

交银施罗德天利宝货币市场基金

基金管理人：交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人：中信银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一七年三月二十九日

§ 1 重要提示

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。

基金经理人：王春雷，男，经济学硕士，具有基金从业资格。2003年8月至2005年1月就职于国泰君安证券有限公司，任债券交易员；2005年1月至2007年1月就职于国泰君安证券有限公司，任债券交易员；2007年1月至2008年1月就职于国泰君安证券有限公司，任债券交易员；2008年1月至2010年1月就职于国泰君安证券有限公司，任债券交易员；2010年1月至今就职于交银施罗德基金管理有限公司，任基金经理助理。

基金经理人：王春雷，男，经济学硕士，具有基金从业资格。

基金经理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。

本年度报告摘要根据年度报告正文，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10月19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	交银天利宝货币
基金主代码	002819
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年10月19日
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司
报告期末基金资产总额	500.565,806,030.00
基金合同生效日期	不定期
下属分级基金的基金简称	交银天利宝货币A 交银天利宝货币B
报告期末下属分级基金的份额总额	2,542,700,406份 560,013,014份

2.2 基金产品说明

投资目标 在力求资金安全性和资产充分流动性的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。

投资策略 在基金合同符合高流动性的前提下，根据国内外外汇市场的运行情况，进行外汇买卖，现金类资产的配置，货币市场工具的运用，同时根据宏观经济形势，适时调整投资组合的资产配置和操作的手段。

业绩比较基准 沪深300指数收益率*2%+一年期定期存款利率(税后)*80%

风险特征 本基金属于货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种，长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。

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	中国银行股份有限公司
地址	上海市浦东新区银城中路16号	北京市西城区复兴门内大街1号
法定代表人	王春雷	陈建东
信息披露负责人	王春雷	王春雷
电子邮箱	xay@jzfund.com, dianxie@jzfund.com	tongwei@cbank.com
客户服务电话	400-700-5000, 021-61056000	95566
传真	(021)61056004	010-48260024

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址：www.huanqiu.com/wecomecenter/

基金半年度报告备查目录：基金管理人办公场所

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

金额单位：人民币元

2016年10月19日(基金合同生效日)至2016年12月31日	
交银天利宝货币A	2,074,06
交银天利宝货币B	2,074,06
本期期间费用	2,074,06
本期利润	2,074,06
本期已实现收益	0.00
本期未分配利润	0.00

注：1.本基金管理人申购赎回费率为零。

2.本期基金收益分配日按公允价值分配。

3.本基金实行货币服务费收取方式，分设两类基金份额：A类基金份额和E类基金份额。A类基金份额与E类基金份额的管理费、托管费相同，A类基金份额按照0.25%的年费率计提公允价值服务费，E类基金份额按照0.01%的年费率计提公允价值服务费。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，E类基金份额按新基金计算。

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，由于货币市场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。

5.本基金合同生效日为2016年10月19日，基金合同生效日至本报告期期末，本基金运作时间未满一年。

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. 交银天利宝货币A：

阶段	份额净值	份额净值增长	份额净值增长	业绩比较基准	业绩比较基准	①-③	②-④
自基金合同生效日起至T日	0.9897%	0.0018%	0.9710%	0.0000%	0.9797%	0.0018%	

注：本基金的业绩比较基准为活期存款利率(税后)。

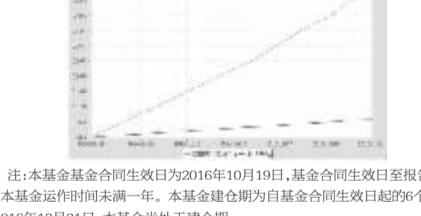
2. 交银天利宝货币B：

阶段	份额净值	份额净值增长	份额净值增长	业绩比较基准	业绩比较基准	①-③	②-④
自基金合同生效日起至T日	0.9893%	0.0018%	0.9710%	0.0000%	0.9793%	0.0018%	

注：本基金的业绩比较基准为活期存款利率(税后)。

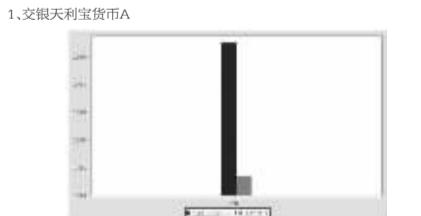
2.2.2 基金合同到期以来基金份额累计净值增长率变动与其同期业绩比较

1. 交银天利宝货币A：



注：本基金基金合同生效日为2016年10月19日，基金合同生效日至报告期末，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96个月。截至2016年12月31日，本基金尚未处于建仓期。

2. 交银天利宝货币B：



注：本基金基金合同生效日为2016年10月19日，基金合同生效日至报告期末，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96个月。截至2016年12月31日，本基金尚未处于建仓期。

3.2.3 过去三年基金的利润分配情况

交银天利宝货币A：

年度	已实现收益总额	直接通过红利再投资获得的金额	应付利润总额	备注
2016	1,016,037	-	267,000	2,074,06
合计	1,016,037	-	267,000	2,074,06

注：图示日期为2016年10月19日(基金合同生效日)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。

3.2.4 过去三年基金的利润分配情况

交银天利宝货币B：

年度	已实现收益总额	直接通过红利再投资获得的金额	应付利润总额	备注
2016	54,273,01	-	2,977,280	3,000
合计	54,273,01	-	2,977,280	3,000

注：图示日期为2016年10月19日(基金合同生效日)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。

4. 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理的情况

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字[2006]128号文批准，由交通银行股份有限公司、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，注册资本为1亿元人民币。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，中国海运集装箱(集团)股份有限公司持有5%的股份。并设有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

4.1.2.1 基金经理

黄莹女士，香港大学工商管理硕士，交银施罗德基金管理有限公司基金经理助理。

黄莹女士，香港大学工商管理硕士，交银施