

诺安货币市场基金 2011 年半年度报告

2011 年 6 月 30 日

基金管理人： 诺安基金管理有限公司

基金托管人： 中国工商银行股份有限公司

送出日期： 2011 年 8 月 25 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。本半年度报告已经全体独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2011 年 8 月 23 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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 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	4
2.5 其他相关资料	5
§3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	5
§4 管理人报告	6
4.1 基金管理人及基金经理情况	6
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	7
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	7
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	7
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	7
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	7
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	8
§5 托管人报告	8
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	8
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、利润分配等情况的说明	8
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	8
§6 半年度财务会计报告(未经审计)	8
6.1 资产负债表	8
6.2 利润表	9

6.3 所有者权益（基金净值）变动表	10
6.4 报表附注	11
§7 投资组合报告	22
7.1 期末基金资产组合情况	22
7.2 债券回购融资情况	22
7.3 基金投资组合平均剩余期限	22
7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合	23
7.5 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
7.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	24
7.7 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
7.8 投资组合报告附注	24
§8 基金份额持有人信息	24
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	24
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况	25
§9 开放式基金份额变动	25
§10 重大事件揭示	25
10.1 基金份额持有人大会决议	25
10.2 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	25
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	25
10.4 基金投资策略的改变	25
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	25
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	25
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	25
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况	26
10.9 其他重大事件	26
§11 备查文件目录	28
11.1 备查文件名称	28
11.2 备查文件存放地点	28
11.3 备查文件查阅方式	28

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	诺安货币市场基金
基金简称	诺安货币
基金主代码	320002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004 年 12 月 6 日
基金管理人	诺安基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,445,887,572.83 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	确保本金的安全性和资产的流动性, 力争为投资者提供高于投资基准的稳定收益。
投资策略	根据宏观经济、央行货币政策操作及短期资金市场供求情况, 判断短期利率的走势, 进行自上而下的整体资产策略配置和资产组合配置; 同时, 根据定量和定性方法, 在个别回购品种、债券品种和市场时机方面进行主动式选择。
业绩比较基准	以当期银行个人活期储蓄利率(税后)作为衡量本基金操作水平的比较基准。
风险收益特征	本基金流动性高, 风险低并且收益稳定。

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		诺安基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈勇	赵会军
	联系电话	0755-83026688	010-66105799
	电子邮箱	info@lionfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-8998	95588
传真		0755-83026677	010-66105798
注册地址		深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518048	100140
法定代表人		秦维舟	姜建清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.lionfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层诺

	安基金管理有限公司
--	-----------

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	诺安基金管理有限公司	深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层

§3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2011年1月1日至2011年6月30日)
本期已实现收益	26,528,982.85
本期利润	26,528,982.85
本期净值收益率	1.64%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2011年6月30日)
期末基金资产净值	1,445,887,572.83
期末基金份额净值	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2011年6月30日)
累计净值收益率	16.48%

注：① 本基金的利润分配是按月结转份额。

② 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,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

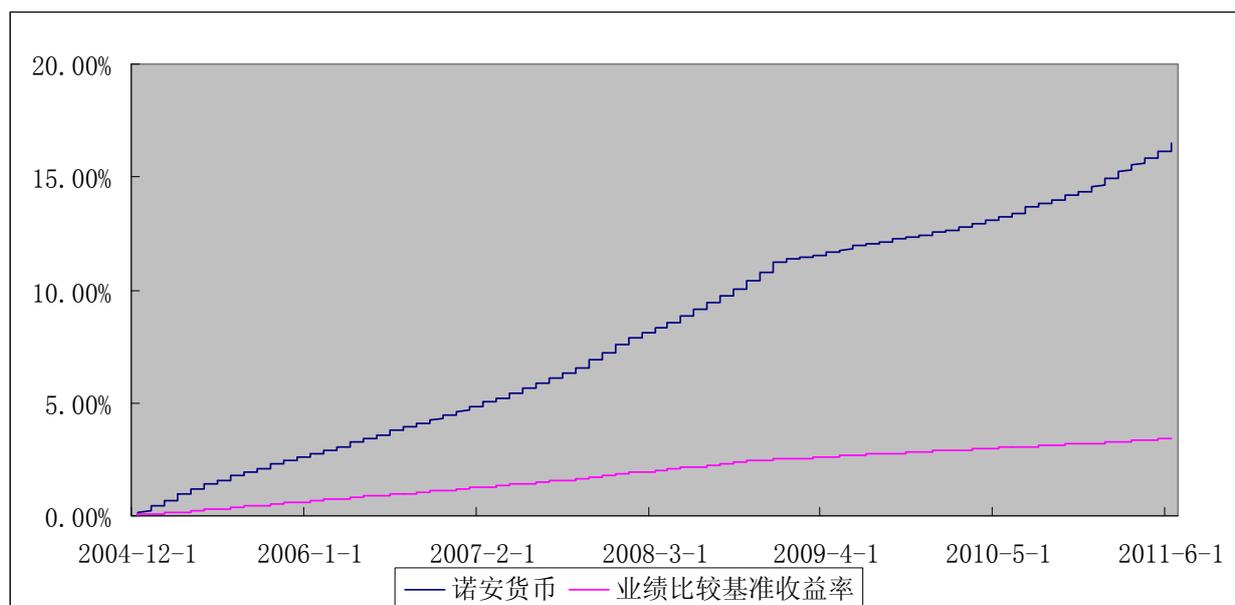
3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.2822%	0.0016%	0.0411%	0.0000%	0.2411%	0.0016%
过去三个月	0.7912%	0.0022%	0.1233%	0.0001%	0.6679%	0.0021%
过去六个月	1.6406%	0.0026%	0.2176%	0.0002%	1.4230%	0.0024%
过去一年	2.7214%	0.0047%	0.3991%	0.0002%	2.3223%	0.0045%
过去三年	6.7268%	0.0065%	1.2562%	0.0003%	5.4706%	0.0062%
自基金合同生效起至今	16.4808%	0.0052%	3.4424%	0.0004%	13.0384%	0.0048%

