# 交银施罗德货币市场证券投资基金

# 2013 年度报告摘要

2013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：二〇一四年三月二十六日**

## §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 2014 年 3 月 24 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 2013 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 | 3,928,819,936.67 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 | 1,917,998,840.58 份 | 2,010,821,096.09 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 | 010-66060069 |
| | 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 | | 021-61055054 | 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.fund001.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 | 2013年 | | 2012年 | | 2011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 | 28,750,637.25 | 210,799,012.77 | 29,684,401.04 | 275,903,841.11 | 8,603,820.69 | 45,243,811.97 |
| 本期利润 | 28,750,637.25 | 210,799,012.77 | 29,684,401.04 | 275,903,841.11 | 8,603,820.69 | 45,243,811.97 |
| 本期净值收益率 | 3.56% | 3.81% | 3.74% | 3.99% | 3.26% | 3.50% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2013年末 | | 2012年末 | | 2011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 | 1,917,998,840.58 | 2,010,821,096.09 | 2,030,992,034.15 | 8,418,303,943.28 | 2,393,326,251.47 | 5,993,217,100.95 |
| 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、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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 1.1566% | 0.0018% | 0.7058% | 0.0000% | 0.4508% | 0.0018% |
| 过去六个月 | 1.8794% | 0.0039% | 1.4115% | 0.0000% | 0.4679% | 0.0039% |
| 过去一年 | 3.5646% | 0.0034% | 2.8000% | 0.0000% | 0.7646% | 0.0034% |
| 过去三年 | 10.9337% | 0.0034% | 8.9195% | 0.0007% | 2.0142% | 0.0027% |
| 过去五年 | 14.2149% | 0.0045% | 12.9284% | 0.0014% | 1.2865% | 0.0031% |
| 自基金合同生效起至今 | 23.8393% | 0.0053% | 20.4296% | 0.0018% | 3.4097% | 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）。

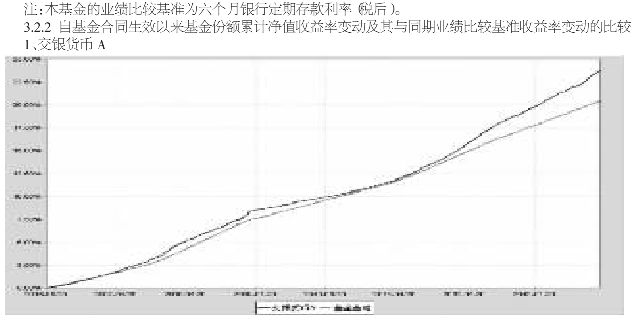
2. 交银货币 B：

| 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 1.2164% | 0.0018% | 0.7058% | 0.0000% | 0.5106% | 0.0018% |
| 过去六个月 | 2.0012% | 0.0039% | 1.4115% | 0.0000% | 0.5897% | 0.0039% |
| 过去一年 | 3.8128% | 0.0034% | 2.8000% | 0.0000% | 1.0128% | 0.0034% |
| 过去三年 | 11.7317% | 0.0034% | 8.9195% | 0.0007% | 2.8122% | 0.0027% |
| 过去五年 | 15.5911% | 0.0045% | 12.9284% | 0.0014% | 2.6627% | 0.0031% |
| 自基金分级日起至今 | 22.2933% | 0.0057% | 17.9070% | 0.0016% | 4.3863% | 0.0041% |

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）。

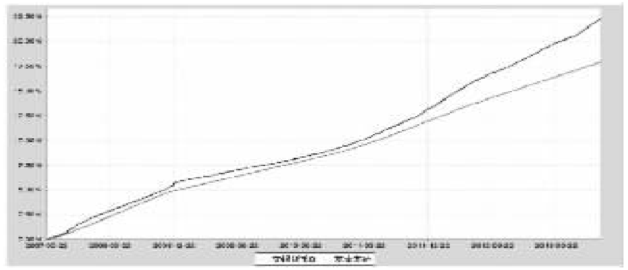
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

1、交银货币 A



注：图示日期为 2006 年 1 月 20 日至 2013 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。

