

交银施罗德货币市场证券投资基金2008年年度报告摘要

2008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

送出日期：2009年03月26日

§ 1 重要提示及目录

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 2009 年 3 月 25 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，投资者在做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 2008 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
§ 2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	5
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算等情况的说明	12
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	13
§ 6 审计报告	13
§ 7 年度财务报表	13
7.1 资产负债表	13
7.2 利润表	15
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
7.4 报表附注	17
§ 8 投资组合报告	21
8.1 期末基金资产组合情况	21
8.2 债券回购融资情况	21
8.3 基金投资组合平均剩余期限	22
8.4 期末按债券品种分类的债券投资组合	23
8.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细	23
8.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	24
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细	24
8.8 投资组合报告附注	24
§ 9 基金份额持有人信息	25
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	25
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况	25
§ 10 开放式基金份额变动	25
§ 11 重大事件揭示	26

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

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01月20日	
报告期末基金份额总额	12,505,942,693.01	
基金合同存续期	不定期	
下属两级基金的基金简称	交银货币A	交银货币B
下属两级基金的交易代码	519588	519589
报告期末下属两级基金的份额总额	1,675,289,851.26	10,830,652,841.75

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	陈超	李芳菲
	联系电话	021-61055050	010-68424199

	话		
	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		021-61055034	010-68424181

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.jysld.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	2008年		2007年		2006年1月20 日至2006年12 月31日
	交银货币A	交银货币B	交银货币A	交银货币B	交银货币
本期已实现收益	13,110,160.98	121,797,321.91	16,274,042.51	13,709,465.19	26,068,816.36
本期利润	13,110,160.98	121,797,321.91	16,274,042.51	13,709,465.19	26,068,816.36
本期净值收益率	3.32%	3.56%	3.22%	2.16%	1.67%
3.1.2 期末数据和指标	2008年	2008年	2007年	2007年	2006年1月20 日至2006年12 月31日
期末基金资产净值	1,675,289,851.26	10,830,652,841.75	271,178,310.65	856,110,131.83	969,423,310.22
期末基金份额净值	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、本基金自 2007 年 6 月 22 日起实施销售服务费分级收费方式，B 级基金份额 2007 年度的会计数据和财务指标计算的期间为 2007 年 6 月 22 日至 2007 年 12 月 31 日。

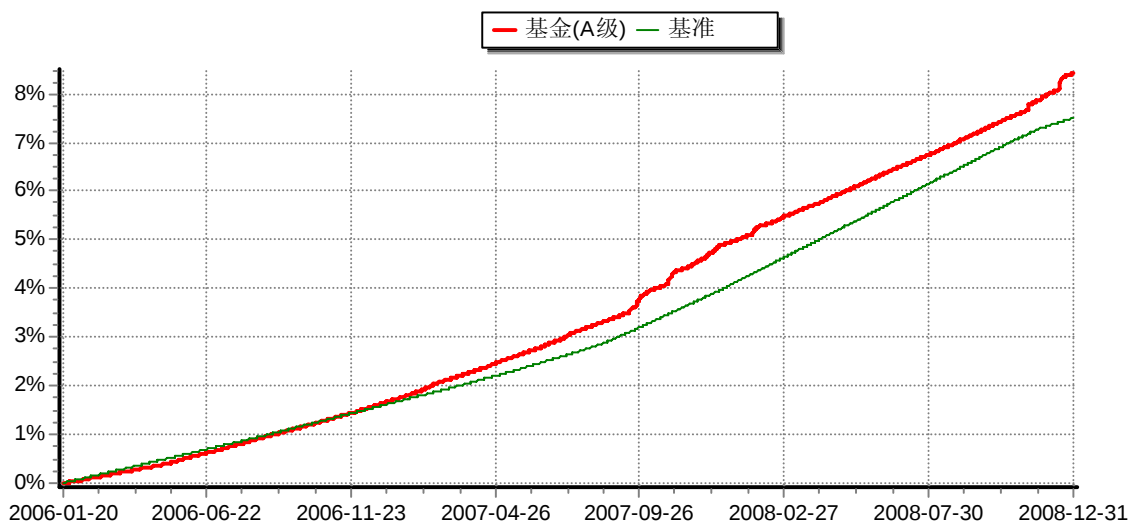
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

