施罗德添源纯债债券型证券投资基金

2025 年中期报告

2025 年 06 月 30 日

基金管理人:施罗德基金管理（中国）有限公司

基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期:2025 年 08 月 29 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。本中期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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025年 8月25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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025年03月27日（基金合同生效日）起至06月30日止。

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 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 6
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
§3 主要财务指标和基金净值表现 6
3.1 主要会计数据和财务指标 7
3.2 基金净值表现 7
§4 管理人报告 9
4.1 基金管理人及基金经理情况 9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 11
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 12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 13
§5 托管人报告 13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 13
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 14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 14
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 14
6.1 资产负债表 14
6.2 利润表 16
6.3 净资产变动表 17
6.4 报表附注 18
§7 投资组合报告 43
7.1 期末基金资产组合情况 43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 44
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细 44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 44
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 45
7.7 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 45
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 45
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 45
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 45
7.12 投资组合报告附注 45
§8 基金份额持有人信息 46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 47

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 47
§9 开放式基金份额变动 47
§10 重大事件揭示 48
10.1 基金份额持有人大会决议 48
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 48
10.4 基金投资策略的改变 48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 48
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 48
10.8 其他重大事件 49
§11 影响投资者决策的其他重要信息 51
11.1 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 51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 51
§12 备查文件目录 51
12.1 备查文件目录 52
12.2 存放地点 52
12.3 查阅方式 52

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	施罗德添源纯债债券型证券投资基金	
基金简称	施罗德添源纯债债券	
基金主代码	023113	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025年03月27日	
基金管理人	施罗德基金管理（中国）有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	5,097,992,420.10份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	施罗德添源纯债债券A	施罗德添源纯债债券C
下属分级基金的交易代码	023113	023114
报告期末下属分级基金的份额总额	5,097,981,301.67份	11,118.43份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险并保持良好流动性的基础上，通过主动的宏观研究和债券类资产的投资，力争实现基金资产长期稳定增值。
投资策略	本基金将通过对宏观环境、货币和财政政策、利率走势、国家经济政策、资本市场资金环境、证券市场走势等因素综合分析，对当前市场的系统性风险、利率曲线、流动性及配置时机进行评估，以确定投资组合在各类固定收益类金融工具之间的配置比例与久期分布，并进行动态调整。本基金的债券投资组合策略包括久期配置策略、期限结构配置策略、类属资产配置策略、息差策略、信用策略。本基金的投资策略还包括金融衍生品投资策略。
业绩比较基准	中债-国债及政策性银行债全价（总值）指数收益率*95%+银行活期存款利率（税后）*5%
风险收益特征	本基金为债券型基金，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。

2.3 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		施罗德基金管理（中国）有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙艳	朱萍
	联系电话	4009-209-588	021-31888888
	电子邮箱	customerservice@schroders.cn	zhup02@spdb.com.cn
客户服务电话		4009-209-588	95528
传真		021-53295668	021-63602540
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道100号33楼33T52A单元	上海市中山东一路12号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心33楼33T52A单元	上海市博成路1388号浦银中心A栋
邮政编码		200120	200126
法定代表人		郭炜	张为忠

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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.schroders.cn
基金中期报告备置地点	上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心33楼33T52A单元

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	施罗德基金管理（中国）有限公司	上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心33楼33T52A单元

§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(2025年03月27日（基金合同生效日）-2025年06月30日)	
	施罗德添源纯债债券A	施罗德添源纯债债券C
本期已实现收益	20,362,311.79	43.40
本期利润	21,388,063.57	45.40
加权平均基金份额本期利润	0.0039	0.0036
本期加权平均净值利润率	0.39%	0.36%
本期基金份额净值增长率	0.39%	0.36%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025年06月30日)	
期末可供分配利润	18,989,236.95	38.46
期末可供分配基金份额利润	0.0037	0.0035
期末基金资产净值	5,117,814,731.35	11,158.75
期末基金份额净值	1.0039	1.0036
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	0.39%	0.36%

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购、申购或交易基金的各项费用，计入费用后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)扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。表中的“期末”均指报告期最后一日，即 6月30日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

4、本基金基金合同生效日为2025年3月27日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间未满六个月。