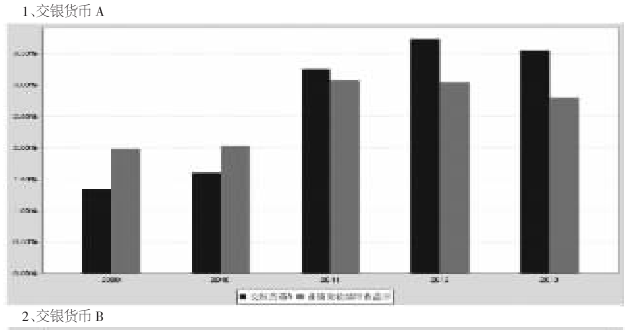
2、交银货币 B



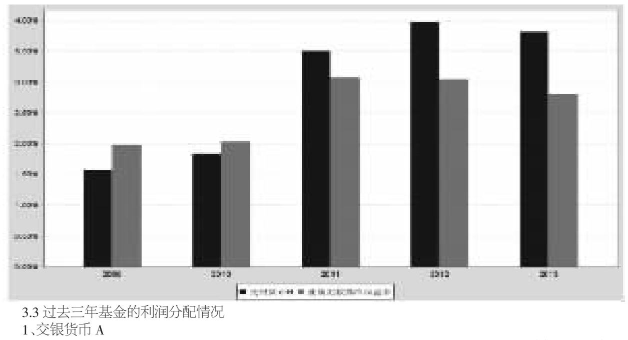
注：图示日期为 2007 年 6 月 22 日至 2013 年 12 月 31 日。本基金建仓期为自基金合同生效日起的 6 个月。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

3.2.3 过去五年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



2、交银货币 B



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 |
|---|---|---|---|---|---|
| 2013年 | 18,467,500.45 | 6,233,395.11 | 4,049,741.69 | 28,750,637.25 | - |
| 2012年 | 22,715,567.31 | 7,750,583.75 | -781,750.02 | 29,684,401.04 | - |
| 2011年 | 4,749,122.26 | 1,247,535.47 | 2,607,162.96 | 8,603,820.69 | - |
| 合计 | 45,932,190.02 | 15,231,514.33 | 5,875,154.63 | 67,038,858.98 | - |

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 |
|---|---|---|---|---|---|
| 2013年 | 137,322,926.18 | 77,570,979.01 | -4,094,892.42 | 210,799,012.77 | - |
| 2012年 | 174,876,661.89 | 101,598,060.09 | -570,880.87 | 275,903,841.11 | - |
| 2011年 | 29,022,341.28 | 9,120,155.18 | 7,101,315.51 | 45,243,811.97 | - |
| 合计 | 341,221,929.35 | 188,289,194.28 | 2,435,542.22 | 531,946,665.85 | - |

## §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 12 月 31 日，公司已经发行并管理的基金共有三十一只：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）、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）、交银施罗德定期支付月月丰债券型证券投资基金（基金合同生效日：2013 年 8 月 13 日）、交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金（基金合同生效日：2013 年 9 月 4 日）、交银施罗德荣泰保本混合型证券投资基金（基金合同生效日：2013 年 12 月 25 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 公平交易制度和控制方法

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所管理的所有资产组合投资运作的公平。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。制度中包含的主要控制方法如下：

（1）公司建立资源共享的投资研究信息平台，所有研究成果对所有投资组合公平开放，确保各投资组合在获得研究支持和实施投资决策方面享有公平的机会。

（2）公司将投资管理职能和交易执行职能相隔离，实行集中交易制度，建立了合理且可操作的公平交易分配机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。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。

（3）公司建立了清晰的投资授权制度，明确各层级投资决策主体的职责和权限划分，组合投资经理充分发挥专业判断能力，不受他人干预，在授权范围内独立行使投资决策权，维护公平的投资管理环境，维护所管理投资组合的合法利益，保证各投资组合交易决策的客观性和独立性，防范不公平及异常交易的发生。

（4）公司建立统一的投资对象备选库和交易对手备选库，制定明确的备选库建立、维护程序。在全公司适用股票、债券备选库的基础上，根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和关联交易限制等，按需要建立不同投资组合的投资对象风格库和交易对手备选库，组合经理在此基础上根据投资授权构建投资组合。

（5）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投资组合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。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合。通过投资交易监控、交易数据分析、专项稽核检查等，本基金管理人未发现任何违反公平交易制度的行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内，本公司管理的所有投资组合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没有超过该证券当日总成交量 5%的情形，本基金与本公司管理的其他投资组合在不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）同向交易的交易价差未出现异常。