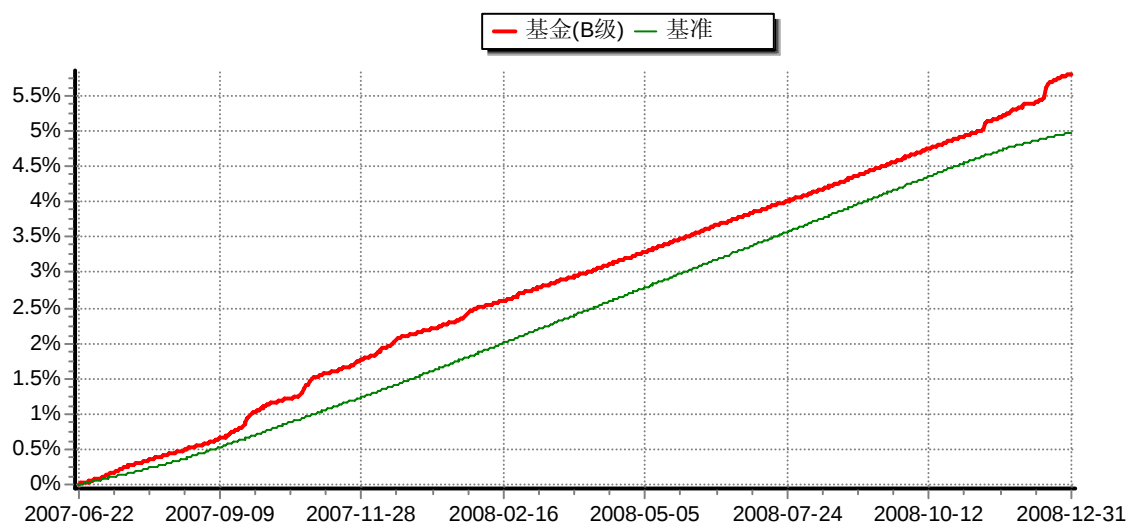
阶段	份额净	份额净	业绩比	业绩比	①-③	②-④
----	-----	-----	-----	-----	-----	-----

		值收益 率①	值收益 率标准 差②	较基准 收益率 ③	较基准 收益率 标准差 ④		
A 级	过去三个月	1.0492%	0.0159%	0.7383%	0.0017%	0.3109%	0.0142%
	过去六个月	1.7994%	0.0113%	1.6434%	0.0015%	0.1560%	0.0098%
	过去一年	3.3151%	0.0083%	3.4340%	0.0011%	-0.1189%	0.0072%
	自基金合同生效日起 至今（2006年01月20 日-2008年12月31日）	8.4266%	0.0065%	7.5012%	0.0023%	0.9254%	0.0042%
B 级	过去三个月	1.1090%	0.0159%	0.7383%	0.0017%	0.3707%	0.0142%
	过去六个月	1.9210%	0.0113%	1.6434%	0.0015%	0.2776%	0.0098%
	过去一年	3.5615%	0.0083%	3.4340%	0.0011%	0.1275%	0.0072%
	自基金分级日起至今 （2007年06月22日 -2008年12月31日）	5.7982%	0.0082%	4.9786%	0.0014%	0.8196%	0.0069%

