

万家货币市场证券投资基金 2011 年半年度报告

2011 年 6 月 30 日

基金管理人： 万家基金管理有限公司

基金托管人： 华夏银行股份有限公司

送出日期： 2011 年 8 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及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。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2011 年 8 月 24 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.....	3
§2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告.....	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	8
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.....	8
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	8
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	9
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	9
§5 托管人报告.....	9
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	9
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.....	9
5.3 托管人对本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.....	9
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	9
6.1 资产负债表.....	9
6.2 利润表.....	11
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	12
6.4 报表附注.....	13
§7 投资组合报告.....	25
7.1 期末基金资产组合情况.....	25
7.2 债券回购融资情况.....	25
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	26
7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	26
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.....	27
7.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	27
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.....	27
7.8 投资组合报告附注.....	27
§8 基金份额持有人信息.....	28
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	28
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.....	28
§9 开放式基金份额变动.....	28

§10 重大事件揭示.....	29
10.1 基金份额持有人大会决议.....	29
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.....	29
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	29
10.4 基金投资策略的改变.....	29
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	29
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.....	29
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	29
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	30
§11 备查文件目录.....	30
11.1 备查文件名称.....	30
11.2 备查文件存放地点.....	30
11.3 备查文件查阅方式.....	30

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	万家货币市场证券投资基金
基金简称	万家货币
基金主代码	519508
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006 年 5 月 24 日
基金管理人	万家基金管理有限公司
基金托管人	华夏银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,466,338,277.31 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在力保本金稳妥和基金资产高流动性的基础上,为投资者提供资金的流动性储备,并追求高于业绩比较基准的稳定收益
投资策略	通过短期利率预期策略、类属资产配置策略和无风险套利操作策略构建投资组合,谋求在满足流动性要求、控制风险的前提下,实现基金收益的最大化
业绩比较基准	一年期银行定期存款税后利率
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中低风险、高流动性的品种,其预期风险和预期收益率都低于股票、债券和混合型基金

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		万家基金管理有限公司	华夏银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	兰剑	郑鹏
	联系电话	021-38619810	010-85238667
	电子邮箱	lanj@wjasset.com	zhjjtgb@hxb.com.cn
客户服务电话		4008880800	95577
传真		021-38619888	010-85238680
注册地址		上海市浦东新区福山路 450 号新天国际大厦 23 楼	北京市东城区建国门内大街 22 号
办公地址		上海市浦东新区福山路 450 号新天国际大厦 23 楼	北京市东城区建国门内大街 22 号
邮政编码		200122	100005
法定代表人		毕玉国	吴建

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》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.wjasset.com
基金半年度报告备置地点	上海市浦东新区福山路 450 号新天国际大厦 23 楼 基金管理人办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 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	54,449,732.92
本期利润	54,449,732.92
本期净值收益率	1.7895%
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	1,466,338,277.31
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	16.1310%