注：①本基金的利润分配是按月结转份额。

② 本基金的业绩比较基准为：当期银行个人活期储蓄利率(税后)。

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



§ 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

诺安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字【2003】132 号文批准, 公司股东为中国对外经济贸易信托有限公司、深圳市捷隆投资有限公司、北京中关村科学城建设股份有限公司, 公司注册资本为 1.5 亿元人民币。公司建立了完善的内部风险控制制度、投资管理制度、监察稽核制度、财务管理制度、人力资源管理制度、信息披露制度、信息技术管理制度、基金会计核算制度、基金销售管理制度、保密制度、紧急应变制度、授权管理制度、资料档案管理制度等公司管理制度体系。截至 2011 年 6 月 30 日, 公司共管理十五只开放式基金: 诺安平衡证券投资基金、诺安货币市场基金、诺安股票证券投资基金、诺安优化收益债券型证券投资基金、诺安价值增长股票证券投资基金、诺安灵活配置混合型证券投资基金、诺安成长股票型证券投资基金、诺安增利债券型证券投资基金、诺安中证 100 指数证券投资基金、诺安中小盘精选股票型证券投资基金、诺安主题精选股票型证券投资基金、诺安全球黄金证券投资基金、上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金、诺安上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、诺安保本混合型证券投资基金。

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 (助理) 期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张乐赛	本基金的基金经理、诺安优化收益债券型证券投资基金的基金经理、诺	2006 年 8 月 19 日	-	6	毕业于南京财经大学金融学院, 具有基金从业资格。曾就职于南京商业银行资金运营中心; 2004 年 12 月加入诺安基金管理有限公司, 2006 年 8 月起担任诺安货币市场基金的基金经理, 2009 年 8 月起担任诺安优化收益债券型证券投资基金的基金经理, 2011 年 5 月起担任诺安保本混合型证券投资基金的基金

	安保本混合型证券投资基金的基金经理				经理。
--	-------------------	--	--	--	-----

注：①此处的任职日期为公司作出决定并对外公告之日；

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》等相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期间, 诺安货币市场基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》及其他有关法律法规, 遵守了《诺安货币市场基金基金合同》的规定, 遵守了本公司管理制度。本基金投资管理未发生违法违规行为。

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

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合, 并根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》制定了《诺安基金管理有限公司公平交易制度》以及相应的流程, 并通过系统和人工等方式在各环节严格控制, 保证了公平交易的严格执行, 本报告期内未出现任何违反公平交易制度的行为。