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

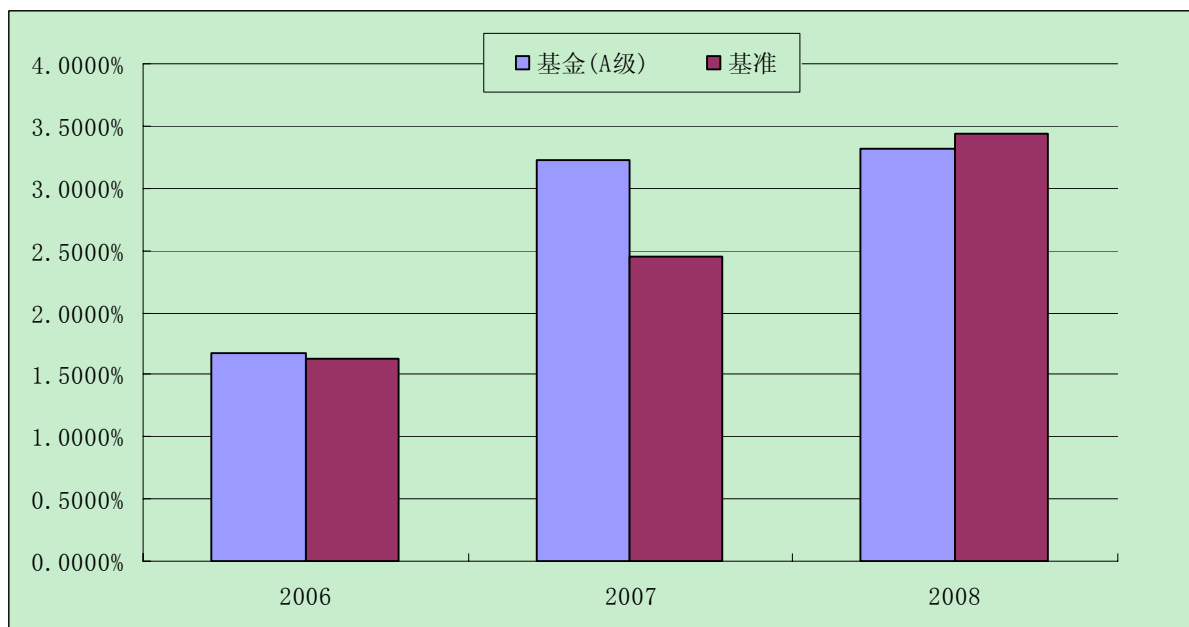


注：图示日期为2006年1月20日至2008年12月31日。本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至2008年12月31日，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

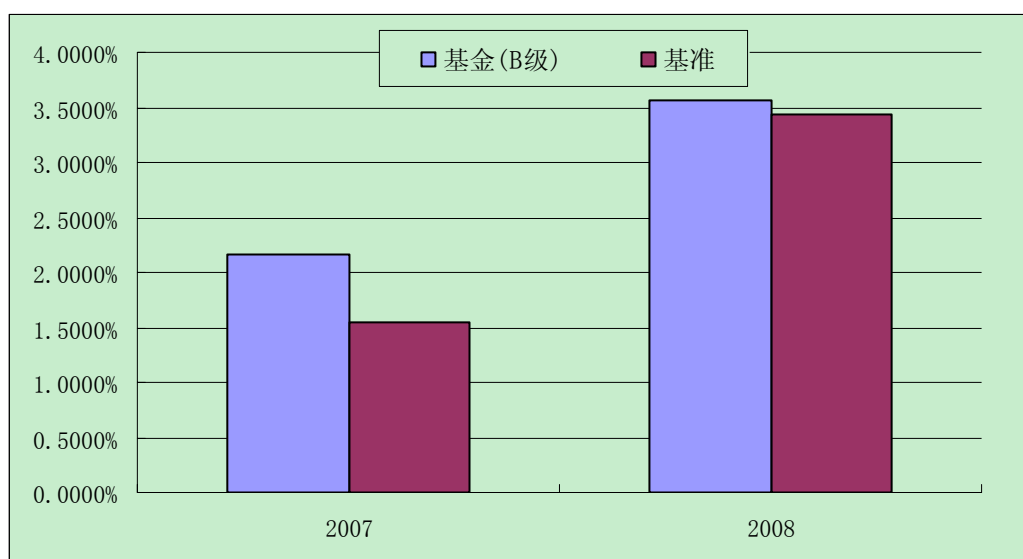


注：图示日期为2007年6月22日至2008年12月31日。本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至2008年12月31日，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

3.2.3 自基金合同生效以来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



注：图示日期为2006年1月20日至2008年12月31日。基金合同生效当年的净值收益率按照当年实际存续期计算。



注：图示日期为2007年6月22日至2008年12月31日。实施基金分级当年的净值收益率按照当年实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	再投资形式发放总额	备注
2008年	134,907,482.89	-
2007年	29,983,507.70	-
2006年	26,068,816.36	-
合计	190,959,806.95	-

§ 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金字[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2008年12月31日，公司已经发行并管理的基金共有七只，均为开放式基金：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）和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）。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈晓秋	本基金的基金经理、交银施罗德增利债券证券投资基金基金经理	2006年01月20日	—	6年	陈晓秋女士，经济学硕士。曾任富国基金管理有限公司研究策略部和投资部研究员，负责债券及宏观分析、债券投资。2005年加入交银施罗德基金管理有限公司。
李家春	本基金的基金经理、交银施罗德增利债券证券投资基金基金经理	2006年12月27日	—	9年	李家春先生，经济学学士。历任长江证券有限责任公司投资经理，汉唐证券有限责任公司高级经理、投资主管，泰信基金管理有限公司高级研究员。2006年加入交银施罗德基金管理有限公司。

