

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

2020 年 9 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年十月二十八日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 2020 年 10 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 7 月 1 日起至 9 月 30 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 7 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 9 月 30 日。

## § 2 基金产品概况

### 2.1 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
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
报告期末基金份额总额	769,969,757.27份

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。
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

注：1、上表中“报告期末”指2020年9月30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。

## 2.2 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
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
报告期末基金份额总额	770,059,000.76份
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。	
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	
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。

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

##### 3.1.1 交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金

单位：人民币元

主要财务指标	报告期
	(2020年7月28日-2020年9月30日)
1. 本期已实现收益	2, 584, 635. 95
2. 本期利润	1, 514, 465. 74

3. 加权平均基金份额本期利润	0.0020
4. 期末基金资产净值	771,483,927.25
5. 期末基金份额净值	1.0020

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。

### 3.1.2 交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2020年7月1日-2020年7月27日)	
	交银理财 60 天债券 A	交银理财 60 天债券 B
1. 本期已实现收益	7,508.58	9,387,349.21
2. 本期利润	7,508.58	9,387,349.21
3. 期末基金资产净值	3,346,487.94	766,712,512.82

注：1、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。

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，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。

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。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 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-2020年9月30日)

##### 3.2.1.1 本报告期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	净值增长率①	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
自基金合同生效起至今	0.20%	0.01%	-1.06%	0.05%	1.26%	-0.04%

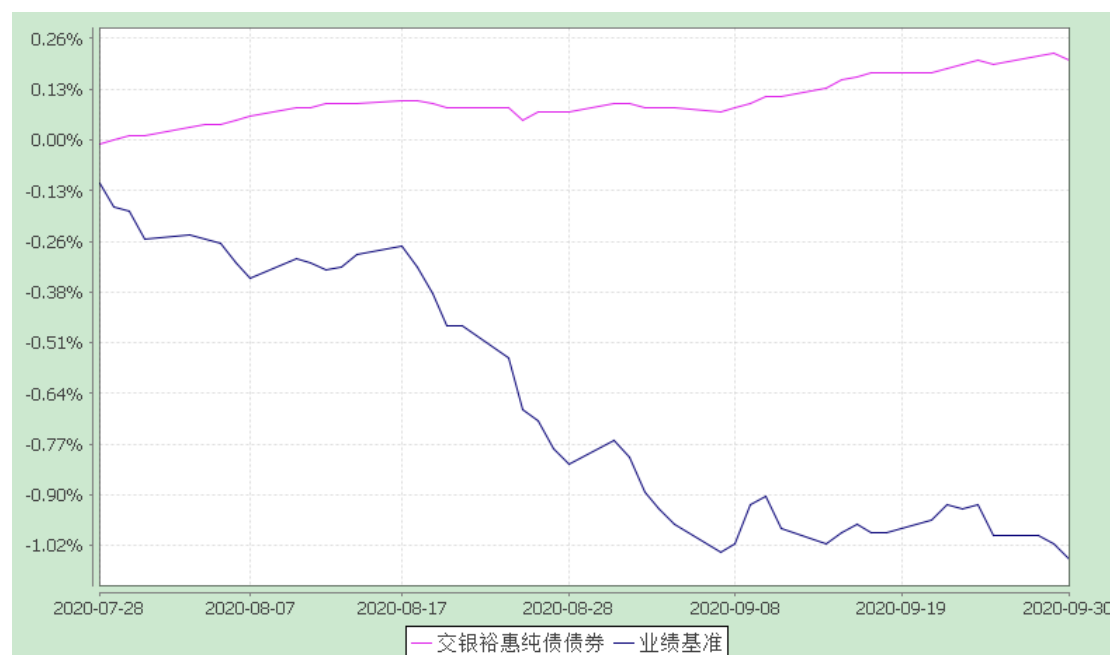
注：交银施罗德理财60天债券型证券投资基金从2020年7月28日起正式转型为交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金，本表列示的是本报告期基金转型后的基金净值表现，转型后基金的业绩比较基准为中债综合全价指数收益率。

##### 3.2.1.2 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

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-2020年9月30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9月30日，本基金尚处于建仓期。

### 3.2.2 交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金

(报告期：2020年7月1日-2020年7月27日)

