汇添富货币市场基金

2011 半年度 报告摘要

2011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:2011 年 8 月 24 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 2011 年 8 月 18 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 2011 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	1,551,375,812.24 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
报告期末下属分级基金的份额总额	386,915,569.95 份	1,164,460,242.29 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×(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报告正文的管理人互联网网址	http://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(2011年1月1日至2011年6月30日)	报告期(2011年1月1日至2011年6月30日)
本期已实现收益	7,083,848.18	33,109,135.82
本期利润	7,083,848.18	33,109,135.82
本期净值收益率	1.62%	1.74%
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	386,915,569.95	1,164,460,242.29
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 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富货币 A

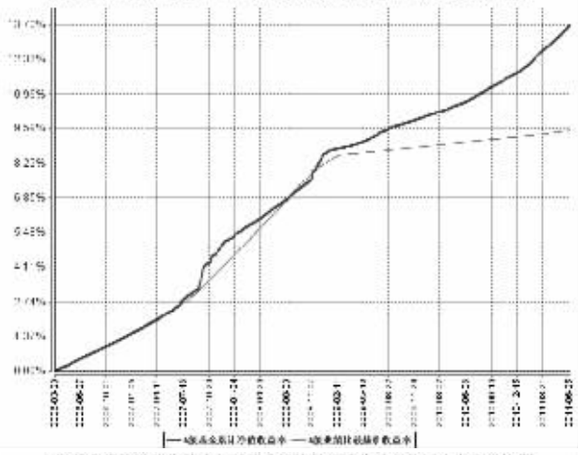
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.2776%	0.0025%	0.0411%	0.0000%	0.2365%	0.0025%
过去三个月	0.8252%	0.0035%	0.1233%	0.0001%	0.7019%	0.0034%
过去六个月	1.6177%	0.0033%	0.2176%	0.0002%	1.4001%	0.0031%
过去一年	2.6261%	0.0038%	0.3995%	0.0002%	2.2266%	0.0036%
过去三年	6.7390%	0.0087%	3.0078%	0.0034%	3.7312%	0.0053%
自基金合同生效日起至今	13.6802%	0.0084%	9.5081%	0.0038%	4.1721%	0.0046%

汇添富货币 B

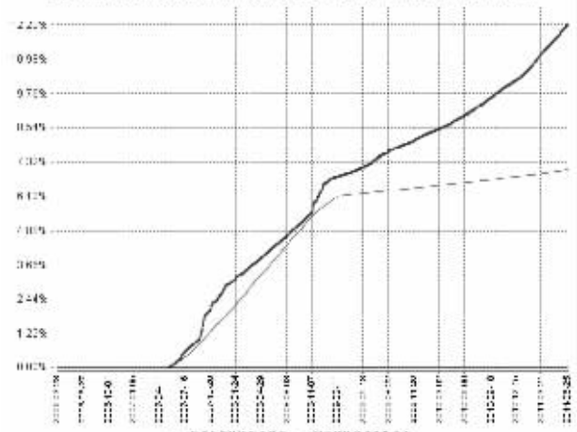
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.2975%	0.0025%	0.0411%	0.0000%	0.2564%	0.0025%
过去三个月	0.8854%	0.0036%	0.1233%	0.0001%	0.7621%	0.0035%
过去六个月	1.7380%	0.0033%	0.2176%	0.0002%	1.5204%	0.0031%
过去一年	2.8717%	0.0038%	0.3995%	0.0002%	2.4722%	0.0036%
过去三年	7.5085%	0.0087%	3.0078%	0.0034%	4.5007%	0.0053%
自基金合同生效日起至今	12.2341%	0.0092%	7.0507%	0.0043%	5.1834%	0.0049%

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

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:本基金建仓期为本(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、东航金戎控股有限责任公司共同发起设立,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,注册资本金为 1 亿元人民币,公司总部设在上海陆家嘴。经过六年多的发展,公司已成为业务布局完善、管理体系严谨、团队稳定优秀、文化优势突出、品牌日益确立,具有较强综合竞争实力的资产管理公司。公司业务覆盖公募基金管理、特定客户资产管理、QDII 业务、社保委托投资管理等,并设立有北京分公司、南方分公司和汇添富资产管理(香港)有限公司(China Universal Asset Management (Hong Kong) Company Limited)。截止 2011 年 6 月 30 日,公司管理证券投资基金规模达到 545 亿元,基金份额持有人户数超过 183 万,资产管理规模在行业内名列前茅。本报告期末,公司管理 15 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、汇添富医药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。

