

诺安货币市场基金 2009年半年度报告摘要

2009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：2009年08月25日

重要提示

基金管理人、基金托管人及基金销售机构均不存在虚假记载、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2009年8月21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。

本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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

本基金的过往业绩并不预示其未来表现。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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2009年1月1日起至2009年6月30日止。

§2 基金简介

基金简称	诺安货币
交易代码	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
报告期末基金份额总额	1,362,814,363.07份

2.2 基金产品说明

投资目标：确保本资产的安全性、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。

投资策略：根据宏观经济、央行货币政策操作及短期货币市场供求情况，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力进行主动式选择。

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，风险低并且收益相对较为稳定。

资产	本期末 2009年06月30日	上年度末 2008年12月31日
银行存款	352,536,763.29	70,923,786.68
结算备付金	0.00	0.00
存出保证金	0.00	0.00
交易性金融资产	969,869,123.55	1,115,126,303.48
其中：股票投资	0.00	0.00
债券投资	969,869,123.55	1,115,126,303.48
资产支持证券投资	0.00	0.00
衍生金融资产	0.00	0.00
买入返售金融资产	180,000,390.00	798,602,517.90
应收证券清算款	0.00	0.00
应收利息	5,862,006.70	6,069,564.36
应收股利	0.00	0.00
应收申购款	56,864,257.77	173,033,989.28
其他资产	0.00	0.00
资产总计	1,565,132,541.31	2,163,756,161.70

负债和所有者权益	本期末 2009年06月30日	上年度末 2008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	0.00	0.00
卖出回购金融资产款	199,999,780.00	0.00
应付证券清算款	0.00	0.00
应付赎回款	0.00	0.00
应付管理人报酬	427,790.45	551,684.15
应付托管费	129,633.48	167,176.98
应付销售服务费	324,083.67	417,942.55
应付交易费用	25,037.46	23,124.85
应交税费	417,600.00	417,600.00
应付利息	6,192.60	0.00
应付股利	790,236.97	1,591,732.56
其他负债	197,823.61	104,500.00
负债合计	202,318,178.24	3,273,761.09
所有者权益：		
实收基金	1,362,814,363.07	2,160,482,400.61
未分配利润	0.00	0.00
所有者权益合计	1,362,814,363.07	2,160,482,400.61
负债和所有者权益总计	1,565,132,541.31	2,163,756,161.70

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
过去一月	0.1453%	0.0066%	0.0296%	0.0000%	0.1157%	0.0066%
过去三月	0.3439%	0.0043%	0.0898%	0.0000%	0.2541%	0.0043%
过去六月	0.6476%	0.0032%	0.1785%	0.0000%	0.4691%	0.0032%
过去一年	2.5617%	0.0094%	0.4971%	0.0005%	2.0646%	0.0089%
过去三年	8.0718%	0.0061%	1.7806%	0.0004%	6.2912%	0.0057%
自基金合同生效起至今	11.9350%	0.0055%	2.6832%	0.0003%	9.2518%	0.0052%

项目	本期 2009年01月01日至2009年06月30日	上年度可比期间 2008年01月01日至2008年06月30日
一、收入	19,314,286.00	13,374,931.27
1.利息收入	16,836,858.70	12,926,381.24
其中：存款利息收入	2,230,283.76	304,085.72
债券利息收入	11,375,264.82	10,691,053.55
资产支持证券利息收入	0.00	0.00
买入返售金融资产收入	3,231,310.12	1,931,241.97
其他利息收入	0.00	0.00
2.投资收益(损失以“-”号填列)	2,477,134.08	448,550.03
其中：股票投资收益	0.00	0.00
债券投资收益	2,477,134.08	448,550.03
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
二、费用(以“-”号填列)	-7,219,237.67	-2,798,100.73
1.管理人报酬	-3,100,489.99	-1,191,844.35
2.托管费	-939,542.52	-321,165.02
3.销售服务费	-2,348,856.06	-902,192.45
4.交易费用	-121,125.32	-15,093.64
5.利息支出	-605,697.67	-123,564.95
其中：卖出回购金融资产支出	-605,697.67	-123,564.95
6.其他费用	-203,526.11	-203,520.50
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	12,095,048.33	10,576,830.54