#### 3.2.2.1 本报告期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	净值收益率①	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	0.2236%	0.0084%	0.0999%	0.0000%	0.1237%	0.0084%
2020年4月1日至2020年7月	0.6819%	0.0050%	0.4364%	0.0000%	0.2455%	0.0050%

27 日						
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	净值收益率①	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	0.2458%	0.0083%	0.0999%	0.0000%	0.1459%	0.0083%



至 2020 年 7 月 27 日						
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 日至 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。

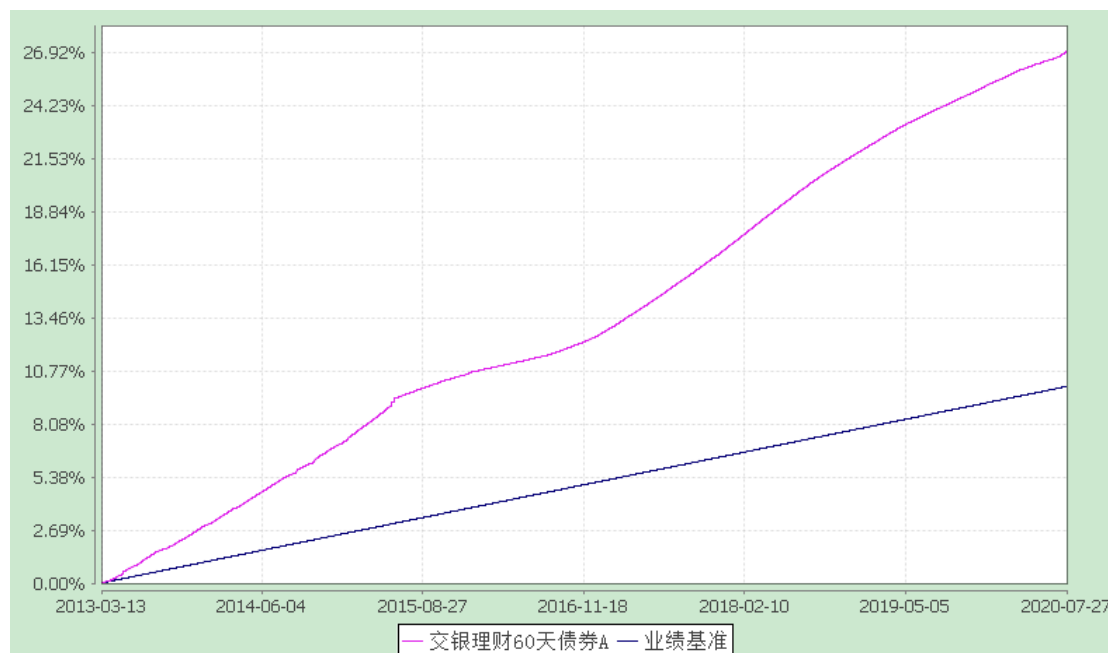
### 3.2.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金

