

华富货币市场基金 2012 年半年度报告摘要

2012 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：2012 年 8 月 28 日

§ 1 重要提示

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 2012 年 8 月 27 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 2012 年 1 月 1 日起至 2012 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	1,744,824,738.92 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(2012年1月1日 - 2012年6月30日)
本期已实现收益	38,729,600.53
本期利润	38,729,600.53
本期净值收益率	2.3629%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2012年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-
期末基金资产净值	1,744,824,738.92
期末基金份额净值	1.0000

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

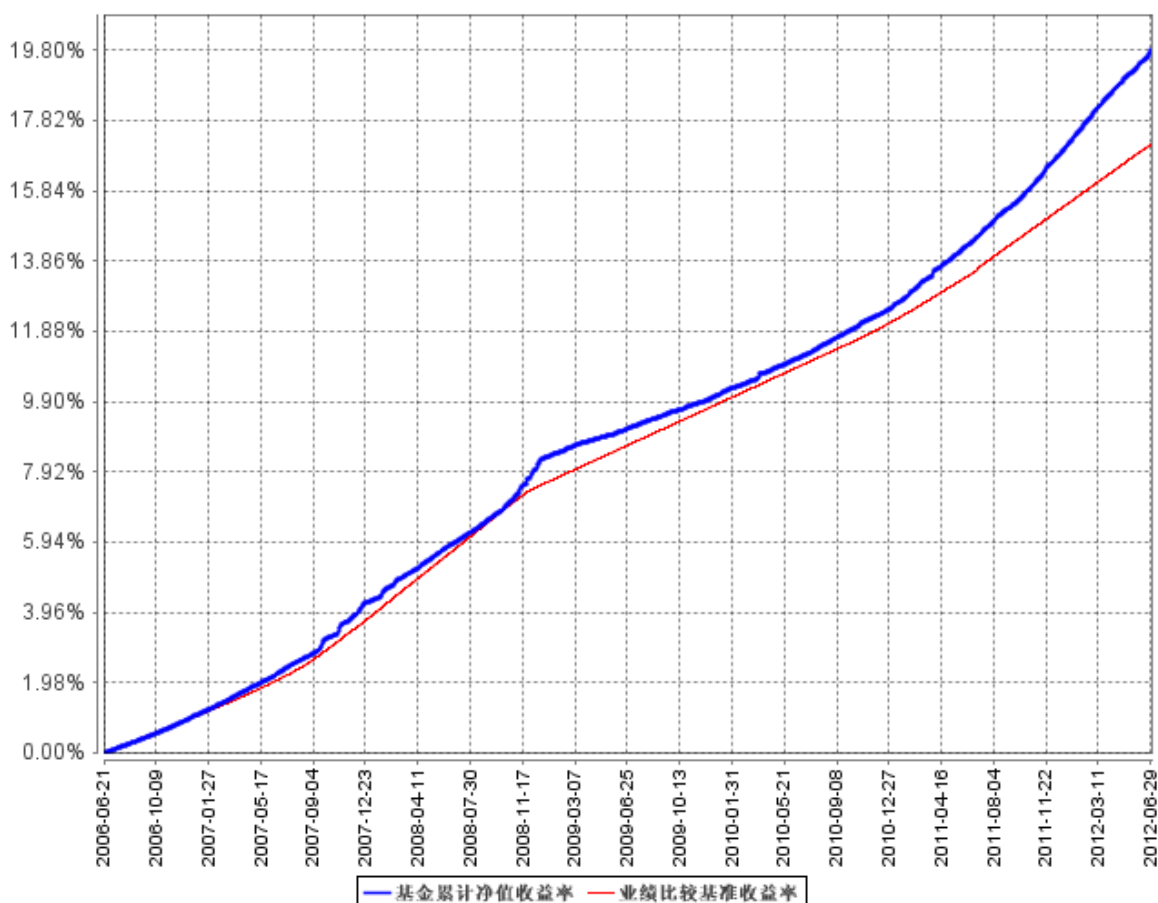
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.4126%	0.0108%	0.2719%	0.0003%	0.1407%	0.0105%
过去三月	1.1004%	0.0073%	0.8568%	0.0003%	0.2436%	0.0070%
过去六月	2.3629%	0.0063%	1.7295%	0.0002%	0.6334%	0.0061%
过去一年	4.6023%	0.0056%	3.4897%	0.0002%	1.1126%	0.0054%
过去三年	9.7488%	0.0065%	8.4479%	0.0015%	1.3009%	0.0050%

自基金合同生效起至今	19.8068%	0.0072%	17.1475%	0.0019%	2.6593%	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 2012 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、华富量子生命力股票型证券投资基金和华富中小板指数增强型证券投资基金十只基金。