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,汇添富增强收益债券型证券投资基金的基金经理、汇添富可转换债券型证券投资基金的基金经理。	2006 年 3 月 23 日	-	17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。
陆文磊	本基金的基金经理,汇添富增强收益债券型证券投资基金的基金经理,汇添富保本混合型证券投资基金的基金经理。	2009 年 1 月 21 日	2011年 6 月 21 日	9年	国籍:中国。学历:华东师范大学金融学博士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任上海申银万国证券研究所有限公司高级分析师。2007 年 8 月加入汇添富基金管理有限公司,任固定收益高级经理,2008 年 3 月 6 日至今任汇添富增强收益债券型证券投资基金的基金经理,2009 年 1 月 21 日至 2011 年 6 月 21 日任汇添富货币市场基金的基金经理,2011 年 1 月 26 日至今任汇添富保本混合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遵规守信情况的说明

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。

2011 年 6 月 28 日,本基金因大额赎回导致基金资产投资于定期存款占基金资产净值的比例超标,为 31.28%。2011 年 6 月 29 日,该投资指标恢复正常。

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

本基金管理人已依据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》建立起健全、有效、规范的公平交易制度体系和公平交易机制,涵盖了各投资组合、各投资市场、各投资标的,贯穿了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估全过程,并通过分析报告、监控、稽核保证制度流程的有效执行。

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

本基金为货币市场基金,截止报告期,与本基金管理人旗下其他基金投资组合风格不同。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内,公司公平交易制度执行情况良好,未发生任何异常交易行为。

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,中国经济保持平稳增长,但 CPI 逐步走高,PMI 指标逐级回落,经济情况变得较为复杂。针对这一情况,央行频繁地采用提高准备金率、加息和控制信贷规模进行紧缩。

报告期内,央行一月一调准备金率,至半年末,准备金率已经提升至 21.5%的历史高位。货币市场利率大幅上升,尤其在春节和半年末,货币市场资金面变得相当紧张,银行类金融机构为了保证各项指标达标,纷纷在市场上融入资金,银行间回购利率一度逼近历史高位。

本基金针对市场的变化积极调整组合配置结构,在控制整体投资组合剩余期限的基础上,阶段性的持有央票及企业短期融资券以提高收益,较频繁地通过逆回购以及银行存款的手段实现组合的收益、并保证了组合的流动性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金 A 级本期净值收益率为 1.62%,B 级本期净值收益率为 1.74%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,中国经济发展正面临一个关键的"转型"阶段,转型是否成功关系到中国经济接下来数年的增长。目前,国内经济面临的各方面"两难"将在下半年进行梳理,选择适当的货币政策进行调整对于中国经济而言举足轻重。我们认为就准备金率而言,目前的水平已经逼近市场能够容忍的极限位置,市场利率受准备金率影响,在上半年末显示的边际效应相当明显,市场短期利率宽幅波动,绝对值处于历史上较高的水平。因此,可以预期如果通胀没有出现严重超预期的变化,准备金率的提升将暂告一段落,三季度最多有一次调整的可能,货币市场利率有望逐步回落,四季度预计准备金率将保持稳定。货币市场利率将可能明显回落。

下半年,我们将密切关注信用市场的变化,基于信贷紧缩和 PMI 下滑,我们认为市场信用风险将有所上升,信用利差仍有上升的可能。虽然目前信用投资品的收益处于高位,但我们认为经济前景不甚明朗,目前不是大规模投资信用投资品的时机。

本基金将密切关注货币市场的变化,适当地调整利率投资品和信用投资品的投资比例,及时调整投资期限,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 3,089,867.46 元,2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日期间累计分配收益 39,556,774.47 元,其中人民币 28,575,167.42 元以红利再投资方式结转入实收基金,人民币 10,981,607.05 元因基金赎回而支付给投资者,其余人民币 3,773,258.23 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:2011 年 6 月 30 日

