

汇添富货币市场基金 2012 年半年度报告摘要

2012 年 6 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2012 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 6 月 30 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	汇添富货币	
基金主代码	519518	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2006 年 3 月 23 日	
基金管理人	汇添富基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	4,143,949,031.50 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	汇添富货币 A	汇添富货币 B
下属分级基金的交易代码:	519518	519517
报告期末下属分基基金的份额总额	1,247,921,330.92 份	2,896,027,700.58 份

2.2 基金产品说明

投资目标	力求本金稳妥和基金资产高流动性的前提下,追求超过业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金将结合宏观分析和微观分析制定投资策略,力求在满足安全性、流动性需要的基础上实现更高的收益率。
业绩比较基准	税后活期存款利率(即活期存款利率 $\times$ (1-利息税率))。
风险收益特征	本货币市场基金是具有较低风险、中低收益、流动性强的证券投资基金品种。

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		汇添富基金管理有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李文	周倩芝
	联系电话	021-28932888	021-61618888
	电子邮箱	service@99fund.com	zhouqz@spdb.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	95528
传真		021-28932998	021-63602540

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	www.99fund.com
基金半年度报告报告备置地点	上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 层汇添富基金管理有限公司

§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

基金级别	汇添富货币 A	汇添富货币 B
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)	报告期(2012 年 1 月 1 日 - 2012 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	27,139,514.99	95,539,179.37
本期利润	27,139,514.99	95,539,179.37
本期净值收益率	2.28%	2.40%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2012 年 6 月 30 日)	
期末基金资产净值	1,247,921,330.92	2,896,027,700.58
期末基金份额净值	1.0000	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。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。

2、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(例如：基金的申购赎回费等)，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、本基金收益分配按月结转份额。

3.2 基金表现

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

汇添富货币 A

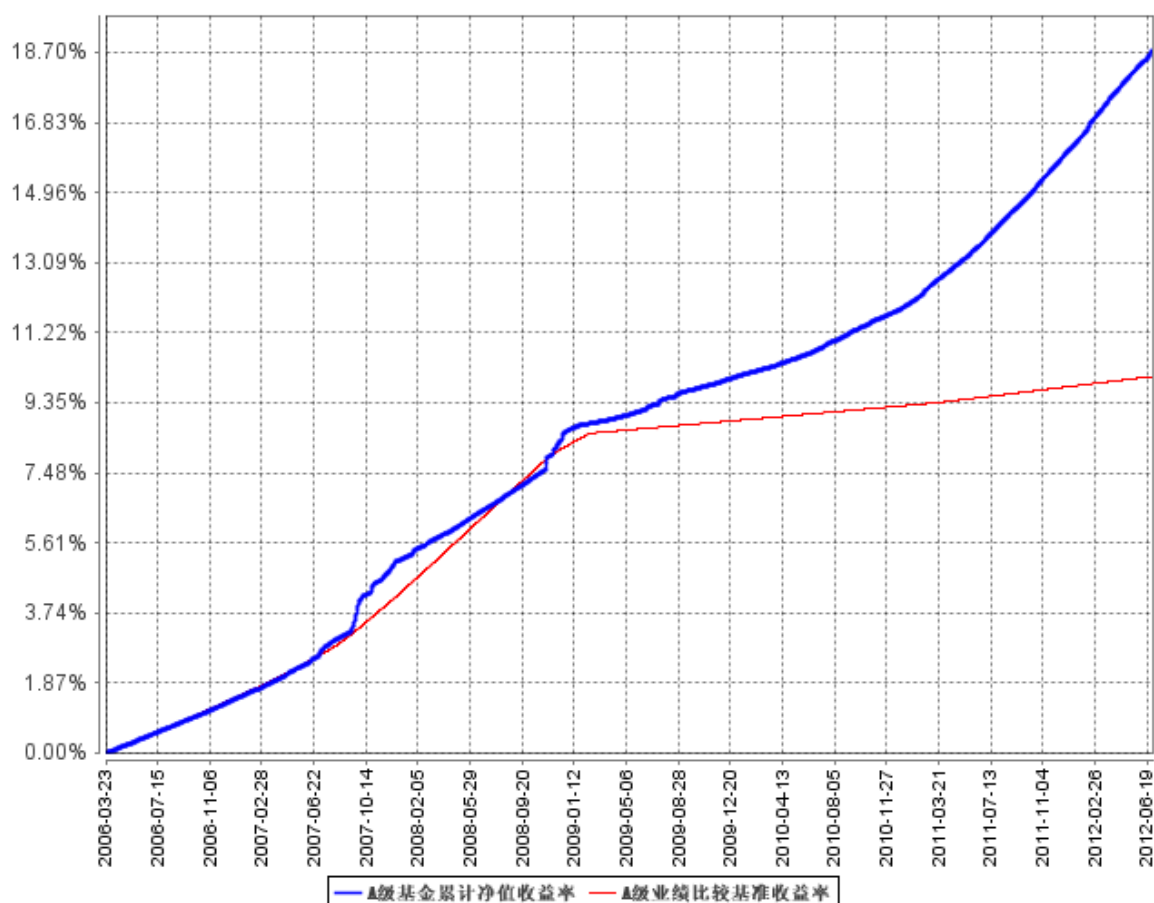
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.3561%	0.0071%	0.0347%	0.0001%	0.3214%	0.0070%
过去三个月	1.0533%	0.0045%	0.1180%	0.0001%	0.9353%	0.0044%
过去六个月	2.2817%	0.0062%	0.2423%	0.0001%	2.0394%	0.0061%
过去一年	4.4469%	0.0046%	0.4950%	0.0001%	3.9519%	0.0045%
过去三年	8.6628%	0.0054%	1.2592%	0.0002%	7.4036%	0.0052%
自基金合同生效日起至 今	18.7353%	0.0081%	10.0496%	0.0037%	8.6857%	0.0044%

