	769,512,873.77
未分配利润	7.1.4.7.10	8,881,634.33
所有者权益合计		778,394,508.10
负债和所有者权益总计		778,893,709.20

注：1、报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0115 元，基金份额总额 769,512,873.77 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2020 年 7 月 28 日(基金转型生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间。

7.1.2 利润表

会计主体：交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金

本报告期：2020 年 7 月 28 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 7 月 28 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		10,465,165.96
1.利息收入		11,548,002.75
其中：存款利息收入	7.1.4.7.11	9,804.30
债券利息收入		10,985,834.84
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		552,363.61
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-959,844.12
其中：股票投资收益	7.1.4.7.12	-
基金投资收益		-
债券投资收益	7.1.4.7.13	-959,844.12
资产支持证券投资收益	7.1.4.7.14	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	7.1.4.7.15	-
股利收益	7.1.4.7.16	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.1.4.7.17	-123,296.59
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.1.4.7.18	303.92
减：二、费用		1,582,681.30
1. 管理人报酬		987,765.46
2. 托管费		329,255.09
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	7.1.4.7.19	15,175.00
5. 利息支出		152,913.89
其中：卖出回购金融资产支出		152,913.89
6. 税金及附加		1,988.51
7. 其他费用	7.1.4.7.20	95,583.35
三、利润总额（亏损总额以“-”号填		8,882,484.66

列)		
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		8,882,484.66

7.1.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金

本报告期：2020 年 7 月 28 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2020 年 7 月 28 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 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）	770,084,760.44	-	770,084,760.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	8,882,484.66	8,882,484.66
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）	-571,886.67	-850.33	-572,737.00
其中：1.基金申购款	713,783.40	2,792.45	716,575.85
2.基金赎回款	-1,285,670.07	-3,642.78	-1,289,312.85
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）	769,512,873.77	8,881,634.33	778,394,508.10

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1.1 至 7.1.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：谢卫，主管会计工作负责人：夏华龙，会计机构负责人：单江

7.1.4 报表附注

7.1.4.1 基金基本情况

交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金是由原交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金(以下简称“原基金”)转型而来。原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]1768 号《关于核准交银施罗德理财 60 天债券型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《交银施罗德理财 60 天债券型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证券投资基金，存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 777,735,040.55 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(2013)第 131 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金基金合同》于 2013 年 3 月 13 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 777,917,201.14 份基金份额，其中认购资金利息折合 182,160.59 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

原基金基金份额持有人大会自 2020 年 5 月 22 日至 2020 年 6 月 22 日止以通讯方式召开，会议审议通过了《关于交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金转型及修改基金合同有关事项的议案》。根据基金管理人于 2020 年 6 月 24 日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》的有关规定，自 2020 年 7 月 28 日起，原交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金转型为交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金，《交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金基金合同》自该日起生效，原《交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金基金合同》自同一起失效，交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金正式变更为交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为交银施罗德基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德裕惠纯债债券型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，包括债券(含国债、金融债、央行票据、地方政府债、政府支持债、政府支持机构债、企业债、公司债、可分离交易可转债的纯债部分、公开发行的次级债、短期融资券、超短期融资券、中期票据)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括定期存款、协议存款、通知存款等)、同业存单、货币市场工具，以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金不投资于股票，也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%。本基金持有的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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中债综合全价指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人交银施罗德基金管理有限公司于 2021 年 3 月 26 日批准报出。

7.1.4.2 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<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.1.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.1.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年 7 月 28 日(基金转型生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间的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 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年 7 月 28 日(基金转型生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.1.4.4 重要会计政策和会计估计

7.1.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2020 年 7 月 28 日(基金转型生效日)至 2020 年 12 月 31 日。

7.1.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.1.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金以交易目的持有的债券投资和资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融

负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.1.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.1.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的债券投资和资产支持证券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调

整并确定公允价值。

7.1.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.1.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.1.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.1.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.1.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的

则按直线法计算。

7.1.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.1.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.1.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.1.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.1.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末发生会计政策变更。

7.1.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

7.1.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.1.4.6 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》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.1.4.7 重要财务报表项目的说明

7.1.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	1,252,444.69
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	1,252,444.69

7.1.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2020 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	743,132,296.59	743,009,000.00	-123,296.59
	合计	743,132,296.59	743,009,000.00	-123,296.59
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		743,132,296.59	743,009,000.00	-123,296.59

7.1.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融工具。

7.1.4.7.4 买入返售金融资产

7.1.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购

交易所市场	-	-
银行间市场	25,000,157.50	-
合计	25,000,157.50	-

7.1.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.1.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	592.30
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	9,629,255.70
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	1,262.00
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	9,631,110.00

7.1.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

7.1.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	15,830.16
合计	15,830.16

7.1.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提信息披露费	120,000.00
预提审计费	90,000.00
预提账户维护费	9,300.00
合计	219,300.00

7.1.4.7.9 实收基金

交银裕惠纯债债券

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年7月28日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	770,084,760.44	770,084,760.44
本期申购	713,783.40	713,783.40
本期赎回（以“-”号填列）	-1,285,670.07	-1,285,670.07
本期末	769,512,873.77	769,512,873.77

注：1. 原交银施罗德理财60天债券型证券投资基金于2020年7月27日的基金份额为770,084,760.44份，已于2020年7月28日本基金转型生效日全部转为本基金的基金份额。

