

交银施罗德货币市场证券投资基金

2013 年度 报告 摘要

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

重要提示：基金管理人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责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事同意，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”）根据基金合同约定，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、投资组合等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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，基金净值及过往业绩并不代表其未来表现。投资者有风险，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摘要。

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。

项目	本期	上期可比期间
当期基金份额持有人应得收益	10,449,295,977.43	10,449,295,977.43
当期基金份额持有人应得收益占基金资产净值的比例	239,549,650.02	239,549,650.02

2.1 基金基本情况

基金名称	交银施罗德货币市场证券投资基金
基金代码	519088
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	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
基金份额持有人数量	不定期
报告期末基金份额持有人户数	交银货币
报告期末基金份额持有人户数	519088
报告期末基金份额持有人户数	319589
报告期末基金份额持有人户数	1,917,996,808.58
报告期末基金份额持有人户数	2,010,821,096.09

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定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：本基金在保持投资组合高流动性的前提下，结合对国内外宏观经济环境、金融货币市场、债券市场、货币市场、利率走势、信用风险等因素的综合分析，合理配置资产，构建投资组合，积极选择投资工具，采取主动性的投资策略和积极化的操作手段。

业绩比较基准：六个月内银行定期存款利率(税后)

风险收益特征：本基金具有较低风险，中收益特征，流动性强的证券投资基金品种。

2.3 基金管理人及基金托管人

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
法定代表人	王勇	李蔚
注册地址	上海市浦东新区银城中路200号	北京市东城区东直门南大街2号
办公地址	上海市浦东新区银城中路200号	北京市东城区东直门南大街2号
客服电话	400-700-5001, 021-61055000	95599
网址	www.fund001.com, www.jiaoyinshiluo.com	www.abchina.com

2.4 信息披露方式

基金年度报告正文及财务报表互联网网址	www.fund001.com, www.jiaoyinshiluo.com
基金年度报告备置地点	基金管理人办公场所

3.1 主要会计数据和财务指标

项目	2013年	2012年	2011年
本期已实现收益	28,750,637.25	210,799,012.77	27,684,401.04
本期公允价值变动损益	3,505	3,815	3,764
本期净收益	3,505	3,815	3,764
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000

注：1. 本基金申购赎回费为零。
2. 本基金收益分配按结转份额。
3. 自2007年1月22日起，本基金实行销售服务费分级收取方式，分别设置基金份额A: 高级基金份额和B级基金份额。A级基金份额与B级基金份额的销售费率、托管费率不同，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0.10%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B级基金份额合并计算，B级基金份额按原设计基金净值。
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，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

期间	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率
过去六个月	1.1660%	0.0181%
过去一年	1.8794%	0.0395%
过去三年	10.9377%	0.0345%
过去五年	15.9137%	0.0648%

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业绩表现与同期业绩比较基准收益变动的比较



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规定。
3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去五年基金的利润分配情况

年度	利润分配形式	基金份额持有人应得收益	基金份额持有人应得收益占基金资产净值的比例
2013年	18,467,500.45	6,235,395.11	4,049,741.69
2012年	22,715,567.31	7,756,583.75	-781,750.02
2011年	4,749,122.36	1,247,535.47	2,607,362.96
合计	45,932,190.02	15,231,514.33	5,753,154.63

4.1 基金管理人及其基金经理简介

姓名	职务	任职日期	离任日期	说明
林蔚	基金管理人	2011-06-09	—	林蔚先生，复旦大学学士，曾任招商局证券有限公司、上海申银万国证券研究所有限公司、上海申银万国证券研究所有限公司、上海申银万国证券研究所有限公司、上海申银万国证券研究所有限公司、上海申银万国证券研究所有限公司。

注：1. 本表所列基金经理（助理）任职日期和离任日期均以基金合同生效日或公司做出聘任公告（如适用）之日为准。
2. 本表所列基金经理（助理）证券从业资格中的“证券从业资格”的含义遵从中国证监会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对本报告期内本基金遵守信守情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《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，为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 管理人对本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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