汇添富货币 B

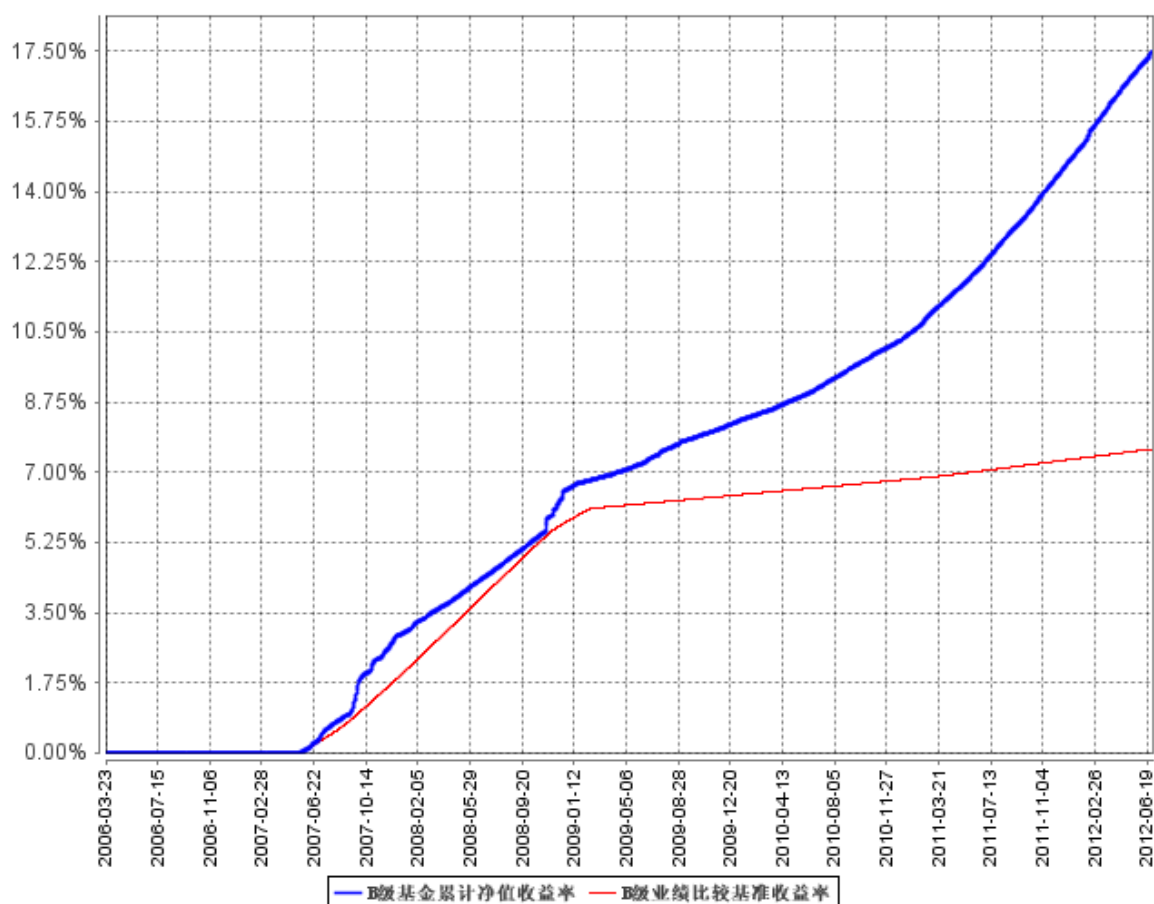
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.3758%	0.0071%	0.0347%	0.0001%	0.3411%	0.0070%
过去三个月	1.1135%	0.0045%	0.1180%	0.0001%	0.9955%	0.0044%
过去六个月	2.4034%	0.0062%	0.2423%	0.0001%	2.1611%	0.0061%
过去一年	4.6968%	0.0046%	0.4950%	0.0001%	4.2018%	0.0045%
过去三年	9.4460%	0.0054%	1.2592%	0.0002%	8.1868%	0.0052%
自基金合同 生效日起至 今	17.5053%	0.0087%	7.5800%	0.0041%	9.9253%	0.0046%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

