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：二〇一三年八月二十六日

# 交银施罗德货币市场证券投资基金

## 2013 半年度 报告摘要

2013年6月30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（以下使用全称或其简称“中国农业银行”）根据本基金合同规定，于2013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2013年1月1日起至2013年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 | 6,654,344,355.82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 | 371,970,177.34份 | 6,282,374,178.48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 | 孙艳 | 李芳菲 |
| | 联系电话 | 021-61055050 | 010-66606069 |
| | 电子邮箱 | zxqpl@jysld.com,disclosure@jysld.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（2013年1月1日至2013年6月30日） | |
|---|---|---|
| | 交银货币A | 交银货币B |
| 本期已实现收益 | 10,356,823.73 | 138,240,806.32 |
| 本期利润 | 10,356,823.73 | 138,240,806.32 |
| 本期净值收益率 | 1.65% | 1.78% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2013年6月30日) | |
| | 交银货币A | 交银货币B |
| 期末基金资产净值 | 371,970,177.34 | 6,282,374,178.48 |
| 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、自2007年6月22日起，本基金实行销售服务费分级收费方式，分设两级基金份额：A级基金份额和B级基金份额。A级基金份额与B级基金份额的管理费、托管费相同，A级基金份额按照0.25%的年费率计提销售服务费，B级基金份额按照0.01%的年费率计提销售服务费。在计算主要财务指标时，A级基金份额与分级前基金连续计算，B级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 | 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | 0.2205% | 0.0017% | 0.2301% | 0.0000% | -0.0096% | 0.0017% |
| 过去三个月 | 0.8235% | 0.0030% | 0.6981% | 0.0000% | 0.1254% | 0.0030% |
| 过去六个月 | 1.6541% | 0.0027% | 1.3885% | 0.0000% | 0.2656% | 0.0027% |
| 过去一年 | 5.4543% | 0.0030% | 4.4332% | 0.0006% | 1.0211% | 0.0024% |
| 过去三年 | 10.6259% | 0.0038% | 9.5369% | 0.0013% | 1.0890% | 0.0025% |
| 自基金合同生效起至今 | 21.5548% | 0.0053% | 19.0180% | 0.0018% | 2.5368% | 0.0035% |

注：本基金的业绩比较基准为六个月银行定期存款利率（税后）。

2. 交银货币B：

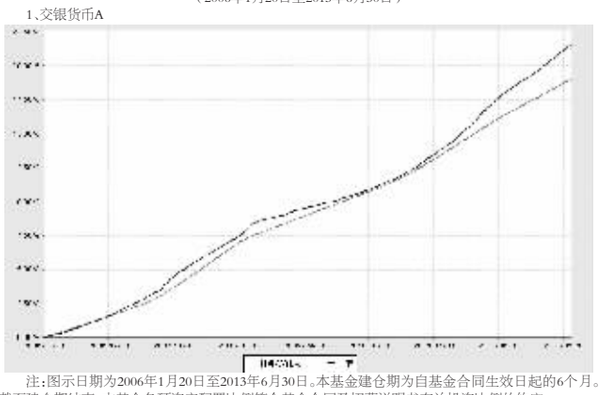
| 阶段 | 份额净值收益率① | 份额净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | 0.2405% | 0.0017% | 0.2301% | 0.0000% | 0.0104% | 0.0017% |
| 过去三个月 | 0.8838% | 0.0030% | 0.6981% | 0.0000% | 0.1857% | 0.0030% |
| 过去六个月 | 1.7760% | 0.0027% | 1.3885% | 0.0000% | 0.3875% | 0.0027% |
| 过去一年 | 5.8339% | 0.0030% | 4.4332% | 0.0006% | 1.4007% | 0.0024% |
| 过去三年 | 11.5574% | 0.0038% | 9.5369% | 0.0013% | 2.0205% | 0.0025% |
| 自基金分级日起至今 | 19.8939% | 0.0057% | 16.4955% | 0.0017% | 3.3984% | 0.0040% |

注：本基金的业绩比较基准为六个月银行定期存款利率（税后）。

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

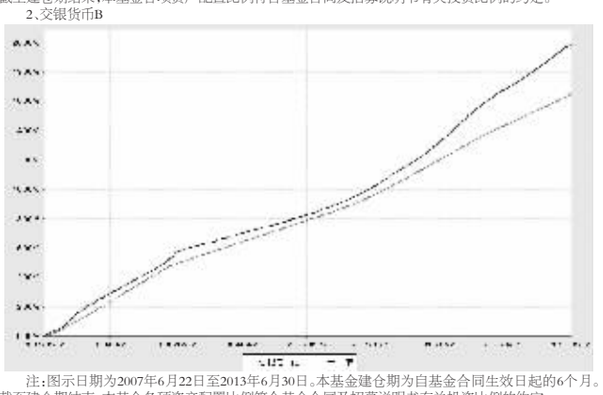
交银施罗德货币市场证券投资基金
累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
（2006年1月20日至2013年6月30日）