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

2013 年对债券市场是一个较为惨痛的年份，上半年主要受流动性推升影响，收益率逐级走低，也给债券基金带来较为丰厚的回报；自 4 月监管风暴，到 6 月钱荒事件，再到利率市场化大背景下三季度无风险利率的大幅飙升，债券从业者在 2013 年里经历了流动性风险、利率风险、信用风险的三重考验。尤其是较为惨痛的三季度开始的无风险利率的飙升，10 年期国债收益率从 3.8%最高上行至 4.7%水平；在无风险利率继续上行过程中，信用产品的收益呈现加速上行的走势，5 年 AA 企业债（有担保）的估值收益从 6.2%快速上行至 7.5%以上水平，信用利差开始扩大。期限结构上看，期限利差依旧较小，收益率曲线仍极为平坦。

宏观方面，CPI 在 10 月份上升到全年最高点 3.2%之后开始小幅回落；受食品涨幅回落影响，11 月 CPI 同比降至 3.0%，12 月同比预计将继续下降。与通胀走势相仿，工业增加值在 11 月也出现了下降的趋势。在基本面小幅回落的情况下，12 月无风险利率上升的趋势趋缓，然而信用产品收益在 12 月继续上行，使得信用利差继续扩大。总体而言，四季度债券收益率的上行主要仍受到银行资产负债表调整以及对年底流动性紧张预期双方面的影响。

本基金在四季度仍保持较大比例的银行协议存款，提高了组合的静态收益，也在年底流动性较为紧张的情况下，保持了基金收益的平稳。

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 3.5646%，交银货币 B 净值收益率为 3.8128%，同期业绩比较基准增长率为 2.8000%。

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 2014 年，我们可以从债券市场的四个维度去分析：基本面、流动性、供求、估值。

2014 年经济增长动能仍然趋弱，2013 年高企利率或将抑制投资需求，而消费相对保持稳定，海外的复苏从目前数据来看应好于此前预期，通胀在上半年保持较低水平或将是大概率事件。因此综合来看，经济大幅向上或大幅向下可能性都比较低，较大可能性在围绕 7.5%的中枢运行。

流动性上看，从央行公布利率走廊以及四季度货币政策报告上看，维持利率的稳定将是全年的基调；因此，流动性在 2014 年应优于 2013 年，而从 NDF 表现出的汇率走势上看，人民币依旧处于升值预期，外汇占款对流动性的影响仍较正面，我们需要更多地关注央行在公开市场上的操作及其态度。

2013 年的利率高企是否真的会大量抑制融资需求无法量化，但从传统分析上看，边际影响不容忽视；另一方面，随着 2013 年券商、保险、基金、银行各家都降低了组合杠杆及久期，从需求上看，市场有能力承受一定的供给。但利率产品的供给仍将较多，同样将对收益率可能的下行造成不利影响。更重要的是，2013 年对影子银行，非标资产的规范及清理工作是否能在 2014 年真正得以实施也将对债券市场产生重要的影响。

从估值上看，债券的绝对收益和信用利差都处于较高水平。

综合以上四点，2014 年基本面可能趋弱，货币市场的流动性可能将优于 2013 年；对货币基金而言，若协议存款和短端利率下行，整体货币市场的收益率也将适当下行。

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，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，本基金每日分配收益，按月结转份额。本基金本报告期内利润分配情况参见年度报告正文 7.4.7.10。

## §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》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 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。

