

华富货币市场基金 2011 年半年度报告摘要

2011 年 6 月 30 日

基金管理人：华富基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2011 年 8 月 24 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。

基金托管人中国建设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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 2011 年 6 月 30 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华富货币
基金主代码	410002
交易代码	410002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年6月21日
基金管理人	华富基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	720,060,902.57份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	力求在保持基金资产本金稳妥和良好流动性的前提下，获得超过基金业绩比较基准的稳定收益。
投资策略	本基金根据宏观经济运行状况，货币政策和财政政策执行状况以及短期利率的变动和货币市场格局的变化，积极主动地在现金、存款、债券资产和回购资产等之间进行动态地资产配置，严格按照相关法律法规规定控制组合资产的比例和平均剩余期限，防范风险，保证资产的流动性和稳定收益水平。
业绩比较基准	人民币税后一年期银行定期储蓄存款利率。
风险收益特征	本基金属于高流动性、低风险品种，其预期风险和预期收益率都低于股票型、债券型和混合型基金。

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		华富基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	满志弘	尹东
	联系电话	021-68886996	010-67595003
	电子邮箱	manzh@hffund.com	yindong.zh@ccb.com
客户服务电话		400-700-8001	010-67595096
传真		021-68887997	010-66275853

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	http://www.hffund.com
基金半年度报告报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公场所

§ 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	18,088,765.31
本期利润	18,088,765.31
本期净值收益率	1.7781%
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	720,060,902.57
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	14.5357%

注：1) 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。

2) 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) 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