注：1、本表所列基金经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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、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、安全高效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 公平交易制度的执行情况

本公司有严格的投资控制制度和风险监控制度来保证旗下基金运作的公平，报告期内本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合。所管理的不同投资组合的整体收益率、分投资类别（股票、债券）的收益率以及不同时间窗内（同日内、5日内、10日内）同向交易的交易价格并未发现异常差异。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本投资组合与公司旗下投资风格相似的其他投资组合之间的业绩表现并未出现差异超过 5% 的情形。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未发现异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

2008年中国经济和债券市场都经历了巨大的变化。中国经济从年初的高通货膨胀演变至年底物价水平出现月度负增长，大宗商品价格在第四季度暴跌，生产者价格指数从7月份的10%迅速跌至11月份的2%；工业生产逐月放缓，在第四季度甚至出现个位数的增长。相应的，中国的宏观经济政策取向也迅速转变：2008年上半年，中国人民银行继续执行偏紧的货币政策，将商业银行存款准备金率从14.5%逐步提高至17.5%。但随着中国经济增长明显放缓和国际经济金融形势的不断恶化，人民银行在9月中旬就宣布降低贷款利率和准备金率，并且在接下来的3个月内，4次降息，3次调低准备金率，幅度之大速度之快超乎市场预期。

2008年上半年，货币市场利率基本保持稳定，只有在大盘股发行期间会出现大幅上升。但随着通货膨胀压力的缓解以及货币政策的转变，货币市场利率从9月份开始迅速

下降：7天回购利率从9月初的3%迅速降至12月份的0.9%。同时，央行在公开市场上大量投放流动性，减少了央行票据的发行量，并停止1年期央行票据和3年期央行票据的发行，1年期央行票据利率从9月初的4%降至12月底的1%。

2008年交银货币基金在保持组合充分流动性的前提下，顺应市场变化，积极投资。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从2008年下半年开始，中国经济经历了大幅调整，企业减产以消化原先积累的过高的库存，因此10、11月份工业增加值增长迅速放缓，降至个位数；物价水平从高位迅速滑落，尤其是原材料和工业品的价格。我们认为，随着企业消减过高库存的进程逐渐结束，08年下半年以来经济快速下滑的态势将会有所改善，2009年下半年经济有可能逐渐走稳。为了实现经济复苏，宏观政策将会继续保持刺激的取向，包括积极的财政政策和宽松的货币政策。

2009年，由于货币政策会在相当一段时间内保持宽松的政策取向，包括下调存贷款基金利率和准备金率等措施，因此货币市场将会继续保持充足的流动性，市场利率可能还会进一步下降。

但是，如果2009年下半年经济逐渐走稳后，目前宽松的货币政策届时可能会有所调整；同时，随着经济走稳，投资者对未来经济增长的悲观预期可能会发生变化，权益类资产可能会出现一定的投资机会。这些变化都可能会引起货币市场资金面的变化以及利率的波动。

交银施罗德货币市场基金管理组将会继续将基金的流动性管理和风险控制放在首位，在控制流动性风险、利率风险和信用风险的基础上，均衡投资，积极进行套利，为基金持有人获取合理的投资回报。

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、风险控制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，由金融工程部进行测算和认证，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，本报告期内交银货币A级、B级利润分配信息列示如下：

份额 级别	本报告期内应分 配金额	本报告期内已分 配金额	尚未分配利润金 额	备注
A 级	13,110,160.98	13,110,160.98	—	每日分配，按 月结转份额
B 级	121,797,321.91	121,797,321.91	—	每日分配，按 月结转份额
合计	134, 907, 482. 89	134, 907, 482. 89	—	

§ 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 2008 年 1 月 1 日至 2008 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。

中国农业银行托管业务部

2009年3月25日

§ 6 审计报告

德勤华永会计师事务所有限公司对交银施罗德货币市场证券投资基金2008年12月31日的资产负债表，2008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(09)第P0183）。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：2008年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2008年12月31日	上年度末 2007年12月31日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	2,394,009,813.17	8,814,571.69
结算备付金		10,711,000.00	261,576,465.71
存出保证金		—	—
交易性金融资产	7.4.7.2	9,629,373,685.90	871,479,493.53
其中：股票投资		—	—