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

施罗德添源纯债债券A

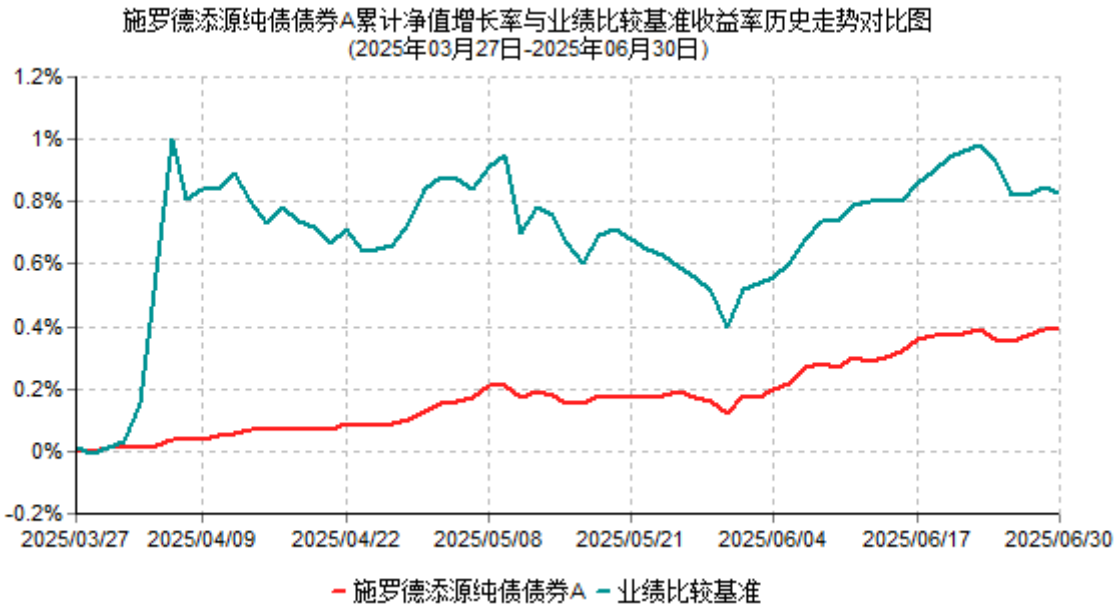
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.21%	0.02%	0.30%	0.04%	-0.09%	-0.02%
过去三个月	0.38%	0.02%	0.82%	0.10%	-0.44%	-0.08%
自基金合同生效起至今	0.39%	0.02%	0.83%	0.10%	-0.44%	-0.08%

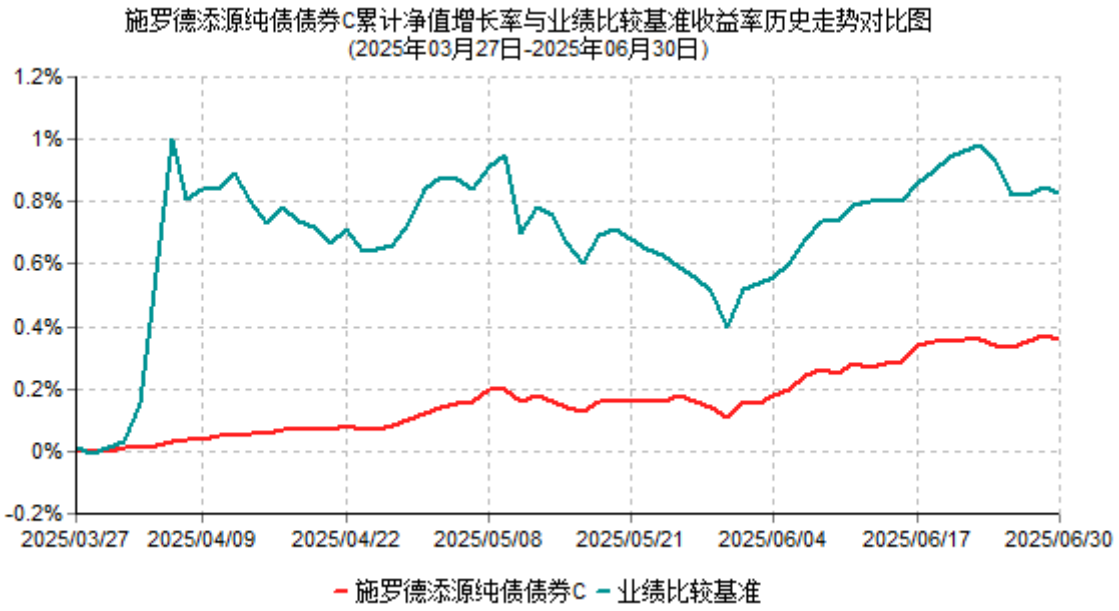
施罗德添源纯债债券C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.20%	0.02%	0.30%	0.04%	-0.10%	-0.02%
过去三个月	0.36%	0.02%	0.82%	0.10%	-0.46%	-0.08%
自基金合同生效起至今	0.36%	0.02%	0.83%	0.10%	-0.47%	-0.08%