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

本基金管理人旗下没有与本基金投资风格相似的投资组合。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内, 本基金不存在异常交易情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2011 年上半年面对居高不下的通胀, 国家采取了一系列的紧缩措施, 加息、上调存款准备金率频频出台。债券市场收益率高起, 资金面紧张, 回购利率大幅上升。流动性成了市场关注的焦点。面对如此环境, 诺安货币市场基金继续坚持“确保本金的安全性、资产的流动性, 力争为投资者提供高于投资基准的稳定收益”的投资目标, 始终将投资安全性与资产的流动性放在首位, 在投资管理过程中严格控制投资与交易风险, 注重资产的流动性管理, 压缩组合久期, 对基金资产进行了合理配置。在投资组合方面, 诺安货币市场基金依旧以中央银行票据、短期金融债、逆回购、定期存款以及短期融资券为主要投资对象, 并坚持对各投资品种进行分散投资。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末, 本基金基金投资组合的剩余期限为 92 天, 影子定价偏离度为正的 0.0508%。本报告期基金份额净值收益率为 1.6406%, 同期业绩比较基准收益率为 0.2176%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2011 年下半年, 通胀压力仍将继续, 到 4 季度可能会出现好转, 但预期也不能太乐观。资金面仍将呈现一种较为紧张的状态, 资金利率维持高位。流动性管理依然是焦点。下一阶段, 诺安货币市场基金将继续注重跟踪分析宏观经济变化与货币政策走向, 根据短期债券市场形势变化, 积极研究投资品种与投资机会, 在保证基金投资安全、保障基金资产流动性的前提下, 为持有人争取较好的投资回报, 实现其“现金管理工具”的职能。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内, 本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》与《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定, 日常估值由本基金管理人与本基金托管人一同进行, 基金份额净值由本基金管理人完成估值后, 经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进

行。

报告期内,公司制定了证券投资基金的估值政策和程序,并由研究部、财务综合部、监察稽核部和风险管理人员、固定收益人员及基金经理等组成了估值小组,负责研究、指导基金估值业务。估值小组成员均为公司各部门人员,均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经验,且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值小组的成员,不介入基金日常估值业务,但应参加估值小组会议,可以提议测算某一投资品种的估值调整影响,并有权表决有关议案但仅享有一票表决权,从而将其影响程度进行适当限制,保证基金估值的公平、合理,保持估值政策和程序的一贯性。

报告期内,本基金未签约与估值相关的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同约定,本基金收益“每日分配、按月支付”。本基金本期实现收益为 26,528,982.85 元,应分配利润 26,528,982.85 元,已实施利润分配 26,528,982.85 元。

本基金本期无应分配而尚未分配的利润情况。

§ 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

2011 年上半年,本基金托管人在对诺安货币市场基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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、利润分配等情况的说明

2011 年上半年,诺安货币市场基金的管理人—诺安基金管理有限公司在诺安货币市场基金的投资运作、每万份基金净收益和 7 日年化收益率、基金利润分配、基金费用开支等问题上,严格遵循《证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》、《货币市场基金信息披露特别规定》等有关法律法规。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对诺安基金管理有限公司编制和披露的诺安货币市场基金 2011 年半年度报告中财务指标、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：诺安货币市场基金

报告截止日：2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	426,979,451.14	27,473,730.66
结算备付金		-	1,789,090.91
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	791,961,615.40	762,291,239.60
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		791,961,615.40	762,291,239.60
资产支持证券投资		-	-

衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	194,830,852.25	629,301,978.95
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	13,946,357.60	8,783,331.58
应收股利		-	-
应收申购款		20,982,744.02	2,100.12
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,448,701,020.41	1,429,641,471.82
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		441,677.79	407,722.53
应付托管费		133,841.80	123,552.26
应付销售服务费		334,604.40	308,880.76
应付交易费用	6.4.7.7	21,818.52	12,039.99
应交税费		417,600.00	417,600.00
应付利息		-	-
应付利润		1,266,081.46	1,060,124.81
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	197,823.61	104,500.00
负债合计		2,813,447.58	2,434,420.35
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	1,445,887,572.83	1,427,207,051.47
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		1,445,887,572.83	1,427,207,051.47
负债和所有者权益总计		1,448,701,020.41	1,429,641,471.82

注：报告截止日 2011 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 1,445,887,572.83 份。

6.2 利润表

会计主体：诺安货币市场基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
一、收入		32,583,707.52	12,773,217.76
1. 利息收入		30,946,816.13	11,685,710.56

其中：存款利息收入	6.4.7.11	6,513,786.46	1,918,826.53
债券利息收入		11,187,931.48	5,838,445.71
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		13,245,098.19	3,928,438.32
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,636,891.39	1,087,507.20
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	1,636,891.39	1,087,507.20
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-
减：二、费用		6,054,724.67	4,360,399.28
1. 管理人报酬		2,688,019.63	1,920,459.97
2. 托管费		814,551.48	581,957.60
3. 销售服务费		2,036,378.44	1,454,893.94
4. 交易费用	6.4.7.18	-	-
5. 利息支出		289,758.61	174,665.79
其中：卖出回购金融资产支出		289,758.61	174,665.79
6. 其他费用	6.4.7.19	226,016.51	228,421.98
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		26,528,982.85	8,412,818.48
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		26,528,982.85	8,412,818.48