A级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



B级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：本基金建仓期为自《基金合同》生效之日（2006 年 3 月 23 日）起 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 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

汇添富基金管理有限公司由东方证券股份有限公司、文汇新民联合报业集团、东航金控控股有限公司共同发起设立，经中国证监会证监基金字（2005）5 号文批准，于 2005 年 2 月 3 日正式成立，注册资本为 1 亿元人民币。截止到 2012 年 6 月 30 日，公司管理证券投资基金规模达到 803.69 亿元，基金份额持有人户数近 200 万，资产管理规模在行业内名列前茅。公司管理 22 只开放式证券投资基金，包括汇添富优势精选混合型证券投资基金、汇添富货币市场基金（A 级、B 级）、汇添富均衡增长股票型证券投资基金、汇添富成长焦点股票型证券投资基金、汇添富增强收益债券型证券投资基金、汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金、汇添富价值精选股票型证券投资基金、汇添富上证综合指数证券投资基金、汇添富策略回报股票型证券投资基金、汇添富民营活力股票型证券投资基金、汇添

富亚洲澳洲成熟市场（除日本外）优势精选股票型证券投资基金、汇添富医疗保健股票型证券投资基金、汇添富保本混合型证券投资基金、汇添富社会责任股票型证券投资基金、汇添富可转换债券债券型证券投资基金、汇添富黄金及贵金属证券投资基金（LOF）、深证 300 交易型开放式指数证券投资基金、汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、汇添富信用债债券型证券投资基金、汇添富逆向投资股票型证券投资基金、汇添富理财 30 天债券型证券投资基金、汇添富理财 60 天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		
王珏池	本基金的基金经理、汇添富可转换债券债券型证券投资基金的基金经理、汇添富信用债债券型证券投资基金的基金经理。	2006 年 3 月 23 日	-	18 年	国籍：中国。学历：澳门科技大学管理学硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任申银万国证券股份有限公司固定收益总部投资部经理。2005 年 4 月加入汇添富基金管理有限公司任交易主管，2006 年 3 月 23 日至今任汇添富货币市场基金的基金经理，2008 年 3 月 6 日至 2011 年 6

					月 21 日任汇添富增强收益债券型证券投资基金的基金经理，2011 年 6 月 17 日至今任汇添富可转换债券债券型证券投资基金的基金经理，2011 年 12 月 20 日至今任汇添富信用债债券型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离职日期”为根据公司决议确定的解聘日期；

2、非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

3、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

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为，本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

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

本基金管理人高度重视投资者利益保护，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》等法规，借鉴国际经验，建立了健全、有效的公平交易制度体系，形成涵盖各投资组合、各投资市场、各投资标的，并贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节的公平交易机制。