债券投资		9,489,438,733.31	871,479,493.53
资产支持证券投资		139,934,952.59	—
衍生金融资产	7.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	7.4.7.4	1,480,000,000.00	—
应收证券清算款		—	—
应收利息	7.4.7.5	46,939,203.34	4,782,498.65
应收股利		—	—
应收申购款		—	—
其他资产	7.4.7.6	—	—
资产总计		13,561,033,702.41	1,146,653,029.58
负债和所有者权益		本期末 2008年12月31日	上年度末 2007年12月31日
负 债：			
短期借款		—	—
交易性金融负债	7.4.7.3	—	—
衍生金融负债		—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付证券清算款		980,000,000.00	—
应付赎回款		35,937,741.12	16,362,050.88
应付管理人报酬		3,322,744.10	290,541.34
应付托管费		1,006,892.15	88,042.85
应付销售服务费		283,764.84	56,767.93
应付交易费用	7.4.7.7	83,164.20	18,691.46
应交税费		—	—
应付利息		—	—
应付利润		33,795,929.02	2,058,530.38
其他负债	7.4.7.8	660,773.97	489,962.26
负债合计		1,055,091,009.40	19,364,587.10
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	12,505,942,693.01	1,127,288,442.48

未分配利润	7.4.7.10	—	—
所有者权益合计		12,505,942,693.01	1,127,288,442.48
负债和所有者权益总计		13,561,033,702.41	1,146,653,029.58

注：报告截止日2008年12月31日，基金份额净值1.0000元，基金份额总额A级：1,675,289,851.26份，B级：10,830,652,841.75份。

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：2008年1月1日至2008年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2008年01月01日至 2008年12月31日	上年度可比期间 2007年01月01日至 2007年12月31日
一、收入		152,654,663.21	37,051,001.01
1.利息收入		105,965,064.21	41,761,462.77
其中：存款利息收入	7.4.7.11	2,620,334.26	700,873.38
债券利息收入		96,081,368.94	24,011,699.47
资产支持证券利息收入		1,926,569.02	—
买入返售金融资产收入		5,336,791.99	17,048,889.92
其他利息收入		—	—
2.投资收益		46,689,599.00	-4,710,461.76
其中：股票投资收益		—	—
债券投资收益	7.4.7.12	46,689,599.00	-4,710,461.76
资产支持证券投资收益		—	—
衍生工具收益		—	—
股利收益		—	—
3.公允价值变动收益		—	—
4.其他收入		—	—
二、费用		-17,747,180.32	-7,067,493.31

1. 管理人报酬		-10,939,659.10	-3,139,407.37
2. 托管费		-3,315,048.33	-951,335.64
3. 销售服务费		-1,226,721.31	-1,541,710.16
4. 交易费用		—	—
5. 利息支出		-1,966,086.42	-1,158,300.73
其中：卖出回购金融资产支出		-1,966,086.42	-1,158,300.73
6. 其他费用	7.4.7.13	-299,665.16	-276,739.41
三、利润总额		134,907,482.89	29,983,507.70
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		134,907,482.89	29,983,507.70

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：2008年1月1日至2008年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期		
	2008年01月01日至2008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）	1,127,288,442.48	—	1,127,288,442.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	134,907,482.89	134,907,482.89
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	11,378,654,250.53	—	11,378,654,250.53
其中：1.基金申购款	45,160,939,076.60	—	45,160,939,076.60
2.基金赎回款	-33,782,284,826.07	—	-33,782,284,826.07
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	—	-134,907,482.89	-134,907,482.89
五、期末所有者权益（基金净值）	12,505,942,693.01	—	12,505,942,693.01

项 目	上年度可比期间2007年01月01日至2007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）	969,423,310.22	—	969,423,310.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	29,983,507.70	29,983,507.70
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	157,865,132.26	—	157,865,132.26
其中：1.基金申购款	6,107,901,993.46	—	6,107,901,993.46
2.基金赎回款	-5,950,036,861.20	—	-5,950,036,861.20
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	—	-29,983,507.70	-29,983,507.70
五、期末所有者权益（基金净值）	1,127,288,442.48	—	1,127,288,442.48

