交银施罗德货币市场证券投资基金

2011 半年度 报告摘要

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

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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

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。

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	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

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

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%

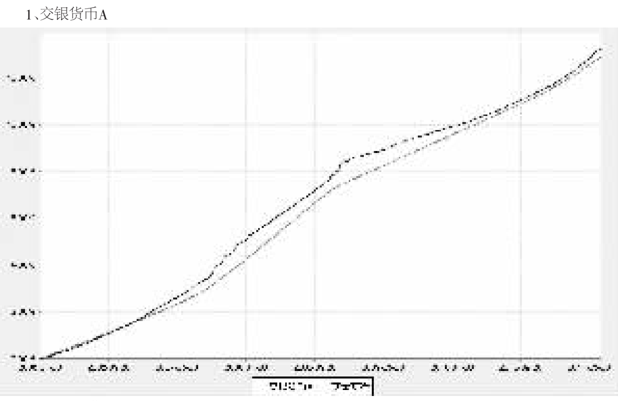
2. 交银货币B:

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
过去一个月	0.2903%	0.0059%	0.2507%	0.0000%	0.0396%	0.0059%
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

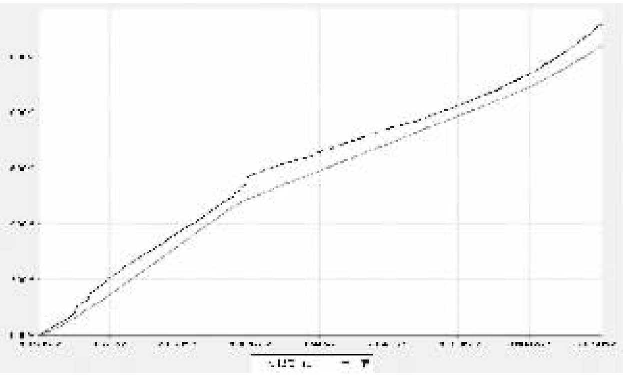
交银施罗德货币市场证券投资基金
份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2006年1月20日至2011年6月30日)

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:1、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。

2、本摘要中资产负债表和利润表所列附注号为半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半年度报告正文。

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关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 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。

6.4.8.2关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	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
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。

6.4.8.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	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
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。

6.4.8.2.3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 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。

6.4.8.3 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 2011年1月1日至2011年6月30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	-	-	-	-	-	-
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日					
	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	-	-

6.4.8.4各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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。

6.4.8.4.2 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。

6.4.8.5 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 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	
	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。

6.4.8.6 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。

6.4.9 期末(2011年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发或增发而流通受限的证券。

6.4.9.2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通受限股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 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

6.4.9.3.2 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。

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。

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	-	-	-	-

交银施罗德基金管理有限公司
二〇一一年八月二十四日