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	华富货币市场基金基金经理、华富收益增强债券基金基金经理、公司固定收益部副总监	2009 年 10 月 19 日	-	八年	中南财经政法大学经济学学士、本科学历，曾任珠海市商业银行资金营运部交易员，从事债券研究及债券交易工作，2006 年 11 月加入华富基金管理有限公司，历任债券交易员、华富货币市场基金基金经理助理，现任华富基金管理有限公司固定收益部副总监、投资决策委员会成员、华富货币市场基金基金经理、华富收益增强债券型证券投资基金基金经理。

注：任职日期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遵规守信情况的说明

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

本基金管理人根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法规要求，结合实际情况，制定了《华富基金管理有限公司公平交易管理制度》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节全部

纳入公平交易管理中，实行事前控制、事中监控、事后分析反馈的流程化管理。在制度和流程上确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本基金报告期内不存在参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

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，受制于欧洲债务危机以及美国经济的增长乏力，国内出口增速大幅下滑；固定资产投资增速受到房地产投资继续回落拖累，同比增速亦放缓至 20.4%。受此影响，上半年 GDP 同比增长 7.8%，国内经济增速仍处于下台阶的过程中。随着经济以及通胀的回落，货币政策预调微调力度进一步加强，上半年央行两次下调存款准备金率以及采取不对称降息和增加存款上浮区间的方式推进存款利率市场化改革，都为后续利率调整的方式和幅度打开了空间，预计后续货币政策宽松力度将延续，甚至加大。

上半年在流动性改善，降准、降息等利好下，债券市场继续演绎牛市行情。其中，信用债在需求推动下，信用利差收窄，收益率大幅下降，AA、AA- 级别 CP 收益率下降 200BP 左右，1 年期央票利率亦大幅回落 80BP 至 2.6% 左右。

上半年本基金根据对短期市场利率走势的判断以及货币基金季度末申购赎回规律，在加强流动性管理的前提下增加了中低等级短期融资券的配置，并提高了协议存款的配置比例和存款期限，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 2.3626%，期间业绩比较基准 1.7295%，期间年化收益率 4.6920%。

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，全球宏观政策预期放松，经济增长乏力，伴随降息周期的启动以及存款准备金率下调后流动性的持续改善，都为债市整体提供较为有利的投资环境。货币基金投资品种中短融仍将是未来重点配置品种，并逐步关注 shibor 浮息债的投资价值。

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 38,729,600.53 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，本基金实施利润分配的金额为 38,729,600.53 元。

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

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：2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	521,658,635.43	357,137,640.03
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	772,249,187.26	694,745,158.77
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		772,249,187.26	694,745,158.77
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	436,301,716.95	29,970,164.96
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	14,531,468.46	11,001,472.84
应收股利		-	-
应收申购款		3,994,231.56	3,200.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,748,735,239.66	1,092,857,636.60
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 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		627,738.83	350,918.10
应付托管费		190,223.89	106,338.84
应付销售服务费		475,559.73	265,847.13
应付交易费用	6.4.7.7	41,259.02	20,628.37
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		2,462,181.07	918,189.18
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	113,538.20	216,000.00
负债合计		3,910,500.74	1,877,921.62
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1,744,824,738.92	1,090,979,714.98
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		1,744,824,738.92	1,090,979,714.98
负债和所有者权益总计		1,748,735,239.66	1,092,857,636.60

注：报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.00 元，基金份额总额 1,744,824,738.92 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：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
一、收入		44,659,869.32	22,074,615.62
1.利息收入		38,370,942.21	19,712,209.35
其中：存款利息收入	6.4.7.11	15,626,693.58	2,884,282.14
债券利息收入		17,310,855.54	11,168,267.60
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		5,433,393.09	5,659,659.61
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		6,288,827.11	2,362,306.27
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	6,288,827.11	2,362,306.27
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	100.00
减：二、费用		5,930,268.79	3,985,850.31
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,796,657.23	1,742,917.10
2. 托管费	6.4.10.2.2	847,471.87	528,156.75
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	2,118,679.71	1,320,391.60
4. 交易费用	6.4.7.19	-	-
5. 利息支出		19,199.77	261,143.31
其中：卖出回购金融资产支出		19,199.77	261,143.31
6. 其他费用	6.4.7.20	148,260.21	133,241.55
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		38,729,600.53	18,088,765.31
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		38,729,600.53	18,088,765.31

注：后附报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：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 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）	1,090,979,714.98	-	1,090,979,714.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	38,729,600.53	38,729,600.53
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）	653,845,023.94	-	653,845,023.94
其中：1.基金申购款	4,126,987,275.06	-	4,126,987,275.06