注：本基金的业绩比较基准为中债-国债及政策性银行债全价（总值）指数收益率*95%+银行活期存款利率（税后）*5%。本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

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





注：本基金基金合同生效日为2025年3月27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2025年6月30日，本基金尚处于建仓期。

§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

施罗德基金管理（中国）有限公司成立于2022年1月29日，注册资本人民币5.03亿元。公司于2023年6月7日取得中国证券监督管理委员会核发的《经营证券期货业务许可证》并正式展业。截至报告期末，公司旗下发行并管理了4只公开募集证券投资基金：施罗德恒享债券型证券投资基金、施罗德中国动力股票型证券投资基金、施罗德添益债券型证券投资基金、施罗德添源纯债债券型证券投资基金。

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		
单坤	固定收益投资总监、本基金基金经理、施罗德恒享债券型证券投资基金及施罗德添益债券型证券投资基金基金经理	2025-03-27	-	18	荷兰格罗宁根大学财务管理学硕士。于2018年加入施罗德集团，现任施罗德基金管理（中国）有限公司固定收益投资总监、基金经理。2018年至2023年曾任施罗德投资管理（上海）有限公司固定收益基金经理，2011年至2018年曾任法国巴黎银行（中国）有限公司环球市场部首席中国策略分析师，2006年至2011年曾任荷兰荷宝投资管理集团固定收益部分析师。
王文龙	本基金基金经理、施罗德添益债券型证券投资基金基金经理	2025-05-23	-	7	伦敦大学皇后玛丽学院材料与商务硕士研究生。于2024年加入施罗德基金管理（中国）有限公司，现任固定收益基金经理。2021年至2024年曾任中航证券有限公司信评岗及投资经理，2018年至2021年曾任中融国

					际信托有限公司标准资产管理事业部董事，2017年至2018年曾任国联基金管理有限公司（原中融基金管理有限公司）固收投资部基金经理，2014年至2017年曾任英大基金管理有限公司信用研究员及投资经理，2011年至2014年曾任中诚信国际信用评级有限责任公司项目经理、分析师。

注：1、基金经理的任职日期及离任日期即本基金管理人对外披露的任免日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

截至本报告期末，本基金的基金经理不存在同时管理私募资产管理计划的情况。

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，本基金管理人遵循《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，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 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据相关法规要求，结合实际情况，制定了《公平交易管理制度》，对研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节规范了各项管理要求，通过系统和人工等方式实行事前控制、事中监控、事后评估及反馈的机制对各业务环节落实公平交易控制。报告期内，本基金管理人公平交易制度和控制方法总体执行情况良好，未发现不公平交易和利益输送行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现异常交易行为。公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况，未发现不公平交易和利益输送行为。

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

2025年上半年，国内经济在持续稳步复苏的同时，也面临一系列的问题和压力。产业方面，转型升级在持续推进，以芯片、AI为主的高新技术行业逐步崭露头角，并打破西方国家的技术封锁；以新能源为核心的产业集群成长为全球领先水平，其中新能源汽车也已经成功打开欧美等国的市场，并成为拉动出口的中坚力量。地产方面，全国需求未见明显好转，房屋价格依然处于下行通道，但长三角区域的部分一、二线城市新房价格和去化速度，在改善性需求的释放支持下出现阶段性好转，同时中央各部委也出台了多项政策以缓解地产的进一步下滑，并取得了一定成效。基建方面，在能源、水利、仓储和物流等多个方面的项目建设显著增加。社零消费方面，“以旧换新”补贴政策有效的拉动了居民在电器、通讯器材等方面的消费，上半年全国家用电器和通讯器材领域的消费额分别同比增长30.7%和24.1%，成为社消的重要增长点，同时国内汽车消费增长也起到了稳定社消的重要支撑作用。进出口方面，尽管特朗普二次上台后推出了一系列的关税政策，引发了全球的贸易不稳定及关税成本的上升，但我国出口的区域结构较好，在中美关税冲突中，仍取得了很好的成果，上半年全国实现出口13万亿元，同比增长7.2%，实现贸易顺差4.21万亿元，同比扩大49.3%，其中以集成电路和汽车为主的机电类产品占总量的60%，光伏组件和锂电池储能产品在全球市场中的份额分别超过95%和92%。

