

交银施罗德货币市场证券投资基金
2011 年半年度报告
2011 年 6 月 30 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
报告送出日期：二〇一一年八月二十四日

1 重要提示及目录

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。本半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 2011 年 8 月 23 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，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
7 投资组合报告	31
7.1 期末基金资产组合情况	31
7.2 债券回购融资情况	31
7.3 基金投资组合平均剩余期限	32
7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合	32
7.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细	33
7.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	33
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	33
7.8 投资组合报告附注	34
8 基金份额持有人信息	34
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	34
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况	35
9 开放式基金份额变动	35
10 重大事件揭示	35
10.1 基金份额持有人大会决议	35

10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	35
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	35
10.4	基金投资策略的改变	36
10.5	报告期内改聘会计师事务所情况	36
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况	36
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	36
10.8	偏离度绝对值超过 0.5% 的情况	36
10.9	其他重大事件	37
11	备查文件目录	38
11.1	备查文件目录	38
11.2	存放地点	39
11.3	查阅方式	39

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	交银施罗德货币市场证券投资基金	
基金简称	交银货币	
基金主代码	519588	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2006年1月20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	832,739,575.19份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	交银货币A	交银货币B
下属分级基金的交易代码	519588	519589
报告期末下属分级基金的 份额总额	201,806,310.25份	630,933,264.94份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金属于货币市场基金，投资目标是在力求本金稳妥和资产充分流动性的前提下，追求超过业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金在保持组合高度流动性的前提下，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	六个月银行定期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金是具有较低风险、中低收益、流动性强的证券投资基金品种。

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	姓名	陈超	李芳菲

负责人	联系电话	021-61055050	010-66060069
	电子邮箱	xxpl@jysld.com, disclosure@jysld.com	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		400-700-5000, 021-61055000	95599
传真		021-61055034	010-63201816
注册地址		上海市浦东新区银城中路 188 号交通 银行大楼二层（裙）	北京市东城区建国门内 大街 69 号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道 201 号渣打 银行大厦 10 楼	北京市西城区复兴门内 大街 28 号凯晨世贸中 心东座 F9
邮政编码		200120	100031
法定代表人		钱文挥	项俊波

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露 报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》
登载基金半年度报告正 文的管理人互联网网址	www.jyfund.com, www.jysld.com, www.bocomschroder.com
基金半年度报告备置地 点	基金管理人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公 司	北京市西城区太平桥大街 17 号

3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期（2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日）	
	交银货币 A	交银货币 B
本期已实现收益	3,108,426.14	23,928,739.82
本期利润	3,108,426.14	23,928,739.82
本期净值收益率	1.46%	1.58%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2011年6月30日)	
	交银货币 A	交银货币 B
期末基金资产净值	201,806,310.25	630,933,264.94
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2011年6月30日)	
	交银货币 A	交银货币 B
累计净值收益率	13.26%	11.18%

注：1、本基金申购赎回费为零；

2、本基金收益分配按月结转份额；

3、本基金自2007年6月22日起实施销售服务费分级收费方式，B级基金份额2007年度的会计数据和财务指标计算的期间为2007年6月22日至2007年12月31日；

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。

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. 交银货币 A:

阶段	份额净值收益率①	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
过去一个月	0.2705%	0.0060%	0.2507%	0.0000%	0.0198%	0.0060%
过去三个月	0.7987%	0.0050%	0.7570%	0.0002%	0.0417%	0.0048%
过去六个月	1.4571%	0.0039%	1.4153%	0.0006%	0.0418%	0.0033%
过去一年	2.3979%	0.0037%	2.4624%	0.0012%	-0.0645%	0.0025%
过去三年	6.3376%	0.0063%	7.0677%	0.0016%	-0.7301%	0.0047%
自基金合同生效起至今	13.2603%	0.0057%	12.9254%	0.0019%	0.3349%	0.0038%

2. 交银货币 B:

