

1.1 重要提示
基金管理人、基金托管人、基金销售机构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。本报告业经会计师事务所审计，审计报告已经二〇一五年十二月三十一日独立审计签字有效，并出具标准无保留意见。
基金管理人中国银河投资管理有限公司（以下简称“中国银河投资”）根据基金合同有关规定，于2016年3月3日发布了本报告中的财务数据、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，保证复核报告不存在虚假记载、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财产，但不保证基金本金一定盈利。
基金的过往业绩并不预示其未来表现。投资者有投资权，投资者作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同。
本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。
本报告自2016年1月1日起至12月31日止。

[illegible][illegible][illegible]

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)对交银施罗德理财21天债券型证券投资基金2014年12月31日的资产负债表、2014年度的利润表、所有者权益基金净值变动表及财务报表附注进行了审核,并出具了无保留意见的审计报告(普华永道中天审字(2015)第1410号)。投资者可通过本基金年度报告正文查阅该审计报告全文。 5.7 年度财务报表 7.1 资产负债表 会计主体:交银施罗德理财21天债券型证券投资基金 报告截止日:2014年12月31日	单位:人民币元 <table border="1"> <thead> <tr> <th>资产</th><th>附注</th><th>本期末 2014年12月31日</th><th>上年末 2013年12月31日</th></tr> </thead> <tbody> <tr> <td>货币:</td><td></td><td></td><td></td></tr> <tr> <td>银行存款</td><td>7.4.7.1</td><td>415,093,248.94</td><td>82,544,514.47</td></tr> <tr> <td>结算备付金</td><td></td><td>-</td><td>-</td></tr> <tr> <td>存出保证金</td><td></td><td>-</td><td>-</td></tr> <tr> <td>交易性金融资产</td><td>7.4.7.2</td><td>941,859,931.35</td><td>9,997,027.85</td></tr> <tr> <td>其中:股票投资</td><td></td><td>-</td><td>-</td></tr> <tr> <td>债券投资</td><td></td><td>-</td><td>-</td></tr> <tr> <td>其他投资</td><td></td><td>-</td><td>-</td></tr> <tr> <td>应收利息</td><td>7.4.7.3</td><td>941,859,931.35</td><td>9,997,027.85</td></tr> <tr> <td>资产支持证券</td><td></td><td>-</td><td>-</td></tr> <tr> <td>贵金属投资</td><td></td><td>-</td><td>-</td></tr> <tr> <td>其他金融资产</td><td>7.4.7.3</td><td>-</td><td>-</td></tr> <tr> <td>其中:基金投资</td><td></td><td>-</td><td>-</td></tr> <tr> <td>其他投资</td><td>7.4.7.4</td><td>-</td><td>10,000,000.00</td></tr> <tr> <td>应收证券清算款</td><td></td><td>-</td><td>4,008,166.87</td></tr> <tr> <td>应收利息</td><td>7.4.7.5</td><td>24,540,558.97</td><td>714,386.71</td></tr> <tr> <td>应收股利</td><td></td><td>-</td><td>-</td></tr> <tr> <td>应收申购款</td><td></td><td>-</td><td>33,555.00</td></tr> </tbody> </table>	资产	附注	本期末 2014年12月31日	上年末 2013年12月31日	货币:				银行存款	7.4.7.1	415,093,248.94	82,544,514.47	结算备付金		-	-	存出保证金		-	-	交易性金融资产	7.4.7.2	941,859,931.35	9,997,027.85	其中:股票投资		-	-	债券投资		-	-	其他投资		-	-	应收利息	7.4.7.3	941,859,931.35	9,997,027.85	资产支持证券		-	-	贵金属投资		-	-	其他金融资产	7.4.7.3	-	-	其中:基金投资		-	-	其他投资	7.4.7.4	-	10,000,000.00	应收证券清算款		-	4,008,166.87	应收利息	7.4.7.5	24,540,558.97	714,386.71	应收股利		-	-	应收申购款		-	33,555.00	基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司 注:下述关联交易均在正常业务范围內按一般商业条款订立。 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易 本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。 7.4.8.2 关联方报酬 7.4.8.2.1 基金管理费 单位:人民币元 <table border="1"> <thead> <tr> <th>项目</th><th>本期 2014年1月1日至2014年12月31日</th><th>上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日</th></tr> </thead> <tbody> <tr> <td>报告期内基金支付给的管理费</td><td>1,974,267.34</td><td>2,338,114.39</td></tr> <tr> <td>其中:支付销售机构的客户维护费</td><td>56,742.31</td><td>493,707.60</td></tr> </tbody> </table> 注:1. 本基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值0.27%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×0.27%÷当年天数。 7.4.8.2.2 基金托管费 单位:人民币元 <table border="1"> <thead> <tr> <th>项目</th><th>本期 2014年1月1日至2014年12月31日</th><th>上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日</th></tr> </thead> <tbody> <tr> <td>报告期内基金支付给托管费</td><td>584,568.12</td><td>692,274.46</td></tr> </tbody> </table> 注:1. 本基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.06%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×0.06%÷当年天数。 7.4.8.2.3 销售服务费	项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日	报告期内基金支付给的管理费	1,974,267.34	2,338,114.39	其中:支付销售机构的客户维护费	56,742.31	493,707.60	项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日	报告期内基金支付给托管费	584,568.12	692,274.46
资产	附注	本期末 2014年12月31日	上年末 2013年12月31日																																																																																										
货币:																																																																																													
银行存款	7.4.7.1	415,093,248.94	82,544,514.47																																																																																										
结算备付金		-	-																																																																																										
存出保证金		-	-																																																																																										
交易性金融资产	7.4.7.2	941,859,931.35	9,997,027.85																																																																																										
其中:股票投资		-	-																																																																																										
债券投资		-	-																																																																																										
其他投资		-	-																																																																																										
应收利息	7.4.7.3	941,859,931.35	9,997,027.85																																																																																										
资产支持证券		-	-																																																																																										
贵金属投资		-	-																																																																																										
其他金融资产	7.4.7.3	-	-																																																																																										
其中:基金投资		-	-																																																																																										
其他投资	7.4.7.4	-	10,000,000.00																																																																																										
应收证券清算款		-	4,008,166.87																																																																																										
应收利息	7.4.7.5	24,540,558.97	714,386.71																																																																																										
应收股利		-	-																																																																																										
应收申购款		-	33,555.00																																																																																										
项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日																																																																																											
报告期内基金支付给的管理费	1,974,267.34	2,338,114.39																																																																																											
其中:支付销售机构的客户维护费	56,742.31	493,707.60																																																																																											
项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日																																																																																											
报告期内基金支付给托管费	584,568.12	692,274.46																																																																																											