回顾上半年的金融市场，央行通过多项工具保持市场流动性充裕，同时适时实施降准降息，并有效防范人民币贬值风险和资金空转。财政部门则加快专项债、超长国债、置换债、注资债等债券的发行，有效提升银行体系的资本实力，降低银行体系整体风险，同时也进一步缓解了地方城投平台的信用风险。在多重因素的综合影响下，国内债券市场总体呈现前升后降的走势。春节假期结束后，在超长债券供给提前等因素的影响下，市场资金面趋紧，资金价格上行，高于10年期国债收益率水平，导致杠杆成本与票息收益倒挂，推动无风险收益率由年初的1.6%反弹至约1.9%的水平，上行幅度达30BP。央行积极干预，通过提前公告MLF续做等进行市场预期引导。4月初在特朗普关税政策影响下，国债收益率快速下行约20BP，为今年以来最大幅度的下行。4月中旬以来，国债收益率整体处于窄幅震荡走势。

本基金于3月底成立，并于二季度开始建仓，通过分析宏观基本面、政策面和国际环境的变化等综合因素，研判国债利率走势，同时叠加杠杆策略和交易策略进行利率曲线的配置与投资交易。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，施罗德添源纯债债券A基金份额净值为1.0039元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.39%，同期业绩比较基准收益率为0.83%；截至报告期末，施

罗德添源纯债债券C基金份额净值为1.0036元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.36%，同期业绩比较基准收益率为0.83%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2025年上半年，全国经济稳中向好，上半年全国实现GDP增速5.3%；预计下半年央行仍将维持较为宽裕的市场流动性，同时不排除采取降准降息、重启国债买卖等政策工具；同时财政部将部分政府债券的发行前置，以较早实现资金到位以及实物工作量。总体来看，债券市场牛市的方向仍未改变，但随着经济基本面的持续复苏，在股债跷跷板效应的影响下，债券收益率或将在低位持续震荡，波动或将有所放大。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，谨慎合理地制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，对基金所持有的投资品种进行估值，并保持估值政策和程序的一贯性。

本基金管理人建立了负责估值工作决策和执行的专门机构即估值委员会。估值委员会由产品、研究、风险管理、基金运营等部门中具有丰富从业经验和专业胜任能力的员工担任，且互相不存在直接的重大利益冲突。基金经理可参与估值委员会对于估值方法的讨论，但无最终决策权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理。

基金日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由管理人完成估值后，经托管人复核无误后由管理人对外公布。

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。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对施罗德添源纯债债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，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

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对施罗德添源纯债债券型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由施罗德基金管理（中国）有限公司编制、本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§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：施罗德添源纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2025年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025年06月30日
资 产：		
货币资金	6.4.7.1	100,313,068.11
结算备付金		2,593,710.73
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	4,471,650,560.51
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		4,471,650,560.51
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-

买入返售金融资产	6.4.7.4	545,073,939.47
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	-
资产总计		5,119,631,278.82
负债和净资产	**附注号**	本期末 2025年06月30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		-
应付清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		1,261,182.47
应付托管费		420,394.15
应付销售服务费		0.90
应付投资顾问费		-
应交税费		27,299.10
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.6	96,512.10
负债合计		1,805,388.72
净资产：		
实收基金	6.4.7.7	5,097,992,420.10
未分配利润	6.4.7.8	19,833,470.00
净资产合计		5,117,825,890.10
负债和净资产总计		5,119,631,278.82

注：1、报告截止日2025年06月30日，基金份额总额为5,097,992,420.10份，其中下属A类基金份额净值为1.0039元，份额总额为5,097,981,301.67份；下属C类基金份额净值为1.0036元，份额总额为11,118.43份。

2、本基金基金合同生效日为2025年3月27日，无上年度可比期间数据。

6.2 利润表

会计主体：施罗德添源纯债债券型证券投资基金

本报告期：2025年03月27日（基金合同生效日）至2025年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025年03月27日（基金合同生效日）至2025年06月30日
一、营业总收入		27,225,460.04
1.利息收入		10,918,662.69
其中：存款利息收入	6.4.7.9	417,028.40
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		10,501,634.29
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		15,281,043.57
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-
基金投资收益	6.4.7.11	-
债券投资收益	6.4.7.12	15,281,043.57
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	-
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,025,753.78
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	-

减：二、营业总支出		5,837,351.07
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	4,306,770.44
2.托管费	6.4.10.2.2	1,435,590.12
3.销售服务费		3.34
4.投资顾问费		-
5.利息支出		1,067.68
其中：卖出回购金融资产支出		1,067.68
6.信用减值损失	6.4.7.19	-
7.税金及附加		37,805.89
8.其他费用	6.4.7.20	56,113.60
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		21,388,108.97
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		21,388,108.97
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		21,388,108.97

注：本基金基金合同生效日为2025年3月27日，无上年度可比期间数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：施罗德添源纯债债券型证券投资基金