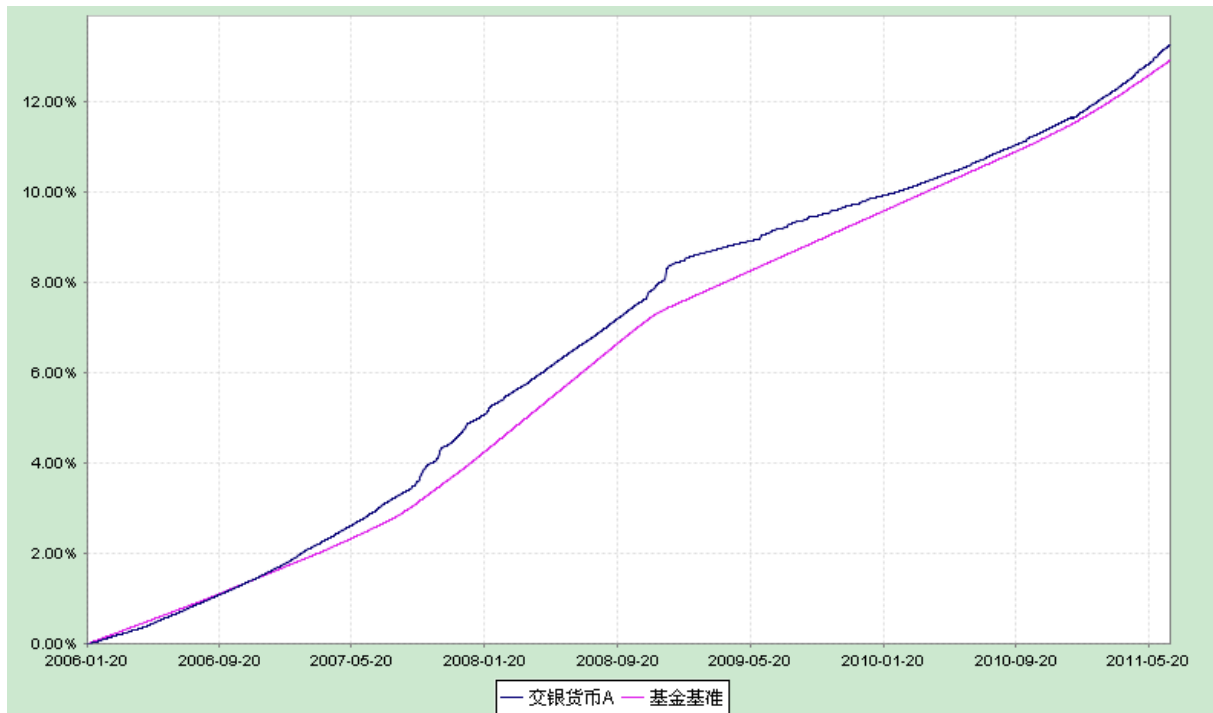
阶段	份额净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个	0.2903%	0.0059%	0.2507%	0.0000%	0.0396%	0.0059%

月						
过去三个月	0.8587%	0.0050%	0.7570%	0.0002%	0.1017%	0.0048%
过去六个月	1.5777%	0.0039%	1.4153%	0.0006%	0.1624%	0.0033%
过去一年	2.6436%	0.0037%	2.4624%	0.0012%	0.1812%	0.0025%
过去三年	7.1050%	0.0063%	7.0677%	0.0016%	0.0373%	0.0047%
自基金分级日起至今	11.1794%	0.0064%	10.4029%	0.0018%	0.7765%	0.0046%

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

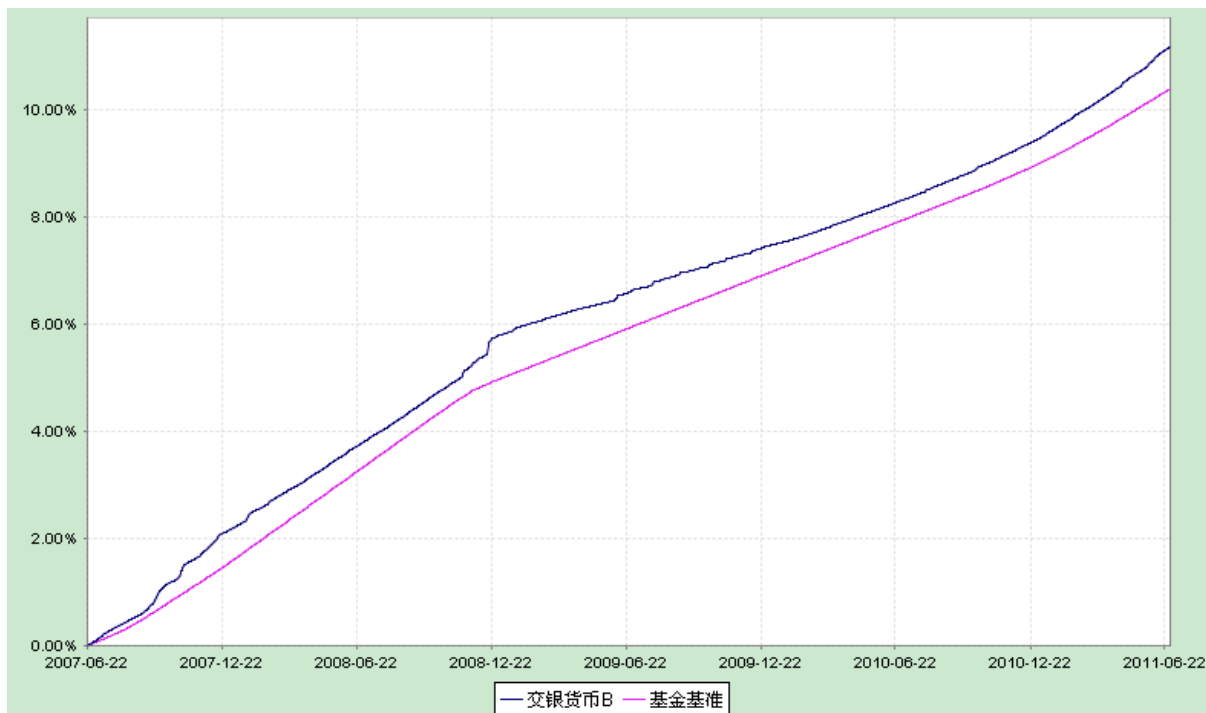
交银施罗德货币市场证券投资基金
份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2006年1月20日至2011年6月30日)