1、交银货币A



注：图示日期为2006年1月20日至2013年6月30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、交银货币B



注：图示日期为2007年6月22日至2013年6月30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。

## 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6月30日，公司已经发行并管理的基金共有二十八只：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）和交银施罗德成长30股票型证券投资基金（基金合同生效日：2013年6月5日）。

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、交银信用添利债券、交银理财21天债券的基金经理，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 | 2011-06-09 | - | 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做出决定并公告(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 公平交易制度的执行情况

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基金运作的公平，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。

公司建立资源共享的投资研究信息平台，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。公司在交易执行环节实行集中交易制度，建立公平的交易分配制度。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。

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账户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。

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，未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司管理的所有投资组合未发生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超过该证券当日总成交量5%的情形。本基金于本报告期内未出现异常交易行为。

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

2013年上半年度，我国经济整体复苏力度偏弱，通胀数据也低于市场预期，货币政策整体偏紧。在经济整体弱复苏背景下，市场对宏观的乐观预期逐渐转弱，债券市场在一、二季度整体呈现震荡上涨态势，收益率曲线平坦化下移，但在4月份及6月份经历了两次基本面因素之外的扰动。4月份，银行间债券市场监管风暴使得中长端债券供给大量增加，收益率一度大幅上行，在理财市场逐渐回归理性之后，债市的运行脉络重回基本面上，收益率继续下行；6月份端午之后，流动性成为债券市场唯一关注的指标。全市场范围内的流动性紧张始于外汇占款持续下降，在对央行投放流动性的预期不断落空的情况下，银行间货币市场流动性紧张逐渐达到了较为极端的状态，出现了6月20日30%的隔夜回购利率。货币市场利率飙升表明了央行对之前银行表外业务扩张的强约束态度和提高金融机构风险防范意识的决心。6月25日，在央行发布报告《合理调节流动性 维护货币市场稳定》之后，市场流动性逐步恢复正常，债市的表现也逐渐平稳。

本基金在上半年度保持较高的存款比例以应付半年末的流动性压力。同时由于流动性可能在未来仍会有较大波动，因此本基金在二季度逐步增加高等级的信用债持仓和降低低评级品种。

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1.6541%，交银货币B净值收益率为1.7760%，同期业绩比较基准增长率为1.3885%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，由于央行的态度对货币市场将产生较大影响，且由于我们目前的经济处于转型期，金融结构也在不断改善之中，对影子银行的监管仍将继续，因此，流动性可能在下半年仍有较大波动的风险。因此，本基金将通过积极调整组合配置，争取为基金持有人带来较为稳健的收益。

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，由量化投资部进行测算和认证，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 | 10,356,823.73 | 10,356,823.73 | - | 每日分配，按月结转份额 |
| 交银货币B | 138,240,806.32 | 138,240,806.32 | - | 每日分配，按月结转份额 |
| 合计 | 148,597,630.05 | 148,597,630.05 | - | |

## 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2013年1月1日至2013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
2013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：2013年6月30日

单位：人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末 2013年6月30日 | 上年度末 2012年12月31日 |
|---|---|---|---|
| 资 产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 792,214,461.28 | 2,465,102,918.66 |
| 结算备付金 | | 2,454,545.45 | - |
| 存出保证金 | | - | - |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 3,982,113,389.05 | 3,186,653,423.90 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 3,982,113,389.05 | 3,186,653,423.90 |
| 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 | 1,799,843,481.32 | 4,741,945,163.72 |
| 应收证券清算款 | | 40,106,836.71 | - |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 46,824,246.67 | 82,922,844.53 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 8,790,178.60 | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 6,672,347,139.08 | 10,476,624,350.81 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2013年6月30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 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | 3,424,911.32 | 10,062,415.98 |
| 应付管理人报酬 | | 2,398,305.23 | 1,414,049.36 |
| 应付托管费 | | 726,759.16 | 428,499.82 |
| 应付销售服务费 | | 174,354.21 | 233,286.44 |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 102,282.50 | 72,749.22 |
| 应交税费 | | 3,033,664.67 | 3,033,664.67 |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | 8,035,072.07 | 11,924,503.27 |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 107,434.10 | 159,204.62 |
| 负债合计 | | 18,002,783.26 | 27,328,373.38 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 6,654,344,355.82 | 10,449,295,977.43 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | - | - |
| 所有者权益合计 | | 6,654,344,355.82 | 10,449,295,977.43 |
| 负债和所有者权益总计 | | 6,672,347,139.08 | 10,476,624,350.81 |

