交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金

2014 半年度 报告摘要

2014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:二〇一四年八月二十五日

§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(以下简称"中国农业银行")根据本基金合同规定,于2014年8月22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2014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	280,026,971.84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	164,569,385.40份	115,457,586.44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	李芳菲
	联系电话	021-61055050	010-66060069
	电子邮箱	xxpl@jysld.com,disclosure@jysld.com	lifangfei@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(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
本期已实现收益	729,224.92	960,485.96
本期利润	10,999,824.74	2,945,948.47
加权平均基金份额本期利润	0.0594	0.0688
本期基金份额净值增长率	6.27%	5.89%
3.1.2期末数据和指标	报告期末(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
期末可供分配基金份额利润	0.018	0.009
期末基金资产净值	172,991,492.16	120,263,179.36
期末基金份额净值	1.051	1.042

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	1.25%	0.12%	0.41%	0.07%	0.84%	0.05%
过去三个月	4.16%	0.13%	2.42%	0.09%	1.74%	0.04%
过去六个月	6.27%	0.12%	4.07%	0.08%	2.20%	0.04%
过去一年	4.47%	0.11%	-0.66%	0.09%	5.13%	0.02%
自基金合同生效起至今	5.83%	0.10%	0.21%	0.09%	5.62%	0.01%

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	1.26%	0.11%	0.41%	0.07%	0.85%	0.04%
过去三个月	3.99%	0.11%	2.42%	0.09%	1.57%	0.02%
过去六个月	5.89%	0.11%	4.07%	0.08%	1.82%	0.03%
过去一年	3.68%	0.11%	-0.66%	0.09%	4.34%	0.02%
自基金合同生效起至今	4.82%	0.10%	0.21%	0.09%	4.61%	0.01%

注:本基金的业绩比较基准为中债综合全价指数。

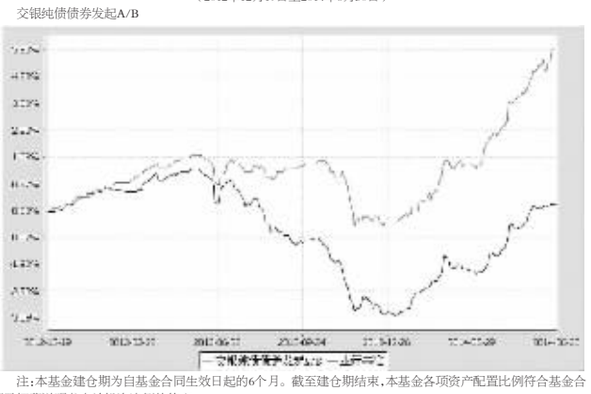
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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

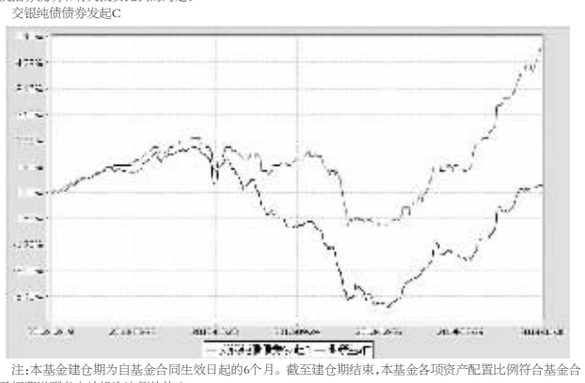
(2012年12月19日至2014年6月30日)