1、交银货币 A



注：图示日期为2006年1月20日至2011年6月30日。

2、交银货币 B



注：图示日期为 2007 年 6 月 22 日至 2011 年 6 月 30 日。

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 2011 年 6 月 30 日，公司已经发行并管理的基金共有十五只：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）、交银施罗德蓝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）、交银施罗德保本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）和交银

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）。

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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
林洪钧	本基金的基金经理、交银施罗德信用添利债券证券投资基金基金经理	2011-06-09	-	7年	林洪钧先生，学士学历。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。
李家春	本基金的基金经理、交银施罗德增利债券证券投资基金基金经理、公司固定收益部副总经理	2006-12-27	2011-06-09	12年	李家春先生，香港大学 MBA。历任长江证券有限责任公司投资经理，汉唐证券有限责任公司高级经理、投资主管，泰信基金管理有限公司高级研究员。2006年加入交银施罗德基金管理有限公司。

注：1、本表所列基金经理任职日期和离职日期均以基金合同生效日或公司做出决定并公告(如适用)之日为准；

2、本表所列基金经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守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管

理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、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、安全高效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 公平交易制度的执行情况

本公司有严格的投资控制制度和风险监控制度来保证旗下基金运作的公平，报告期内本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合。本投资组合与公司旗下管理的不同投资组合的整体收益率、分投资类别（股票、债券）的收益率以及不同时间窗内（同日内、5日内、10日内）同向交易的交易价格并未发现异常差异。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本公司旗下无与本基金投资风格相似的其他投资组合。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未发现异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2011 年上半年的债券市场短端收益率受偏紧的货币政策与资金面的影响而逐渐走高。截至 2011 年 7 月上旬，中国人民银行三次上调一年期存款基准利率至 3.50%，并 6 次提高存款准备金率至 21.50%。受紧缩货币政策的影响，宏观经济出现了一定程度的回落。与此同时，通胀却始终居高不下，6 月我国 CPI 同比 6.4%，通胀在上半年成为困扰资本市场的挥之不去的问题。

受紧缩货币政策影响，货币市场资金面整体趋紧，回购利率较去年同期上升明显。尤其在 6 月份，银行间市场 1 天回购利率均值达 5.26%，7 天回购更是达到 6.33%。本报告期内，1 年期央票利率上行 32BP 至 3.79%。在整个上半年资金紧张的情况下，本基金保持相对稳健的投资，以保证本基金的良好流动性和安全性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，交银货币 A 净值收益率为 1.4571%，交银货币 B 净值收益率为 1.5777%，同期业绩比较基准增长率为 1.4153%。

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 2011 年下半年，在流动性不断趋紧的情况下，继续动用数量工具的频率可能

降低，价格工具的调整同样受制于实体经济增速的放缓。因此，下半年货币市场受货币政策影响的程度可能将比上半年小，回购利率长期保持 6 月份高位的可能性也不高。由于债券短端收益率在 6 月份的大幅上行，下半年货币市场收益上承担的压力将小于上半年。

尽管我们认为回购利率不会长期保持 6 月份的高位，但可以预期的是，回购利率的下滑将比较缓慢，这将是影响货币市场整体规模的一个重要因素。由于目前组合内资产配置较为合理，在保证良好流动性前提下，本基金将尽力为投资者在下半年争取更稳健的收益。

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，由金融工程部进行测算和认证，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其适用性的情况后，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，本报告期内交银货币 A 级、B 级利润分配信息列示如下：

单位：人民币元

份额级别	本报告期内应分配金额	本报告期内已分配金额	尚未分配利润金额	备注
交银货币 A	3,108,426.14	3,108,426.14	-	每日分配，按月结转份额
交银货币 B	23,928,739.82	23,928,739.82	-	每日分配，按月结转份额
合计	27,037,165.96	27,037,165.96	-	

