交银施罗德理财21天债券型证券投资基金 2016年年度报告摘要

基金管理人：交银施罗德基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年三月二十九日

§1 重要提示

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。本年度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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司(以下简称“中国农业银行”)根据本基金合同规定，于2017年3月28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。

本报告期自2016年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	交银理财21天债券	
基金主代码	519716	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年11月5日	
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	4,022,983,722.80份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	交银理财21天债券A	交银理财21天债券B
下属分级基金的交易代码	519716	519717
报告期末下属分级基金的份额总额	11,855,373.33份	4,011,128,349.47份

2.2 基金产品说明

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	七天通知存款税后利率
风险收益特征	本基金属于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，高于货币市场型证券投资基金。

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		交银施罗德基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙艳	林葛
	联系电话	（021）61055050	010-66060069
	电子邮箱	xxp1@jyishi.com，dianbosure@jyishi.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-700-5000，021-61055000	95599
传真		（021）61055054	010-68121816

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fund001.com，www.boccomschroder.com
基金年度报告备置地点	基金管理人的办公场所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2016年		2015年		2014年	
	交银理财21天债券A	交银理财21天债券B	交银理财21天债券A	交银理财21天债券B	交银理财21天债券A	交银理财21天债券B
本期已实现收益	438,686.08	33,832,155.51	849,632.96	16,000,599.56	2,479,274.89	26,877,858.72
本期利润	438,686.08	33,832,155.51	849,632.96	16,000,599.56	2,479,274.89	26,877,858.72
本期净值收益率	2.71%	2.41%	3.62%	3.90%	4.67%	3.51%
3.1.2期末数据和指标	2016年末		2015年末		2014年末	
	交银理财21天债券A	交银理财21天债券B	交银理财21天债券A	交银理财21天债券B	交银理财21天债券A	交银理财21天债券B
期末基金资产净值	11,855,373.33	4,011,128,349.47	19,873,199.04	82,158,333.51	29,814,764.46	1,113,020,533.75
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000

注：1、本基金申购赎回费为零。

2、本基金收益分配按运作期结转份额。

3、自2013年1月9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。在计算主要财务指标时，A类基金份额与分类前基金连续计算，B类基金份额按新设基金计算；

4、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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

1. 交银理财21天债券A：

3.1.1期间数据和指标	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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
过去三个月	0.6881%	0.0040%	0.3403%	0.0000%	0.3478%	0.0040%
过去六个月	1.3097%	0.0030%	0.6805%	0.0000%	0.6292%	0.0030%
过去一年	2.7140%	0.0168%	1.3837%	0.0000%	1.3603%	0.0168%
过去三年	11.3999%	0.0213%	4.0537%	0.0000%	7.3462%	0.0213%
自基金合同生效起至今	16.6337%	0.0184%	5.6145%	0.0000%	11.0192%	0.0184%

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、本基金的业绩比较基准为七天通知存款税后利率。

2. 交银理财21天债券B：

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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
过去三个月	0.7616%	0.0040%	0.3403%	0.0000%	0.4213%	0.0040%
过去六个月	1.4575%	0.0030%	0.6805%	0.0000%	0.7770%	0.0030%
过去一年	2.4094%	0.0072%	1.3837%	0.0000%	1.0257%	0.0072%
过去三年	10.1401%	0.0112%	4.0537%	0.0000%	6.0864%	0.0112%
自基金合同生效起至今	14.8331%	0.0100%	5.3741%	0.0000%	9.4590%	0.0100%

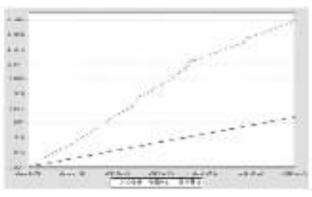
注：1、本表净值收益率数据所取的基金运作周期为销售服务费分类日为起始日的运作周期。

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、本基金的业绩比较基准为七天通知存款税后利率。

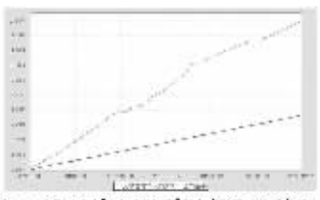
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

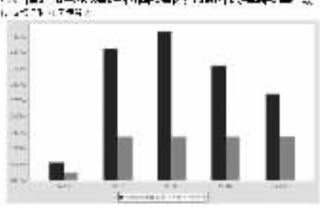
1、交银理财21天债券A



注：图示日期为2012年11月5日至2016年12月31日。本基金建仓期为自基金合同生效日起的6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。