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：诺安货币市场基金

本报告期：2011年1月1日至2011年6月30日

单位：人民币元

项目	本期		
	2011年1月1日至2011年6月30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）	1,427,207,051.47	-	1,427,207,051.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	26,528,982.85	26,528,982.85
三、本期基金份额交易产生的基金净	18,680,521.36	-	18,680,521.36

值变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1. 基金申购款	4,854,144,480.04	-	4,854,144,480.04
2. 基金赎回款	-4,835,463,958.68	-	-4,835,463,958.68
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-26,528,982.85	-26,528,982.85
五、期末所有者权益（基金净值）	1,445,887,572.83	-	1,445,887,572.83
项目	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30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）	3,000,062,352.43	-	3,000,062,352.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	8,412,818.48	8,412,818.48
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-2,151,783,059.39	-	-2,151,783,059.39
其中：1. 基金申购款	2,398,033,449.50	-	2,398,033,449.50
2. 基金赎回款	-4,549,816,508.89	-	-4,549,816,508.89
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-8,412,818.48	-8,412,818.48
五、期末所有者权益（基金净值）	848,279,293.04	-	848,279,293.04

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

奥成文 _____ 薛有为 _____ 薛有为 _____
 基金管理公司负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

诺安货币市场基金(简称“本基金”),经中国证券监督管理委员会(简称“中国证监会”)证监基金字[2004]162号文《关于同意诺安货币市场基金募集的批复》核准,于2004年11月8日至2004年11月30日向社会进行公开募集,经利安达会计师事务所验资,共募集资金人民币1,573,321,100.00元,折合1,573,321,100.00份基金份额。有效认购金额产生的利息为人民币489,376.35元,其中在基金募集期产生的利息为人民币276,940.62元,折合276,940.62份基金份额,其余利息为人民币212,435.73元于基金合同生效后归入本基金。基金合同生效日为2004年12月6日,合同生效日基金份额为1,573,598,040.62份基金单位。

本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为诺安基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。《诺安货币市场基金基金合同》、《诺安货币市场基金招募说明书》等文件已按规定报送中国证监会备案。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按财政部于2006年2月15日颁布的企业会计准则(以下简称“企业会计准则”)和中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证券监督管理委员会颁布的《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第3号《半

年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 5 号《货币市场基金信息披露特别规定》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》等通知及其他相关规定和基金合同的规定而编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金的财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了基金 2011 年 6 月 30 日的财务状况以及 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 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

本基金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一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无差错更正。

6.4.6 税项

1、营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》,自 2004 年 1 月 1 日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征营业税和企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

2、个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》,对基金取得的股票的股息、红利及债券的利息等收入,由上市公司、债券发行企业等在向基金派发时代扣代缴 20%的个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日
活期存款	26,979,451.14
定期存款	400,000,000.00
其中:存款期限 1-3 个月	400,000,000.00
其他存款	-
合计	426,979,451.14

6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日				
	摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度(%)	
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	791,961,615.40	792,696,000.00	734,384.60	0.05
	合计	791,961,615.40	792,696,000.00	734,384.60	0.05

注:偏离金额=影子定价-摊余成本,偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	194,830,852.25	-
合计	194,830,852.25	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
应收活期存款利息	1,745.34
应收定期存款利息	2,077,499.70
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	11,579,537.13
应收买入返售证券利息	287,575.43
应收申购款利息	-
其他	-
合计	13,946,357.60

6.4.7.6 其他资产

本项其他资产为报表项目，本基金本期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	21,818.52
合计	21,818.52

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	197,823.61

合计	197,823.61
----	------------

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,427,207,051.47	1,427,207,051.47
本期申购	4,854,144,480.04	4,854,144,480.04
本期赎回（以“-”号填列）	-4,835,463,958.68	-4,835,463,958.68
本期末	1,445,887,572.83	1,445,887,572.83

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	26,528,982.85	-	26,528,982.85
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-26,528,982.85	-	-26,528,982.85
本期末	-	-	-

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
活期存款利息收入	76,435.27
定期存款利息收入	6,371,666.37
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	5,283.97
其他	60,400.85
合计	6,513,786.46

注：“其他”为认申购款利息收入。

6.4.7.12 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	594,586,858.42
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	582,064,591.25
减：应收利息总额	10,885,375.78
债券投资收益	1,636,891.39

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金本报告期没有进行资产支持证券投资,不存在资产支持证券收益。

6.4.7.14 衍生工具收益**6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期没有进行衍生工具投资,不存在衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