7.4 报表附注

7.4.1 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与最近一期年度报告一致，所采用的会计估计与最近一期年度报告一致。

7.4.2 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”)	基金管理人股东、基金代销机构
施罗德投资管理有限公司	基金管理人股东
中国国际海运集装箱(集团)股份有限公司	基金管理人股东

7.4.2.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无。

7.4.2.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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	基金管理人、基金销售机构
中国农业银行	基金托管人、基金代销机构
交通银行	基金管理人的股东、基金代销机构

7.4.3 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.3.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

7.4.3.2 关联方报酬

7.4.3.2.1 基金管理费

单位：人民币元

关联方名称	本期 2008年01月01日至2008年12 月31日	上年度可比期间 2007年01月01日至2007年12 月31日
当期应支付的管理费	10,939,659.10	3,139,407.37
其中：当期已支付	7,616,915.00	2,848,866.03
期末未支付	3,322,744.10	290,541.34

注：支付基金管理人交银施罗德基金管理有限公司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

7.4.3.2.2 基金托管费

单位：人民币元

关联方名称	本期 2008年01月01日至2008年12 月31日	上年度可比期间 2007年01月01日至2007年12 月31日
当期应支付的托管费	3,315,048.33	951,335.64
其中：当期已支付	2,308,156.18	863,292.79
期末未支付	1,006,892.15	88,042.85

注：支付基金托管人中国农业银行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：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

7.4.3.2.3 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(A级)	本期 2008年01月01日至2008年12月31日		
	当期已支付	期末未支付	合计
交银施罗德基金管理有限公司	84,652.40	19,651.89	104,304.29
中国农业银行	221,212.80	46,664.12	267,876.92
交通银行	378,410.05	83,378.62	461,788.67
合计	684,275.25	149,694.63	833,969.88
获得销售服务费的各关联方名称(A级)	上年度可比期间 2007年01月01日至2007年12月31日		
	当期已支付	期末未支付	合计
交银施罗德基金管理有限公司	515,446.87	5,335.65	520,782.52
中国农业银行	252,635.00	14,707.40	267,342.40
交通银行	616,109.28	28,611.62	644,720.90
合计	1,384,191.15	48,654.67	1,432,845.82
获得销售服务费的各关联方名称(B级)	本期 2008年01月01日至2008年12月31日		
	当期已支付	期末未支付	合计
交银施罗德基金管理有限公司	155,870.78	64,151.76	220,022.54
中国农业银行	8,243.39	3,720.08	11,963.47
交通银行	7,571.36	9,882.42	17,453.78
合计	171,685.53	77,754.26	249,439.79

获得销售服务费的 各关联方名称(B级)	上年度可比期间 2007年06月22日至2007年12月31日		
	当期已支付	期末未支付	合计
交银施罗德基金管理 有限公司	23,170.83	5,498.88	28,669.71
中国农业银行	315.05	278.72	593.77
交通银行	2,828.96	552.63	3,381.59
合计	26,314.84	6,330.23	32,645.07

注：本基金的基金销售服务费在2007年6月22日之前按前一日基金资产净值0.25%的年费率逐日计提。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%的年费率逐日计提销售服务费，B级基金按前一日基金资产净值0.01%的年费率逐日计提销售服务费。

7.4.3.3 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

本期 2008年01月01日至2008年12月31日						
银行间市场交易的 各关联方名称	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	147,893,588.36				386,800,000.00	127,482.30
交通银行		203,444,495.89				
上年度可比期间 2007年01月01日至2007年12月31日						
银行间市场交易的 各关联方名称	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	48,685,000.00	69,511,540.00			1,686,900,000.00	279,489.53
交通银行	—					

7.4.3.4 各关联方投资本基金的情况

无。

7.4.3.5 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 2008年01月01日至2008年12月31日		上年度可比期间 2007年01月01日至2007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	2,394,009,813.17	2,522,657.30	8,814,571.69	284,155.36

7.4.3.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.4 期末（2008年12月31日）本基金持有的流通受限证券

无。

§ 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	9,629,373,685.90	71.01
	其中：债券	9,489,438,733.31	69.98
	资产支持证券	139,934,952.59	1.03
2	买入返售金融资产	1,480,000,000.00	10.91
	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	2,404,720,813.17	17.73
	其他资产	46,939,203.34	0.35
	合计	13,561,033,702.41	100.00