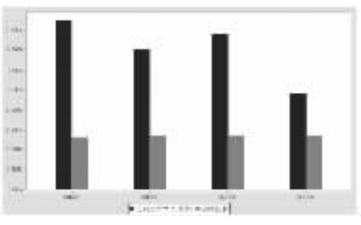
2、交银理财21天债券B





注：图示日期为2012年11月5日至2016年12月31日。基金合同生效当年的净值增长率按照当年实际存续期计算。

2、交银理财21天债券B



注：图示日期为2013年1月9日至2016年12月31日。实施销售服务费分类当年的净值增长率按照当年实际存续期计算。

3.3过去三年基金的利润分配情况

交银理财21天债券A：

单位：人民币元

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2016年	424,999.99	19,223.72	-5,537.63	438,686.08	-
2015年	793,620.55	66,698.00	-10,685.59	849,632.96	-
2014年	2,266,419.70	254,424.39	-41,569.20	2,479,274.89	-
合计	3,485,040.24	340,346.11	-57,792.42	3,767,593.93	-

交银理财21天债券B：

单位：人民币元

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2016年	27,027,065.44	3,170,613.59	3,634,476.48	33,832,155.51	-
2015年	11,264,970.72	6,126,036.83	-1,390,407.99	16,000,599.56	-
2014年	19,503,567.90	6,017,669.34	1,356,621.48	26,877,858.72	-
合计	57,795,604.06	15,314,319.76	3,600,689.97	76,710,613.79	-

§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

交银施罗德基金管理有限公司是经中国证监会证监基金字[2005]128号文批准，由交通银行股份有限公司、施罗德投资管理有限公司、中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司共同发起设立。公司成立于2005年8月4日，注册地在中国上海，注册资本金为2亿元人民币。其中，交通银行股份有限公司持有65%的股份，施罗德投资管理有限公司持有30%的股份，中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司持有5%的股份。公司并下设交银施罗德资产管理（香港）有限公司和交银施罗德资产管理有限公司。

截至报告期末，公司管理了包括货币型、债券型、保本混合型、普通混合型和股票型在内的69只基金，其中股票型涵盖普通指数型、交易型开放式（ETF）、QDII等不同类型基金。

4.1.2基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
黄莹洁	交银货币、交银理财21天债券、交银现金宝货币、交银丰享收益债券、交银丰泽收益债券、交银稳通纯债债券、交银活期通货币、交银天利宝货币、交银钰隆纯债债券、交银大鑫宝货币、交银活期宝货币基金经理	2015-05-27	-	8年	黄莹洁女士，香港大学工商管理硕士，北京大学经济学，管理学双学士。历任中海基金管理有限公司交易员，2012年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任中央交易室交易员。

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

本报告期内，本基金管理人严格遵循《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。

本报告期内，本基金整体运作合规合法，无不当内幕交易和关联交易，基金投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的约定，未发生损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1公平交易制度和控制方法

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所管理的所有资产组合投资运作的公平。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。制度中包含的主要控制方法如下：

（1）公司建立资源共享的投资研究信息平台，所有研究成果对所有投资组合公平开放，确保各投资组合在获得研究支持和实施投资决策方面享有公平的机会。

（2）公司将投资管理职能和交易执行职能相隔离，实行集中交易制度，建立了合理且可操作的公平交易分配机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。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。

（3）公司建立了清晰的投资授权制度，明确各层级投资决策主体的职责和权限划分，组合投资经理充分发挥专业判断能力，不受他人干预，在授权范围内独立行使投资决策权，维护公平的投资管理环境，维护所管理投资组合的合法利益，保证各投资组合交易决策的客观性和独立性，防范不公平及异常交易的发生。

（4）公司建立统一的投资对象备选库和交易对手备选库，制定明确的备选库建立、维护程序。在全公司适用股票、债券备选库的基础上，根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和关联交易限制等，按需要建立不同投资组合的投资对象风格库和交易对手备选库，组合经理在此基础上根据投资授权构建投资组合。

（5）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投资组合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。

4.3.2公平交易制度的执行情况

本报告期内公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合。通过投资交易监控、交易数据分析、专项稽核检查等，本基金管理人未发现任何违反公平交易制度的行为。

4.3.3异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内未发现异常交易行为。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超过该证券当日总成交量5%的情况有2次，是投资组合因投资策略或在合规范围内因被动超标调整需要而发生同日反向交易，未发现不公平交易和利益输送的情况。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发现异常。

