

2008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
送出日期：2009年03月26日

1.1 重要提示
基金管理人的董事会、董事承诺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法律责任。

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2009年3月25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。

2.1 基金基本情况
基金简称：交银货币
基金运作方式：契约型开放式
基金合同生效日：2006年01月20日

Table with 3 columns: 基金名称, 基金运作方式, 基金合同生效日, 报告期末基金资产总额, 基金合同存续期, 下属两级基金名称, 下属两级基金的交易代码, 下属两级基金资产总额

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定和资产充分流动的前提下，追求超过业绩比较基准的投资收益。

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. 包含姓名、名称、地址、电话、传真等信息。

2.3 基金管理人及基金托管人
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

Table with 2 columns: 主要会计数据和财务指标. 包含期间和指标, 2008年, 2007年, 2006年12月31日, 2005年12月31日.

Table with 2 columns: 3.1.1 期间和指标, 2008年, 2007年, 2006年12月31日, 2005年12月31日.

Table with 2 columns: 3.1.2 期间和指标, 2008年, 2007年, 2006年12月31日, 2005年12月31日.

注：1.本基金申购费用为零；
2.本基金收益的分配按结转份额；
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。

Table with 2 columns: 3.2 基金净值表现. 包含阶段, 份额净值增长率①, 份额净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④.

Table with 2 columns: 3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩比较基准收益变动及其与同期业绩比较基准收益变动的比较.

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《交银施罗德货币市场证券投资基金合同》、《交银施罗德货币市场证券投资基金托管协议》的约定。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信情况的说明
本托管人认为，交银施罗德基金管理有限公司投资运作的交银施罗德货币市场证券投资基金符合基金合同的约定，基金管理人投资运作的行为符合基金合同的约定。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息内容的真实、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资料符合《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。

注：报告日期为2007年6月22日至2008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2008年12月31日，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
注：报告日期为2007年6月22日至2008年12月31日。实施基金分级收费当年的净值收益率按照当年实际存续期间计算。

注：报告日期为2006年1月20日至2008年12月31日。基金合同生效当年的净值收益率按照当年实际存续期间计算。

注：报告日期为2007年6月22日至2008年12月31日。实施基金分级收费当年的净值收益率按照当年实际存续期间计算。

注：报告日期为2006年1月20日至2008年12月31日。基金合同生效当年的净值收益率按照当年实际存续期间计算。

注：报告日期为2007年6月22日至2008年12月31日。实施基金分级收费当年的净值收益率按照当年实际存续期间计算。

注：报告日期为2006年1月20日至2008年12月31日。基金合同生效当年的净值收益率按照当年实际存续期间计算。

注：报告日期为2007年6月22日至2008年12月31日。实施基金分级收费当年的净值收益率按照当年实际存续期间计算。

注：报告日期为2006年1月20日至2008年12月31日。基金合同生效当年的净值收益率按照当年实际存续期间计算。

注：报告日期为2007年6月22日至2008年12月31日。实施基金分级收费当年的净值收益率按照当年实际存续期间计算。

注：报告日期为2006年1月20日至2008年12月31日。基金合同生效当年的净值收益率按照当年实际存续期间计算。

续期计算。
3.3 过去三年基金的利润分配情况
单位：人民币元

Table with 3 columns: 年度, 再投资形式发放总额, 备注. 包含2008年, 2007年, 2006年, 合计.

4.1 基金管理人及基金经理简介
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]129号文批准，于2005年8月4日成立的合资基金管理公司。

截至到2008年12月31日，公司已经发行并管理的基金共有七只，均为开放式基金：交银施罗德精选股票证券投资基金、交银施罗德货币市场证券投资基金、交银施罗德稳健配置混合证券投资基金、交银施罗德成长证券投资基金、交银施罗德蓝筹证券投资基金、交银施罗德领先回报灵活配置证券投资基金、交银施罗德主题策略灵活配置证券投资基金。

4.1.2 基金业绩 基金经理小组及基金经理助理简介
姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 说明. 包含陈晓秋, 李春春.