本报告期内，基金管理人公平交易制度和公平交易机制实现了流程优化和进一步系统化，确保全程嵌入式风险控制体系的有效运行，包括投资独立决策、研究公平分享、集中交易公平执行、交易严密监控和报告及时分析等在内的公平交易各环节执行情况良好。

本报告期内，通过投资交易监控、交易数据分析以及专项稽核检查，本基金管理人未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金管理人对投资交易全过程实施了严格的监控、分析和检查，未发现任何异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年经济呈现“低增长，低通胀”态势，整体经济数据偏弱。外需方面，美国和欧洲两大经济体经济增长回落：美国一季度经济拉动力的暖冬与补库存因素在二季度消散，就业情况改善不佳，复苏之路坎坷，欧元区经济在欧债危机阴影笼罩下持续低迷，我国的出口增速在上半年维持低位。内需方面，去年以来偏紧的信贷环境与房地产等行业高库存状况，使经济内生性的进入去杠杆阶段，内需增速放缓。上半年国内通货膨胀在经历了一季度的反复之后开始大幅降低，蔬菜与猪肉价格回落明显，经济增速回落与货币增速放缓、大宗商品价格大幅下跌这三个因素带动非食品通胀回到 10 年上半年的低位。CPI、PPI 持续走低，工业增加值缺口继续扩大，这些迹象都表明经济运行于潜在增长率之下。二季度货币市场整体维持相对宽松的格局，这与商业银行体系“宽货币，弱信贷”的现状一致，货币市场流动性仅在半年末因商业银行考核而出现了阶段性的紧张。5 月份的降准和六月份的降息彻底扭转了之前持续将近一年的货币市场资金较为紧张的局面，上半年银行间平均隔夜回购利率为 3.02%，平均七天回购利率 3.64%，均达到 2010 年末以来的最低值。本基金在报告期内配置了较多的短期融资券和银行同业存款，随着货币市场利率的逐级走低，投资短期融资券带来的高票息和资本利得较好地提升了组合的收益，同时本基金较大比例地投资银行同业存款，也获得了理想的效果。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内本基金 A 级净值收益率为 2.2817%，B 级净值收益率为 2.4034%，同期业绩比较基准收益率为 0.2423%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为下半年央行货币政策仍将保持宽松。一方面，在通过降息、降准降低银行放贷成本的基础上，积极推进利率市场化改革，提高银行业竞争水平，促使银行贷款向收益率水平较高的中小企业

倾斜，另外一方面，大力推进债券市场发展，提高企业发债能力和发债速度，一些有规模、有信誉的企业通过市场化手段获取所需要的资金，减少了信贷的需求。总体而言，货币市场处于资金日渐宽松，债券大量发行的阶段。本基金将利用这一有利时机，选择理想投资品种进行配置，保持较长的组合剩余期限，以期获得理想收益。

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同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，并由投资研究部、产品创新部、基金营运部和稽核监察部人员及基金经理等组成了估值委员会，负责研究、指导基金估值业务。估值委员会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历，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值委员会的成员，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，本基金依据签署的《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》从中央国债登记结算有限责任公司取得中债估值服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金每日计算投资人帐户当日所产生的收益，每月将投资人帐户累计的收益结转为基金份额，计入该投资人帐户的基金份额中。

本基金期初应付收益 7,866,087.61 元，2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日期间累计分配收益 118,857,519.65 元，其中人民币 76,464,012.28 元以红利再投资方式结转入实收基金，人民币 42,393,507.37 元因基金赎回而支付给投资者，其余人民币 11,687,262.32 元为期末应付收益。

§ 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

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对汇添富货币市场基金

的托管过程中，严格遵守《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》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，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

本报告期内，本托管人依照《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》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对汇添富货币市场基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期内，由汇添富基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、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：汇添富货币市场基金

报告截止日：2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	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	2,904,433,121.92	2,336,024,574.87
结算备付金	727,272.73	-
存出保证金	250,000.00	250,000.00
交易性金融资产	1,573,591,828.57	1,344,951,710.37
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	1,553,591,828.57	1,344,951,710.37
资产支持证券投资	20,000,000.00	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	149,940,344.91
应收证券清算款	-	-
应收利息	61,718,260.82	24,693,464.40
应收股利	-	-