## §6 审计报告

德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）对交银施罗德货币市场证券投资基金 2013 年 12 月 31 日的资产负债表，2013 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（2014）第 P0233 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：2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末<br>2013年12月31日 | 上年度末<br>2012年12月31日 |
|---|---|---|---|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 3,629,815,007.28 | 2,465,102,918.66 |
| 结算备付金 | | - | - |
| 存出保证金 | | - | - |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 768,414,984.02 | 3,186,653,423.90 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 768,414,984.02 | 3,186,653,423.90 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 7.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 7.4.7.4 | 179,499,869.25 | 4,741,945,163.72 |
| 应收证券清算款 | | - | - |
| 应收利息 | 7.4.7.5 | 36,772,308.05 | 82,922,844.53 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 138,798,171.74 | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 7.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 4,753,300,340.34 | 10,476,624,350.81 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末<br>2013年12月31日 | 上年度末<br>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 | 7.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | 476,598,811.70 | - |
| 应付证券清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | 329,572,172.79 | 10,062,415.98 |
| 应付管理人报酬 | | 1,792,673.93 | 1,414,049.36 |
| 应付托管费 | | 543,234.54 | 428,499.82 |
| 应付销售服务费 | | 523,910.05 | 233,286.44 |
| 应付交易费用 | 7.4.7.7 | 30,913.66 | 72,749.22 |
| 应交税费 | | 3,292,568.78 | 3,033,664.67 |
| 应付利息 | | 44,383.98 | - |
| 应付利润 | | 11,879,352.54 | 11,924,503.27 |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 7.4.7.8 | 202,381.70 | 159,204.62 |
| 负债合计 | | 824,480,403.67 | 27,328,373.38 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 7.4.7.9 | 3,928,819,936.67 | 10,449,295,977.43 |
| 未分配利润 | 7.4.7.10 | - | - |
| 所有者权益合计 | | 3,928,819,936.67 | 10,449,295,977.43 |
| 负债和所有者权益总计 | | 4,753,300,340.34 | 10,476,624,350.81 |

注：1、报告截止日 2013 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 3,928,819,936.67 份，其中 A 类基金份额 1,917,998,840.58 份，B 类基金份额 2,010,821,096.09 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：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期<br>2013年1月1日至2013年12月31日 | 上年度可比期间<br>2012年1月1日至2012年12月31日 |
|---|---|---|---|
| 一、收入 | | 280,834,421.89 | 358,626,336.05 |
| 1.利息收入 | | 278,783,471.63 | 339,505,250.22 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.11 | 169,311,504.62 | 213,338,164.03 |
| 债券利息收入 | | 87,983,141.26 | 114,444,785.06 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 21,488,825.75 | 11,722,301.13 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | -7,162,905.47 | 19,121,085.83 |
| 其中：股票投资收益 | | - | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.12 | -7,162,905.47 | 19,121,085.83 |
| 资产支持证券投资收益 | 7.4.7.13 | - | - |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 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） | 7.4.7.14 | 9,213,855.73 | - |
| 减：二、费用 | | 41,284,771.87 | 53,038,093.90 |
| 1.管理人报酬 | | 21,447,957.72 | 26,007,753.71 |
| 2.托管费 | | 6,499,380.97 | 7,881,137.75 |
| 3.销售服务费 | | 2,444,411.57 | 2,697,457.70 |
| 4.交易费用 | | - | - |
| 5.利息支出 | | 10,560,092.07 | 16,081,742.49 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 10,560,092.07 | 16,081,742.49 |
| 6.其他费用 | 7.4.7.15 | 332,929.54 | 370,002.25 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 239,549,650.02 | 305,588,242.15 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 239,549,650.02 | 305,588,242.15 |

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：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2013年1月1日至2013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） | 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） | - | 239,549,650.02 | 239,549,650.02 |
| 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） | -6,520,476,040.76 | - | -6,520,476,040.76 |
| 其中：1.基金申购款 | 62,803,167,077.33 | - | 62,803,167,077.33 |
| 2.基金赎回款 | -69,323,643,118.09 | - | -69,323,643,118.09 |
| 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） | - | -239,549,650.02 | -239,549,650.02 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 3,928,819,936.67 | - | 3,928,819,936.67 |
| 项目 | 上年度可比期间<br>2012年1月1日至2012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） | 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） | - | 305,588,242.15 | 305,588,242.15 |
| 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） | 2,062,752,625.01 | - | 2,062,752,625.01 |
| 其中：1.基金申购款 | 80,880,636,847.65 | - | 80,880,636,847.65 |
| 2.基金赎回款 | -78,817,884,222.64 | - | -78,817,884,222.64 |
| 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） | - | -305,588,242.15 | -305,588,242.15 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 10,449,295,977.43 | - | 10,449,295,977.43 |

报表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

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”）以证监基金字［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 2013 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（2013 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）的银行定期存款或大额存单、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）。

本财务报表由本基金的基金管理人交银施罗德基金管理有限公司于 2014 年 3 月 21 日批准报出。

7.4.2 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》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的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。

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有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2013 年 12 月 31 日的财务状况以及 2013 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。

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（“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 |
| 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交易。

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<br>2013年1月1日至2013年12月31日 | 上年度可比期间<br>2012年1月1日至2012年12月31日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 21,447,957.72 | 26,007,753.71 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 2,243,491.08 | 2,279,379.41 |