4) 本基金收益分配按月结转份额。

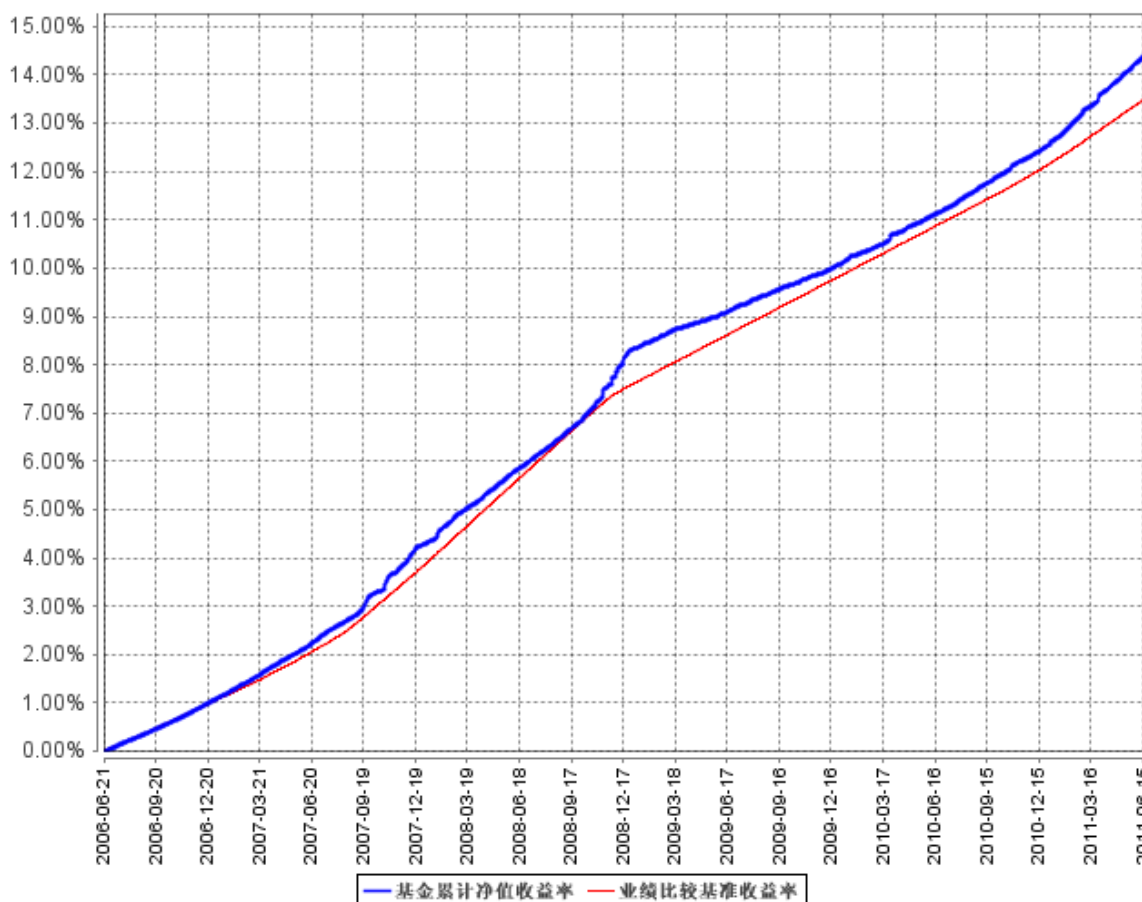
3.2 基金净值表现

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	0.2827%	0.0022%	0.2671%	0.0000%	0.0156%	0.0022%
过去三月	0.8366%	0.0035%	0.8068%	0.0002%	0.0298%	0.0033%
过去六月	1.7781%	0.0069%	1.5199%	0.0005%	0.2582%	0.0064%
过去一年	3.0011%	0.0057%	2.7082%	0.0011%	0.2929%	0.0046%
过去三年	8.1010%	0.0080%	7.8804%	0.0016%	0.2206%	0.0064%
自基金合同生效起至今	14.5357%	0.0072%	13.6577%	0.0019%	0.8780%	0.0053%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金建仓期为 2006 年 6 月 21 日至 9 月 21 日，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。本报告期内，本基金严格执行了基金合同的相关规定。

§ 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

基金管理人华富基金管理有限公司于 2004 年 3 月 29 日经中国证监会证监基金字[2004]47 号文核准开业，4 月 19 日在上海正式注册成立，注册资本 1.2 亿元，公司股东为华安证券有限责任公司、安徽省信用担保集团有限公司和合肥兴泰控股集团有限公司。截止 2011 年 6 月 30 日，本基金管理人管理了华富竞争力优选混合型证券投资基金、华富货币市场基金、华富成长趋势股票型证券投资基金、华富收益增强债券型证券投资基金、华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金、华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金、华富中证 100 指数证券投资基金、华富强化回报债券型证券投资基金和华富量子生命力股票型证券投资基金九只基金。

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		
胡伟	华富货币基金经理	2009年10月19日	-	七年	中南财经政法大学经济学学士，曾在珠海市商业银行资金营运部从事债券研究及债券交易工作，2006年11月加入我公司，任债券交易员、华富货币市场基金基金经理助理

注：任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，证券从业年限的计算标准上，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》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，本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及相关法律法规、基金合同的规定，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，基金运作合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本基金管理人在报告期内严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》以及本公司公平交易制度的相关规定，在日常交易中公平对待所管理的不同投资组合。

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

本基金为货币基金，本基金管理人管理的其他基金的投资风格与本基金的投资风格不相似。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内无异常交易行为发生。

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

上半年由于欧洲债务危机、日本地震、美国房地产以及就业市场低迷等不利因素影响，发达经济体表现疲软。国内经济总体运行稳健，但通胀压力较大，上半年央行主要通过加息以及上调存款准备金率来维持偏紧的货币政策环境。

上半年由于存款准备金率的持续上调对资金面的影响逐渐增强，加之存贷比指标日均考核，部分时点各大银行吸收存款等不利因素影响，资金利率波动较大，资金成本呈上升趋势。由于实体经济增速仍然较强、通胀超预期、资金面整体偏紧，债券收益率曲线整体上移并呈平坦化。上

半年，一年期央票发行利率上涨 99BP 至 3.5% 的水平。中债综合净价指数大幅回落 0.53%。

上半年由于银行短期理财产品发展迅速，货币市场基金份额遭遇挤压，整体赎回压力较大。本基金根据货币基金季节性申赎规律，合理安排各类资产配置比例和期限结构，加强了对组合流动性的管理。通过对市场利率走势的判断，在资金利率较高时点，提高了存款以及回购资产的比例，实现了较为稳定的投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金于 2006 年 6 月 21 日正式成立。上半年基金净值收益率为 1.7781%，期间业绩比较基准 1.5199%，期间年化收益率 3.5592%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年，国内经济增速将在紧缩调控下逐渐放缓，通胀将触顶回落，但仍将维持较高水平，短期内紧缩力度将会维持。但由于美国经济复苏较慢，欧洲债务危机深化，外部面临较多不确定性，国内宏观调难度较大。经过流动性以及城投信用事件冲击过后，高等级短融配置价值逐渐体现。由于资金利率、债券收益率均较年初有大幅度的上升，货币基金投资收益有望维持在较高水平。