2. 如果本报告期间发生红利再投、转换入业务，则总申购份额中包含该业务；

3. 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。

4. 根据《交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金基金合同生效暨开放日常申购、赎回、定期定额投资业务的公告》和《交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金开放日常转换业务的公告》，本基金自2020年7月28日(基金转型生效日)起开始办理基金交易日常申购和赎回业务，自2020年7月28日起开始办理基金交易日常转换业务。

7.1.4.7.10 未分配利润

交银裕惠纯债债券

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	9,005,781.25	-123,296.59	8,882,484.66
本期基金份额交易产生的	-2,214.01	1,363.68	-850.33

变动数			
其中：基金申购款	3,474.15	-681.70	2,792.45
基金赎回款	-5,688.16	2,045.38	-3,642.78
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,003,567.24	-121,932.91	8,881,634.33

7.1.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 7 月 28 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	5,216.82
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	4,587.38
其他	0.10
合计	9,804.30

7.1.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期内无股票投资收益。

7.1.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年7月28日（基金合同生效日）至2020年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	936,282,910.32
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	922,882,984.12
减：应收利息总额	14,359,770.32
买卖债券差价收入	-959,844.12

7.1.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

7.1.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

7.1.4.7.16 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

7.1.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年7月28日（基金合同生效日）至2020年12月31日
1.交易性金融资产	-123,296.59
——股票投资	-
——债券投资	-123,296.59
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-123,296.59

7.1.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年7月28日（基金合同生效日）至2020年12月31日
基金赎回费收入	-
基金转换费收入	303.92
合计	303.92

注：本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的不低于赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

7.1.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 7 月 28 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
----	--

交易所市场交易费用	-
银行间市场交易费用	15,175.00
合计	15,175.00

7.1.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 7 月 28 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
审计费用	21,475.17
信息披露费	51,475.17
银行费用	6,762.17
债券账户费用	15,870.84
合计	95,583.35

7.1.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.1.4.8.1或有事项

无。

7.1.4.8.2资产负债表日后事项

无。

7.1.4.9 关联方关系

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(“交银施罗德基金公司”)	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	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
施罗德投资管理有限公司	基金管理人的股东
中国国际海运集装箱(集团)股份有限公司	基金管理人的股东
交银施罗德资产管理有限公司	基金管理人的子公司
上海直源投资管理有限公司	受基金管理人控制的公司

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。

7.1.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.1.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的交易。

7.1.4.10.2 关联方报酬

7.1.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年7月28日（基金合同生效日）至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	987,765.46
其中：支付销售机构的客户维护费	1,822.32

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.30%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 × 0.30%/当年天数。

7.1.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年7月28日（基金合同生效日）至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	329,255.09

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.10%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×0.10%÷当年天数。

7.1.4.10.2.3 销售服务费

无。

7.1.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.1.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**7.1.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本报告期内未发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.1.4.10.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2020 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
上海直源投资管理有限公司	7,676,914.48	1.00%

注：关联方投资本基金的费率按照基金合同和招募说明书规定的确定，符合公允性要求。

7.1.4.10.5 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 2020年7月28日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	1,252,444.69	5,216.82

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。

7.1.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销证券。

7.1.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

7.1.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.1.4.12 期末（2020年12月31日）本基金持有的流通受限证券**7.1.4.12.1 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。

7.1.4.12.2 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。

7.1.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.1.4.13 金融工具风险及管理**7.1.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金是一只债券型基金，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括债券（含国债、金融债、央行票据、地方政府债、政府支持债、政府支持机构债、企业债、公司债、可分离交易可转债的纯债部分、公开发行的次级债、短期融资券、超短期融资券、中期票据）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、货币市场工具，以及法律法规或中国证监会允许

投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金不投资于股票，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力争持续稳定地实现超越业绩比较基准的投资回报。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立合规审核及风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由风险管理部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。风险管理部对公司总经理负责。督察长独立行使督察权利，直接对董事会负责，就内部控制制度和执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能，定期和不定期地向董事会报告公司内部控制执行情况。

本基金的基金管理人建立了以合规审核及风险管理委员会为核心的，由督察长、风险控制委员会、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.1.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国建设银行，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

7.1.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020年12月31日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	50,085,000.00
合计	50,085,000.00

注：未评级部分为政策性金融债。

7.1.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年12月31日
AAA	412,988,000.00
AAA 以下	-
未评级	279,936,000.00
合计	692,924,000.00

注：未评级部分为政策性金融债。

7.1.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2020 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期

现金流量。

注：流动性受限资产、7 个工作日可变现资产的计算口径见《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》第四十条。

7.1.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》且于基金开放期内按照《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。于开放期内，本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.1.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

于开放期内，本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

7.1.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.1.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

7.1.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,252,444.69	-	-	-	1,252,444.69
交易性金融资产	482,993,000.00	250,426,000.00	9,590,000.00	-	743,009,000.00
买入返售金融资产	25,000,157.50	-	-	-	25,000,157.50
应收利息	-	-	-	9,631,110.00	9,631,110.00
应收申购款	-	-	-	997.01	997.01
资产总计	509,245,602.19	250,426,000.00	9,590,000.00	9,632,107.01	778,893,709.20
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	197,105.82	197,105.82
应付托管费	-	-	-	65,701.92	65,701.92
应付交易费用	-	-	-	15,830.16	15,830.16
应交税费	-	-	-	1,263.20	1,263.20
其他负债	-	-	-	219,300.00	219,300.00
负债总计	-	-	-	499,201.10	499,201.10
利率敏感度缺口	509,245,602.19	250,426,000.00	9,590,000.00	9,132,905.91	778,394,508.10

