

## 交银施罗德货币市场证券投资基金

## [2012] 第二季度报告

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:二〇一二年七月十八日

## §1 重要提示

基金管理人的董事、监事、高级管理人员和基金经理人声明本报告不存在虚假记载、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。基金托管人声明本报告不存在虚假记载、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。

本报告所载财务数据未经审计。

本报告期自2012年4月1日至6月30日。

## §2 基金产品概况

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1月20日

报告期末基金份额总额:6,156,482,501.96份

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、金融市场动态、资金流动格局、货币市场收益率曲线等因素等的分析，合理安排组合期限结构，积极选择投资工具，实现主动性的投资策略和精细化的操作手法。

## §3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

报告期(2012年4月1日-2012年6月30日) 单位:人民币

主要财务指标 交银货币 A 交银货币 B

1.本期已实现收益 8,708,360.92 109,928,421.43

2.本期利润 8,708,360.92 109,928,421.43

3.期末基金资产净值 661,140,850.95 6,195,341,651.01

注:1.自2007年6月22日起,本基金实行管理费率收取方式分设两级基金份额:A级基金份额收取0.25%的年费并按季计提销售服务费,B级基金份额不收取销售服务费并按季计提0.25%的年费并按季计提销售服务费,其他费用与A级基金的费用与分级前基金费用相同。B级基金份额不收取销售服务费并按季计提销售服务费,其他费用与A级基金的费用与分级前基金费用相同。

2.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,本期利润即为本期已实现收益和本期的利息收入。

3.期末基金资产净值。

3.2.1 本报告期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 净值收益率(①) 净值收益率的标准差(②) 业绩比较基准收益率(③) 业绩比较基准收益率的标准差(④) ①-③ ②-④

过去三个月 1.0186% 0.0021% 0.8070% 0.0003% 0.2116% 0.0018%

注:本基金收益率分母按月结转份额。

2.交银货币 B:

阶段 净值收益率(①) 净值收益率的标准差(②) 业绩比较基准收益率(③) 业绩比较基准收益率的标准差(④) ①-③ ②-④

过去三个月 1.0788% 0.0022% 0.8070% 0.0003% 0.2718% 0.0019%

注:本基金收益率分母按月结转份额。

3.2.2 基金合同生效以来基金的份额累计净值增长率及其走势对比如图

2006年1月20日至2012年6月30日

1. 交银货币 A:

注:图示日期为2006年1月20日至2012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。截至建仓结束及本报告期末,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2012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。截至建仓结束及本报告期末,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。

3.4 管理人报告

4.1 基金经理、基金基金经理小组简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证书从业年限 说明

林洪钧 本基金的基金经理,交银施罗德信用添利债券型证券投资基金基金经理 2011年6-9 - 8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服务部经理,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,历任专营部投资经理助理、专户投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵守信守情况的说明

在报告期内,基金管理人严格遵循《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同以及其他相关法律法规的规定,并本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理本基金,基金投资管理符合有关法律法规及基金合同所规定的投资比例和投资策略。

4.3 公公平交易专项说明

4.3.1 公公平交易的执行情况

本公司严格按照《证券投资基金运作管理办法》公平对待旗下各货币组合,本报告组合与公司旗下管理的不同类型的货币组合、分投资类别、品种、期限的资产的发行主体未受到公开融资和处罚。