本基金本报告期没有进行股票投资和基金投资,不存在股利收益。

6.4.7.16 公允价值变动收益

本基金本报告期不存在公允价值变动损益。

6.4.7.17 其他收入

本基金本报告期不存在其他收入。

6.4.7.18 交易费用

本基金本报告期不存在交易费用。

6.4.7.19 其他费用

单位:人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	143,808.12
汇划费	23,692.90
债券托管账户维护费	8,926.92
合计	226,016.51

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

本基金本报告期无需披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

(1) 本基金于 2011 年 7 月 22 日宣告本基金收益支付公告(2011 年第 7 号),对本基金自 2011 年 6 月 22 日起至 2011 年 7 月 21 日的累计收益进行集中支付,并按 1 元面值直接结转为基金份额,不进行现金支付。

(2) 本基金于 2011 年 8 月 22 日宣告本基金收益支付公告(2011 年第 8 号),对本基金自 2011 年 7 月 22 日起至 2011 年 8 月 21 日的累计收益进行集中支付,并按 1 元面值直接结转为基金份额,不进行现金支付。

6.4.9 关联方关系**6.4.9.1 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**

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无发生变化。

6.4.9.2 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
诺安基金管理有限公司	发起人、管理人
中国工商银行股份有限公司	托管人
深圳市捷隆投资有限公司	管理人股东

注:下述关联方交易均在正常业务范围内,按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间不存在应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月 30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010 年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,688,019.63	1,920,459.97
其中：支付销售机构的客户维护费	155,231.60	132,708.41

注：A. 基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.33% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.33\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

B. 基金管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月 30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010 年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	814,551.48	581,957.60

注：A. 基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

B. 基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

6.4.10.2.3 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	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
诺安基金管理有限公司(管理人)	1,370,683.40
中国工商银行股份有限公司(托管人)	236,738.94
合计	1,607,422.34
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
诺安基金管理有限公司(管理人)	914,518.99

中国工商银行股份有限公司(托管人)	214,596.73
合计	1,129,115.72

注：A. 基金销售服务费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

B. 基金销售服务费每日计算, 逐日累计至每月月底, 按月支付; 由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给销售机构。

6.4.10.3 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 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 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
中国工商银行股份有限公司	20,002,508.20	50,587,355.62	-	-	-	-
上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 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
中国工商银行股份有限公司	-	19,959,800.82	-	-	-	-

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间基金管理人无投资本基金的情况。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2011 年 6 月 30 日		上年度末 2010 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
深圳市捷隆投资有限公司	216,009,920.44	14.94%	-	-

6.4.10.5 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 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	26,979,451.14	76,435.27	2,233,575.42	64,200.65

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在承销期内无参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联事项的说明

本基金无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

已按再投资形式	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配合计	备注
23,145,568.45	3,177,457.75	205,956.65	26,528,982.85	-

6.4.12 期末（2011年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发或增发而形成的流通受限证券。

6.4.12.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.2.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2011 年 6 月 30 日止, 本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0.00 元, 无债券作为抵押。

6.4.12.2.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2011 年 6 月 30 日止, 本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 0.00 元。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券, 按证券交易所规定的比例折算为标准券后, 不低于债券回购交易的余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了严格的风险管理政策和风险控制程序来识别、测量、分析以及控制这些风险, 并设定适当的投资限额, 通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人的风险管理组织体系由三级构成: 第一层次为董事会、合规审查与风险控制委员会所领导; 第二层次为总经理、督察长、风险控制办公会、监察稽核部及研究部风险管理组所监控; 第三层次为公司各业务相关部门对各自部门的风险控制负责。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任, 或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息, 导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券, 且通过分散化投资以降低信用风险。本基金投资于同一公司发行的短期企业债券的比例不超过基金资产净值的 10%, 且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券总和, 不得超过该证券的 10%。

本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估, 以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
A-1	460,030,511.82	499,968,660.85
A-1 以下	-	-
未评级	-	-
合计	460,030,511.82	499,968,660.85

注：因政府债券(包括国债、央行票据、政策性金融债)不涉及信用评级, 故上表不包含政府债券。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
AAA	102,054,166.81	102,225,530.82
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	102,054,166.81	102,225,530.82

注：因政府债券(包括国债、央行票据、政策性金融债)不涉及信用评级,故上表不包含政府债券。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额,另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持证券均可在银行间同业市场交易,能够及时变现。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金所持有金融负债以及可赎回基金份额净值(所有者权益)的合同约定到期日均为一年以内且不计息,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求,并通过独立的风险管理岗位对投资组合中的证券的流动性风险进行持续的监测和分析。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

