

# 交银施罗德现金宝货币市场基金

## 2014 年度 报告 摘要

债券市场仍有一定利好的影响,然而,更为确定的是通缩压力目前看来仍是市场的主要矛盾,也是支持债券市场在上半年或仍有较好表现的重要因素。另一方面,市场资金面情况则看好2014年12月,也是支持债券市场在上半年可能仍有一定利好的表现的一个重要因素。值得注意的是,连续IPO可能会对市场对流动性及情绪有同性的冲击,而央行货币政策的力度仍较为稳健,受到资金面和通胀预期的限制,降准等货币政策可能并不会给债券市场带来收益的快速下行。因此,债券收益率应该不会继续下滑2014年如此大幅度的下行,修复更大可能性是在一、二季度保持缓慢下行的态势。品种选择上,3年左右中短期的品种由于收益曲线的修复可能表现的会更好。总体来看,本基金对2015年一季度债券市场的短跑较为乐观。

因此,组合在2015年一季度将保持中性债券仓位,同时由于IPO间歇性冲击,增加存款资产的配置,在保持流动性平稳的同时,努力增加基金收益性。

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员、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规定进行估值,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和基金估值人员的专业素质、研究并参考市场普遍认同的做法,建立合理的估值模型、进行测算和认证,认可后交给估值委员会成员从基金会计、风险、合规等方面审核,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,基金估值作为估值委员会,对本基金持仓证券的交易价格、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,参与估值流程管理。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  
遵照法律法规及基金合同的约定,本基金每日分配收益,按日结转份额。本基金本报告期内利润分配情况参见年度报告正文2.7.4.10。

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  
本基金本报告期内无需预警说明。

### 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况说明  
自2014年9月12日交银施罗德现金宝货币市场基金(以下简称“本基金”)成立以来,作为本基金的托管人,中信银行严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的约定,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在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  
报告期内,托管人按照国家有关法律法规、基金合同和托管协议的约定,与基金管理人——交银施罗德基金管理有限公司在本基金投资运作方面进行了监督,对基金管理人净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,未发现基金管理人损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见  
由本基金管理人——交银施罗德基金管理有限公司编制,并经本托管人复核审查的本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

### 6 审计报告

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)对交银施罗德现金宝货币市场基金2014年12月31日的资产负债表,2014年9月12日至2014年12月31日止期间的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注出具了标准无保留意见的审计报告【普华永道中天审字(2015)第1524号】。投资者可通过本年年度报告正文查看审计报告全文。

### 7 年度财务报表

7.1 资产负债表  
会计主体:交银施罗德现金宝货币市场基金  
报告截止日:2014年12月31日

资产		附注	金额 2014年12月31日
货币			
银行存款		7.4.3.1	296,201,398.46
结算备付金			—
交易性金融资产		7.4.3.2	76,127,907.89
其中:股票投资			—
债券投资			76,127,907.89
其中:国债投资			—
企业债券投资			—
金融债券投资			—
资产支持证券投资			—
其他金融资产			—
应收利息		7.4.3.3	226,789,664.63
应收股利			—
其他应收款			—
递延所得税资产			46,340.38
其他资产			—
资产总计		7.4.3.4	599,475,010.40
负债和所有者权益		附注	2014年12月31日
负债:			
短期借款			—
应付短期融资券			—
应付票据			—
应付账款			—
应付利息		7.4.3.5	3,989,276.35
应付股利			—
其他应付款			—
递延所得税负债			—
其他负债			—
负债合计			3,989,276.35
所有者权益:			
实收基金		7.4.3.6	399,443,763.51
未分配利润		7.4.3.7	196,042,070.54
所有者权益合计			599,475,010.40

注:1、报告截止日2014年12月31日,基金净值净值1,000元,基金份额总额599,443,763.51份。  
2、本财务报表的实际编制期间为2014年9月12日(基金合同生效日)至2014年12月31日。  
3、本报告中资产负债表和利润表所列附注号为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上的年度报告正文。

