

交银施罗德现金宝货币市场基金

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

1.1 重要提示

基金管理人、基金托管人、基金销售机构不存在虚假记载、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。基金管理人中信银行股份有限公司(以下简称“中信银行”)根据本基金合同约定，于2017年3月28日披露了本报告中财务数据、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，保证财务报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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

基金基本情况		交银现金宝货币
基金名称	交银现金宝货币	
基金代码	000710	
基金运作方式	契约开放式	
基金存续期限	不定期	
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	
报告期末基金份额总额	3,074,032,983.03份	
基金合同生效日期	2010年04月01日	
下属分级基金的基金简称	交银现金宝货币A 交银现金宝货币B	
报告期末下属分级基金的份额总额	3,043,361,201.49份 30,497,781.54份	

2.2 基金产品说明	
投资目标	力求基金安全稳健并追求长期稳定的投资回报，力求超越业绩比较基准。
投资策略	本基金采取积极配置和适度主动的资产配置，结合对国内外宏观经济运行、金融市场环境、资金流动情况、货币市场收益率曲线等因素进行综合分析，在严格控制风险的前提下，积极把握市场机会，实现基金资产的增值和长期稳定的投资目标。
业绩比较基准	货币市场利率(税后)
风险收益特征	本基金属于货币市场基金，是证券投资基金中风险最低品种，长期风险收益特征明显低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。

2.3 基金管理人及基金托管人	
名称	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 中信银行股份有限公司
法定代表人	王康 方方
注册地址	上海市浦东新区世纪大道1601号36楼 北京市西城区金融大街19号
办公地址	上海市浦东新区世纪大道1601号36楼 北京市西城区金融大街19号
客服电话	400-700-0000, 021-68600000 95568
网址	www.fund123.com www.bocchina.com.cn

2.4 信息披露披露方式	
信息披露年度内指定信息披露网站	www.fund123.com www.bocchina.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人处

3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

指标	交联基金宝货币A	交联基金宝货币B	交联基金宝货币A	交联基金宝货币B	交联基金宝货币A	交联基金宝货币B
本期已实现收益	89,350,198.44	71,917.76	26,171,134.00	-	1,434,493.59	-
本期利润	89,350,198.44	71,917.76	26,171,134.00	-	1,434,493.59	-
本期净增值收益率	2.26%	0.7278%	3.76%	-	0.978%	-
1.2 基金份额净值						
	交联基金宝货币A	交联基金宝货币B	交联基金宝货币A	交联基金宝货币B	交联基金宝货币A	交联基金宝货币B
期末基金资产净值	3,043,361,201.49	167,654,589.11	2,275,311,611.11	-	599,443.76	-
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	-	1.0000	-

注：1. 本基金申购赎回费为零。

2. 本基金收益分配按结转后处理。

3. 自2016年8月15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、销售服务费按照0.25%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. 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

交银现金宝货币A	
阶段	份额净值收益率 份额净值收益率标准差 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率标准差
过去三个月	0.0243% 0.0007% 0.0022% 0.0007% 0.4425% 0.0007%
过去六个月	1.0052% 0.0007% 0.1764% 0.0007% 0.9108% 0.0007%
过去一年	2.3400% 0.0014% 0.3707% 0.0007% 1.8505% 0.0014%
自基金合同生效以来	7.1156% 0.0007% 0.0747% 0.0007% 6.2301% 0.0014%

注：本基金的业绩比较基准为活期存款利率(税后)。

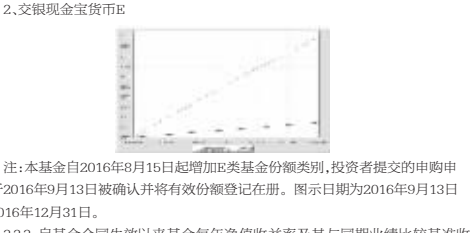
2. 交银现金宝货币B

交银现金宝货币B	
阶段	份额净值收益率 份额净值收益率标准差 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率标准差
过去三个月	0.0241% 0.0007% 0.0022% 0.0007% 0.4425% 0.0007%
过去六个月	1.0051% 0.0007% 0.1764% 0.0007% 0.9108% 0.0007%
过去一年	2.3399% 0.0014% 0.3707% 0.0007% 1.8505% 0.0014%
自基金合同生效以来	7.1155% 0.0007% 0.0747% 0.0007% 6.2301% 0.0014%