本基金将坚持把流动性管理和风险控制放在首位，密切关注货币政策、财政政策的变化，及时调整组合期限和投资品种，严格控制流动性风险、信用风险和利率风险，力争为基金持有人获取合理的投资收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为了有效控制基金估值流程，按照相关法律法规的规定，成立了估值委员会，并制订了相关制度和流程。估值委员会负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允、合理，保证估值未被歪曲以免对基金持有人产生不利影响。公司估值委员会主席为公司总经理，成员包括总经理、副总经理、运作保障部负责人、监察稽核部负责人以及基金核算、金融工程、行业研究等方面的骨干。估值委员会所有相关人员均具有丰富的行业分析经验和会计核算经验等证券投资基金行业从业经验和专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。本基金未与任何第三方签订定价服务协议。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金以份额面值 1.00 元固定份额净值交易方式，每日计算当日收益并按基金份额面值 1.00 元分配后转入持有人权益，每月集中宣告收益分配并将当月收益结转到基金份额持有人基金账户。

本基金在本半年度应分配收益 18,088,765.31 元，已全部分配，符合法律法规和《基金合同》的相关规定。

§ 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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金分红再投资的总金额为 18,088,765.31 元。

5.3 托管人对半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 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：华富货币市场基金

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	40,323,874.11	80,185,068.53
结算备付金		-	1,636,363.64
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	456,524,250.31	445,531,120.35
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		456,524,250.31	445,531,120.35
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	214,801,122.20	117,548,518.27
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	3,451,732.04	4,048,147.49
应收股利		-	-
应收申购款		6,259,284.23	1,900.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		721,360,262.89	648,951,118.28
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		340,376.75	215,957.86
应付托管费		103,144.50	65,441.80
应付销售服务费		257,861.17	163,604.46
应付交易费用	6.4.7.7	27,691.22	13,896.16
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		401,650.14	219,102.03
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	168,636.54	264,500.00
负债合计		1,299,360.32	942,502.31
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	720,060,902.57	648,008,615.97
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		720,060,902.57	648,008,615.97
负债和所有者权益总计		721,360,262.89	648,951,118.28

注：报告截止日 2011 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.00 元，基金份额总额 720,060,902.57 份。

后附报表附注为本财务报表的组成部分。

6.2 利润表

会计主体：华富货币市场基金

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 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

一、收入		22,074,615.62	8,326,037.53
1. 利息收入		19,712,209.35	6,523,325.40
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,884,282.14	60,753.81
债券利息收入		11,168,267.60	5,373,878.70
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		5,659,659.61	1,088,692.89
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,362,306.27	1,802,712.13
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	2,362,306.27	1,802,712.13
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	100.00	-
减：二、费用		3,985,850.31	2,366,885.47
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,742,917.10	1,018,298.85
2. 托管费	6.4.10.2.2	528,156.75	308,575.40
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,320,391.60	771,438.56
4. 交易费用	6.4.7.19	-	-
5. 利息支出		261,143.31	126,733.78
其中：卖出回购金融资产支出		261,143.31	126,733.78
6. 其他费用	6.4.7.20	133,241.55	141,838.88
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		18,088,765.31	5,959,152.06
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		18,088,765.31	5,959,152.06

注：后附表附注为本财务报表的组成部分。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华富货币市场基金

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	648,008,615.97	-	648,008,615.97