注：1.本表所列基金经理任职日期和离任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.本表所列基金经理任职日期和离任日期均以中国证券投资基金业协会《证券投资基金从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对于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》及其他法律法规、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。

4.3 管理人对于报告期内本基金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
本公司严格执行投资授权制度和风险控制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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明
本基金报告期内未发现异常交易行为。

4.4 管理人对于报告期内本基金的投资策略和业绩表现说明
2008年中国经济和债券市场都经历了巨大的变化。中国经济从年初的高通胀膨胀演至年底物价水平出现月度负增长。

2009年，由于货币政策在相当一段时间内保持宽松的政策取向，包括下调存款准备金率和准备金率等措施，因此货币市场将维持持续宽松的流动性，市场利率可能会进一步下降。

4.5 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”） 基金管理人、基金销售机构

4.6 管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金管理人聘请了健全、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。

4.7 管理人对于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：

Table with 4 columns: 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.

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严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信情况的说明
本托管人认为，交银施罗德基金管理有限公司投资运作的交银施罗德货币市场证券投资基金符合基金合同的约定。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息内容的真实、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资料符合《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。

注：报告日期为2006年1月20日至2008年12月31日。基金合同生效当年的净值收益率按照当年实际存续期间计算。

注：报告日期为2007年6月22日至2008年12月31日。实施基金分级收费当年的净值收益率按照当年实际存续期间计算。

注：报告日期为2006年1月20日至2008年12月31日。基金合同生效当年的净值收益率按照当年实际存续期间计算。

注：报告日期为2007年6月22日至2008年12月31日。实施基金分级收费当年的净值收益率按照当年实际存续期间计算。

注：报告日期为2006年1月20日至2008年12月31日。基金合同生效当年的净值收益率按照当年实际存续期间计算。

注：报告日期为2007年6月22日至2008年12月31日。实施基金分级收费当年的净值收益率按照当年实际存续期间计算。

注：报告日期为2006年1月20日至2008年12月31日。基金合同生效当年的净值收益率按照当年实际存续期间计算。

注：报告日期为2007年6月22日至2008年12月31日。实施基金分级收费当年的净值收益率按照当年实际存续期间计算。

注：报告日期为2006年1月20日至2008年12月31日。基金合同生效当年的净值收益率按照当年实际存续期间计算。

注：报告日期为2007年6月22日至2008年12月31日。实施基金分级收费当年的净值收益率按照当年实际存续期间计算。

注：报告日期为2006年1月20日至2008年12月31日。基金合同生效当年的净值收益率按照当年实际存续期间计算。

续期计算。
3.3 过去三年基金的利润分配情况
单位：人民币元

Table with 3 columns: 年度, 再投资形式发放总额, 备注. 包含2008年, 2007年, 2006年, 合计.

4.1 基金管理人及基金经理简介
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]129号文批准，于2005年8月4日成立的合资基金管理公司。

截至到2008年12月31日，公司已经发行并管理的基金共有七只，均为开放式基金：交银施罗德精选股票证券投资基金、交银施罗德货币市场证券投资基金、交银施罗德稳健配置混合证券投资基金、交银施罗德成长证券投资基金、交银施罗德蓝筹证券投资基金、交银施罗德领先回报灵活配置证券投资基金、交银施罗德主题策略灵活配置证券投资基金。

4.1.2 基金业绩 基金经理小组及基金经理助理简介
姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 说明. 包含陈晓秋, 李春春.

注：1.本表所列基金经理任职日期和离任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.本表所列基金经理任职日期和离任日期均以中国证券投资基金业协会《证券投资基金从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对于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》及其他法律法规、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。

4.3 管理人对于报告期内本基金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
本公司严格执行投资授权制度和风险控制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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明
本基金报告期内未发现异常交易行为。

4.4 管理人对于报告期内本基金的投资策略和业绩表现说明
2008年中国经济和债券市场都经历了巨大的变化。中国经济从年初的高通胀膨胀演至年底物价水平出现月度负增长。

2009年，由于货币政策在相当一段时间内保持宽松的政策取向，包括下调存款准备金率和准备金率等措施，因此货币市场将维持持续宽松的流动性，市场利率可能会进一步下降。

4.5 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”） 基金管理人、基金销售机构

4.6 管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金管理人聘请了健全、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。

4.7 管理人对于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：

Table with 4 columns: 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.