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰

早予以分类。

7.1.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币万元）
		本期末 2020 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点	减少约 262
	市场利率下降 25 个基点	增加约 265

7.1.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.1.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的债券，因此无重大其他价格风险。

7.1.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 743,009,000.00 元，无属于第一或第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 12 月 31 日, 本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债, 其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外, 截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7.2 交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金

7.2.1 资产负债表

会计主体: 交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金

报告截止日: 2020 年 7 月 27 日

单位: 人民币元

资 产	附注号	本期末 2020 年 7 月 27 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资 产:			
银行存款	7.2.4.7.1	2,715,773.95	1,751,376,445.57
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.2.4.7.2	729,966,052.15	6,076,077,745.20
其中: 股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		729,966,052.15	6,076,077,745.20
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.2.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.2.4.7.4	35,000,000.00	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.2.4.7.5	5,630,470.47	23,101,962.92
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.2.4.7.6	-	-

资产总计		773,312,296.57	7,850,556,153.69
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 7 月 27 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.2.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	728,114,015.90
应付证券清算款		1,998,309.31	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		640,756.52	1,301,984.06
应付托管费		256,302.60	520,793.67
应付销售服务费		32,784.66	66,665.01
应付交易费用	7.2.4.7.7	35,911.43	73,515.26
应交税费		123,692.79	113,302.57
应付利息		-	57,114.01
应付利润		25,759.68	24,919,789.49
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.2.4.7.8	139,778.82	259,300.00
负债合计		3,253,295.81	755,426,479.97
所有者权益:			
实收基金	7.2.4.7.9	770,059,000.76	7,095,129,673.72
未分配利润	7.2.4.7.10	-	-
所有者权益合计		770,059,000.76	7,095,129,673.72
负债和所有者权益总计		773,312,296.57	7,850,556,153.69

注：1、报告截止日 2020 年 7 月 27 日(基金合同失效前日)，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 770,059,000.76 份，其中 A 类基金份额 3,346,487.94 份，B 类基金份额 766,712,512.82 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 7 月 27 日(基金合同失效前日)。

7.2.2 利润表

会计主体：交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 7 月 27 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 7 月 27 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		109,875,266.75	317,062,327.33

1.利息收入		101,471,168.74	316,287,372.13
其中：存款利息收入	7.2.4.7.11	13,056,623.42	62,754,256.42
债券利息收入		82,369,687.57	250,310,736.39
资产支持证券利息收入		-	1,217,033.23
买入返售金融资产收入		6,044,857.75	2,005,346.09
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		8,404,098.01	724,725.76
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.2.4.7.12	8,404,098.01	724,725.76
资产支持证券投资收益	7.2.4.7.13	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.2.4.7.14	-	50,229.44
减：二、费用		18,699,437.93	47,652,024.06
1. 管理人报酬		7,552,985.97	17,349,540.50
2. 托管费		3,021,194.46	6,939,816.32
3. 销售服务费		385,565.58	894,025.44
4. 交易费用		-	-
5. 利息支出		7,364,588.44	21,986,101.85
其中：卖出回购金融资产支出		7,364,588.44	21,986,101.85
6. 税金及附加		136,143.99	124,621.35
7. 其他费用	7.2.4.7.15	238,959.49	357,918.60
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		91,175,828.82	269,410,303.27
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		91,175,828.82	269,410,303.27

7.2.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 7 月 27 日

单位：人民币元

项 目	本期
-----	----

	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 7 月 27 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）	7,095,129,673.72	-	7,095,129,673.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	91,175,828.82	91,175,828.82
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）	-6,325,070,672.96	-	-6,325,070,672.96
其中：1.基金申购款	113,767,120.08	-	113,767,120.08
2.基金赎回款	-6,438,837,793.04	-	-6,438,837,793.04
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）	-	-91,175,828.82	-91,175,828.82
五、期末所有者权益（基金净值）	770,059,000.76	-	770,059,000.76
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 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）	11,768,816,309.72	-	11,768,816,309.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	269,410,303.27	269,410,303.27
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）	-4,673,686,636.00	-	-4,673,686,636.00
其中：1.基金申购款	267,129,197.14	-	267,129,197.14
2.基金赎回款	-4,940,815,833.14	-	-4,940,815,833.14
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）	-	-269,410,303.27	-269,410,303.27
五、期末所有者权益（基金净值）	7,095,129,673.72	-	7,095,129,673.72

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.2.1 至 7.2.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：谢卫，主管会计工作负责人：夏华龙，会计机构负责人：单江

7.2.4 报表附注

7.2.4.1 基金基本情况

交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金(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]1768 号《关于核准交银施罗德理财 60 天债券型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《交银施罗德理财 60 天债券型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证券投资基金，存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 777,735,040.55 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(2013)第 131 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金基金合同》于 2013 年 3 月 13 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 777,917,201.14 份基金份额，其中认购资金利息折合 182,160.59 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金基金合同》和《交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金招募说明书》，本基金根据投资人持有本基金的份额数量，对投资人持有的基金份额按照不同的费率计提销售服务费用，因此形成 A 类和 B 类两类基金份额。两类基金份额分别公布每万份基金净收益和七日年化收益率。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德理财 60 天债券型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，包括现金，通知存款，一年以内(含一年)的银行定期存款和大额存单，剩余期限(或回售期限)在 397 天以内(含 397 天)的债券、资产支持证券和中期票据，期限在一年以内(含一年)的债券回购，期限在一年以内(含一年)的中央银行票据和短期融资券，以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他固定收益类金融工具及相关衍生工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的业绩比较基准为：人民币七天通知存款税后利率。