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

在托管交银施罗德货币市场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》等相关法律法规的规定以及《交银施罗德货币市场证券投资基金基金合同》、《交银施罗德货币市场证券投资基金托管协议》的约定，对交银施罗德货币市场证券投资基金管理人—交银施罗德基金管理有限公司 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 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货币市场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 托管人对本半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货币市场证券投资基金半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。

中国农业银行股份有限公司托管业务部
2011 年 8 月 23 日

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：交银施罗德货币市场证券投资基金

报告截止日：2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	13,673,596.37	618,377,187.91
结算备付金		1,452,380.95	-

存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	834,255,626.13	1,612,805,066.61
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		834,255,626.13	1,612,805,066.61
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	99,000,268.50	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	13,250,925.64	15,690,517.63
应收股利		-	-
应收申购款		448,630.76	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		962,081,428.35	2,246,872,772.15
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		119,999,820.00	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		4,156,621.43	771,643.48
应付管理人报酬		337,590.78	692,130.41
应付托管费		102,300.23	209,736.47
应付销售服务费		57,502.30	68,081.69
应付交易费用	6.4.7.7	13,645.92	12,549.66
应交税费		2,559,524.67	2,524,524.67
应付利息		16,618.36	-
应付利润		1,992,657.20	3,568,655.69
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	105,572.27	157,023.59
负债合计		129,341,853.16	8,004,345.66
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	832,739,575.19	2,238,868,426.49

未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		832,739,575.19	2,238,868,426.49
负债和所有者权益总计		962,081,428.35	2,246,872,772.15

注：报告截止日2011年6月30日，基金份额净值1.0000元，基金份额总额A级：201,806,310.25份，B级：630,933,264.94份。

6.2 利润表

会计主体：交银施罗德货币市场证券投资基金

本报告期：2011年1月1日至2011年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2011年1月1日至 2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年6月30日
一、收入		32,309,335.02	59,091,922.38
1.利息收入		29,834,956.20	56,709,618.90
其中：存款利息收入	6.4.7.11	8,819,751.36	9,350,808.04
债券利息收入		20,229,662.14	42,464,847.59
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		785,542.70	4,893,963.27
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,474,378.82	2,382,303.48
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	2,474,378.82	2,382,303.48
资产支持证券投资收益		-	-
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）		-	-
减：二、费用		5,272,169.06	14,677,071.02
1. 管理人报酬		2,922,483.77	10,106,570.16
2. 托管费		885,601.09	3,062,597.04
3. 销售服务费		344,957.08	890,810.15
4. 交易费用		-	-

5. 利息支出		998,475.56	493,147.31
其中：卖出回购金融资产支出		998,475.56	493,147.31
6. 其他费用	6.4.7.13	120,651.56	123,946.36
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		27,037,165.96	44,414,851.36
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		27,037,165.96	44,414,851.36

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：交银施罗德货币市场证券投资基金

本报告期：2011年1月1日至2011年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30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）	2,238,868,426.49	-	2,238,868,426.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	27,037,165.96	27,037,165.96
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）	-1,406,128,851.30	-	-1,406,128,851.30
其中：1.基金申购款	4,494,686,676.34	-	4,494,686,676.34
2.基金赎回款	-5,900,815,527.64	-	-5,900,815,527.64
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）	-	-27,037,165.96	-27,037,165.96
五、期末所有者权益（基金净值）	832,739,575.19	-	832,739,575.19
项目	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30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)	20,076,398,317.20	-	20,076,398,317.20
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	44,414,851.36	44,414,851.36
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)	-16,217,423,159.86	-	-16,217,423,159.86
其中：1.基金申购款	8,036,900,469.26	-	8,036,900,469.26
2.基金赎回款	-24,254,323,629.12	-	-24,254,323,629.12
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)	-	-44,414,851.36	-44,414,851.36
五、期末所有者权益 (基金净值)	3,858,975,157.34	-	3,858,975,157.34

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：战龙，主管会计工作负责人：许珊燕，会计机构负责人：张丽

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

交银施罗德货币市场证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人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》、《交银施罗德货币市场证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规的规定，经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2005]204 号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集基金份额为 4,741,255,133.16 份，经德勤华永会计师事务所有限公司验证，并出具了编号为德师报(验)字(06)第 0003 号验资报告。《交银施罗德货币市场证券投资基金基金合同》(以下简称“原基金合同”)于 2006 年 1 月 20 日正式生效。本基金因自 2007 年 7 月 1 日起执行财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)，于 2007 年 9 月 29 日公告了修改后的基金合同(以下简称“修改后的基金合同”)。本基金的管理人为交银施罗德基金管理有限公司，托管人为中国农业银行股份有限公司(以下简称“中国农业银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同、招募说明书及其定期更新的有关规定，本基金的投资范围为现金、通知存款、一年以内(含一年)的银行定期存款、