注：支付基金管理人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<br>2013年1月1日至2013年12月31日 | 上年度可比期间<br>2012年1月1日至2012年12月31日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 6,499,380.97 | 7,881,137.75 |

注：支付基金托管人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<br>2013年1月1日至2013年12月31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 | 103,346.10 | 397,406.95 | 500,753.05 |
| 中国农业银行 | 580,939.56 | 23,579.96 | 604,519.52 |
| 交通银行 | 819,459.14 | 15,587.91 | 835,047.05 |
| 合计 | 1,503,744.80 | 436,574.82 | 1,940,319.62 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2012年1月1日至2012年12月31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 | 131,054.09 | 549,418.06 | 680,472.15 |
| 中国农业银行 | 414,781.56 | 26,224.43 | 441,005.99 |
| 交通银行 | 676,534.57 | 12,186.87 | 688,721.44 |
| 合计 | 1,222,370.22 | 587,829.36 | 1,810,199.58 |

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%的年费率计提，B 级基金按前一日基金资产净值的 0.01%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给交银施罗德基金公司，再交由交银施罗德基金公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

A 级基金日销售服务费=前一日 A 级基金份额对应的资产净值×0.25%÷当年天数；

B 级基金日销售服务费=前一日 B 级基金份额对应的资产净值×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<br>2013年1月1日至2013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 | 466,581,091.49 | 80,184,834.24 | - | - | - | - |
| 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<br>2012年1月1日至2012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 | 394,004,113.54 | 302,101,791.12 | - | - | 298,000,000.00 | 24,691.47 |
| 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未发生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未持有本基金。

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<br>2013年1月1日至2013年12月31日 | | 上年度可比期间<br>2012年1月1日至2012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 | 5,815,007.28 | 559,625.56 | 15,102,918.66 | 730,809.51 |

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，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未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.8.7 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。

7.4.9 期末（2013 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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

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通受限股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，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 476,598,811.70 元，是以如下债券作为抵押：

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 |
|---|---|---|---|---|---|
| 068019 | 06京投债 | 2014-01-02 | 98.73 | 400,000 | 39,492,000.00 |
| 130243 | 13国开 43 | 2014-01-02 | 99.30 | 600,000 | 59,580,000.00 |
| 130311 | 13进出 11 | 2014-01-02 | 99.08 | 1,200,000 | 118,896,000.00 |
| 090407 | 09农发 07 | 2014-01-02 | 99.77 | 600,000 | 59,862,000.00 |
| 041362017 | 13晋阳光 CP001 | 2014-01-02 | 99.70 | 300,000 | 29,910,000.00 |
| 041370002 | 13宏润建设 CP001 | 2014-01-02 | 99.55 | 200,000 | 19,910,000.00 |
| 041362042 | 13黑牡丹 CP001 | 2014-01-02 | 99.68 | 300,000 | 29,904,000.00 |
| 041362046 | 13九龙江 CP002 | 2014-01-02 | 100.00 | 1,000,000 | 100,000,000.00 |
| 041355014 | 13天业 CP001 | 2014-01-03 | 99.78 | 300,000 | 29,934,000.00 |
| 合计 | | - | - | 4,900,000 | 487,488,000.00 |

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

（1）公允价值

（a）不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

（b）以公允价值计量的金融工具

（i）金融工具公允价值计量的方法

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值确定公允价值计量层级。公允价值计量层级可分为：

第一层级：同类资产或负债在活跃市场上（未经调整）的报价；

第二层级：直接（比如取自价格）或间接（比如根据价格推算的）可观察到的、除市场报价以外的有关资产或负债的输入值估值；

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值（不可观察输入值）。

（ii）各层次金融工具公允价值

于 2013 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第二层级的余额为 768,414,984.02 元，无属于第一层级和第三层级的余额（2012 年 12 月 31 日：第二层级 3,186,653,423.90 元，无属于第一层级和第三层级的余额）。

（iii）公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层级或第三层级。

（iv）第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

（2）除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §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 | 768,414,984.02 | 16.17 |
| | 其中：债券 | 768,414,984.02 | 16.17 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | 179,499,869.25 | 3.78 |
| | 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 | 3,629,815,007.28 | 76.36 |
| 4 | 其他各项资产 | 175,570,479.79 | 3.69 |
| | 合计 | 4,753,300,340.34 | 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 | 3.83 | |
| | 其中：买断式回购融资 | 0.02 | |
| 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 | 476,598,811.70 | 12.13 |
| | 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