注：本基金的业绩比较基准为活期存款利率(税后)。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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. 交银现金宝货币A



注：图示日期为2014年9月12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. 交银现金宝货币B



注：图示日期为2014年9月12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. 过去3个月末的利润分配情况

交银现金宝货币A	
年度	已实现投资收益/费用 直接计入所有者权益的公允价值变动损益 期初所有者权益 年度利润分配金额
2016	89,350,198.44 - 69,735.07 1,434,493.59 1,374,758.52
2015	26,171,134.00 - 71,420.08 26,171,134.00 26,100,000.00
2014	1,434,493.59 - 71,032.18 1,434,493.59 1,363,461.41
合计	116,955,826.03 - 208,187.33 1,434,493.59 1,744,321.02

单位：人民币元

交银现金宝货币B

交银现金宝货币B	
年度	已实现投资收益/费用 直接计入所有者权益的公允价值变动损益 期初所有者权益 年度利润分配金额
2016	89,350,198.44 - 71,367.04 1,374,758.52 1,303,391.48
2015	26,171,134.00 - 71,420.08 26,171,134.00 26,100,000.00
2014	1,434,493.59 - 71,032.18 1,434,493.59 1,363,461.41
合计	116,955,826.03 - 208,187.33 1,434,493.59 1,744,321.02

单位：人民币元

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金投资情况

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、中国上海国际信托有限公司(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，注册资本为22亿元人民币。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，中国上海国际信托有限公司(集团)股份有限公司持有5%的股份。公司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(香港)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 and 股票型在内的60只基金，其中股票型基金普通混合型、交易型开放式(ETF)、QDII等不同类型的基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金基金经理的简历

基金管理人：交银施罗德基金管理有限公司(特别普通合伙)对交银施罗德现金宝货币市场基金2016年12月31日的资产负债、2016年度的利润表、所有者权益变动表(净值表现)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139号)。投资者可通过上述基金年度报告正文查看该审计报告全文。

7.1 资产负债表

单位：人民币元

资产负债表	
资产	负债和所有者权益
货币资金	应付账款
交易性金融资产	应付利息
应收账款	应付股利
预付款项	其他应付款
其他流动资产	其他流动负债
其他长期资产	其他长期负债
所有者权益合计	负债和所有者权益合计