4.3.2 公公平交易的执行情况

报告期内本公司严格执行公平交易制度,公平对待旗下各货币组合,未发现明显不公平的交易行为。

4.3.3 公公平交易的执行情况

在报告期内,本公司严格执行公平交易制度,公平对待旗下各货币组合,未发现明显不公平的交易行为。

4.3.4 公公平交易的执行情况

在报告期内,本公司严格执行公平交易制度,公平对待旗下各货币组合,未发现明显不公平的交易行为。

4.3.5 公公平交易的执行情况

在报告期内,本公司严格执行公平交易制度,公平对待旗下各货币组合,未发现明显不公平的交易行为。

4.3.6 公公平交易的执行情况

在报告期内,本公司严格执行公平交易制度,公平对待旗下各货币组合,未发现明显不公平的交易行为。

4.3.7 公公平交易的执行情况

在报告期内,本公司严格执行公平交易制度,公平对待旗下各货币组合,未发现明显不公平的交易行为。

4.3.8 公公平交易的执行情况

在报告期内,本公司严格执行公平交易制度,公平对待旗下各货币组合,未发现明显不公平的交易行为。

4.3.9 公公平交易的执行情况

在报告期内,本公司严格执行公平交易制度,公平对待旗下各货币组合,未发现明显不公平的交易行为。

4.3.10 公公平交易的执行情况

在报告期内,本公司严格执行公平交易制度,公平对待旗下各货币组合,未发现明显不公平的交易行为。

4.3.11 公公平交易的执行情况

在报告期内,本公司严格执行公平交易制度,公平对待旗下各货币组合,未发现明显不公平的交易行为。

4.3.12 公公平交易的执行情况

在报告期内,本公司严格执行公平交易制度,公平对待旗下各货币组合,未发现明显不公平的交易行为。

4.3.13 公公平交易的执行情况

在报告期内,本公司严格执行公平交易制度,公平对待旗下各货币组合,未发现明显不公平的交易行为。

4.3.14 公公平交易的执行情况

在报告期内,本公司严格执行公平交易制度,公平对待旗下各货币组合,未发现明显不公平的交易行为。

4.3.15 公公平交易的执行情况

在报告期内,本公司严格执行公平交易制度,公平对待旗下各货币组合,未发现明显不公平的交易行为。

4.3.16 公公平交易的执行情况

在报告期内,本公司严格执行公平交易制度,公平对待旗下各货币组合,未发现明显不公平的交易行为。

4.3.17 公公平交易的执行情况

在报告期内,本公司严格执行公平交易制度,公平对待旗下各货币组合,未发现明显不公平的交易行为。

4.3.18 公公平交易的执行情况

在报告期内,本公司严格执行公平交易制度,公平对待旗下各货币组合,未发现明显不公平的交易行为。

4.3.19 公公平交易的执行情况

在报告期内,本公司严格执行公平交易制度,公平对待旗下各货币组合,未发现明显不公平的交易行为。

4.3.20 公公平交易的执行情况

在报告期内,本公司严格执行公平交易制度,公平对待旗下各货币组合,未发现明显不公平的交易行为。

4.3.21 公公平交易的执行情况

在报告期内,本公司严格执行公平交易制度,公平对待旗下各货币组合,未发现明显不公平的交易行为。

4.3.22 公公平交易的执行情况

在报告期内,本公司严格执行公平交易制度,公平对待旗下各货币组合,未发现明显不公平的交易行为。

4.3.23 公公平交易的执行情况

在报告期内,本公司严格执行公平交易制度,公平对待旗下各货币组合,未发现明显不公平的交易行为。

4.3.24 公公平交易的执行情况

在报告期内,本公司严格执行公平交易制度,公平对待旗下各货币组合,未发现明显不公平的交易行为。

4.3.25 公公平交易的执行情况

在报告期内,本公司严格执行公平交易制度,公平对待旗下各货币组合,未发现明显不公平的交易行为。

4.3.26 公公平交易的执行情况

在报告期内,本公司严格执行公平交易制度,公平对待旗下各货币组合,未发现明显不公平的交易行为。

4.3.27 公公平交易的执行情况

在报告期内,本公司严格执行公平交易制度,公平对待旗下各货币组合,未发现明显不公平的交易行为。

4.3.28 公公平交易的执行情况

在报告期内,本公司严格执行公平交易制度,公平对待旗下各货币组合,未发现明显不公平的交易行为。

4.3.29 公公平交易的执行情况

在报告期内,本公司严格执行公平交易制度,公平对待旗下各货币组合,未发现明显不公平的交易行为。

4.3.30 公公平交易的执行情况

在报告期内,本公司严格执行公平交易制度,公平对待旗下各货币组合,未发现明显不公平的交易行为。

4.3.31 公公平交易的执行情况

在报告期内,本公司严格执行公平交易制度,公平对待旗下各货币组合,未发现明显不公平的交易行为。

4.3.32 公公平交易的执行情况

在报告期内,本公司严格执行公平交易制度,公平对待旗下各货币组合,未发现明显不公平的交易行为。

4.3.33 公公平交易的执行情况

在报告期内,本公司严格执行公平交易制度,公平对待旗下各货币组合,未发现明显不公平的交易行为。

4.3.34 公公平交易的执行情况

在报告期内,本公司严格执行公平交易制度,公平对待旗下各货币组合,未发现明显不公平的交易行为。

4.3.35 公公平交易的执行情况

在报告期内,本公司严格执行公平交易制度,公平对待旗下各货币组合,未发现明显不公平的交易行为。

4.3.36 公公平交易的执行情况

在报告期内,本公司严格执行公平交易制度,公平对待旗下各货币组合,未发现明显不公平的交易行为。

4.3.37 公公平交易的执行情况

在报告期内,本公司严格执行公平交易制度,公平对待旗下各货币组合,未发现明显不公平的交易行为。

4.3.38 公公平交易的执行情况

在报告期内,本公司严格执行公平交易制度,公平对待旗下各货币组合,未发现明显不公平的交易行为。

4.3.39 公公平交易的执行情况

在报告期内,本公司严格执行公平交易制度,公平对待旗下各货币组合,未发现明显不公平的交易行为。

4.3.40 公公平交易的执行情况

在报告期内,本公司严格执行公平交易制度,公平对待旗下各货币组合,未发现明显不公平的交易行为。

4.3.41 公公平交易的执行情况

在报告期内,本公司严格执行公平交易制度,公平对待旗下各货币组合,未发现明显不公平的交易行为。

4.3.42 公公平交易的执行情况

在报告期内,本公司严格执行公平交易制度,公平对待旗下各货币组合,未发现明显不公平的交易行为。

4.3.43 公公平交易的执行情况

在报告期内,本公司严格执行公平交易制度,公平对待旗下各货币组合,未发现明显不公平的交易行为。

4.3.44 公公平交易的执行情况

在报告期内,本公司严格执行公平交易制度,公平对待旗下各货币组合,未发现明显不公平的交易行为。

4.3.45 公公平交易的执行情况

在报告期内,本公司严格执行公平交易制度,公平对待旗下各货币组合,未发现明显不公平的交易行为。

4.3.46 公公平交易的执行情况

在报告期内