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:二〇一四年三月二十六日

交银施罗德理财21天债券型证券投资基金

2013年度报告摘要

2013年12月31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2014年3月24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2013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	102,266,739.63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	84,634,331.81份	17,632,407.82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	李芳菲
	联系电话	021-61055050	010-66060069
	电子邮箱	xxpl@jyshd.com, disclosure@jyshd.com	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		400-700-5000,021-61055000	95599
传真		021-61055054	010-63201816

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.bocomschroder.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	2013年		2012年11月5日(基金合同生效日)至2012年12月31日
	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
本期已实现收益	13,892,420.71	20,696,462.24	23,171,426.51
本期利润	13,892,420.71	20,696,462.24	23,171,426.51
本期净值收益率	4.11%	4.26%	0.56%
3.1.2期末数据和指标	2013年末		2012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
期末基金资产净值	84,634,331.81	17,632,407.82	1,274,213,061.31
期末基金份额净值	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。

5、本基金于2013年1月9日起实行销售服务费分类收费模式,截至本报告期末,本基金B类份额运作未满一年。

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. 交银理财21天债券A:

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	1.0342%	0.0033%	0.3403%	0.0000%	0.6939%	0.0033%
过去六个月	2.1819%	0.0030%	0.6805%	0.0000%	1.5014%	0.0030%
过去一年	4.1106%	0.0054%	1.3500%	0.0000%	2.7606%	0.0054%
自基金合同生效起至今	4.6982%	0.0053%	1.5608%	0.0000%	3.1374%	0.0053%

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	1.1082%	0.0033%	0.3403%	0.0000%	0.7679%	0.0033%
过去六个月	2.3316%	0.0030%	0.6805%	0.0000%	1.6511%	0.0030%
自基金分类日起至今	4.2610%	0.0046%	1.3204%	0.0000%	2.9406%	0.0046%

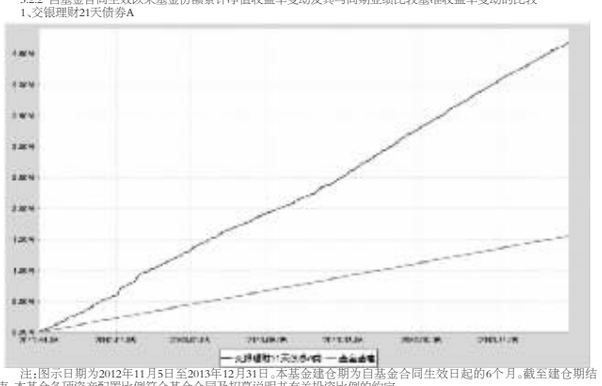
注:1、本表净值收益率数据所取的基金运作周期为基金分类日为起始日的运作周期。

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。

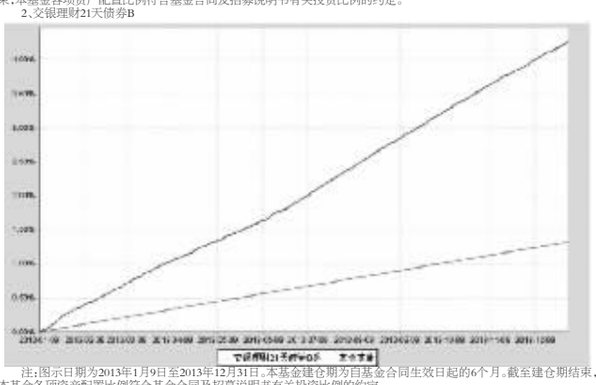
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

1、交银理财21天债券A



注:图示日期为2012年11月5日至2013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。

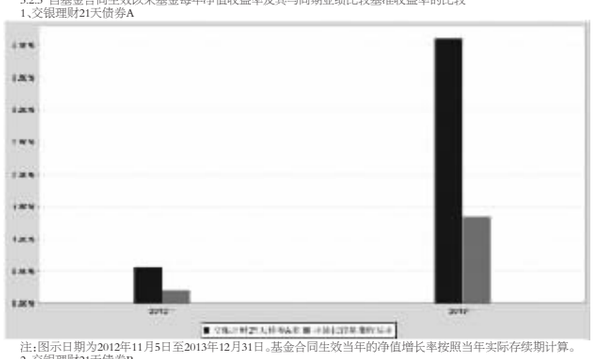
2、交银理财21天债券B



注:图示日期为2013年1月9日至2013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。

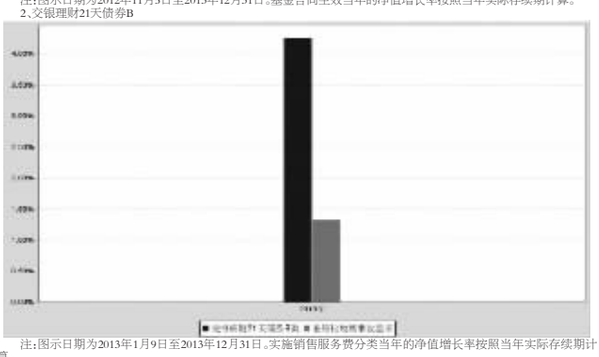
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1、交银理财21天债券A