应收申购款	419,777,746.44	206,665,490.73
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	4,960,498,230.48	4,062,525,585.28
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2012 年 6 月 30 日	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	-	-
卖出回购金融资产款	799,998,350.00	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	99,513.24	1,218.93
应付管理人报酬	2,410,248.60	812,538.17
应付托管费	730,378.37	246,223.67
应付销售服务费	338,061.47	142,830.75
应付交易费用	36,780.15	25,596.01
应交税费	452,400.00	452,400.00
应付利息	347,449.68	-
应付利润	11,687,262.32	7,866,087.61
递延所得税负债	-	-
其他负债	448,755.15	559,018.22
负债合计	816,549,198.98	10,105,913.36
所有者权益:		
实收基金	4,143,949,031.50	4,052,419,671.92
未分配利润	-	-
所有者权益合计	4,143,949,031.50	4,052,419,671.92
负债和所有者权益总计	4,960,498,230.48	4,062,525,585.28

注：报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 4,143,949,031.50 份，其中，A 级份额 1,247,921,330.92 份，B 级份额 2,896,027,700.58 份。

6.2 利润表

会计主体：汇添富货币市场基金

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	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
一、收入	139,529,342.78	46,914,164.01
1.利息收入	127,439,315.33	44,184,583.48
其中：存款利息收入	88,193,547.58	11,676,454.50
债券利息收入	35,236,111.70	20,161,303.77

资产支持证券利息收入	284,449.32	-
买入返售金融资产收入	3,725,206.73	12,346,825.21
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	11,768,220.37	2,683,416.14
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	11,768,220.37	2,683,416.14
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（损失以“-”号填列）	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	321,807.08	46,164.39
减：二、费用	16,850,648.42	6,721,180.01
1. 管理人报酬	8,957,918.21	3,934,159.37
2. 托管费	2,714,520.60	1,192,169.46
3. 销售服务费	1,744,222.33	639,405.81
4. 交易费用	-	-
5. 利息支出	3,193,799.88	728,193.84
其中：卖出回购金融资产支出	3,193,799.88	728,193.84
6. 其他费用	240,187.40	227,251.53
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	122,678,694.36	40,192,984.00

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富货币市场基金

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）	4,052,419,671.92	-	4,052,419,671.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	122,678,694.36	122,678,694.36
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）	91,529,359.58	-	91,529,359.58

其中：1.基金申购款	26,823,754,714.54	-	26,823,754,714.54
2.基金赎回款	-26,732,225,354.96	-	-26,732,225,354.96
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)	-	-122,678,694.36	-122,678,694.36
五、期末所有者权益(基金净值)	4,143,949,031.50	-	4,143,949,031.50
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)	2,808,383,300.11	-	2,808,383,300.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	40,192,984.00	40,192,984.00
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)	-1,257,007,487.87	-	-1,257,007,487.87
其中：1.基金申购款	8,364,688,199.58	-	8,364,688,199.58
2.基金赎回款	-9,621,695,687.45	-	-9,621,695,687.45
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)	-	-40,192,984.00	-40,192,984.00
五、期末所有者权益(基金净值)	1,551,375,812.24	-	1,551,375,812.24

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：

_____林利军_____ _____陈灿辉_____ _____王小练_____

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

汇添富货币市场投资基金(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]21 号文《关于同意汇添富货币市场基金募集的批复》的核准,由汇添富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 3 月 23 日正式生效,首次设立募集规

模为 4,104,914,022.13 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汇添富基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

2007 年 5 月 22 日，本基金按照 500 万份基金份额的界限划分为 A 级基金份额和 B 级基金份额，单一持有人持有 500 万份基金份额以下的为 A 级，达到或超过 500 万份的为 B 级。本基金份额分级规则于分级日起生效。基金分级后，当份额持有人在单个基金账户保留的基金份额减少至 500 万份以下时，本基金的注册登记机构自动将其在该基金帐户持有的 B 级基金份额降级为 A 级基金份额；相应地，当达到或超过 500 万份时，A 级基金份额自动升级为 B 级基金份额。两级基金份额单独计算及公布基金日收益和基金七日收益率。