4.3.3 异常交易行为的专项说明

4.4 管理人对于报告期内基金投资运作及投资业绩的说明

4.4.1 报告期内本基金投资策略和运作分析

4.4.2 报告期内本基金业绩表现

4.4.3 报告期内本基金的投资组合

4.4.4 报告期内本基金的投资组合

4.3.1 公平交易制度和控制方法

项目	本期	上期可比期间
当期基金份额持有人应得收益	10,449,295,977.43	10,449,295,977.43
当期基金份额持有人应得收益占基金资产净值的比例	239,549,650.02	239,549,650.02

4.3.2 公平交易制度的执行情况

4.3.3 异常交易行为的专项说明

4.4 管理人对于报告期内基金投资运作及投资业绩的说明

4.4.1 报告期内本基金投资策略和运作分析

4.4.2 报告期内本基金业绩表现

4.4.3 报告期内本基金的投资组合

4.4.4 报告期内本基金的投资组合

4.4.1 报告期内本基金投资策略和运作分析

项目	本期	上期可比期间
当期基金份额持有人应得收益	10,449,295,977.43	10,449,295,977.43
当期基金份额持有人应得收益占基金资产净值的比例	239,549,650.02	239,549,650.02

4.4.2 报告期内本基金业绩表现

4.4.3 报告期内本基金的投资组合

4.4.4 报告期内本基金的投资组合

4.4.3 报告期内本基金的投资组合

项目	本期	上期可比期间
当期基金份额持有人应得收益	10,449,295,977.43	10,449,295,977.43
当期基金份额持有人应得收益占基金资产净值的比例	239,549,650.02	239,549,650.02

4.4.4 报告期内本基金的投资组合

4.4.4.1 基金资产配置

4.4.4.2 基金资产配置

4.4.4.3 基金资产配置

4.4.4.4 基金资产配置

4.4.4.1 基金资产配置

项目	本期	上期可比期间
当期基金份额持有人应得收益	10,449,295,977.43	10,449,295,977.43
当期基金份额持有人应得收益占基金资产净值的比例	239,549,650.02	239,549,650.02

4.4.4.2 基金资产配置

4.4.4.3 基金资产配置

4.4.4.4 基金资产配置

4.4.4.2 基金资产配置

项目	本期	上期可比期间
当期基金份额持有人应得收益	10,449,295,977.43	10,449,295,977.43
当期基金份额持有人应得收益占基金资产净值的比例	239,549,650.02	239,549,650.02

4.4.4.3 基金资产配置

4.4.4.4 基金资产配置

4.4.4.3 基金资产配置

项目	本期	上期可比期间
当期基金份额持有人应得收益	10,449,295,977.43	10,449,295,977.43
当期基金份额持有人应得收益占基金资产净值的比例	239,549,650.02	239,549,650.02

4.4.4.4 基金资产配置

4.4.4.4.1 基金资产配置

4.4.4.4.2 基金资产配置

4.4.4.4.3 基金资产配置

4.4.4.4.4 基金资产配置

4.4.4.4.1 基金资产配置

项目	本期	上期可比期间
当期基金份额持有人应得收益	10,449,295,977.43	10,449,295,977.43
当期基金份额持有人应得收益占基金资产净值的比例	239,549,650.02	239,549,650.02

4.4.4.4.2 基金资产配置

4.4.4.4.3 基金资产配置

4.4.4.4.4 基金资产配置

4.4.4.4.2 基金资产配置

项目	本期	上期可比期间
当期基金份额持有人应得收益	10,449,295,977.43	10,449,295,977.43
当期基金份额持有人应得收益占基金资产净值的比例	239,549,650.02	239,549,650.02