本财务报表由本基金的基金管理人交银施罗德基金管理有限公司于 2021 年 3 月 26 日批准报出。

7.2.4.2 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<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.2.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

经中国证监会批准,本基金的基金管理人交银施罗德基金管理有限公司将本基金于基金合同失效日 2020 年 7 月 28 日转型为交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金,存续期限为不定期,因此本基金财务报表仍以持续经营假设为编制基础。

7.2.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 7 月 27 日(基金合同失效前日)止期间的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 2020 年 7 月 27 日(基金合同失效前日)的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 7 月 27 日(基金合同失效前日)止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.2.4.4 重要会计政策和会计估计

7.2.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 7 月 27 日(基金合同失效前日)。

7.2.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.2.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金以交易目的持有的债券投资和资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.2.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。对于取得债券投资或资产支持证券投资支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资和资产支持证券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资和资产支持证券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.2.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免投资组合的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金管理人于每一计价日采用投资组合的公允价值计算影子价格。当影子价格确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的偏离度绝对值达到或超过 0.25%时，基金管理人应根据相关法律法规采取相应措施，使基金资产净值更能公允地反映基金投资组合价值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资和资产支持证券投资的公允价值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充

足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.2.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.2.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为人民币 1.00 元。由于申购、赎回及分红再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。上述申购和赎回分别包括因类别调整而引起的 A、B 类基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

7.2.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

债券投资和资产支持证券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

债券投资或资产支持证券投资处置时其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.2.4.4.9 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的

则按直线法计算。

7.2.4.4.10 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。申购的基金份额享有确认当日的分红权益，而赎回的基金份额不享有确认当日的分红权益。本基金以份额面值 1.00 元固定份额净值交易方式，每日计算当日收益并全部分配结转至应付收益科目，并在运作期期末集中支付。

7.2.4.4.11 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.2.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金计算影子价格过程中确定债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可交换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可交换债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.2.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.2.4.5.1 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。

7.2.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.2.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.2.4.6 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》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.2.4.7 重要财务报表项目的说明

7.2.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 7 月 27 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	2,715,773.95	1,376,445.57
定期存款	-	-

其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	1,750,000,000.00
合计	2,715,773.95	1,751,376,445.57

注：本基金持有的其他存款，均为有存款期限，但根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款。

7.2.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2020 年 7 月 27 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度（%）
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	729,966,052.15	730,002,000.00	35,947.85	0.0047
	合计	729,966,052.15	730,002,000.00	35,947.85	0.0047
资产支持证券		-	-	-	-
合计		729,966,052.15	730,002,000.00	35,947.85	0.0047
项目		上年度末 2019 年 12 月 31 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度（%）
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	6,076,077,745.20	6,080,324,000.00	4,246,254.80	0.0598
	合计	6,076,077,745.20	6,080,324,000.00	4,246,254.80	0.0598
资产支持证券		-	-	-	-
合计		6,076,077,745.20	6,080,324,000.00	4,246,254.80	0.0598

注：1、偏离金额=影子定价-摊余成本；

2、偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

7.2.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融工具。

7.2.4.7.4 买入返售金融资产

7.2.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 7 月 27 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	35,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	35,000,000.00	-
项目	上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-

7.2.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.2.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 7 月 27 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	33,838.35	8,792.72
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	7,957,221.56
应收结算备付金利息	-	-
应收债券利息	5,596,632.12	15,135,948.64
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	-	-
合计	5,630,470.47	23,101,962.92

7.2.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.2.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 7 月 27 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	35,911.43	73,515.26
合计	35,911.43	73,515.26

7.2.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 7 月 27 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提信息披露费	68,524.83	120,000.00
预提审计费	68,524.83	130,000.00
预提账户维护费	2,729.16	9,300.00
合计	139,778.82	259,300.00

7.2.4.7.9 实收基金

交银理财 60 天债券 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年7月27日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,498,988.29	5,498,988.29
本期申购	113,156.57	113,156.57
本期赎回（以“-”号填列）	-2,265,656.92	-2,265,656.92
本期末	3,346,487.94	3,346,487.94

交银理财 60 天债券 B

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年7月27日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	7,089,630,685.43	7,089,630,685.43
本期申购	113,653,963.51	113,653,963.51
本期赎回（以“-”号填列）	-6,436,572,136.12	-6,436,572,136.12
本期末	766,712,512.82	766,712,512.82

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。

7.2.4.7.10 未分配利润

交银理财 60 天债券 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	59,131.25	-	59,131.25
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-59,131.25	-	-59,131.25
本期末	-	-	-

交银理财 60 天债券 B

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	91,116,697.57	-	91,116,697.57
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-91,116,697.57	-	-91,116,697.57
本期末	-	-	-

7.2.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 7 月 27 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	51,831.07	26,215.54
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	13,004,792.35	62,728,040.88
结算备付金利息收入	-	-
其他	-	-
合计	13,056,623.42	62,754,256.42

7.2.4.7.12 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年7月 27日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	12,197,600,482.19	19,464,781,560.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	12,108,147,385.02	19,379,850,627.50
减：应收利息总额	81,048,999.16	84,206,206.74
买卖债券差价收入	8,404,098.01	724,725.76

7.2.4.7.13 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年7月27日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
卖出资产支持证券成交总额	-	133,522,186.03
减：卖出资产支持证券成本总额	-	131,955,000.00
减：应收利息总额	-	1,567,186.03
资产支持证券投资收益	-	-

