交银施罗德货币市场证券投资基金 2010年年度报告摘要

2010年12月31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:二〇一一年三月二十八日

§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2011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。

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2010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	2,238,868,426.49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	219,955,115.21份	2,018,913,311.28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
信息披露负责人	姓名	陈超	李芳菲
	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

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.jyfund.com,www.jysld.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	2010年		2009年		2008年	
	交银货币A	交银货币B	交银货币A	交银货币B	交银货币A	交银货币B
本期已实现收益	5,149,485.00	70,921,812.15	10,641,321.28	106,181,408.96	13,110,160.98	121,797,321.91
本期利润	5,149,485.00	70,921,812.15	10,641,321.28	106,181,408.96	13,110,160.98	121,797,321.91
本期净值收益率	1.60%	1.84%	1.34%	1.58%	3.32%	3.56%
3.1.2期末数据和指标	2010年末		2009年末		2008年末	
	交银货币A	交银货币B	交银货币A	交银货币B	交银货币A	交银货币B
期末基金资产净值	219,955,115.21	2,018,913,311.28	1,915,031,696.28	18,161,366,620.92	1,675,289,851.26	10,830,652,841.75
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	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。

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	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	0.5069%	0.0031%	0.5480%	0.0003%	-0.0411%	0.0028%
过去六个月	0.9273%	0.0029%	1.0471%	0.0004%	-0.1198%	0.0025%
过去一年	1.5968%	0.0023%	2.0289%	0.0003%	-0.4321%	0.0020%
过去三年	6.3709%	0.0062%	7.4429%	0.0020%	-1.0720%	0.0042%
自基金合同生效起至今	11.6336%	0.0058%	11.5101%	0.0019%	0.1235%	0.0039%

2. 交银货币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	0.5677%	0.0031%	0.5480%	0.0003%	0.0197%	0.0028%
过去六个月	1.0493%	0.0029%	1.0471%	0.0004%	0.0022%	0.0025%
过去一年	1.8421%	0.0023%	2.0289%	0.0003%	-0.1868%	0.0020%
过去三年	7.1387%	0.0062%	7.4429%	0.0020%	-0.3042%	0.0042%
自基金分级日起至今	9.4526%	0.0067%	8.9875%	0.0019%	0.4651%	0.0048%

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、交银货币A

注:图示日期为2006年1月20日至2010年12月31日。

2、交银货币B

注:图示日期为2007年6月22日至2010年12月31日。

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、交银货币A

注:图示日期为2006年1月20日至2010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计算。

2、交银货币B

注:图示日期为2007年6月22日至2010年12月31日。实施基金分级当年的净值收益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、交银货币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
2010年	4,545,722.49	1,009,354.22	-405,591.71	5,149,485.00	-
2009年	10,446,073.33	2,330,231.06	-2,134,983.11	10,641,321.28	-
2008年	8,345,071.85	2,530,680.96	2,234,408.17	13,110,160.98	-
合计	23,336,867.67	5,870,266.24	-306,166.65	28,900,967.26	-

2、交银货币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
2010年	62,527,940.64	13,923,031.77	-5,529,160.26	70,921,812.15	-
2009年	114,772,402.74	13,566,544.47	-22,157,538.25	106,181,408.96	-
2008年	66,491,563.57	25,802,767.87	29,502,990.47	121,797,321.91	-
合计	243,791,906.95	53,292,344.11	1,816,291.96	298,900,543.02	-

§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2010年12月31日,公司已经发行并管理的基金共有十三只,均为开放式基金: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)和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)。

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		
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	2006-12-27	-	11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的说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2010年,全球经济在成功抵御了欧洲主权债务危机的冲击后,继续运行在复苏的道路上。2009年率先通过政策刺激走出经济低谷的中国,在2010年同样保持了强劲的复苏态势。按照国家统计局初步测算,全年GDP再次实现了两位数的增长,增速高达10.3%,其中进出口总额增长34.7%,全社会固定资产投资增长23.8%,社会消费品零售总额增长18.4%。