注：1. 本表所有项目均以人民币列示。

2. 本表所有项目均以人民币列示。

3. 本表所有项目均以人民币列示。

4. 本表所有项目均以人民币列示。

5. 本表所有项目均以人民币列示。

6. 本表所有项目均以人民币列示。

7. 本表所有项目均以人民币列示。

8. 本表所有项目均以人民币列示。

9. 本表所有项目均以人民币列示。

10. 本表所有项目均以人民币列示。

11. 本表所有项目均以人民币列示。

12. 本表所有项目均以人民币列示。

13. 本表所有项目均以人民币列示。

14. 本表所有项目均以人民币列示。

15. 本表所有项目均以人民币列示。

16. 本表所有项目均以人民币列示。

17. 本表所有项目均以人民币列示。

18. 本表所有项目均以人民币列示。

19. 本表所有项目均以人民币列示。

20. 本表所有项目均以人民币列示。

21. 本表所有项目均以人民币列示。

22. 本表所有项目均以人民币列示。

23. 本表所有项目均以人民币列示。

24. 本表所有项目均以人民币列示。

25. 本表所有项目均以人民币列示。

26. 本表所有项目均以人民币列示。

27. 本表所有项目均以人民币列示。

28. 本表所有项目均以人民币列示。

29. 本表所有项目均以人民币列示。

30. 本表所有项目均以人民币列示。

31. 本表所有项目均以人民币列示。

32. 本表所有项目均以人民币列示。

33. 本表所有项目均以人民币列示。

34. 本表所有项目均以人民币列示。

35. 本表所有项目均以人民币列示。

36. 本表所有项目均以人民币列示。

37. 本表所有项目均以人民币列示。

38. 本表所有项目均以人民币列示。

39. 本表所有项目均以人民币列示。

40. 本表所有项目均以人民币列示。

41. 本表所有项目均以人民币列示。

42. 本表所有项目均以人民币列示。

43. 本表所有项目均以人民币列示。

44. 本表所有项目均以人民币列示。

45. 本表所有项目均以人民币列示。

46. 本表所有项目均以人民币列示。

47. 本表所有项目均以人民币列示。

48. 本表所有项目均以人民币列示。

49. 本表所有项目均以人民币列示。

50. 本表所有项目均以人民币列示。

51. 本表所有项目均以人民币列示。

52. 本表所有项目均以人民币列示。

53. 本表所有项目均以人民币列示。

54. 本表所有项目均以人民币列示。

55. 本表所有项目均以人民币列示。

56. 本表所有项目均以人民币列示。

57. 本表所有项目均以人民币列示。

58. 本表所有项目均以人民币列示。

59. 本表所有项目均以人民币列示。

60. 本表所有项目均以人民币列示。

61. 本表所有项目均以人民币列示。

62. 本表所有项目均以人民币列示。

63. 本表所有项目均以人民币列示。

64. 本表所有项目均以人民币列示。

65. 本表所有项目均以人民币列示。

66. 本表所有项目均以人民币列示。

67. 本表所有项目均以人民币列示。

68. 本表所有项目均以人民币列示。

69. 本表所有项目均以人民币列示。

70. 本表所有项目均以人民币列示。

71. 本表所有项目均以人民币列示。

72. 本表所有项目均以人民币列示。

73. 本表所有项目均以人民币列示。

74. 本表所有项目均以人民币列示。

75. 本表所有项目均以人民币列示。

76. 本表所有项目均以人民币列示。

77. 本表所有项目均以人民币列示。

78. 本表所有项目均以人民币列示。

79. 本表所有项目均以人民币列示。

80. 本表所有项目均以人民币列示。

81. 本表所有项目均以人民币列示。

82. 本表所有项目均以人民币列示。

83. 本表所有项目均以人民币列示。

84. 本表所有项目均以人民币列示。

85. 本表所有项目均以人民币列示。

86. 本表所有项目均以人民币列示。

87. 本表所有项目均以人民币列示。

88. 本表所有项目均以人民币列示。

89. 本表所有项目均以人民币列示。

90. 本表所有项目均以人民币列示。

91. 本表所有项目均以人民币列示。

92. 本表所有项目均以人民币列示。

93. 本表所有项目均以人民币列示。

94. 本表所有项目均以人民币列示。

95. 本表所有项目均以人民币列示。

96. 本表所有项目均以人民币列示。

97. 本表所有项目均以人民币列示。

98. 本表所有项目均以人民币列示。

99. 本表所有项目均以人民币列示。

100. 本表所有项目均以人民币列示。

101. 本表所有项目均以人民币列示。

102. 本表所有项目均以人民币列示。

103. 本表所有项目均以人民币列示。

104. 本表所有项目均以人民币列示。

105. 本表所有项目均以人民币列示。

106. 本表所有项目均以人民币列示。

107. 本表所有项目均以人民币列示。

108. 本表所有项目均以人民币列示。

109. 本表所有项目均以人民币列示。

110. 本表所有项目均以人民币列示。

111. 本表所有项目均以人民币列示。

112. 本表所有项目均以人民币列示。

113. 本表所有项目均以人民币列示。

114. 本表所有项目均以人民币列示。

115. 本表所有项目均以人民币列示。

116. 本表所有项目均以人民币列示。

117. 本表所有项目均以人民币列示。

118. 本表所有项目均以人民币列示。

119. 本表所有项目均以人民币列示。

120. 本表所有项目均以人民币列示。

121. 本表所有项目均以人民币列示。

122. 本表所有项目均以人民币列示。

123