本报告期：2025年03月27日（基金合同生效日）至2025年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2025年03月27日（基金合同生效日）至2025年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	5,999,188,092.77	-	5,999,188,092.77
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-901,195,672.67	19,833,470.00	-881,362,202.67
（一）综合收益总	-	21,388,108.97	21,388,108.97

额			
（二）本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-901,195,672.67	-1,554,638.97	-902,750,311.64
其中：1.基金申购款	298,833,549.16	1,165,450.84	299,999,000.00
2.基金赎回款	-1,200,029,221.83	-2,720,089.81	-1,202,749,311.64
（三）本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	5,097,992,420.10	19,833,470.00	5,117,825,890.10

注：本基金基金合同生效日为2025年3月27日，无上年度可比期间数据。

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:

张兰	朱鸣	朱鸣
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

施罗德添源纯债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”)《关于准予施罗德添源纯债债券型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2024]1836号)准予注册，由施罗德基金管理（中国）有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》等相关法规和《施罗德添源纯债债券型证券投资基金基金合同》进行募集，基金合同于2025年3月27日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为5,999,188,092.77份基金份额。本基金的基金管理人及注册登记机构为施罗德基金管理（中国）有限公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《施罗德添源纯债债券型证券投资基金基金合同》和《施罗德添源纯债债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金

的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行、上市的债券（包括国债、央行票据、地方政府债、政策性金融债、商业银行金融债）、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款、通知存款及其他银行存款等）、现金、同业存单、国债期货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）。本基金不投资于股票，也不投资于可转换债券和可交换债券。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

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%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为：中债-国债及政策性银行债全价（总值）指数收益率*95%+银行活期存款利率（税后）*5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《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“基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注6.4.2中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金2025年6月30日的财务状况、自2025年3月27日（基金合同生效日）至2025年6月30日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历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自2025年3月27日（基金合同生效日）至2025年6月30日止期间。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1、金融资产的分类

本基金的金融工具包括债券投资和买入返售金融资产等。

本基金通常根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产分为不同类别：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其他综合收益的金融资产及以摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；

- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产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。本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

2、金融负债的分类

本基金将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及以摊余成本计量的金融负债。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无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。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

1、金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

2、后续计量

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息和股利收入）计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

- 以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失（包括利息费用）计入当期损益。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

3、金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

- 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；

- 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。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；

- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

4、金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限（包括考虑续约选择权）。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来12个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后12个月内（若金融工具的预计存续期少于12个月，则为预计存续期）可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或

- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定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。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，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，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，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。采用估值技术确定公允价值时，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。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

6.4.4.7 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份额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。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

1、利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

2、投资收益

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

3、公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、衍生工具、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失，不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资在持有期间按票面利率计算的利息。

6.4.4.10 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。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。基金份额持有人可对其持有的本基金 A 类基金份额和 C 类

基金份额分别选择不同的分红方式。如投资者在同一销售机构选择的分红方式不同，基金登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式为准；

3、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，而C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同；本基金同一类别每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”），在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证监会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值。

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

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号文《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号文《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号文《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号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税 [2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a)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，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。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。

b)对证券投资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。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c)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。

d)对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025年06月30日
活期存款	100,313,068.11
等于：本金	100,312,377.99
加：应计利息	690.12
减：坏账准备	-
定期存款	-

等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	100,313,068.11

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025年06月30日			
		成本	应计利息	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	4,442,254,246.22	28,370,560.51	4,471,650,560.51	1,025,753.78
	合计	4,442,254,246.22	28,370,560.51	4,471,650,560.51	1,025,753.78
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		4,442,254,246.22	28,370,560.51	4,471,650,560.51	1,025,753.78

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 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 2025年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	545,073,939.47	-
银行间市场	-	-
合计	545,073,939.47	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	40,798.50
其中：交易所市场	-
银行间市场	40,798.50
应付利息	-
预提费用-审计费	15,428.16
预提费用-信息披露费	34,285.44
预提费用-账户维护费	6,000.00
合计	96,512.10

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 施罗德添源纯债债券A

金额单位：人民币元

项目 (施罗德添源纯债债券A)	本期 2025年03月27日（基金合同生效日）至2025年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	5,999,173,794.18	5,999,173,794.18
本期申购	298,833,549.16	298,833,549.16
本期赎回（以“-”号填列）	-1,200,026,041.67	-1,200,026,041.67
本期末	5,097,981,301.67	5,097,981,301.67

6.4.7.7.2 施罗德添源纯债债券C

金额单位：人民币元

项目 (施罗德添源纯债债券C)	本期 2025年03月27日（基金合同生效日）至2025年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	14,298.59	14,298.59
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-3,180.16	-3,180.16
本期末	11,118.43	11,118.43