注：1、本基金收益分配按月结转份额。

2、本基金无持有人申购、赎回的交易费用。

3、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。

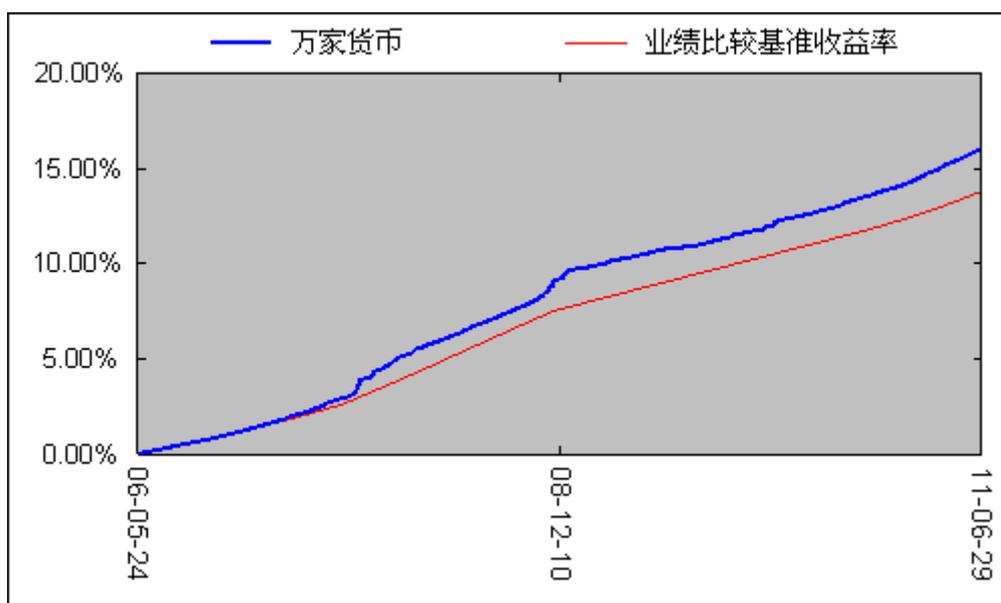
3.2 基金净值表现

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 1 个月	0.3436%	0.0053%	0.2671%	0.0000%	0.0765%	0.0053%
过去 3 个月	0.9245%	0.0060%	0.8068%	0.0002%	0.1177%	0.0058%
过去 6 个月	1.7895%	0.0050%	1.5199%	0.0005%	0.2696%	0.0045%
过去 1 年	3.0174%	0.0049%	2.7082%	0.0011%	0.3092%	0.0038%
过去 3 年	8.5826%	0.0107%	7.8853%	0.0016%	0.6973%	0.0091%
自基金合同生效起至今	16.1310%	0.0098%	13.8061%	0.0020%	2.3249%	0.0078%

注：业绩比较基准收益率=一年期银行定期存款税后利率

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:本基金成立于 2006 年 5 月 24 日,建仓期为 3 个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同要求。报告期末各项资产配置比例符合基金合同要求。

§ 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

万家基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]44 号文批准设立。公司现股东为齐鲁证券有限公司、上海久事公司、深圳市中航投资管理有限公司和山东省国有资产投资控股有限公司,住所地及办公地点均为上海市浦东新区福山路 450 号,注册资本 1 亿元人民币。目前管理十只开放式基金,分别为万家 180 指数证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、万家公用事业行业股票型证券投资基金、万家货币市场证券投资基金、万家和谐增长混合型证券投资基金、万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金、万家精选股票型证券投资基金、万家稳健增利债券型证券投资基金、万家中证红利指数证券投资基金和万家添利分级债券型证券投资基金。

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		
邹昱	本基金基金经理; 万家稳健增利基金经理, 万家添利分级基金基金	2009 年 8 月 4 日	-	5 年	复旦大学硕士,曾在南京银行股份有限公司从事固定收益研究。2008 年 4 月进入本公司,从事固定收益投资研究工作,并担任基金经理助理。

	经理；固定收益部总监				
孙驰	本基金基金经理、万家增强收益基金经理	2011年3月19日	-	4年	复旦大学硕士，2007年7月至2010年4月在中海信托股份有限公司从事固定收益投资研究工作，担任投资经理职务。2010年4月加入万家基金管理有限公司，历任固定收益研究员、基金经理助理。

注：①任职日期以公告为准。

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》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

本基金管理人严格遵守基金合同、《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律、法规和监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金持有人谋取最大利益，没有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

本公司严格遵循公平交易的原则，在投资管理活动中公平对待不同基金品种，无直接或间接在不同投资组合之间进行利益输送的行为，报告期内无异常交易。

公司根据中国证监会发布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，制订和完善了公平交易内部控制制度，通过制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，公司通过对投资交易行为的监控、分析评估来加强对公平交易过程和结果的监督。

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

在本报告期，我公司没有和本基金投资风格相似的其他投资组合品种。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内无异常交易

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

整个上半年，央行货币政策继续紧缩，每月上调一次准备金并每季上调一次存贷款基准利率。资金面整体来看比较紧张，只有在4月份由于公开市场操作天量到期而出现了宽裕局面，在春节前夕以及6季末均出现了8%-9%的回购利率，主要是受到了提高存款准备金的累加效应影响。