基金所得税资产		-	-	-	-	-	-	-	-	单位:人民币元
其他资产	7.4.7.6	-	-	-	-	-	-	-	-	
资产总计		1,381,493,539.26	-	107,297,650.70	-	-	-	-	-	
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日	本期末 2014年12月31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	7.4.7.3	-	-	-	-	-	-	-	-	
卖出回购金融资产款		236,599,125.40	-	-	-	-	-	-	-	
应付短期融资款		-	-	-	-	-	-	-	-	
应付账款		171,259.09	-	4,464,280.93	-	-	-	-	-	
应付管理人报酬		329,187.68	-	30,330.18	-	-	-	-	-	
应付托管费		95,537.11	-	8,986.70	-	-	-	-	-	
应付销售服务费		20,236.10	-	27,125.97	-	-	-	-	-	
应付交易费	7.4.7.7	25,547.09	-	11,330.82	-	-	-	-	-	
应交税费		-	-	-	-	-	-	-	-	
应付利息		31,642.31	-	-	-	-	-	-	-	
应付利润		1,422,032.36	-	106,970.08	-	-	-	-	-	
递延所得税负债		-	-	-	-	-	-	-	-	
其他负债	7.4.7.8	159,645.00	-	381,886.75	-	-	-	-	-	
负债合计		238,654,241.05	-	510,911.91	-	-	-	-	-	
所有者权益:		-	-	-	-	-	-	-	-	
实收基金	7.4.7.9	1,142,835,296.21	-	102,266,739.63	-	-	-	-	-	
未分配利润	7.4.7.10	-	-	-	-	-	-	-	-	
所有者权益合计		1,142,835,296.21	-	102,266,739.63	-	-	-	-	-	
负债和所有者权益总计		1,381,493,539.26	-	107,297,650.70	-	-	-	-	-	