注：1、申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

2、本基金基金合同于2025年3月27日生效。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币5,999,146,416.68元，在募集期间产生的存款利息为人民币41,676.09元，以上实收基金（本息）合计为人民币5,999,188,092.77元，折合5,999,188,092.77份基金份额，其中A类基金份额5,999,173,794.18份，C类基金份额14,298.59份。

3、根据《施罗德添源纯债债券型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告》，本基金自2025年4月28日起开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务。

4、根据《施罗德添源纯债债券型证券投资基金暂停接受个人投资者申购、转换转入和定期定额投资业务的公告》，本基金自2025年4月30日起暂停接受个人投资者申购、转换转入和定期定额投资业务。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 施罗德添源纯债债券A

单位：人民币元

项目 (施罗德添源纯债债券A)	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	20,362,311.79	1,025,751.78	21,388,063.57
本期基金份额交易产生的变动数	-1,373,074.84	-181,559.05	-1,554,633.89
其中：基金申购款	1,066,671.70	98,779.14	1,165,450.84
基金赎回款	-2,439,746.54	-280,338.19	-2,720,084.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	18,989,236.95	844,192.73	19,833,429.68

6.4.7.8.2 施罗德添源纯债债券C

单位：人民币元

项目 (施罗德添源纯债债券C)	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	43.40	2.00	45.40
本期基金份额交易产生的变动数	-4.94	-0.14	-5.08
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-4.94	-0.14	-5.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	38.46	1.86	40.32

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期

	2025年03月27日（基金合同生效日）至2025年06月30日
活期存款利息收入	214,070.57
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	182,957.25
其他	20,000.58
合计	417,028.40

注：“其他”为基金申购款利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益

本基金本报告期内无股票投资收益。

6.4.7.11 基金投资收益

本基金本报告期内无基金投资收益。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年03月27日（基金合同生效日）至2025年06月30日
债券投资收益——利息收入	15,035,661.56
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	245,382.01
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	15,281,043.57

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年03月27日（基金合同生效日）至2025年06月30日
卖出债券（债转股	1,502,622,144.88

及债券到期兑付）成交总额	
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,484,978,469.63
减：应计利息总额	17,356,906.48
减：交易费用	41,386.76
买卖债券差价收入	245,382.01

6.4.7.12.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.12.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益-申购差价收入。

6.4.7.13 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。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年03月27日（基金合同生效日）至2025年06月30日
1.交易性金融资产	1,025,753.78
——股票投资	-
——债券投资	1,025,753.78

——资产支持证券投资	-
——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	1,025,753.78

6.4.7.18 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

6.4.7.19 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年03月27日（基金合同生效日）至2025年06月30日
审计费用	15,428.16
信息披露费	34,285.44
证券出借违约金	-
账户维护费	6,000.00
开户费	400.00
合计	56,113.60

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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

无。

6.4.9.2 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
上海浦东发展银行股份有限公司	基金托管人
施罗德基金管理（中国）有限公司	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 基金交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行基金交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年03月27日（基金合同生效日）至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,306,770.44
其中：应支付销售机构的客户维护费	837,642.66
应支付基金管理人的净管理费	3,469,127.78

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.30%年费率每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。计算方法如下：日管理费＝前一日基金资产净值×0.30%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年03月27日（基金合同生效日）至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,435,590.12

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%年费率每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。计算方法如下：日托管费＝前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

报告期内，本基金未发生应支付关联方的销售服务费。

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费，本基金C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.10%年费率每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。计算方法如下：日基金销售服务费＝前一日C类份额基金资产净值×0.10%÷当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

报告期内，本基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.4.2 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

施罗德添源纯债债券A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2025年06月30日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
上海浦东发展银行股份有限公司	2,998,999,000.00	58.83%

6.4.10.5 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 2025年03月27日（基金合同生效日）至2025年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
上海浦东发展银行股份有限公司	100,313,068.11	214,070.57

注：本基金的银行存款由基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司保管，按银行同业利率及约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 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。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2025年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末，从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末，从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为债券型基金，其预期风险和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。本基金在日常投资管理中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。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，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的多层级立体风险管理体系。董事会及其下设合规与风险管理委员会、管理层及其下设风险控制委员会、督察长、风险管理部以及各个业务部门、各岗位在各自职责范围内依法履行职责，形成高效、制衡的监督约束机制，以确保风险管理的贯彻执行。

6.4.13.2 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。

本基金在交易所进行的交易均与中央对手方完成证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小；在进行银行存款、银行间同业市场交易前对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

