华夏现金增利证券投资基金 2009年半年度报告摘要

2009年6月30日

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：二〇〇九年八月二十九日

§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2009年8月20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2009年1月1日起至6月30日止。

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。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华夏现金增利货币
交易代码	003003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年4月7日
报告期末基金份额总额	19,701,079,986.15份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在确保本金安全和高流动性的前提下，追求超过基准的较高收益。
投资策略	积极判断短期利率变动，合理安排期限，细致研究，谨慎操作，以实现本金的安全性、流动性和稳定超过基准的较高收益。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为“同期7天通知存款利率”。
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中低风险的品种，其长期平均的风险和预期收益率低于股票基金、混合基金和债券基金。

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		华夏基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	廖为	尹东
	联系电话	400-818-6666	010-67595003
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	yindong.zh@ccb.com
客户服务电话		400-818-6666	010-67595096
传真		010-88066511	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	www.ChinaAMC.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

§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（2009年1月1日-2009年6月30日）
本期已实现收益	252,636,996.26
本期利润	252,636,996.26
本期净值收益率	0.9096%
3.1.2 期末数据和指标	报告期（2009年1月1日-2009年6月30日）
期末基金资产净值	19,701,079,986.15
期末基金份额净值	1.0000

注：①本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

②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本基金按日结转份额。

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	0.1263%	0.0040%	0.1110%	0.0000%	0.0153%	0.0040%
过去三个月	0.4958%	0.0080%	0.3366%	0.0000%	0.1592%	0.0080%
过去六个月	0.9096%	0.0063%	0.6695%	0.0000%	0.2401%	0.0063%
过去一年	3.4087%	0.0129%	1.5011%	0.0005%	1.9076%	0.0124%
过去三年	9.9038%	0.0091%	6.4154%	0.0020%	3.4884%	0.0071%
自基金合同生效起至今	15.7592%	0.0072%	10.6180%	0.0016%	5.1412%	0.0056%

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

华夏现金增利证券投资基金

份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2004年4月7日至2009年6月30日）

注：按照华夏现金增利货币基金的基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起3个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十八条（二）投资范围、（六）投资组合的有关约定。

§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

华夏基金管理有限公司成立于1998年4月9日，是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京，在北京、上海、深圳和成都设有分公司，在香港设有子公司。华夏基金是首批全国社保基金投资管理人、企业年金基金投资管理人、QDII基金管理人、特定客户资产管理人以及境内首只ETF基金管理人、境内唯一的亚债中国基金投资管理人，是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

截至2009年6月30日，公司管理资产规模超过2500亿元，基金份额持有人户数超过1200万，是境内管理基金资产规模最大的基金管理公司。公司管理着2只封闭式基金、21只开放式基金、亚洲债券基金二期中国子基金及多只全国社保基金投资组合，公司已经被超过110家大中型企业确定为年金投资管理人，并被多家客户确定为特定客户资产管理人。

2009年上半年，华夏基金以深入的投资研究为基础，规范经营、稳健运作，旗下基金整体表现在同业中位居前列：

根据中国银河证券基金研究中心的统计，截至2009年6月30日，华夏基金旗下12只股票型及混合型基金今年以来业绩增长率超过40%，其中，华夏复兴股票基金净值增长率为71.43%，在125只标准股票型基金中收益名列第3；华夏上证50ETF基金净值增长71.15%，在11只标准指数型基金中名列第3；中信经典配置混合基金在33只灵活配置型基金中位列第5。在固定收益产品方面，华夏希望债券基金在25只普通债券型基金（二级）中位列第2。

根据截至2009年6月30日的晨星开放式基金业绩排行榜，华夏基金旗下参与评价的12只主动型开放式基金中，有9只基金获得两年期五星级评价，3只基金获得两年期四星级评价。