同为复苏,多数发达国家是依靠继续保持甚至进一步扩大政策刺激力度从而使经济增速进一步脱离低增长区域。而以中国为代表的部分发展中国家更多的是通过政策调整将经济从快速复苏回归到可持续的正常增长道路上来,以减少刺激政策带来的负面影响,如资产价格和物价上升过快、结构性或短期经济过热等。

复杂的内外部环境使得我国2010年的宏观经济政策不再像2009年那样单向发力,而是采取了更为灵活多变的方式。年初为防止经济走向过热,政府采取了严格的信贷控制措施,随后又进行了房地产调控。年中因为担忧经济二次探底,管理层减弱了调控力度,遏止了经济增速回落过快的势头。四季度受美联储实施第二轮量化宽松政策的影响,全球货币泛滥推动粮食、原油及大宗商品价格上涨,进而推动国内通胀水平迅速上升,11月CPI一度超过5%,我国政府再度采取了严厉的调控措施,央行数次提高利率和准备金率以收紧货币,至年底M2同比增长19.7%,较前年同期增速下降了8个百分点。

货币市场利率也充分反映了政策变化的情况,SHIBOR利率在政策调控力度较大的二、四季度均出现了显著上升,尤以四季度为甚。一年期央票利率全年上涨了144BP,主要涨幅也集中在四季度。

在货币市场利率持续上升的环境下,本基金采取了相对稳健的配置策略,增加了协议存款的配置比例,并耐心等待短期债券的增持机会。

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1.5968%,交银货币B净值收益率为1.8421%,同期业绩比较基准增长率为2.0289%。

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,全球经济复苏的步伐将更加稳固,但是通胀对经济和政策的扰动也将更为显著,上半年通过加息和提高准备金率以抑制通胀的压力依然较大,但也需要把握好在通胀压力下降时短期债券的配置机会。

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:

单元: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	5,149,485.00	5,149,485.00	-	每日分配,按月结转份额
交银货币B	70,921,812.15	70,921,812.15	-	每日分配,按月结转份额
合计	76,071,297.15	76,071,297.15	-	

§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2010年1月1日至2010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3月25日

§6 审计报告

德勤华永会计师事务所有限公司对交银施罗德货币市场证券投资基金2010年12月31日的资产负债表,2010年度的利润表、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 (德师报审字 (11)第P0135号)。投资者可通过本基金年度报告正文查看该审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 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:2010年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
资 产:			
银行存款	7.4.7.1	618,377,187.91	6,633,747,773.65
结算备付金		-	7,518,763,809.52
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	1,612,805,066.61	3,577,919,295.83
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,612,805,066.61	3,577,919,295.83
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	1,650,596,439.84
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	15,690,517.63	23,117,996.38
应收股利		-	-
应收申购款		-	1,222,430,424.49
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		2,246,872,772.15	20,626,575,739.71
负债和所有者权益	附注号	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009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		-	-
应付证券清算款		-	500,000,000.00
应付赎回款		771,643.48	35,501,299.62
应付管理人报酬		692,130.41	1,907,670.11
应付托管费		209,736.47	578,081.87
应付销售服务费		68,081.69	189,541.02
应付交易费用	7.4.7.7	12,549.66	19,415.45
应交税费		2,524,524.67	2,316,379.47
应付利息		-	-
应付利润		3,568,655.69	9,503,407.66
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	157,023.59	161,627.31
负债合计		8,004,345.66	550,177,422.51
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	2,238,868,426.49	20,076,398,317.20
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		2,238,868,426.49	20,076,398,317.20
负债和所有者权益总计		2,246,872,772.15	20,626,575,739.71

注:1、报告截止日2010年12月31日,基金份额净值1.0000元,基金份额总额A级:219,955,115.21份,B级:2,018,913,311.28份。