7.2.4.7.14 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2020年1月1日至2020年7月27日	2019年1月1日至2019年12月31日
基金赎回费收入	-	-
基金转换费收入	-	50,229.44
合计	-	50,229.44

7.2.4.7.15 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年7月27 日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
审计费用	68,524.83	130,000.00
信息披露费	68,524.83	120,000.00
银行费用	30,580.67	70,718.60
债券账户费用	21,329.16	37,200.00
律师费	40,000.00	-
公证费	10,000.00	-
合计	238,959.49	357,918.60

7.2.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.2.4.8.1 或有事项

无。

7.2.4.8.2 资产负债表日后事项

根据2020年5月22日至2020年6月22日本基金基金份额持有人大会审议通过的《关于交银施罗德理财60天债券型证券投资基金转型及修改基金合同有关事项的议案》，及基金管理人于2020年6月24日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德理财60天债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》的有关规定，自2020年7月28日起，原交银施罗德理财60天债券型证券投资基金转型为交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金，《交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金基金合同》自该日起生效，原《交银施罗德理财60天债券型证券投资基金基金合同》自同一日起失效，交银施罗德理财60天债券型证券投资基金正式变更为交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金。

7.2.4.9 关联方关系

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(“交银施罗德基金公司”)	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	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

施罗德投资管理有限公司	基金管理人的股东
中国国际海运集装箱(集团)股份有限公司	基金管理人的股东
交银施罗德资产管理有限公司	基金管理人的子公司
上海直源投资管理有限公司	受基金管理人控制的公司

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。

7.2.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.2.4.10.1 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。

7.2.4.10.2 关联方报酬

7.2.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年7月 27日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	7,552,985.97	17,349,540.50
其中：支付销售机构的客户维护费	1,060.66	5,002.07

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.20%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 × 0.20% ÷ 当年天数。

7.2.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年7月 27日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,021,194.46	6,939,816.32

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.08%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 × 0.08% ÷ 当年天数。

7.2.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各	本期 2020年1月1日至2020年7月27日
-----------	----------------------------

关联方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	交银理财 60 天债券 A	交银理财 60 天债券 B	合计
交通银行	3,974.10	—	3,974.10
中国建设银行	1,033.27	—	1,033.27
交银施罗德基金公司	2,367.83	377,376.33	379,744.16
合计	7,375.20	377,376.33	384,751.53
获得销售服务费的各 关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	交银理财60天债券A	交银理财60天债券B	合计
	交通银行	—	7,538.94
中国建设银行	2,502.45	—	2,502.45
交银施罗德基金公司	14,571.59	866,561.60	881,133.19
合计	24,612.98	866,561.60	891,174.58

注：本基金实行销售服务费分类收费方式，分设 A、B 两类基金份额：A 类基金按前一日基金资产净值 0.30% 的年费率逐日计提销售服务费，B 类基金按前一日基金资产净值 0.01% 的年费率逐日计提，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：

A 类基金日销售服务费 = 前一日 A 类基金份额对应的资产净值 × 0.30% ÷ 当年天数；

B 类基金日销售服务费 = 前一日 B 类基金份额对应的资产净值 × 0.01% ÷ 当年天数。

7.2.4.10.3 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发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.2.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.2.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间未发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.2.4.10.4.2 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

交银理财 60 天债券 A

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 A 类基金份额。

交银理财 60 天债券 B

份额单位：份

关联方名称	交银理财 60 天债券 B 本期末 2020 年 7 月 27 日		交银理财 60 天债券 B 上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金	持有的基金份额	持有的基金份

		份额占基金 总份额的比 例		额占基金总份 额的比例
上海直源投资管理 有限公司	7,676,657.16	1.00%	7,563,937.24	0.11%

注：关联方投资本基金的费率按照基金合同和招募说明书规定的确定，符合公允性要求。

7.2.4.10.5 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 2020年1月1日至2020年7月27日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有 限公司	2,715,773.95	51,831.07	1,376,445.57	26,215.54

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。

7.2.4.10.6 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的证券。

7.2.4.10.7 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。

7.2.4.11 利润分配情况

交银理财 60 天债券 A

单位：人民币元

已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分 配合计	备注
64,673.86	7,281.76	-12,824.37	59,131.25	-

交银理财 60 天债券 B

单位：人民币元

已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配 合计	备注
113,653,963.51	2,343,939.50	-24,881,205.44	91,116,697.57	-

7.2.4.12 期末（2020年7月27日）本基金持有的流通受限证券

7.2.4.12.1 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。

7.2.4.12.2 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。

7.2.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.2.4.13 金融工具风险及管理

7.2.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为采用固定组合策略的短期理财债券型基金，属于证券投资基金中较低风险、预期收益较为稳定的品种，其预期的风险水平低于股票基金、混合基金和普通债券基金。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，力求通过主动承担适度信用风险获得持续投资收益，谋求基金资产的长期稳定增长。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立合规审核及风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由风险管理部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。风险管理部对公司总经理负责。督察长独立行使督察权利，直接对董事会负责，就内部控制制度和执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能，定期和不定期地向董事会报告公司内部控制执行情况。

本基金的基金管理人建立了以合规审核及风险管理委员会为核心的，由督察长、风险控制委员会、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.2.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国建设银行，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险；在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

7.2.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020年7月27日 (基金合同失效前日)	上年度末 2019年12月31日
A-1	-	200,620,885.62
A-1 以下	-	-
未评级	377,980,839.40	1,788,083,389.37
合计	377,980,839.40	1,988,704,274.99