凭借良好的业绩、稳健的经营和优秀的品牌，华夏基金荣获国内外多家机构评选的多个奖项：在和讯网举办的“2008年度中国财经风云榜”活动中获得“中国十大品牌基金公司”、“最佳投资者关系基金公司”、“最佳基金网上交易平台”三项公司奖，在中国证券报主办的“第六届中国基金业金牛奖”评选中荣获“2008年度十大金牛基金公司”奖，在证券时报社主办的“2008年度中国明星基金暨最佳托管银行评选”获得本届特别奖“中国最具影响力基金公司”称号及“2008年度十大明星基金公司”称号，在上海证券报主办的“第六届中国金基金奖”评选中获得唯一的“金基金公司TOP大奖”，在国际知名基金研究机构理柏主办的“2008年理柏基金奖”中荣获混合型团体大奖，在亚洲权威资产管理行业杂志《亚洲资产管理》（Asia Asset Management）评选中荣获“中国股票-5年最佳业绩奖”和“中国最佳社会服务奖”，并第三次获得《亚洲投资者》（Asian Investor）杂志评选的“年度中国最佳基金管理公司”奖。

为树立理性的基金投资理念，增进与投资者之间的交流，2009年上半年，华夏基金在投资者理财服务方面加大投入，在全国9个城市举办了“2009华夏基金——信心之旅巡回报告会”，在全国多家媒体开设了“华夏基金投资者教育专栏”，持续进行基金理财知识的宣传。

在客户服务方面，华夏基金继续采取多种手段，不断提高服务投资者水平：推出在线客户服务，为客户提供及时、稳定、优质的网络在线咨询服务；推动销售机构改善系统，提高客户交易成功率；积极联系客户，为客户提供及时的交易通知和基金信息服务。华夏基金荣获了中国信息化推进联盟客户关系管理专业委员会（CCCS）评选的“2009年最佳呼叫中心”奖及中国服务贸易协会、中国信息协会评选的“中国最佳客户服务”奖和“中国最佳客户服务管理团队”奖等多项服务行业重要奖项。

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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
曲波	本基金的基金经理	2008-1-18	—	6年	清华大学经济学学士。2003年加入华夏基金管理有限公司，曾任交易管理部交易员、华夏现金增利证券投资基金基金经理助理。

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、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，为基金份额持有人谋求最大利益，没有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

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

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

根据中国证监会《关于核准中信经典配置证券投资基金等四只基金基金份额持有人大会决议的批复》（证监许可[2009]1号），中信现金优势货币市场基金的基金管理人更换为华夏基金管理有限公司。中信现金优势货币市场基金与华夏现金增利证券投资基金构成投资风格相似的投资组合。业务交接前，上述两只基金的业绩暂不具有可比性；业务交接后，二者的投资业绩无明显差异。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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 本基金业绩表现

截至2009年6月30日，基金七日年化收益率为2.819%，上半年总回报率为0.9096%，折年收益率超越业绩比较基准收益率约0.49个百分点。

4.4.2 行情回顾及运作分析

2009年上半年，宽松货币政策使得货币市场资金极其充裕，短期市场利率保持在历史低位。同时，银行信贷呈现天量增长，上半年贷款增量即超过7万亿，超过2008年全年总量。在有效的宏观调控措施作用下，国内经济恢复的速度和力度均超过预期，经济基本面快速扭转。伴随着宏观经济的复苏，债券市场在上半年经历了一波逐步下跌的行情，进入6月份后，跌速加快，收益率曲线不断陡峭化。

1季度，本基金保持了信用类债券投资为主的较高债券配置比例，增持了部分浮息债，充分享受了低利率环境下信用利差收窄所带来的类属配置收益；鉴于央票的绝对收益率较低，基金减持了部分央票。2季度，在预期IPO可能重启、资金面的宽裕状况可能逐步改变、收益率曲线在整体上升的同时有逐步平坦化倾向的判断基础上，本基金逐步减持了信用类债券，并在浮息债大幅度上涨后减持了部分浮息债券，以降低组合风险，提高组合流动性，应对资金面可能的变化。