金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	18,088,765.31	18,088,765.31
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)	72,052,286.60	-	72,052,286.60
其中: 1. 基金申购款	5,878,965,879.00	-	5,878,965,879.00
2. 基金赎回款	-5,806,913,592.40	-	-5,806,913,592.40
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)	-	-18,088,765.31	-18,088,765.31
五、期末所有者权益(基金净值)	720,060,902.57	-	720,060,902.57
	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日		
项目	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)	661,713,544.73	-	661,713,544.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	5,959,152.06	5,959,152.06
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)	-166,210,539.92	-	-166,210,539.92
其中: 1. 基金申购款	4,512,111,361.59	-	4,512,111,361.59
2. 基金赎回款	-4,678,321,901.51	-	-4,678,321,901.51
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)	-	-5,959,152.06	-5,959,152.06
五、期末所有者权益(基金净值)	495,503,004.81	-	495,503,004.81

注: 后附报表附注为本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:

章宏韬
基金管理公司负责人

姚怀然
主管会计工作负责人

陈大毅
会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华富货币市场基金由华富基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及相关规定和《华富货币市场基金基金合同》发起，经中国证券监督管理委员会证监基金字【2006】87号文核准募集设立。本基金自2006年5月29日起公开向社会发行，至2006年6月16日募集结束。经安永大华会计师事务所有限责任公司验资并出具安永大华业字（2006）第549号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。本次募集资金总额851,982,753.02元；募集资金的银行存款利息150,001.00元，折成基金份额，归投资人所有；设立募集期共募集852,132,754.02份基金单位。本基金为契约型开放式，存续期限不定，基金管理人为华富基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司；有关基金设立文件已按规定向中国证券监督管理委员会备案；基金合同于2006年6月21日生效，该日的基金份额为852,132,754.02份基金单位。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以财政部于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”)、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》、《华富货币市场基金基金合同》以及中国证监会发布的基金行业实务操作的规定编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2011半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2011年6月30日的财务状况以及2011半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期本基金会计政策无变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期本基金会计估计无变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本报告期本基金无重大会计差错。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策问题的通知》、财税[2007]84 号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项如下:

以发行基金方式募集资金,不属于营业税征收范围,不征收营业税。

基金买卖债券的差价收入,从 2004 年 1 月 1 日起,继续免征营业税。

对基金买卖债券的差价收入,从 2004 年 1 月 1 日起,继续免征收企业所得税;对基金取得的企业债券的利息收入,由上市公司和发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化

6.4.7.2 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
华富基金管理有限公司	基金发起人、管理人、注册登记人、销售机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
华安证券有限责任公司(“华安证券”)	基金管理人的股东、代销机构

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 债券回购交易

金额单位: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	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
华安证券有限责任公司	355,000,000.00	100.00%	80,000,000.00	100.00%

6.4.8.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华安证券有限责任公司	29,752.78	100.00%	89,752.78	100.00%
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			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华安证券有限责任公司	29,752.78	100.00%	29,752.78	100.00%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取，并由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	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
当期发生的基金应支付的管理费	1,742,917.10	1,018,298.85
其中：支付销售机构的客户维护费	181,893.25	101,594.15

注：支付基金管理人华富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：

$$\text{日基金管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.33\% / \text{当年天数}。$$

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	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
当期发生的基金应支付的托管费	528,156.75	308,575.40

注：支付基金托管人中国建设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：

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

6.4.8.2.3 销售服务费

金额单位：人民币元

获得销售服务费 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	
华富基金管理有限公司（管理人）	313,855.68	
中国建设银行（托管人）	587,682.29	
华安证券有限责任公司（管理人股东）	255.83	
合计	901,793.80	
获得销售服务费 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	
华富基金管理有限公司（管理人）	274,597.31	
中国建设银行（托管人）	278,999.15	
华安证券有限责任公司（管理人股东）	169.71	
合计	553,766.17	

注：支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.25% 计提，逐日累计至每月月底，按月支付给华富基金管理有限公司，再由华富基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日基金销售服务费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

6.4.8.3 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
中国建设银行	-	-	58,200,000.00	11,879.18	1,253,720,000.00	134,803.93
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
中国建设银行	20,105,921.35	20,158,107.08	-	-	1,938,165,000.00	90,597.34

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间内本基金管理人没有运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 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

本基金本报告期末和上年度末除基金管理人之外的其他关联方没有投资本基金。

6.4.8.5 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		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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	323,874.11	64,393.93	866,681.82	46,109.39

注：本表仅列示活期存款余额及产生利息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期内及上年度可比期间内未参与关联方承销证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无