本基金在上半年业绩比较稳定。一季度，在资金面紧张之前保留了较多现金头寸，所以即使在基金出现大量的赎回时，也保持了比较好的流动性。当判断市场资金面有缓和迹象时，增持了短期融资券，进行波段操作。二季度虽然已经提前预判到资金面会趋紧，并且减持了债券配置，增加了现金比例，但是对货币基金的赎回规模预估不足，致使在回购利率飙升的时候，现金头寸对基金资产贡献收益相对有限。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值收益率为1.7895%，业绩比较基准收益率为1.5199%

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

基本上看，通胀在经过6月的新高后会逐渐回落，而经济处于去库存阶段，已确定缓慢下行的趋势。央行会在保增长与控通胀之间寻求平衡，预计政策继续紧缩的空间会大大减小。这种判断的风险点就在于通胀回落幅度很小，一直在高位徘徊。

在这种情形下，资金面是下一阶段决定货币市场走势的核心因素。由于下半年公开市场操作到期量比较少，而外汇占款增加量可能不会像上半年那样，预计资金面会处于一个偏紧平衡的状态。

下半年，本基金的操作会更侧重于持有现金类资产，对债券资产的增持会更慎重，除非在期间货币政

策出现转向。只有在资金面紧张的时候,才会适时进行波段操作。由于判断 shibor 利率在中期可能继续在高位徘徊,会继续保持较高的浮息债配置比例。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、参与估值流程各方及人员(或小组)的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

基金管理人

公司成立了估值委员会,定期评价现行估值政策和程序,在发生了影响估值政策和程序有效性及适用性的情况后及时修订估值方法。估值委员会主要由分管基金估值业务的公司领导、督察长、基金估值业务的负责人、监察稽核部负责人、研究发展部负责人等组成。估值委员会的成员均具备专业胜任能力和相关从业资格,精通各自领域的理论知识,熟悉政策法规,并具有丰富的实践经验。

托管银行

托管银行根据法律法规要求履行估值及净值计算等复核和核查的责任。

会计师事务所

会计师事务所对基金管理公司所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。

2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理不参与和决定基金估值。

3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4、已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

本基金管理人与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金每日计算分配收益,按月集中支付。本报告期内本基金应分配利润 54,449,732.92 元,本报告期内本基金已分配利润 54,449,732.92 元。

§ 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

报告期内,本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在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、利润分配等情况的说明

报告期内,基金管理人在基金资产净值计算、利润分配、基金费用开支、投资运作等主要方面,能够遵守有关法律法规,未发现有损害基金份额持有人利益的行为。报告期内,该基金出现了持有的现金、到期日在一年以内的政府债券和央行票据不足基金资产净值 5%的情况。托管人根据有关法律法规规定及法律合同约定对管理人进行了提示,管理人表示将适时调整。

5.3 托管人对本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

托管人认为,由基金管理人编制并经托管人复核的本基金 2011 年半年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、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:万家货币市场证券投资基金

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	13,013,775.23	59,384,098.53
结算备付金		0.00	11,247,272.73
存出保证金		0.00	0.00
交易性金融资产	6.4.7.2	1,204,147,398.69	2,625,209,386.66
其中：股票投资		0.00	0.00
基金投资		-	-
债券投资		1,204,147,398.69	2,625,209,386.66
资产支持证券投资		0.00	0.00
衍生金融资产	6.4.7.3	0.00	0.00
买入返售金融资产	6.4.7.4	423,401,235.10	960,002,280.00
应收证券清算款		0.00	0.00
应收利息	6.4.7.5	19,406,188.62	21,773,687.30
应收股利		0.00	0.00
应收申购款		20,974,306.63	0.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	0.00	0.00
资产总计		1,680,942,904.27	3,677,616,725.22
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		0.00	0.00
交易性金融负债		0.00	0.00
衍生金融负债	6.4.7.3	0.00	0.00
卖出回购金融资产款		209,999,775.00	207,799,458.10
应付证券清算款		0.00	0.00
应付赎回款		2,003.49	300,825.49
应付管理人报酬		720,781.75	1,261,105.17
应付托管费		218,418.65	382,153.08
应付销售服务费		546,046.78	955,382.69
应付交易费用	6.4.7.7	49,754.07	41,503.35
应交税费		47,400.00	47,400.00
应付利息		29,054.79	75,005.04
应付利润		2,977,328.41	3,571,075.40
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	14,064.02	110,000.00
负债合计		214,604,626.96	214,543,908.32
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1,466,338,277.31	3,463,072,816.90