本基金本报告期内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 | 68 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 165 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 32 |

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

本基金本报告期内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 | 54.71 | 12.13 |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30天（含）—60 天 | 6.87 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60天（含）—90 天 | 33.86 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 4 | 90天（含）—180 天 | 12.69 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | 1.01 | - |
| 5 | 180天（含）—397 天（含） | 8.39 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| | 合计 | 116.52 | 12.13 |

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 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 238,932,787.90 | 6.08 |
| | 其中：政策性金融债 | 238,932,787.90 | 6.08 |
| 4 | 企业债券 | 39,678,186.83 | 1.01 |
| 5 | 企业短期融资券 | 489,804,009.29 | 12.47 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 其他 | - | - |
| 8 | 合计 | 768,414,984.02 | 19.56 |
| 9 | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | 39,678,186.83 | 1.01 |

8.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序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 | 130311 | 13进出 11 | 1,200,000 | 118,990,754.24 | 3.03 |
| 2 | 041359012 | 13沙钢 CP001 | 1,100,000 | 109,985,047.59 | 2.80 |
| 3 | 041358057 | 13皖高速 CP001 | 1,000,000 | 99,923,170.13 | 2.54 |
| 4 | 041362046 | 13九龙江 CP002 | 1,000,000 | 99,909,479.75 | 2.54 |
| 5 | 090407 | 09农发 07 | 600,000 | 60,122,923.11 | 1.53 |
| 6 | 130243 | 13国开 43 | 600,000 | 59,819,110.55 | 1.52 |
| 7 | 041355014 | 13天业 CP001 | 400,000 | 40,021,995.33 | 1.02 |
| 8 | 041353017 | 13昆钢 CP001 | 400,000 | 40,007,231.35 | 1.02 |
| 9 | 068019 | 06京投债 | 400,000 | 39,678,186.83 | 1.01 |
| 10 | 041362017 | 13晋阳光 CP001 | 300,000 | 30,000,053.28 | 0.76 |

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 | 13次 |
| 报告期内偏离度的最高值 | 0.2438% |
| 报告期内偏离度的最低值 | -0.4999% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.1149% |

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末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 | 36,772,308.05 |
| 4 | 应收申购款 | 138,798,171.74 |
| 5 | 其他应收款 | - |
| 6 | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 175,570,479.79 |

8.8.5 其他需说明的重要事项

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §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 | 23,645 | 81,116.47 | 38,195,174.54 | 1.99% | 1,879,803,666.04 | 98.01% |
| 交银货币 B | 103 | 19,522,534.91 | 1,263,519,335.03 | 62.84% | 747,301,761.06 | 37.16% |
| 合计 | 23,748 | 165,437.93 | 1,301,714,509.57 | 33.13% | 2,627,105,427.10 | 66.87% |

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|---|---|---|---|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 交银货币 A | 9464718.36 | 0.49% |
| | 交银货币 B | - | - |
| | 合计 | 9464718.36 | 0.24% |

注：本基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人（不包括本基金的基金经理）持有本基金份额总量的数量区间为 100 万份以上；本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0 至 10 万份（含）。

## §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 | 2,030,992,034.15 | 8,418,303,943.28 |
| 本报告期基金总申购份额 | 6,937,375,022.11 | 55,865,792,055.22 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 7,050,368,215.68 | 62,273,274,902.41 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 1,917,998,840.58 | 2,010,821,096.09 |

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；

3、本基金于 2007 年 6 月 22 日起实行销售服务费分级收费方式。

## §11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本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：本基金管理人本报告期内未发生重大人事变动。

2、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动：本基金托管人的基金托管部门本报告期内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

本报告期内未发生涉及本基金管理人、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

本基金本报告期内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

本报告期内，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（特殊普通合伙），本期审计费用为 80,000 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

本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员本报告期内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 | - | - | 13,881,000,000.00 | 100.00% | - | - |

注：1、报告期内，本基金交易单元未发生变化；

2、租用证券公司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、租用证券公司交易单元的程序：首先根据租用证券公司交易单元的选择标准进行综合评价，然后根据评价选择基金交易单元。研究部提交方案，并上报公司批准。

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期内不存在偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

交银施罗德基金管理有限公司
二〇一四年三月二十六日