单位：人民币元

本期末 2011 年 6 月 30 日	6 个月以内	6 个月到 1 年	1-5 年	5 年 以上	合计
资产					
银行存款	426,979,451.14	-	-	-	426,979,451.14
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	571,949,963.42	220,011,651.98	-	-	791,961,615.40
买入返售金融资产	194,830,852.25	-	-	-	194,830,852.25
资产总计	1,193,760,266.81	220,011,651.98	-	-	1,413,771,918.79
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	-	-
流动性净额	1,193,760,266.81	220,011,651.98	-	-	1,413,771,918.79
上年度末 2010 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月到 1 年	1-5 年	5 年 以上	合计
资产					
银行存款	27,473,730.66	-	-	-	27,473,730.66
结算备付金	1,789,090.91	-	-	-	1,789,090.91
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	452,287,496.84	310,003,742.76	-	-	762,291,239.60
买入返售金融资产	629,301,978.95	-	-	-	629,301,978.95
资产总计	1,110,852,297.36	310,003,742.76	-	-	1,420,856,040.12
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-

应付证券清算款	-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	-	-
流动性净额	1,110,852,297.36	310,003,742.76	-	-	1,420,856,040.12

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因市场价格变动而发生波动的风险,包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

本基金主要投资于银行间市场交易的固定收益品种,以摊余成本法计价,并通过“影子定价”机制使按摊余成本法确认的基金资产净值能近似反映基金资产的公允价值,因此本基金的运作仍然存在相应的利率风险。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感度缺口进行监控。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值,并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2011 年 6 月 30 日	6 个月以内	6 个月到 1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	426,979,451.14	-	-	-	-	426,979,451.14
结算备付金	-	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	571,949,963.42	220,011,651.98	-	-	-	791,961,615.40
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	194,830,852.25	-	-	-	-	194,830,852.25
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	13,946,357.60	13,946,357.60
应收申购款	-	-	-	-	20,982,744.02	20,982,744.02
资产总计	1,193,760,266.81	220,011,651.98	-	-	34,929,101.62	1,448,701,020.41
负债						
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	441,677.79	441,677.79
应付托管费	-	-	-	-	133,841.80	133,841.80
应付销售服务费	-	-	-	-	334,604.40	334,604.40
应付交易费用	-	-	-	-	21,818.52	21,818.52
应交税费	-	-	-	-	417,600.00	417,600.00
应付利润	-	-	-	-	1,266,081.46	1,266,081.46
其他负债	-	-	-	-	197,823.61	197,823.61
负债总计	-	-	-	-	2,813,447.58	2,813,447.58
利率敏感度缺口	1,193,760,266.81	220,011,651.98	-	-	32,115,654.04	1,445,887,572.83
上年度末 2010 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月到 1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

资产						
银行存款	27,473,730.66	-	-	-	-	27,473,730.66
结算备付金	1,789,090.91	-	-	-	-	1,789,090.91
存出保证金	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	452,287,496.84	310,003,742.76	-	-	-	762,291,239.60
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	629,301,978.95	-	-	-	-	629,301,978.95
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	8,783,331.58	8,783,331.58
应收申购款	-	-	-	-	2,100.12	2,100.12
资产总计	1,110,852,297.36	310,003,742.76	-	-	8,785,431.70	1,429,641,471.82
负债						
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	407,722.53	407,722.53
应付托管费	-	-	-	-	123,552.26	123,552.26
应付销售服务费	-	-	-	-	308,880.76	308,880.76
应付交易费用	-	-	-	-	12,039.99	12,039.99
应交税费	-	-	-	-	417,600.00	417,600.00
应付利润	-	-	-	-	1,060,124.81	1,060,124.81
其他负债	-	-	-	-	104,500.00	104,500.00
负债总计	-	-	-	-	2,434,420.35	2,434,420.35
利率敏感度缺口	1,110,852,297.36	310,003,742.76	-	-	6,351,011.35	1,427,207,051.47

注：各期限分类的标准：按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 市场利率发生变化。		
	2. 其他市场变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末(2011年6月30日)	上年度末(2010年12月31日)
	1. 市场利率下降 27 个基点	750,969.68	960,555.57
	2. 市场利率上升 27 个基点	-750,969.68	-960,555.57

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指外汇风险和利率风险以外的市场风险。本基金的投资标的物包括但不限于以下金融工具：剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的国债、金融债和 AAA 企业债等债券，期限在一年以内(含一年)的债券回购、中央银行票据和银行存款(含现金、银行定期存款、大额存单等)以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的金融工具。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，且以摊余成本法进行计价，因此无重大价格风险。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