未分配利润	6.4.7.10	0.00	0.00
所有者权益合计		1,466,338,277.31	3,463,072,816.90
负债和所有者权益总计		1,680,942,904.27	3,677,616,725.22

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 1,466,338,277.31 份。

6.2 利润表

会计主体: 万家货币市场证券投资基金

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		66,525,102.96	39,564,738.90
1. 利息收入		63,386,985.38	32,617,900.63
其中: 存款利息收入	6.4.7.11	1,826,298.75	937,010.16
债券利息收入		37,338,718.60	28,384,049.51
资产支持证券利息收入		0.00	0.00
买入返售金融资产收入		24,221,968.03	3,296,840.96
其他利息收入		0.00	0.00
2. 投资收益(损失以“-”填列)		3,108,117.58	6,946,838.27
其中: 股票投资收益		0.00	0.00
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	3,108,117.58	6,946,838.27
资产支持证券投资收益		0.00	0.00
衍生工具收益		0.00	0.00
股利收益		0.00	0.00
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		0.00	0.00
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.13	30,000.00	0.00
减: 二、费用		12,075,370.04	9,910,201.72
1. 管理人报酬		5,317,785.82	4,697,542.31
2. 托管费		1,611,450.16	1,423,497.72
3. 销售服务费		4,028,625.67	3,558,744.17
4. 交易费用	6.4.7.14	0.00	0.00
5. 利息支出		1,092,876.67	157,848.83
其中: 卖出回购金融资产支出		1,092,876.67	157,848.83

6. 其他费用	6.4.7.15	24,631.72	72,568.69
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		54,449,732.92	29,654,537.18
减: 所得税费用		0.00	0.00
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		54,449,732.92	29,654,537.18

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 万家货币市场证券投资基金

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)	3,463,072,816.90	0.00	3,463,072,816.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	0.00	54,449,732.92	54,449,732.92
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)	-1,996,734,539.59	0.00	-1,996,734,539.59
其中: 1. 基金申购款	15,183,625,047.79	0.00	15,183,625,047.79
2. 基金赎回款	-17,180,359,587.38	0.00	-17,180,359,587.38
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)	0.00	-54,449,732.92	-54,449,732.92
五、期末所有者权益(基金净值)	1,466,338,277.31	0.00	1,466,338,277.31
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)	2,223,061,232.51	0.00	2,223,061,232.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	0.00	29,654,537.18	29,654,537.18
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)	969,777,630.56	0.00	969,777,630.56
其中: 1. 基金申购款	14,102,336,890.98	0.00	14,102,336,890.98
2. 基金赎回款	-13,132,559,260.42	0.00	-13,132,559,260.42
四、本期向基金份额持有	0.00	-29,654,537.18	-29,654,537.18

人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	3,192,838,863.07	0.00	3,192,838,863.07

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：

毕玉国 杨峰 陈广益
 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

万家货币市场证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2006]69 号文《关于同意万家货币市场证券投资基金募集的批复》的核准,由万家基金管理有限公司作为发起人向社会公开发行募集,基金合同于 2006 年 5 月 24 日正式生效,首次设立募集规模为 2,437,395,340.44 份基金份额。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万家基金管理有限公司,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为华夏银行股份有限公司。

