

交银施罗德货币市场证券投资基金 2018年半年度报告摘要

2018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:二〇一八年八月二十五日

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根据本基金合同规定,于**2018年8月26日**复核了本半年度报告中的财务指标、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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失或本金增值。

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。

本半年度报告编制自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,请阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告日期**2018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
基金代码	519088
基金运作方式	契约开放式
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	3,315,768,404.79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	519088 519089
报告期末下属分级基金的份额总额	486,388,513.58份 2,829,380,891.21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定和资产充分流动的前提下,追求超过业绩比较基准的投资收益。

投资策略
 本基金在保持组合整体流动性的前提下,结合对国内外宏观经济运行、金融市场价格走势、资金流动趋势、货币市场收益率曲线等因素的分析,合理配置组合期限结构,积极选择投资工具,采取主动的投资策略和相对化的操作手段,力争超过业绩比较基准。

风险收益特征
 本基金属于低风险、中收益、高流动性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
姓名	陈军	陈军
联系电话	021-61055050	010-66060069
电子邮箱	xsp@yrd.com.cn	txsp@abcchina.com
客户服务电话	400-700-5000 021-61055000	95599
传真	021-61055054	010-68121816

2.4 信息披露方式

本基金半年度报告正文的管理人网站网址: www.fund001.com
 基金半年度报告备置地点:基金管理人办公场所

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务数据和财务指标

项目	3.1.1 期间	报告期 2018年1月1日至2018年6月30日
本期已实现收益	交银货币 A 交银货币 B	8,893,273.47 171,144,215.35
本期利润	交银货币 A 交银货币 B	8,893,273.47 171,144,215.35
本期净值增长率	交银货币 A 交银货币 B	1.78% 190%

3.2 基金净值表现

本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	业绩比较基准收益率②	①-②	①-②
过去一个月	0.2736%	0.0016%	0.1086%	0.0000%
过去三个月	0.8433%	0.0038%	0.3241%	0.0000%
过去六个月	1.7791%	0.0033%	0.6447%	0.0000%
过去一年	3.6999%	0.0024%	1.3000%	0.0000%
过去三年	9.1610%	0.0024%	4.0207%	0.0003%
自基金合同生效起至今	43.8260%	0.0051%	28.8686%	0.0025%

3.3 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为:六个月银行定期存款利率(税后)。

3.4 基金净值表现

本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	业绩比较基准收益率②	①-②	①-②
过去一个月	0.2935%	0.0016%	0.1086%	0.0000%
过去三个月	0.9044%	0.0038%	0.3241%	0.0000%
过去六个月	1.9000%	0.0033%	0.6447%	0.0000%
过去一年	3.9848%	0.0024%	1.3000%	0.0000%
过去三年	9.9830%	0.0024%	4.0207%	0.0003%
自基金合同生效起至今	43.8260%	0.0051%	28.8427%	0.0030%

3.5 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为:六个月银行定期存款利率(税后)。

3.6 基金净值表现

本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	业绩比较基准收益率②	①-②	①-②
过去一个月	0.2736%	0.0016%	0.1086%	0.0000%
过去三个月	0.8433%	0.0038%	0.3241%	0.0000%
过去六个月	1.7791%	0.0033%	0.6447%	0.0000%
过去一年	3.6999%	0.0024%	1.3000%	0.0000%
过去三年	9.1610%	0.0024%	4.0207%	0.0003%
自基金合同生效起至今	43.8260%	0.0051%	28.8686%	0.0025%

3.7 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为:六个月银行定期存款利率(税后)。

3.8 基金净值表现

本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	业绩比较基准收益率②	①-②	①-②
过去一个月	0.2935%	0.0016%	0.1086%	0.0000%
过去三个月	0.9044%	0.0038%	0.3241%	0.0000%
过去六个月	1.9000%	0.0033%	0.6447%	0.0000%
过去一年	3.9848%	0.0024%	1.3000%	0.0000%
过去三年	9.9830%	0.0024%	4.0207%	0.0003%
自基金合同生效起至今	43.8260%	0.0051%	28.8427%	0.0030%