注:图示日期为2012年11月5日至2013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2013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

1、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
2013年	10,242,463.93	5,092,968.47	-1,443,011.69	13,892,420.71	-
2012年	6,013,677.71	15,386,346.72	1,771,402.08	23,171,426.51	-
合计	16,256,141.64	20,479,315.19	328,390.39	37,063,847.22	-

2、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
2013年	12,557,634.02	8,360,248.53	-221,420.31	20,696,462.24	-
合计	12,557,634.02	8,360,248.53	-221,420.31	20,696,462.24	-

§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

本基金的基金管理人为交银施罗德基金管理有限公司。交银施罗德基金管理有限公司是经中国证监会证监基字[2005]128号文批准,于2005年8月4日成立的合资基金管理公司。公司总部设于上海,注册资本为2亿元人民币。截止到2013年12月31日,公司已经发行并管理的基金共有三十一只:交银施罗德精选股票证券投资基金(基金合同生效日:2005年9月29日)、交银施罗德货币市场证券投资基金(基金合同生效日:2006年1月20日)、交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金(基金合同生效日:2006年6月14日)、交银施罗德成长股票证券投资基金(基金合同生效日:2006年10月23日)、交银施罗德监筹股票证券投资基金(基金合同生效日:2007年8月8日)、交银施罗德增利债券证券投资基金(基金合同生效日:2008年3月31日)、交银施罗德环球精选价值证券投资基金(基金合同生效日:2008年8月22日)、交银施罗德优势行业灵活配置混合型证券投资基金(基金合同生效日:2009年1月21日)、交银施罗德先锋股票证券投资基金(基金合同生效日:2009年4月10日)、上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金(基金合同生效日:2009年9月25日)、交银施罗德上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金(基金合同生效日:2009年9月29日)、交银施罗德主题优选灵活配置混合型证券投资基金(基金合同生效日:2010年6月30日)、交银施罗德趋势优先股票证券投资基金(基金合同生效日:2010年12月22日)、交银施罗德信用添利债券证券投资基金(基金合同生效日:2011年1月27日)、交银施罗德先进制造股票证券投资基金(基金合同生效日:2011年6月22日)、深证300价值交易型开放式指数证券投资基金(基金合同生效日:2011年9月22日)、交银施罗德双利债券证券投资基金(基金合同生效日:2011年9月26日)、交银施罗德深证300价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金(基金合同生效日:2011年9月28日)、交银施罗德全球自然资源证券投资基金(基金合同生效日:2012年5月22日)、交银施罗德荣安保本混合型证券投资基金(基金合同生效日:2012年6月20日)、交银施罗德阿尔法核心股票型证券投资基金(基金合同生效日:2012年8月3日)、交银施罗德理财21天债券型证券投资基金(基金合同生效日:2012年11月5日)、交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金(基金合同生效日:2012年11月7日)、交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金(基金合同生效日:2012年12月19日)、交银施罗德理财60天债券型证券投资基金(基金合同生效日:2013年3月13日)、交银施罗德双轮动债券型证券投资基金(基金合同生效日:2013年4月18日)、交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金(基金合同生效日:2013年4月24日)、交银施罗德成长30股票型证券投资基金(基金合同生效日:2013年6月5日)、交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金(基金合同生效日:2013年8月13日)、交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金(基金合同生效日:2013年9月4日)、交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金(基金合同生效日:2013年12月25日)。

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		
林洪钧	本基金、交银货币、交银信用添利债券的基金经理,交银荣安保本混合、交银荣祥保本混合的基金经理助理,公司固定收益部助理总经理	2012-11-05	-	9年	林洪钧先生,复旦大学学士。历任国泰君安证券股份有限公司上海分公司机构客户部客户经理,华安基金管理有限公司债券交易员,加拿大Financial Engineering Source Inc.金融研究员。2009年加入交银施罗德基金管理有限公司,历任专户投资部投资经理助理、专户投资经理。

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。

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不存在异常交易行为。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没有超过该证券当日总成交量5%的情形,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出现异常。