本基金采取主动式投资管理策略,主要投资于现金、通知存款、1 年以内(含 1 年)的银行定期存款及大额存单;剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券;期限在 1 年以内(含 1 年)的债券回购;期限在 1 年以内(含 1 年)的中央银行票据;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货币市场工具。对于法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金在力保本金稳妥和基金资产高流动性的基础上,为投资者提供资金的流动性储备,并追求高于业绩比较基准的稳定收益。本基金的业绩比较基准为:一年期银行定期存款税后利率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则-基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释、以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《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》、《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 2 号《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》、证监会公告[2010]5 号关于发布《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>》及其他中国证监会颁布的相关规定而编制。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2011 年 6 月 30 日的财务状况以及 2011 年 1 月 1 日至 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

本半年度报告所采用的会计政策、会计估计与上年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错。

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	13,013,775.23
定期存款	0.00
其中：存款期限 1-3 个月	0.00
其他存款	0.00
合计	13,013,775.23

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	0.00	0.00	0.00	0.0000%
	银行间市场	1,204,147,398.69	1,202,793,000.00	-1,354,398.69	-0.0924%
	合计	1,204,147,398.69	1,202,793,000.00	-1,354,398.69	-0.0924%

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告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
银行间市场买入返售金融资产	423,401,235.10	0.00

合计	423,401,235.10	0.00
----	----------------	------

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无

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	2,606.48
应收定期存款利息	0.00
应收其他存款利息	0.00
应收结算备付金利息	0.00
应收债券利息	17,971,591.46
应收买入返售证券利息	1,431,990.68
应收申购款利息	0.00
其他	0.00
合计	19,406,188.62

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
其他应收款	0.00
待摊费用	0.00
合计	0.00

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	0.00
银行间市场应付交易费用	49,754.07
合计	49,754.07

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	0.00
应付赎回费	0.00
预提审计费	14,062.32
其他应付款	1.70
合计	14,064.02

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	3,463,072,816.90	3,463,072,816.90
本期申购	15,183,625,047.79	15,183,625,047.79
本期赎回（以“-”号填列）	-17,180,359,587.38	-17,180,359,587.38
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,466,338,277.31	1,466,338,277.31

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	0.00	0.00	0.00
本期利润	54,449,732.92	0.00	54,449,732.92
本期基金份额交易产生的变动数	0.00	0.00	0.00
其中：基金申购款	0.00	0.00	0.00
基金赎回款	0.00	0.00	0.00
本期已分配利润	-54,449,732.92	0.00	-54,449,732.92
本期末	0.00	0.00	0.00

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	116,950.04
定期存款利息收入	1,675,942.19
其他存款利息收入	0.00
结算备付金利息收入	33,406.52
其他	0.00
合计	1,826,298.75

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	5,474,494,193.78

总额	
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	5,437,639,669.35
减：应收利息总额	33,746,406.85
债券投资收益	3,108,117.58

6.4.7.13 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
基金赎回费收入	0.00
债券分销手续费	30,000.00
合计	30,000.00

6.4.7.14 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
交易所市场交易费用	0.00
银行间市场交易费用	0.00
合计	0.00

6.4.7.15 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	14,062.32
信息披露费	0.00
银行费用	1,204.40
账户维护费	9,000.00
其他	365.00
合计	24,631.72

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

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

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

无

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
万家基金管理有限公司	基金管理人, 发起人, 基金销售机构

华夏银行股份有限公司	基金托管人，基金代销机构
齐鲁证券有限公司	基金管理人股东，基金代销机构

注：以下关联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

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交易。

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	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	5,317,785.82	4,697,542.31
其中：支付销售机构的客户维护费	1,563,313.57	1,860,507.35

注：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：

$$H = E \times 0.33\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费在基金合同生效后每日计提，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 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	1,611,450.16	1,423,497.72

注：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：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费在基金合同生效后每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

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
万家基金管理有限公司	1,193,619.20
华夏银行股份有限公司	275,935.10
齐鲁证券有限公司	0.00
合计	1,469,554.30
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
万家基金管理有限公司	1,060,886.67
华夏银行股份有限公司	190,133.85
齐鲁证券有限公司	26,682.14
合计	1,277,702.66

注：基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售、服务等各项费用，由基金管理人支配使用。本基金销售服务费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计算。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人支付给各代销机构，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金

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

本报告期及上年度可比期间除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金

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		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
华夏银行股份有限 公司	13,013,775.23	116,950.04	15,337,264.20	420,183.27