单位:人民币元

资 产	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	405,234,115.68	372,478,865.65
结算备付金	-	5,279,659.09
存出保证金	250,000.00	250,000.00
交易性金融资产	871,213,319.20	1,503,041,488.37
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	871,213,319.20	1,503,041,488.37
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	318,901,158.35	907,162,400.74
应收证券清算款	-	-
应收利息	9,444,347.95	13,789,362.52
应收股利	-	-
应收申购款	32,018,884.90	11,643,445.71
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,637,061,826.08	2,813,645,222.08
负债和所有者权益	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	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	79,999,760.00	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	31,785.04
应付管理人报酬	633,924.98	749,121.14
应付托管费	192,098.46	227,006.41
应付销售服务费	137,633.49	56,287.51
应付交易费用	42,050.68	20,659.74
应交税费	452,400.00	452,400.00
应付利息	11,198.90	-
应付利润	3,773,258.23	3,089,867.46
递延所得税负债	-	-
其他负债	443,689.10	634,794.67
负债合计	85,686,013.84	5,261,921.97
所有者权益:		
实收基金	1,551,375,812.24	2,808,383,300.11
未分配利润	-	-
所有者权益合计	1,551,375,812.24	2,808,383,300.11
负债和所有者权益总计	1,637,061,826.08	2,813,645,222.08

注:

1、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 1,551,375,812.24 份,其中,A 级份额 386,915,569.95 份,B 级份额 1,164,460,242.29 份。

6.2 利润表

会计主体:汇添富货币市场基金

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	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
一、收入	46,914,164.01	40,768,396.36
1.利息收入	44,184,583.48	36,715,071.65
其中:存款利息收入	11,676,454.50	11,517,672.93
债券利息收入	20,161,303.77	17,597,006.16
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	12,346,825.21	7,600,392.56
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	2,683,416.14	4,045,866.44
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	2,683,416.14	4,045,866.44
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)	46,164.39	7,458.27
减:二、费用	6,721,180.01	9,540,415.08
1.管理人报酬	3,934,159.37	6,653,811.44
2.托管费	1,192,169.46	2,016,306.50
3.销售服务费	639,405.81	415,278.19
4.交易费用	-	-
5.利息支出	728,193.84	197,952.07
其中:卖出回购金融资产支出	728,193.84	197,952.07
6.其他费用	227,251.53	257,066.88
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	40,192,984.00	31,227,981.28
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	40,192,984.00	31,227,981.28

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: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)	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
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)	5,916,447,694.98	-	5,916,447,694.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	31,227,981.28	31,227,981.28
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)	-2,558,436,070.18	-	-2,558,436,070.18
其中:1.基金申购款	5,416,671,827.04	-	5,416,671,827.04
2.基金赎回款	-7,975,107,897.22	-	-7,975,107,897.22
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)	-	-31,227,981.28	-31,227,981.28
五、期末所有者权益(基金净值)	3,358,011,624.80	-	3,358,011,624.80

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×(1-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 2011 年 6 月 30 日的财务状况以及 2011 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 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

本基金本报告期内无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无会计估计变更。

6.4.5.3 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
东航金戎控股有限责任公司	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 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	
	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	354,217,000.00	100.00%	2,388,021,000.00	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 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
当期发生的基金应支付的管理费	3,934,159.37	6,653,811.44
其中:支付销售机构的客户维护费	272,996.06	116,621.89

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 ×0.33%÷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 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
当期发生的基金应支付的托管费	1,192,169.46	2,016,306.50

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 ×0.10%÷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

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		
	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
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		
	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	76,529.32	161,570.68	238,100.00
上海浦东发展银行股份有限公司	35,162.54	1,898.49	37,061.03
东方证券股份有限公司	9,347.03	0.00	9,347.03
合计	121,038.89	163,469.17	284,508.06

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×R÷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 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
上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 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
-	-	-	-	-	-	-

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 B

份额单位:份

关联方名称	本期末 2011年 6 月 30 日		上年度末 2010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	6,015,467.22	0.39%	-	-

注:上海汇添富公益基金会于 2011 年 5 月 6 日运用 6,000,000.00 元申购本基金 B 类份额 6,000,000.00 份(本基金无申购费用),于 2011 年 6 月 2 日获得收益结转成的份额 15,467.22 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 2011年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间 2010年 1