本基金投资于法律法规允许的金融工具包括：现金、通知存款、一年以内（含一年）的银行定期存款、大额存单、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、期限在一年以内（含一年）的央行票据、期限在一年以内（含一年）的债券回购、短期融资券及中国证监会、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。本基金结合宏观分析和微观分析制定投资策略，力求在满足安全性、流动性需要的基础上实现更高的收益率。本基金的业绩比较基准为税后活期存款利率(即活期存款利率 $\times(1 - \text{利息税率})$)。

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。

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 2012 年 6 月 30 日的财务状况以及 2012 年上半年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 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

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 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

本报告期内未发生与本基金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。

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
汇添富基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
东方证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
东航金控控股有限责任公司	基金管理人的股东
文汇新民联合报业集团	基金管理人的股东
汇添富资产管理（香港）有限公司	基金管理人的子公司
上海汇添富公益基金会	与基金管理人同一批关键管理人员

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
东方证券股份有限公司	840,000,000.00	100.00%	354,217,000.00	100.00%

6.4.8.1.2 应支付关联方的佣金

本基金本期及上年度可比期间均未有应支付关联方的佣金。

注:证券公司不向本基金收取债券回购交易佣金,但交易的经手费和上海证券交易所证管费由本基金交纳,其所计提的证券结算风险基金由证券公司按季偿付本基金。佣金的比率是公允的,符合证监会有关规定。管理人因此从关联方获取的服务主要包括: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	8,957,918.21	3,934,159.37
其中:支付销售机构的客户维护费	801,201.75	272,996.06

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 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

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 5 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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	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	2,714,520.60	1,192,169.46

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 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

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 5 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。

6.4.8.2.3 销售服务费

获得销售服务费的各关联方名称	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		
	汇添富货币 A	汇添富货币 B	合计
汇添富基金管理有限公司	319,191.51	169,078.88	488,270.39
上海浦东发展银行股份有限公司	55,580.12	3,023.02	58,603.14
东方证券股份有限公司	50,016.26	740.22	50,756.48
合计	424,787.89	172,842.12	597,630.01
获得销售服务费的各关联方名称	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		
	汇添富货币 A	汇添富货币 B	合计
汇添富基金管理有限公司	147,979.48	86,882.79	234,862.27

上海浦东发展银行股份有限公司	38,987.99	1,098.43	40,086.42
东方证券股份有限公司	11,913.85	0.00	11,913.85
合计	198,881.32	87,981.22	286,862.54

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。

本基金各级基金份额按照不同的费率计提销售服务费，但各级基金份额的销售服务费率均不超过 0.25% 年费率，A 级基金份额和 B 级基金份额的约定年费率分别为 0.25% 和 0.01%。各级基金份额的销售服务费计提的计算公式如下：

$$H = E \times R \div \text{当年天数}$$

H 为各级基金份额每日应计提的销售服务费

E 为前一日该级基金份额的基金资产净值

R 为该级基金份额的销售服务费率

各级基金份额的销售服务费在基金合同生效后每日计提，按月支付，由基金托管人于次月首 5 个工作日内从基金财产中一次性划往基金注册登记清算账户。由基金管理人支付给各销售机构，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

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
上海浦东发展银行股份有限公司	-	-	-	-	-	-
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
上海浦东发展银行股份有限公司	-	-	-	-	1,138,100,000.00	143,591.75

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

注：本报告期及上年度可比期间本公司未发生运用固有资金投资本基金的情况。

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

汇添富货币 A

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
上海汇添富公 益基金会	1,739,551.49	0.04%	-	-

汇添富货币 B

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
上海汇添富公 益基金会	-	-	6,144,573.02	0.15%

注：上海汇添富公益基金会于 2012 年 3 月 23 日赎回 4,500,000.00 份（本基金无赎回费）；本报告期共得收益结转为的份额 94,978.47 份。

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
上海浦东发展银 行股份有限公司	4,433,121.92	939,325.78	5,234,115.68	375,788.46

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本期及上年度可比期间在承销期内未有参与关联方承销证券的情况。