注：1、报告截止日2013年6月30日，基金份额净值1.0000元，基金份额总额A级：371,970,177.34份，B级：6,282,374,178.48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：2013年1月1日至2013年6月30日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期 2013年1月1日至2013年6月30日 | 上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日 |
|---|---|---|---|
| 一、收入 | | 177,208,557.46 | 210,743,989.96 |
| 1.利息收入 | | 162,990,932.68 | 196,299,149.38 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 86,577,544.43 | 137,878,985.59 |
| 债券利息收入 | | 60,617,133.81 | 51,800,574.11 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 15,796,254.44 | 6,619,589.68 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 5,003,769.05 | 14,444,840.58 |
| 其中：股票投资收益 | | 0.00 | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.12 | 5,003,769.05 | 14,444,840.58 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.13 | - | - |
| 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） | 6.4.7.14 | 9,213,855.73 | - |
| 减：二、费用 | | 28,610,927.41 | 25,705,054.64 |
| 1.管理人报酬 | | 13,921,019.45 | 13,849,177.09 |
| 2.托管费 | | 4,218,490.64 | 4,196,720.50 |
| 3.销售服务费 | | 1,187,418.42 | 1,478,972.73 |
| 4.交易费用 | | - | - |
| 5.利息支出 | | 9,108,589.86 | 5,998,017.50 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 9,108,589.86 | 5,998,017.50 |
| 6.其他费用 | 6.4.7.15 | 175,409.04 | 182,166.82 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 148,597,630.05 | 185,038,935.32 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 148,597,630.05 | 185,038,935.32 |

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：2013年1月1日至2013年6月30日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2013年1月1日至2013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） | 10,449,295,977.43 | - | 10,449,295,977.43 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 148,597,630.05 | 148,597,630.05 |
| 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） | -3,794,951,621.61 | - | -3,794,951,621.61 |
| 其中：1.基金申购款 | 39,522,079,226.45 | - | 39,522,079,226.45 |
| 2.基金赎回款 | -43,317,030,848.06 | - | -43,317,030,848.06 |
| 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） | - | -148,597,630.05 | -148,597,630.05 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 6,654,344,355.82 | - | 6,654,344,355.82 |
| 项目 | 上年度可比期间 2012年1月1日至2012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） | 8,386,543,352.42 | - | 8,386,543,352.42 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 185,038,935.32 | 185,038,935.32 |
| 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） | -1,530,060,850.46 | - | -1,530,060,850.46 |
| 其中：1.基金申购款 | 42,944,380,815.31 | - | 42,944,380,815.31 |
| 2.基金赎回款 | -44,474,441,665.77 | - | -44,474,441,665.77 |
| 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） | - | -185,038,935.32 | -185,038,935.32 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 6,856,482,501.96 | - | 6,856,482,501.96 |

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

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(特殊普通合伙)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

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《交银施罗德货币市场证券投资基金基金合同》和中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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2013年6月30日的财务状况以及2013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》、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，包括买卖债券的差价收入，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，暂不缴纳企业所得税。

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

本基金本报告期内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交易。

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 2013年1月1日至2013年6月30日 | 上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 13,921,019.45 | 13,849,177.09 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 956,505.06 | 1,307,091.28 |

注：支付基金管理人交银施罗德基金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 2013年1月1日至2013年6月30日 | 上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 4,218,490.64 | 4,196,720.50 |

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 2013年1月1日至2013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 |
| 交银施罗德基金公司 | 52,545.99 | 297,269.41 | 349,815.40 |
| 中国农业银行 | 197,874.74 | 7,724.31 | 205,599.05 |
| 交通银行 | 330,498.43 | 6,862.25 | 337,360.68 |
| 合计 | 580,919.16 | 311,855.97 | 892,775.13 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 2012年1月1日至2012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 |
| 交银施罗德基金公司 | 56,153.68 | 290,499.83 | 346,653.51 |
| 中国农业银行 | 242,602.56 | 16,650.87 | 259,253.43 |
| 交通银行 | 380,033.53 | 7,408.79 | 387,442.32 |
| 合计 | 678,789.77 | 314,559.49 | 993,349.26 |

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

| 本期 2013年1月1日至2013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 | 466,581,091.49 | 20,028,956.71 | - | - | - | - |
| 上年度可比期间 2012年1月1日至2012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 | 344,018,397.79 | 48,677,794.54 | - | - | - | - |

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生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

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金。

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 2013年1月1日至2013年6月30日 | | 上年度可比期间 2012年1月1日至2012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 | 172,214,461.28 | 428,736.50 | 120,117,481.75 | 433,804.55 |

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未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.8.7其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.9 期末(2013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/增发证券而流通受限的证券。

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

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

## 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 | 3,982,113,389.05 | 59.68 |
| | 其中：债券 | 3,982,113,389.05 | 59.68 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | 1,799,843,481.32 | 26.97 |
| | 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 | 794,669,006.73 | 11.91 |
| 4 | 其他各项资产 | 95,721,261.98 | 1.