注：未评级部分为国债和政策性金融债。

7.2.4.13.2.2 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020年7月27日 (基金合同失效前日)	上年度末 2019年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	99,645,024.72	4,027,123,371.62
合计	99,645,024.72	4,027,123,371.62

7.2.4.13.2.3 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年7月27日 (基金合同失效前日)	上年度末 2019年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	252,340,188.00	60,250,098.59
合计	252,340,188.00	60,250,098.59

注：未评级部分为政策性金融债。

7.2.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2020 年 7 月 27 日(基金合同失效前日)，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

注：流动性受限资产、7 个工作日可变现资产的计算口径见《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》第四十条。

7.2.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。基金投资组合的平

均剩余期限在每个交易日均不得超 180 天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场 交易债券应对流动性需求。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，银行间正回购上限一般不超过基金资产净值的 40%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.2.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

7.2.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.2.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.2.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 7 月 27 日 (基金合同失效前 日)	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计
资产							
银行存款	2,715,773.95	-	-	-	-	-	2,715,773.95
买入返售金融资产	35,000,000.00	-	-	-	-	-	35,000,000.00
交易性金融资产	-	329,597,832.45	400,368,219.70	-	-	-	729,966,052.15
应收利息	-	-	-	-	-	5,630,470.47	5,630,470.47
资产总计	37,715,773.95	329,597,832.45	400,368,219.70	-	-	5,630,470.47	773,312,296.57
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,998,309.31	1,998,309.31
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	640,756.52	640,756.52
应付托管费	-	-	-	-	-	256,302.60	256,302.60
应付销售服务费	-	-	-	-	-	32,784.66	32,784.66
应付交易费用	-	-	-	-	-	35,911.43	35,911.43
应交税费	-	-	-	-	-	123,692.79	123,692.79
应付利润	-	-	-	-	-	25,759.68	25,759.68
其他负债	-	-	-	-	-	139,778.82	139,778.82
负债总计	-	-	-	-	-	3,253,295.81	3,253,295.81
利率敏感度缺口	37,715,773.95	329,597,832.45	400,368,219.70	-	-	2,377,174.66	770,059,000.76
上年度末 2019 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计
资产							
银行存款	101,376,445.57	1,650,000,000.00	-	-	-	-	1,751,376,445.57
交易性金融资产	-	4,330,387,965.74	1,745,689,779.46	-	-	-	6,076,077,745.20
应收利息	-	-	-	-	-	23,101,962.92	23,101,962.92
资产总计	101,376,445.57	5,980,387,965.74	1,745,689,779.46	-	-	23,101,962.92	7,850,556,153.69
负债							
卖出回购金融资产款	728,114,015.90	-	-	-	-	-	728,114,015.90
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,301,984.06	1,301,984.06
应付托管费	-	-	-	-	-	520,793.67	520,793.67
应付销售服务费	-	-	-	-	-	66,665.01	66,665.01
应付交易费用	-	-	-	-	-	73,515.26	73,515.26
应交税费	-	-	-	-	-	113,302.57	113,302.57
应付利息	-	-	-	-	-	57,114.01	57,114.01
应付利润	-	-	-	-	-	24,919,789.49	24,919,789.49
其他负债	-	-	-	-	-	259,300.00	259,300.00
负债总计	728,114,015.90	-	-	-	-	27,312,464.07	755,426,479.97

利率敏感度缺口	-626,737,570.33	5,980,387,965.74	1,745,689,779.46	-	-	-4,210,501.15	7,095,129,673.72

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

7.2.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2020 年 7 月 27 日 (基金合同失效前日)	上年度末 2019 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点	减少约 86	减少约 448
	市场利率下降 25 个基点	增加约 87	增加约 449

7.2.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.2.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的债券，因此无重大其他价格风险。

7.2.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 7 月 27 日(基金合同失效前日)，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益

的金融资产中属于第二层次的余额为 729,966,052.15 元，无属于第一或第三层次的余额(2019 年 12 月 31 日：第二层次 6,076,077,745.20 元，无第一或第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 7 月 27 日(基金合同失效前日)，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2019 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金

(报告期：2020 年 7 月 28 日(基金合同生效日)-2020 年 12 月 31 日)

8.1.1 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	基金投资	-	-
3	固定收益投资	743,009,000.00	95.39
	其中：债券	743,009,000.00	95.39
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	25,000,157.50	3.21

	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,252,444.69	0.16
8	其他各项资产	9,632,107.01	1.24
9	合计	778,893,709.20	100.00

8.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.1.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

8.1.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

8.1.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

8.1.4 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。

8.1.5 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	743,009,000.00	95.45
	其中：政策性金融债	330,021,000.00	42.40
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	743,009,000.00	95.45

8.1.6 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	200207	20 国开 07	800,000	80,088,000.00	10.29
2	180203	18 国开 03	600,000	60,252,000.00	7.74
3	1620039	16 徽商银行 02	600,000	60,192,000.00	7.73
4	1820037	18 宁波银行 03	500,000	50,570,000.00	6.50
5	1828017	18 兴业绿色金融 02	500,000	50,430,000.00	6.48

8.1.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

8.1.8 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。

8.1.9 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。

8.1.10 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。

8.1.11 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。

8.1.12 投资组合报告附注

8.1.12.1 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。

8.1.12.2 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。

8.1.12.3 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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	9,631,110.00

5	应收申购款	997.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,632,107.01

8.1.12.4 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。

8.1.12.5 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。

8.1.12.6 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。

8.2 交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金

(报告期：2020年1月1日-2020年7月27日)