大额存单、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、期限在一年以内(含一年)的中央银行票据、期限在一年以内(含一年)的债券回购、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的资产支持证券以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金暂不投资于交易所债券。本基金的业绩比较基准采用：六个月银行定期存款利率(税后)。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金执行企业会计准则、中国证监会基金部【2010】5 号关于发布《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>》等问题的通知、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》和修改后的基金合同及中国证监会发布的其他关于基金行业实务操作的有关规定。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2011 年 6 月 30 日的财务状况以及 2011 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

- 1) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不缴纳营业税。
- 2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

3) 对基金取得的债券利息收入,由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2011年6月30日	
	活期存款	13,673,596.37
定期存款	-	
其他存款	-	
合计	13,673,596.37	

6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目		本期末 2011年6月30日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	834,255,626.13	834,560,600.00	304,973.87	0.0366
	合计	834,255,626.13	834,560,600.00	304,973.87	0.0366

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位:人民币元

项目	本期末 2011年6月30日	
	账面余额	其中:买断式逆回购
银行间	99,000,268.50	-
合计	99,000,268.50	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式买入返售金融资产。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
应收活期存款利息	4,172.87
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	653.60
应收债券利息	12,943,633.41
应收买入返售证券利息	302,465.76
应收申购款利息	-
其他	-
合计	13,250,925.64

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	13,645.92
合计	13,645.92

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	895.13
应付后端申购费	-
银行手续费	1,000.00
预提审计费	49,588.57
预提信息披露费	49,588.57

预提帐户维护费	4,500.00
合计	105,572.27

6.4.7.9 实收基金

交银货币 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	219,955,115.21	219,955,115.21
本期申购	674,135,542.76	674,135,542.76
本期赎回（以“-”号填列）	-692,284,347.72	-692,284,347.72
本期末	201,806,310.25	201,806,310.25

交银货币 B

金额单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,018,913,311.28	2,018,913,311.28
本期申购	3,820,551,133.58	3,820,551,133.58
本期赎回（以“-”号填列）	-5,208,531,179.92	-5,208,531,179.92
本期末	630,933,264.94	630,933,264.94

注：申购含红利再投、转换入及份额级别调增数，赎回含转换出及份额级别调减数。

6.4.7.10 未分配利润

交银货币 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	3,108,426.14	-	3,108,426.14
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-3,108,426.14	-	-3,108,426.14
本期末	-	-	-

交银货币 B

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	23,928,739.82	-	23,928,739.82
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-23,928,739.82	-	-23,928,739.82
本期末	-	-	-

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
活期存款利息收入	272,254.28
定期存款利息收入	8,488,773.05
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	58,724.03
其他	-
合计	8,819,751.36

6.4.7.12 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,149,933,252.32
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,129,465,857.82
减：应收利息总额	17,993,015.68
债券投资收益	2,474,378.82

6.4.7.13 其他费用

单位：人民币元

项目	本期

	2011年1月1日至2011年6月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	49,588.57
银行汇划费用	12,397.50
其他	150.00
债券帐户维护费	8,926.92
合计	120,651.56

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

本基金无需说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无需说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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、基金代销机构
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	基金管理人的股东、基金代销机构

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 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股票交易、权证交易、债券交易及债券回购交易。

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金，期末无应付关联方佣金余额。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年6月30日	2010年1月1日至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,922,483.77	10,106,570.16
其中：支付销售机构的客户维护费	118,853.66	402,926.50

注：支付基金管理人交银施罗德基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.33%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：

日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.33%÷当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年6月30日	2010年1月1日至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	885,601.09	3,062,597.04

注：支付基金托管人中国农业银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.1%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：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.1%÷当年天数。

6.4.10.2.3 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		
	2011年1月1日至2011年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	交银货币 A	交银货币 B	合计
交银施罗德基金管理有限公司	51,549.80	71,746.38	123,296.18
中国农业银行	34,139.48	873.07	35,012.55
交通银行	109,113.65	211.86	109,325.51
合计	194,802.93	72,831.31	267,634.24
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2010年1月1日至2010年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	交银货币 A	交银货币 B	合计

交银施罗德基金管理有限公司	93,719.90	256,623.13	350,343.03
中国农业银行	115,424.23	5,291.29	120,715.52
交通银行	238,120.05	3,622.15	241,742.20
合计	447,264.18	265,536.57	712,800.75

注：本基金实行销售服务费分级收费方式，分设A、B两级基金份额：A级基金按前一日基金资产净值0.25%的年费率逐日计提销售服务费，B级基金按前一日基金资产净值0.01%的年费率逐日计提销售服务费。其计算公式为：

A级基金日销售服务费=前一日A级基金资产净值×0.25%÷当年天数，

B级基金日销售服务费=前一日B级基金资产净值×0.01%÷当年天数。

6.4.10.3 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 2011年1月1日至2011年6月30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	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30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	-	-	156,800,000.00	22,135.36	-	-