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,公司管理了包括货币型、债券型、保本混合型、普通混合型和股票型在内的34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		
胡军华	本基金、交银理财60天债券、交银双轮动债券的基金经理,公司固定收益部总经理	2012-12-19	2014-03-31	22年	胡军华女士,中国人民大学经济学硕士。历任中国经济开发信托投资公司证券业务总部研究部副总经理、华鑫证券有限公司深圳营业部副总经理、原南方证券有限公司债券业务总部投资经理、招商基金管理有限公司固定收益部总监、基金经理、瑞银证券资产管理部/财富管理部董事、高级投资组合经理。其中2005年5月至2006年5月担任招商现金增值开放式证券投资基金基金经理,2005年8月至2008年12月担任招商安泰系列证券投资基金基金经理,2006年7月至2008年12月担任招商安本增利债券型证券投资基金基金经理。2012年加入交银施罗德基金管理有限公司,2013年3月13日至2014年3月30日担任交银施罗德理财60天债券型证券投资基金基金经理,2013年4月18日至2014年3月30日担任交银施罗德双轮动债券型证券投资基金基金经理。
林洪钧	本基金、交银货币、交银信用添利债券(LOF)、交银理财21天债券的基金经理,交银荣安保本混合、交银荣祥保本混合的基金经理助理,公司固定收益部助理总经理	2014-03-31	-	10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。
孙超	本基金、交银理财60天债券、交银双轮动债券的基金经理助理	2013-07-08	-	3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债券投资经理兼固定收益总监助理。2013年加入交银施罗德基金管理有限公司。

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、经公司总经理办公室会议审议通过,孙超先生自2014年7月1日起不再担任本基金基金经理助理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

本报告期内,经济增长动能驱弱。一季度工业增加值延续去年四季度疲弱的表现,通胀及PPI都处于较低水平,而货币政策较去年发生了较大的变化,市场流动性出现了较大的改善。至二季度,经济基本面进一步驱弱,4、5月工业增加值为8.7%、8.8%,PPI今年以来连续5个月环比为负,这些都体现了经济下行的压力较一季度进一步加大。而二季度房地产销售、新开工面积同比不断下降,房价也在高位出现下跌迹象。房地产投资严重下滑使得今年保增长的压力显得尤为突出。与经济下行相对应的是,二季度各种结构性政策的频频出台。自4月16日起,央行降低了部分农信社、城商行、部分股份制银行的存款准备金率。政策的连续出台在下半年或将起到积极的作用。

本报告期内,受经济下滑、货币政策加码、流动性充沛三方面影响,债券市场经历了较为明显的涨幅,中债总财富指数上涨6.05%。从产品类属上,一季度中高等级企业债表现较好,而长久期政策性金融债以及城投在二季度的表现更为突出。然而,在二季度末,由于稳增长的政策不断加码,债券市场的预期发生了微妙的变化。出于对下半年政策进一步加码的担忧,从宽货币到宽信用的路径似乎在二季度末正在政策指导下发生,债券市场在二季度末收益出现了一些震荡。

本基金在本报告期内保持了较高的债券仓位,报告期内A/B类基金份额净值上涨6.27%,C类基金份额净值上涨5.89%,贡献主要来自于债券在二季度的资本利得。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年6月30日,交银纯债债券A/B份额净值为1.051元,本报告期份额净值增长率为6.27%,同期业绩比较基准增长率为4.07%;交银纯债债券C份额净值为1.042元,本报告期份额净值增长率为5.89%,同期业绩比较基准增长率为4.07%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度,前期政策累加的效果可能逐步出现,同时稳增长的政策可能继续出台,在稳增长的背景下,宽信用出现的可能性在不断提高。因此,债券市场在下半年继续出现上半年较大涨幅的可能性在降低,债券收益率可能出现波动。而另一方面,由于房地产下滑严重,中国经济结构性问题也无法在短期内解决。从市场出清到经济恢复内生增长动力仍需较长时间。所以债券市场收益率大幅上行的可能性也不高。总体说来,本基金对三季度债券市场持较谨慎观点。组合管理方面,同时降低债券仓位和久期,预计以持有票息为主。