4.4.4.4.3 基金资产配置

4.4.4.4.4 基金资产配置

4.4.4.4.3 基金资产配置

项目	本期	上期可比期间
当期基金份额持有人应得收益	10,449,295,977.43	10,449,295,977.43
当期基金份额持有人应得收益占基金资产净值的比例	239,549,650.02	239,549,650.02

4.4.4.4.4 基金资产配置

4.4.4.4.4.1 基金资产配置

4.4.4.4.4.2 基金资产配置

4.4.4.4.4.3 基金资产配置

4.4.4.4.4.4 基金资产配置

4.4.4.4.4.1 基金资产配置

项目	本期	上期可比期间
当期基金份额持有人应得收益	10,449,295,977.43	10,449,295,977.43
当期基金份额持有人应得收益占基金资产净值的比例	239,549,650.02	239,549,650.02

4.4.4.4.4.2 基金资产配置

4.4.4.4.4.3 基金资产配置

4.4.4.4.4.4 基金资产配置

4.4.4.4.4.2 基金资产配置

项目	本期	上期可比期间
当期基金份额持有人应得收益	10,449,295,977.43	10,449,295,977.43
当期基金份额持有人应得收益占基金资产净值的比例	239,549,650.02	239,549,650.02

4.4.4.4.4.3 基金资产配置

4.4.4.4.4.4 基金资产配置

4.4.4.4.4.3 基金资产配置

项目	本期	上期可比期间
当期基金份额持有人应得收益	10,449,295,977.43	10,449,295,977.43
当期基金份额持有人应得收益占基金资产净值的比例	239,549,650.02	239,549,650.02

4.4.4.4.4.4 基金资产配置

4.4.4.4.4.4.1 基金资产配置

4.4.4.4.4.4.2 基金资产配置

4.4.4.4.4.4.3 基金资产配置

4.4.4.4.4.4.4 基金资产配置

4.4.4.4.4.4.1 基金资产配置

项目	本期	上期可比期间
当期基金份额持有人应得收益	10,449,295,977.43	10,449,295,977.43
当期基金份额持有人应得收益占基金资产净值的比例	239,549,650.02	239,549,650.02

4.4.4.4.4.4.2 基金资产配置

4.4.4.4.4.4.3 基金资产配置

4.4.4.4.4.4.4 基金资产配置

4.4.4.4.4.4.2 基金资产配置

项目	本期	上期可比期间
当期基金份额持有人应得收益	10,449,295,977.43	10,449,295,977.43
当期基金份额持有人应得收益占基金资产净值的比例	239,549,650.02	239,549,650.02

4.4.4.4.4.4.3 基金资产配置

4.4.4.4.4.4.4 基金资产配置

4.4.4.4.4.4.3 基金资产配置

项目	本期	上期可比期间
当期基金份额持有人应得收益	10,449,295,977.43	10,449,295,977.43
当期基金份额持有人应得收益占基金资产净值的比例	239,549,650.02	239,549,650.02

4.4.4.4.4.4.4 基金资产配置

4.4.4.4.4.4.4.1 基金资产配置

4.4.4.4.4.4.4.2 基金资产配置

4.4.4.4.4.4.4.3 基金资产配置

4.4.4.4.4.4.4.4 基金资产配置

4.4.4.4.4.4.4.1 基金资产配置

项目	本期	上期可比期间
当期基金份额持有人应得收益	10,449,295,977.43	10,449,295,977.43
当期基金份额持有人应得收益占基金资产净值的比例	239,549,650.02	239,549,650.02

4.4.4.4.4.4.4.2 基金资产配置

4.4.4.4.4.4.4.3 基金资产配置

4.4.4.4.4.4.4.4 基金资产配置

4.4.4.4.4.4.4.2 基金资产配置

项目	本期	上期可比期间
当期基金份额持有人应得收益	10,449,295,977.43	10,449,295,977.43
当期基金份额持有人应得收益占基金资产净值的比例	239,549,650.02	239,549,650.02

