

施罗德添源纯债债券型证券投资基金 运作终止报告

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

报告出具日: 2026年07月17日

报告公告日: 2026年07月21日

一、重要提示

施罗德添源纯债债券型证券投资基金（以下或简称“本基金”）的募集申请于2024年12月6日获中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2024]1836号文准予注册。本基金基金合同于2025年3月27日正式生效。

本基金经中国证监会2026年5月21日证监许可[2026]1242号文准予变更注册为路博迈添源纯债债券型证券投资基金，基金管理人由施罗德基金管理（中国）有限公司（以下或简称“施罗德基金公司”）变更为路博迈基金管理（中国）有限公司（以下或简称“路博迈基金公司”）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规和《施罗德添源纯债债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的基金管理人经与本基金的基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司协商一致，以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，审议通过了《关于施罗德添源纯债债券型证券投资基金变更基金管理人并变更注册为路博迈添源纯债债券型证券投资基金有关事项的议案》。根据施罗德基金公司于2026年7月6日发布的《施罗德基金管理（中国）有限公司关于施罗德添源纯债债券型证券投资基金变更为路博迈添源纯债债券型证券投资基金的公告》，自2026年7月6日当日，本基金的基金管理人正式变更为路博迈基金公司。自该日起，《路博迈添源纯债债券型证券投资基金基金合同》生效，《施罗德添源纯债债券型证券投资基金基金合同》失效。

本基金最后运作日为2026年7月5日。本报告旨在反映本基金最后运作日的财务状况，并由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）对本报告进行审计，上海市通力律师事务所对本报告出具法律意见。

二、基金产品概况

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
最后运作日（2026年7月5日）基	497,404,516.37 份

基金份额总额		
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。	
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	
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
最后运作日（2026年7月5日）下属分级基金的份额总额	497,400,438.22 份	4,078.15 份

三、基金运作及本次基金管理人变更情况概述

本基金经中国证监会《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登记机构为施罗德基金公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

本基金经中国证监会证监许可[2026]1242号文准予变更注册为路博迈添源纯债债券型证券投资基金，基金管理人由施罗德基金公司变更为路博迈基金公司。施罗德基金公司于2026年5月22日发布《施罗德基金管理（中国）有限公司关于以通讯方式召开施罗德添源纯债债券型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》，组织召开本次基金份额持有人大会，审议《关于施罗德添源纯债债券型证券投资基金变更基金管理人并变更注册为路博迈添源纯债债券型证券投资基金有关事项的议案》。施罗德基金公司于2026年6月24日发布《施罗德基金管理（中国）有限公司关于施罗德添源纯债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》，本次会议议案获得基金份额持有人大会审议通过。

施罗德基金公司根据本次基金份额持有人大会决议，执行本基金的正式变更。施罗德基金公司于2026年7月6日发布《施罗德基金管理（中国）有限公司关于施罗德添源纯债债券型证券投资基金变更为路博迈添源纯债债券型证券投资基金的公告》，路博迈基金公司于同日发布《路博迈基金管理（中国）有限公司关于施罗德添源纯债债券型证券投资基金变更为路博迈添源纯债债券型证券投资基金的公告》。自2026年7月6日当日，本基金的基金管理人正式变更为路博迈基金公司。自该日起，《路博迈添源纯债债券型证券投资基金基金合同》生效，《施罗德添源纯债债券型证券投资基金基金合同》失效。

路博迈基金公司于2026年7月18日发布《路博迈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并参与费率优惠活动的公告》及《路博迈添源纯债债券型证券投资基金暂停个人投资者申购、转换转入及定期定额投资业务的公告》，自2026年7月20日开放办理路博迈添源纯债债券型证券投资基金的申购、赎回、转换和定期定额投资业务，但暂不向个人投资者开放申购、转换转入及定期定额投资业务。

路博迈添源纯债债券型证券投资基金的后续运作情况，以路博迈基金公司的相关公告为准。

四、财务会计报告

1、资产负债表（已经审计）

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：2026年7月5日（最后运作日）

单位：人民币元

资 产	2026年7月5日（最后运作日）
资 产：	
货币资金	85,973,350.70
结算备付金	-
存出保证金	-
交易性金融资产	419,483,504.10
其中：股票投资	-
基金投资	-
债券投资	419,483,504.10
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
其他投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
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	-
资产总计	505,456,854.80
负债和净资产	2026年7月5日（最后运作日）
负 债：	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
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	20,765.39
应付托管费	6,921.80
应付销售服务费	0.05
应付投资顾问费	-
应交税费	4,718.32
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	94,697.26
负债合计	127,102.82
净资产：	
实收基金	497,404,516.37
未分配利润	7,925,235.61
净资产合计	505,329,751.98
负债和净资产总计	505,456,854.80

注：截至本基金最后运作日2026年7月5日，基金份额总额为497,404,516.37 份，其中下属A类基金份额净值为1.0159 元，份额总额为497,400,438.22 份；下属C类基金份额净值为1.0144 元，份额总额为 4,078.15 份。

五、备查文件目录

1、备查文件目录

- (1) 施罗德添源纯债债券型证券投资基金基金财务报表及审计报告
- (2) 关于施罗德添源纯债债券型证券投资基金终止运作的法律意见

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。

3、查阅方式

投资人可以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

2026年07月21日