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
-------	----	---------

	2011年1月1日至2011年6月30日		2010年1月1日至2010年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	13,673,596.37	272,254.28	177,394,836.15	1,733,265.37

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

1、交银货币 A

单位：人民币元

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	本期利润分配 合计	备注
2,469,978.60	513,493.71	124,953.83	3,108,426.14	-

2、交银货币B

单位：人民币元

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	本期利润分配 合计	备注
20,245,804.55	5,383,887.59	-1,700,952.32	23,928,739.82	-

6.4.12 期末（2011年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发或增发而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2011 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 119,999,820.00 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值 单价	数量（张）	期末估值 总额
100231	10国开31	2011-07-01	99.97	1,200,000	119,964,000.00

合计		-	-	1,200,000	119,964,000.00
----	--	---	---	-----------	----------------

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末不存在交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为货币市场基金，本基金的运作涉及的金融工具主要是具有良好流动性的货币市场工具。与这些金融工具有关的风险，以及本基金管理人管理这些风险所采取的风险管理政策如下所述。

本基金管理人从事风险管理的目标是使本基金在风险和收益之间取得适当的平衡，将风险对本基金经营业绩的负面影响降低到最低水平，使基金持有人的利益最大化。基于该风险管理目标，本基金管理人风险管理的基本策略是识别和分析本基金运作使本基金面临各种类型的风险，确定适当的风险容忍度，并及时可靠地对各种风险进行监督，将风险控制在限定的范围之内。本基金目前面临的主要风险包括：信用风险、流动性风险和市场风险。与本基金相关的市场风险主要包括利率风险和其他价格风险。

本基金管理人建立了以全面、独立、相互制约以及定性和定量相结合为原则的，由董事会最终负责，业务部门进行风险评估和监控，风险管理部监察执行，同时督察长行使独立监察权力的风险管理组织架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指金融工具的一方到期无法履行约定义务致使本基金遭受损失的风险。本基金的信用风险主要存在于银行存款、结算备付金、债券投资、买入返售金融资产、资产支持证券、应收利息及其他。

本基金的银行存款存放于本基金的托管行—中国农业银行及声誉良好的股份制商业银行。本基金认为与其相关的信用风险不重大。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

对于与债券投资等投资品种相关的信用风险，本基金管理人通过对投资品种的信用等级评估来选择适当的投资对象，并限制单个投资品种的持有比例来管理信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指没有足够资金以满足到期债务支付的风险。本基金流动风险来源于开放式基金每日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。本基金所持大部分交易性金融资产在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中

列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。

本基金投资组合的平均剩余期限，在每个交易日均不得超过 180 天。本基金保留的现金以及投资于一年期以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。此外，针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款，设计了非常情况下赎回资金的处理模式，控制因开放模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。本基金所持有的其他金融负债到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。同时，本基金在需要时可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金，以缓解流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。基于本基金产品特点，短期债券是其主要投资品种，利息收入是本基金的主要收入来源，生息资产占基金资产绝对比重较高，因此短期利率风险是本基金的主要风险。此外，本基金的债券投资在存续期间一般情况下是按摊余成本进行后续计量的，并每日计算投资组合摊余成本与其他可参考公允价值指针之间的偏离程度，对发生重大差异的，需改按公允价值进行后续计量。因此，本基金的利率风险还表现于当投资组合的公允价值受市场利率的变动导致与其摊余成本发生重大差异时对损益的影响。本基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，通过对短期利率水平的预测、收益率曲线分析、利率重定价日组合及类别品种配置、调整投资组合的久期、凸性等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本年末 2011年6月30 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	13,673,596.37						13,673,596.37
结算备付金	1,452,380.95						1,452,380.95
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	295,367,192.36	538,888,433.77	-	-	-	834,255,626.13
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	99,000,268.50	-	-	-	-	-	99,000,268.50
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	13,250,925.64	13,250,925.64
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	448,630.76	448,630.76