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

本报告期内，国内经济整体上延续弱势平稳的态势。央行货币政策中性稳健定调未变，央行持续逆回购及MLF以维护资金面平稳，但通过抬升贷金成本引导金融机构主动控制杠杆风险，加强流动性管理。同时监管升级对流动性亦有一定影响。临近2016年年末，银行系统内部流动性趋紧，货币市场工具利率大幅上行。

基金操作方面，本基金通过合理有效的久期管理，保障了组合充足的流动性。动态对比债券、回购、存款、同业存单的收益率，排序选择更优的资产进行配置，在力保安全性、流动性的同时，努力提高长期收益。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期内，交银理财21天债券A净值收益率为2.7140%，同期业绩比较基准增长率为1.3537%；交银理财21天债券B净值收益率2.4094%，同期业绩比较基准增长率为1.3537%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2017年，我们对债券市场保持谨慎乐观的态度。中国内在的经济增长动能仍处于下降通道，未来可能低位波动，因此基本面依然对债市有所支撑。但债券市场仍存在一些不确定因素，包括金融机构去杠杆的力度，通胀压力是否缓解，资金面的波动等。本基金将根据不同资产收益率的动态变化，适时调整组合结构，根据期限利差动态调整组合杠杆率，通过对市场利率的前瞻性判断进行合理有效的久期管理，尽力严格控制信用风险、流动性风险和利率风险，努力为持有人创造较为稳健的收益。

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部、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约定进行估值，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成员按投资品种的不同性质，研究并参考市场普遍认同的做法，建议合理的估值模型，进行测算和认证，认可后交各估值委员会成员从基金会计、风险、合规等方面审批，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。基金经理作为估值委员会成员，对本基金持仓证券的交易情况、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，参与估值政策讨论。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定价服务机构签约。

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，按运作期结转份额。本基金本报告期内利润分配情况参见年度报告正文7.4.7.10。

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声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—交银施罗德基金管理有限公司 2016 年 1 月 1 日至 2016年12月31日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事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

本托管人认为，交银施罗德基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，交银施罗德基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 审计报告

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）对交银施罗德理财21天债券型证券投资基金2016年12月31日的资产负债表，2016年度的利润表、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(2017)第20169 号】。投资者可通过本基金年度报告正文查看该审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：交银施罗德理财21天债券型证券投资基金

报告截止日：2016年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	1,098,712,208.47	42,033,061.38
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	549,093,614.02	50,016,722.17
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		549,093,614.02	50,016,722.17
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	2,372,971,815.36	9,500,134.25
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	6,327,086.59	648,585.04
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		4,027,104,724.44	102,198,502.84
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		237,535.26	28,662.15
应付托管费		95,014.14	8,492.50
应付销售服务费		14,709.55	6,089.35
应付交易费用	7.4.7.7	32,925.19	13,307.51
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		3,649,702.50	20,928.78
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	91,115.00	89,490.00
负债合计		4,121,001.64	166,970.29
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	4,022,983,722.80	102,031,532.55
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		4,022,983,722.80	102,031,532.55
负债和所有者权益总计		4,027,104,724.44	102,198,502.84

注：1、报告截止日2016年12月31日，基金份额净值1.000元，基金份额总额4,022,983,722.8份，其中A类基金份额11,855,373.33份，B类基金份额4,011,128,349.47份。

2、本摘要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的年度报告正文。

7.2 利润表

会计主体：交银施罗德理财21天债券型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
一、收入		43,598,568.91	20,218,964.91
1.利息收入		43,443,796.79	15,984,026.89
其中：存款利息收入	7.4.7.11	15,693,149.08	8,919,711.20
债券利息收入		24,168,151.63	6,554,406.74
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		3,582,495.08	509,908.95
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		154,773.12	4,234,938.02
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.12	154,773.12	4,234,938.02
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.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.14	-	-
减：二、费用		9,327,727.32	3,368,732.39
1. 管理人报酬		2,795,454.55	963,200.15
2. 托管费		964,652.60	285,392.58
3. 销售服务费		167,820.45	104,592.49
4. 交易费用		-	-
5. 利息支出		5,238,284.71	1,850,329.01
其中：卖出回购金融资产支出		5,238,284.71	1,850,329.01
6. 其他费用	7.4.7.15	161,515.01	165,218.16
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		34,270,841.59	16,850,232.52
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		34,270,841.59	16,850,232.52