本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。

6.4.13.2.1 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 2025年06月30日
A-1	-

A-1以下	-
未评级	787,434,821.91
合计	787,434,821.91

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级债券一般为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票，以及未有第三方评级机构给予短期债项信用评级的债券。

3、债券投资以全价列示。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 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 2025年06月30日
AAA	-
AAA以下	-
未评级	3,684,215,738.60
合计	3,684,215,738.60

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票，以及未有第三方评级机构给予债项评级的债券。

3、债券投资以全价列示。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。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，基金管理人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。基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定对巨额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。

6.4.13.3.1 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》等有关法规的要求建立开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性状况，制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

本基金采用分散投资、控制流动性受限资产比例等方式防范流动性风险。资产端通过流动性热力图进行监控与预警，负债端对申购赎回情况进行监控和预测，加强持有人结构管理，并结合流动性压力测试，建立全覆盖、多层次的流动性管理体系。

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发行的证券不得超过该证券的10%（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上述比例限制）。

本基金本报告期内未发生重大流动性风险。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2025年06月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	100,313,068.11	-	-	-	100,313,068.11
结算备付金	2,593,710.73	-	-	-	2,593,710.73
交易性金融资产	787,434,821.91	3,092,135,312.34	592,080,426.26	-	4,471,650,560.51
买入返售金融资产	545,073,939.47	-	-	-	545,073,939.47
资产总计	1,435,415,540.22	3,092,135,312.34	592,080,426.26	-	5,119,631,278.82
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	1,261,182.47	1,261,182.47
应付托管费	-	-	-	420,394.15	420,394.15
应付销售服务费	-	-	-	0.90	0.90
应交税费	-	-	-	27,299.10	27,299.10
其他负	-	-	-	96,512.10	96,512.10

债					
负债总计	-	-	-	1,805,388.72	1,805,388.72
利率敏感度缺口	1,435,415,540.22	3,092,135,312.34	592,080,426.26	-1,805,388.72	5,117,825,890.10

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 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：人民币元）
		本期末 2025年06月30日
	市场利率上升25个基点	-32,164,407.47
	市场利率下降25个基点	32,614,658.03

注：上表反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对净资产产生的影响。

6.4.13.4.2 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，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 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证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的投资组合比例为：投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025年06月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产－股票投资	-	-
交易性金融资产－基金投资	-	-
交易性金融资产－债券投资	4,471,650,560.51	87.37
交易性金融资产－贵金属投资	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-
其他	-	-
合计	4,471,650,560.51	87.37

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于2025年6月30日，基金成立尚未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025年06月30日

第一层次	-
第二层次	4,471,650,560.51
第三层次	-
合计	4,471,650,560.51

6.4.14.2.2 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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2025年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截止资产负债表日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,471,650,560.51	87.34
	其中：债券	4,471,650,560.51	87.34
	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	545,073,939.47	10.65
	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	102,906,778.84	2.01
8	其他各项资产	-	-
9	合计	5,119,631,278.82	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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。

7.2.2 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。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

本基金本报告期内未持有股票。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	1,519,280,338.60	29.69
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,952,370,221.91	57.69
	其中：政策性金融债	2,952,370,221.91	57.69
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	4,471,650,560.51	87.37

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	230203	23国开03	4,000,000	416,595,945.21	8.14
2	230208	23国开08	4,000,000	411,781,808.22	8.05
3	250206	25国开06	3,800,000	381,632,958.90	7.46
4	240024	24附息国债24	3,300,000	330,478,545.21	6.46
5	250005	25附息国债05	2,900,000	291,828,589.04	5.70

7.7 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。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行在报告编制前一年内受到国家金融监督管理总局北京监管局的处罚。本基金对于上述证券的投资决策程序符合相关法规及公司制度的要求。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 本基金于本报告期末未持有股票投资。

7.12.3 期末其他各项资产构成

本基金本报告期末未持有其他资产。

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
施罗德添源纯债债券A	271	18,811,739.12	5,097,851,882.49	100.00%	129,419.18	0.00%
施罗德添源纯债债券C	86	129.28	0.00	0.00%	11,118.43	100.00%
合计	357	14,280,090.81	5,097,851,882.49	100.00%	140,537.61	0.00%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	施罗德添源纯债债券A	32,721.96	0.0006%
	施罗德添源纯债债券C	2,760.12	24.8247%
	合计	35,482.08	0.0007%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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	施罗德添源纯债债券A	10~50
	施罗德添源纯债债券C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	施罗德添源纯债债券A	0
	施罗德添源纯债债券C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	施罗德添源纯债债券A	施罗德添源纯债债券C
基金合同生效日(2025年03月27日)基金份额总额	5,999,173,794.18	14,298.59
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	298,833,549.16	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,200,026,041.67	3,180.16
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	5,097,981,301.67	11,118.43