递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产							
资产总计	114,126,245.82	295,367,192.36	538,888,433.77	-	-	13,699,556.40	962,081,428.35
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	119,999,820.00	-	-	-	-	-	119,999,820.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	4,156,621.43	4,156,621.43
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	337,590.78	337,590.78
应付托管费	-	-	-	-	-	102,300.23	102,300.23
应付销售服务费	-	-	-	-	-	57,502.30	57,502.30
应付交易费用	-	-	-	-	-	13,645.92	13,645.92
应交税费	-	-	-	-	-	2,559,524.67	2,559,524.67
应付利息	-	-	-	-	-	16,618.36	16,618.36
应付利润	-	-	-	-	-	1,992,657.20	1,992,657.20
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	105,572.27	105,572.27
负债总计	119,999,820.00	-	-	-	-	9,342,033.16	129,341,853.16
利率敏感度缺口	<u>-5,873,574.18</u>	<u>295,367,192.36</u>	<u>538,888,433.77</u>	-	-	<u>4,357,523.24</u>	<u>832,739,575.19</u>
上年末 2010年12月31日	<u>1个月以内</u>	<u>1-3个月</u>	<u>3个月-1年</u>	<u>1-5年</u>	<u>5年以上</u>	<u>不计息</u>	<u>合计</u>
资产							
银行存款	218,377,187.91	400,000,000.00	-	-	-	-	618,377,187.91
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	100,019,698.47	494,215,429.79	1,018,569,938.35	-	-	-	1,612,805,066.61
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	15,690,517.63	15,690,517.63
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	318,396,886.38	894,215,429.79	1,018,569,938.35	-	-	15,690,517.63	2,246,872,772.15
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-

交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	771,643.48	771,643.48
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	692,130.41	692,130.41
应付托管费	-	-	-	-	-	209,736.47	209,736.47
应付销售服务费	-	-	-	-	-	68,081.69	68,081.69
应付交易费用	-	-	-	-	-	12,549.66	12,549.66
应交税费	-	-	-	-	-	2,524,524.67	2,524,524.67
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	3,568,655.69	3,568,655.69
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	157,023.59	157,023.59
负债总计	-	-	-	-	-	8,004,345.66	8,004,345.66
利率敏感度缺口	318,396,886.38	894,215,429.79	1,018,569,938.35	-	-	7,686,171.97	2,238,868,426.49

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	市场利率平行上升或下降25个基点		
	其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
	市场利率平行上升25个基点	减少约61	减少约203
	市场利率平行下降25个基点	增加约61	增加约204

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指金融工具的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。该风险可能与特定投资品种相关，也有可能与整体投资组合相关。对本基金而言，其他价格风险表现在当投资组合的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动导致与其摊余成本发生重大差异时对损益的影响。本基金管理人通过加强投资组合管理、优化品种配置、每日跟踪偏离程度等方法对其他价格风险

进行管理。

于 2011 年 6 月 30 日及 2010 年 12 月 31 日，本基金投资组合的摊余成本与可参考公允价值的偏离程度绝对值分别为 0.04% 与 0.06%，故不存在重大其他价格风险。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	834,255,626.13	86.71
	其中：债券	834,255,626.13	86.71
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	99,000,268.50	10.29
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	15,125,977.32	1.57
4	其他各项资产	13,699,556.40	1.42
5	合计	962,081,428.35	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	4.09	
	其中：买断式回购融资	0.22	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	119,999,820.00	14.41
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个银行间市场交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	115
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	144
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	99

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过180天。

7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	13.70	14.41
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	12.65	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	6.63	-
3	60 天(含)—90 天	22.82	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	9.60	-
4	90 天(含)—180 天	50.29	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	2.27	-
5	180 天(含)—397 天(含)	14.42	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
6	合计	113.89	14.41

7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	9,958,735.34	1.20

3	金融债券	570,080,055.12	68.46
	其中：政策性金融债	570,080,055.12	68.46
4	企业债券	74,127,314.70	8.90
5	企业短期融资券	180,089,520.97	21.63
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	834,255,626.13	100.18
9	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	154,097,763.14	18.50

7.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量 (张)	摊余成本	占基金资产 净值比例 (%)
1	100231	10 国开 31	2,500,000	249,932,125.48	30.01
2	100226	10 国开 26	1,000,000	99,984,810.23	12.01
3	068007	06 首都机场债	570,000	55,223,804.88	6.63
4	1181226	11 甬电力 CP01	500,000	50,092,321.43	6.02
5	010211	01 国开 11	500,000	50,082,721.81	6.01
6	110409	11 农发 09	500,000	49,978,028.40	6.00
7	090407	09 农发 07	500,000	49,970,448.44	6.00
8	080306	08 进出 06	400,000	40,131,920.76	4.82
9	1081314	10 白药 CP01	300,000	30,000,528.86	3.60
10	110217	11 国开 17	300,000	30,000,000.00	3.60

7.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	12
报告期内偏离度的最高值	0.3071%
报告期内偏离度的最低值	-0.0709%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1340%

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

7.8 投资组合报告附注

7.8.1 基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价，即计价对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内按照实际利率和摊余成本逐日摊销计算损益。

7.8.2 本基金报告期每日持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本均未超过当日基金资产净值的 20%。

7.8.3 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

7.8.4 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	13,250,925.64
4	应收申购款	448,630.76
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	13,699,556.40