项目	本期 2009年01月01日至2009年06月30日	上年度可比期间 2008年01月01日至2008年06月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	2,160,482,400.61	0.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-12,095,048.33	12,095,048.33
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)	-797,668,037.54	0.00
其中：1.基金申购款	3,247,253,612.11	0.00
2.基金赎回款(以“-”号填列)	-4,044,921,649.65	0.00
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)	-	-12,095,048.33
五、期末所有者权益(基金净值)	1,362,814,363.07	0.00

项目	本期 2008年01月01日至2008年06月30日	上年度可比期间 2008年01月01日至2008年06月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	914,814,398.84	0.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-10,576,830.54	10,576,830.54
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)	-250,449,625.35	0.00
其中：1.基金申购款	3,247,253,612.11	0.00
2.基金赎回款(以“-”号填列)	-4,044,921,649.65	0.00
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)	-	-10,576,830.54
五、期末所有者权益(基金净值)	664,364,773.49	0.00

项目	本期 2008年01月01日至2008年06月30日	上年度可比期间 2008年01月01日至2008年06月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	914,814,398.84	0.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-10,576,830.54	10,576,830.54
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)	-250,449,625.35	0.00
其中：1.基金申购款	3,247,253,612.11	0.00
2.基金赎回款(以“-”号填列)	-4,044,921,649.65	0.00
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)	-	-10,576,830.54
五、期末所有者权益(基金净值)	664,364,773.49	0.00

项目	本期 2008年01月01日至2008年06月30日	上年度可比期间 2008年01月01日至2008年06月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	914,814,398.84	0.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-10,576,830.54	10,576,830.54
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)	-250,449,625.35	0.00
其中：1.基金申购款	3,247,253,612.11	0.00
2.基金赎回款(以“-”号填列)	-4,044,921,649.65	0.00
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)	-	-10,576,830.54
五、期末所有者权益(基金净值)	664,364,773.49	0.00

项目	本期 2008年01月01日至2008年06月30日	上年度可比期间 2008年01月01日至2008年06月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	914,814,398.84	0.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-10,576,830.54	10,576,830.54
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)	-250,449,625.35	0.00
其中：1.基金申购款	3,247,253,612.11	0.00
2.基金赎回款(以“-”号填列)	-4,044,921,649.65	0.00
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)	-	-10,576,830.54
五、期末所有者权益(基金净值)	664,364,773.49	0.00

项目	本期 2008年01月01日至2008年06月30日	上年度可比期间 2008年01月01日至2008年06月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	914,814,398.84	0.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-10,576,830.54	10,576,830.54
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)	-250,449,625.35	0.00
其中：1.基金申购款	3,247,253,612.11	0.00
2.基金赎回款(以“-”号填列)	-4,044,921,649.65	0.00
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)	-	-10,576,830.54
五、期末所有者权益(基金净值)	664,364,773.49	0.00

项目	本期 2008年01月01日至2008年06月30日	上年度可比期间 2008年01月01日至2008年06月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	914,814,398.84	0.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-10,576,830.54	10,576,830.54
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)	-250,449,625.35	0.00
其中：1.基金申购款	3,247,253,612.11	0.00
2.基金赎回款(以“-”号填列)	-4,044,921,649.65	0.00
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)	-	-10,576,830.54
五、期末所有者权益(基金净值)	664,364,773.49	0.00

项目	本期 2008年01月01日至2008年06月30日	上年度可比期间 2008年01月01日至2008年06月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	914,814,398.84	0.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-10,576,830.54	10,576,830.54
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)	-250,449,625.35	0.00
其中：1.基金申购款	3,247,253,612.11	0.00
2.基金赎回款(以“-”号填列)	-4,044,921,649.65	0.00
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)	-	-10,576,830.54
五、期末所有者权益(基金净值)	664,364,773.49	0.00