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，预期宽松的货币政策仍将继续，但力度可能有所降低。在宏观经济形势快速好转的情况下，为防止经济走向过热以及可能的通货膨胀，货币政策可能会出现微调，在一定程度上加强流动性的回收。同时，IPO的重启将导致投资者的机会成本上升，短期利率将率先承受机会成本上升带来的冲击。因此，下半年市场资金面在总体宽松的基础上，宽裕程度会较上半年降低，且资金利率上行压力较大。基于此，本基金在下半年将加强流动性管理，在确保组合良好流动性的同时寻找货币市场短期冲击带来的交易性机会，努力提高组合回报。

珍惜基金份额持有人的每一分投资和每一份信任，本基金将继续奉行华夏基金管理有限公司“为信任奉献回报”的经营理念，规范运作，审慎投资，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在0.25%以上时对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。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，组成人员包括督察长、投资风险总监、法律监察总监及基金会计负责人等。其中，超过三分之二以上的人员具有10年以上的基金从业经验，且具有风控、合规、会计方面的专业经验。同时，根据基金管理公司制定的相关制度，负责估值工作决策和执行的机构成员中不包括基金经理。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同及招募更新书（更新）等有关规定，本基金每日将基金净收益分配给基金份额持有人（该收益参与下一日的收益分配），并按自然月结转为相应的基金份额。

§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252，636，996.26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：华夏现金增利证券投资基金

报告截止日：2009年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2009年6月30日	上年度末 2008年12月31日
资产：			
银行存款		3,075,983,044.74	572,151,836.39
结算备付金		13,705,555.56	-
存出保证金		250,000.00	250,000.00
交易性金融资产		13,269,259,593.19	39,612,187,987.37
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		13,269,259,593.19	39,612,187,987.37
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		4,205,600,000.00	-
应收证券清算款		2,214,558,415.79	-
应收利息		200,361,262.58	220,913,200.94
应收股利		-	-
应收申购款		221,646,331.91	2,747,872.14
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		23,201,364,203.77	40,408,250,896.84
负债和所有者权益	附注号	本期末 2009年6月30日	上年度末 2008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		3,482,747,658.62	3,089,496,640.00
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		6,357,901.74	10,005,160.87
应付托管费		1,926,636.86	3,031,866.96
应付销售服务费		4,816,592.20	7,579,667.31
应付交易费用		87,693.63	497,485.91
应交税费		116,510.00	116,510.00
应付利息		106,547.69	85,315.84
应付利润		3,696,590.07	1,661,184.16
递延所得税负债		-	-
其他负债		428,086.81	364,520.70
负债合计		3,500,284,217.62	3,112,838,351.75
所有者权益：			
实收基金		19,701,079,986.15	37,295,412,545.09
未分配利润		-	-
所有者权益合计		19,701,079,986.15	37,295,412,545.09
负债和所有者权益总计		23,201,364,203.77	40,408,250,896.84

注：报告截止日2009年6月30日，基金份额净值1.0000元，基金份额总额19，701，079，986.15份。

6.2 利润表

会计主体：华夏现金增利证券投资基金

本报告期：2009年1月1日至2009年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2009年1月1日至2009年6月30日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30日
一、收入		357,437,793.48	224,759,580.37
1.利息收入		289,567,832.95	231,051,516.31
其中：存款利息收入		31,967,297.75	7,144,730.11
债券利息收入		252,458,406.91	193,956,100.34
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		5,142,128.29	29,950,685.86
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		67,869,960.53	-6,291,935.94
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		67,869,960.53	-6,291,935.94
资产支持证券投资收益		-	-
衍生金融资产		-	-
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）		-	-
二、费用（以“-”号填列）		-104,800,797.22	-52,169,178.67
1.管理人报酬		-47,306,113.03	-18,889,165.14
2.托管费		-14,335,185.72	-5,723,989.53
3.销售服务费		-35,837,964.44	-14,309,973.66
4.交易费用		-	-
5.利息支出		-7,082,815.66	-12,977,520.98
其中：卖出回购金融资产支出		-7,082,815.66	-12,977,520.98
6.其他费用		-238,718.37	-268,529.36
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		252,636,996.26	172,590,401.70
所得税费用（以“-”号填列）		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		252,636,996.26	172,590,401.70