### 累计净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

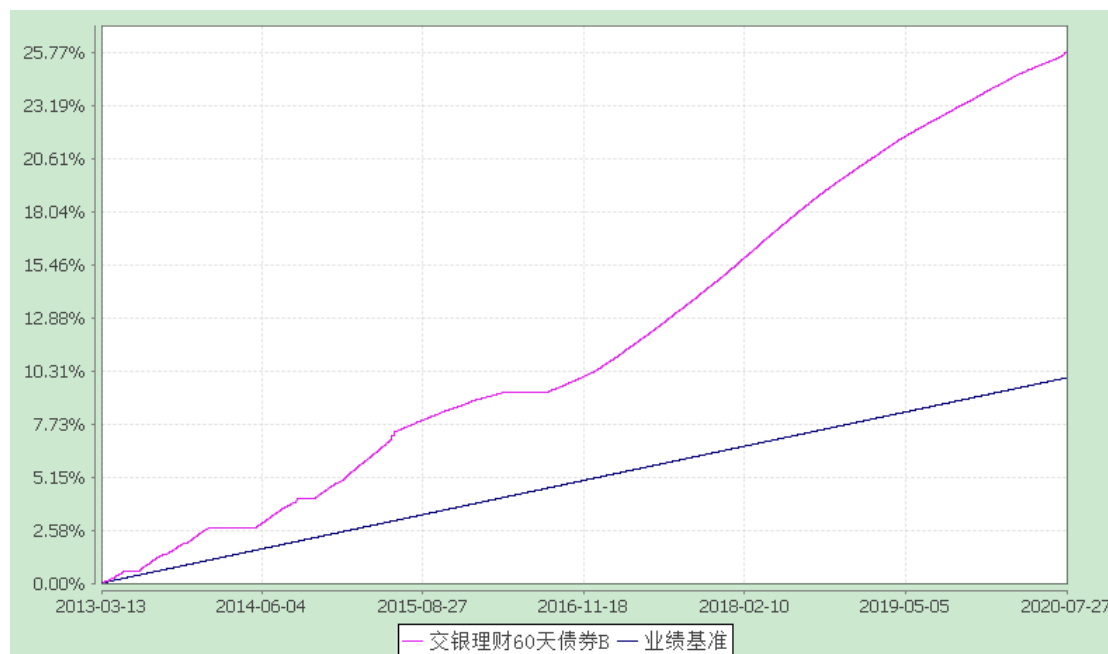
(2013 年 3 月 13 日至 2020 年 7 月 27 日)

#### 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。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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遵规守信情况的说明

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 公平交易专项说明

##### 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2020年三季度,主要受出口、房地产与基建等驱动,我国经济继续修复。七、八月我国出口继续较快增长,房地产投资维持较高增速,基建投资增速尽管不及预期,但继续为经济增长发挥托底的作用。同时制造业景气度维持向好势头,三季度中采制造业PMI进一步提升,消费逐步改善。八月社会零售消费总额自新冠疫情爆发以来首次取得正增长,社融新增规模较大,金融条件继续对经济修复提供较大支持。

货币政策方面,三季度鉴于国内经济逐步修复及资金空转套利等问题,央行货币政策向中性回归,公开市场操作趋于谨慎。尽管三季度央行公开市场净投放3723亿,但是政府债券发行在4万亿以上。资金面上,受央行公开市场操作谨慎,政府债券发行量较大,银行超储率较低及结构性存款压降等因素影响,银行间市场资金面波动显著放大,货币市场利率中枢上移。三季度R001均值较二季度上升48个BP左右,三季度存单存款收益率持续回升,三个月M股份行存单收益率三季度均值较二季度上升90个BP以上。由于国内经济改善超预期,利率债供给较大,央行货币政策宽松预期落空,资金价格中枢不断回升以及股市波动等影响,三季度债市整体上依然处于下跌通道之中。七月上旬,股市大幅上涨引发债市大

幅回调，至中下旬股市走弱，叠加中美外交冲突加剧，债市迎来一波反弹行情。但是在上述多重利空因素冲击下，八月以来利率债基本上处于跌跌不休的状态中。三季度末十年期国债YTM较二季度末上升30个BP以上。

基金操作方面，三季度本基金回笼流动性，满足转型期基金份额持有人潜在赎回需求，并且根据债市行情，在防御策略下逐步完成组合债券配置。

展望2020年四季度，国内经济整体上继续修复的概率更大一些，但房地产等领域走弱的风险也在上升，同时疫苗的进展可能提振经济改善的信心。四季度美国总统大选及其对全球政治与经济的影响，值得关注。鉴于内外形势的不确定性，预计短期内人行货币政策整体上维持中性格局的概率较大。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研发进展。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，把握市场波动机会，控制风险，为投资者创造稳健的回报。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金（各类）份额净值及业绩表现请见“3.1 主要财务指标”及“3.2.1.1本报告期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”、“3.2.2.1本报告期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。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内无需预警说明。

### § 5 投资组合报告

#### 5.1 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-2020年9月30日）

##### 5.1.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	654,369,000.00	84.77
	其中：债券	654,369,000.00	84.77

	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	99,800,349.70	12.93
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	5,264,199.37	0.68
7	其他资产	12,532,539.77	1.62
8	合计	771,966,088.84	100.00