注：本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，2011 年 1 月 1 日至 6 月 30 日获得的利息为人民币 33,406.52 元(2010 年 1 月 1 日至 6 月 30 日为人民币 441,826.92 元)，2011 年 6 月 30 日结算备付金余额为人民币 0.00 元(2010 年 6 月 30 日余额为人民币 4,131,000.00 元)。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均不存在在承销期内直接购入关联方所承销证券的情况。

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
39,533,059.40	15,510,420.51	-593,746.99	54,449,732.92	-

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

本报告期末，本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

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 209, 999, 775.00 元, 是以如下债券作为质押:

金额单位: 人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
090213	09 国开 13	2011-07-01	101.76	2, 100, 000	213, 691, 928.58
合计				2, 100, 000	213, 691, 928.58

6.4.12.2.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末, 本基金无交易所市场正回购余额。

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政策和程序来识别及分析这些风险, 并设定适当的风险限额及内部控制流程, 通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人将风险管理融入各业务层面, 建立了三道防线: 以各岗位目标责任制为基础, 形成第一道防线; 通过相关部门、相关岗位之间相互监督制衡, 形成第二道防线; 由监察稽核部门、督察长对各岗位、各部门、各机构、各项业务实施监督反馈, 形成第三道防线。

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债券、国债、央行票据等, 且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行, 申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外, 在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算, 因此违约风险发生的可能性很小; 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。

根据本基金的信用风险控制要求, 本基金投资的短期融资券的信用评级, 不低于以下标准:

- 1) 国内信用评级机构评定的 A-1 级或相当于 A-1 级的短期信用级别;
- 2) 根据有关规定予以豁免信用评级的短期融资券, 其发行人最近三年的信用评级和跟踪评级具备下列条件之一:
 - A. 国内信用评级机构评定的 AAA 级或相当于 AAA 级的长期信用级别;
 - B. 国际信用评级机构评定的低于中国主权评级一个级别的信用级别。

同一发行人同时具有国内信用评级和国际信用评级的, 以国内信用级别为准。

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	760, 184, 577.21	1, 324, 922, 336.53
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	760, 184, 577.21	1, 324, 922, 336.53

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	199,743,474.53	310,045,379.44
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	244,219,346.95	990,241,670.69
合计	443,962,821.48	1,300,287,050.13

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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。

本基金所持大部分证券为剩余期限较短、信誉良好的国债、企业债及央行票据等,除在证券交易所的债券回购交易,其余均在银行间同业市场交易,因此,本年末本基金的资产均能及时变现。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。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求,并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求,对流动性指标进行持续的监测和分析。

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所处市场各类价格因素的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

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间市场交易的固定收益品种,以摊余成本计价,并通过“影子定价”机制使按摊余成本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。

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	1个月以内	1-3 个月	3个月 -1年	1-5年	5年以 上	不计息	合计
资产							
银行 存款	13,013,775.23	-	-	-	-	-	13,013,775.23
结 算 备 付 金	-	-	-	-	-	-	-
存 出 保 证 金	-	-	-	-	-	-	-
债 券 投 资	334,446,693.52	110,085,292.85	759,615,412.32	-	-	-	1,204,147,398.69

买入 返售 金融 资产	150,000,465.00	100,000,270.00	173,400,500.10	-	-	-	423,401,235.10
应收 证券 清算 款	-	-	-	-	-	-	-
应收 利息	-	-	-	-	-	19,406,188.62	19,406,188.62
应收 申购 款	-	-	-	-	-	20,974,306.63	20,974,306.63
资产 总计	497,460,933.75	210,085,562.85	933,015,912.42	-	-	40,380,495.25	1,680,942,904.27
负债							
卖出 回购 金融 资产 款	209,999,775.00	-	-	-	-	-	209,999,775.00
应付 证券 清算 款	-	-	-	-	-	-	-
应付 赎回 款	-	-	-	-	-	2,003.49	2,003.49
应付 管理 人报 酬	-	-	-	-	-	720,781.75	720,781.75
应付 托管 费	-	-	-	-	-	218,418.65	218,418.65
应付 销售 服务 费	-	-	-	-	-	546,046.78	546,046.78
应付 交易 费用	-	-	-	-	-	49,754.07	49,754.07
应交 税费	-	-	-	-	-	47,400.00	47,400.00