6.4.9 期末（ 2012 年 6 月 30 日 ）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.9.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.2.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2012 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 799,998,350.00 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
041259018	12 南高轮 CP001	2012-7-2	100.39	700,000	70,271,470.17
041254001	12 红狮 CP001	2012-7-2	99.95	500,000	49,972,931.48
041164011	11 敦 煌 种 业 CP001	2012-7-2	100.01	300,000	30,001,764.47
041158028	11 人福 CP002	2012-7-2	100.82	400,000	40,327,958.26
041158005	11 康缘集 CP001	2012-7-2	100.00	500,000	50,001,859.95
041154010	11 石河子 CP002	2012-7-2	100.00	400,000	40,000,797.03
011212001	12 华能 SCP001	2012-7-3	100.00	1,000,000	100,002,037.94
041260016	12 大装备 CP001	2012-7-4	100.09	500,000	50,046,789.65
041261013	12 津城建 CP001	2012-7-4	100.17	500,000	50,083,218.29
041154012	11 广汽 CP001	2012-7-4	101.20	500,000	50,601,444.50
041151007	11 中铁建 CP001	2012-7-2	100.53	500,000	50,264,726.12
041158004	11 中铁股 CP001	2012-7-2	100.83	500,000	50,415,149.52
041158013	11 皖交投 CP002	2012-7-2	100.06	200,000	20,012,640.26
041252016	12 新希望 CP001	2012-7-2	100.08	300,000	30,023,366.43
041253003	12 中核建 CP001	2012-7-2	100.42	700,000	70,291,969.86
041258002	12 广 汇 汽 车 CP001	2012-7-2	100.47	200,000	20,094,079.54
041158015	11 华 谊 兄 弟 CP001	2012-7-2	100.02	300,000	30,006,101.81
合计				8,000,000	802,418,305.28

6.4.9.2.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未持有交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	1,573,591,828.57	31.72
	其中: 债券	1,553,591,828.57	31.32
	资产支持证券	20,000,000.00	0.40
2	买入返售金融资产	-	-
	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	2,905,160,394.65	58.57
4	其他各项资产	481,746,007.26	9.71
5	合计	4,960,498,230.48	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	3.56	
	其中: 买断式回购融资	0.12	
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	799,998,350.00	19.31
	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

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例 (%)	原因	调整期
1	2012-06-27	30.32	满足流动性需求	2 个交易日
2	2012-06-28	23.81	满足流动性需求	1 个交易日

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	128
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	161
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	87

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

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。

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	18.07	19.31
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	4.66	-
2	30 天(含)—60 天	10.13	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	2.16	-
3	60 天(含)—90 天	17.62	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.72	-
4	90 天(含)—180 天	40.77	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.95	-
5	180 天(含)—397 天（含）	21.50	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		108.09	19.31

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	108,417,133.46	2.62
3	金融债券	441,400,106.32	10.65
	其中：政策性金融债	341,395,353.49	8.24
4	企业债券	111,222,420.33	2.68

5	企业短期融资券	892,552,168.46	21.54
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	1,553,591,828.57	37.49
9	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	352,438,434.82	8.50

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	1,300,000	131,404,299.62	3.17
2	1101094	11 央行票据 94	1,100,000	108,417,133.46	2.62
3	110414	11 农发 14	1,000,000	100,179,339.00	2.42
4	071202001	12 国泰君安 CP001	1,000,000	100,004,752.83	2.41
5	011212001	12 华能 SCP001	1,000,000	100,002,037.94	2.41
6	100230	10 国开 30	800,000	79,824,816.76	1.93
7	041253003	12 中核建 CP001	700,000	70,291,969.86	1.70
8	041259018	12 南高轮 CP001	700,000	70,271,470.17	1.70
9	0980147	09 中航工债 浮	600,000	61,885,116.33	1.49
10	041154012	11 广汽 CP001	500,000	50,601,444.50	1.22

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	20
报告期内偏离度的最高值	0.36%
报告期内偏离度的最低值	0.03%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.19%

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

序号	证券代码	证券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	119017	宁公控 1	200,000	20,000,000.00	0.48

7.8 投资组合报告附注

7.8.1 本基金估值采用摊余成本法计价，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，在其剩余期限内平均摊销。

7.8.2 本报告期内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当日基金资产净值的 20%。

7.8.3 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或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	250,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	61,718,260.82
4	应收申购款	419,777,746.44
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	481,746,007.26