2. 基金赎回款	-3, 473, 142, 251. 12	-	-3, 473, 142, 251. 12
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）	-	-38, 729, 600. 53	-38, 729, 600. 53
五、期末所有者权益（基金净值）	1, 744, 824, 738. 92	-	1, 744, 824, 738. 92
项目	上年度可比期间 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）	648, 008, 615. 97	-	648, 008, 615. 97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	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

注：后附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：

章宏韬

姚怀然

陈大毅

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

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 2012 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 2012 年 6 月 30 日的财务状况以及 2012 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，继续免征收营业税。

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 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 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	220,000,000.00	100.00%	355,000,000.00	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 2012 年 1 月 1 日至 2012 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	29,835.26	100.00%	29,835.26	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 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%
----------------	-----------	---------	-----------	---------

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 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,796,657.23	1,742,917.10
其中：支付销售机构的客户维护费	187,504.95	181,893.25

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：

日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.33% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	847,471.87	528,156.75

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：

日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.1% / 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 2012 年 1 月 1 日至 2012 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）	1,157,336.50
中国建设银行（托管人）	436,186.88
华安证券有限责任公司（管理人股东）	772.06

合计	1,594,295.44
获得销售服务费 各关联方名称	上年度可比期间 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

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：

日基金销售服务费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 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 2012 年 1 月 1 日至 2012 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	-	-	-	-	139,000,000.00	16,680.82
上年度可比期间 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

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 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
华安证券有限责任 公司	102,387,387.00	5.87%	100,076,072.57	9.17%

注：关联方投资本基金的费率按照基金合同及招募说明书的规定确定，符合公允性要求。

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 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 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	1,658,635.43	50,267.06	323,874.11	64,393.93

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（2012 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	772,249,187.26	44.16
	其中：债券	772,249,187.26	44.16
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	436,301,716.95	24.95
	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	521,658,635.43	29.83

4	其他各项资产	18,525,700.02	1.06
5	合计	1,748,735,239.66	100.00

注：本表列示的其他各项资产详见 7.8.4 期末其他各项资产构成。

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	0.11	
	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	114
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	152
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	35.16	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	4.33	-
2	30 天(含)—60 天	14.90	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.57	-

3	60 天(含)—90 天	9.46	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—180 天	16.10	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	180 天(含)—397 天（含）	23.55	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		99.16	-

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	90,496,309.11	5.19
	其中：政策性金融债	90,496,309.11	5.19
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	681,752,878.15	39.07
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	772,249,187.26	44.26
9	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	85,497,289.40	4.90

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	600,000	60,560,659.70	3.47
2	041269013	12 西子 CP001	600,000	60,132,779.94	3.45
3	041258033	12 均瑶 CP001	600,000	60,000,000.00	3.44
4	041164012	11 农六师 CP001	400,000	40,206,243.12	2.30
5	041264011	12 兵团建工 CP001	400,000	40,046,757.37	2.30

6	041254011	12 北大荒 CP001	400,000	40,010,485.11	2.29
7	041267001	12 渝涪高 CP001	300,000	30,124,040.50	1.73
8	041260003	12 闽交运 CP001	300,000	30,012,695.35	1.72
9	041162015	11 沪强生 CP001	300,000	30,000,664.08	1.72
10	041260015	12 天生港 CP001	300,000	30,000,620.38	1.72

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	120
报告期内偏离度的最高值	0.4638%
报告期内偏离度的最低值	0.2203%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.3662%

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 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	14,531,468.46
4	应收申购款	3,994,231.56
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	18,525,700.02

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
5,793	301,195.36	1,258,407,737.57	72.12%	486,417,001.35	27.88%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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基金	202,309.85	0.0116%

注：本报告期末基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人、本基金的基金经理未持有本基金份额。

§ 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	1,090,979,714.98
本报告期基金总申购份额	4,126,987,275.06
减：本报告期基金总赎回份额	3,473,142,251.12
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,744,824,738.92

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，因个人原因，崔健先生不再担任华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务，聘任陈德义担任该基金基金经理。

2、经华富基金管理有限公司第三届董事会第十三次会议（临时会议）书面审议通过，因个人原因，邹牧先生不再担任华富基金管理有限公司副总经理。

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

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	股票交易	应支付该券商的佣金

	交易单元 数量	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	备注
华安证券	1	-	-	-	-	-

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没有发生变更。

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。

10.7.2 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	-	-	220,000,000.00	100.00%	-	-

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

2012年1月16日，托管人中国建设银行股份有限公司发布关于董事长任职的公告，自2012年1月16日起，王洪章先生就任本行董事长、执行董事。