注:本基金实行销售服务费分档收费方式,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,逐日累计至每月月末,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。 7.4.8.3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
2014年1月1日至2014年12月31日		
银行间同业拆借	债券交易金额	基金回购

注1: 报告期内截至2014年12月31日, 基金份额净值1.000元, 基金份额总额1,142,836,288.21份, 其中A类基金份额为814,784,466份, B类基金份额1,113,020,532.75份。			
注2: 表中括号内负数金额和同样标注附注号为年度报告正文中对应的附注号, 投资者了解相应附注的内容, 阅读披露于基金管理人网站的年度报告正文。			
7.2 利润表			
会计主体: 交通银行理财型21天债券型证券投资基金			
本报告期: 2013年1月1日至2014年12月31日			
		单位: 人民币元	
项目	附注号	本期 2014年1月1日至2014年12月 31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月 31日
		2014年1月1日至2014年12月 31日	2013年1月1日至2013年12月 31日
一、收入		34,940,961.55	41,297,378.21
1.利息收入		31,303,504.94	37,796,778.32
其中: 存款利息收入	7.4.7.11	16,535,428.85	23,334,038.89
债券利息收入		13,926,283.15	12,759,130.35
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		841,259.34	1,703,609.08
其他利息收入		—	—
2.投资收益(损失以“—”填列)		3,643,456.61	3,048,792.84
其中: 股票投资收益		—	—
基金投资收益		—	—
债券投资收益	7.4.7.12	3,643,456.61	3,048,792.84
资产支持证券投资收益	7.4.7.13	—	—
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.其他收入(损失以“—”号填列)		—	—
5.其他收入(损失以“—”号填列)	7.4.7.14	—	561,807.06

1.管理人报酬	5,889,827.94	6,708,495.39
2.托管人报酬	1,974,267.34	2,338,114.29
3.销售服务费	584,968.12	692,774.46
4.交易费用	228,046.78	1,102,532.31
5.利息支出	2,575,922.02	2,137,786.45
其中:卖出回购金融资产支出	2,575,922.02	2,137,786.45
6.其他费用	226,623.68	437,267.65
3.期间费用(亏损总额以“-”号填列)	29,357,133.61	34,588,882.95
减:所得税费用		
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	29,357,133.61	34,588,882.95

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:安银诺利资产管理21号债券型证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	102,266,739.63	102,266,739.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净收益)	-29,357,133.61	-29,357,133.61
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)	1,040,568,558.58	1,040,568,558.58
其中:1.基金申购款	3,899,681,713.11	3,899,681,713.11
2.基金赎回款	-2,859,113,154.53	-2,859,113,154.53
四、本期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)	-29,357,133.61	-29,357,133.61

二、期末所有者权益(基金净值)	1,142,835,298.21	-	1,142,835,298.21
项目	2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012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)	1,274,213,061.31	-	1,274,213,061.31
二、本期损益及净资产公允价值变动额(本期利润)	-	34,588,882.95	34,588,882.95
三、本期基金份额交易产生的损益(净收益或净减少) (“号填列)	-1,171,946,321.68	-	-1,171,946,321.68
其中：1.基金申购款	4,905,755,414.57	-	4,905,755,414.57
2.基金赎回款	-6,077,701,736.25	-	-6,077,701,736.25
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的现金流量(净收益或净减少) (“号填列)	-	-34,588,882.95	-34,588,882.95
五、期末所有者权益(基金净值)	102,266,739.63	-	102,266,739.63