8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金资产净值比例（%）
1	报告期内债券回购融资余额	26,715,027,041.37	2.20

	其中：买断式回购融资	—	—
2	报告期末债券回购融资余额	—	—
	其中：买断式回购融资	—	—

注：1、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日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

2、在本报告期内本货币市场基金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	131
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	180
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	49

注：本报告期内本货币市场基金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	32.26	7.84
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
2	30天(含)—60天	15.81	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.59	—
3	60天(含)—90天	4.78	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
4	90天(含)—180天	22.15	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.15	—
5	180天(含)—397天（含）	33.06	—

	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
	合计	108.06	7.84

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	5,025,430,981.09	40.18
3	金融债券	1,482,132,168.69	11.85
	其中：政策性金融债	1,482,132,168.69	11.85
4	企业债券	91,884,400.35	0.73
5	企业短期融资券	2,889,991,183.18	23.11
6	其他	—	—
7	合计	9,489,438,733.31	75.88
8	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	91,884,400.35	0.73

8.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名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	0801016	08央行票据16	16,100,000.00	1,605,018,858.03	12.83
2	080302	08进出02	6,800,000.00	681,628,608.99	5.45
3	0801034	08央行票据34	5,000,000.00	498,093,101.06	3.98
4	0801046	08央行票据46	4,700,000.00	466,473,821.95	3.73
5	0881219	08电网CP02	4,200,000.00	425,589,580.75	3.40
6	0881245	08首钢CP02	4,000,000.00	401,924,110.09	3.21
7	0801084	08央行票据84	3,800,000.00	377,789,751.51	3.02
8	0881249	08电网CP03	3,500,000.00	351,970,696.21	2.81

9	0801043	08央行票据43	3,000,000.00	298,088,416.03	2.38
10	0881253	08陕有色CP02	2,500,000.00	251,630,593.96	2.01

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	43
报告期内偏离度的最高值	0.45%
报告期内偏离度的最低值	-0.21%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.13%

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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量 (份)	公允价值	占基金资产净值 比例(%)
1	0830011	08开元1A1	500,000.00	50,000,000.00	0.40
2	0838012	08信银A1-2	500,000.00	50,000,000.00	0.40
3	0840011	08浙元1A	400,000.00	39,934,952.59	0.32

8.8 投资组合报告附注

8.8.1 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 其他资产构成

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	46,939,203.34
4	应收申购款	—
5	其他应收款	—
6	其他	—
7	合计	46,939,203.34

§ 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
A级	18,169	92,205.95	151,167,651.85	9.02%	1,524,122,199.41	90.98%
B级	220	49,230,240.19	10,233,145,633.63	94.48%	597,507,208.12	5.52%
合计	18,389	680,077.37	10,384,313,285.48	83.04%	2,121,629,407.53	16.96%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	份额 级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员 持有本开放式基金	A级	1,083,584.28	0.01%
	B级	—	—
	合计	1,083,584.28	0.01%

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	A级	B级
基金合同生效日(2006年01月20日)	4,741,255,133.16	—

基金份额总额		
报告期期初基金份额总额	271,178,310.65	856,110,131.83
报告期期间基金总申购份额	11,077,381,112.10	34,083,557,964.50
报告期期间基金总赎回份额	9,673,269,571.49	24,109,015,254.58
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	—	—
报告期期末基金份额总额	1,675,289,851.26	10,830,652,841.75

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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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：

2008年2月22日本基金管理人发布公告，经交银施罗德基金管理有限公司第一届董事会第二十四次会议通过，免去公司董事长谢红兵先生的职务，选举彭纯先生担任公司董事长；免去公司总经理雷贤达先生的职务，选举莫泰山先生担任公司总经理；选举雷贤达先生担任公司副董事长。

2、报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 基金改聘会计师事务所情况

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。报告年度支付给德勤华永会计师事务所有限公司的审计费85,000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 报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易	债券回购交易	应支付该券商的佣金
------	----	--------	-----------

	单元 数量	成交金额	占当期债券回购 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	12,977,300,000.00	100%	—	—

注： 1、报告期内，本基金 1 个专用交易席位，本报告期间未新增加席位；

2、租用证券公司专用席位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、租用证券公司专用席位的程序：首先根据租用证券公司专用席位的选择标准进行综合评价，然后根据评价结果选择基金专用席位。研究部提交方案，并报公司批准。