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：交银施罗德理财21天债券型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016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）	102,031,532.55	-	102,031,532.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	34,270,841.59	34,270,841.59
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）	3,920,952,190.25	-	3,920,952,190.25
其中：1.基金申购款	6,051,618,639.55	-	6,051,618,639.55
2.基金赎回款	-2,130,666,449.30	-	-2,130,666,449.30
四、本期向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）	-	-34,270,841.59	-34,270,841.59
五、期末所有者权益（基金净值）	4,022,983,722.80	-	4,022,983,722.80
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015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）	1,142,835,298.21	-	1,142,835,298.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	16,850,232.52	16,850,232.52
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）	-1,040,803,765.66	-	-1,040,803,765.66
其中：1.基金申购款	188,312,772.17	-	188,312,772.17
2.基金赎回款	-1,229,116,537.83	-	-1,229,116,537.83
四、本期向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）	-	-16,850,232.52	-16,850,232.52
五、期末所有者权益（基金净值）	102,031,532.55	-	102,031,532.55

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从7.1至7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：阮红，主管会计工作负责人：夏华龙，会计机构负责人：单江

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

交银施罗德理财21天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”)证监许可[2012]第1282号《关于核准交银施罗德理财21天债券型证券投资基金募集的批复》核准，由交银施罗德基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德理财21天债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集8,503,647,851.36元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第428号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《交银施罗德理财21天债券型证券投资基金基金合同》于2012年11月5日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为8,505,567,812.46份基金份额，其中认购资金利息折合1,919,961.10份基金份额。本基金的基金管理人为交银施罗德基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

经与本基金托管人中国农业银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，本基金管理人自2013年1月9日起对本基金实施基金份额分类，并对《交银施罗德理财21天债券型证券投资基金基金合同》、《交银施罗德理财21天债券型证券投资基金托管协议》和《交银施罗德理财21天债券型证券投资基金招募说明书》的相关内容进行了修改。本基金实施基金份额分类后根据投资人持有本基金的份额数量，对投资人持有的基金份额按照不同的费率计提销售服务费用，因此形成A类和B类两类基金份额。两类基金份额分别公布每万份基金净收益和七日年化收益率。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德理财21天债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为法律法规允许的金融工具，包括现金，通知存款，一年以内(含一年)的银行定期存款和大额存单，剩余期限(或回售期限)在397天以内(含397天)的债券、资产支持证券和中期票据，期限在一年以内(含一年)的债券回购，期限在一年以内(含一年)的中央银行票据和短期融资券，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具及相关衍生工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的业绩比较基准为：七天通知存款税后利率。

本财务报表由本基金的基金管理人交银施罗德基金管理有限公司于2017年3月24日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《交银施罗德理财21天债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2016年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2016年12月31日的财务状况以及2016年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计差错更正。

7.4.6税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《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《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：：

(1)于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2)对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。

(3) 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。

7.4.7关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
交银施罗德基金管理有限公司(交银施罗德基金公司)	基金管理人、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	基金托管人、基金销售机构
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	基金管理人的股东、基金销售机构
施罗德投资管理有限公司	基金管理人的股东
中国国际海运集装箱集团股份有限公司	基金管理人的股东
交银施罗德资产管理有限公司	基金管理人的子公司
上海直源投资管理有限公司	受基金管理人控制的公司
交烨投资管理(上海)有限公司	受基金管理人控制的公司

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。

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

本基金本报告期内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

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,795,454.55	963,200.15
其中：支付销售机构的客户维护费	17,561.59	26,168.59

注：1. 2016年1月1日到2016年8月23日，支付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；

2. 2016年8月24日到2016年12月31日，支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值0.20%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×0.20%÷当年天数。

7.4.8.2.2基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	964,652.60	285,392.58

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.08%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×0.08%÷当年天数。

7.4.8.2.3销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	交银理财21天债券A	交银理财21天债券B	合计
交通银行	20,245.15	-	20,245.15
中国农业银行	14,076.87	22.77	14,099.64
交银施罗德基金公司	5,818.06	118,929.76	124,747.82
合计	40,140.08	118,952.53	159,092.61
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	交银理财21天债券A	交银理财21天债券B	合计
交通银行	36,963.23	-	36,963.23
中国农业银行	21,115.73	-	21,115.73
交银施罗德基金公司	4,572.35	33,297.52	37,869.87
合计	62,651.31	33,297.52	96,948.83

注：本基金实行销售服务费分类收费方式，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，逐日累计至每月月底，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

本期 2016年1月1日至2016年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国农业银行	99,808,569.57	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2015年1月1日至2015