应付利息	-	-	-	-	-	29,054.79	29,054.79
应付利润	-	-	-	-	-	2,977,328.41	2,977,328.41
其他负债	-	-	-	-	-	14,064.02	14,064.02
负债总计	209,999,775.00	-	-	-	-	4,604,851.96	214,604,626.96
利率敏感度缺口	287,461,158.75	210,085,562.85	933,015,912.42	-	-	35,775,643.29	1,466,338,277.31
上年度末 2010 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月 -1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	9,384,098.53	50,000,000.00	-	-	-	-	59,384,098.53
结算备付金	11,247,272.73	-	-	-	-	-	11,247,272.73
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
债券投资	940,106,371.46	350,239,677.36	1,334,863,337.84	-	-	-	2,625,209,386.66
买入返售金融资产	460,001,330.00	-	500,000,950.00	-	-	-	960,002,280.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	21,773,687.30	21,773,687.30
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-

资产总计	1,420,739,072.72	400,239,677.36	1,834,864,287.84	-	-	21,773,687.30	3,677,616,725.22
负债							
卖出回购金融资产款	207,799,458.10	-	-	-	-	-	207,799,458.10
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	300,825.49	300,825.49
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,261,105.17	1,261,105.17
应付托管费	-	-	-	-	-	382,153.08	382,153.08
应付销售服务费	-	-	-	-	-	955,382.69	955,382.69
应付交易费用	-	-	-	-	-	41,503.35	41,503.35
应交税费	-	-	-	-	-	47,400.00	47,400.00
应付利息	-	-	-	-	-	75,005.04	75,005.04
应付利润	-	-	-	-	-	3,571,075.40	3,571,075.40
其他负债	-	-	-	-	-	110,000.00	110,000.00
负债总计	207,799,458.10	-	-	-	-	6,744,450.22	214,543,908.32
利率敏感度缺口	1,212,939,614.62	400,239,677.36	1,834,864,287.84	-	-	15,029,237.08	3,463,072,816.90

注:表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值,其中交易性债券工具以摊余成本近似反映

其公允价值, 并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况;		
	2. 该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点, 且除利率之外的其他市场变量保持不变;		
	3. 该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动;		
	4. 银行存款和结算备付金均以活期存款利率计息, 假定利率变动仅影响该类资产的未来收益, 而对其本身的公允价值无重大影响。		
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)
	基准利率增加 0.25%	-2,167,900.00	-2,306,100.00
	基准利率减少 0.25%	2,306,700.00	2,496,200.00

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, 因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格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除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种和证券交易所的债券回购产品, 且以摊余成本法进行后续计量, 因此无重大市场价格风险。

§ 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	1,204,147,398.69	71.64
	其中: 债券	1,204,147,398.69	71.64
	资产支持证券	0.00	0.00
2	买入返售金融资产	423,401,235.10	25.19
	其中: 买断式回购的买入返售金融资产	0.00	0.00
3	银行存款和结算备付金合计	13,013,775.23	0.77
4	其他各项资产	40,380,495.25	2.40
5	合计	1,680,942,904.27	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	3.00

	余额		
	其中：买断式回购融资		0.00
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	209,999,775.00	14.32
	其中：买断式回购融资	0.00	0.00

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%说明

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基金资产净值的 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	119
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	149
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	73

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	33.93	14.32
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	16.66	0.00
2	30 天(含)—60 天	0.00	0.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.00	0.00
3	60 天(含)—90 天	10.24	0.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.00	0.00
4	90 天(含)—180 天	47.93	0.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.00	0.00
5	180 天(含)—397 天（含）	19.79	0.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.00	0.00
	合计	111.89	14.32