6.4.9 期末（2011年6月30日）本基金持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有流通受限证券。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无

§ 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	456,524,250.31	63.29
	其中：债券	456,524,250.31	63.29
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	214,801,122.20	29.78
	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	40,323,874.11	5.59
4	其他各项资产	9,711,016.27	1.35
5	合计	721,360,262.89	100.00

注：本表列示的其他资产详见 7.8.4 其他资产构成。

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	2.11

	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：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% 的说明

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%

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	113
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	116
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	52

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

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

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	28.65	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	8.42	-
2	30 天(含)—60 天	11.11	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	4.16	-
3	60 天(含)—90 天	21.52	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	6.31	-
4	90 天(含)—180 天	12.55	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	180 天(含)—397 天（含）	25.01	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		98.83	-

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	-	-
3	金融债券	176,255,797.03	24.48
	其中：政策性金融债	176,255,797.03	24.48
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	280,268,453.28	38.92
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	456,524,250.31	63.40
9	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	136,026,461.06	18.89

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	1181252	11 浙商集 CP01	700,000	70,094,286.43	9.73
2	090213	09 国开 13	600,000	60,609,901.43	8.42
3	1081290	10 方大 CP01	400,000	40,082,754.25	5.57
4	1181235	11 雅戈尔 CP01	400,000	40,001,145.52	5.56
5	1181157	11 锦州港 CP01	400,000	40,000,000.00	5.56
6	1081346	10 轻纺 CP01	300,000	30,091,440.64	4.18
7	110206	11 国开 06	300,000	29,967,117.58	4.16
8	070219	07 国开 19	250,000	24,982,908.81	3.47
9	090205	09 国开 05	200,000	20,466,533.24	2.84
10	070211	07 国开 11	200,000	20,247,776.68	2.81

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	24
报告期内偏离度的最高值	0.3522%
报告期内偏离度的最低值	-0.0557%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1915%

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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 本基金采用固定份额净值，基金账面份额净值始终保持为人民币 1.00 元。

本基金所持有的债券（包括票据）的估值采用摊余成本法，即估值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，在其剩余存续期限内按实际利率法进行摊销，每日计提收益或损失。

7.8.2 本报告期内，本基金不存在剩余期限小于 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日基金资产净值 20% 的情况。

7.8.3 本基金在报告期内投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责，处罚的情况。

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	3,451,732.04
4	应收申购款	6,259,284.23
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	9,711,016.27

7.8.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 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

4,429	162,578 .66	340,560,020.9 3	47.30%	379,500,881.64	52.70%
-------	----------------	--------------------	--------	----------------	--------

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	-	-

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2006年6月21日）基金份额总额	852,132,754.02
本报告期期初基金份额总额	648,008,615.97
本报告期基金总申购份额	5,878,965,879.00
减：本报告期基金总赎回份额	5,806,913,592.40
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	720,060,902.57

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

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

1、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，韩玮先生、季雷先生不再担任华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。

2、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，增聘张钊先生为华富强化回报债券型证券投资基金的基金经理。

3、本基金托管人 2011 年 2 月 9 日发布公告，经中国建设银行研究决定，聘任杨新丰为中国建设银行投资托管服务部副总经理（主持工作），其任职资格已经中国证监会审核批准（证监许可（2011）115 号）。解聘罗中涛中国建设银行投资托管服务部总经理职务。

4、本基金托管人 2011 年 1 月 31 日发布任免通知，解聘李春信中国建设银行投资托管服务部副总经理职务。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

基金管理人、基金财产、基金托管业务在本报告期内没有发生诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未有改聘为其审计的会计师事务所情况。

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

本基金的管理人、托管人及其高级管理人员报告期内未受监管部门的稽查或处罚。

10.7 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	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华安证券	-	-	355,000,000.00	100.00%	-	-

注：1) 根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》(证监基金字[2007]48号)，我公司重新修订了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序，比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，选择了研究能力强、内部管理规范、信息资讯服务能力强的几家券商租用了基金专用交易单元。

2) 本报告期本基金租用券商交易单元无变更。

3) 债券交易中企业债及可分离债券的成交金额按净价统计，可转债的成交金额按全价统计。

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

无

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

无