2、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:交银施罗德货币市场证券投资基金

本报告期:2010年1月1日至2010年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
一、收入		99,329,708.18	152,577,255.69
1.利息收入		93,827,099.08	128,102,425.20
其中:存款利息收入	7.4.7.11	14,883,990.37	24,751,769.11
债券利息收入		73,838,173.75	94,672,277.15
资产支持证券利息收入		-	2,020,637.10
买入返售金融资产收入		5,104,934.96	6,657,741.84
其他利息收入		-	-
2.投资收益 (损失以 “-”填列)		5,502,609.10	24,474,830.49
其中:股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.12	5,502,609.10	24,249,612.34
资产支持证券投资收益	7.4.7.13	-	225,218.15
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		23,258,411.03	35,754,525.45
1.管理人报酬		15,279,124.30	25,163,339.85
2.托管费		4,630,037.74	7,625,254.53
3.销售服务费		1,341,483.52	2,709,640.02
4.交易费用		-	-
5.利息支出		1,758,616.67	-
其中:卖出回购金融资产支出		1,758,616.67	-
6.其他费用	7.4.7.14	249,148.80	256,291.05
三、利润总额 (亏损总额以 “-”号填列)		76,071,297.15	116,822,730.24
减:所得税费用		-	-
四、净利润 (净亏损以 “-”号填列		76,071,297.15	116,822,730.24

7.3 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:2010年1月1日至2010年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010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)	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)	-	76,071,297.15	76,071,297.15
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)	-17,837,529,890.71	-	-17,837,529,890.71
其中:1.基金申购款	14,852,714,608.33	-	14,852,714,608.33
2.基金赎回款	-32,690,244,499.04	-	-32,690,244,499.04
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)	-	-76,071,297.15	-76,071,297.15
五、期末所有者权益 (基金净值)	2,238,868,426.49	-	2,238,868,426.49
项目	上年度可比期间 2009年1月1日至2009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)	12,505,942,693.01	-	12,505,942,693.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	116,822,730.24	116,822,730.24
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)	7,570,455,624.19	-	7,570,455,624.19
其中:1.基金申购款	51,957,996,805.73	-	51,957,996,805.73
2.基金赎回款	-44,387,541,181.54	-	-44,387,541,181.54
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)	-	-116,822,730.24	-116,822,730.24
五、期末所有者权益 (基金净值)	20,076,398,317.20	-	20,076,398,317.20

报告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

7.4 报表附注

7.4.1 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》、基金合同及于2010年9月3日公告的《交银施罗德货币市场证券投资基金 (更新)招募说明书 (2010年第2号)》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)。

本基金的财务报表于2011年3月24日已经本基金管理人及托管人批准报出。

7.4.2 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。

7.4.3 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2010年12月31日的财务状况以及2010年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 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一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

7.4.6 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》、国税函 [2008]870号《关于做好证券市场个人投资者证券交易结算资金利息所得免征个人所得税工作的通知》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。

7.4.7 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	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
施罗德投资管理有限公司	基金管理人的股东
中国国际海运集装箱 (集团)股份有限公司	基金管理人的股东

注:下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 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。

7.4.8.2关联方报酬

7.4.8.2.1基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	15,279,124.30	25,163,339.85
其中:支付销售机构的客户维护费	536,850.54	1,475,790.67

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

7.4.8.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	4,630,037.74	7,625,254.53

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

7.4.8.2.3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 2010年1月1日至2010年12月31日		
	当期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	147,156.30	394,336.74	541,493.04
中国农业银行	159,329.29	6,669.55	165,998.84
交通银行	364,261.38	3,680.37	367,941.75
合计	670,746.97	404,686.66	1,075,433.63
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日		
	当期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	241,164.98	585,953.49	827,118.47
中国农业银行	448,430.58	14,062.60	462,493.18
交通银行	765,606.07	18,998.32	784,604.39
合计	1,455,201.63	619,014.41	2,074,216.04

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

7.4.8.3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

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日					
	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
交通银行	-	-	-	-	-	-
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日					
	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	88,604,842.19	154,871,494.52	-	-	-	-
交通银行	-	-	-	-	-	-

7.4.8.4各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1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。

7.4.8.4.2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。

7.4.8.5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 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31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	118,377,187.91	2,107,144.88	4,533,747,773.65	5,017,723.44