8.2.1 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	固定收益投资	729,966,052.15	94.39
	其中：债券	729,966,052.15	94.39
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	35,000,000.00	4.53
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	2,715,773.95	0.35
4	其他各项资产	5,630,470.47	0.73
5	合计	773,312,296.57	100.00

8.2.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	9.32	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个银行间市场交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

本基金合同约定：“本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%”。本报告期内，本基金未发生超标情况。

8.2.3 基金投资组合平均剩余期限

8.2.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	168
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	171
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	12

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金合同约定：“本基金投资组合的平均剩余期限控制在 180 天（含）以内。”本基金本报告期内投资组合平均剩余期限未超过 180 天。

8.2.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30 天以内	4.90	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	29.80	-

	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	13.00	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	51.99	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
合计		99.69	-

8.2.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余存续期未超过 240 天。

8.2.5 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	摊余成本	占基金资产净值 比例(%)
1	国家债券	19,951,091.42	2.59
2	央行票据	-	-
3	金融债券	610,369,936.01	79.26
	其中：政策性金融债	610,369,936.01	79.26
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	99,645,024.72	12.94
8	其他	-	-
9	合计	729,966,052.15	94.79
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

8.2.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本	占基金资产净值比例（%）
1	200211	20 国开 11	2,000,000	198,031,687.46	25.72
2	180203	18 国开 03	1,000,000	101,244,947.12	13.15
3	180208	18 国开 08	1,000,000	101,091,585.12	13.13
4	190307	19 进出 07	1,000,000	100,125,268.26	13.00
5	111909327	19 浦发银行 CD327	1,000,000	99,645,024.72	12.94
6	2003662	20 进出 662	600,000	59,872,792.29	7.78
7	100410	10 农发 10	500,000	50,003,655.76	6.49
8	209928	20 贴现国债 28	200,000	19,951,091.42	2.59

8.2.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	41
报告期内偏离度的最高值	0.4311%
报告期内偏离度的最低值	0.0027%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1839%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内未存在负偏离度的绝对值达到 0.25%情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本基金本报告期内未存在正偏离度的绝对值达到 0.5%情况。

8.2.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

8.2.9 投资组合报告附注

8.2.9.1 基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价，即计价对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内按照实际利率和摊余成本逐日摊销计算损益。

8.2.9.2 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。

8.2.9.3 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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	5,630,470.47
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	5,630,470.47

8.2.9.4 其他需说明的重要事项

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。

§ 9 基金份额持有人信息**9.1 交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金**

（报告期：2020年7月28日（基金合同生效日）-2020年12月31日）

9.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
311	2,474,317.92	766,738,213.36	99.64%	2,774,660.41	0.36%

9.1.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	1,824.84	0.00%

9.1.3 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情况

项目	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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

9.2 交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金

(报告期: 2020年1月1日-2020年7月27日)

9.2.1 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	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
交银理财 60 天债券 A	322	10,392.82	48,597.74	1.45%	3,297,890.20	98.55%
交银理财 60 天债券 B	3	255,570.8 37.61	766,712,512. 82	100.00%	-	-
合计	325	2,369,412. 31	766,761,110. 56	99.57%	3,297,890.20	0.43%

9.2.2 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	交银理财 60 天债券 A	1,925.22	0.06%
	交银理财 60 天债券 B	0.00	0.00%
	合计	1,925.22	0.00%

9.2.3 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	交银理财 60 天债券 A	0~10
	交银理财 60 天债券 B	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	交银理财 60 天债券 A	0~10
	交银理财 60 天债券 B	0
	合计	0~10

§ 10 开放式基金份额变动

10.1 交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金

(报告期: 2020年7月28日(基金合同生效日)-2020年12月31日)

单位: 份

基金合同生效日(2020年7月28日)基金份额总额	770,084,760.44
本报告期期初基金份额总额	770,084,760.44
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	713,783.40
减: 基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,285,670.07
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	769,512,873.77

注: 1、上表中“报告期”指2020年7月28日至2020年12月31日;

2、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;

3、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。

10.2 交银施罗德理财60天债券型证券投资基金

(报告期: 2020年1月1日-2020年7月27日)

单位: 份

项目	交银理财 60 天债券 A	交银理财 60 天债券 B
基金合同生效日(2013年3月13日) 基金份额总额	756,744,683.05	21,172,518.09
本报告期期初基金份额总额	5,498,988.29	7,089,630,685.43
本报告期基金总申购份额	113,156.57	113,653,963.51
减: 本报告期基金总赎回份额	2,265,656.92	6,436,572,136.12
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	3,346,487.94	766,712,512.82

注: 1、上表中“报告期”指2020年1月1日至2020年7月27日;

2、如果本报告期间发生转换入、份额类别调整、红利再投业务, 则总申购份额中包含该业务;

3、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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金管理人于 2020 年 5 月 22 日起至 2020 年 6 月 22 日 17: 00 止以通讯方式召开本基金的基

金份额持有人大会，就本基金转型及基金合同修改有关事项的议案进行表决。本次基金份额持有人大会于 2020 年 6 月 23 日表决通过了《关于交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金转型及修改基金合同有关事项的议案》，本次基金份额持有人大会决议自该日起生效，正式实施转型日为 2020 年 7 月 28 日。详情请查阅本基金管理人于 2020 年 6 月 24 日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

11.2 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：本报告期内，本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