报表附注为财务报表的组成部分。
本报告页码(号数)从7.1至7.4,财务报表由下列负责人签署:

小。

(二) 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	941,859,931.35	68.18
	其中：债券	941,859,931.35	68.18
	资产支持证券	--	--
2	买入返售金融资产	--	--
	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	415,093,248.94	30.05
4	其他各项资产	24,540,358.97	1.78
5	合计	1,381,493,539.26	100.00

R.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	6.66	
	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	236,399,125.40	20.69
	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各个银行间市场交易日期融资余额占资产净值10%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。

8.3 报告期内投资组合平均剩余期限

8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	121
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	214
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	212

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

序号	发生日期	平均剩余期限(天数)	原因	调整数
1	2014-11-14	160	系统原因	已在1个工作日内完成调整
2	2014-07-05	150	2014年7月9日巨额赎回导致投资组合平均剩余期限增加	已在约1个工作日内完成调整
3	2014-07-14	212	2014年7月9日巨额赎回导致投资组合平均剩余期限增加	已在约1个工作日内完成调整
4	2014-07-11	214	2014年7月9日巨额赎回导致投资组合平均剩余期限增加	已在约1个工作日内完成调整

注：本基金合同约定：“本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过141天”。

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 其中,剩余存息期限超过397天的浮动利率债	22.32	20.69
2	30天(含)~60天 其中,剩余存息期限超过397天的浮动利率债	14.92	--
3	60天(含)~90天 其中,剩余存息期限超过397天的浮动利率债	22.83	--
4	90天(含)~180天 其中,剩余存息期限超过397天的浮动利率债	33.35	--
5	180天(含)~397天(含) 其中,剩余存息期限超过397天的浮动利率债	25.32	--
6	397天以上	118.73	20.60

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	--	--
2	央行票据	--	--
3	金融债券	100,016,028.51	8.75
	其中：政策性金融债	100,016,028.51	8.75
4	企业债券	--	--
5	企业短期融资券	841,843,902.84	73.66
6	中期票据	--	--
7	其他	--	--
8	合计	941,859,931.35	82.41
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	--	--

8.5月末按摊余成本法基金资产净值比例大小排序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	债券面值(元)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	144144034	14晋能债CP001	990,000	988,355.79	7.91
2	144145006	14莱州CP001	600,000	598,727.93	5.28
3	141710876	14林城发债CP001	600,000	599,091.63	5.25
4	144161026	14广德债CP001	500,000	50,456,753.33	4.42
5	144153039	14豫汇CP001	500,000	50,362,828.82	4.41
6	144161017	14金三CP002	500,000	50,238,530.50	4.40
7	144146018	14屯电利发CP002	500,000	50,237,752.66	4.40
8	144161039	14华信利发CP001	500,000	50,067,152.19	4.38
9	1441628	14隆平债CP001	500,000	50,019,060.46	4.38
10	“14益源07”	“华源利发CP001”	500,000	50,009,000.40	4.38

8.6 “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%以上-0.5%间的次数	17
报告期内偏离度的最高值	-0.3266%
报告期内偏离度的最低值	-0.1879%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0637%

8.7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

本基金本报告期末持有资产支持证券。

8.8 投资组合报告附注

8.8.1 基金计价方法说明

8.8.2 估值程序：本基金的估值按照《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》和《证券投资基金信息披露编报规则》的有关规定进行。除中国证监会另有规定外，金融资产（不含应收款项）的公允价值采用估值技术确定。估值技术在应用时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债的可观察输入值或取得切实可行的情况下，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，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。

息折价,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。

8.8.2 金融资产预期自持有剩余期限于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本均不超过当日资产净值的 20%。