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。

7.4.8.6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。

7.4.9期末 (2010年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末不存在因认购新发/增发证券而于年末持有的流动受限证券。

7.4.9.2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动受限股票。

7.4.9.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末不存在债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.10有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析财务报表的其他事项。

§8 投资组合报告

8.1 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	1,612,805,066.61	71.78
	其中:债券	1,612,805,066.61	71.78
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	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	618,377,187.91	27.52
4	其他各项资产	15,690,517.63	0.70
	合计	2,246,872,772.15	100.00

8.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	2.45	
	其中:买断式回购融资	-	
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	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-

注:1、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日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

2、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%。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1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	143
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	172
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	40

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。

8.3.2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	14.22	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天 (含)—60天	18.51	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	3.32	-
3	60天 (含)—90天	21.43	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	2.23	-
4	90天 (含)—180天	7.96	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.84	-
5	180天 (含)—397天 (含)	37.53	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	99.65	-

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

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	9,804,659.16	0.44
3	金融债券	979,495,935.64	43.75
	其中:政策性金融债	979,495,935.64	43.75
4	企业债券	93,187,279.34	4.16
5	企业短期融资券	530,317,192.47	23.69
6	其他	-	-
7	合计	1,612,805,066.61	72.04
8	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	143,150,756.50	6.39

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

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	3,000,000	299,807,297.39	13.39
2	090301	09进出01	2,000,000	199,824,783.41	8.93
3	060202	06国开02	1,000,000	100,019,698.47	4.47
4	100226	10国开26	1,000,000	99,960,044.23	4.46
5	100310	10进出10	1,000,000	99,929,085.76	4.46
6	068007	06首都机场债	770,000	74,384,286.37	3.32
7	1081241	10岳纸CP01	600,000	60,068,059.91	2.68
8	1081037	10桂冠CP01	600,000	60,026,614.56	2.68
9	100233	10国开33	600,000	59,386,914.85	2.65
10	1081218	10津创业CP01	500,000	50,109,409.90	2.24

8.6 “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	0
报告期内偏离度的最高值	0.2367%
报告期内偏离度的最低值	-0.1630%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1368%

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

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

8.8 投资组合报告附注

8.8.1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。

8.8.2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%。

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	15,690,517.63
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	15,690,517.63

8.8.5其他需说明的重要事项标题

由于四舍五入原因,分项之和与合计之和可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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	6,990	31,467.11	48,653,802.31	22.12%	171,301,312.90	77.88%
交银货币B	51	39,586,535.52	1,963,177,912.73	97.24%	55,735,398.55	2.76%
合计	7,041	317,975.92	2,011,831,715.04	89.86%	227,036,711.45	10.14%

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

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	348,521.96	0.16%
	交银货币B	-	-
	合计	348,521.96	0.02%

§10 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	1,915,031,696.28	18,161,366,620.92
本报告期基金总申购份额	2,633,447,345.84	12,219,267,262.49
减:本报告期基金总赎回份额	4,328,523,926.91	28,361,720,572.13
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	219,955,115.21	2,018,913,311.28

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。

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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:2010年6月29日本基金管理人发布公告,经交银施罗德基金管理有限公司第二届董事会第十七次会议审议通过,同意彭纯先生因工作调动原因辞去公司董事长职务,任命钱文挥先生担任公司董事长。2010年9月29日本基金管理人发布公告,经交银施罗德基金管理有限公司第二届董事会第二十次会议审议通过,同意莫泰山先生辞去公司总经理职务,并决定由公司副董事长雷贤达先生代为履行公司总经理职务。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、报告期内,基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内,为本基金提供审计服务的会计师事务所为德勤华永会计师事务所。报告年度支付给德勤华永会计师事务所有限公司的审计费100,000元,自本基金基金合同生效以来,本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1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	-	-	-	-	-

11.7.2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	-	-	22,734,500,000.00	100.00%	-	-

注:1、报告期内,本基金1个专用交易席位,本报告期间未新增加席位;

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。研究部提交方案,并报公司批准。

11.8 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	-	-	-	-

交银施罗德基金管理有限公司
二〇一一年三月二十八日