### 5.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.1.2.1 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。

#### 5.1.2.2 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。

### 5.1.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

### 5.1.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	9,617,000.00	1.25
2	央行票据	-	-
3	金融债券	644,752,000.00	83.57
	其中：政策性金融债	241,127,000.00	31.25
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	654,369,000.00	84.82

#### 5.1.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	180208	18 国开 08	1,000,000	100,670,000.00	13.05
2	190307	19 进出 07	700,000	70,021,000.00	9.08
3	180203	18 国开 03	600,000	60,468,000.00	7.84
4	1620039	16 徽商银行 02	600,000	59,976,000.00	7.77
5	1828017	18 兴业绿色金融 02	500,000	50,700,000.00	6.57

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 5.1.7 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。

#### 5.1.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.1.9 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。

#### 5.1.10 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。

#### 5.1.11 投资组合报告附注

5.1.11.1 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。

5.1.11.2 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。

### 5.1.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	12,532,539.77
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,532,539.77

### 5.1.11.4 报告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。

### 5.1.11.5 报告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。

### 5.1.11.6 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。

## 5.2 交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金

(报告期：2020年7月1日-2020年7月27日)

### 5.2.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	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	其他资产	5,630,470.47	0.73
5	合计	773,312,296.57	100.00

### 5.2.2 报告期债券回购融资情况

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	0.09	
	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。

### 5.2.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 5.2.3.1 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。

### 5.2.3.2 报告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	-

### 5.2.4 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。

### 5.2.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本（元）	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	-	-

### 5.2.6 报告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

序号	债券代码	债券名称	债券数量 (张)	摊余成本 (元)	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

### 5.2.7 “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	0 次
报告期内偏离度的最高值	0.14%
报告期内偏离度的最低值	0.00%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.07%

#### 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。

### 5.2.8 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 5.2.9 投资组合报告附注

#### 5.2.9.1 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。

5.2.9.2 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。

#### 5.2.9.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
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

#### 5.2.9.4 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。

## § 6 开放式基金份额变动

### 6.1 交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金

单位：份

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	333,925.05
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	448,928.22
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	769,969,757.27

注：1、上表中“报告期”指2020年7月28日至2020年9月30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。

### 6.2 交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金

单位：份

项目	交银理财60天债券A	交银理财60天债券B
本报告期期初基金份额总额	3,387,367.23	6,043,210,125.77
报告期基金总申购份额	12,784.35	8,543,722.54
减：报告期基金总赎回份额	53,663.64	5,285,041,335.49
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7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。

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内未发生基金管理人运用自有资金投资本基金的情况。

## 7.2 基金管理人运用自有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期内未进行本基金的申购、赎回、红利再投等。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 交银施罗德裕惠纯债债券型证券投资基金

#### 8.1.1 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	2020/7/28-2020/9/30	544,890,864.30	18,264.37	18,264.37	544,890,864.30	70.77%
	2	2020/7/28-2020/9/30	214,170,434.58	7,178.85	7,178.85	214,170,434.58	27.82%

#### 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。

注：序号为 1 的机构，由于基金进行转型，申购份额为基金管理人发起的强制调增。

### 8.2 交银施罗德理财 60 天债券型证券投资基金

#### 8.2.1 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

		超过20%的时间 区间					
个人	1	2020/7/1-2020 /7/27	1,066 ,869. 21	2,410 .55	43.54	1,069,236. 22	0.14%
机构	1	2020/7/1-2020 /7/27	543,5 54,77 2.01	1,344 ,408. 48	26,580. 56	544,872,59 9.93	70.76%
	2	2020/7/1-2020 /7/27	213,6 45,28 0.86	528,4 22.41	10,447. 54	214,163,25 5.73	27.81%
	3	2020/7/1-2020 /7/27	1,638 ,514, 095.9 6	2,521 ,497. 61	1,641,0 35,593. 57		
	4	2020/7/1-2020 /7/27	2,159 ,711, 471.9 2	1,429 ,064. 73	2,161,1 40,536. 65		
产品特有风险							
<p>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。</p>							

注：序号为 1 的机构，申购份额为每日的红利再投份额汇总所得。

### 8.3 影响投资者决策的其他重要信息

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券型证券投资基金。有关详情请查阅本基金管理人 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》。



## §9 备查文件目录

### 9.1 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。

### 9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

### 9.3 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