8.8.3 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。

8.8.4 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	24,540,388.97
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-

6	持摊费用		--
7	其他		--
8	合计		24,540,358.97

8.8.5 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。

9.9 基金份额持有人信息

9.1 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
安银理财21债货币A	766	38,922.67	938,38.92	3.15%	28,876,025.54	96.85%

合计	2,008	1,488,066.28	1,113,969.27	97.47%	28,876,025.54	2.53%
----	-------	--------------	--------------	--------	---------------	-------

9.2 期末基金持有人的从业人员持有本基金的情况

项目	份数类别	持有份额(股份数)	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21天债券A	89,128.38	0.36%
	交银理财21天债券B	-	-
	合计	89,128.38	0.01%

9.3 期末基金持有人的从业人员持有未开放式基金份额总额占总额的情况

项目	份额类别	持有基金份额总额的数量(万股)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门持有未开放式基金	交银理财21天债券A	0
	交银理财21天债券B	0
	合计	0
本基金基金经理持有	交银理财21天债券A	0

本开放式基金	交理财财21天持有期	0
	合计	0
§ 10 开放式基金份额变动		
单位:份		
项目	交理财财21天持有期 A	交理财财21天持有期 B
基金合同生效日(2022年11月5日)基金份额总额	8,505,567,812.46	-
本报告期初基金份额总额	84,634,331.81	17,632,407.82
本报告基金总申购份额	52,814,945.21	3,846,866,767.90
减:本报告基金总赎回份额	107,634,512.56	2,781,478,641.97
本报告基金份额变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	29,814,764.46	1,111,020,535.75

3、本基金于2013年7月19日经基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会核准注册。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开基金份额持有人大会。

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、基金管理人的人事变动情况：2014年12月23日本基金管理人发布公告，经公司第六届董事会第三十二次会议审议通过，同意袁庆先生辞去公司总经理职务，并决定由公司董事长程文先生代为履行公司总经理职务，代为履行总经理职务的期限不超过90日。期间变动（如有）敬请关注基金管理人发布的相关公告。

2、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动：因中国农业银行股份有限公司（以下简称“中国农业银行”）工作需要，任命袁庆先生为主持中国农业银行托管业务部/养老金管理中心工作。袁晓晨先生为基金托管部高级经理人员任职时间在一年内未发生变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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。

11.4 基金费用及费用的变更

本基金报告期内投资策略未发生改变。

17.1.5 为基金提供审计的会计师事务所情况

本报告期内，为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 40,000.00 元。自本基金基金合同生效以来，基金未支付为其审计的会计师事务所的费用。

17.1.6 管理人、托管人及其他高级管理人员受调查或处罚情况

截至报告期末，除收到中国证券监督管理委员会上海监管局就 2014 年 11 月 14 日发生了组合平均调仓期限外溢问题给予警示外，本报告期内，本管理人、托管人及其他高级管理人员未受监管部门调查或处罚。

17.1.7 基金租用证券公司交易席位的情况

17.1.7.1 基金租用证券公司交易席位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	交易单数数量	股票交易 成交金额	应支付该券商的佣金	备注

中国国际金融有限公司	1	--	--	--	--	--
康曼万得证券股份有限公司	1	--	--	--	--	--

11.7.2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		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交金额的比例	成交金额	占当期回购成交金额的比例	成交金额	占当期权证成交金额的比例
中国国际金融有限公司			735,000,000.00	100.00%		

注：1、报告期内，本基金交易单元未发生变更；
2、租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：券商综合实力、财务状况、经营状况、券商研究机构和投资服务水平、提供其他增值服务的情况、席位数量、综合服务费用、所在地的营业网点分布和经纪业务的综合能力等。

17. 利用证券公司交易单元的程序,首先根据利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

本基金报告期内不存在偏离度绝对值超过0.5%的情况。

交银施罗德基金管理有限公司
二〇一五年三月三十一日