§ 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

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
汇 添 富 货 币 A	20,512	60,838.60	79,636,839.43	6.38%	1,168,284,491.49	93.62%
汇 添 富 货 币 B	64	45,250,432.82	2,834,464,908.73	97.87%	61,562,791.85	2.13%
合计	20,576	201,397.21	2,914,101,748.16	70.32%	1,229,847,283.34	29.68%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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 持有本基金	汇添富货币 A	20,034,786.27	1.61%
	汇添富货币 B	-	-
	合计	20,034,786.27	0.48%

注：1）本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 100 万份以上。

2）该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间为 0 至 10 万份（含）。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	汇添富货币 A	汇添富货币 B
基金合同生效日（2006年3月23日）基金份额总额	4,104,914,022.13	254,810,938.22
本报告期期初基金份额总额	909,884,081.11	3,142,535,590.81
本报告期基金总申购份额	6,340,160,263.23	20,483,594,451.31
减：本报告期基金总赎回份额	6,002,123,013.42	20,730,102,341.54
本报告期期末基金份额总额	1,247,921,330.92	2,896,027,700.58

注：1、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。

2、2007 年 5 月 22 日（分级日）本基金按照 500 万份基金份额的界限划分为 A 级基金份额和 B 级基金份额。分级日，实收基金份额余额为 422,758,458.79 份，分别划分为 A 级基金 167,947,520.57 份和 B 级基金 254,810,938.22 份。表中 B 级基金合同生效日基金份额总额为分级日份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无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

1、基金管理人 2012 年 3 月 3 日公告，增聘韩贤旺先生、叶从飞先生担任汇添富均衡增长股票型证券投资基金的基金经理,与苏竞先生共同管理该基金。同时，陈晓翔先生、欧阳沁春先生不再担任该基金的基金经理。

2、基金管理人 2012 年 3 月 3 日公告，增聘周睿先生担任汇添富医药保健股票型证券投资基金的基金经理，由其与王栩先生共同管理该基金。

3、《汇添富逆向投资股票型证券投资基金基金合同》于 2012 年 3 月 9 日正式生效，顾耀强先生任

该基金的基金经理。

4、基金管理人于 2012 年 3 月 14 日公告，聘请雷继明先生担任本公司副总经理。

5、《汇添富理财 30 天债券型证券投资基金基金合同》于 2012 年 5 月 9 日正式生效，曾刚先生任该基金的基金经理。

6、基金管理人 2012 年 6 月 7 日公告，潘鑫军先生担任本公司董事长，桂水发先生不再担任本公司的董事长。

7、《汇添富理财 60 天债券型证券投资基金基金合同》于 2012 年 6 月 12 日正式生效，曾刚先生任该基金的基金经理。

8、本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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

本报告期内，为本基金进行审计的机构未发生变化，为安永华明会计师事务所。

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

本报告期内未发生基金管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

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	
东方证券	2	-	-	-	-	-

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
东方证券	-	-	840,000,000.00	100.00%	-	-

注：1、专用交易单元的选择标准和程序：

- (1) 基金交易单元选择和成交量的分配工作由投资研究部统一负责组织、协调和监督。
- (2) 交易单元分配的目标是按照证监会的有关规定和对券商服务的评价控制交易单元的分配比例。
- (3) 投资研究部根据评分的结果决定本月的交易单元分配比例。其标准是按照上个月券商评分决定本月的交易单元拟分配比例，并在综合考察年度券商的综合排名及累计的交易分配量的基础上进行调整，使得总的交易量的分配符合综合排名，同时每个交易单元的分配量不超过总成交量的 30%。
- (4) 每半年综合考虑近半年及最新的评分情况，作为增加或更换券商交易单元的依据。
- (5) 调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部决定，投资总监审批。
- (6) 成交量分布的决定应于每月第一个工作日完成；更换券商交易单元的决定于合同到期前一个月完成。
- (7) 调整和更换交易单元所涉及到的交易单元运行费及其他相关费用，基金会计应负责协助及时催缴。

2、报告期内未发生租用证券公司交易单元的变更情况。

10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况

注：本基金本期未发生偏离度绝对值超过0.5%的情况。

汇添富基金管理有限公司
2012 年 8 月 28 日