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

本基金本报告期内未进行利润分配。

§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交银施罗德纯债债券型发起式证券投资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:2014年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
资产:			
银行存款	6.4.7.1	2,504,907.63	458,432.58
结算备付金		8,414,118.34	1,422,709.53
存出保证金		12,290.04	1.30
交易性金融资产	6.4.7.2	529,894,945.76	230,536,900.00
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		519,845,945.76	230,536,900.00
资产支持证券投资		10,049,000.00	-
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	-	45,890,468.84
应收证券清算款		19,971,213.70	-
应收利息	6.4.7.5	10,557,589.09	5,559,561.34
应收股利		-	-
应收申购款		129,835.22	4,582.98
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		571,484,899.78	283,872,656.57
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013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		277,299,159.05	24,051,787.97
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		38,377.29	283,768.60
应付管理人报酬		138,907.28	144,194.49
应付托管费		46,302.41	48,064.86
应付销售服务费		36,844.78	6,346.10
应付交易费用	6.4.7.7	7,144.98	11,093.27
应交税费		425,400.00	425,400.00
应付利息		40,233.24	2,161.97
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	197,859.23	399,331.00
负债合计		278,230,228.26	25,372,148.26
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	280,026,971.84	261,384,633.99
未分配利润	6.4.7.10	13,227,699.68	-2,884,125.68
所有者权益合计		293,254,671.52	258,500,508.31
负债和所有者权益总计		571,484,899.78	283,872,656.57

注:1、报告截止日2014年6月30日,交银纯债债券A/B基金份额净值1.051元,交银纯债债券C基金份额净值1.042元,基金份额总额280,026,971.84份,其中交银纯债债券A/B基金份额164,569,385.40份,交银纯债债券C基金份额115,457,586.44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:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入		16,568,420.50	31,229,531.63
1.利息收入		8,314,846.00	32,020,652.01
其中:存款利息收入	6.4.7.11	38,931.28	6,683,620.19
债券利息收入		7,932,691.46	21,853,130.13
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	3,483,901.69
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-4,116,627.49	2,416,949.24
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	-4,116,627.49	2,416,949.24
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	12,256,062.33	-3,555,572.07
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	114,139.66	347,502.45
减:二、费用		2,622,647.29	8,762,687.83
1.管理人报酬		688,427.47	4,231,845.21
2.托管费		229,475.75	1,410,615.09
3.销售服务费		84,651.69	721,993.12
4.交易费用	6.4.7.19	5,441.15	23,348.08
5.利息支出		1,388,530.44	2,129,860.39
其中:卖出回购金融资产支出		1,388,530.44	2,129,860.39
6.其他费用	6.4.7.20	226,120.79	245,025.94
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		13,945,773.21	22,466,843.80
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		13,945,773.21	22,466,843.80

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:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 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
项目	上年度可比期间 2013年1月1日至2013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)	2,116,634,959.21	2,936,957.84	2,119,571,917.05
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	22,466,843.80	22,466,843.80
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)	-1,481,559,711.03	-17,405,499.93	-1,498,965,210.96
其中:1.基金申购款	614,313,702.62	8,850,783.24	623,164,485.86
2.基金赎回款	-2,095,873,413.65	-26,256,283.17	-2,122,129,696.82
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)	635,075,248.18	7,998,301.71	643,073,549.89

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:战龙,主管会计工作负责人:许珊燕,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日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(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2014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2014年6月30日的财务状况以及2014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、会计估计与最近一期年度报告相一致。

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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

6.4.5.2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。

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》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》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。基金买卖股票、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,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,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,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)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

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、基金代销机构
交通银行股份有限公司("交通银行")	基金管理人的股东、基金代销机构

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 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	688,427.47	4,231,845.21
其中:支付销售机构的客户维护费	114,229.18	1,486,569.36

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 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	229,475.75	1,410,615.09

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 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
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013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
中国农业银行	-	396,185.07	396,185.07
交通银行	-	155,130.23	155,130.23
交银施罗德基金公司	-	48,581.62	48,581.62
合计	-	599,896.92	599,896.92

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

单位:人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国农业银行	-	-	-	-	-	-
	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日					
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国农业银行	-	40,275,720.55	-	-	-	-

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固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013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
基金合同生效日(2012年12月19日)持有的基金份额	-	-	-	-
报告期初持有的基金份额	10,072,734.64	-	10,003,472.22	-
报告期间申购/买入总份额	-	-	-	-
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	10,072,734.64	-	10,003,472.22	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	6.12%	-	2.09%	-

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