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

（1）本报告期内基金管理人无重大人事变动。

（2）本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日（2025年3月27日）起聘请毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，未发生基金托管人的托管业务部门及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	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	佣金	占当期佣金总量的	

			额的比例		比例	
中金公司	2	-	-	153,856.07	100.00%	-

注：1、本基金于报告期内成立，并新增中国国际金融股份有限公司交易单元2个。

2、此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、债券、债券回购、权证、基金等交易（如有）而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

3、本基金采用券商结算交易模式，根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》中第六条规定，可豁免单个券商交易佣金的比例限制。

4、本基金管理人选择财务状况良好、经营行为规范、合规风控能力和交易服务能力较强、同时具有良好诚信记录的券商作为本基金的证券经纪商。

5、本基金管理人根据上述标准制定交易服务商评价表，由各部门对相关交易服务商进行评价并提交公司相关投资决策委员会审议。经审批通过后，公司与相关交易服务商签署服务协议，并由其提供相关服务。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
中金公司	836,911,705.81	100.00%	43,755,962,000.00	100.00%	-	-	-	-

10.8 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	施罗德添源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	中国证监会规定媒介	2025-03-18
2	施罗德添源纯债债券型证券投资基金基金份额发售公告	中国证监会规定媒介	2025-03-18
3	施罗德添源纯债债券型证券	中国证监会规定媒介	2025-03-18

	投资基金基金合同		
4	施罗德添源纯债债券型证券投资基金托管协议	中国证监会规定媒介	2025-03-18
5	施罗德添源纯债债券型证券投资基金招募说明书	中国证监会规定媒介	2025-03-18
6	施罗德添源纯债债券型证券投资基金（施罗德添源纯债债券A）基金产品资料概要	中国证监会规定媒介	2025-03-18
7	施罗德添源纯债债券型证券投资基金（施罗德添源纯债债券C）基金产品资料概要	中国证监会规定媒介	2025-03-18
8	施罗德添源纯债债券型证券投资基金提前结束募集的公告	中国证监会规定媒介	2025-03-26
9	施罗德添源纯债债券型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会规定媒介	2025-03-28
10	施罗德基金管理（中国）有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024年度）	中国证监会规定媒介	2025-03-31
11	施罗德添源纯债债券型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告	中国证监会规定媒介	2025-04-24
12	施罗德添源纯债债券型证券投资基金暂停接受个人投资者申购、转换转入和定期定额投资业务的公告	中国证监会规定媒介	2025-04-30
13	施罗德添源纯债债券型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会规定媒介	2025-05-23
14	施罗德添源纯债债券型证券投资基金招募说明书更新	中国证监会规定媒介	2025-05-23
15	施罗德添源纯债债券型证券	中国证监会规定媒介	2025-05-23

	投资基金（施罗德添源纯债债券A）基金产品资料概要更新		
16	施罗德添源纯债债券型证券投资基金（施罗德添源纯债债券C）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2025-05-23

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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	20250327 - 20250630	2,998,999,000.00	-	-	2,998,999,000.00	58.83%
	2	20250327 - 20250630	1,499,999,000.00	-	200,000,000.00	1,299,999,000.00	25.50%
产品特有风险							
本基金在本报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额20%的情况，存在可能因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、巨额赎回风险、净值波动风险等，并可能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。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人于2025年4月30日发布《施罗德添源纯债债券型证券投资基金暂停接受个人投资者申购、转换转入和定期定额投资业务的公告》，自2025年4月30日起，本基金暂停接受个人投资者申购、转换转入和定期定额投资业务申请。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中国证监会准予施罗德添源纯债债券型证券投资基金注册的文件

2、《施罗德添源纯债债券型证券投资基金基金合同》

3、《施罗德添源纯债债券型证券投资基金托管协议》

4、《施罗德添源纯债债券型证券投资基金招募说明书》

5、法律意见书

6、基金管理人业务资格批件和营业执照

7、基金托管人业务资格批件和营业执照

8、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人、基金托管人的住所。其中，基金管理人的住所为中国（上海）自由贸易试验区世纪大道100号33楼33T52A单元。

12.3 查阅方式

投资人可以登录基金管理人的网站www.schroders.cn查阅，或在营业时间内至基金管理人上述地址免费查阅。

施罗德基金管理（中国）有限公司

二〇二五年八月二十九日