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

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金于 2020 年 6 月 23 日召开基金份额持有人大会审议并表决通过了《关于交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金转型及修改基金合同有关事项的议案》，修订后的《交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金基金合同》与《交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金托管协议》自 2020 年 7 月 28 日起生效。基金的基金名称、投资目标、投资范围、投资策略、业绩比较基准、投资限制、基金的估值、基金的费用以及其他部分条款等按照修订后的《交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金基金合同》相关规定进行运作。前述修改变更事项已按照相关法律法规及基金合同的约定履行相关手续。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），本期审计费用为 90,000.00 元。自本基金合同生效以来，本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

1、管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金管理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。

2、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金

(报告期: 2020年7月28日(基金合同生效日)-2020年12月31日)

11.7.1.1 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	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		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	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

11.7.1.2 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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券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	-	-	537,500,000.00	100.00%	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

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。

11.7.2 交银施罗德理财60天债券型证券投资基金

(报告期: 2020年1月1日-2020年7月27日)

11.7.2.1 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	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		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	-	-	-	-	-
中信建投证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	-

11.7.2.2 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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券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	-	-	68,000,000.00	100.00%	-	-
中信建投证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-

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。

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期内不存在偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

11.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金 2019 年第 4 季度报告	公司网站	2020-01-21
2	交银施罗德基金管理有限公司关于春节假期调整延期办理有关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2020-01-31
3	交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金（更新）招募说明书摘要（2019 年第 3 号）	公司网站	2020-02-15
4	交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金（更新）招募说明书（2019 年第 3 号）	公司网站	2020-02-15
5	交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金 2019 年年度报告	公司网站	2020-03-30
6	交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金	公司网站	2020-04-22

	2020 年第 1 季度报告		
7	交银施罗德基金管理有限公司关于以通讯方式召开交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金基金份额持有人大会的公告	中国证券报、公司网站	2020-05-21
8	交银施罗德基金管理有限公司关于以通讯方式召开交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	中国证券报、公司网站	2020-05-22
9	交银施罗德基金管理有限公司关于以通讯方式召开交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	中国证券报、公司网站	2020-05-23
10	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金暂停及恢复赎回业务的公告	中国证券报、公司网站	2020-06-19
11	交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金招募说明书	公司网站	2020-06-24
12	交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金托管协议	公司网站	2020-06-24
13	交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金基金合同摘要	公司网站	2020-06-24
14	交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金基金合同	公司网站	2020-06-24
15	交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	中国证券报、公司网站	2020-06-24
16	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	中国证券报、公司网站	2020-06-24
17	交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金 2020 年第 2 季度报告	公司网站	2020-07-21
18	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金基金合同生效暨开放日常申购、赎回、定期定额投资业务的公告	中国证券报、公司网站	2020-07-28
19	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金开放日常转换业务的公告	中国证券报、公司网站	2020-08-24
20	交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金 2020 年中期报告	公司网站	2020-08-29
21	交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金基金产品资料概要	公司网站	2020-08-31
22	交银施罗德基金管理有限公司关于暂停上海凯石财富基金销售有限公司办理相关销售业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2020-09-29

23	交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金(原交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金转型)2020 年第 3 季度报告	公司网站	2020-10-28
24	交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司手机银行基金前端申购(含定期定额投资)费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2020-12-31

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金

12.1.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2020/7/28-2020/12/31	544,890,864.30	18,264.37	18,264.37	544,890,864.30	70.81%
	2	2020/7/28-2020/12/31	214,170,434.58	7,178.85	7,178.85	214,170,434.58	27.83%
产品特有风险							
本基金本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例超过基金总份额20%的情况。如该类投资者集中赎回,可能会对本基金带来流动性冲击,从而影响基金的投资运作和收益水平。基金管理人将加强流动性管理,防范相关风险,保护持有人利益。							

12.2 交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金

12.2.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2020/1/1-2020/7/27	1,687,007.44	13,098.29	1,700,105.73	-	-
	2	2020/1/1-2020/7/27	1,613,848,842.60	27,106,625.43	1,640,955,468.03	-	-
	3	2020/1/1-2020/7/27	2,125,624,801.38	35,410,122.48	2,161,034,923.86	-	-
	4	2020/1/1-2020/7/27	535,28	9,587,9	-	544,872,599.	70.76%

		7	4,697.39	02.54		93	
	5	2020/1/1-2020/7/27	210,178,830.11	3,984,425.62	-	214,163,255.73	27.81%
个人	1	2020/1/1-2020/7/27	1,053,890.99	15,345.23	-	1,069,236.22	0.14%
产品特有风险							
本基金本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例超过基金总份额20%的情况。如该类投资者集中赎回,可能会对本基金带来流动性冲击,从而影响基金的投资运作和收益水平。基金管理人将加强流动性管理,防范相关风险,保护持有人利益。							

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金募集的文件;
- 2、《交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金基金合同》;
- 3、《交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金招募说明书》;
- 4、《交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金托管协议》;
- 5、《交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金基金合同》;
- 6、《交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金招募说明书》;
- 7、《交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金托管协议》;
- 8、基金管理人业务资格批件、营业执照;
- 9、基金托管人业务资格批件、营业执照;
- 10、关于申请募集交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金之法律意见书;
- 11、关于修改《交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金基金合同》的法律意见书
- 12、报告期内交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金、交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

13.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

13.3 查阅方式

投资者可在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅备查文件,或者登录基金管理人的网站(www.fund001.com)查阅。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人交银施罗德基金管理有限公司。本公司客户

服务中心电话：400-700-5000（免长途话费），021-61055000，电子邮件：services@jysld.com。

交银施罗德基金管理有限公司

二〇二一年三月三十日