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

2013年对债券市场是一个较为惨痛的年份,上半年主要受流动性推升影响,收益率逐级走低,也给债券基金带来较为丰厚的回报;自4月监管风暴,到6月钱荒事件,再到利率市场化大背景下三季度无风险利率的大幅飙升,债券从业者在2013年里经历了流动性风险、利率风险、信用风险的三重考验。尤其是较为惨痛的三季度开始的无风险利率的飙升,10年期国债收益率从3.8%最高上行至4.7%水平;在无风险利率继续上行过程中,信用产品的收益呈现加速上行的走势,5年AA企业债(有担保)的估值收益从6.2%快速上行至7.5%以上水平,信用利差开始扩大。期限结构上看,期限利差依旧较小、收益率曲线仍极为平坦。

宏观方面,CPI在10月份上升到全年最高点3.2%之后开始小幅回落;受食品涨幅回落影响,11月CPI同比降至3.0%,12月同比预计将继续下降。与通胀走势相仿,工业增加值在11月也出现了下降的趋势。在基本面小幅回落的情况下,12月无风险利率上升的趋势趋缓,然而信用产品收益在12月继续上行,使得信用利差继续扩大。总体而言,四季度债券收益率的上行主要仍受到银行资产负债表调整以及对年底流动性紧张预期双方面的影响。

本基金在四季度仍保持较大比例的银行协议存款,提高了组合的静态收益,也在年底流动性较为紧张的情况下,保持了基金收益的平稳。

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4.1106%,同期业绩比较基准增长率为1.3500%;交银理财21天债券B净值收益率4.2610%,同期业绩比较基准增长率为1.3204%。

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2014年,我们可以从债券市场的四个维度去分析:基本面、流动性、供求、估值。

2014年经济增长动能仍然趋弱,2013年高企利率或将抑制投资需求,而消费相对保持稳定,海外的复苏从目前数据来看应好于此前预期,通胀在上半年保持较低水平或将是大概率事件。因此综合来看,经济大幅向上或大幅向下可能性都比较低,较大可能性在围绕7.5%的中枢运行。

流动性上看,从央行公布利率走廊以及四季度货币政策报告上看,维持利率的稳定将是全年的基调;因此,流动性在2014年应优于2013年,而从NDF表现出的汇率走势上看,人民币依旧处于升值预期,外汇占款对流动性的影响仍较正面,我们需要更多地关注央行在公开市场上的操作及其走度。

2013年的利率高企是否真的会大量抑制融资需求无法量化,但从传统分析上看,边际影响不容忽视;另一方面,随着2013年券商、保险、基金、银行各家都降低了组合杠杆及久期,从需求上看,市场有能力承受一定的供给。但利率产品的供给仍将较多,同样将对收益率可能的下行造成不利影响。更重要的是,2013年对影子银行、非标资产的规范及清理工作是否能在2014年真正得以实施也将对债券市场产生重要的影响。

从估值上看,债券的绝对收益和信用利差都处于较高水平。

综合以上四点,2014年基本面可能趋弱,货币市场的流动性可能将优于2013年;对短期理财基金而言,若协议存款和短端利率下行,整体货币市场的收益率也将适当下行。

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。

§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

在托管交银施罗德理财21天债券型证券投资基金的过程中,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《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》的约定,对交银施罗德理财21天债券型证券投资基金管理人—交银施罗德基金管理有限公司2013年1月1日至2013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交银施罗德理财21天债券型证券投资基金的投资运作、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交银施罗德理财21天债券型证券投资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2013年12月31日及2012年12月31日的资产负债表、2013年度和2012年11月5日(基金合同生效日)至2012年12月31日期间的利润表、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(2014)第20553号)。投资者可通过本基金年度报告正文查看该审计报告正文。

§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:2013年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
资 产:			
银行存款	7.4.7.1	82,544,514.47	816,621,648.21
结算备付金		-	15,909.09
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	9,997,027.85	701,722,152.89
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		9,997,027.85	701,722,152.89
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	10,000,000.00	47,400,311.10
应收证券清算款		4,008,166.67	-
应收利息	7.4.7.5	714,386.71	19,458,645.19
应收股利		-	-
应收申购款		33,555.00	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		107,297,650.70	1,585,218,666.48
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012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		-	306,272,700.59
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		4,464,280.57	1,693,870.22
应付管理人报酬		30,330.18	414,226.85
应付托管费		8,986.70	122,733.89
应付销售服务费		27,125.97	460,252.03
应付交易费用	7.4.7.7	11,330.82	24,969.60
应交税费		-	-
应付利息		-	199,910.31
应付利润		106,970.08	1,771,402.08
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	381,886.75	45,539.60
负债合计		5,030,911.07	311,005,605.17
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	102,266,739.63	1,274,213,061.31
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		102,266,739.63	1,274,213,061.31
负债和所有者权益总计		107,297,650.70	1,585,218,666.48