3.9 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为:六个月银行定期存款利率(税后)。

3.10 基金净值表现

本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	业绩比较基准收益率②	①-②	①-②
过去一个月	0.2736%	0.0016%	0.1086%	0.0000%
过去三个月	0.8433%	0.0038%	0.3241%	0.0000%
过去六个月	1.7791%	0.0033%	0.6447%	0.0000%
过去一年	3.6999%	0.0024%	1.3000%	0.0000%
过去三年	9.1610%	0.0024%	4.0207%	0.0003%
自基金合同生效起至今	43.8260%	0.0051%	28.8686%	0.0025%

3.11 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为:六个月银行定期存款利率(税后)。

3.12 基金净值表现

本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	业绩比较基准收益率②	①-②	①-②
过去一个月	0.2935%	0.0016%	0.1086%	0.0000%
过去三个月	0.9044%	0.0038%	0.3241%	0.0000%
过去六个月	1.9000%	0.0033%	0.6447%	0.0000%
过去一年	3.9848%	0.0024%	1.3000%	0.0000%
过去三年	9.9830%	0.0024%	4.0207%	0.0003%
自基金合同生效起至今	43.8260%	0.0051%	28.8427%	0.0030%

3.13 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为:六个月银行定期存款利率(税后)。

3.14 基金净值表现

本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	业绩比较基准收益率②	①-②	①-②
过去一个月	0.2736%	0.0016%	0.1086%	0.0000%
过去三个月	0.8433%	0.0038%	0.3241%	0.0000%
过去六个月	1.7791%	0.0033%	0.6447%	0.0000%
过去一年	3.6999%	0.0024%	1.3000%	0.0000%
过去三年	9.1610%	0.0024%	4.0207%	0.0003%
自基金合同生效起至今	43.8260%	0.0051%	28.8686%	0.0025%

3.15 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为:六个月银行定期存款利率(税后)。

基金份额持有人持有**69%**的股份,施罗德投资管理有限公司持有**30%**的股份,中国国际海运集装箱(集团)股份有限公司持有**9%**的股份,公司下设交银施罗德资产管理(香港)有限公司和交银施罗德资产管理(上海)有限公司。

截至报告期末,公司管理了包括货币类、债券类、保本混合型、普通混合型和股票类在内的**81**只基金,其中股票型基金普通指数型、交易型开放式(**FOF**)等不同类型的基金。

4.1 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	在本基金的任职日期	在本基金的离职日期	证券从业年限	说明
黄景浩	交银货币基金经理	2015-05-27	-	10年	毕业于上海、香港理工大学工商管理硕士,上海交通大学管理心理学硕士,曾任中海基金管理公司交易员,2012年加入交银施罗德资产管理(香港)有限公司,担任中国区交易员,2015年7月25日加入交银施罗德资产管理(香港)有限公司担任交银货币基金经理,2015年8月18日担任交银货币基金经理兼债券投资部证券投资基金的基金经理。
陈嘉靖	交银货币基金经理	2015-05-27	-	10年	毕业于上海、香港理工大学工商管理硕士,上海交通大学管理心理学硕士,曾任中海基金管理公司交易员,2012年加入交银施罗德资产管理(香港)有限公司,担任中国区交易员,2015年7月25日加入交银施罗德资产管理(香港)有限公司担任交银货币基金经理,2015年8月18日担任交银货币基金经理兼债券投资部证券投资基金的基金经理。
陈嘉靖	交银货币基金经理	2015-10-18	-	5年	毕业于上海、香港理工大学工商管理硕士,上海交通大学管理心理学硕士,曾任中海基金管理公司交易员,2012年加入交银施罗德资产管理(香港)有限公司,担任中国区交易员,2015年7月25日加入交银施罗德资产管理(香港)有限公司担任交银货币基金经理,2015年8月18日担任交银货币基金经理兼债券投资部证券投资基金的基金经理。
李多华	交银货币基金经理	2017-09-19	-	6年	毕业于上海交通大学工商管理硕士,2012年加入交银施罗德资产管理(香港)有限公司,担任中国区交易员,2017年9月19日加入交银施罗德资产管理(香港)有限公司担任交银货币基金经理,2017年9月19日担任交银货币基金经理兼债券投资部证券投资基金的基金经理。