假设市场因子的变化服从多元正态分布, 在 95% 的置信度下, 使用过去一年的历史数据, 按照 VaR 正态算法, 计算未来一个交易日里, 基金持仓资产组合可能的最大损失值。

假设	1. 置信度: 95%		
	2. 观察期: 一年		
分析	风险价值 (单位: 人民币元)	本期末(2011年6月30日)	上年度末(2010年12月31日)
	基金投资组合的风险价值	537,000.06	536,410.58
	合计	537,000.06	536,410.58

§7 投资组合报告**7.1 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	791,961,615.40	54.67
	其中: 债券	791,961,615.40	54.67
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	194,830,852.25	13.45
	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	426,979,451.14	29.47
4	其他各项资产	34,929,101.62	2.41
5	合计	1,448,701,020.41	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位: 人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	0.94	
	其中: 买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中: 买断式回购融资	-	-

注: 本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个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 说明

在本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限**7.3.1 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	92
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	102
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	59

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

无。

7.3.2 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	25.73	0.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	6.94	0.00
2	30 天(含)—60 天	23.52	0.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	19.48	0.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	3.57	0.00
4	90 天(含)—180 天	13.83	0.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	180 天(含)—397 天(含)	15.22	0.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	97.78	0.00

7.4 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	49,913,464.01	3.45
3	金融债券	179,963,472.76	12.45
	其中：政策性金融债	179,963,472.76	12.45
4	企业债券	102,054,166.81	7.06
5	企业短期融资券	460,030,511.82	31.82
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	791,961,615.40	54.77
9	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	151,970,878.30	10.51

7.5 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	100226	10 国开 26	800,000	79,987,848.16	5.53
2	078058	07 华谊债	500,000	51,653,776.17	3.57
3	058017	05 首都机场债	500,000	50,400,390.64	3.49
4	080414	08 农发 14	500,000	50,058,913.11	3.46
5	110221	11 国开 21	500,000	49,916,711.49	3.45
6	1101025	11 央行票据 25	500,000	49,913,464.01	3.45

7	1181279	11 北营钢 CP01	400,000	40,001,321.85	2.77
8	1081439	10 建发集 CP02	300,000	30,000,495.52	2.07
9	1081396	10 珠海港 CP01	200,000	20,009,460.06	1.38
10	1181290	11 岳阳 CP01	200,000	20,006,515.64	1.38

7.6 “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	-
报告期内偏离度的最高值	0.20%
报告期内偏离度的最低值	-0.07%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.08%

7.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 投资组合报告附注

7.8.1 基金计价方法说明

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,在其剩余期限内按实际利率法摊销,每日计提收益。

7.8.2 本报告期内不存在“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”的摊余成本超过当日基金资产净值的 20%的情况。

7.8.3 本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体,本期没有出现被监管部门立案调查的情形,也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.8.4 期末其他各项资产构成

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	13,946,357.60
4	应收申购款	20,982,744.02
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	34,929,101.62

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

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

7,281	198,583.65	1,207,469,719.79	83.51%	238,417,853.04	16.49%
-------	------------	------------------	--------	----------------	--------

8.2 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	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	2,504,395.28	0.17%

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2004年12月6日)基金份额总额	1,573,598,040.62
本报告期期初基金份额总额	1,427,207,051.47
本报告期基金总申购份额	4,854,144,480.04
减:本报告期基金总赎回份额	4,835,463,958.68
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,445,887,572.83

注：总申购含红利再投、转换入份额，总赎回含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开本基金的基金份额持有人大会，没有基金份额持有人大会决议。

10.2 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

本基金基金管理人、托管人的专门基金托管部门在本报告期内没有发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金的投资组合策略没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所没有发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金的基金管理人、托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚的任何情形。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

注：1、 本基金租用证券公司交易单元没有进行股票投资。

2、 本报告期租用证券公司交易单元未发生变更。

3、 专用交易单元的选择标准和程序

基金管理人选择使用基金专用交易席位的证券经营机构的选择标准为：

- (1) 实力雄厚, 信誉良好, 注册资本不少于 3 亿元人民币。
 - (2) 财务状况良好, 各项财务指标显示公司经营状况稳定。
 - (3) 经营行为规范, 最近两年未发生重大违规行为而受到中国证监会处罚。
 - (4) 内部管理规范、严格, 具备健全的内控制度, 并能满足基金运作高度保密的要求。
 - (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件, 交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要, 并能为本基金提供全面的信息服务。
 - (6) 研究实力较强, 有固定的研究机构和专门的研究人员, 能及时为本基金提供高质量的咨询服务。
- 基金管理人根据以上标准进行评估后确定证券经营机构的选择, 与被选择的券商签订《专用证券交易单元租用协议》。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券回购交易	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
国信证券股份有限公司	930,000,000.00	100.00%