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	0.00	0.00
2	央行票据	0.00	0.00
3	金融债券	443,962,821.48	30.28
	其中：政策性金融债	244,219,346.95	16.66
4	企业债券	0.00	0.00
5	企业短期融资券	760,184,577.21	51.84
6	中期票据	0.00	0.00
7	其他	0.00	0.00
8	合计	1,204,147,398.69	82.12
9	剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债券	244,219,346.95	16.66

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	090213	09 国开 13	2,400,000	244,219,346.95	16.66
2	018001	01 中信债	2,000,000	199,743,474.53	13.62
3	1081355	10 粤温氏 CP01	700,000	69,930,129.11	4.77
4	1081334	10 苏恒力 CP01	600,000	60,000,000.00	4.09
5	1081290	10 方大 CP01	500,000	50,085,292.85	3.42
6	1081353	10 奥克斯 CP01	500,000	50,077,402.76	3.42
7	1181246	11 华侨城 CP02	500,000	50,015,542.79	3.41
8	1181087	11 丝绸 CP01	500,000	50,000,000.00	3.41
9	1081380	10 瑞水泥 CP01	500,000	49,926,299.70	3.40
10	1081349	10 渝涪高 CP01	400,000	39,896,853.30	2.72

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	0
报告期内偏离度的最高值	0.2236%
报告期内偏离度的最低值	-0.0930%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1035%

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，按照票面利率或协议利率每日计提利息，并考虑其买入时的溢价和折价在其剩余期限内摊销，每日计提损益。

本基金通过每日分红使基金份额净值维持在 1.00 元。

7.8.2 本基金本报告期内未发生持有剩余期限小于 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 本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的,在报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、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	0.00
2	应收证券清算款	0.00
3	应收利息	19,406,188.62
4	应收申购款	20,974,306.63
5	其他应收款	0.00
6	待摊费用	0.00
7	其他	0.00
8	合计	40,380,495.25

§ 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
17,414	84,204.56	262,669,004.67	17.91%	1,203,669,272.64	82.09%

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	1,174,286.33	0.08%

§ 9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2006年5月24日)基金份额总额	2,437,395,340.44
本报告期期初基金份额总额	3,463,072,816.90
本报告期基金总申购份额	15,183,625,047.79
减:本报告期基金总赎回份额	17,180,359,587.38
本报告期基金拆分变动份额	-

本报告期末基金份额总额	1,466,338,277.31
-------------	------------------

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

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

2011 年 1 月 29 日基金管理人在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》发布“万家基金管理有限公司关于公司董事变更的公告”，选举毕玉国、杨峰、陈晓龙、魏颖晖、刘兴云、蔡荣生、邓辉为万家基金管理有限公司第三届董事会董事，其中刘兴云、蔡荣生、邓辉为第三届董事会独立董事。

2011 年 3 月 4 日基金管理人在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》发布“万家基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告”，毕玉国先生担任公司董事长职务，孙国茂先生不再担任公司董事长职务；杨峰先生担任公司总经理职务，李振伟先生不再担任总经理职务。

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期末改聘会计师事务所。

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

本报告期管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

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	债券交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期债券成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中航证券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-

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

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
中航证券	4,542,900,000.00	100.00%

注：1、基金专用交易席位的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息；

能根据公司所管理基金的特定要求, 提供专门研究报告, 具有开发量化投资组合模型的能力; 能积极为公司投资业务的开展, 投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下:

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构;
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

3、报告期内基金租用证券公司交易单元的变更情况:

无

10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况

本基金本报告期内无偏离度绝对值超过 0.5%(含) 的情况

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件名称

- 1、中国证监会批准万家货币市场证券投资基金发行及募集的文件。
- 2、《万家货币市场证券投资基金基金合同》。
- 3、《万家货币市场证券投资基金托管协议》。
- 4、万家基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程。
- 5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的基金净值、季度报告、更新招募说明书及其他临时公告。
- 6、万家货币市场证券投资基金 2011 年半年度报告原文。

11.2 备查文件存放地点

上海市浦东新区福山路 450 号新天国际大厦 23 楼

11.3 备查文件查阅方式

网址: <<http://www.wjassset.com>>

万家基金管理有限公司
2011 年 8 月 26 日