7.2 利润表  
会计主体:交银施罗德现金宝货币市场基金  
报告期间:2014年9月12日(基金合同生效日)至2014年12月31日

资产		附注	金额 2014年9月12日至2014年12月31日
一、收入			3,020,675.98
利息收入			1,763,133.26
其中:存款利息收入		7.4.3.8.1	1,763,133.26
债券利息收入			27,740.46
公允价值变动收益			—
其他收入			—
二、费用			81,275.54
利息支出			—
其他费用			81,275.54
三、利润总额			3,020,675.98
四、净利润			3,020,675.98
五、每股收益			—
六、其他综合收益			—
七、综合收益总额			3,020,675.98
八、每股收益			—
九、其他综合收益			—
十、综合收益总额			3,020,675.98
十一、其他综合收益			—
十二、综合收益总额			3,020,675.98
十三、其他综合收益			—
十四、综合收益总额			3,020,675.98
十五、其他综合收益			—
十六、综合收益总额			3,020,675.98
十七、其他综合收益			—
十八、综合收益总额			3,020,675.98
十九、其他综合收益			—
二十、综合收益总额			3,020,675.98
二十一、其他综合收益			—
二十二、综合收益总额			3,020,675.98
二十三、其他综合收益			—
二十四、综合收益总额			3,020,675.98
二十五、其他综合收益			—
二十六、综合收益总额			3,020,675.98
二十七、其他综合收益			—
二十八、综合收益总额			3,020,675.98
二十九、其他综合收益			—
三十、综合收益总额			3,020,675.98
三十一、其他综合收益			—
三十二、综合收益总额			3,020,675.98
三十三、其他综合收益			—
三十四、综合收益总额			3,020,675.98
三十五、其他综合收益			—
三十六、综合收益总额			3,020,675.98
三十七、其他综合收益			—
三十八、综合收益总额			3,020,675.98
三十九、其他综合收益			—
四十、综合收益总额			3,020,675.98
四十一、其他综合收益			—
四十二、综合收益总额			3,020,675.98
四十三、其他综合收益			—
四十四、综合收益总额			3,020,675.98
四十五、其他综合收益			—
四十六、综合收益总额			3,020,675.98
四十七、其他综合收益			—
四十八、综合收益总额			3,020,675.98
四十九、其他综合收益			—
五十、综合收益总额			3,020,675.98
五十一、其他综合收益			—
五十二、综合收益总额			3,020,675.98
五十三、其他综合收益			—
五十四、综合收益总额			3,020,675.98
五十五、其他综合收益			—
五十六、综合收益总额			3,020,675.98
五十七、其他综合收益			—
五十八、综合收益总额			3,020,675.98
五十九、其他综合收益			—
六十、综合收益总额			3,020,675.98
六十一、其他综合收益			—
六十二、综合收益总额			3,020,675.98
六十三、其他综合收益			—
六十四、综合收益总额			3,020,675.98
六十五、其他综合收益			—
六十六、综合收益总额			3,020,675.98
六十七、其他综合收益			—
六十八、综合收益总额			3,020,675.98
六十九、其他综合收益			—
七十、综合收益总额			3,020,675.98
七十一、其他综合收益			—
七十二、综合收益总额			3,020,675.98
七十三、其他综合收益			—
七十四、综合收益总额			3,020,675.98
七十五、其他综合收益			—
七十六、综合收益总额			3,020,675.98
七十七、其他综合收益			—
七十八、综合收益总额			3,020,675.98
七十九、其他综合收益			—
八十、综合收益总额			3,020,675.98
八十一、其他综合收益			—
八十二、综合收益总额			3,020,675.98
八十三、其他综合收益			—
八十四、综合收益总额			3,020,675.98
八十五、其他综合收益			—
八十六、综合收益总额			3,020,675.98
八十七、其他综合收益			—
八十八、综合收益总额			3,020,675.98
八十九、其他综合收益			—
九十、综合收益总额			3,020,675.98
九十一、其他综合收益			—
九十二、综合收益总额			3,020,675.98
九十三、其他综合收益			—
九十四、综合收益总额			3,020,675.98
九十五、其他综合收益			—
九十六、综合收益总额			3,020,675.98
九十七、其他综合收益			—
九十八、综合收益总额			3,020,675.98
九十九、其他综合收益			—
一百、综合收益总额			3,020,675.98