注：本基金租用的证券公司交易单元本期无债券交易和权证交易。

10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况

本基金本报告期不存在偏离度绝对值超过 0.5% 的情况。

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	诺安基金管理有限公司旗下基金 2010 年年度最后一个交易日基金资产净值、基金份额净值及份额累计净值公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2011-01-04
2	诺安货币市场基金招募说明书（更新）2010 年第 2 期	基金管理人网站	2011-01-19
3	诺安货币市场基金招募说明书（更新）摘要 2010 年第 2 期	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2011-01-19
4	诺安货币市场基金 2010 年第四季度报告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2011-01-21
5	诺安货币市场基金收益支付公告（2011 年第 1 号）	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2011-01-24
6	诺安货币市场基金春节假期前暂停申购及转换转入业务公告（2011）	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2011-01-27
7	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加温州银行个人网上银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2011-02-01
8	诺安基金管理有限公司关于旗下基金参加上海农商银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2011-02-16
9	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在广发华福证券开通定期定额投资业务及参加申购费率优惠活动	《中国证券报》、 《上海证券报》、	2011-02-18

	的公告	《证券时报》	
10	诺安基金管理有限公司关于旗下基金在光大证券开通定期定额投资业务及参加申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2011-02-18
11	诺安货币市场基金收益支付公告（2011 年第 2 号）	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2011-02-24
12	诺安基金管理有限公司关于增加西南证券为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2011-03-04
13	诺安基金管理有限公司关于开通交通银行借记卡基金网上直销业务的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2011-03-07
14	诺安基金管理有限公司关于旗下基金参加光大证券开放式基金网上交易定期定额投资申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2011-03-08
15	诺安基金管理有限公司关于增加东兴证券为旗下基金代销机构的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2011-03-09
16	诺安基金管理有限公司关于增加财达证券为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2011-03-18
17	诺安货币市场基金收益支付公告（2011 年第 3 号）	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2011-03-22
18	诺安货币市场基金清明节假期前暂停申购及转换转入业务公告（2011）	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2011-03-29
19	诺安货币市场基金 2010 年年度报告摘要	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2011-03-29
20	诺安货币市场基金 2010 年年度报告	基金管理人网站	2011-03-29
21	诺安货币市场基金收益支付公告（2011 年第 4 号）	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2011-04-22
22	诺安货币市场基金 2011 年第一季度报告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2011-04-22
23	诺安基金管理有限公司关于旗下基金在中信证券开通基金定期定额投资业务及转换业务的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2011-05-09
24	诺安基金管理有限公司关于开通中国民生银行借记卡基金网上直销交易业务的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2011-05-16

25	诺安基金管理有限公司关于增加烟台银行为旗下基金代销机构及开通定投、转换业务的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2011-05-17
26	诺安货币市场基金收益支付公告(2011年第5号)	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2011-05-23
27	诺安基金管理有限公司关于开通招商银行借记卡基金网上直销交易业务的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2011-05-23
28	诺安基金管理有限公司关于增加国金证券为旗下基金代销机构及开通基金转换业务的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2011-06-16
29	诺安基金管理有限公司关于中信建投证券调整基金定投业务的最低申购金额的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2011-06-16
30	诺安基金管理有限公司关于增加华西证券为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2011-06-20
31	诺安货币市场基金收益支付公告(2011年第6号)	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2011-06-22
32	诺安基金管理有限公司关于增加红塔证券为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2011-06-28
33	诺安基金管理有限公司关于增加中信万通证券为旗下基金代销机构及开通基金转换业务的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》	2011-06-28

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件名称

- ① 中国证券监督管理委员会批准诺安货币市场基金设立的文件。
- ② 《诺安货币市场基金基金合同》。
- ③ 《诺安货币市场基金托管协议》。
- ④ 诺安基金管理有限公司批准成立批件、营业执照。
- ⑤ 《诺安基金管理有限公司开放式基金业务规则》。
- ⑥ 诺安货币市场基金 2011 年半年度报告正文。
- ⑦ 本报告期内在中国证监会指定报刊上公开披露的各项公告。

11.2 备查文件存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

11.3 备查文件查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可致电本基金管理人全国统一客户服务电话：400-888-8998，亦可至基金管理人网站 www.lionfund.com.cn 查阅详情。

诺安基金管理有限公司
2011 年 8 月 25 日