注:1、报告截止日2013年12月31日,基金份额净值1.000元,基金份额总额102,266,739.63份,其中A类基金份额84,634,331.81份,B类基金份额17,632,407.82份。

2、本财务报表的实际编制期间为2013年度和2012年11月5日(基金合同生效日)至2012年12月31日。

3、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:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年11月5日(基金合同生效日)至2012年12月31日
一、收入		41,297,378.21	29,102,413.08
1.利息收入		37,796,778.32	27,439,973.22
其中:存款利息收入	7.4.7.11	23,334,038.89	22,822,190.52
债券利息收入		12,759,130.35	4,342,243.37
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,703,609.08	275,539.33
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		3,048,792.84	1,662,439.86
其中:股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.12	3,048,792.84	1,662,439.86
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	451,807.05	-
减:二、费用		6,708,495.26	5,930,986.57
1.管理人报酬		2,338,114.39	1,840,296.90
2.托管费		692,774.46	545,273.28
3.销售服务费		1,102,532.31	2,044,774.36
4.交易费用		-	-
5.利息支出		2,137,786.45	1,441,984.95
其中:卖出回购金融资产支出		2,137,786.45	1,441,984.95
6.其他费用	7.4.7.15	437,287.65	58,657.08
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		34,588,882.95	23,171,426.51
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		34,588,882.95	23,171,426.51

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:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013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、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	34,588,882.95	34,588,882.95
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)	-1,171,946,321.68	-	-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基金净值变动(净值减少以"-"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

项目	上年度可比期间 2012年11月5日(基金合同生效日)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)	8,505,567,812.46	-	8,505,567,812.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	23,171,426.51	23,171,426.51
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)	-7,231,354,751.15	-	-7,231,354,751.15
其中:1.基金申购款	532,891,140.96	-	532,891,140.96
2.基金赎回款	-7,764,245,892.11	-	-7,764,245,892.11
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)	-	-23,171,426.51	-23,171,426.51
五、期末所有者权益(基金净值)	1,274,213,061.31	-	1,274,213,061.31

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:战龙,主管会计工作负责人:许珊燕,会计机构负责人:朱鸣

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》、《交银施罗德理财21天债券型证券投资基金托管协议》的约定,对交银施罗德理财21天债券型证券投资基金管理人—交银施罗德基金管理有限公司2013年1月1日至2013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交银施罗德理财21天债券型证券投资基金的投资运作、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交银施罗德理财21天债券型证券投资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2013年12月31日及2012年12月31日的资产负债表、2013年度和2012年11月5日(基金合同生效日)至2012年12月31日期间的利润表、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(2014)第20553号)。投资者可通过本基金年度报告正文查看该审计报告正文。

§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:2013年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
资 产:			
银行存款	7.4.7.1	82,544,514.47	816,621,648.21
结算备付金		-	15,909.09
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	9,997,027.85	701,722,152.89
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		9,997,027.85	701,722,152.89
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	10,000,000.00	47,400,311.10
应收证券清算款		4,008,166.67	-
应收利息	7.4.7.5	714,386.71	19,458,645.19
应收股利		-	-
应收申购款		33,555.00	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		107,297,650.70	1,585,218,666.48
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012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		-	306,272,700.59
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		4,464,280.57	1,693,870.22
应付管理人报酬		30,330.18	414,226.85
应付托管费		8,986.70	122,733.89
应付销售服务费		27,125.97	460,252.03
应付交易费用	7.4.7.7	11,330.82	24,969.60
应交税费		-	-
应付利息		-	199,910.31
应付利润		106,970.08	1,771,402.08
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	381,886.75	45,539.60
负债合计		5,030,911.07	311,005,605.17
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	102,266,739.63	1,274,213,061.31
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		102,266,739.63	1,274,213,061.31
负债和所有者权益总计		107,297,650.70	1,585,218,666.48

注:1、报告截止日2013年12月31日,基金份额净值1.000元,基金份额总额102,266,739.63份,其中A类基金份额84,634,331.81份,B类基金份额17,632,407.82份。

2、本财务报表的实际编制期间为2013年度和2012年11月5日(基金合同生效日)至2012年12月31日。

3、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:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期 2013年1月1日至2013年12月31日 | 上年度可比期间 2012年11月5日(