

## 交银施罗德货币市场证券投资基金

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:二〇一七年三月二十九日

## § 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2017年3月28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,保证复核结果不存在虚假记载、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认真阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘录了年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2016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	519698
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
报告期基金总资产	38,290,369,472.05份
基金合同生效日期	不适用
下属分级基金的基金简称	交银货币A
下属分级基金的交易代码	519698
报告期下属分级基金的份额总额	991,001,158.11份

## 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于货币基金,投资目标在于力求资金头寸和资产头寸的动态平衡。
投资策略	本基金在综合考虑货币市场动态变化的情况下,通过对宏观经济指标、金融市场资金面、利率、信用利差、债券收益率、回购利率等的综合分析,合理安排货币资产的配置,选择投资工具,采取主动性的投资策略,在保证本金安全的前提下,力争获得超越基准的收益。
业绩基准	六个月定期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金具有低风险、低收益、流动性好的货币基金特征。

## 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
法定代表人	孙农	林葛
信息披露负责人	(021)61060060	010-62000000
电子邮箱	duochuxuan@jz.com	txgpb@abchina.com
客户服务电话	400-700-5000,010-60500000	95599
传真	(021)61060604	010-62128186

## 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.jzfund.com, www.bocomcharder.com

基金半年度报告摘要登载的管理人名称:交银施罗德基金管理有限公司

## § 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 利润数据	
2016年	2015年
营业收入	交银货币A 699,300,369.00 671,018.00
本期已实现收益	36,290,369,472.05份
本期利润	36,290,369,472.05份
本期利润净额	36,290,369,472.05份
2.47%	2.72%
3.1.2 利润数据和利润分配	2016年末 2015年末 2014年末
货币基金资产	39,611,300,000.00 39,601,300,000.00 39,601,300,000.00
货币基金余额	10,000.00 10,000.00 10,000.00

注:1、本基金申购赎回费率为零。

2、本基金收益按月结转份额。

3、2007年1月22日起,本基金按期开放收费方式,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级基金份额的费率、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。在计算主要基金指标时, A级基金份额与分段前基金连续计算B级基金份额按新设基金计算。

4、本期已实现收益指本基金本期利息收入、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 基金份额净值增长率与其同期业绩比较基准收益率的比较

## 1. 交银货币A:

份额	份额净值	份额净值	份额比较基准	业绩比较基准	①-③	②-④
过去三个月	0.0509%	0.0014%	0.3277%	0.0000%	0.2712%	0.0014%
过去六个月	1.1903%	0.0013%	0.6953%	0.0000%	0.5030%	0.0013%
过去一年	2.4720%	0.0013%	1.3000%	0.0000%	1.1602%	0.0016%
过去三年	10.4509%	0.0007%	5.6938%	0.0001%	4.4224%	0.0020%
过去五年	10.694%	0.0006%	11.0779%	0.0001%	6.7911%	0.0022%
自基金合同生效以来	30.40%	0.0005%	26.422%	0.0001%	10.3273%	0.0023%

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 基金合同生效以来基金份额累计净值收益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:

份额	份额净值	份额净值	份额比较基准	业绩比较基准	①-③	②-④
过去三个月	0.0509%	0.0014%	0.3277%	0.0000%	0.2714%	0.0014%
过去六个月	1.1903%	0.0013%	0.6953%	0.0000%	0.5030%	0.0013%
过去一年	2.4720%	0.0013%	1.3000%	0.0000%	1.1602%	0.0016%
过去三年	10.4509%	0.0007%	5.6938%	0.0001%	4.4224%	0.0020%
过去五年	10.694%	0.0006%	11.0779%	0.0001%	6.7911%	0.0022%
自基金合同生效以来	30.40%	0.0005%	26.422%	0.0001%	10.3273%	0.0023%

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)。

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

## 2. 交银货币B:

份额	份额净值	份额净值	份额比较基准	业绩比较基准	①-③	②-④
过去三个月	0.0509%	0.0014%	0.3277%	0.0000%	0.2714%	0.0014%
过去六个月	1.1903%	0.0013%	0.6953%	0.0000%	0.5030%	0.0013%
过去一年	2.4720%	0.0013%	1.3000%	0.0000%	1.1602%	0.0016%
过去三年	10.4509%	0.0007%	5.6938%	0.0001%	4.4224%	0.0020%
过去五年	10.694%	0.0006%	11.0779%	0.0001%	6.7911%	0.0022%
自基金合同生效以来	30.40%	0.0005%	26.422%	0.0001%	10.3273%	0.0023%

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)。

3.2.4 本基金合同生效以来基金份额累计净值收益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B:

份额	份额净值	份额净值	份额比较基准	业绩比较基准	①-③	②-④
过去三个月	0.0509%	0.0014%	0.3277%	0.0000%	0.2714%	0.0014%
过去六个月	1.1903%	0.0013%	0.6953%	0.0000%	0.5030%	0.0013%
过去一年	2.4720%	0.0013%	1.3000%	0.0000%	1.1602%	0.0016%
过去三年	10.4509%	0.0007%	5.6938%	0.0001%	4.4224%	0.0020%
过去五年	10.694%	0.0006%	11.0779%	0.0001%	6.7911%	0.0022%
自基金合同生效以来	30.40%	0.0005%	26.422%	0.0001%	10.3273%	0.0023%

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)。

3.2.5 本基金合同生效以来基金份额累计净值收益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B:

份额	份额净值	份额净值	份额比较基准</th
----	------	------	------------