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严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信情况的说明
本托管人认为，交银施罗德基金管理有限公司投资运作的交银施罗德货币市场证券投资基金符合基金合同的约定。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息内容的真实、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资料符合《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。

注：报告日期为2006年1月20日至2008年12月31日。基金合同生效当年的净值收益率按照当年实际存续期间计算。

注：报告日期为2007年6月22日至2008年12月31日。实施基金分级收费当年的净值收益率按照当年实际存续期间计算。

注：报告日期为2006年1月20日至2008年12月31日。基金合同生效当年的净值收益率按照当年实际存续期间计算。

注：报告日期为2007年6月22日至2008年12月31日。实施基金分级收费当年的净值收益率按照当年实际存续期间计算。

注：报告日期为2006年1月20日至2008年12月31日。基金合同生效当年的净值收益率按照当年实际存续期间计算。

注：报告日期为2007年6月22日至2008年12月31日。实施基金分级收费当年的净值收益率按照当年实际存续期间计算。

注：报告日期为2006年1月20日至2008年12月31日。基金合同生效当年的净值收益率按照当年实际存续期间计算。

注：报告日期为2007年6月22日至2008年12月31日。实施基金分级收费当年的净值收益率按照当年实际存续期间计算。

注：报告日期为2006年1月20日至2008年12月31日。基金合同生效当年的净值收益率按照当年实际存续期间计算。

注：报告日期为2007年6月22日至2008年12月31日。实施基金分级收费当年的净值收益率按照当年实际存续期间计算。

注：报告日期为2006年1月20日至2008年12月31日。基金合同生效当年的净值收益率按照当年实际存续期间计算。

7.4.3.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况
无。
7.4.4 期末2008年12月31日 本基金持有的流通受限证券
无。

8.1 期末基金资产组合情况
金额单位：人民币元

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%).

8.2 债券回购融资情况
金额单位：人民币元

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%).

注：1.报告期末债券回购融资余额占基金资产净值的比例均小于10%。
2.在报告期末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%。

8.3 基金投资组合平均持仓期限
8.3.1 投资组合平均持仓期限基本情况

Table with 2 columns: 项目, 天数. 包含报告期末投资组合平均持仓期限, 报告期内投资组合平均持仓期限最高值, 报告期内投资组合平均持仓期限最低值.

注：本报告期末本货币市场基金投资组合平均持仓期限未超过180天。
8.3.2 期末投资组合平均持仓期限分布比例

Table with 4 columns: 序号, 平均持仓期限, 各期资产占基金资产净值的比例(%) , 各期负债占基金资产净值的比例(%) .

8.4 期末按债券品种分类的债券投资组合
金额单位：人民币元

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 摊余成本, 占基金资产净值的比例(%) .

8.5 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

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 债券数量(张), 摊余成本, 占基金资产净值的比例(%) .

8.6 影子定价与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离
金额单位：人民币元

Table with 2 columns: 项目, 偏离情况. 包含报告期末偏离度的绝对值在0.25%~0.5%间的次数, 报告期内偏离度的最高值, 报告期内偏离度的最低值.

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
金额单位：人民币元

Table with 4 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(份), 公允价值, 占基金资产净值的比例(%) .

8.8 投资组合附注
8.8.1 本基金采用摊余成本法计价，即计价对象以买入成本列示，按票面利率或约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。

8.8.2 本基金报告期内持有剩余期限小于397天的浮动利率债券的摊余成本均未超过报告期末基金资产净值的20%。

8.8.3 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。

8.8.4 其他资产构成
单位：人民币元

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额. 包含1. 存出保证金, 2. 应收证券清算款, 3. 应收利息, 4. 其他应收款, 5. 其他应付款, 6. 其他, 7. 合计.

9.1 期末基金持有人户数及持有人结构
份额单位：份

Table with 4 columns: 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.

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况
金额单位：人民币元

Table with 3 columns: 项目, A级, B级. 包含基金合同生效日, 报告期初基金份额总额, 报告期末基金份额总额.

注：1.报告期末，本基金1个专门交易席位，本报告期末未新增席位；
2.租用证券公司专用席位的选择标准主要包括：券商基本评价、财务状况、经营状况、券商研究机构评价、报告质量、及时性、数量、券商每日信息评价、及时性、有效性和券商合作表现评价等四个方面；
3.租用证券公司专用席位的程序：首先根据租用证券公司专用席位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席位，研究提供方案，并报公司批准。