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏现金增利证券投资基金

本报告期：2009年1月1日至2009年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009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）	37,295,412,545.09	-	37,295,412,545.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	252,636,996.26	252,636,996.26
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）	-17,594,332,558.94	-	-17,594,332,558.94
其中：1.基金申购款	29,730,091,828.86	-	29,730,091,828.86
2.基金赎回款（以“-”号填列）	-47,324,424,387.80	-	-47,324,424,387.80
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）	-	-252,636,996.26	-252,636,996.26
五、期末所有者权益（基金净值）	19,701,079,986.15	-	19,701,079,986.15
项目	上年度可比期间 2008年1月1日至2008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）	11,286,195,792.67	-	11,286,195,792.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	172,590,401.70	172,590,401.70
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）	3,466,174,709.72	-	3,466,174,709.72
其中：1.基金申购款	41,134,469,699.27	-	41,134,469,699.27
2.基金赎回款（以“-”号填列）	-37,668,294,989.55	-	-37,668,294,989.55
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）	-	-172,590,401.70	-172,590,401.70
五、期末所有者权益（基金净值）	14,752,370,502.39	-	14,752,370,502.39

6.4 报表附注

6.4.1 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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.2 会计差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 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

本基金本报告期不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。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金关系
华夏基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人 基金注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金销售机构
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
中信建投证券有限责任公司（“中信建投证券”）	基金管理人股东控股的公司、基金销售机构
中信万通证券有限责任公司（“中信万通证券”）	基金管理人股东控股的公司、基金销售机构
中信金通证券有限责任公司（“中信金通证券”）	基金管理人股东控股的公司、基金销售机构

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1 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均未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年6月30日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30日
当期应支付的管理费	47,306,113.03	18,889,165.14
其中：当期已支付	40,948,211.29	15,095,311.69
期末未支付	6,357,901.74	3,793,853.45

注：①支付基金管理人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。

②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.33%/当年天数。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年6月30日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30日
当期应支付的托管费	14,335,185.72	5,723,989.53
其中：当期已支付	12,408,548.86	4,574,336.96
期末未支付	1,926,636.86	1,149,652.57

注：①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金托管费计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

6.4.4.2.3 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 2009年1月1日至2009年6月30日		
	当期应支付的销售服务费		
	当期已支付	期末未支付	合计
华夏基金管理有限公司	6,220,793.80	1,029,620.07	7,250,413.87
中国建设银行	8,073,320.42	1,144,992.65	9,218,313.07
中信建投证券	554,867.78	93,766.53	648,634.31
中信证券	142,802.32	20,656.24	163,458.56
中信金通证券	40,291.88	5,000.93	45,292.81
中信万通证券	20,895.04	4,298.56	25,193.60
合计	15,052,971.24	2,298,334.98	17,351,306.22
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30日		
	当期应支付的销售服务费		
	当期已支付	期末未支付	合计
华夏基金管理有限公司	4,413,022.90	1,289,161.71	5,702,184.61
中国建设银行	3,315,847.66	1,058,345.94	4,374,193.60
中信建投证券	130,451.39	40,204.80	170,656.19
中信证券	38,719.07	11,527.28	50,246.35
中信金通证券	22,837.04	3,839.65	26,676.69
中信万通证券	10,083.18	1,777.25	11,860.43
合计	7,930,961.24	2,404,856.63	10,335,817.87