项目	本期 2008年01月01日至2008年06月30日	上年度可比期间 2008年01月01日至2008年06月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	914,814,398.84	0.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-10,576,830.54	10,576,830.54
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)	-250,449,625.35	0.00
其中：1.基金申购款	3,247,253,612.11	0.00
2.基金赎回款(以“-”号填列)	-4,044,921,649.65	0.00
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)	-	-10,576,830.54
五、期末所有者权益(基金净值)	664,364,773.49	0.00

项目	本期 2008年01月01日至2008年06月30日	上年度可比期间 2008年01月01日至2008年06月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	914,814,398.84	0.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-10,576,830.54	10,576,830.54
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)	-250,449,625.35	0.00
其中：1.基金申购款	3,247,253,612.11	0.00
2.基金赎回款(以“-”号填列)	-4,044,921,649.65	0.00
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)	-	-10,576,830.54
五、期末所有者权益(基金净值)	664,364,773.49	0.00

项目	本期 2008年01月01日至2008年06月30日	上年度可比期间 2008年01月01日至2008年06月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	914,814,398.84	0.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-10,576,830.54	10,576,830.54
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)	-250,449,625.35	0.00
其中：1.基金申购款	3,247,253,612.11	0.00
2.基金赎回款(以“-”号填列)	-4,044,921,649.65	0.00
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)	-	-10,576,830.54
五、期末所有者权益(基金净值)	664,364,773.49	0.00

项目	本期 2008年01月01日至2008年06月30日	上年度可比期间 2008年01月01日至2008年06月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	914,814,398.84	0.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-10,576,830.54	10,576,830.54
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)	-250,449,625.35	0.00
其中：1.基金申购款	3,247,253,612.11	0.00
2.基金赎回款(以“-”号填列)	-4,044,921,649.65	0.00
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)	-	-10,576,830.54
五、期末所有者权益(基金净值)	664,364,773.49	0.00

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，日常估值由基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由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、季中和年末估值复核与基金会计账务核对同时进行。

报告期内，公司制定了《证券投资基金估值政策和程序》并由财务部、财务综合部、监察稽核部和风险管理部、运营支持人员及基金运营部组成了估值小组，负责研究、指导基金估值业务。估值小组成员均为公司各相关部门人员，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小组的成员，不介入基金日常估值业务，但参加估值小组会议，可以提议调整某项投资品种的估值调整影响，并有表决权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，本基金未参与与估值相关的定价服务。

4.7 管理人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12,095,048.33元，应分配利润12,095,048.33元。本基金本期已实施利润分配12,095,048.33元。本基金本期无应分配而未分配的利润情况。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵守信守情况声明

2009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信守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2009年上半年，诺安货币市场基金基金管理人——诺安基金管理有限公司在诺安货币市场基金基金的投资运作、每份基金份额净值和7日年化收益率、基金利润分配、基金费用开支等方面上，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》等相关法律法规。

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

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基金2009年半年度报告中财务指标、利润分配情况、财务会计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：2009年06月30日

资产	本期末 2009年06月30日	上年度末 2008年12月31日
银行存款	352,536,763.29	70,923,786.68
结算备付金	0.00	0.00
存出保证金	0.00	0.00
交易性金融资产	969,869,123.55	1,115,126,303.48
其中：股票投资	0.00	0.00
债券投资	969,869,123.55	1,115,126,303.48
资产支持证券投资	0.00	0.00
衍生金融资产	0.00	0.00
买入返售金融资产	180,000,390.00	798,602,517.90
应收证券清算款	0.00	0.00
应收利息	5,862,006.70	6,069,564.36
应收股利	0.00	0.00
应收申购款	56,864,257.77	173,033,989.28