7.3 所有者权益(基金净值)变动表  
会计主体:交银施罗德现金宝货币市场基金  
报告期间:2014年9月12日(基金合同生效日)至2014年12月31日

资产		附注	金额 2014年9月12日至2014年12月31日
一、所有者权益			3,020,675.98
实收基金			3,020,675.98
未分配利润			—
二、所有者权益			3,020,675.98
三、所有者权益			3,020,675.98
四、所有者权益			3,020,675.98
五、所有者权益			3,020,675.98
六、所有者权益			3,020,675.98
七、所有者权益			3,020,675.98
八、所有者权益			3,020,675.98
九、所有者权益			3,020,675.98
十、所有者权益			3,020,675.98
十一、所有者权益			3,020,675.98
十二、所有者权益			3,020,675.98
十三、所有者权益			3,020,675.98
十四、所有者权益			3,020,675.98
十五、所有者权益			3,020,675.98
十六、所有者权益			3,020,675.98
十七、所有者权益			3,020,675.98
十八、所有者权益			3,020,675.98
十九、所有者权益			3,020,675.98
二十、所有者权益			3,020,675.98
二十一、所有者权益			3,020,675.98
二十二、所有者权益			3,020,675.98
二十三、所有者权益			3,020,675.98
二十四、所有者权益			3,020,675.98
二十五、所有者权益			3,020,675.98
二十六、所有者权益			3,020,675.98
二十七、所有者权益			3,020,675.98
二十八、所有者权益			3,020,675.98
二十九、所有者权益			3,020,675.98
三十、所有者权益			3,020,675.98
三十一、所有者权益			3,020,675.98
三十二、所有者权益			3,020,675.98
三十三、所有者权益			3,020,675.98
三十四、所有者权益			3,020,675.98
三十五、所有者权益			3,020,675.98
三十六、所有者权益			3,020,675.98
三十七、所有者权益			3,020,675.98
三十八、所有者权益			3,020,675.98
三十九、所有者权益			3,020,675.98
四十、所有者权益			3,020,675.98
四十一、所有者权益			3,020,675.98
四十二、所有者权益			3,020,675.98
四十三、所有者权益			3,020,675.98
四十四、所有者权益			3,020,675.98
四十五、所有者权益			3,020,675.98
四十六、所有者权益			3,020,675.98
四十七、所有者权益			3,020,675.98
四十八、所有者权益			3,020,675.98
四十九、所有者权益			3,020,675.98
五十、所有者权益			3,020,675.98
五十一、所有者权益			3,020,675.98
五十二、所有者权益			3,020,675.98
五十三、所有者权益			3,020,675.98
五十四、所有者权益			3,020,675.98
五十五、所有者权益			3,020,675.98
五十六、所有者权益			3,020,675.98
五十七、所有者权益			3,020,675.98
五十八、所有者权益			3,020,675.98
五十九、所有者权益			3,020,675.98
六十、所有者权益			3,020,675.98
六十一、所有者权益			3,020,675.98
六十二、所有者权益			3,020,675.98
六十三、所有者权益			3,020,675.98
六十四、所有者权益			3,020,675.98
六十五、所有者权益			3,020,675.98
六十六、所有者权益			3,020,675.98
六十七、所有者权益			3,020,675.98
六十八、所有者权益			3,020,675.98
六十九、所有者权益			3,020,675.98
七十、所有者权益			3,020,675.98
七十一、所有者权益			3,020,675.98
七十二、所有者权益			3,020,675.98
七十三、所有者权益			3,020,675.98
七十四、所有者权益			3,020,675.98
七十五、所有者权益			3,020,675.98
七十六、所有者权益			3,020,675.98
七十七、所有者权益			3,020,675.98
七十八、所有者权益			3,020,675.98
七十九、所有者权益			3,020,675.98
八十、所有者权益			3,020,675.98
八十一、所有者权益			3,020,675.98
八十二、所有者权益			3,020,675.98
八十三、所有者权益			3,020,675.98
八十四、所有者权益			3,020,675.98
八十五、所有者权益			3,020,675.98
八十六、所有者权益			3,020,675.98
八十七、所有者权益			3,020,675.98
八十八、所有者权益			3,020,675.98
八十九、所有者权益			3,020,675.98
九十、所有者权益			3,020,675.98
九十一、所有者权益			3,020,675.98
九十二、所有者权益			3,020,675.98
九十三、所有者权益			3,020,675.98
九十四、所有者权益			3,020,675.98
九十五、所有者权益			3,020,675.98
九十六、所有者权益			3,020,675.98
九十七、所有者权益			3,020,675.98
九十八、所有者权益			3,020,675.98
九十九、所有者权益			3,020,675.98
一百、所有者权益			3,020,675.98

7.4 本报告期末所有者权益(基金净值)变动表  
会计主体:交银施罗德现金宝货币市场基金  
报告期间:2014年9月12日(基金合同生效日)至2014年12月31日

资产		附注	金额 2014年9月12日至2014年12月31日
一、所有者权益			3,020,675.98
实收基金			3,020,675.98
未分配利润			—
二、所有者权益			3,020,675.98
三、所有者权益			3,020,675.98
四、所有者权益			3,020,675.98
五、所有者权益			3,020,675.98
六、所有者权益			3,020,675.98
七、所有者权益			3,020,675.98
八、所有者权益			3,020,675.98
九、所有者权益			3,020,675.98
十、所有者权益			3,020,675.98
十一、所有者权益			3,020,675.98
十二、所有者权益			3,020,675.98
十三、所有者权益			3,020,675.98
十四、所有者权益			3,020,675.98
十五、所有者权益			3,020,675.98
十六、所有者权益			3,020,675.98
十七、所有者权益			3,020,675.98
十八、所有者权益			3,020,675.98
十九、所有者权益			3,020,675.98