4.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,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,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

5 31 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

项目	金额	占基金总资产的比例(%)
货币市场基金	4,486,388,513.58	100.00
债券	-	-
股票	-	-
其他	-	-

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	公允价值	占基金资产净值比例(%)
股票	-	-

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	11815275	18民生银行 CD275	3,000,000	297,350,279.87
2	11811173	18平安银行 CD173	2,500,000	247,660,469.95
3	11820128	18交通银行 CD128	2,500,000	247,660,469.95
4	11815262	18民生银行 CD262	2,000,000	198,339,672.82
5	189916	18招商国债 CD186	1,500,000	148,631,312.69
6	11810229	18民生银行 CD229	1,000,000	99,496,706.43
7	11810244	18民生银行 CD244	1,000,000	99,357,649.48
8	11810249	18民生银行 CD249	1,000,000	99,303,965.60
9	11819863	18交通银行 CD363	1,000,000	99,121,151.08

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	146534	14国债17	500,000	50,000,000.00

5.5 报告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

序号	证券代码	证券名称	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	146534	14国债17	500,000	50,000,000.00

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号	权证代码	权证名称	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	146534	14国债17	500,000	50,000,000.00

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名衍生品投资明细

序号	衍生品代码	衍生品名称	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	146534	14国债17	500,000	50,000,000.00

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名境外资产投资明细

序号	境外资产代码	境外资产名称	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	146534	14国债17	500,000	50,000,000.00

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资明细

序号	贵金属代码	贵金属名称	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	146534	14国债17	500,000	50,000,000.00

5.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名期货投资明细

序号	期货代码	期货名称	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	146534	14国债17	500,000	50,000,000.00

5.11 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名期权投资明细

序号	期权代码	期权名称	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	146534	14国债17	500,000	50,000,000.00

5.12 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名其他资产投资明细

序号	其他资产代码	其他资产名称	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	146534	14国债17	500,000	50,000,000.00

5.13 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名境外资产投资明细

序号	境外资产代码	境外资产名称	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	146534	14国债17	500,000	50,000,000.00

5.14 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资明细

序号	贵金属代码	贵金属名称	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	146534	14国债17	500,000	50,000,000.00

5.15 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名期货投资明细

序号	期货代码	期货名称	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	146534	14国债17	500,000	50,000,000.00

5.16 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名期权投资明细

序号	期权代码	期权名称	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	146534	14国债17	500,000	50,000,000.00

5.17 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名其他资产投资明细

序号	其他资产代码	其他资产名称	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	146534	14国债17	500,000	50,000,000.00

5.18 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名境外资产投资明细

序号	境外资产代码	境外资产名称	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	146534	14国债17	500,000	50,000,000.00

5.19 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资明细

序号	贵金属代码	贵金属名称	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	146534	14国债17	500,000	50,000,000.00

5.20 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名期货投资明细

序号	期货代码	期货名称	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	146534	14国债17	500,000	50,000,000.00

5.21 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名期权投资明细

序号	期权代码	期权名称	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	146534	14国债17	500,000	50,000,000.00

5.22 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名其他资产投资明细

序号	其他资产代码	其他资产名称	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	146534	14国债17	500,000	50,000,000.00

5.23 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名境外资产投资明细

序号	境外资产代码	境外资产名称	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	146534	14国债17	500,000	50,000,000.00

5.24 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资明细

序号	贵金属代码	贵金属名称	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	146534	14国债17	500,000	50,000,000.00

5.25 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名期货投资明细

序号	期货代码	期货名称	
----	------	------	--