4.4.4.4.4.4.4.3 基金资产配置

4.4.4.4.4.4.4.4 基金资产配置

4.4.4.4.4.4.4.3 基金资产配置

项目	本期	上期可比期间
当期基金份额持有人应得收益	10,449,295,977.43	10,449,295,977.43
当期基金份额持有人应得收益占基金资产净值的比例	239,549,650.02	239,549,650.02

4.4.4.4.4.4.4.4 基金资产配置

4.4.4.4.4.4.4.4.1 基金资产配置

4.4.4.4.4.4.4.4.2 基金资产配置

4.4.4.4.4.4.4.4.3 基金资产配置

4.4.4.4.4.4.4.4.4 基金资产配置

4.4.4.4.4.4.4.4.1 基金资产配置

项目	本期	上期可比期间
当期基金份额持有人应得收益	10,449,295,977.43	10,449,295,977.43
当期基金份额持有人应得收益占基金资产净值的比例	239,549,650.02	239,549,650.02

4.4.4.4.4.4.4.4.2 基金资产配置

4.4.4.4.4.4.4.4.3 基金资产配置

4.4.4.4.4.4.4.4.4 基金资产配置

4.4.4.4.4.4.4.4.2 基金资产配置

项目	本期	上期可比期间
当期基金份额持有人应得收益	10,449,295,977.43	10,449,295,977.43
当期基金份额持有人应得收益占基金资产净值的比例	239,549,650.02	239,549,650.02

4.4.4.4.4.4.4.4.3 基金资产配置

4.4.4.4.4.4.4.4.4 基金资产配置

4.4.4.4.4.4.4.4.3 基金资产配置

项目	本期	上期可比期间
当期基金份额持有人应得收益	10,449,295,977.43	10,449,295,977.43
当期基金份额持有人应得收益占基金资产净值的比例	239,549,650.02	239,549,650.02

4.4.4.4.4.4.4.4.4 基金资产配置

4.4.4.4.4.4.4.4.4.1 基金资产配置

4.4.4.4.4.4.4.4.4.2 基金资产配置

4.4.4.4.4.4.4.4.4.3 基金资产配置

4.4.4.4.4.4.4.4.4.4 基金资产配置

4.4.4.4.4.4.4.4.4.1 基金资产配置

项目	本期	上期可比期间
当期基金份额持有人应得收益	10,449,295,977.43	10,449,295,977.43
当期基金份额持有人应得收益占基金资产净值的比例	239,549,650.02	239,549,650.02

4.4.4.4.4.4.4.4.4.2 基金资产配置

4.4.4.4.4.4.4.4.4.3 基金资产配置

4.4.4.4.4.4.4.4.4.4 基金资产配置

第二层级：直接（比如报价价格）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次的余额为768,414,984.02元，无属于第一层次和第三层次的余额（2012年12月31日：第二层次3,186,463,442.60元，无属于第一层次和第三层次的余额）。

(iii)公允价值所属层次的变动
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（包括跌停时）或交易不活跃，或属于非公开发行股票等情况，本基金基于于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间的交易量和停牌期间估值调整中采用不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票债券公允价值所属第二层次或第三层次。

(iv) 第三层次公允价值余额和本期变动金额
除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需说明的其他重要事项。
8.1 期末投资组合情况

8.1 期末投资组合情况

序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
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	权益类投资	179,499,869.25	3.78
	其中：股票	179,499,869.25	3.78
3	货币市场基金	3,629,850,997.28	76.36
4	其他资产	17,531,479.79	0.36
合计	4,753,304,304.34	100.00	

8.2 债券投资组合情况

序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期末债券投资组合余额	768,414,984.02	3.83
	其中：新发申购投资	—	—
2	报告期末债券投资组合余额	476,998,811.76	12.13
	其中：新发申购投资	—	—

注：报告期末债券投资组合余额占基金资产净值的比例与报告期末每个银行间市场交易日期债券投资组合资产净值的