7.8.5 其他需说明的重要事项

由于四舍五入原因，分项之和与合计之和可能存在尾差。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
交银货币A	6,511	30,994.67	34,379,611.36	17.04%	167,426,698.89	82.96%
交银货币B	20	31,546,663.25	620,378,958.45	98.33%	10,554,306.49	1.67%

合计	6,531	127,505.68	654,758,569.81	78.63%	177,981,005.38	21.37%
----	-------	------------	----------------	--------	----------------	--------

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	交银货币 A	7,884.42	0.00%
	交银货币 B	-	-
	合计	7,884.42	0.00%

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	交银货币 A	交银货币 B
基金合同生效日(2006年1月20日)基金份额总额	4,741,255,133.16	-
本报告期期初基金份额总额	219,955,115.21	2,018,913,311.28
本报告期基金总申购份额	674,135,542.76	3,820,551,133.58
减：本报告期基金总赎回份额	692,284,347.72	5,208,531,179.92
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	201,806,310.25	630,933,264.94

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投、份额级别调整业务，则总申购份额中包含该业务；

2、如果本报告期间发生转换出、份额级别调整业务，则总赎回份额中包含该业务。

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人的重大人事变动：2011年1月26日本基金管理人发布公告，经公司第二届董事会第二十一次会议审议通过，任命战龙先生担任本公司总经理。

2、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动：2011年1月21日，中国证监会核准中国农业银行股份有限公司张健基金行业高级管理人员任职资格（证监许可〔2011〕116号），张健任中国农业银行股份有限公司托管业务部总经理。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内，本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
申银万国证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
申银万国证券股份有限公司	-	-	707,200,000.00	100.00%	-	-

注：1、报告期内，本基金1个专用交易单元，未发生变化；

2、租用证券公司专用交易单元的选择标准主要包括：券商基本面评价（财务状况、经营状况）、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）、券商每日信息评价（及时性和有效性）和券商协作表现评价等四个方面；

3、租用证券公司专用交易单元的程序：首先根据租用证券公司专用交易单元的选择标准进行综合评价，然后根据评价结果选择基金专用交易单元。研究部提交方案，并报公司批准。

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

项目	发生日期	偏离度	法定披露报刊	法定披露日期
----	------	-----	--------	--------

报告期内偏离度绝对值在0.5%（含）以上	-	-	-	-
----------------------	---	---	---	---

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	交银施罗德货币市场证券投资基金2010年第四季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-1-21
2	交银施罗德基金管理有限公司关于开通部分银行卡办理交银施罗德货币市场证券投资基金网上直销业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-1-21
3	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德货币市场证券投资基金于2011年“春节”假期前暂停申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-1-26
4	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德货币市场证券投资基金于2011年“春节”假期后恢复申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-1-26
5	交银施罗德货币市场证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2011年第1号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-3-5
6	交银施罗德基金管理有限公司关于增加开通旗下基金在部分代销机构定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-3-9
7	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德货币市场证券投资基金于2011年“清明节”假期前暂停申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-3-28
8	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德货币市场证券投资基金于2011年“清明节”假期后恢复申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-3-28
9	交银施罗德货币市场证券投资基金2010年年度报告摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-3-28
10	交银施罗德货币市场证券投资基金2011年第一季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-4-22
11	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德货币市场证券投资基金于2011年“劳动	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-4-26

	节”假期前暂停申购、转换转入及定期定额投资业务的公告		
12	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德货币市场证券投资基金于2011年“劳动节”假期后恢复申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-4-26
13	交银施罗德基金管理有限公司关于增加开通旗下基金在部分代销机构代销业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-5-6
14	交银施罗德基金管理有限公司关于开通基金网上直销通联支付业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-5-25
15	交银施罗德基金管理有限公司关于开通旗下部分基金基金转换业务及调整基金转换业务规则的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-5-27
16	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德货币市场证券投资基金于2011年“端午节”假期前暂停申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-5-31
17	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德货币市场证券投资基金于2011年“端午节”假期后恢复申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-5-31
18	交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德货币市场证券投资基金基金经理变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011-6-9

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准交银施罗德货币市场证券投资基金设立的文件；
- 2、《交银施罗德货币市场证券投资基金基金合同》；
- 3、《交银施罗德货币市场证券投资基金招募说明书》；
- 4、《交银施罗德货币市场证券投资基金托管协议》；
- 5、关于募集交银施罗德货币市场证券投资基金之法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、报告期内交银施罗德货币市场证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

11.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

11.3 查阅方式

投资者可在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅备查文件，或者登录基金管理人的网站(www.jyfund.com, www.jysld.com, www.bocomschroder.com)查阅。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人交银施罗德基金管理有限公司。本公司客户服务中心电话：400-700-5000（免长途话费），021-61055000，电子邮件：services@jysld.com。

交银施罗德基金管理有限公司
二〇一一年八月二十四日