注：①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0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。

②基金销售服务费计算公式为：日基金销售服务费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

6.4.4.3 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 2009年1月1日至2009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	-	20,050,987.40	-	-		21,133,600,000.00
上年度可比期间 2008年1月1日至2008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	317,625,964.16	592,012,188.84	-	-	17,686,000,000.00	2,236,604.94

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.4.4.2 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

本基金本报告期末及上年度末均无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.4.5 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 2009年1月1日至2009年6月30日		上年度可比期间 2008年1月1日至2008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	75,983,044.74	1,118,979.43	74,901,294.57	1,606,697.68

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.4.6 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未通过关联方购买其承销的证券。

6.4.5 期末（2009年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌股票。

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2009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3，482，747，658.62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
080303	08进出03	2009-07-01	100.06	9,000,000	900,574,613.54
050603	05中行02浮	2009-07-01	100.00	8,500,000	849,969,562.40
070419	07农发19	2009-07-01	99.93	4,700,000	469,691,717.10
0881269	08苏交通CP01	2009-07-01	100.32	3,300,000	331,049,027.99
068007	06首都机场债	2009-07-01	96.12	3,250,000	312,388,115.31
0981039	09苏交通CP01	2009-07-01	100.13	2,800,000	280,365,797.26
0881196	08浙能源CP01	2009-07-01	98.75	2,000,000	197,508,380.86
0881243	08申能CP03	2009-07-01	100.23	1,500,000	150,349,533.63
070309	07进出09	2009-07-01	100.03	600,000	60,019,917.48
合计	-	-	-	35,650,000	3,551,916,665.57

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购截至本报告期末2009年6月30日止，本基金没有因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

§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	13,269,259,593.19	57.19
	其中：债券	13,269,259,593.19	57.19
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	4,205,600,000.00	18.13
	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	3,089,688,600.30	13.32
4	其他资产	2,636,816,010.28	11.36
5	合计	23,201,364,203.77	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产净值的比例（%）
1	报告期内债券回购融资余额	191,855,631,240.77	5.31
	其中：买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	3,482,747,658.62	17.68
	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	66
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	153
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	66

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	52.08	17.68
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	1.02	-
2	30天（含）-60天	14.53	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	6.36	-
3	60天（含）-90天	22.46	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	9.39	-
4	90天（含）-180天	12.47	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天（含）-397天（含）	14.09	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		115.62	17.68

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	968,708,627.47	4.92
3	金融债券	3,192,331,046.49	16.20
	其中：政策性金融债	2,342,361,484.09	11.89
4	企业债券	312,388,115.31	1.59
5	企业短期融资券	8,795,831,803.92	44.65
6	其他	-	-
7	合计	13,269,259,593.19	67.35
8	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	3,304,241,713.74	16.77

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	0801092	08央行票据92	9,700,000	968,708,627.47	4.92
2	080303	08进出03	9,000,000	900,574,613.54	4.57
3	050603	05中行02浮	8,500,000	849,969,562.40	4.31
4	0881205	08国电集CP01	4,700,000	474,171,418.94	2.41
5	070419	07农发19	4,700,000	469,691,717.10	2.38
6	0881219	08电网CP02	4,000,000	402,305,187.92	2.04
7	070413	07农发13	4,000,000	400,982,956.54	2.04
8	0881210	08网通CP01	3,500,000	352,386,782.94	1.79
9	0881209	08大唐CP01	3,500,000	350,715,703.59	1.78
10	0881269	08苏交通CP01	3,300,000	331,049,027.99	1.68

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	115次
报告期内偏离度的最高值	0.47%
报告期内偏离度的最低值	0.21%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.37%

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

鉴于货币市场基金的特性，本基金采用摊余成本法计算基金资产净值，即本基金按持有债券投资的票面利率或商定利率每日计提应收利息，并按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价，以摊余的成本计算基金资产净值。

为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与